

Skuldabréfavísitölur GAMMA Capital Management hf. - nóvember 2016

GAMMA: GBI 297,835
GAMMAi 301,997
GAMMAxi 269,204

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

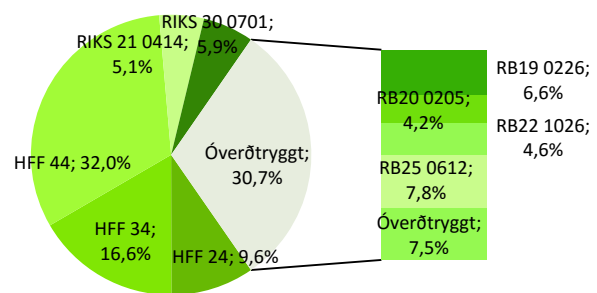
Vigtir skuldabréfa

| | GAMMA: GBI | | | GAMMAi: Verðtryggt | | | GAMMAxi: Óverðtryggt | | |
|--------------|------------|----------|----------|--------------------|----------|----------|----------------------|----------|----------|
| | 1.okt.16 | 1.nóv.16 | Breyting | 1.okt.16 | 1.nóv.16 | Breyting | 1.okt.16 | 1.nóv.16 | Breyting |
| HFF 24 | 10,16% | 9,62% | -0,54% | 15,00% | 13,88% | -1,12% | | | |
| HFF 34 | 18,21% | 16,63% | -1,58% | 26,88% | 24,01% | -2,87% | | | |
| HFF 44 | 33,92% | 32,03% | -1,89% | 50,07% | 46,22% | -3,84% | | | |
| RIKS 21 0414 | 5,46% | 5,14% | -0,32% | 8,06% | 7,42% | -0,64% | | | |
| RIKS 30 0701 | 0,00% | 5,87% | 5,87% | 0,00% | 8,47% | 8,47% | | | |
| RB19 0226 | 6,93% | 6,55% | -0,37% | | | | 21,48% | 21,35% | -0,13% |
| RB20 0205 | 4,27% | 4,24% | -0,04% | | | | 13,25% | 13,79% | 0,55% |
| RB22 1026 | 5,17% | 4,63% | -0,54% | | | | 16,04% | 15,08% | -0,96% |
| RB25 0612 | 8,15% | 7,82% | -0,33% | | | | 25,27% | 25,47% | 0,19% |
| RB31 0124 | 7,73% | 7,47% | -0,26% | | | | 23,96% | 24,31% | 0,35% |
| | 100,00% | 100,00% | | 100,00% | 100,00% | | 100,00% | 100,00% | |

Nýtt bréf er tekið inn í vísitöluna um mánaðamótin, RIKS 30 0701 [71,3 ma. nom], þar sem tekin var upp viðskiptavakt á bréfinu í mánuðinum. Er þetta fyrsta skuldabréfið sem tekið er inn í verðtryggða hluta ríkistryggðu vísitölnnar frá því í maí 2010. Bréfið vegur 5,9% í heildarvísitölnni og 8,5% í verðtryggðu undirvísitölnni. Einnig voru gefin út bréf í flokki RB20 [2.590 mln nom].

Hlutfall óverðtryggðra bréfa lækkar um 1,5 prósentustig milli mánaða og er 30,7%. Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni hækkar um 84 ma. og er nú 1.518 ma.

Líftími vísitölnnar hækkar um 0,1 ár og er 8,0 ár.

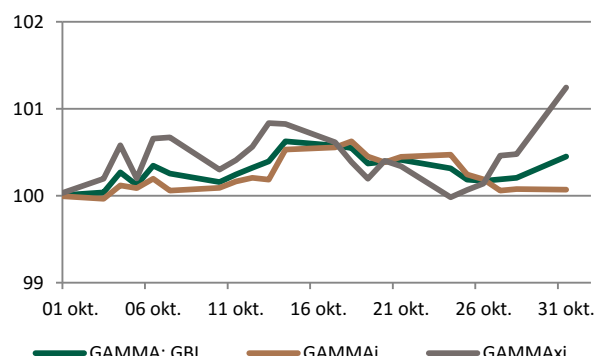
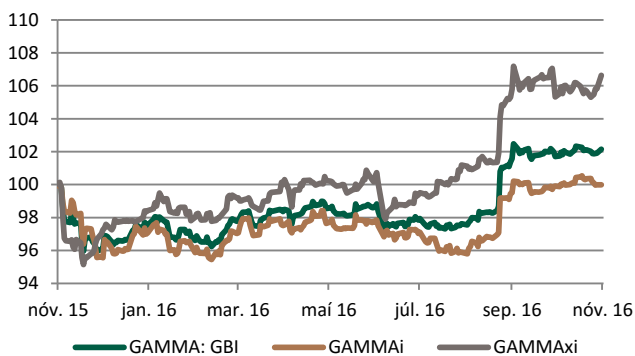


Ávöxtun vísitölnnar

Heildarvísitalan, GAMMA: GBI, hækkaði um 0,4% í október. Verðtryggða vísitalan GAMMAi hækkaði um 0,1% og óverðtryggða vísitalan GAMMAxi hækkaði um 1,2%.

Meðaldagsvelta GBI var um 4,8 ma. í október, þar af 0,5 ma. með verðtryggt og 4,3 ma. með óverðtryggt.

| | GAMMA: GBI | GAMMAi | GAMMAxi |
|-----|------------|--------|---------|
| 1m | 0,45% | 0,07% | 1,25% |
| 3m | 4,64% | 4,27% | 5,39% |
| 6m | 3,67% | 2,39% | 6,36% |
| 1Y | 2,16% | -0,02% | 6,64% |
| ytd | 4,74% | 2,99% | 8,36% |



Um skuldabréfavísitölur GAMMA

Skuldabréfavísitölur GAMMA eru reiknaðar og birtar af GAMMA Capital Management hf., óháðu og sérhæfðu ráðgjafar- og sjóðastýringarfyrtækni með starfsleyfi frá FME sem tekur til reksturs verðbréfasjóða og fjárfestingarráðgjafar. Vísitölnnar sýna heildarávöxtun útgefina íbúðabréfa, ríkisbréfa og spariskirteina, hlutfallsviðmið miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni. 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 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 er u 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.