Hagfræðideild Landsbankans

2. júní 2023

Mánaðaryfirlit sértryggðra skuldabréfa

Fréttir af markaði

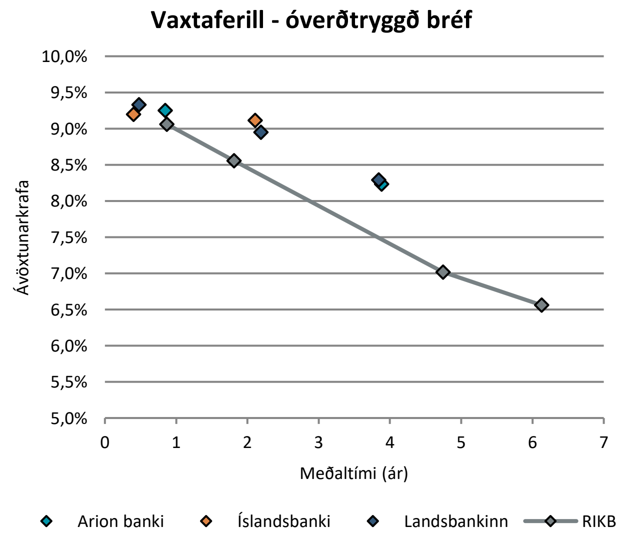
12. maí hélt [Íslandsbanki] útboð. Í flokknum ISB CBI 29 seldi bankinn bréf að fjárhæð 8.020 m.kr. á kröfunni 2,60%, í flokknum ISB CBF 27 bréf að fjárhæð 620 m.kr. á 0,40% álag á 1 mánaða REIBOR og í flokknum ISB CB 27 seldi bankinn bréf að fjárhæð 300 m.kr. á kröfunni 9,06%. Í tilfelli ISB CBI 29 og ISB CBF 27 voru seld bréf í eigu bankans. Samhliða útboðinu keypti bankinn til baka bréf í flokknum ISB CB 23 að nafnvirði 7.700 m.kr.

16. maí seldi Landsbankinn bréf í flokknum LBANK CB 27 að fjárhæð 2.160 m.kr. á kröfunni 8,21%. Í tengslum við útboðið keypti bankinn til baka bréf í flokknum LBANK CB 23 að nafnvirði 1.780 m.kr.

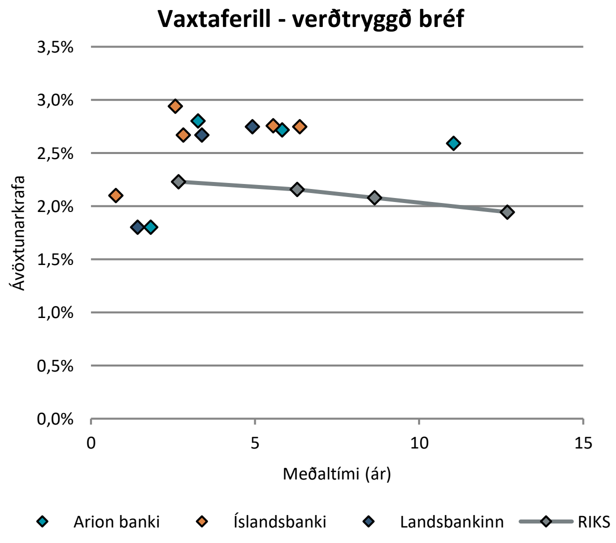
S&P breytti horfum á lánshæfismati sértryggðra skuldabréfa Landsbankans og Arion banka úr stöðugum í jákvæðar.

		Frá áramótum:	
Óverðtryggð bréf	Krafa 31.5.2023	Breyting á kröfu	Ávöxtun
ARION CB 24	9,25%	1,97%	1,4%
ARION CB 27	8,23%	1,18%	-1,4%
ISB CB 23	9,20%	2,25%	2,0%
ISB CB 27	9,11%	1,81%	-0,3%
LBANK CB 23	9,33%	2,37%	1,8%
LBANK CB 25	8,95%	1,59%	-0,3%
LBANK CB 27	8,29%	1,20%	-1,4%
Verðtryggð bréf			
ARION CBI 25	1,80%	-0,60%	7,0%
ARION CBI 26	2,80%	0,40%	4,6%
ARION CBI 29	2,72%	0,32%	4,0%
ARION CBI 48	2,59%	0,04%	5,5%
ISB CBI 24	2,10%	-0,35%	6,2%
ISB CBI 26	2,67%	0,30%	5,0%
ISB CBI 28	2,94%	0,54%	4,4%
ISB CBI 29	2,76%		
ISB CBI 30	2,75%	0,33%	3,8%
LBANK CBI 24	1,80%	-0,70%	7,0%
LBANK CBI 26	2,67%	0,27%	5,0%
LBANK CBI 28	2,75%	0,32%	4,3%

Heimild: Kodiak Excel

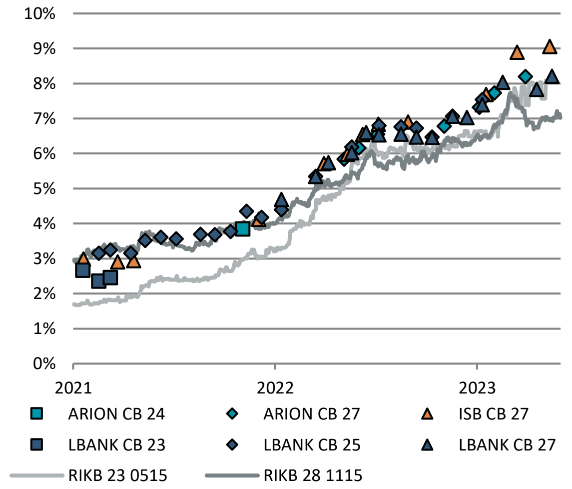


M.v. lok dags 31.5.2023. Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel



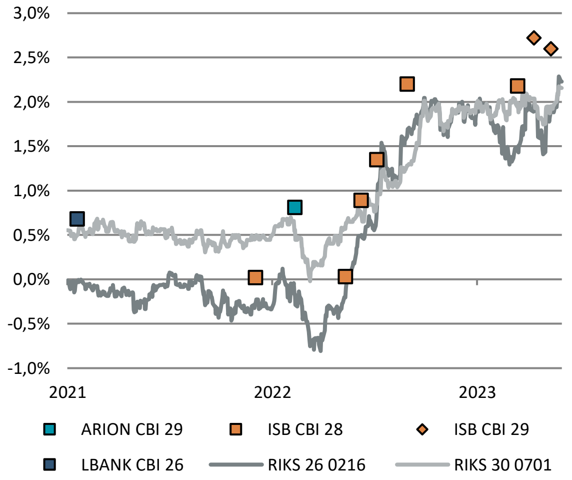
M.v. lok dags 31.5.2023. Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

Krafa í útboðum – óverðtryggð bréf



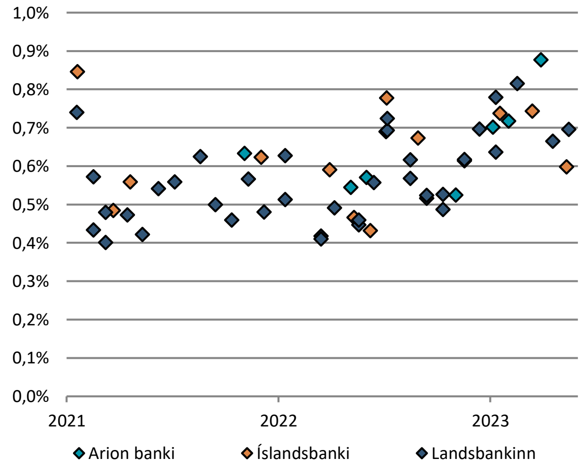
Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

Krafa í útboðum – verðtryggð bréf



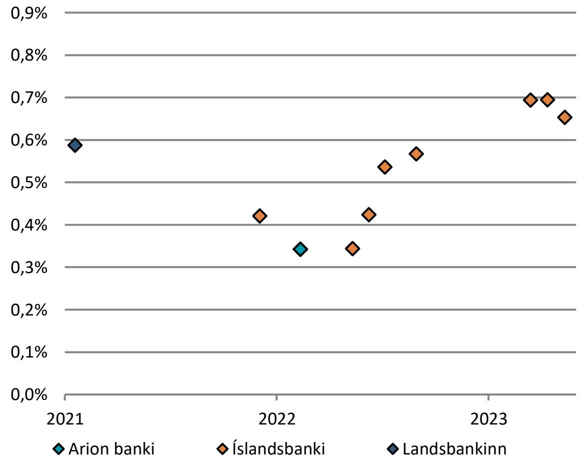
Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

Álag[1] m.v. ríkisbréf í útboðum – óverðtryggð bréf



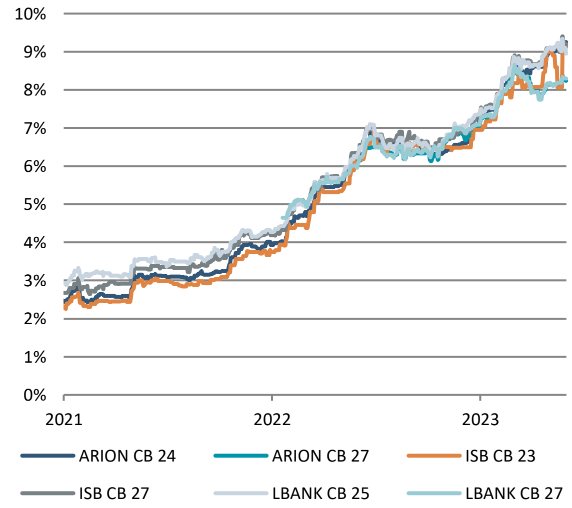
Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel, útreikningar Hagfræðideildar

Álag m.v. ríkisbréf í útboðum – verðtryggð bréf



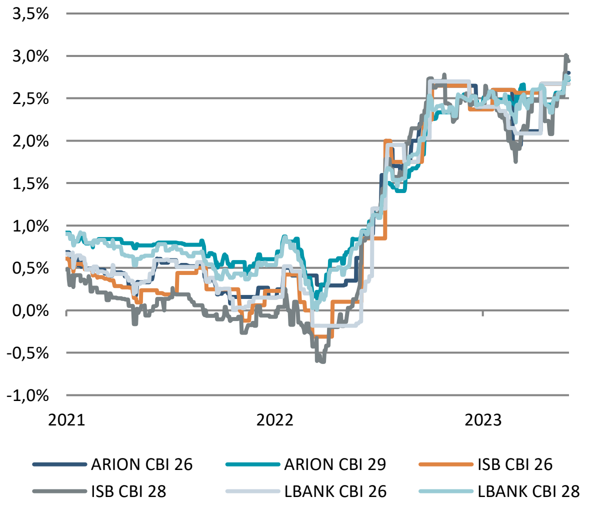
Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel, útreikningar Hagfræðideildar

Ávöxtunarkrafa á markaði – óverðtryggð bréf



Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

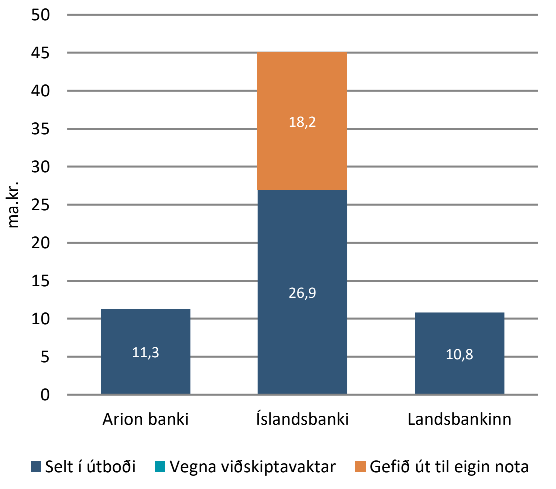
Ávöxtunarkrafa á markaði – verðtryggð bréf



Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

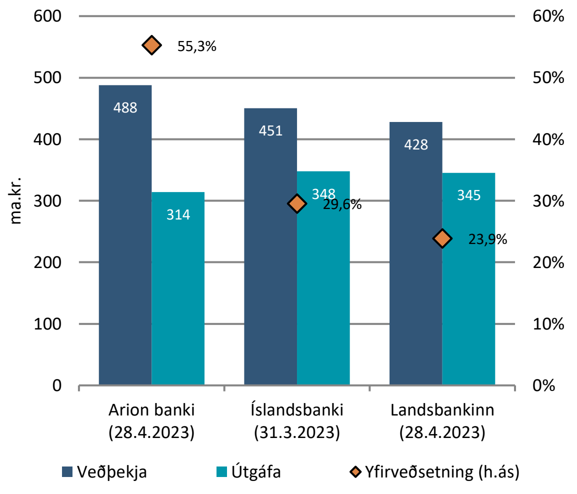
[1] Álag er reiknað sem munur á kröfu í útboði og línulegu brúarinnar út frá meðaltíma á vaxtakúrfu ríkisbréfa.

Útgáfa 2023



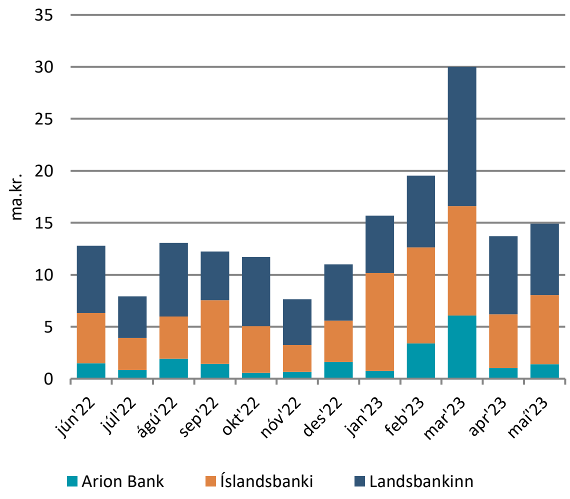
Heimild: Arion banki, Íslandsbanki, Landsbankinn

Veðhlutfall útgáfu



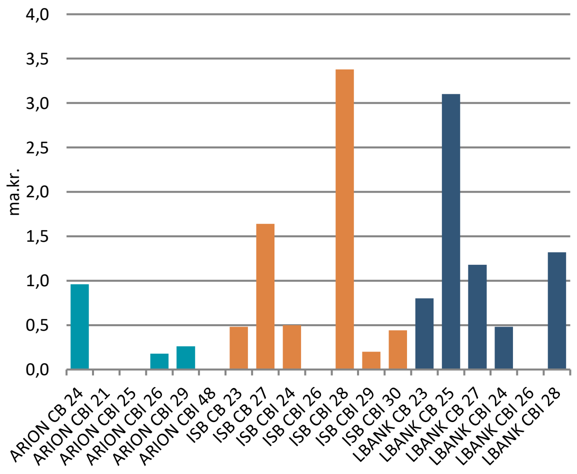
Heimild: Arion banki, Íslandsbanki, Landsbankinn

Velta á markaði undanfarna 12 mánuði



Hemild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

Velta á markaði í maí



Heimild: Nasdaq Iceland, Kodiak Excel

Sértryggð bréf 31. maí 2023 í m.kr.

	Nafnverð í upphafi mán.	Útgáfa / innlausn	Nafnverð í lok mán.	Nafnverð m/áföllnum verðbótum í lok mán.
ARION CB 24	40.180		40.180	40.180
ARION CB 27	19.380		19.380	19.380
ARION CBI 25	37.940		37.940	50.739
ARION CBI 26	17.080		17.080	21.731
ARION CBI 29	27.200		27.200	37.894
ARION CBI 48	11.680		11.680	15.378
			ALLS:	**185.301**
ISB CB 23	39.940		39.940	39.940
ISB CB 27	85.400	300	85.700	85.400
ISB CBF 27	10.000		10.000	10.000
ISB CBI 24	28.560		28.560	43.298
ISB CBI 26	25.460		25.460	35.102
ISB CBI 28	45.700		45.700	58.009
ISB CBI 29	12.660		12.660	12.845
ISB CBI 30	24.000		24.000	31.928
			ALLS:	**316.523**
LBANK CB 23	48.040		48.040	48.040
LBANK CB 25	55.620		55.620	55.620
LBANK CB 27	23.400	1.260	24.660	24.660
LBANK CBI 24	39.080		39.080	52.111
LBANK CBI 26	12.080		12.080	15.014
LBANK CBI 28	49.240		49.240	66.319
			ALLS:	**261.763**

Þessi umfjöllun og/eða samantekt er markaðsefni sem er ætluð til upplýsinga en felur hvorki í sér fjárfestingarráðgjöf né óháða fjárfestingagreiningu. Lagakröfur sem gilda um fjárfestingarráðgjöf og fjárfestingagreiningar eiga því ekki við, þar með talið bann við viðskiptum fyrir dreifingu. Umfjöllunin var unnin út frá opinberum upplýsingum frá aðilum sem Landsbankinn hefur metið áreiðanlega, en bankinn getur ekki ábyrgst réttmæti þeirra. Landsbankinn tekur enga ábyrgð á tjóni sem gæti hlotist af því að nýta upplýsingar sem hér eru settar fram.

Upplýsingar um fyrri árangur fjármálagerninga eða -vísitalna sýna nafnávöxtun, nema annað sé tekið fram. Ef árangur byggir á erlendum gjaldmiðli getur ávöxtun aukist eða minnkað vegna gengissveiflna. Árangur í fortíð gefur ekki áreiðanlega vísbendingu um framtíðarárangur. Nánari upplýsingar um fyrri árangur fjármálagerninga og -vísitalna má finna á vef Landsbankans, þ.m.t. um ávöxtun síðastliðinna 5 ára.

Verðbréfaviðskipti fela í sér áhættu og eru lesendur hvattir til að kynna sér áhættulýsingu vegna viðskipta með fjármálagerninga og stefnu Landsbankans um hagsmunaárekstra á vef Landsbankans.

Landsbankinn er viðskiptabanki sem starfar samkvæmt lögum nr. 161/2002, um fjármálafyrirtæki, og starfar undir leyfi og eftirliti Fjármálaeftirlits Seðlabanka Íslands (www.fme.is).