

40. heti jelentés a magyar állampapírcsoporról

2013. szept. 30 - okt. 06.

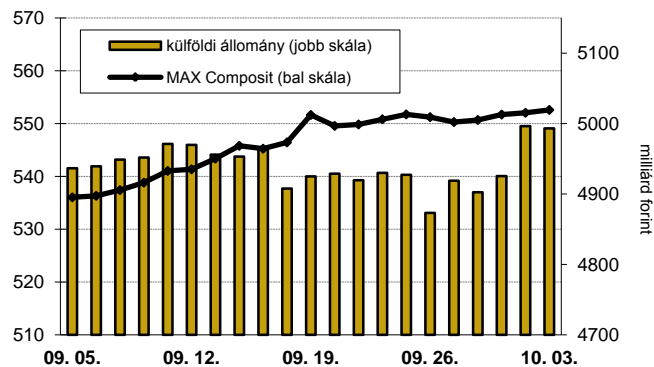
40. heti események

- A 40. héten a nettó állampapírcsopori kibocsátás 75,1 milliárd forint volt. 2013-ben összesen nettó 1124,2 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.
- A 3 hónapos DKJ aukcióján a fedezettség 2,91-et ért el, az átlagos hozam 9 bázisponttal 3,51%-ra csökkent. A 3 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 2,59-et ért el, az átlagos hozam 7 bázisponttal 4,48%-ra csökkent. Az 5 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 3,77-et ért el, az átlagos hozam 6 bázisponttal 4,99%-ra csökkent. A 10 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 2,11-et ért el, az átlagos hozam 88 bázisponttal 5,75%-ra csökkent. Az ÁKK a héten visszavásárlási aukciót tartott a 2014/C, 2014/D sorozatjelű állampapírokból. Az elfogadott mennyiség rendre 1,60 és 1,10 milliárd forint volt.
- A referenciahozam a 12 hónapos lejáraton 13 bázisponttal, a 3 hónapos lejáraton 10 bázisponttal, a 6 hónapos és a 3 éves lejáraton 7-8 bázisponttal, a 10 éves, a 15 éves és az 5 éves lejáraton 3-4 bázisponttal csökkent.
- A MAX Composite állampapírindex 1,4 ponttal 552,6 pontra nőtt, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírállomány 120,0 milliárd forinttal 4993,2 milliárd forintra gyarapodott a héten.

Következő heti események

- A 41. héten a nettó állampapír-csopori kibocsátás 45,91 milliárd forint körül várható.
- A héten a 3 hónapos és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy aukciójára kerül sor. A meghirdetett mennyiség a 3 hónapos DKJ-ből 40 milliárd forint.
- Az ÁKK csereaukción keretében 7-7 milliárd forint névértékig 2015A és 2015C államkötvényt 2020A sorozatú államkötvényre cserél.

MAX-index és a külföldiek részvétele a magyar állampapírcsoporon



Állampapír-csopori kibocsátás (mrd Ft)

2013	BRUTTÓ KIBOCSÁTÁS			LEJÁRAT			VISSZAVÁSÁRLÁS			NETTÓ KIBOCSÁTÁS			Évi KUM. NETTÓ KIBOCS.	
	hét sorszáma:	39	40	41	39	40	41	39	40	41	39	40	41	39
Diszkontkincstárjegy	39,61	107,75	39,65	49,48	49,52	54,50	0,00	0,00	0,00	-9,86	58,22	-14,86	139,78	198,00
Államkötvény	29,86	5,00	63,47	0,00	0,84	0,00	9,81	0,00	2,70	20,05	4,17	60,77	459,22	463,38
Kamatkozó kincstárjegy	22,94	22,66	6,32	4,67	9,99	6,32	0,00	0,00	0,00	18,27	12,67	0,00	450,17	462,83
Féléves kincstárjegy	1,07	0,74	0,25	0,48	0,38	0,25	0,00	0,00	0,00	0,59	0,36	0,00	8,46	8,82
ÖSSZESEN	92,42	135,40	109,43	54,15	60,35	60,82	9,81	0,00	2,70	28,45	75,06	45,91	1049,16	1124,22

Állampapír-csopori hozamok (%)

2013.10.03	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEGYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	3,55	3,35	3,51	3,45
6 hónap	3,63	3,44	3,50	3,54
12 hónap	3,60	3,40	3,55	3,50
3 év	4,53	4,40	4,57	4,46
5 év	5,08	4,92	5,06	5,00
10 év	5,83	5,68	5,80	5,74
15 év	6,41	6,25	6,37	6,33

*az OTC-átlag értéknapi adat

Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2013. 09. 27 - 2013. 10. 03.	DKJ		Államkötvény		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2013.09.27	0,49	27,0	0,00	260,5	0,49	287,6
2013.09.30	0,00	21,0	0,00	185,8	0,00	206,8
2013.10.01	0,00	13,6	0,00	97,8	0,00	111,5
2013.10.02	0,99	63,8	0,00	247,8	0,99	311,6
2013.10.03	0,00	20,2	0,00	254,1	0,00	274,3
ÖSSZESEN	1,47	145,7	0,00	1 046,1	1,47	1 191,8

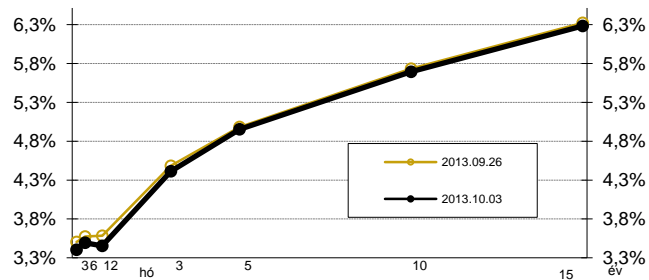
*az OTC-forgalom értéknapi adat

A legutóbbi állampapír-csopori aukciók fontosabb adatai (mrd Ft)

2013.10.04	AUKCIÓ DÁTUMA	MAX. HOZAM (%)	ÁTLAGHOZAM (%)	VÁLTOZÁS ELŐZŐ AUKCIÓHOZ KÉPEST (bp)	MEGHIR. MENNY.	BENYÚJTOTT AJÁNLATOK	ELFOG. AJÁNL.	FEDEZETTSÉG	NEM KOMP. ÉRTÉK.	ÖSSZES PIACI KIBOCS.
likviditási DKJ	2013.02.04	5,52	5,50	-16	50	55,7	40,0	1,11	0,0	40,0
3 hónapos DKJ	2013.10.01	3,53	3,51	-9	40	116,6	40,0	2,91	0,0	40,0
12 hónapos DKJ	2013.09.26	3,63	3,61	-23	50	131,5	60,0	2,63	0,0	60,0
3 éves államkötvény	2013.10.03	4,51	4,48	-7	16	41,5	20,0	2,59	6,7	26,7
5 éves államkötvény	2013.10.03	5,01	4,99	-6	12	45,2	18,0	3,77	6,6	24,6
10 éves államkötvény	2013.10.03	5,77	5,75	-88	9	19,0	9,0	2,11	3,2	12,2
15 éves államkötvény	2013.09.19	6,28	6,21	55	9	2,4	2,4	0,26	0,0	2,4

A jelentéssel kapcsolatos észrevétel esetén, kérem írjon a regulya@akk.hu emailcímrre, vagy keresse Reguly Ágostont a +36-1-488-9446-es telefonszámon.

Referenciahozam-görbe



Zérókuponhozam-görbe

