

43. heti jelentés a magyar állampapírpiacon

2017. okt. 23 - okt. 29.

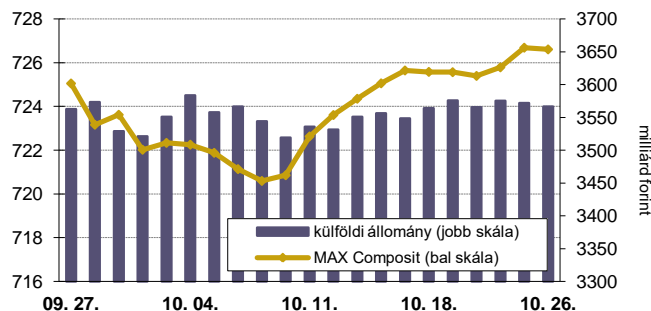
43. heti események

- A 43. héten a nettó állampapírpiacon kibocsátás -45,9 milliárd forint volt. 2017-ban összesen nettó 636,0 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.
- A 3 hónapos DKJ aukción a fedezettség 1,18-ot ért el, az átlagos hozam 4 bázisponttal -0,01%-ra nőtt. A 3 éves államkötvény aukción a fedezettség 1,86-ot ért el, az átlagos hozam 3 bázisponttal 0,49%-ra csökkent. Az 5 éves államkötvény aukción a fedezettség 2,00-ot ért el, az átlagos hozam 3 bázisponttal 1,19%-ra csökkent. A 10 éves államkötvény aukción a fedezettség 3,30-ot ért el, az átlagos hozam 10 bázisponttal 2,46%-ra csökkent.
- A referenciahozam a 10 éves lejáraton 6 bázisponttal, a 15 éves lejáraton 4 bázisponttal csökkent, a 3 hónapos, a 6 hónapos és a 12 hónapos lejáraton nem változott, az 5 éves és a 3 éves lejáraton 1-2 bázisponttal nőtt.
- A MAX Composite állampapírindex 1,0 ponttal 726,6 pontra nőtt, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírállomány 8,8 milliárd forinttal 3566,6 milliárd forintra mérséklődött a héten.

Következő heti események

- A 44. héten a nettó állampapír-piaci kibocsátás 114,97 milliárd forint körül várható.
- A héten a likviditási diszkontkincstárjegy, a 3 hónapos és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy, valamint a változó kamatozású államkötvény aukción kerül sor. A meghirdetett mennyiség a likviditási DKJ-ből 30, a 3 hónapos DKJ-ből 40, a 12 hónapos DKJ-ből 40, a változó kamatozású kötvényből pedig 7 milliárd forint.

MAX-index és a külföldiek részvétele a magyar állampapírpiacon



Állampapír-piaci kibocsátás (mrd Ft)

2017	BRUTTÓ KIBOCSÁTÁS			LEJÁRAT			VISSZAVÁSÁRLÁS			NETTÓ KIBOCSÁTÁS			Évi KUM. NETTÓ KIBOCS.	
	hét sorszáma:	42	43	44	42	43	44	42	43	44	42	43	44	42
Diszkontkincstárjegy	15,00	47,01	55,00	15,00	94,86	17,09	0,00	0,00	0,00	0,00	-47,85	37,91	-145,72	-193,58
Államkötvény	63,49	8,08	77,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	63,49	8,08	77,06	449,90	457,98
Kamatkozó kincstárjegy	55,33	55,79	45,05	59,62	58,36	45,05	0,00	0,00	0,00	-4,29	-2,57	0,00	486,40	483,83
Féléves kincstárjegy	12,06	11,38	24,59	10,44	14,89	24,59	0,00	0,00	0,00	1,62	-3,51	0,00	-108,70	-112,21
ÖSSZESEN	145,88	122,26	201,70	85,06	168,11	86,74	0,00	0,00	0,00	60,82	-45,85	114,97	681,89	636,03

Állampapír-piaci hozamok (%)

2017.10.26	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEJYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	0,03	-0,11	-0,02	-0,04
6 hónap	0,04	-0,07	0,00	-0,02
12 hónap	0,04	-0,08	0,04	-0,02
3 év	0,54	0,47	0,19	0,49
5 év	1,23	1,13	1,03	1,18
10 év	2,49	2,40	2,35	2,45
15 év	3,26	3,14	3,25	3,20

*az OTC-átlag értéknapi adat

Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2017. 10. 20 - 2017. 10. 26.	DKJ		Államkötvény		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2017.10.20	0,00	18,3	0,00	194,4	0,00	212,7
2017.10.23	0,00	0,0	0,00	0,0	0,00	0,0
2017.10.24	0,00	14,3	0,72	519,4	0,72	533,7
2017.10.25	0,00	74,0	0,38	228,7	0,38	302,7
2017.10.26	0,00	44,3	1,24	143,6	1,24	187,9
ÖSSZESEN	0,00	151,0	2,34	1 086,2	2,34	1 237,1

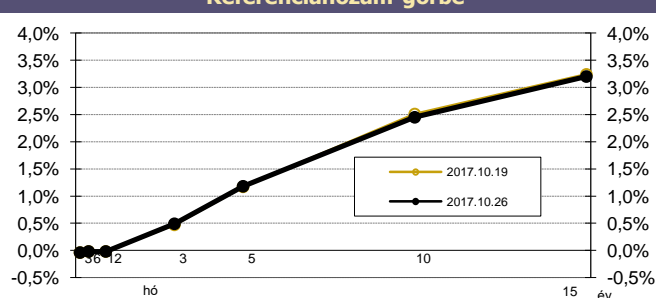
*az OTC-forgalom értéknapi adat

A legutóbbi állampapíraukciók 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.
3 hónapos DKJ	2017.10.24	0,00	-0,01	4	25	29,4	25,0	1,18	0,0	25,0
12 hónapos DKJ	2017.10.19	-0,01	-0,02	-2	20	65,9	27,0	3,29	0,0	27,0
3 éves államkötvény	2017.10.26	0,50	0,49	-3	20	37,2	25,0	1,86	2,6	27,6
5 éves államkötvény	2017.10.26	1,20	1,19	-3	20	40,0	25,0	2,00	4,5	29,5
10 éves államkötvény	2017.10.26	2,47	2,46	-10	10	33,0	15,0	3,30	5,0	20,0
15 éves államkötvény	2017.10.12	3,29	3,28	-38	10	18,1	10,0	1,81	2,2	12,2
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.
Változó kötvény	2017.10.19	99,24	99,28	0,1	7	22,9	7,0	3,26	1,1	8,1

A jelentéssel kapcsolatos észrevétel esetén, kérem írjon a kadar.andras@akk.hu emailcímre, vagy keresse Kádár András a +36-1-488-9404-os telefonszámon.

Referenciahozam-görbe



Zérókuponthozam-görbe

