

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa - október 2015

GAMMA: Corporate Bond Index 132,285
GAMMAcb: Sértryggt 124,551

Gengi vísitalna síðasta viðskiptadag í september 2015

Vigtir skuldabréfa

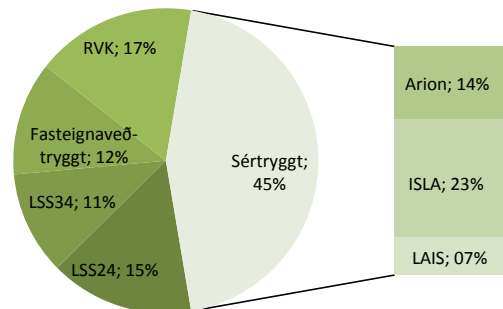
Bréf	GAMMA: CBI			GAMMAcb: Sértryggt		
	1.sep.15	1.okt.15	Breyting	1.sep.15	1.okt.15	Breyting
LSS150224	16,1%	15,3%	-0,82%			
LSS150434	11,6%	10,9%	-0,61%			
RVK 19 1	1,2%	1,1%	-0,07%			
RVK 53 1	16,9%	15,9%	-0,97%			
EIK 12 01	7,2%	6,9%	-0,36%			
REG3A 14 1	5,5%	5,2%	-0,25%			
ARION CBI 19	2,7%	2,5%	-0,14%	6,4%	5,6%	-0,76%
ARION CBI 21	1,9%	1,8%	-0,10%	4,5%	4,0%	-0,54%
ARION CBI 29	6,6%	6,2%	-0,34%	15,8%	13,9%	-1,85%
ARION CBI 34	1,5%	1,4%	-0,08%	3,5%	3,1%	-0,42%
ISLA CBI 16	2,6%	2,5%	-0,14%	6,2%	5,5%	-0,74%
ISLA CBI 19	4,9%	4,6%	-0,31%	11,8%	10,3%	-1,52%
ISLA CBI 20	2,5%	2,3%	-0,12%	5,9%	5,2%	-0,68%
ISLA CBI 24	6,6%	6,2%	-0,44%	15,9%	13,8%	-2,07%
ISLA CBI 26	2,6%	3,6%	1,08%	6,1%	8,1%	1,99%
LBANK CBI 22	2,8%	3,3%	0,47%	6,7%	7,3%	0,59%
ARION CB 22	0,0%	2,3%	2,34%	0,0%	5,2%	5,23%
ISLA CB 16	1,6%	1,6%	-0,08%	3,9%	3,5%	-0,44%
ISLA CB 19	1,1%	2,3%	1,25%	2,6%	5,2%	2,62%
LBANK CB 16	2,0%	1,9%	-0,10%	4,7%	4,2%	-0,55%
LBANK CB 17	0,8%	0,8%	-0,04%	2,0%	1,8%	-0,23%
LBANK CB 19	1,6%	1,4%	-0,16%	3,8%	3,2%	-0,63%
	100,00%	100,00%		100,00%	100,00%	

Nýtt bréf var gefið út í mánuðinum og kemur inn í vísitöluna um mánaðamótin, ARION CB 22. Bréfið er 2,3% af heildarvísitölunni og 5,2% af sértryggtu undirvísitölunni.

Verðtryggingarhlutfall vísitölnnar lækkaði um 3,3 prósentustig í september og er 89,7%. Sértryggt bréf hækka um 3 prósentustig og eru 44,6% af heildarvísitölunni.

Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni hækkar um 10 milljarða og er um 186 milljarðar.

Líftími vísitölnnar lækkar um 0,2 og er 7,9 ár.


Ávöxtun vísitölnnar

Heildarvísitalan, GAMMA: CBI, hækkaði um 0,2% í september
Sértryggt vísitalan GAMMAcb hækkaði um 0,2%.

Meðaldagsvelta CBI var um 183 milljónir króna í september, þar af 72 milljónir með sértryggt.

	GAMMA: CBI	GAMMAcb
1m	0,15%	0,20%
3m	2,80%	2,80%
6m	4,39%	4,09%
1Y	9,15%	8,00%
ytd	7,78%	6,76%

Um vísitölu fyrirtækjaskuldabréfa

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa er reiknuð og birt af GAM Management hf., óháðu og sérhæfðu ráðgjafar- og sjóðastýringarfyrirtæki með starfsleyfi frá FME sem tekur til reksturs verðbréfasjóða og fjárfestingarráðgjafar. Vísitalan sýnir heildarávöxtun útgafinna skuldabréfa sem hafa ekki beina ríkisábyrgð, hlutfallsvígtað miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni. Notast er við lokagengi skuldabréfa á hverjum viðskiptadegi eins og það er birt í NASDAQ OMX Nordic Exchange. Heildarávöxtun þýðir að

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 GAM Management hf. sem vinna umfjöllunina og eru þær settar fram eftir bestu samvisku miðað við útgáfudag og kunn 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 lánar eru í ljós, kunna að vera ólíkar skoðunum á sama efni sem lánar eru í ljós af öðrum starfsmönnum GAM Management hf. og stafar það af því að beitt er mismunandi forsendum eða aðferðafræði. Almennit fylgir áhætta fjárfestingu í verðbréfum og verðbréfasjóðum og athygli er vakin á því að söguleg ávöxtun gefur ekki vísbendingu um framtíðarávöxtun.