

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa - september 2016

GAMMA: Corporate Bond Index 135,927
GAMMAcb: Sértryggt 129,919

Gengi vísitalna síðasta viðskiptadag í ágúst 2016

Vigtir skuldabréfa

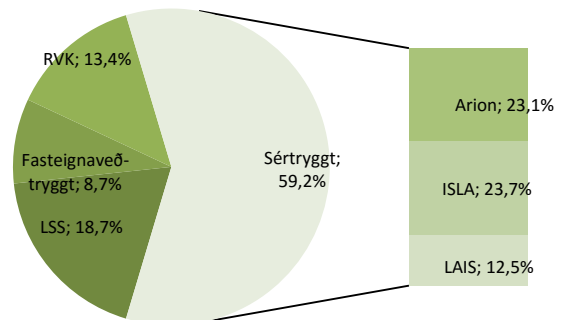
Bréf	GAMMA: CBI			GAMMAcb: Sértryggt		
	1.ágú.16	1.sep.16	Breyting	1.ágú.16	1.sep.16	Breyting
LSS150224	10,9%	9,9%	-0,96%			
LSS150434	8,8%	8,8%	-0,08%			
RVK 19 1	0,6%	0,6%	-0,01%			
RVK 53 1	11,3%	11,3%	0,02%			
RVKN 35 1	1,4%	1,4%	0,05%			
EIK 12 01	5,1%	5,0%	-0,11%			
REG3A 14 1	3,9%	3,7%	-0,23%			
ARION CBI 19	1,9%	1,8%	-0,04%	3,2%	3,1%	-0,14%
ARION CBI 21	3,8%	3,9%	0,11%	6,5%	6,5%	0,04%
ARION CBI 29	8,7%	9,1%	0,47%	14,9%	15,4%	0,47%
ARION CBI 34	1,0%	1,0%	-0,06%	1,8%	1,6%	-0,14%
ISLA CBI 19	3,5%	3,4%	-0,07%	6,0%	5,8%	-0,25%
ISLA CBI 20	1,7%	1,7%	-0,04%	3,0%	2,9%	-0,13%
ISLA CBI 22	2,2%	2,1%	-0,03%	3,8%	3,6%	-0,13%
ISLA CBI 24	4,6%	4,5%	-0,08%	8,0%	7,7%	-0,31%
ISLA CBI 26	5,4%	6,1%	0,73%	9,3%	10,3%	1,03%
LBANK CBI 22	6,6%	6,8%	0,15%	11,4%	11,4%	0,00%
ARION CB 22	7,1%	7,3%	0,13%	12,3%	12,3%	-0,05%
ISLA CB 19	2,9%	2,9%	0,00%	5,0%	4,8%	-0,12%
ISLA CB 23	2,8%	2,9%	0,06%	4,9%	4,9%	-0,01%
LBANK CB 17	0,8%	0,7%	-0,01%	1,3%	1,3%	-0,04%
LBANK CB 19	5,0%	5,0%	-0,01%	8,7%	8,4%	-0,21%
	100,00%	100,00%		100,00%	100,00%	

Gefin voru út bréf í flokkum ARION CBI 21 [440 mln nom], ARION CBI 29 [1.280 mln nom], ISLA CBI 26 [1.940 mln nom] og LBANK CBI 22 [720 mln nom].

Verðtryggingarhlutfall vísitölnnar lækkar um 0,2 prósentustig og er 81,2%. Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni hækkar um 6 ma. í mánuðinum og er 253 milljarðar.

Líftími vísitölnnar lækkar um 0,1 ár og er 7,1 ár.

Líftími sértryggtu vísitölnnar er 5,7 ár og verðtryggingarhlutfall 68,3%.


Ávöxtun vísitölnnar

Heildarvísitalan, GAMMA: CBI, hækkaði um 1,5% í ágúst.

Sértryggtá vísitalan GAMMAcb hækkaði um 1,6%.

Meðaldagsvelta CBI var um 427 milljónir króna í ágúst, þar af 356 milljón með sértryggt.

	GAMMA: CBI	GAMMAcb
1m	1,45%	1,55%
6m	2,49%	3,19%
1Y	2,91%	4,52%
ytd	3,12%	3,87%

Um vísitölu fyrirtækjaskuldabréfa

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa er reiknuð og birt af GAMMA Capital Management hf., óháðu og sérhæfðu ráðgjafar- og sjóðastýringarfyrirtæki með starfsleyfi frá FME sem tekur til reksturs verðbréfasjóða og fjárfestingarráðgjafar. Vísitalan sýnir heildarávöxtun útgefina skuldabréfa sem hafa ekki beina ríkisábyrgð, hlutfallsvígtað miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni. Sjá nánar á www.gamma.is/visitolur.

Fyrirvari: Umfjöllun þessi felur ekki í sér fjárfestingarráðgjöf eða tilboð eða hvatningu um að eiga viðskipti með verðbréf. Mat, álit og forspár endurspeglar eingöngu skoðanir þeirra starfsmanna GAMMA Capital Management hf. sem vinna umfjöllunina og eru þær settar fram eftir bestu samvisku miðað við útgáfudag og kunna að breytast án fyrirvara. Þó svo upplýsingar þær sem birtast í þessari umfjöllun komi frá heimildum sem við teljum vera áreiðanlegar og þó svo við höfum lagt okkur fram um að tryggja áreiðanleika upplýsinganna á útgáfudegi þá ábyrgjumst við ekki beint eða óbeint notagildi þeirra varðandi forspá um framtíðarávöxtun eða mat á núverandi verðgildi eða framtíðarverðgildi verðbréfa. Umfjöllunin ætti hvorki að skoðast sem fullnægjandi lýsing á þeim verðbréfum né á þeim mörkuðum sem hér er vitnað til. Skoðanir, sem látnar eru í ljós, kunna að vera ólíkar skoðunum á sama efni sem látnar eru í ljós af öðrum starfsmönnum GAMMA Capital Management hf. og stafar það af því að beitt er mismunandi forsendum eða aðferðafræði. Almennt fylgir áhætta fjárfestingu í verðbréfum og verðbréfasjóðum og athygli er vakin á því að söguleg ávöxtun gefur ekki vísbendingu um framtíðarávöxtun.