

Vísitala fyrirtækjaskuldabréfa - ágúst 2018

GAMMA: Corporate Bond Index 152,551
GAMMAcb: Sértryggt 144,922

Gengi vísitalna síðasta viðskiptadag í júlí 2018

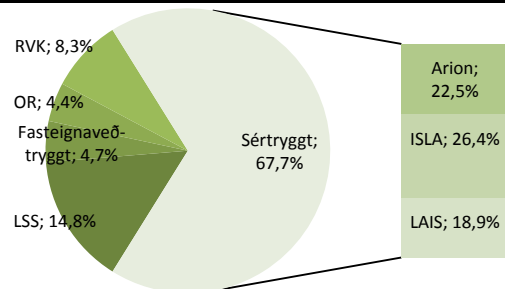
Vigtir skuldabréfa

| Bréf | GAMMA: CBI | | | GAMMAcb: Sértryggt | | |
|--------------|------------|----------|----------|--------------------|----------|----------|
| | 1.júl.18 | 1.ágú.18 | Breyting | 1.júl.18 | 1.ágú.18 | Breyting |
| AL260148 | 1,4% | 1,3% | -0,06% | | | |
| LSS150224 | 4,5% | 4,5% | -0,07% | | | |
| LSS150434 | 7,5% | 7,5% | 0,02% | | | |
| LSS151155 | 2,9% | 2,8% | -0,07% | | | |
| OR090524 | 0,7% | 0,7% | -0,01% | | | |
| OR090546 | 3,8% | 3,7% | -0,08% | | | |
| RVK 19 1 | 0,1% | 0,1% | 0,00% | | | |
| RVK 53 1 | 7,3% | 7,1% | -0,15% | | | |
| RVKN 35 1 | 1,1% | 1,1% | -0,04% | | | |
| REGINN290547 | 1,6% | 1,6% | -0,03% | | | |
| REG3A 14 1 | 1,8% | 1,8% | -0,04% | | | |
| ARION CBI 19 | 1,0% | 1,0% | -0,03% | 1,5% | 1,4% | -0,06% |
| ARION CBI 21 | 2,3% | 2,2% | -0,05% | 3,4% | 3,3% | -0,09% |
| ARION CBI 25 | 6,3% | 6,4% | 0,07% | 9,4% | 9,4% | 0,03% |
| ARION CBI 29 | 5,9% | 5,9% | -0,07% | 8,8% | 8,6% | -0,18% |
| ARION CBI 48 | 1,0% | 1,0% | 0,01% | 1,4% | 1,4% | 0,01% |
| ISLA CBI 19 | 1,8% | 1,8% | -0,03% | 2,7% | 2,6% | -0,07% |
| ISLA CBI 20 | 0,9% | 0,9% | -0,01% | 1,3% | 1,3% | -0,03% |
| ISLA CBI 22 | 3,8% | 3,8% | -0,08% | 5,7% | 5,6% | -0,16% |
| ISLA CBI 24 | 5,9% | 6,1% | 0,17% | 8,8% | 9,0% | 0,19% |
| ISLA CBI 26 | 5,3% | 5,2% | -0,11% | 8,0% | 7,7% | -0,23% |
| ISLA CBI 30 | 4,6% | 4,6% | 0,04% | 6,8% | 6,9% | 0,01% |
| LBANK CBI 22 | 4,4% | 4,4% | -0,05% | 6,6% | 6,5% | -0,13% |
| LBANK CBI 24 | 3,2% | 3,6% | 0,42% | 4,7% | 5,3% | 0,59% |
| LBANK CBI 28 | 5,7% | 6,0% | 0,35% | 8,5% | 8,9% | 0,45% |
| ARION CB 19 | 0,6% | 0,5% | -0,01% | 0,8% | 0,8% | -0,03% |
| ARION CB 22 | 5,5% | 5,5% | 0,04% | 8,2% | 8,2% | 0,00% |
| ISLA CB 19 | 2,2% | 2,2% | -0,05% | 3,3% | 3,2% | -0,11% |
| ISLA CB 23 | 1,8% | 1,7% | -0,01% | 2,6% | 2,6% | -0,04% |
| LBANK CB 19 | 3,7% | 3,6% | -0,09% | 5,5% | 5,3% | -0,17% |
| LBANK CB 21 | 1,0% | 0,9% | -0,03% | 1,4% | 1,4% | -0,05% |
| LBANK CB 23 | 0,3% | 0,3% | 0,04% | 0,4% | 0,5% | 0,05% |
| | 100,00% | 100,00% | | 100,00% | 100,00% | |

Í mánuðinum voru gefin út bréf í flokkum ARION CBI 25 [1.200 mln nom], ARION CBI 48 [980 mln nom], ISLA CBI 24 [260 mln nom], ISLA CBI 26 [680 mln nom], LBANK CBI 24 [420 mln nom], ISLA CB 23 [500 mln nom].

Markaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni hækkaði um 14,3 ma. í mánuðinum og er 513,1 milljarðar.

Líftími vísitölnnar lækkaði milli mánaða og er 6,9 ár. Líftími sértryggtu undirvísitölnnar stóð í stað milli mánaða og er 5,4 ár og verðtryggingarhlutfall 77,8%.


Ávöxtun vísitölnnar

Heildarvísitalan, GAMMA: CBI, lækkaði um 1,23% í júlí. Sértryggða vísitalan GAMMAcb lækkaði um 1,30%.

Meðaldagsvelta CBI var um 720 milljónir króna í júlí, þar af 475 milljónir með sértryggt.

| | GAMMA: CBI | GAMMAcb |
|-----|------------|---------|
| 1m | -1,23% | -1,30% |
| 6m | 0,37% | 0,57% |
| 1Y | 4,16% | 3,93% |
| ytd | 0,68% | 0,62% |

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 heildarvöxtun útgefina skuldabréfa sem hafa ekki beina ríkisábyrgð, hlutfallsvið miðað við markaðsverðmæti hvers bréfs í hlutfalli af heildarmarkaðsverðmæti skuldabréfa í vísitölnni. Sjá nánar á www.gamma.is/visolur.

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 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.