

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa - júlí 2015

GAMMA: Corporate Bond Index 128,686
GAMMAcb: Sértryggt 121,157

Gengi vísitalna síðasta viðskiptadag í júní 2015

Vigtir skuldabréfa

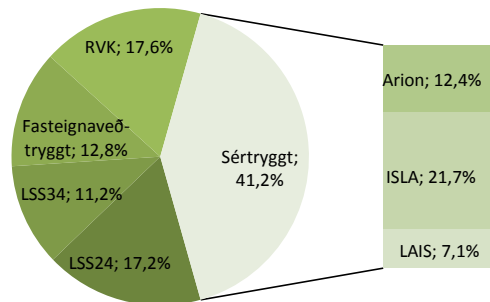
| Bréf | GAMMA: CBI | | | GAMMAcb: Sértryggt | | |
|--------------|------------|----------|----------|--------------------|----------|----------|
| | 1.jún.15 | 1.júl.15 | Breyting | 1.jún.15 | 1.júl.15 | Breyting |
| LSS150224 | 18,1% | 17,2% | -0,91% | | | |
| LSS150434 | 11,7% | 11,2% | -0,51% | | | |
| RVK 19 1 | 1,2% | 1,2% | -0,06% | | | |
| RVK 53 1 | 17,6% | 16,5% | -1,17% | | | |
| EIK 12 01 | 7,6% | 7,2% | -0,39% | | | |
| REG3A 14 1 | 5,8% | 5,5% | -0,30% | | | |
| ARION CBI 19 | 2,8% | 2,7% | -0,16% | 7,4% | 6,5% | -0,98% |
| ARION CBI 21 | 1,6% | 1,9% | 0,25% | 4,3% | 4,5% | 0,26% |
| ARION CBI 29 | 4,8% | 6,4% | 1,55% | 12,7% | 15,5% | 2,73% |
| ARION CBI 34 | 1,6% | 1,5% | -0,08% | 4,2% | 3,7% | -0,54% |
| ISLA CBI 16 | 2,8% | 2,6% | -0,19% | 7,3% | 6,3% | -1,05% |
| ISLA CBI 19 | 5,2% | 4,9% | -0,26% | 13,6% | 11,9% | -1,73% |
| ISLA CBI 20 | 2,0% | 2,5% | 0,42% | 5,4% | 6,0% | 0,58% |
| ISLA CBI 24 | 6,9% | 6,5% | -0,35% | 18,2% | 15,9% | -2,32% |
| ISLA CBI 26 | 1,5% | 2,5% | 1,03% | 3,9% | 6,0% | 2,20% |
| LBANK CBI 22 | 1,1% | 2,7% | 1,67% | 2,8% | 6,6% | 3,82% |
| ISLA CB 16 | 1,7% | 1,6% | -0,10% | 4,6% | 4,0% | -0,61% |
| ISLA CB 19 | 1,1% | 1,1% | -0,07% | 3,0% | 2,6% | -0,40% |
| LBANK CB 16 | 2,2% | 2,0% | -0,24% | 5,9% | 4,8% | -1,06% |
| LBANK CB 17 | 0,9% | 0,8% | -0,05% | 2,3% | 2,0% | -0,30% |
| LBANK CB 19 | 1,7% | 1,6% | -0,10% | 4,4% | 3,8% | -0,60% |
| | 100,00% | 100,00% | | 100,00% | 100,00% | |

Gefin voru út bréf í ARION CBI 21 [600mln nom], ARION CBI 29 [3.120mln nom], ISLA CBI 20 [920mln nom], ISLA CBI 26 [1.880mln nom] og LBANK CBI 22 [3.000mln nom] í mánuðinum sem hækkar hlutfall þeirra í vísitölunni.

Verðtryggingarhlutfall vísitölnnar hækkar um 0,5 prósentustig milli mánaða og er 92,9%. Sértryggt bréf hækka um 3,3 prósentustig og eru 41,2% af heildarvísitölunni.

Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni, með nýjum útgáfum, hækkaði um 10ma. í júní og er nú 173ma.

Líftími vísitölnnar hækkar um 0,1 og er 8,1 ár.


Ávöxtun vísitölnnar

Heildarvísitalan, GAMMA: CBI, hækkaði um 0,8% í júní. Sértryggt vísitalan GAMMAcb hækkaði um 0,5%.

Meðaldagsvelta CBI var um 97 milljónir króna í júní, þar af 24 milljónir með sértryggt.

| | GAMMA: CBI | GAMMAcb |
|-----|------------|---------|
| 1m | 0,79% | 0,51% |
| 3m | 1,55% | 1,25% |
| 6m | 4,84% | 3,85% |
| 1Y | 7,75% | 6,71% |
| ytd | 4,84% | 3,85% |

Um vísitölu fyrirtækjaskuldabréfa

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa er reiknuð og birt af GAM Management hf., óháðu og sérhæfðu ráðgjafar- og sjóðastýringarfyrirtæki með starfsleyfi frá FME sem tekur til reksturs verðbréfasjóða og fjárfestingarráðgjafar. Vísitalan sýnir heildarávöxtun útgefinna skuldabréfa sem hafa ekki beina ríkisábyrgð, hlutfallsvigt að miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni. Notast er við lokagengi skuldabréfa á hverjum viðskiptadegi eins og það er birt í NASDAQ OMX Nordic Exchange. Heildarávöxtun þýðir að vaxtagreiðslur og afborganir eru í raun endurfjárfestar aftur í vísitölunni. Sjá nánar á www.gamma.is/visitolar.

Fyrirvari: Umfjöllun þessi felur ekki í sér fjárfestingarráðgjöf eða tilboð eða hvatningu um að eiga viðskipti með verðbréf. Mat, álit og forspár endurspeglar eingöngu skoðanir þeirra starfsmanna GAM Management hf. sem vinna umfjöllunina og eru þær settar fram eftir bestu samvisku miðað við útgáfudag og kunn að breytast án fyrirvara. Þó svo upplýsingar þær sem birtast í þessari umfjöllun komi frá heimildum sem við teljum vera áreiðanlegar og þó svo við höfum lagt okkur fram um að tryggja áreiðanleika upplýsinganna á útgáfudegi þá ábyrgjumst við ekki beint eða óbeint notagildi þeirra varðandi forspá um framtíðarávöxtun eða mat á núverandi verðgildi eða framtíðarverðgildi verðbréfa. Umfjöllunin ætti hvorki að skoðast sem fullnægjandi lýsing á þeim verðbréfum né á þeim mörkuðum sem hér er vitnað til. Skoðanir, sem látnar eru í ljós, kunna að vera ólíkar skoðunum á sama efni sem látnar eru í ljós af öðrum starfsmönnum GAM Management hf. og stafar það af því að beitt er mismunandi forsendum eða aðferðafræði. Almennit fylgir áhætta fjárfestingu í verðbréfum og verðbréfasjóðum og athygli er vakin á því að söguleg ávöxtun gefur ekki vísbendingu um framtíðarávöxtun.