

Skuldabréfavísitölur GAMMA Capital Management hf. - febrúar 2016

GAMMA: GBI 282,315

GAMMAi 290,975

GAMMAxi 246,905

Gengi vísitalna síðasta viðskiptadag í janúar (sett 100 1. jan 2005).

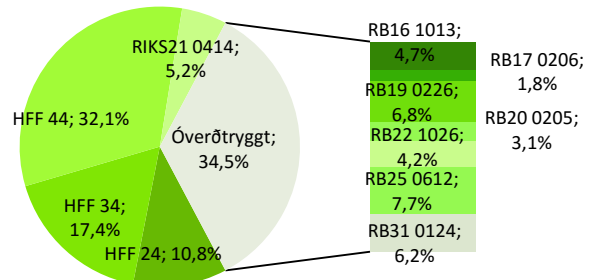
Vigtir skuldabréfa

	GAMMA: GBI			GAMMAi: Verðtryggt			GAMMAxi: Óverðtryggt		
	1.jan.16	1.feb.16	Breyting	1.jan.16	1.feb.16	Breyting	1.jan.16	1.feb.16	Breyting
HFF 24	10,82%	10,84%	0,02%	16,47%	16,54%	0,07%			
HFF 34	17,36%	17,37%	0,01%	26,43%	26,51%	0,09%			
HFF 44	32,29%	32,11%	-0,19%	49,16%	49,00%	-0,16%			
RIKS21 0414	5,21%	5,21%	-0,01%	7,94%	7,94%	0,01%			
RB16 1013	4,68%	4,73%	0,04%				13,65%	13,71%	0,06%
RB17 0206	1,51%	1,79%	0,28%				4,39%	5,19%	0,80%
RB19 0226	6,73%	6,77%	0,04%				19,62%	19,63%	0,02%
RB20 0205	2,80%	3,06%	0,27%				8,15%	8,89%	0,74%
RB22 1026	4,24%	4,25%	0,01%				12,36%	12,32%	-0,03%
RB25 0612	7,69%	7,66%	-0,03%				22,41%	22,23%	-0,19%
RB31 0124	6,67%	6,22%	-0,45%				19,43%	18,03%	-1,40%
	100,00%	100,00%		100,00%	100,00%		100,00%	100,00%	

Gefin voru út bréf í flokki RB17 [3.940 mln nom], RB20 [3.605 mln nom] og RB31 [602 mln nom] sem hækka hlutfall hlutfall þeirra í vísitölunni. Hlutfall óverðtryggðra bréfa hækkaði um 0,2 prósentustig milli mánaða og er 34,5%.

Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni lækkaði um 8 ma. og er nú 1.499ma.

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

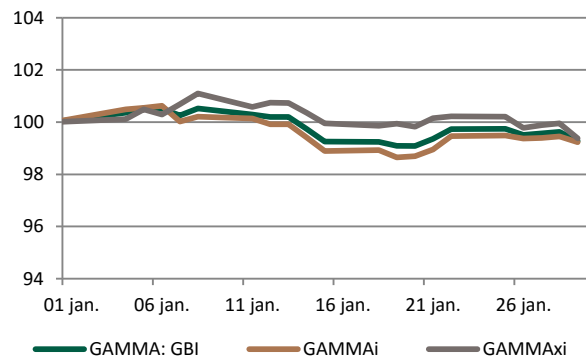
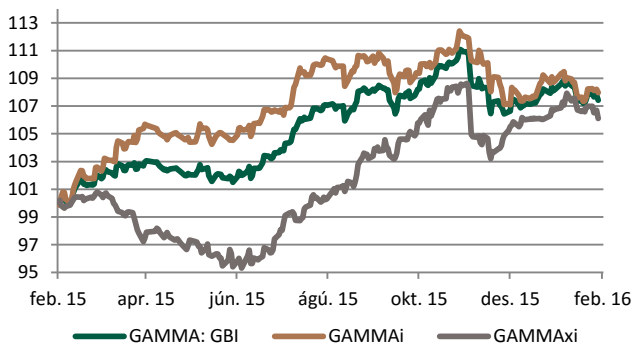


Ávöxtun vísitölnunnar

Heildarvísitalan, GAMMA: GBI, lækkaði um 0,7% í janúar. Verðtryggða vísitalan GAMMAi lækkaði um 0,8% og óverðtryggða vísitalan GAMMAxi lækkaði um 0,6%.

Meðaldagsvelta GBI var um 6,9 ma. í janúar, þar af 1,0 ma. með verðtryggt og 6,0 ma. með óverðtryggt.

	GAMMA: GBI	GAMMAi	GAMMAxi
1m	-0,72%	-0,77%	-0,62%
3m	-3,17%	-3,67%	-2,20%
6m	0,33%	-2,20%	5,78%
1Y	7,41%	7,96%	6,09%
ytd	8,32%	9,33%	6,05%



Um skuldabréfavísitölur GAMMA

Skuldabréfavísitölur GAMMA eru reiknaðar og birtar af GAM Management hf., óháðu og sérhæfðu ráðgjafar- og sjóðastýringarfyrtækni með starfsleyfi frá FME sem tekur til reksturs verðbréfasjóða og fjárfestingarráðgjafar. Vísitölurnar sýna heildarvöxtun útgefna íbúðabréfa, ríkisbréfa og spariskirteina, hlutfallsvígtað miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölunni. Sjá nánar í GAMMA: Government Bond Index – aðferðafræði.

Fyrirvari: Umfjöllun þessi felur ekki í sér fjárfestingarráðgjöf eða tilboð eða hvatningu um að eiga viðskipti með verðbréf. Mat, álit og forspár endurspegla 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 framtíðarvöxtun 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 framtíðarvöxtun.