

42. heti jelentés a magyar állampapírcsőr

2015. okt. 12 - okt. 18.

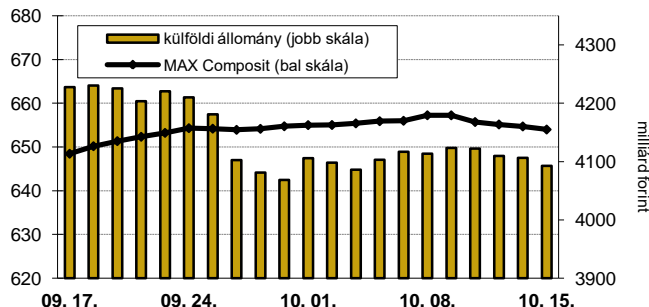
42. heti események

- A 42. héten a nettó állampapírcsőr kibocsátás 53,6 milliárd forint volt. 2015-ben összesen nettó 1233,1 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.
- A 3 hónapos DKJ aukcióján a fedezettség 1,31-ot ért el, az átlagos hozam 11 bázisponttal 0,54%-ra nőtt. A 3 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 2,07-ot ért el, az átlagos hozam 20 bázisponttal 1,72%-ra nőtt. Az 5 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 3,33-ot ért el, az átlagos hozam 5 bázisponttal 2,35%-ra nőtt. A 10 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 1,49-ot ért el, az átlagos hozam 2 bázisponttal 3,27%-ra csökkent. Az ÁKK a héten visszavásárlási aukciót tartott a 2016/C, 2016/D sorozatjelű állampapírcsőr. Az elfogadott mennyiség rendre 12,8 és 10,4 milliárd forint volt.
- A referenciahozam a 3 hónapos, a 12 hónapos, a 6 hónapos, a 10 éves és a 15 éves lejáraton 2-11 bázisponttal, a 3 éves és az 5 éves lejáraton 20 bázisponttal nőtt.
- A MAX Composite állampapírindex 3,3 ponttal 654,0 pontra csökkent, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírállomány 21,0 milliárd forinttal 4092,6 milliárd forintra mérséklődött a héten.

Következő heti események

- A 43. héten a nettó állampapír-csőr kibocsátás 21,30 milliárd forint körül várható.
- A héten a 3 hónapos és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy, valamint 3 vagy 5 éves változó kamatozású államkötvény aukciójára kerül sor. A meghirdetett mennyiség a 3 hónapos DKJ-ből 20 milliárd forint.
- Az ÁKK csereaukciójában 20-20 milliárd forint névértékű 2017/A és 2017/B államkötvényt 2024/B sorozatú államkötvényre cserél.

MAX-index és a külföldiek részvétele a magyar állampapírcsőr



Állampapír-csőr kibocsátás (mrd Ft)

2015	BRUTTÓ KIBOCSÁTÁS			LEJÁRAT			VISSZAVÁSÁRLÁS			NETTÓ KIBOCSÁTÁS			Évi KUM. NETTÓ KIBOCS.	
	hét sorszáma:	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41
Diszkontkincstárjegy	19,98	37,88	16,98	29,93	29,94	37,39	0,00	0,00	0,00	-9,95	7,94	-20,41	-218,46	-210,52
Államkötvény	100,66	46,57	64,83	0,00	0,00	0,00	4,27	20,82	23,12	96,39	25,75	41,72	925,70	951,45
Kamatkozó kincstárjegy	36,88	38,49	20,00	19,94	19,21	20,00	0,00	0,00	0,00	16,94	19,28	0,00	465,43	484,70
Féléves kincstárjegy	1,82	1,89	1,13	1,32	1,24	1,13	0,00	0,00	0,00	0,50	0,65	0,00	6,78	7,43
ÖSSZESEN	159,34	124,83	102,94	51,19	50,39	58,52	4,27	20,82	23,12	103,88	53,62	21,30	1179,45	1233,07

Állampapír-csőr hozamok (%)

2015.10.15	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEGYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	0,63	0,43	0,60	0,53
6 hónap	0,67	0,48	0,54	0,57
12 hónap	0,64	0,48	0,50	0,56
3 év	1,79	1,65	1,65	1,73
5 év	2,49	2,33	2,14	2,41
10 év	3,35	3,21	3,23	3,28
15 év	3,88	3,71	3,50	3,80

*az OTC-átlag értéknapi adat

Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2015. 10. 09 - 2015. 10. 15.	DKJ		Államkötvény		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2015.10.09	0,00	20,3	0,00	329,8	0,00	350,2
2015.10.12	0,00	16,9	0,36	175,7	0,36	192,6
2015.10.13	0,30	18,2	0,05	210,0	0,35	228,2
2015.10.14	0,00	46,0	0,00	150,0	0,00	196,0
2015.10.15	0,00	19,4	0,00	116,5	0,00	135,9
ÖSSZESEN	0,30	120,8	0,41	982,1	0,71	1 102,9

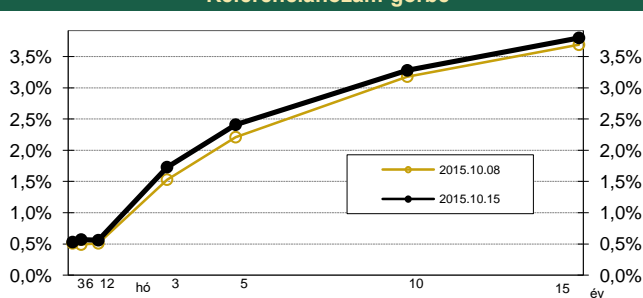
*az OTC-forgalom értéknapi adat

A legutóbbi állampapír-csőr aukciójának fontosabb adatai (mrd Ft)

Fix kamatozású államkötvények	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	2015.01.12	1,90	1,86	-8	60	238,4	90,0	3,97	0,0	90,0
3 hónapos DKJ	2015.10.13	0,58	0,54	11	20	26,1	17,0	1,31	0,0	17,0
12 hónapos DKJ	2015.10.08	0,55	0,51	4	20	27,0	20,0	1,35	0,0	20,0
3 éves államkötvény	2015.10.15	1,73	1,72	20	20	41,3	24,0	2,07	6,7	30,7
5 éves államkötvény	2015.10.15	2,35	2,35	5	15	49,9	20,0	3,33	0,5	20,5
10 éves államkötvény	2015.10.15	3,29	3,27	-2	12	17,9	12,0	1,49	1,6	13,6
15 éves államkötvény	2015.09.03	4,03	4,01	-17	10	19,5	10,0	1,95	3,3	13,3
Változó kamatozású államkötvények	AUKCIÓ DÁTUMA	MIN. ÁR (%)	ÁTLAGÁR (%)	ÁR-VÁLTOZÁS AZ ELŐZŐ AUKCIÓHOZ KÉPEST (%)	MEGHIR. MENNY.	BENYÚJTOTT AJÁNLATOK	ELFOG. AJÁNL.	FEDEZETTSÉG	NEM KOMP. ÉRTÉK.	ÖSSZES PIACI KIBOCS.
3 éves változó kötvény	2015.10.08	100,55	100,59	0,9	12	33,2	18,0	2,76	3,6	21,6
5 éves változó kötvény	2015.09.24	98,84	98,87	0,7	10	47,8	15,0	4,78	5,2	20,2

A jelentéssel kapcsolatos észrevétel esetén, kérem írjon a reguly.agoston@akk.hu emailcímre, vagy keresse Reguly Ágostont a +36-1-488-9446-os telefonszámon.

Referenciahozam-görbe



Zérókuponhozam-görbe

