



БЪЛГАРСКА
НАРОДНА
БАНКА

Пазар на държавни ценни книжа

www.bnb.bg/fiscal services

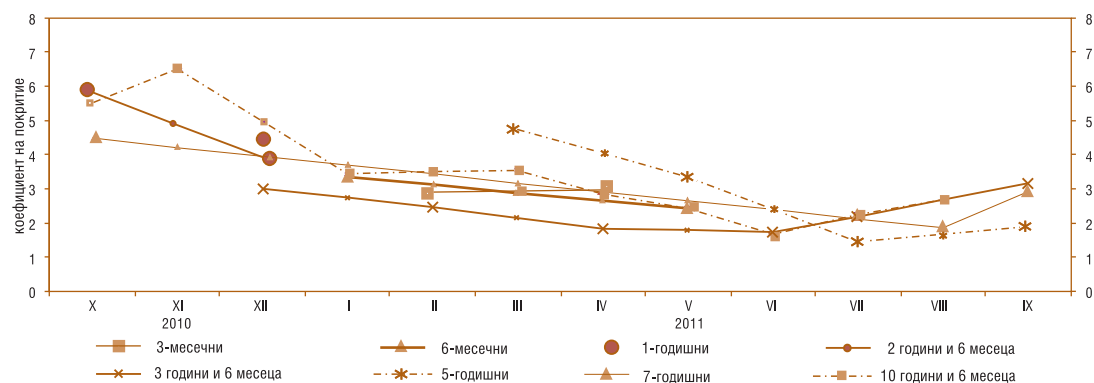
юли – септември 2011 г.

Първичен пазар на ДЦК

Резултати от проведените аукциони за продажба на ДЦК през юли – септември 2011 г.

Емисия №	BG 20 300 11 113	BG 20 301 10 113	BG 20 400 11 210	BG 20 401 10 210	BG 20 301 10 113	BG 20 401 10 210	BG 20 300 11 113
Дата на емисия	30.03.2011	22.12.2010	19.01.2011	17.02.2010	22.12.2010	17.02.2010	30.03.2011
Дата на падеж	30.03.2016	22.06.2014	19.07.2021	17.02.2017	22.06.2014	17.02.2017	30.03.2016
Валута	EUR	BGN	BGN	BGN	BGN	BGN	EUR
Лихвен процент (%)	4.00	3.45	5.00	4.50	3.45	4.50	4.00
Дата на аукциона	04.07.2011	25.07.2011	08.08.2011	15.08.2011	12.09.2011	19.09.2011	26.09.2011
	(III аукцион)	(V аукцион)	(V аукцион)	(V аукцион)	(VI аукцион)	(VI аукцион)	(IV аукцион)
Дата на плащане	06.07.2011	27.07.2011	10.08.2011	17.08.2011	14.09.2011	21.09.2011	28.09.2011
Номинална стойност на предложеното на аукциона количество	50 000 000	30 000 000	50 000 000	40 000 000	35 000 000	55 000 000	35 000 000
Съвкупна номинална стойност на допуснатите до участие в аукциона поръчки	72 800 000	65 750 000	134 800 000	74 585 600	110 260 011	160 050 000	66 850 000
в т. ч. състезателни	66 400 000	62 750 000	103 500 000	59 711 000	103 250 000	125 950 000	54 750 000
несъстезателни	6 400 000	3 000 000	31 300 000	14 874 600	7 010 011	34 100 000	12 100 000
Съвкупна номинална стойност на одобрените поръчки	14 000 000	30 000 000	50 000 000	40 000 000	51 510 011	55 000 000	35 000 000
в т. ч. състезателни	7 600 000	27 000 000	25 000 000	25 125 400	44 500 000	27 500 000	24 500 000
несъстезателни	6 400 000	3 000 000	25 000 000	14 874 600	7 010 011	27 500 000	10 500 000
Цена на одобрените поръчки на 100 единици номинал и съответстваща доходност	цена (евро) ГД (%)	цена (лв.) ГД (%)	цена (лв.) ГД (%)	цена (лв.) ГД (%)	цена (лв.) ГД (%)	цена (лв.) ГД (%)	цена (евро) ГД (%)
- минимална	99.44 4.18	99.76 3.57	97.92 5.34	99.95 4.57	100.39 3.33	100.57 4.44	100.16 4.01
- максимална	99.78 4.10	100.03 3.47	98.23 5.30	100.40 4.47	100.66 3.22	101.00 4.34	101.12 3.77
- среднопретеглена	99.53 4.16	99.86 3.53	98.09 5.31	100.13 4.53	100.50 3.29	100.72 4.40	100.58 3.90

Коефициент на покритие за аукционите за продажба на ДЦК



Коефициентът на покритие се изчислява като съотношение между съвкупната номинална стойност на допуснатите до участие в аукциона поръчки и съвкупната номинална стойност на предложеното от МФ количество ДЦК за аукцион.

Дълг по държавни ценни книжа, емитирани от правителството на вътрешния пазар

(номинална стойност в хил. лв.)

Структура на дълга	Дълг по ДЦК, емитирани за финансиране на бюджетния дефицит		Дълг по ДЦК, емитирани за структурната реформа	Размер на дълга
	общо	в т. ч. облигации с целево предназначение за физически лица		
2001	1 084 703	32 513	776 601	1 861 304
2002	1 476 501	27 641	647 601	2 124 102
2003	1 719 496	43 382	537 204	2 256 700
2004	2 211 159	49 277	469 457	2 680 616
2005	2 375 053	48 109	467 671	2 842 724
2006	2 544 013	20 668	411 796	2 955 809
2007	2 838 275	9 680	361 638	3 199 913
2008	2 735 910	9 015	337 358	3 073 268
2009	2 705 333	667	304 127	3 009 459
2010	3 652 450	0	281 708	3 934 158
септември 2011	3 968 807	0	248 654	4 217 462

Забележка: Левовата равностойност на ДЦК, деноминирани в чуждестранна валута, е изчислена по определените от БНБ обменни курсове, валидни за последния работен ден на съответния период.

Търгуеми държавни ценни книжа в обращение, емитирани от правителството на вътрешния пазар, към 30 септември 2011 г.

Номер на емисията	Вид на валутата	Падеж на емисията	Общ обем на емисията (номинална стойност)	Лихвен процент (%)	Предстоящо лихвено плащане
BG 30 103 11002	BGN	11.11.2011	1 800 000.00	-	-
BG 30 101 10008	BGN	08.12.2011	35 000 000.00	-	-
BG 20 300 07111	BGN	24.01.2012	295 000 000.00	4.00	24.01.2012
BG 20 402 02215	BGN	17.04.2012	83 219 600.00	7.50	17.10.2011
BG 20 300 10115	EUR	03.08.2012	151 525 000.00	2.00	03.02.2012
левава равностойност			296 357 140.75		
BG 20 400 03217	BGN	08.01.2013	49 472 272.00	7.50	08.01.2012
BG 20 300 08119	BGN	20.02.2013	84 800 000.00	4.25	20.02.2012
BG 20 403 03211	BGN	02.07.2013	50 000 000.00	5.75	02.01.2012
BG 20 400 04215	BGN	04.02.2014	80 000 000.00	5.20	04.02.2012
BG 20 300 09117	BGN	18.02.2014	233 000 000.00	4.45	18.02.2012
BG 20 301 10113	BGN	22.06.2014	256 510 011.00	3.45	22.12.2011
BG 20 400 05212	BGN	12.01.2015	150 000 000.00	4.25	12.01.2012
BG 20 400 06210	BGN	04.01.2016	170 000 000.00	3.50	04.01.2012
BG 20 300 11113	EUR	30.03.2016	109 000 000.00	4.00	30.03.2012
левава равностойност			213 185 470.00		
BG 20 400 07218	BGN	10.01.2017	250 000 000.00	4.25	10.01.2012
BG 20 401 10210	BGN	17.02.2017	225 000 000.00	4.50	17.02.2012
BG 20 099 93226	BGN	01.07.2017	763 099.62	ОЛП	01.01.2012
BG 20 400 08216	BGN	16.01.2018	168 500 000.00	4.50	16.01.2012
BG 20 098 93228	BGN	01.10.2018	3 445 007.40	ОЛП	01.10.2011
BG 20 404 03219	EUR	11.10.2018	100 000 000.00	6.00	11.10.2011
левава равностойност			195 583 000.00		
BG 20 096 93222	BGN	01.12.2018	369 635.32	ОЛП	01.12.2011
BG 20 097 94228	USD	01.01.2019	78 276 634.13	LIBOR	01.01.2012
левава равностойност			113 379 007.94		
BG 20 400 99223	EUR	01.01.2019	66 824 698.03	EURIBOR	01.01.2012
левава равностойност			130 697 749.15		
BG 20 400 09214	BGN	28.01.2019	157 500 000.00	4.95	28.01.2012
BG 20 400 10212	BGN	13.07.2020	313 110 000.00	5.00	13.01.2012
BG 20 400 11210	BGN	19.07.2021	202 900 000.00	5.00	19.01.2012
BG 20 402 10218	EUR	29.09.2025	234 105 000.00	5.75	29.03.2012
левава равностойност			457 869 582.15		

Общо в левове

4 217 461 575.33

Забележка: Левовата равностойност на ДЦК, деноминирани във валута, е изчислена по определените от БНБ обменни курсове на чуждестранните валути към българския лев, валидни за 30 септември 2011 г.

Търгуеми държавни ценни книжа, емитирани от правителството на външните пазари, в обращение към 30 септември 2011 г.

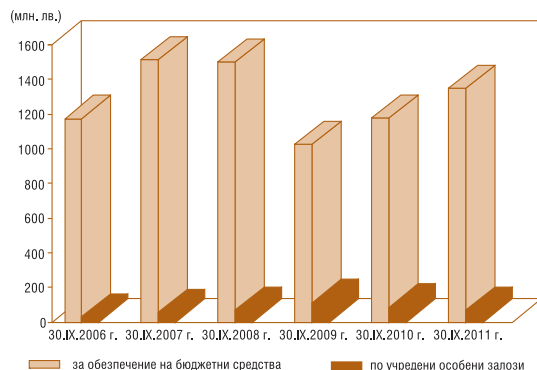
Номер на емисията глобални облигации	Вид на валутата	Падеж на емисията	Общ обем на емисията (номинална стойност)	Лихвен процент (%)	Предстоящо лихвено плащане
XS0145624432	EUR	15.01.2013	818 465 000.00	7.50	15.01.2012
левава равностойност			1 600 778 400.95		
XS0145623624	USD	15.01.2015	1 086 351 000.00	8.25	15.01.2012
левава равностойност			1 573 514 242.44		

Общо в левове

3 174 292 643.39

Забележка: Левовата равностойност на ДЦК е изчислена по определените от БНБ обменни курсове на чуждестранните валути към българския лев, валидни за 30 септември 2011 г.

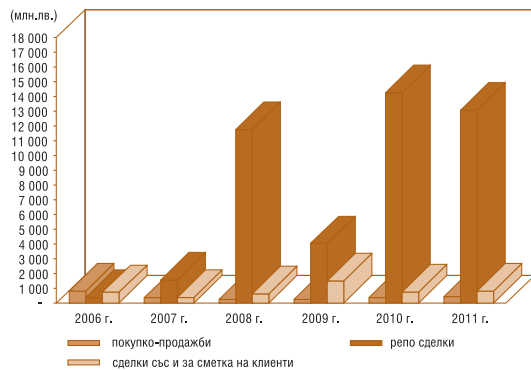
Размер и структура на блокираните ДЦК



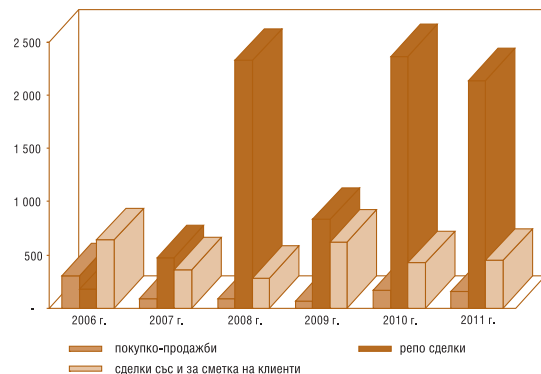
Забележка: Левовата равностойност на ДЦК, деноминирани в чуждестранна валута, е изчислена по определените от БНБ обменни курсове, валидни за последния работен ден на съответния период.

Вторичен пазар на ДЦК

Обем на видовете сделки с търгуеми ДЦК (III тримесечие)



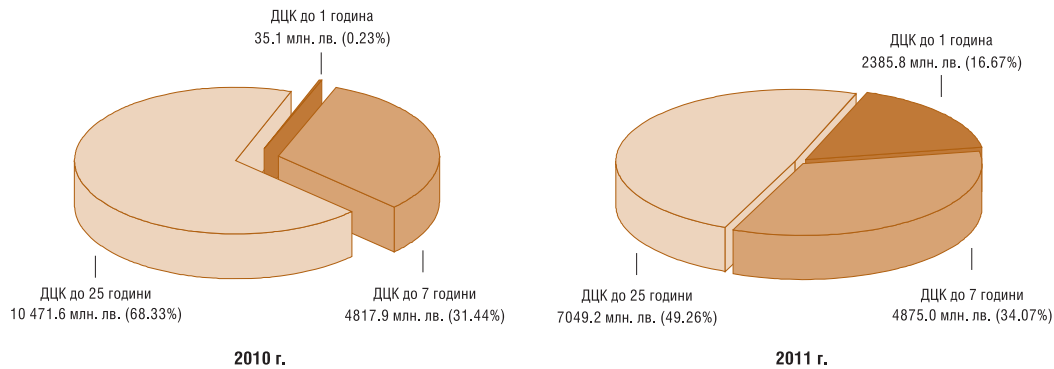
Брой на видовете сделки с търгуеми ДЦК (III тримесечие)



Забележки: 1. Обемът на репо сделките включва обратните репо сделки и тези, сключени през текущия ден.
2. Сделките с ДЦК, деноминирани във валута, са в левова равностойност по определения от БНБ обменен курс на съответната валута в деня на сделката.

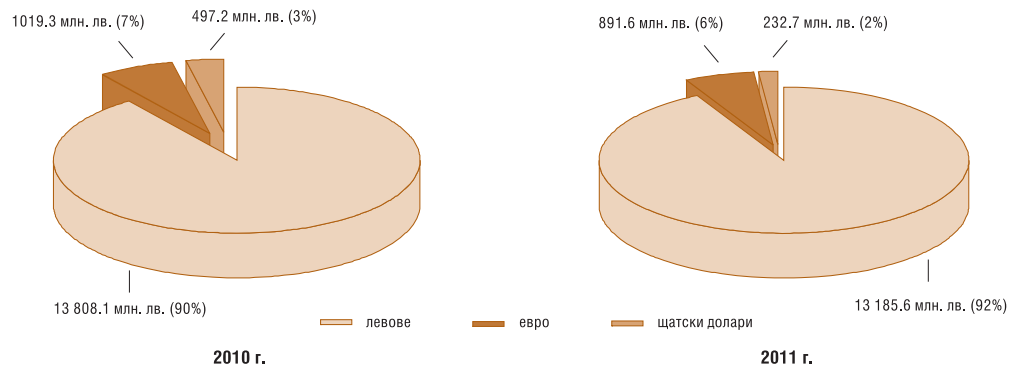
Забележка: Броят на репо сделките включва обратните репо сделки и тези, сключени през текущия ден.

Обем и структура на сделките с търгуеми ДЦК по срокност на емисиите (III тримесечие)



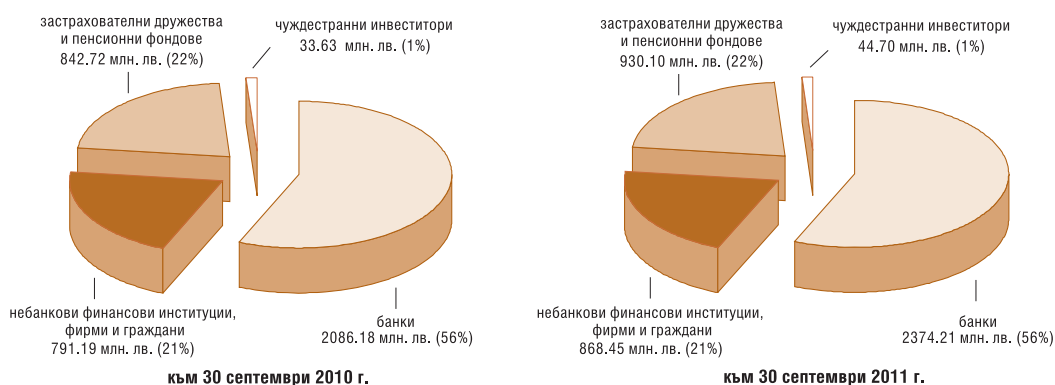
Забележки: 1. Обемът на репо сделките включва обратните репо сделки и тези, сключени през текущия работен ден.
2. Сделките с ДЦК, деноминирани във валута, са в левова равностойност по определения от БНБ обменен курс на съответната валута в деня на сделката.

Обем и структура на сделките с търгуеми ДЦК по валута на емисиите (III тримесечие)



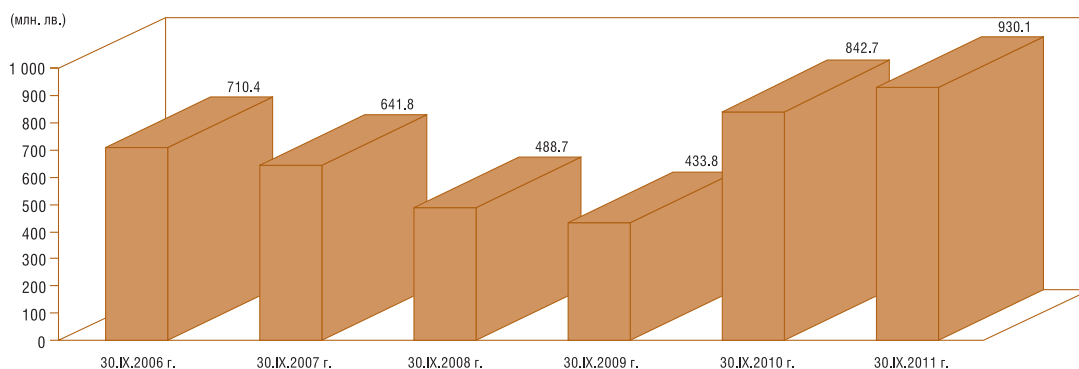
Забележка: Левовата равностойност на сделките с ДЦК, деноминирани във валута, е изчислена по определения от БНБ обменен курс на съответната валута в деня на сделката.

Държатели на ДЦК



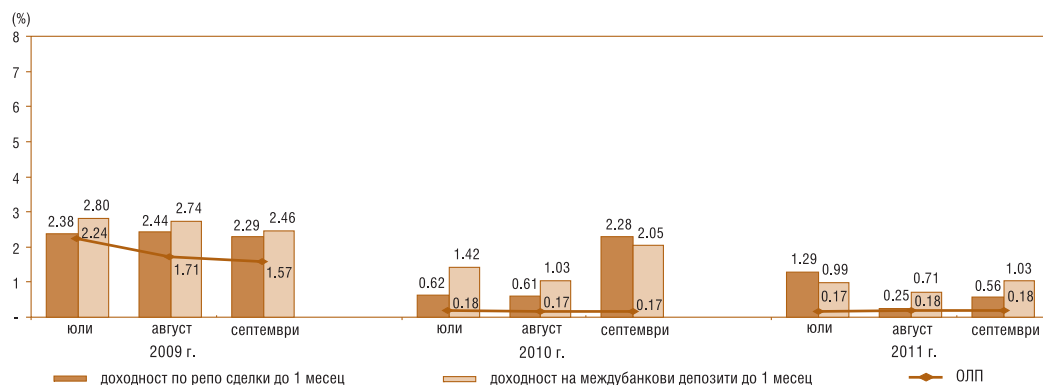
Забележки: 1. Левовата равностойност на ДЦК, деноминирани във валута, е изчислена по определения от БНБ обменен курс, валиден за последния работен ден на съответния период.
2. По данни на БНБ и на участниците в ЕСРОТ.

ДЦК в портфейла на застрахователни дружества и пенсионни фондове



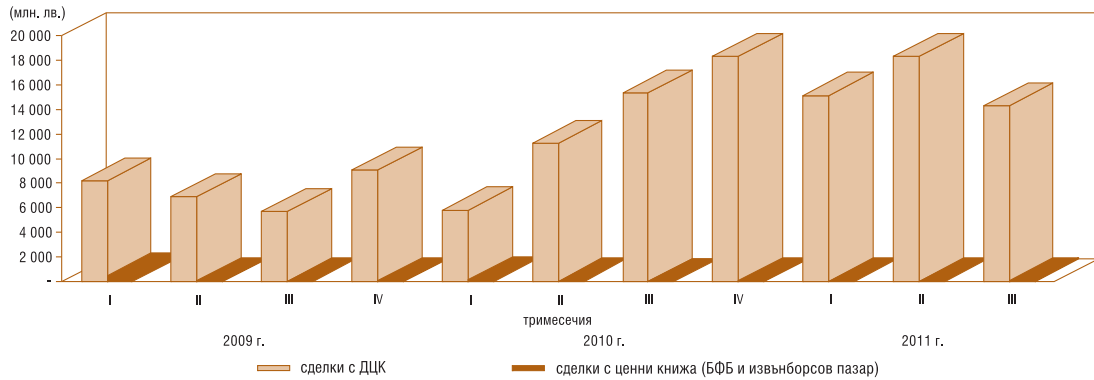
Забележка: Левовата равностойност на ДЦК, деноминирани във валута, е изчислена по определения от БНБ обменен курс, валиден за последния работен ден на съответния период.

Доходност по репо сделки с ДЦК и лихвен процент по междубанковите депозити (III тримесечие)



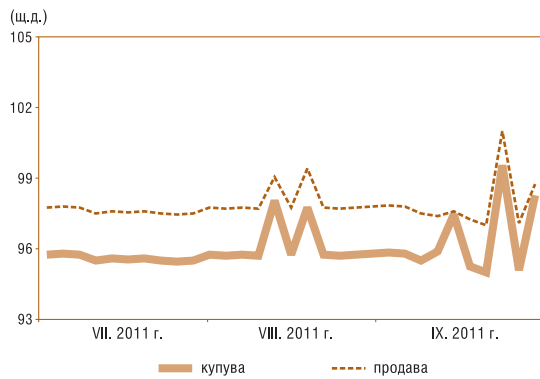
Вторичен пазар на ДЦК

Обем на сключените сделки с ДЦК на вторичния пазар и сделки с ценни книжа на Българската фондова борса и извънборсовия пазар



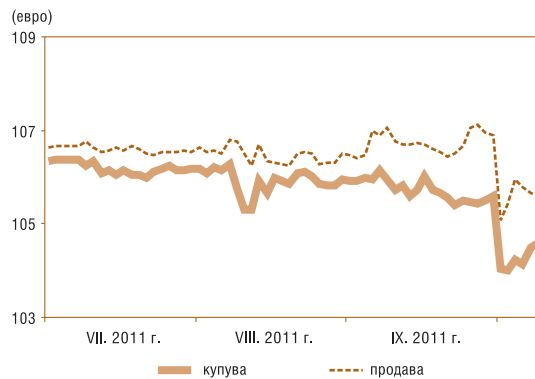
- Забележки:**
- Обемът на сделките с ДЦК включва покупко-продажбите, репо сделките (в т.ч. обратните репо сделки и тези, сключени през текущия ден) и сделките със и за сметка на клиенти.
 - Сделките с ДЦК, деноминирани във валута, са в левова равностойност по определения от БНБ обменен курс на съответната валута в деня на сделката.
 - Информацията за обема на сделките на БФБ и извънборсовия пазар е по пазарна стойност и е предоставена от управление „Банково“ на БНБ.

Котировки „купува“ и „продава“ на деноминирани в щатски долари ДЦК, емитирани по ЗУНК



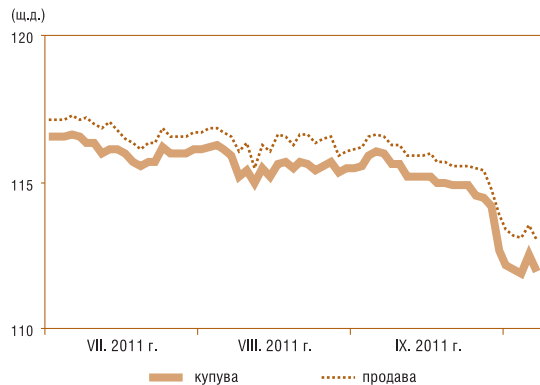
Източник: Ройтерс.

Котировки „купува“ и „продава“ на българските глобални облигации в евро



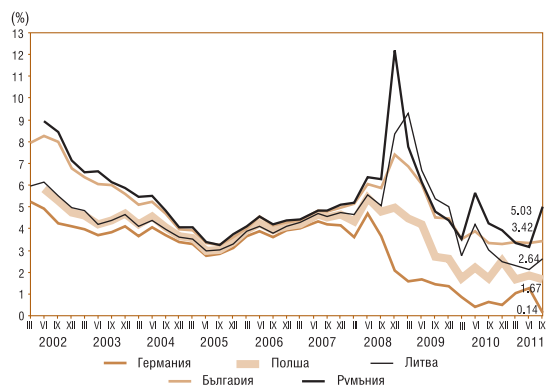
Източник: Ройтерс.

Котировки „купува“ и „продава“ на българските глобални облигации в щатски долари



Източник: Ройтерс.

Доходност по 10-годишни еврооблигации



Източник: Ройтерс.

СПИСЪК

на участниците в Електронната система за регистриране и обслужване на търговията с ДЦК (ЕСРОТ)

Код на участника	Наименование	SWIFT адрес	Първичен дилър* – участник в АДЦК	Поддепозитар
Банки				
0120	„ИНВЕСТБАНК“ АД	IORTBGSF	НЕ	ДА
0130	„ОБЩИНСКА БАНКА“ АД	SOMBBGSF	ДА	ДА
0145	„ИНГ БАНК Н.В.“ – КЛОН СОФИЯ	INGBBGSF	НЕ	ДА
0150	„ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА“ АД	FINVBGSF	ДА	ДА
0155	„РАЙФАЙЗЕНБАНК (БЪЛГАРИЯ)“ ЕАД	RZBBBGSF	ДА	ДА
0170	„БАНКА ПИРЕОС БЪЛГАРИЯ“ АД	PIRBBSGF	НЕ	ДА
0195	„МКБ ЮНИОНБАНК“ АД	CBUNBGSF	НЕ	ДА
0200	„ОБЕДИНЕНА БЪЛГАРСКА БАНКА“ АД	UBBSBGSF	ДА	ДА
0220	„КОРПОРАТИВНА ТЪРГОВСКА БАНКА“ АД	KORPBGSF	ДА	ДА
0240	„ТЪРГОВСКА БАНКА Д“ АД	DEMIBGSF	НЕ	ДА
0250	„СИТИБАНК Н.А.“ – КЛОН СОФИЯ	CITIBGSF	НЕ	ДА
0260	„ТОКУДА БАНК“ АД	CREXBGSF	НЕ	ДА
0300	„БАНКА ДСК“ ЕАД	STABGSF	ДА	ДА
0400	„СОСИЕТЕ ЖЕНЕРАЛ ЕКСПРЕСБАНК“ АД	TTBBBG22	ДА	ДА
0440	„БНП ПАРИБА С.А.“ – КЛОН СОФИЯ	BNPABGSX	НЕ	ДА
0470	„ИНТЕРНЕТЪНЪЛ АСЕТ БАНК“ АД	IABGBGSF	НЕ	ДА
0480	„ЕМПОРИКИ БАНК“ – БЪЛГАРИЯ ЕАД	BINVBGSF	НЕ	ДА
0545	ЧПБ „ТЕКСИМ“ АД	TEXIBGSF	НЕ	ДА
0561	„АЛИАНЦ БАНК БЪЛГАРИЯ“ АД	BUNBGSF	ДА	ДА
0620	„БЪЛГАРСКА БАНКА ЗА РАЗВИТИЕ“ АД	NASBBGSF	НЕ	ДА
0790	„ЦЕНТРАЛНА КООПЕРАТИВНА БАНКА“ АД	CECBBGSF	ДА	ДА
0800	„УНИКРЕДИТ БУЛБАНК“ АД	UNCRBGSF	ДА	ДА
0888	„СИБАНК“ АД	BUIBBGSF	ДА	ДА
0898	„АЛФА БАНК“ АД – КЛОН БЪЛГАРИЯ	CRBABGSF	НЕ	ДА
0920	„ЮРОБАНК И ЕФ ДЖИ БЪЛГАРИЯ“ АД	BPBIBGSF	ДА	ДА
Инвестиционни посредници – институции, различни от банки				
9702	„ЕЛАНА ТРЕЙДИНГ“ АД	-	НЕ	НЕ
9705	„БУЛБРОКЪРС“ АД	-	НЕ	НЕ
9881	„ЕВРО-ФИНАНС“ АД	EUFCBGSF	НЕ	НЕ
Други				
1482	МИНИСТЕРСТВО НА ФИНАНСИТЕ	-	НЕ	НЕ
6666	РЕЗЕРВЕН БЕЗПЕЧИТЕЛЕН ФОНД	-	НЕ	НЕ

* За периода 1 януари – 31 декември 2011 г.

Тримесечен бюлетин на управление „Фискални услуги“

© Българска народна банка, 2011
1000 София, пл. „Княз Александър I“ № 1
Телефон: 02/9145 1301. Факс: 02/980 2425, 980 6493
Предпечатна подготовка: „Печатни издания на БНБ“
Печат и книговежко изпълнение: Полиграфична база на БНБ

Материалите са получени за редакционна обработка на 14 октомври 2011 г.
Информацията в бюлетина може да се ползва единствено с изричното позоваване на източника.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ БОНОВЕ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията	Дата на емисията (плащането)	Падеж на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)		Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)			Средна доходност до падежа (%)	Средна годишна доходност (%)		ОПТ към датата на емисията (плащането) (%)				
				на предложеното от МО количество	на допуснатите до участие в аукциона поръчки			на одобрените поръчки	Средна цена на допуснатите до участие в аукциона поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки		Средна цена на одобрените поръчки	на допуснатите до участие в аукциона поръчки		на одобрените поръчки	на допуснатите до участие в аукциона поръчки	на одобрените поръчки	
BG 30 103 11002	11.05.2011	11.11.2011	184	25 000 000.00	60 550 000.00	1 787 380.00	12 620.00	99.21	99.29	99.31	99.30	0.80	0.70	1.56	1.38	1.38	0.21	
Общо шестмесечни емисии				25 000 000.00	60 550 000.00	1 787 380.00	12 620.00											
BG 30 101 10008	08.12.2010	08.12.2011	365	35 000 000.00	155 950 000.00	34 185 027.50	814 972.50	97.49	97.55	97.81	97.67	2.57	2.39	2.54	2.35	2.54	2.35	0.18
Общо 1-годишни емисии				35 000 000.00	155 950 000.00	34 185 027.50	814 972.50											
Общо краткосрочни ДЦК				60 000 000.00	216 500 000.00	35 972 407.50	827 592.50											

Забележка: Доходността на съкровищните бонове се изчислява съгласно прилаганата от МО методика и възприета от 1.1.2001 г. лихвена конвенция (ACT/360).

(продължава)

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Пареч на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)		Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Надбавка над номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)				Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането)			
				на предложението от МФ	количество				на допуснатите участии в аукциона	поръчки	на одобрените поръчки	на допуснатите участии в аукциона		поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки		Средна цена на одобрените поръчки	на допуснатите участии в аукциона	поръчки
BG 20 301 10113/22.12.2010*	22.06.2014	1 278	240 000 000.00	553 310 011.00	256 510 011.00	0.00	207 228.00	98.81	99.90	99.84	99.31	3.45	3.85	3.69	0.18				
I отваряне	22.12.2010	22.06.2014	30 000 000.00	90 350 000.00	30 000 000.00	0.00	187 980.00	99.14	99.22	99.94	99.53	3.45	3.76	3.63	0.19				
II отваряне	23.02.2011	22.06.2014	40 000 000.00	98 450 000.00	40 000 000.00	0.00	54 865.01	99.57	99.61	100.18	99.90	3.45	3.62	3.51	0.19				
III отваряне	06.04.2011	22.06.2014	55 000 000.00	100 800 000.00	55 000 000.00	0.00	87 115.00	99.67	99.66	100.02	99.83	3.45	3.59	3.54	0.22				
IV отваряне	08.06.2011	22.06.2014	50 000 000.00	87 700 000.00	50 000 000.00	0.00	41 850.00	99.66	99.76	100.03	99.86	3.45	3.60	3.53	0.17				
V отваряне	27.07.2011	22.06.2014	30 000 000.00	65 750 000.00	30 000 000.00	0.00	257 775.06	100.30	100.39	100.66	100.50	3.45	3.36	3.29	0.18				
VI отваряне	14.09.2011	22.06.2014	35 000 000.00	110 260 011.00	51 510 011.00	0.00	579 038.01	98.81	99.02	99.84	99.31	3.45	3.85	3.69	0.18				
общо 3-годишни и 6-месечна			240 000 000.00	553 310 011.00	256 510 011.00	0.00	579 038.01	98.81	99.02	99.84	99.31	3.45	3.85	3.69	0.18				
BG 20 300 07111/24.01.2007*	24.01.2012	1 826	295 000 000.00	715 027 198.00	295 000 000.00	0.00	274 255.00	98.81	99.02	100.00	99.22	4.00	4.31	4.22	3.43				
I отваряне	24.01.2007	24.01.2012	35 000 000.00	101 600 000.00	35 000 000.00	0.00	86 690.00	99.25	99.60	99.99	99.71	4.00	4.21	4.11	3.52				
II отваряне	07.03.2007	24.01.2012	30 000 000.00	94 000 000.00	30 000 000.00	0.00	325 000.00	97.98	98.15	99.30	98.29	4.00	4.53	4.46	3.81				
III отваряне	23.05.2007	24.01.2012	25 000 000.00	88 950 000.00	25 000 000.00	0.00	857 654.99	96.44	97.19	98.00	97.55	4.00	4.95	4.66	4.01				
IV отваряне	25.07.2007	24.01.2012	35 000 000.00	92 402 198.00	35 000 000.00	0.00	510 395.00	97.51	97.82	98.25	97.96	4.00	4.69	4.57	4.09				
V отваряне	26.09.2007	24.01.2012	25 000 000.00	72 650 000.00	25 000 000.00	0.00	909 890.00	96.37	96.00	98.49	96.97	4.00	5.04	4.87	4.26				
VI отваряне	28.11.2007	24.01.2012	30 000 000.00	43 350 000.00	30 000 000.00	0.00	1 435 230.00	95.72	95.08	97.00	95.90	4.00	5.82	5.74	2.27				
VII отваряне	13.05.2009	24.01.2012	35 000 000.00	38 475 000.00	35 000 000.00	0.00	1 481 525.00	94.22	93.80	96.51	95.06	4.00	6.62	6.23	2.24				
VIII отваряне	15.07.2009	24.01.2012	30 000 000.00	43 300 000.00	30 000 000.00	0.00	50 640.00	99.34	99.62	100.00	99.75	4.00	4.37	4.17	0.61				
IX отваряне	25.11.2009	24.01.2012	20 000 000.00	49 750 000.00	20 000 000.00	0.00	34 890.84	99.41	99.65	100.08	99.89	4.00	4.34	4.10	0.55				
X отваряне	09.12.2009	24.01.2012	30 000 000.00	90 550 000.00	30 000 000.00	0.00	573 150.00	97.00	97.16	99.75	98.09	4.250	5.00	4.74	4.75				
BG 20 300 08119/20.02.2008*	20.02.2008	20.02.2013	95 000 000.00	256 279 000.00	84 800 000.00	0.00	1 792 064.50	92.56	93.99	97.35	94.88	4.250	6.21	5.59	4.96				
I отваряне	20.02.2008	20.02.2013	30 000 000.00	84 775 000.00	30 000 000.00	0.00	1 836 280.00	85.53	89.76	93.02	90.73	4.250	8.49	6.88	5.38				
II отваряне	18.06.2008	20.02.2013	35 000 000.00	91 229 000.00	35 000 000.00	0.00													
III отваряне	22.10.2008	20.02.2013	30 000 000.00	80 275 000.00	19 800 000.00	0.00													

* Емисия от отворен тип.

Забележка: Доходността на съкровищните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възрапетата от 1.1.2001 г. лхвена конвенция (ACT/ACT), като за ДЦК, емитирани до 22.XI.2004 г., се използва вградената в MICROSOFТ EXCEL функция за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.XI.2004 г., се използва формулата BMA – International Yield.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Париж на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)			Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Надбавка над номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)			Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането) (%)	
				на предложеното от МФ количество	на допуснатите участии в аукциона поръчки	на одобрените поръчки				Средна цена на допуснатите участии в аукциона поръчки	Минимална цена на одобрените поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки		Средна цена на одобрените поръчки	на допуснатите участии в аукциона поръчки		на одобрените поръчки
Вс 20 300 09117/18.02.2009*				250 000 000.00	490 875 000.00	233 000 000.00						4.450					
I отваряне	18.02.2009	18.02.2014	1 826	30 000 000.00	78 975 000.00	30 000 000.00	27 707 440.00	2 292 560.00	0.00	91.15	91.41	93.50	92.36	6.66	6.35	3.92	
II отваряне	24.06.2009	18.02.2014		30 000 000.00	18 875 000.00	13 000 000.00	12 019 895.00	1 180 305.00	0.00	89.66	90.02	92.03	90.92	7.22	6.87	2.35	
III отваряне	30.10.2009	18.02.2014		30 000 000.00	81 900 000.00	30 000 000.00	29 592 150.01	674 849.99	0.00	96.82	97.20	98.96	97.75	5.35	5.10	1.46	
IV отваряне	16.12.2009	18.02.2014		30 000 000.00	54 050 000.00	30 000 000.00	29 993 910.00	444 090.00	0.00	97.88	98.06	99.40	98.52	5.08	4.90	0.55	
V отваряне	27.01.2010	18.02.2014		35 000 000.00	70 700 000.00	35 000 000.00	35 420 090.00	272 910.00	0.00	98.61	98.94	99.92	99.22	4.89	4.72	0.39	
VI отваряне	17.03.2010	18.02.2014		35 000 000.00	78 375 000.00	35 000 000.00	35 637 635.00	0.00	522 135.00	101.01	102.35	101.49	4.21	4.07	0.18		
VII отваряне	26.03.2010	18.02.2014		30 000 000.00	57 850 000.00	30 000 000.00	30 445 900.30	0.00	313 900.30	100.74	101.50	101.05	4.29	4.20	0.18		
VIII отваряне	12.05.2010	18.02.2014		30 000 000.00	50 150 000.00	30 000 000.00	29 921 870.00	418 230.00	37 100.00	97.83	100.88	98.73	5.15	4.88	0.18		
Общо 5-годишни				640 000 000.00	1 462 181 198.00	612 800 000.00	603 663 405.83	15 450 610.32	875 636.14								
Общо средносрочни ДЦК				880 000 000.00	2 015 491 209.00	869 310 011.00	861 937 582.96	16 029 648.33	1 133 411.20								
Вс 20 401 10210/17.02.2010*				225 000 000.00	581 362 848.00	225 000 000.00						4.500					
I отваряне	15.02.2010	17.02.2017	2 557	35 000 000.00	118 600 000.00	35 000 000.00	33 474 850.02	1 525 149.98	0.00	94.53	95.40	96.17	95.64	5.53	5.33	0.24	
II отваряне	21.04.2010	17.02.2017		30 000 000.00	47 047 248.00	30 000 000.00	28 422 550.00	1 811 450.00	0.00	93.43	93.21	95.21	93.96	5.77	5.66	0.17	
III отваряне	05.05.2010	17.02.2017		35 000 000.00	46 950 000.00	35 000 000.00	32 456 962.50	2 875 537.50	0.00	91.46	91.16	93.75	91.78	6.16	6.09	0.18	
IV отваряне	27.10.2010	17.02.2017		30 000 000.00	134 130 000.00	30 000 000.00	28 993 968.00	1 270 032.00	0.00	91.95	95.33	96.21	95.77	6.16	5.38	0.17	
V отваряне	17.08.2011	17.02.2017		40 000 000.00	74 585 600.00	40 000 000.00	40 052 637.48	11.44	52 648.92	99.84	100.40	100.13	4.59	4.53	0.18		
VI отваряне	21.09.2011	17.02.2017		55 000 000.00	160 050 000.00	55 000 000.00	55 631 149.97	0.00	394 650.00	100.35	101.00	100.72	4.48	4.40	0.18		
Общо 7-годишни				225 000 000.00	581 362 848.00	225 000 000.00	219 032 117.97	7 482 180.92	447 298.92								
Вс 20 402 02215/17.04.2002***				90 000 000.00	202 867 400.00	84 920 000.00						7.50					
I отваряне	17.04.2002	17.04.2012	3 653	15 000 000.00	72 080 000.00	15 000 000.00	14 720 665.01	279 334.99	0.00	95.24	96.54	101.40	98.14	8.21	7.77	4.08	
II отваряне	24.04.2002	17.04.2012		25 000 000.00	59 589 600.00	25 000 000.00	24 227 272.51	807 727.49	0.00	95.47	95.94	97.91	96.77	8.17	7.97	4.08	
III отваряне	19.06.2002	17.04.2012		25 000 000.00	42 338 500.00	25 000 000.00	24 302 575.01	1 019 925.00	0.00	94.84	95.33	97.29	95.92	8.27	8.10	3.71	
IV отваряне	24.07.2002	17.04.2012		25 000 000.00	28 859 300.00	19 920 000.00	19 077 708.99	1 242 683.00	0.00	93.10	92.81	98.16	93.76	8.54	8.44	3.67	

* Емисия от отворен тип.

** Част от тази емисия е изкупена обратно преди падежа, което е отразено в таблица Държавни ценни книжа, обратно изкупени преди падежа им чрез аукционни.

Забележка: Доходността на съкровищните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възприетата от 1.1.2007 г. лихвена конвенция (ACT/ACT), като за ДЦК, емитирани до 22.XI.2004 г., се използва вградената в MISOSOFТ БЖСЕ функция за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.XI.2004 г., се използва формулата ISMA – International Yield.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Париж на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)			Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Надбавка над номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)				Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането) (%)
				на предложеното от МФ количество	на допуснатите до участия в аукциона поръчки	на одобрените поръчки				Средна цена на допуснатите до участия в аукциона поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки	Минимална цена на одобрените поръчки	Средна цена на одобрените поръчки		на допуснатите до участия в аукциона поръчки	на одобрените поръчки	
BG 20 400 03217/08.01.2003***	08.01.2003	08.01.2013	3653	50 000 000.00	150 644 800.00	50 000 000.00	31 224 784.99	0.00	1 224 784.99	102.73	103.67	105.17	104.08	7.50	7.11	6.93	3.31
I отваряне	08.01.2003	08.01.2013		30 000 000.00	94 289 800.00	30 000 000.00	21 382 630.03	0.00	1 036 630.01	104.05	104.76	106.02	105.18	7.50	6.93	6.78	2.56
II отваряне	02.04.2003	08.01.2013		20 000 000.00	56 355 000.00	20 000 000.00											
BG 20 403 03211/02.07.2003*	02.07.2003	02.07.2013	3653	50 000 000.00	148 103 000.00	50 000 000.00	19 763 860.01	236 139.99	0.00	97.29	98.20	100.75	98.82	5.75	6.12	5.91	2.52
I отваряне	02.07.2003	02.07.2013		20 000 000.00	69 350 000.00	20 000 000.00	29 743 095.01	685 905.01	0.00	97.06	97.30	98.99	97.71	5.75	6.15	6.06	2.59
II отваряне	01.10.2003	02.07.2013		30 000 000.00	78 753 000.00	30 000 000.00											
III отваряне	04.02.2014	04.02.2014	3653	80 000 000.00	332 118 000.00	80 000 000.00											
I отваряне	04.02.2004	04.02.2014		20 000 000.00	85 300 000.00	20 000 000.00	19 570 500.01	429 499.99	0.00	96.65	97.57	100.48	97.85	5.20	5.64	5.48	2.51
II отваряне	14.04.2004	04.02.2014		20 000 000.00	82 680 000.00	20 000 000.00	20 037 891.47	160 108.50	0.00	98.28	98.93	99.61	99.20	5.20	5.43	5.30	2.55
III отваряне	06.10.2004	04.02.2014		20 000 000.00	86 010 000.00	20 000 000.00	20 129 630.03	50 369.98	0.00	98.66	99.55	100.40	99.75	5.20	5.37	5.23	2.39
IV отваряне	17.11.2004	04.02.2014		20 000 000.00	78 128 000.00	20 000 000.00	20 591 255.01	0.00	293 255.01	100.30	100.79	102.40	101.47	5.20	5.16	5.01	2.44
BG 20 400 05212/12.01.2005*	12.01.2005	12.01.2015	3652	150 000 000.00	637 757 000.00	150 000 000.00	25 170 640.00	0.00	170 640.00	98.72	100.16	102.35	100.68	4.25	4.46	4.21	2.37
I отваряне	12.01.2005	12.01.2015		25 000 000.00	130 600 000.00	25 000 000.00	25 434 249.97	0.00	271 749.96	100.18	100.80	104.27	101.09	4.25	4.27	4.16	1.91
II отваряне	09.03.2005	12.01.2015		25 000 000.00	102 150 000.00	25 000 000.00	15 817 572.50	0.00	561 072.50	102.25	103.42	104.96	103.74	4.25	4.00	3.82	2.06
III отваряне	08.06.2005	12.01.2015		15 000 000.00	86 325 000.00	15 000 000.00	37 464 134.98	0.00	1 750 135.00	103.88	104.71	106.60	105.00	4.25	3.80	3.66	2.04
IV отваряне	06.07.2005	12.01.2015		35 000 000.00	158 625 000.00	35 000 000.00	26 806 635.01	0.00	1 599 135.00	105.59	105.99	107.39	106.40	4.25	3.57	3.47	2.04
V отваряне	21.09.2005	12.01.2015		25 000 000.00	79 707 000.00	25 000 000.00	26 797 595.03	0.00	1 550 095.02	105.60	105.94	107.25	106.20	4.25	3.57	3.49	2.04
VI отваряне	05.10.2005	12.01.2015		25 000 000.00	80 350 000.00	25 000 000.00											
BG 20 400 06210/04.01.2006*	04.01.2006	04.01.2016	3652	170 000 000.00	456 930 000.00	170 000 000.00	49 132 245.03	877 254.97	9 500.00	97.58	97.65	101.75	98.26	3.50	3.83	3.74	2.21
I отваряне	04.01.2006	04.01.2016		50 000 000.00	96 350 000.00	50 000 000.00	29 423 549.00	717 451.00	0.00	96.63	97.23	98.75	97.61	3.50	3.95	3.83	2.25
II отваряне	22.02.2006	04.01.2016		30 000 000.00	107 905 000.00	30 000 000.00	46 546 793.00	3 988 207.00	0.00	90.64	91.25	96.81	92.02	3.50	4.77	4.58	2.48
III отваряне	26.04.2006	04.01.2016		50 000 000.00	97 410 000.00	50 000 000.00	18 242 870.50	1 799 129.50	0.00	88.06	90.15	92.59	91.00	3.50	5.17	4.74	2.69
IV отваряне	26.07.2006	04.01.2016		20 000 000.00	67 765 000.00	20 000 000.00	19 396 745.02	927 254.99	0.00	94.37	95.18	96.39	95.36	3.50	4.30	4.16	3.26
V отваряне	20.12.2006	04.01.2016		20 000 000.00	87 500 000.00	20 000 000.00											

* Емисия от отворен тип.

** Част от тази емисия е изкупува обратно преди падежа, което е отразено в таблица „Държавни ценни книжа, обратно изкупени преди падежа им чрез аукцион“.

Забележка: Доходността на скриваните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възприетата от 1.1.2001 г. лихвена конвенция (ACT/ACT), като за ДЦК, емитирани до 22.XI.2004 г., се използва вградената в MICROSOFT EXCEL функция за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.XI.2004 г., се използва формулата SMA – International Yield.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Период на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)		Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Надбавка над номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)				Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането) (%)	
				на предложено от МФ количество	на допуснатите участители в аукциона поръчки				на одобрените поръчки	Средна цена на допуснатите участители в аукциона поръчки	Минимална цена на одобрените поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки		Средна цена на одобрените поръчки	на допуснатите участители в аукциона поръчки		на одобрените поръчки
BG 20 400 07218/10.01.2007*																	
I отваряне	10.01.2007	10.01.2017	3653	250 000 000.00	716 040 000.00	34 977 369.00	57 980.73	35 349.73	99.11	99.52	104.00	99.94	4.25	4.42	4.31	3.43	
II отваряне	21.02.2007	10.01.2017		35 000 000.00	133 640 000.00	30 063 500.00	83 500.00	0.00	99.05	99.44	100.06	99.72	4.25	4.42	4.34	3.53	
III отваряне	14.03.2007	10.01.2017		30 000 000.00	120 700 000.00	30 273 680.00	150.00	54 830.00	99.62	99.96	100.80	100.18	4.25	4.35	4.28	3.52	
IV отваряне	09.05.2007	10.01.2017		25 000 000.00	98 700 000.00	25 109 505.00	237 995.00	0.00	98.33	98.51	99.76	99.05	4.25	4.52	4.43	3.81	
V отваряне	11.07.2007	10.01.2017		35 000 000.00	87 600 000.00	33 585 695.00	1 417 805.00	0.00	95.25	95.40	98.00	99.95	4.25	4.95	4.85	4.01	
VI отваряне	19.09.2007	10.01.2017		35 000 000.00	69 050 000.00	34 685 055.00	605 445.00	0.00	96.82	97.16	99.60	98.27	4.25	4.74	4.54	4.09	
VII отваряне	14.11.2007	10.01.2017		30 000 000.00	53 700 000.00	29 309 980.00	1 134 020.00	0.00	94.65	94.05	99.00	96.22	4.25	5.06	4.83	4.26	
VIII отваряне	05.12.2007	10.01.2017		30 000 000.00	59 050 000.00	28 487 780.00	2 028 220.00	0.00	91.69	92.51	95.01	93.24	4.25	5.50	5.27	4.58	
BG 20 400 08216/16.01.2008*																	
I отваряне	16.01.2008	16.01.2018	3653	200 000 000.00	506 285 000.00	28 587 510.00	1 412 490.00	0.00	93.21	93.85	98.01	95.29	4.50	5.46	5.17	4.68	
II отваряне	12.03.2008	16.01.2018		35 000 000.00	70 000 000.00	34 614 933.50	626 566.50	0.00	96.11	97.00	100.20	98.21	4.50	5.07	4.78	4.83	
III отваряне	21.05.2008	16.01.2018		40 000 000.00	88 775 000.00	38 764 150.00	1 855 850.00	0.00	92.64	94.35	96.65	95.36	4.50	5.57	5.18	4.93	
IV отваряне	01.10.2008	16.01.2018		30 000 000.00	96 600 000.00	27 045 295.00	3 239 705.00	0.00	83.09	88.11	91.51	89.20	4.50	7.13	6.12	5.38	
V отваряне	12.11.2008	16.01.2018		35 000 000.00	85 575 000.00	2 951 915.00	599 185.00	0.00	72.94	81.51	83.57	82.88	4.50	9.07	7.19	5.72	
VI отваряне	10.12.2008	16.01.2018		30 000 000.00	68 200 000.00	25 145 330.00	5 397 670.00	0.00	77.33	81.41	83.49	82.01	4.50	8.22	7.36	5.77	
BG 20 400 09214/28.01.2009*																	
I отваряне	28.01.2009	28.01.2019	3652	195 000 000.00	374 975 000.00	25 458 095.00	4 541 905.00	0.00	83.31	83.92	86.87	84.86	4.95	7.47	7.21	5.17	
II отваряне	08.04.2009	28.01.2019		35 000 000.00	71 800 000.00	30 330 160.00	5 002 340.00	0.00	83.47	83.60	88.17	85.71	4.95	7.48	7.11	3.53	
III отваряне	27.05.2009	28.01.2019		35 000 000.00	59 050 000.00	21 303 060.00	4 074 037.50	0.00	82.35	80.66	86.51	83.69	4.95	7.70	7.47	2.27	
IV отваряне	29.07.2009	28.01.2019		35 000 000.00	24 250 000.00	6 086 170.00	1 439 582.50	0.00	77.76	80.33	81.42	80.87	4.95	8.57	7.99	2.24	
V отваряне	30.09.2009	28.01.2019		30 000 000.00	98 550 000.00	25 830 589.99	4 430 410.01	0.00	84.13	84.78	85.81	85.23	4.95	7.46	7.27	1.57	
VI отваряне	02.10.2009	28.01.2019		30 000 000.00	85 850 000.00	25 884 690.01	4 383 310.00	0.00	84.63	85.21	85.64	85.38	4.95	7.38	7.25	1.46	
Общо 10-годишни				1 235 000 000.00	3 525 720 200.00	1 123 499 360.62	55 791 158.65	8 557 177.22									

* Емисия от отворен тип.

Забележка: Доходността на съкровищните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възприета от 1.1.2001 г. лихвеня конвенция (ACT/ACT), като за ДЦК, емитирани до 22.12.2004 г., се използва въведената в MICROSOFT EXCEL функция за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.12.2004 г., се използва формулата ISMA – International Yield.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Период на емисията	Брой дни	Номинална стойност (лв.)		Фактически преведена сума (лв.)	Отстъпка от номинала (лв.)	Надбавка над номинала (лв.)	Цена на 100 лв. номинал (лв.)				Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането)	
				на предложено участие от МФ	Количество				на допуснатите до участие в аукциона поръчки	на одобрените поръчки	Средна цена на допуснатите до участие в аукциона поръчки	Минимална цена на одобрените поръчки		Максимална цена на одобрените поръчки	Средна цена на одобрените поръчки		на допуснатите до участие в аукциона поръчки
BG20 400 10 212/13.01.2010*																	
I отваряне	13.01.2010	13.07.2020	3 834	295 000 000.00	856 940 000.00	313 110 000.00	2 888 454.99	0.00	87.90	88.85	95.29	90.37	5.00	6.74	6.37	0.39	
II отваряне	24.02.2010	13.07.2020		30 000 000.00	87 200 000.00	30 000 000.00	1 682 430.01	0.00	93.31	93.97	95.16	94.39	5.00	5.97	5.82	0.24	
III отваряне	02.03.2010	13.07.2020		30 000 000.00	97 850 000.00	30 000 000.00	1 700 820.00	0.00	93.45	93.95	95.17	94.33	5.00	5.95	5.83	0.18	
IV отваряне	31.03.2010	13.07.2020		30 000 000.00	61 000 000.00	30 000 000.00	2 196 575.00	0.00	92.05	92.40	93.90	92.68	5.00	6.15	6.06	0.18	
V отваряне	28.04.2010	13.07.2020		30 000 000.00	65 900 000.00	30 000 000.00	2 837 925.00	0.00	89.20	89.60	92.19	90.54	5.00	6.58	6.38	0.17	
VI отваряне**	27.05.2010	13.07.2020		30 000 000.00	95 500 000.00	0.00	-	-	86.28	-	-	-	5.00	7.04	-	0.18	
VII отваряне	30.06.2010	13.07.2020		45 000 000.00	91 100 000.00	45 000 000.00	3 501 834.99	0.00	91.14	91.69	93.56	92.22	5.00	6.30	6.15	0.20	
VIII отваряне	29.07.2010	13.07.2020		45 000 000.00	114 860 000.00	93 110 000.00	6 924 514.00	0.00	92.10	91.18	94.20	92.56	5.00	6.17	6.10	0.18	
IX отваряне	10.11.2010	13.07.2020		25 000 000.00	162 430 000.00	25 000 000.00	1 317 185.04	0.00	93.89	94.53	95.31	94.73	5.00	5.93	5.81	0.17	
BG20 400 11 210/19.01.2011*																	
I отваряне	19.01.2011	19.07.2021	3 834	205 000 000.00	567 670 000.00	202 900 000.00	1 489 574.99	0.00	95.47	96.52	97.02	96.69	5.00	5.65	5.49	0.18	
II отваряне	09.03.2011	19.07.2021		45 000 000.00	154 220 000.00	45 000 000.00	924 630.02	0.00	96.13	97.08	97.61	97.36	5.00	5.57	5.40	0.18	
III отваряне	29.04.2011	19.07.2021		25 000 000.00	70 950 000.00	22 900 000.00	581 375.00	0.00	96.77	97.19	97.80	97.46	5.00	5.49	5.39	0.19	
IV отваряне	22.06.2011	19.07.2021		50 000 000.00	83 950 000.00	50 000 000.00	1 356 725.00	0.00	96.75	96.96	97.82	97.29	5.00	5.49	5.42	0.22	
V отваряне	10.08.2011	19.07.2021		50 000 000.00	134 800 000.00	50 000 000.00	954 200.00	0.00	97.51	97.92	98.23	98.09	5.00	5.39	5.31	0.18	
Общо 10 години и 6 месеца				500 000 000.00	1 424 610 000.00	516 010 000.00	492 175 827.97	0.00									
Общо дългосрочни ДЦК				1 960 000 000.00	5 531 693 048.00	1 901 930 000.00	1 834 707 306.56	91 629 583.61	9 004 476.14								
Общо ДЦК, реализирани чрез аукционни, в левове				2 900 000 000.00	7 763 684 257.00	2 808 040 011.00	2 732 617 297.02	108 486 824.44	10 137 887.34								

* Емисия от отворен тип.
** Министерството на финансите отхвърля всички постъпващи поръчки за участие в провеждания на 25.V.2010 г. аукцион за продажба на ДЦК от отворен тип с дата на плащане 27.V.2010 г.

Забележка: Доходността на съкровищните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възприетата от 1.1.2001 г. лихвена конвенция (IS/ISCT), като за ДЦК, емитирани до 22.XI.2004 г., се използва вградената в МІСОБОТГЕКС функцията за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.XI.2004 г., се използва формулата ISMA – International Yield.

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, ОБРАТНО ИЗКУПЕНИ ПРЕДИ ПАДЕЖА ИМ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

(продължение)

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на обратно изкупуване	Падеж на емисията	Цена на обратното изкупуване	Номинална стойност (лв.)			на емисията в обращение след обратното изкупуване	
				на емисията преди обратното изкупуване	на допуснатите поръчки	на одобрените поръчки		
BG 20 402 02215/17.04.2002	24.02.2011	17.04.2012	105.99	84 920 000.00	5 662 053.00	1 700 400.00	83 219 600.00	
BG 20 400 03217/08.01.2003	16.02.2011	08.01.2013	108.83	50 000 000.00	6 768 193.00	527 728.00	49 472 272.00	
BG 20 403 03211/02.07.2003*	23.03.2011	02.07.2013	-	50 000 000.00	2 222 800.00	0.00	50 000 000.00	
Общо ДЦК, обратно изкупени преди падежа им							2 228 128.00	

* Министерството на финансите отхвърли всички постъпили поръчки за участие в проведенния на 21.ІІІ.2011 г. аукцион за обратно изкупуване на ДЦК без определен срок чрез заплащане с дата на обратно изкупуване 23.ІІІ.2011 г.

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, ЕМИТИРАНИ В ЛЕВОВЕ

	Номинална стойност (лв.)
Общо ДЦК, реализирани чрез аукциони	2 808 040 011.00
Общо ДЦК, обратно изкупени преди падежа им	2 228 128.00
Общо ДЦК, намиращи се в обращение към 30.09.2011 г.	2 805 811 883.00

(продължава)

Първичен пазар на ДЦК

ДЪРЖАВНИ ЦЕННИ КНИЖА, РЕАЛИЗИРАНИ ЧРЕЗ АУКЦИОНИ, НАМИРАЩИ СЕ В ОБРАЩЕНИЕ КЪМ 30 СЕПТЕМВРИ 2011 Г.

СЪКРОВИЩНИ ОБЛИГАЦИИ, ЕМИТИРАНИ В ЕВРО

(продължение)

Номер на емисията/дата на емисията	Дата на плащането	Период на емисията	Брой дни	Номинална стойност (евро)		Фактически преведена сума (евро)	Отстъпка от номинала (евро)	Надбавка над номинала (евро)	Цена на 100 евро номинал (евро)				Годишна лихва (%)	Средна годишна доходност (%)		ОП към датата на емисията (плащането) (%)
				на предложеното от МФ количество	на допуснатите до участие в аукциона поръчки				на одобрените поръчки	Средна цена на допуснатите до участие в аукциона поръчки	Максимална цена на одобрените поръчки	Минимална цена на одобрените поръчки		Средна цена на одобрените поръчки	на допуснатите до участие в аукциона поръчки	
BG 20 300 10115/03.02.2010*			912	105 000 000.00	351 100 000.00	151 525 000.00						2.00				
I отваряне	03.02.2010	03.08.2012		25 000 000.00	70 975 000.00	25 000 000.00	828 077.50	0.00	96.04	96.49	96.86	96.69	3.71	3.43	0.24	
II отваряне	14.04.2010	03.08.2012		35 000 000.00	64 000 000.00	35 000 000.00	1 037 100.00	0.00	96.67	96.66	97.62	97.04	3.55	3.38	0.17	
III отваряне	04.08.2010	03.08.2012		15 000 000.00	70 125 000.00	61 525 000.00	1 326 930.00	0.00	97.71	97.47	98.31	97.84	3.22	3.15	0.17	
IV отваряне	13.10.2010	03.08.2012		15 000 000.00	87 100 000.00	15 000 000.00	303 491.00	0.00	97.56	97.73	98.54	97.98	3.44	3.19	0.17	
V отваряне	15.12.2010	03.08.2012		15 000 000.00	58 900 000.00	15 000 000.00	178 155.00	0.00	98.46	98.65	99.07	98.81	3.00	2.77	0.18	
Общо 2 години и 6 месеца				105 000 000.00	351 100 000.00	151 525 000.00	3 673 753.50	0.00								
BG 20 300 11113/30.03.2011*			1 827	145 000 000.00	375 840 000.00	109 000 000.00						4.00				
I отваряне	30.03.2011	30.03.2016		25 000 000.00	118 670 000.00	25 000 000.00	119 484.99	0.00	98.87	99.42	99.92	99.52	4.30	4.16	0.18	
II отваряне	18.05.2011	30.03.2016		35 000 000.00	117 520 000.00	35 000 000.00	76 060.00	0.00	99.25	99.68	100.05	99.78	4.22	4.10	0.21	
III отваряне	06.07.2011	30.03.2016		50 000 000.00	72 800 000.00	14 000 000.00	65 835.00	0.00	99.02	99.44	99.78	99.53	4.28	4.16	0.17	
IV отваряне	28.09.2011	30.03.2016		35 000 000.00	66 850 000.00	35 000 000.00	202 129.99	0.00	100.14	100.16	101.12	100.58	4.01	3.90	0.18	
Общо 5-годишни				145 000 000.00	375 840 000.00	109 000 000.00	261 379.99	202 129.99								
Общо средносрочни ДЦК				250 000 000.00	726 940 000.00	260 525 000.00	3 935 133.49	202 129.99								
BG 20 404 03219/12.11.2003*			5 447	100 000 000.00	350 871 536.00	100 000 000.00						6.00				
I отваряне	12.11.2003	11.10.2018		20 000 000.00	73 628 536.00	20 000 000.00	1 037 235.21	0.00	92.13	93.90	101.97	94.81	6.85	6.55	2.60	
II отваряне	23.01.2004	11.10.2018		50 000 000.00	124 820 000.00	50 000 000.00	285 946.50	1 002.00	98.62	98.74	101.45	99.43	6.14	6.06	2.83	
III отваряне	06.08.2004	11.10.2018		15 000 000.00	62 878 000.00	15 000 000.00	88 060.47	0.00	99.40	100.27	101.91	100.59	6.06	5.94	2.44	
IV отваряне	07.01.2005	11.10.2018		15 000 000.00	89 545 000.00	15 000 000.00	16 805 042.50	1 587 542.50	109.07	110.38	110.91	110.58	5.14	4.99	2.37	
Общо 14 години и 1 месеца				100 000 000.00	350 871 536.00	100 000 000.00	1 323 181.71	1 676 604.97								
BG 20 402 10218/29.09.2010*			5 479	45 000 000.00	311 355 000.00	234 105 000.00						5.75				
I отваряне	29.09.2010	29.09.2025		45 000 000.00	311 355 000.00	234 105 000.00	13 490 631.00	0.00	93.24	92.89	97.57	94.24	6.56	6.45	0.17	
Общо 15-годишни				45 000 000.00	311 355 000.00	234 105 000.00	13 490 631.00	0.00								
Общо дългосрочни ДЦК				145 000 000.00	662 226 536.00	334 105 000.00	14 813 812.71	1 676 604.97								
Общо ДЦК, реализирани чрез аукциони, в евро				395 000 000.00	1 389 166 536.00	594 630 000.00	18 748 946.20	1 878 734.96								

* Емисия от отворен тип.

Забележка: Доходността на съкровищните облигации се изчислява съгласно прилаганата от МФ методика и възприетата от 1.1.2001 г. лихвена конвенция (IS/ISCT), като за ДЦК, емитирани до 22.Х.2004 г., се използва вградената в MICROSOFT EXCEL функция за доход (Yield), а за ДЦК, емитирани след 22.Х.2004 г., се използва формулата ISMA – International Yield.