

Επισκόπηση εργασιών, 3^ο τρίμηνο 2011

Εκδόσεις χρέους: τον Ιούλιο πραγματοποιήθηκαν δύο εκδόσεις Γραμματίων Δημοσίου 13 και 31 εβδομάδων, ονομαστικής αξίας 90 εκ και 50 εκ ευρώ και με αποδόσεις 3,50% και 3,90% αντίστοιχα. Βραχυπρόθεσμο χρέος εκδόθηκε επίσης μέσω των χρεογράφων ECP, για 200 εκ ευρώ με απόδοση 4,51%, και 215 εκ δολάρια ΗΠΑ με αποδόσεις μεταξύ 3,27% και 3,71%. Η έκθεση σε ξένο νόμισμα αντισταθμίστηκε με αντίστοιχες συναλλαγές ανταλλαγής (swap) νομισμάτων.

Η μεγαλύτερη έκδοση χρέους πραγματοποιήθηκε τον Ιούλιο με την έκδοση 2-ετών Κρατικών Ονομαστικών Χρεογράφων Αναπτύξεως στην εγχώρια αγορά. Από την έκδοση αντλήθηκε ποσό ονομαστικής αξίας 714,6 εκ ευρώ με μέση απόδοση 5%, και ονομαστικό επιτόκιο 4,50%. Περαιτέρω, σε μία μικρή έκδοση ΚΟΧΑ 10-ετούς διάρκειας τον Αύγουστο αντλήθηκαν 23,1 εκ ευρώ, με απόδοση 7%.

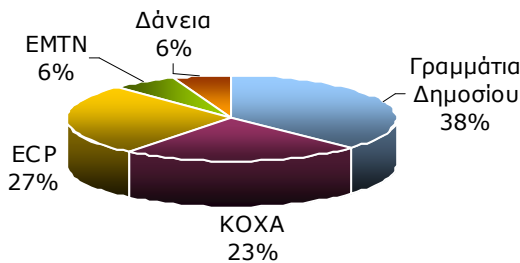
Κατά το υπό αναφορά τρίμηνο παραχωρήθηκε επίσης μακροχρόνιο δάνειο με κυμαινόμενο επιτόκιο από την Ευρωπαϊκή Τράπεζα Επενδύσεων ύψους 40 εκ ευρώ.

Επαναγορές χρέους: τον Ιούλιο πραγματοποιήθηκαν επαναγορές συνολικού ύψους 664 εκ ευρώ. Οι επαναγορές αφορούσαν το μεγαλύτερο μέρος τεσσάρων Γραμματίων Δημοσίου, με αρχικές ημερομηνίες λήξης μεταξύ Ιουλίου και Οκτωβρίου 2011.

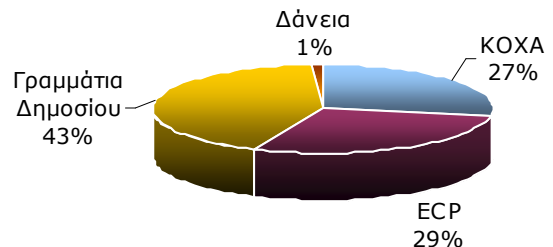
Αποπληρωμές χρέους: οι αποπληρωμές του τριμήνου ανήλθαν στα 458 εκ ευρώ. Από αυτά, 315 εκ ευρώ αντιστοιχούσαν σε αποπληρωμή χρεογράφων ECP, ενώ το υπόλοιπο ποσό αφορούσε αποπληρωμές Γραμματίων Δημοσίου και δανείων εξωτερικού.

Μεταβολή χρέους Ιαν-Σεπτ. 2011

Νέος δανεισμός 2011

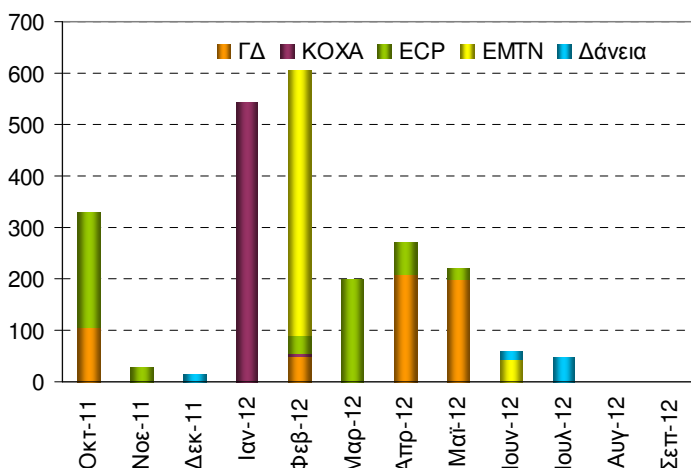


Αποπληρωμές 2011

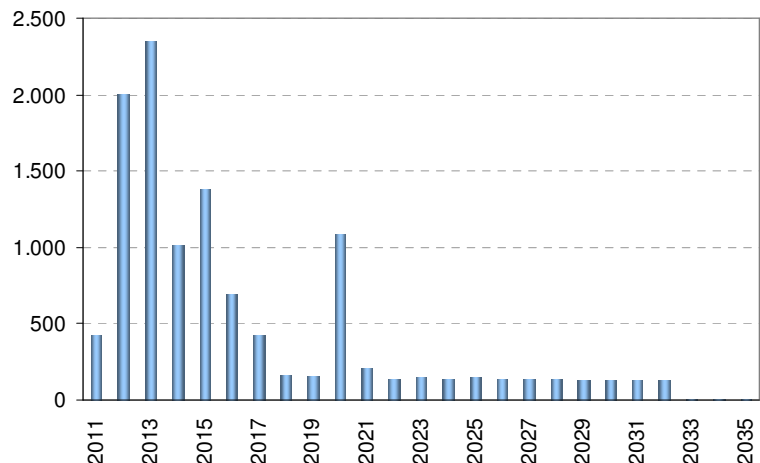


Χρονοδιάγραμμα λήξης χρέους

Χρέος ληξιπρόθεσμο εντός 12 μηνών, € εκ.



Συνολικό χρέος, € εκ.



Δομή χρέους

30-9-2011

30-6-2011

Χρέος Κεντρικής Κυβέρνησης¹

€11.490 εκ

€11.525 εκ

Χρέος εσωτερικού

47,8%

48,4%

Χρέος εξωτερικού

52,2%

51,6%

Σταθερού επιτοκίου

88,8%

89,1%

Κυμαινόμενου επιτοκίου²

11,2%

10,9%

Σε εγχώριο νόμισμα

99,8%

99,8%

Σε ξένα νομίσματα³

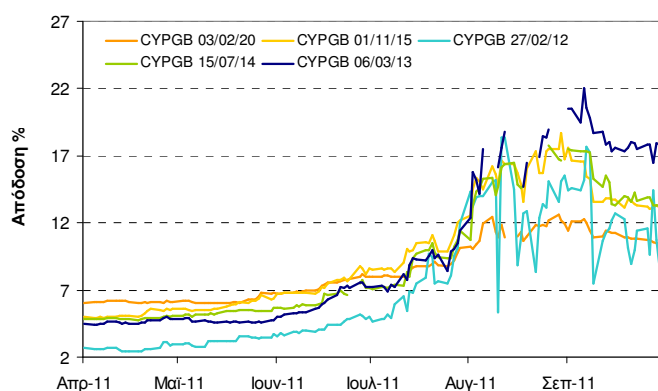
0,2%

0,2%

1. Δεν περιλαμβάνει την προσαρμογή του χρέους Κεντρικής Κυβέρνησης με την συμπερίληψη χρέους ημικρατικών οργανισμών
2. Δεν περιλαμβάνει το βραχυπρόθεσμο χρέος
3. Μετά από πράξεις swap συναλλάγματος

Κυπριακά ομόλογα αναφοράς

Πορεία απόδοσης



Διαφορά απόδοσης

