

45. heti jelentés a magyar állampapírpiacon

2017. nov. 06 - nov. 12.

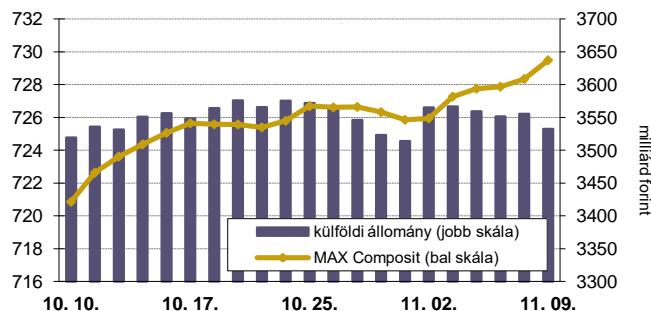
45. heti események

- A 45. héten a nettó állampapírpiacon kibocsátás 108,2 milliárd forint volt. 2017-ban összesen nettó 855,0 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.
- A likviditási DKJ aukcióján a fedezettség 2,72-ot ért el, az átlagos hozam 1 bázisponttal 0,01%-ra nőtt. A 3 hónapos DKJ aukcióján a fedezettség 1,61-ot ért el, az átlagos hozam az előző aukcióhoz képest nem változott. A 3 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 2,15-öt ért el, az átlagos hozam 4 bázisponttal 0,53%-ra nőtt. Az 5 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 3,58-ot ért el, az átlagos hozam 9 bázisponttal 1,10%-ra csökkent. A 10 éves államkötvény aukcióján a fedezettség 3,39-öt ért el, az átlagos hozam 23 bázisponttal 2,23%-ra csökkent.
- A referenziahozam a 10 éves és a 15 éves lejáraton 19-20 bázisponttal, az 5 éves lejáraton 6 bázisponttal csökkent, a 3 hónapos és a 12 hónapos lejáraton nem változott, a 6 hónapos és a 3 éves lejáraton 2 bázisponttal nőtt.
- A MAX Composite állampapírindex 3,5 ponttal 729,5 pontra nőtt, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírállomány 32,7 milliárd forinttal 3532,2 milliárd forintra mérséklődött a héten.

Következő heti események

- A 46. héten a nettó állampapír-piaci kibocsátás 144,69 milliárd forint körül várható.
- A héten a likviditási diszkontkincstárjegy, a 3 hónapos és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy, valamint a változó kamatozású államkötvény aukciójára kerül sor. A meghirdetett mennyiség a likviditási DKJ-ből 40, a 3 hónapos DKJ-ből 40 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:	44	45	46	44	45	46	44	45	46	44	45	46	44
Diszkontkincstárjegy	60,00	114,99	80,00	15,02	15,00	17,93	0,00	0,00	0,00	44,98	99,99	62,07	-148,59	-48,60
Allamkötvény	77,06	8,10	82,62	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	77,06	8,10	82,62	535,04	543,14
Kamatkozó kincstárjegy	50,29	39,09	54,50	45,29	33,73	54,50	0,00	0,00	0,00	4,99	5,35	0,00	488,76	494,11
Féléves kincstárjegy	8,47	6,34	11,93	24,66	11,58	11,93	0,00	0,00	0,00	-16,19	-5,24	0,00	-128,42	-133,66
ÖSSZESEN	195,81	168,52	229,05	84,97	60,32	84,36	0,00	0,00	0,00	110,85	108,20	144,69	746,79	854,99

Állampapír-piaci hozamok (%)

2017.11.09	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEJYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	0,03	-0,11	0,00	-0,04
6 hónap	0,06	-0,04	0,00	0,01
12 hónap	0,06	-0,04	0,06	0,01
3 év	0,58	0,49	0,48	0,53
5 év	1,20	1,10	0,99	1,15
10 év	2,33	2,20	2,40	2,26
15 év	3,09	2,96	3,14	3,03

*az OTC-átlag értéknapi adat

Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2017. 11. 03 - 2017. 11. 09.	DKJ		Államkötvény		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2017.11.03	0,00	93,1	0,00	157,3	0,00	250,4
2017.11.06	0,00	72,8	0,76	356,2	0,76	429,1
2017.11.07	0,00	44,2	0,21	378,5	0,21	422,6
2017.11.08	0,00	117,4	0,32	164,8	0,32	282,3
2017.11.09	0,00	33,4	0,00	382,9	0,00	416,3
ÖSSZESEN	0,00	361,0	1,28	1 439,7	1,28	1 800,7

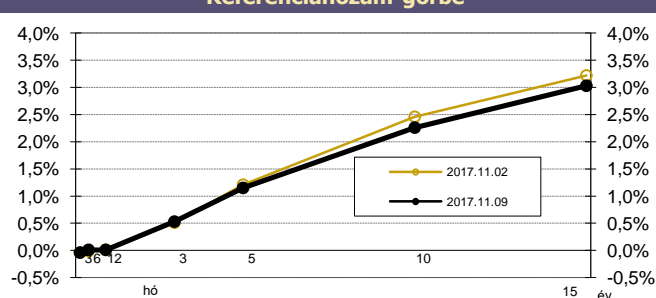
*az OTC-forgalom értéknapi adat

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.
likviditási DKJ	2017.11.06	0,02	0,01	1	40	108,6	50,0	2,72	0,0	50,0
3 hónapos DKJ	2017.11.07	0,02	0,01	0	40	64,5	40,0	1,61	0,0	40,0
12 hónapos DKJ	2017.11.02	0,05	0,03	5	40	29,8	25,0	0,75	0,0	25,0
3 éves államkötvény	2017.11.09	0,54	0,53	4	20	42,9	27,5	2,15	0,4	27,9
5 éves államkötvény	2017.11.09	1,11	1,10	-9	20	71,6	24,0	3,58	0,1	24,1
10 éves államkötvény	2017.11.09	2,24	2,23	-23	20	67,8	30,0	3,39	0,6	30,6
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	2017.11.02	99,17	99,23	-0,1	7	14,2	7,0	2,03	1,1	8,1

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

Referenziahozam-görbe



Zérókuponhozam-görbe

