

44. heti jelentés a magyar állampapírcsoporthoz

2014. okt. 27 - nov. 02.

44. heti események

A 44. héten a nettó állampapírcsoporthoz kibocsátás 28,4 milliárd forint volt. 2014-ben összesen nettó 1277,2 milliárd forint összegű állampapír került értékesítésre.

A likviditási DKJ aukcióján a fedezettség 1,21-ot ért el, az átlagos hozam 106 bázisponttal 1,82%-ra csökkent. A 3 hónapos DKJ aukcióján a fedezettség 1,31-ot ért el, az átlagos hozam 40 bázisponttal 1,74%-ra nőtt. A 3 éves állampapír aukcióján a fedezettség 1,92-ot ért el, az átlagos hozam 8 bázisponttal 2,88%-ra csökkent. Az 5 éves állampapír aukcióján a fedezettség 3,30-ot ért el, az átlagos hozam 25 bázisponttal 3,36%-ra csökkent. A 15 éves állampapír aukcióján a fedezettség 2,87-ot ért el, az átlagos hozam 67 bázisponttal 4,26%-ra csökkent. Az ÁKK a héten visszavásárlási aukciót tartott a 2015/A, 2015/C, 2016/C sorozatjelű állampapírokból. Az elfogadott mennyiség rendre 30,63; 5,97; 35,43 milliárd forint volt.

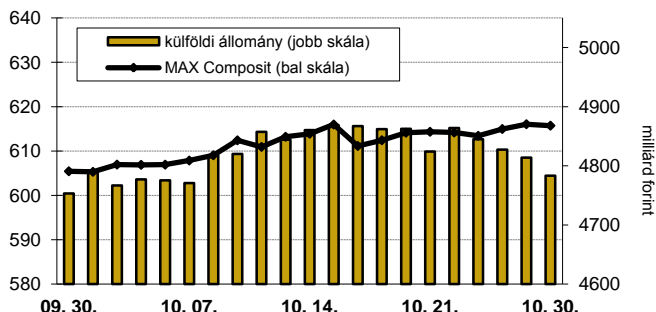
A referenciahozam az 5 éves, a 10 éves és a 15 éves lejáraton 3-10 bázisponttal csökkent, a 3 éves lejáraton 3 bázisponttal, a 12 hónapos, a 6 hónapos és a 3 hónapos lejáraton 11-21 bázisponttal nőtt.

A MAX Composite állampapírindex 1,4 ponttal 615,7 pontra nőtt, a külföldi tulajdonban lévő forint-állampapírállomány 40,8 milliárd forinttal 4783,2 milliárd forintra mérséklődött a héten.

Következő heti események

- A 45. héten a nettó állampapírcsoporthoz kibocsátás -18,33 milliárd forint körül várható.
- A héten a 3 hónapos és a 12 hónapos diszkontkincstárjegy, valamint a változó kamatozású állampapír aukciójára kerül sor. A meghirdetett mennyiség a 3 hónapos DKJ-ből 30 milliárd forint.

MAX-index és a külföldiek részvétele a magyar állampapírcsoporthoz



Állampapírcsoporthoz kibocsátás (mrd Ft)

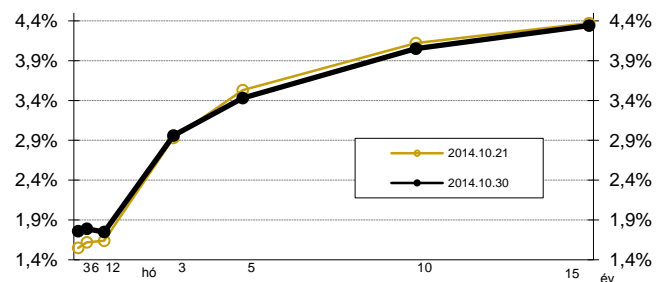
2014	BRUTTÓ KIBOCSÁTÁS			LEJÁRAT			VISSZAVÁSÁRLÁS			NETTÓ KIBOCSÁTÁS			Évi KUM. NETTÓ KIBOCS.	
	hét sorszáma:	43	44	45	43	44	45	43	44	45	43	44	45	43
Diszkontkincstárjegy	39,87	64,81	29,87	49,76	39,82	55,57	0,00	0,00	0,00	-9,89	24,99	-25,70	16,04	41,02
Állampapír	75,00	7,50	79,40	0,00	0,00	0,00	25,46	0,00	72,02	49,54	7,50	7,37	1116,11	1123,61
Kamatkozó kincstárjegy	20,07	11,49	17,61	15,73	15,60	17,61	0,00	0,00	0,00	4,34	-4,11	0,00	116,62	112,51
Féléves kincstárjegy	1,26	0,83	0,97	0,82	1,03	0,97	0,00	0,00	0,00	0,45	-0,20	0,00	7,70	7,50
ÖSSZESEN	134,94	83,80	126,88	65,49	55,42	73,18	25,46	0,00	72,02	43,99	28,38	-18,33	1248,77	1277,15

Állampapírcsoporthoz hozamok (%)

2014.10.30	ELSŐDLEGES FORGALMAZÓK ÁRJEGYZÉSE		OTC-ÁTLAG*	REF. HOZAM
	VÉTEL	ELADÁS		
3 hónap	1,80	1,62	1,64	1,71
6 hónap	1,83	1,65	1,70	1,74
12 hónap	1,80	1,60	1,62	1,70
3 év	2,98	2,84	2,89	2,91
5 év	3,46	3,30	3,43	3,38
10 év	4,07	3,92	4,09	4,00
15 év	4,36	4,21	4,30	4,29

*az OTC-átlag értéknapi adat

Referenciahozam-görbe

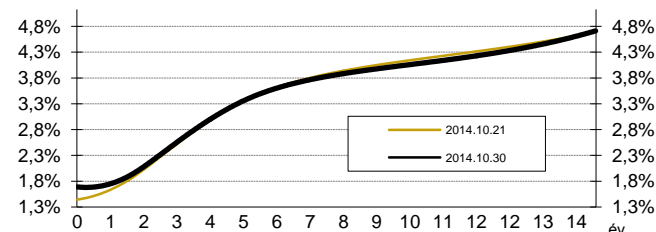


Másodpiaci forgalom (mrd Ft)

2014. 10. 24 - 2014. 10. 30.	DKJ		Állampapír		ÁLLAMPAPÍR	
	MTS	OTC*	MTS	OTC*	MTS	OTC*
2014.10.24	0,00	0,0	0,00	0,0	0,00	0,0
2014.10.27	0,50	37,5	0,00	355,4	0,50	393,0
2014.10.28	3,38	20,5	3,29	316,9	6,66	337,5
2014.10.29	0,00	118,8	0,00	291,4	0,00	410,1
2014.10.30	0,00	69,6	0,56	322,3	0,56	391,9
ÖSSZESEN	3,87	246,5	3,85	1 286,0	7,73	1 532,5

*az OTC-forgalom értéknapi adat

Zérókuponhozam-görbe



A legutóbbi állampapírcsoporthoz fontosabb adatai (mrd Ft)

Fix kamatozású állampapírcsoporthoz	AUKCIÓ DÁTUMA	MAX. HOZAM (%)	ÁTLAGHOZAM (%)	VÁLTOZÁS ELŐZŐ AUKCIÓHOZ KÉPST (bp)	MEGHIR. MENNY.	BENYÚJTOTT AJÁNLATOK	ELFOG. AJÁNL.	FEDEZETTSÉG	NEM KOMP. ÉRTÉK.	ÖSSZES PIACI KIBOCS.
likviditási DKJ	2014.10.27	1,92	1,82	-106	50	60,7	45,0	1,21	0,0	45,0
3 hónapos DKJ	2014.10.28	1,85	1,74	40	30	39,2	30,0	1,31	0,0	30,0
12 hónapos DKJ	2014.10.22	-	-	-	40	15,1	0,0	-	0,0	0,0
3 éves állampapír	2014.10.30	2,92	2,88	-8	20	38,4	20,0	1,92	2,4	22,4
5 éves állampapír	2014.10.30	3,37	3,36	-25	20	65,9	30,0	3,30	6,8	36,8
10 éves állampapír	2014.10.16	4,23	4,22	-32	20	54,2	30,0	2,71	0,0	30,0
15 éves állampapír	2014.10.30	4,28	4,26	-67	10	28,7	15,0	2,87	5,2	20,2
Változó kamatozású állampapírcsoporthoz	AUKCIÓ DÁTUMA	MIN. ÁR (%)	ÁTLAGÁR (%)	ÁR-VÁLTOZÁS AZ ELŐZŐ AUKCIÓHOZ KÉPST (%)	MEGHIR. MENNY.	BENYÚJTOTT AJÁNLATOK	ELFOG. AJÁNL.	FEDEZETTSÉG	NEM KOMP. ÉRTÉK.	ÖSSZES PIACI KIBOCS.
3 éves változó kötvény	2014.10.09	99,18	99,20	0,0	20	85,2	30,0	4,26	8,5	38,5
5 éves változó kötvény	2014.10.22	96,71	96,96	-0,1	15	13,7	7,5	0,91	0,0	7,5

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