

42. heti jelentés a magyar állampapírcsoporthoz

2012. okt. 15 - okt. 21.

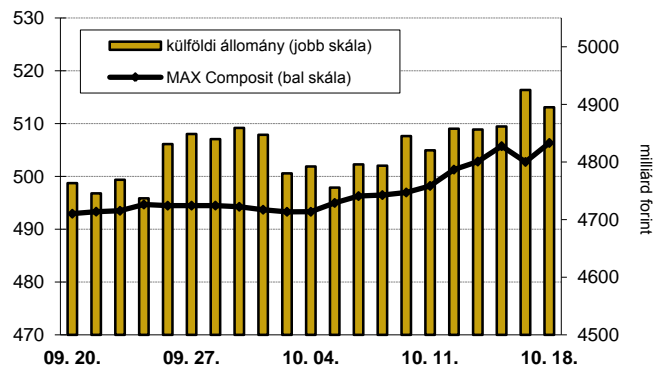
42. heti események

- A 42. héten a nettó állampapírcsoporthoz kibocsátás 46,7 milliárd forint volt. 2012-ben összesen nettó 1442,4 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.
- A heti első likviditási DKJ aukción a fedezettség 1,19-ot ért el, az átlagos hozam 5 bázisponttal 6,36%-ra csökkent. A második likviditási DKJ aukción a fedezettség 2,39-ot ért el, az átlagos hozam 3 bázisponttal 6,33%-ra csökkent. A 3 hónapos DKJ aukción a fedezettség 2,95-ot ért el, az átlagos hozam 28 bázisponttal 6,12%-ra csökkent. A 3 éves államkötvény aukción a fedezettség 2,01-ot ért el, az átlagos hozam 82 bázisponttal 5,90%-ra csökkent. Az 5 éves államkötvény aukción a fedezettség 1,50-ot ért el, az átlagos hozam 82 bázisponttal 6,03%-ra csökkent. A 10 éves államkötvény aukción a fedezettség 3,16-ot ért el, az átlagos hozam 106 bázisponttal 6,33%-ra csökkent.
- A referenciahozam a 15 éves és a 10 éves lejáraton 56-61 bázisponttal, a 3 éves és az 5 éves lejáraton 42-43 bázisponttal, a 12 hónapos, a 3 hónapos és a 6 hónapos lejáraton 20-26 bázisponttal csökkent.
- A MAX Composite állampapírindex 8,1 ponttal 506,3 pontra nőtt, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírcsoporthoz 74,7 milliárd forinttal 4895,0 milliárd forintra gyarapodott a héten.

Következő heti események

- A 43. héten a nettó állampapírcsoporthoz kibocsátás -220,74 milliárd forint körül várható.
- A héten a 3 hónapos diszkontkincstárjegy és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy aukción kerül sor. A meghirdetett mennyiség a 3 hónapos DKJ-ből 45 milliárd forint.

MAX-index és a külföldiek részvétele a magyar állampapírcsoporthoz



Állampapírcsoporthoz kibocsátás (mrd Ft)

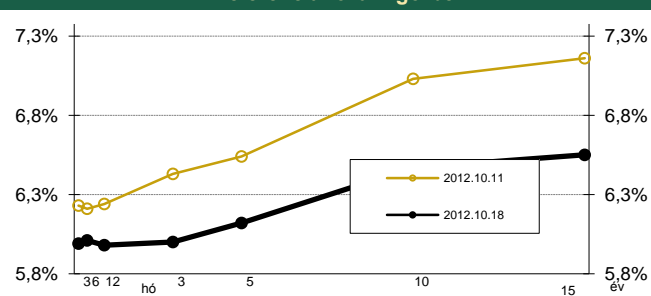
2012	BRUTTÓ KIBOCSÁTÁS			LEJÁRAT			VISSZAVÁSÁRLÁS			NETTÓ KIBOCSÁTÁS			Évi KUM. NETTÓ KIBOCS.	
	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41	42
<i>hét sorszáma:</i>	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41	42	43	41	42
Diszkontkincstárjegy	118,30	164,94	118,51	44,14	126,10	58,90	0,00	0,00	0,00	74,16	38,83	59,61	303,00	341,84
Államkötvény	55,54	7,00	55,80	0,00	0,00	336,14	0,00	6,91	0,00	55,54	0,09	-280,34	839,37	839,46
Kamatkozó kincstárjegy	6,30	9,29	0,95	1,09	1,55	0,95	0,00	0,00	0,00	5,21	7,74	0,00	253,34	261,08
Féléves kincstárjegy	0,16	0,15	0,95	0,00	0,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,16	0,14	0,95	8,69	8,83
ÖSSZESEN	180,14	181,23	175,26	45,23	127,65	395,99	0,00	6,91	0,00	134,91	46,67	-220,74	1395,71	1442,38

Állampapírcsoporthoz hozamok (%)

2012.10.18	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEGYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	6,14	5,90	6,36	6,03
6 hónap	6,15	5,95	6,15	6,05
12 hónap	6,13	5,90	6,23	6,02
3 év	6,06	6,00	6,22	6,04
5 év	6,25	6,07	6,36	6,16
10 év	6,55	6,45	6,61	6,51
15 év	6,65	6,50	6,60	6,59

*az OTC-átlag értéknapi adat

Referenciahozam-görbe

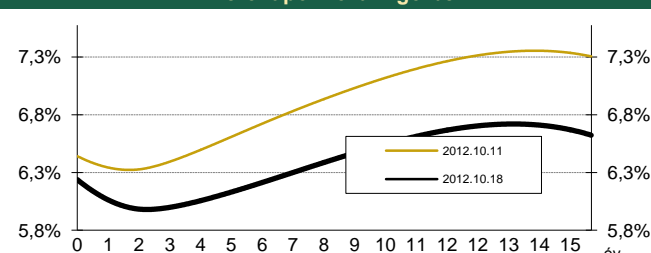


Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2012. 10. 12 - 2012. 10. 18.	DKJ		Államkötvény		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2012.10.12	0,00	71,8	85,97	262,5	85,97	334,3
2012.10.15	0,00	138,5	22,22	370,1	22,22	508,6
2012.10.16	0,00	53,3	52,09	284,3	52,09	337,6
2012.10.17	8,73	269,2	150,70	289,3	159,43	558,6
2012.10.18	4,74	66,8	122,37	234,9	127,12	301,7
ÖSSZESEN	13,48	599,6	433,34	1 441,1	446,82	2 040,7

*az OTC-forgalom értéknapi adat

Zérókuponhozam-görbe



A legutóbbi állampapírcsoporthoz aukción fontosabb adatai (mrd Ft)

2012.10.19	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	2012.10.19	6,37	6,33	-3	50	119,4	60,0	2,39	0,0	60,0
3 hónapos DKJ	2012.10.16	6,15	6,12	-28	45	132,6	60,0	2,95	0,0	60,0
12 hónapos DKJ	2012.10.11	6,32	6,30	-23	45	190,4	65,0	4,23	0,0	65,0
3 éves államkötvény	2012.10.18	5,91	5,90	-82	20	40,1	20,0	2,01	1,4	21,4
5 éves államkötvény	2012.10.18	6,07	6,03	-82	15	22,5	13,0	1,50	0,0	13,0
10 éves államkötvény	2012.10.18	6,34	6,33	-106	12	37,9	16,0	3,16	5,4	21,4
15 éves államkötvény	2012.08.23	7,36	7,34	-58	9	6,2	4,5	0,68	0,0	4,5

A jelentéssel kapcsolatos észrevétel esetén, kérem írjon a hejjaspi@akk.hu emailcímrre, vagy keresse Héjjas Péter Istvánt a +36-1-488-9446-os telefonszámon.