

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Европа вновь в центре внимания; Банк Японии заряжает инвесторов на оптимизм

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Рынок не спешит восстанавливаться после старта налогового периода сентября
- Рубль продолжает корректироваться вслед за внешними площадками

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды остаются по действием слабого спроса на риск
- Локальный рынок нивелировал пятничное ралли

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

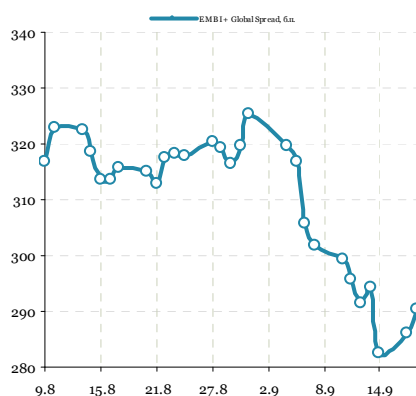
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 17/
- Результаты торгов евробондами /стр. 18/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 20/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.81	▼	-0.03	1.39
UST-10-2Y sprd	155	▼	-3	117
EMBI+ Glob.	290	▲	4	282
EMBI+ Rus sprd	167	▲	9	161
Russia'30 yield	2.97	▼	-0.04	2.85
Денежный рынок				
Libor-3m	0.38	▼	0.00	0.38
Euribor-3m	0.24	▼	0.00	0.24
MosPrime-1m	6.43	■	0.00	5.75
Корсчета в ЦБ	798.4	▲	27.0	446
Депоз. в ЦБ	72.2	▼	-3.2	61
NDF RU 3m	6.3	▲	0.1	5
Валютный рынок				
USD/RUB	30.915	▲	0.310	28.98
EUR/RUB	40.318	▲	0.148	38.48
EUR/USD	1.305	▼	-0.007	1.21
Корзина ЦБ	35.129	▲	0.231	33.33
ДХУ Индекс	79.249	▲	0.239	78.71
Фондовые индексы				
RTS	1547.7	▲	0.0%	1228
Dow Jones	13564.6	▲	0.09%	12101
DAX	7347.7	▼	-0.76%	5969
Nikkei 225	9124	▲	1.60%	8296
Shanghai Comp.	2059.5	▲	0.45%	2038
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	110.2	▼	-0.85%	88
Нефть Brent	112.0	▲	0.38%	89
Золото	1772.0	▲	0.23%	1540
CRB Index	311.6	▼	-0.92%	267

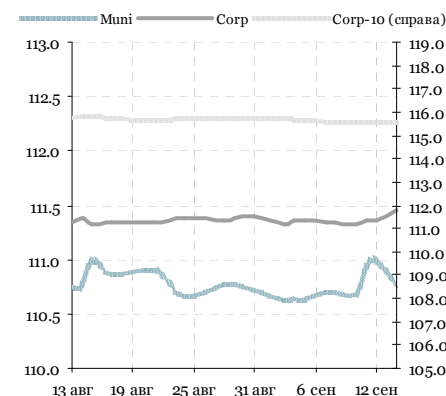
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETBI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETBI

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Price Return				
OFZ	117.2	▲	0.18	107.5
Muni	110.8	▼	-0.20	110.5
Corp	111.5	▲	0.11	110.7
Corp-10	115.6	▼	-0.01	115.5
Total Return				
OFZ	267.4	▲	0.50	233.3
Muni	343.6	▼	-0.42	324.8
Corp	342.8	▲	0.49	323.6
Corp-10	343.8	▲	0.19	324.6
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	2 921	▲	2 123	0
Muni	598	▼	-120	6 146
Corp	6 525	▲	880	19

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ОАО «Магнит» завершило вчера прием заявок инвесторов на биржевые облигации серии БО-07 объемом 5 млрд. руб., по итогам маркетинга установлена ставка 1-го купона в размере 8,9% годовых. К ставке 1-го купона приравнены ставки 2-6-го купонов облигаций, доходность к погашению при размещении составляет 9,1% годовых. Спрос на бумаги составил 12,3 млрд. руб., в 2,5 раза превысив предложение. /Интерфакс, Банк ЗЕНИТ/

ОАО «Газпромбанк» вчера разместило еврооблигации на 15 млрд. руб. (486 млн. долл.) с погашением в декабре 2015 г., ставка купона составила 8,625% годовых. Спрос на бумаги банка со стороны инвесторов в 2 раза превзошел объем размещения и составил 30 млрд. руб. Организаторами выступили Barclays Capital, Citigroup, HSBC Holdings и сам Газпромбанк. /Интерфакс, Bloomberg/

ОАО «Московский Кредитный Банк» открыло книгу заявок на покупку облигационного выпуска БО-02 объемом 3 млрд. руб. Индикативная ставка купона находится в диапазоне 9,5 - 10% годовых. По выпуска предполагается оферта через 1 год, доходность к оферте составляет 9,73 - 10,25% годовых. Книга будет открыта до 17:00 мск 21 сентября, размещение на бирже запланировано на 25 сентября. Организаторами займа выступают ОАО АКБ «Связь-Банк», ЗАО «ВТБ Капитал», ООО «БК Регион». /Cbonds/

ОАО «Северсталь» может сегодня разместить пятилетние облигации на сумму 450 млн. долл. с возможностью расширения предложения до 500 млн. долл. Ориентир доходности к погашению облигаций, которые могут быть конвертированы в глобальные депозитарные расписки Северстали, составляет 2 - 2,5% годовых. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 18.09.2012 – вторник

Статистика США: Net Long-term TIC Flows, Current Account Balance

- **Выплата купона:** Северсталь, БО-01 (7.5%, 561 млн руб.), ВТБ, БО-03 (8%, 99.7 млн руб.), ВТБ, БО-04 (8.6%, 108.4 млн руб.), Муниципальная инвестиционная компания, 02 (10.5%, 52.3 млн руб.), Альфа-Банк, 2015-2 (8%, 24 млн долл.), Русфинанс Банк, 09 (7.7%, 76.7 млн руб.), ТГК-2, БО-01 (9%, 224.4 млн руб.), Транскапиталбанк, 02 (8.15%, 73.1 млн руб.), Департамент Финансов Тверской области, 34007 (8.5%, 63.5 млн руб.), АФК Система, 04 (7.65%, 514.9 млн руб.), ХКФ Банк, 2014 (LPN) (7%, 17.5 млн долл.), Вымпелком, 01 (8.85%, 441.3 млн руб.), Вымпелком, 04 (8.85%, 661.9 млн руб.), Транскапиталбанк, 2017 (LPN) (10.514%, 5.2 млн долл.), ЭГИДА, 01 (9.3%, 2.8 млн руб.)
- **Оферта:** АИЖК, 23 (14 млрд руб.), Транскапиталбанк, 2017 (LPN) (100 млн долл.)
- **Погашение:** Северсталь, БО-01 (15 млрд руб.)

Сегодня: 19.09.2012 – среда

Статистика США: Housing starts, Existing home sales, Building permits

- **Выплата купона:** Россия, 26202 (11.2%, 1.1 млрд руб.), Россия, 25069 (10.8%, 2.4 млрд руб.), Казань, 34007 (8.75%, 37 млн руб.), РСГ-Финанс, 01 (10.75%, 80.4 млн руб.), Россия, 35011(ГСО-ППС) (7%, 1 млрд руб.), Еврофинансы-Недвижимость, 03 (1.5%, 5.6 млн руб.), Вологодская область, 34002 (10.65%, 66.6 млн руб.), Министерство финансов Самарской области, 35008 (9%, 336.6 млн руб.), Органический синтез (бывш. Казаньоргсинтез), 2015 (LPN) (10%, 10 млн долл.), Желдорипотека, 03 (13%, 129.6 млн руб.)
- **Погашение:** Россия, 25069 (45 млрд руб.), Желдорипотека, 03 (2 млрд руб.)

Завтра: 20.09.2012 – четверг

Статистика Еврозоны: PMI Composite, PMI Manufacturing, Consumer Confidence

Статистика США: Initial Jobless Claims

- **Выплата купона:** Департамент Финансов Тверской области, 34005 (15%, 3 млн руб.), Акрон, 02 (8.2%, 143.1 млн руб.), Ипотечный агент МБРР, 1А (8%, 14.7 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 34004 (9.75%, 38.9 млн руб.), АРИЖК, 01 (3%, 9 млн руб.), АЛРОСА, 21 (8.25%, 164.5 млн руб.), АЛРОСА, 23 (8.95%, 156.1 млн руб.), Карелия, 34013 (9.71%, 42.1 млн руб.), ТехноНИКОЛЬ-Финанс, БО-02 (13%, 162 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-03 (9.45%, 35.3 млн руб.), Волгоград, 34005 (9.5%, 23.7 млн руб.), Группа ЛСР (ОАО), БО-03 (9.5%, 94.7 млн руб.), Россия, 26204 (7.5%, 5.6 млрд руб.), Металлоинвест, 06 (9%, 448.8 млн руб.), КБ МИА (ОАО), 01 (10%, 5.4 млн руб.), Гражданские самолеты Сухого, 01 (7%, 174.5 млн руб.), ТНК-ВР, 2017 (6.625%, 26.5 млн руб.), Элис, 02 (14%, 34.9 млн руб.), Костромская область, 34005 (9%, 26.4 млн руб.), Министерство финансов Самарской области, 35005 (9.3%, 9.6 млн руб.)
- **Погашение:** КБ МИА (ОАО), 01 (2.2 млрд руб.), Элис, 02 (500 млн руб.)

Внешний рынок долга

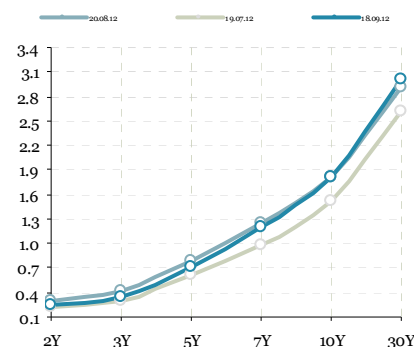
Европа вновь в центре внимания; Банк Японии заряжает инвесторов на оптимизм

Настроения на мировых площадках вчера оставались подавленными. В первой половине суток спекулянты продолжили корректировать прежний рост, вызванный эффектом от запуска очередной программы выкупа активов со стороны ФРС США. Очевидно, что поводом для нисходящей динамики служит не только рыночная истина «продавать на факте», но сомнения в том, что гонка печатанных станков закончится для мировой экономики положительным исходом. Так, еще недавно объявленное намерение главы ЕЦБ Марио Драги выкупать долги проблемных экономик региона, обратившихся за помощь к стабилизационным фондам ЕС, уже заметно обесценилось в глазах инвесторов. Бонды Испании с погашением через 10 лет вчера вновь превысили уровень в 6%, который был еще до объявления ЕЦБ количественных мер. Инвесторы таким образом, вероятно, подталкивают власти страны к решению обратиться за помощью к европейским спасителям, чтобы бонды Испании смогли участвовать в программе выкупа ЕЦБ. Впрочем, динамика в этом процессе определенно есть. Вчера испанский вице-премьер сообщила, что власти страны планируют рассмотреть вариант обращения за финансовой помощью в небольшом объеме и на приемлемых условиях. Ранее премьер Рахой говорил, что ключевым моментом в стремлении обратиться за помощью должно быть отсутствие попыток регулирования бюджета страны со стороны надзорных органов еврозоны. Для тех стран, которые уже получают финансовую помощь, это условно обязательное соблюдение рекомендаций кредиторов в регулировании налогово-бюджетной политике было одним из основных условий предоставления помощи.

Сегодня утром Банк Японии прервал негативную динамику текущей недели, объявив о расширении масштаба количественных стимулов. Программа выкупа активов была расширена с 70 до 80 трлн иен и продлена до декабря 2013 г. Эти новости помогут снизить давление на рынки от накопившейся геополитической обстановки между Японией и КНР, однако развернуть рыночные настроения они вряд ли способны.

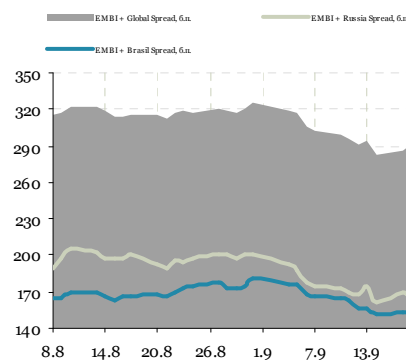
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



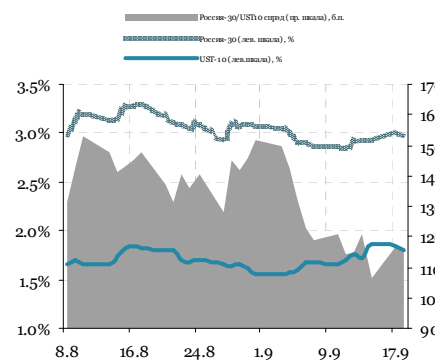
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



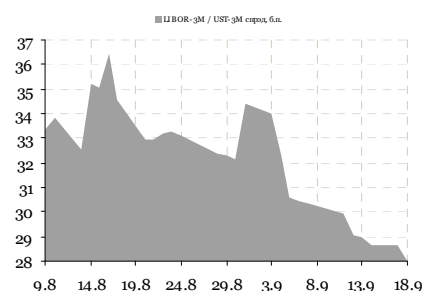
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Рынок не спешит восстанавливаться после старта налогового периода сентября

Условия локального денежно-кредитного рынка вчера существенно не изменились, несмотря на отсутствие существенных платежей и пополнение ликвидности за счет аукционов ЦБ по 7-дневному репо и размещению средств федерального бюджета на банковские депозиты. На рынке МБК стоимость кредитов овернайт осталась на уровне 6.0% годовых, под столько же обходилось и междилерское репо на ММВБ. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банкам удалось привлечь на 1 день 119 млрд руб. (спрос – 169 млрд руб.), на 7 дней – 1.2 трлн руб. (спрос 1.2 трлн руб.). Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 50.1 млрд руб., составив 920.7 млрд руб.

На текущей неделе налоговый период продолжится, до четверга предстоит уплатить НДС, что потребует еще порядка 170 млрд руб. из банковской системы. Насколько сильно рынок негативно отреагирует на эти платежи, во многом зависит от «щедрости» Центробанка на аукционах прямого репо. Впрочем, регулятору пока удается удерживать совокупный объем задолженности по этим операциям на прежнем уровне в 1.4 трлн руб.

Рубль продолжает корректироваться вслед за внешними площадками

Валютные торги вторника вновь принесли рублю убытки, по отношению к бивалютной корзине он потерял 30 коп., закрывшись на отметке 35.21 руб. Сохранение негативной динамики на внешних площадках, которая вновь привела к укреплению доллара США и снижению котировок нефти до локальных минимумов. Сегодня внешний фон выглядит несколько лучше на фоне стимулирующих мер со стороны Банка Японии, однако, на примере недавних действий ФРС США, это может стать лишь поводом для краткосрочного спекулятивного роста рискованных активов и валют.

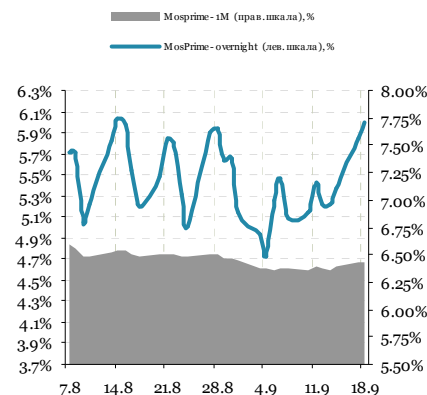
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

Дата	Аукционы ЦБ и Фонда ЖКХ, поступление и возврат средств на счета комбанков, уплата налогов	Прямое репо с ЦБ РФ, 1 день, млрд руб.
Понедельник	Уплата налогов	Страховые взносы в фонды (~230 млрд руб.)
	Аукцион ЦБ	Прямое репо, 3 мес.
Вторник	Аукцион Казначейства	35 дней, 25 млрд руб., от 6.2% годовых
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26207, 25 млрд руб.
Четверг	Уплата налогов	НДС, 1/3 за II квартал (~170 млрд руб.)
Пятница		

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

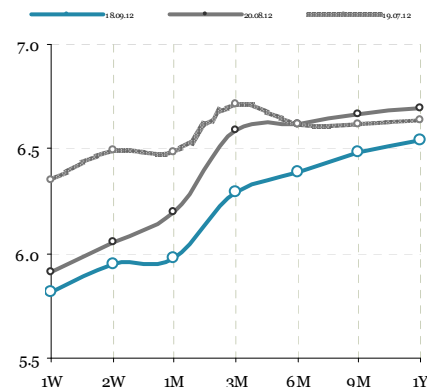
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды остаются под действием слабого спроса на риск

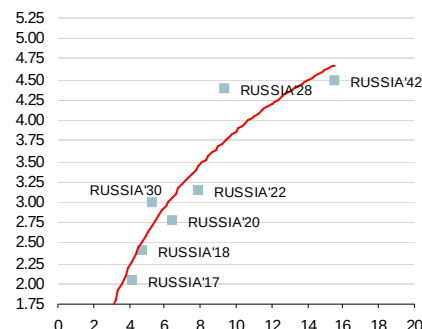
Российский сегмент провел день в условиях действия противоречивых факторов. Суверенные выпуски копировали динамику на рынке UST, что позволило им прибавить в ценах в среднем более 25 бп. Дальний Россия'42 прибавил порядка 50 бп и завершал день на уровне 118.25%, «тридцатка» показала более скромный результат: здесь котировки выросли на 25 бп, достигнув к концу дня отметки 125.50%. Корпоративный сектор был более чувствителен сохраняющемуся слабому спросу на риск: цены на корпоративные бумаги преимущественно снижались, расширяя спрэды к суверенной кривой. Среди аутсайдеров рынка находились дальние выпуски ВЭБа и Сбербанка, потерявшие в ценах порядка 50-75 бп, среди частных компаний аналогичный результат показали выпуски Вымпелкома и Металлоинвеста.

Локальный рынок нивелировал пятничное ралли

Локальный рынок остается под действием повышенных ставок и коррекционных настроений, идущих со стороны валютного рынка и котировок сырья. По итогам вчерашних торгов цены на дальнем участке кривой ОФЗ опустились в среднем на 15 бп, доходности вернулись ближе к уровням четверга, отыграв обратно большую часть пятничного ралли. Активность в корпоративном сегменте заметно сократилась, на среднем участке кривой оживление было заметно в выпусках ВЭБ 21 и ВЭБ Лизинг 6, цены которых показали лишь незначительные изменения.

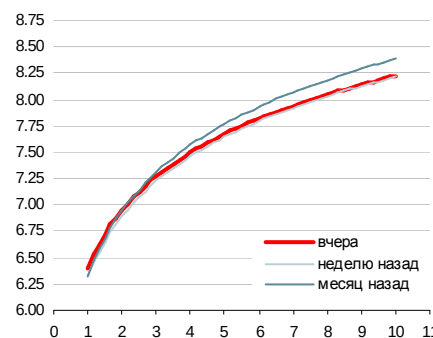
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



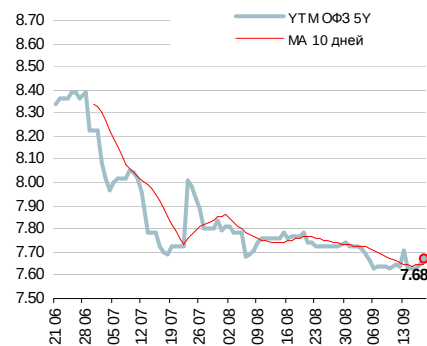
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



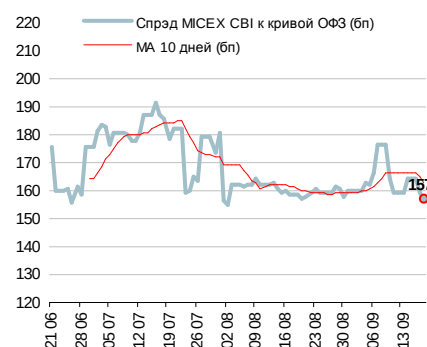
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



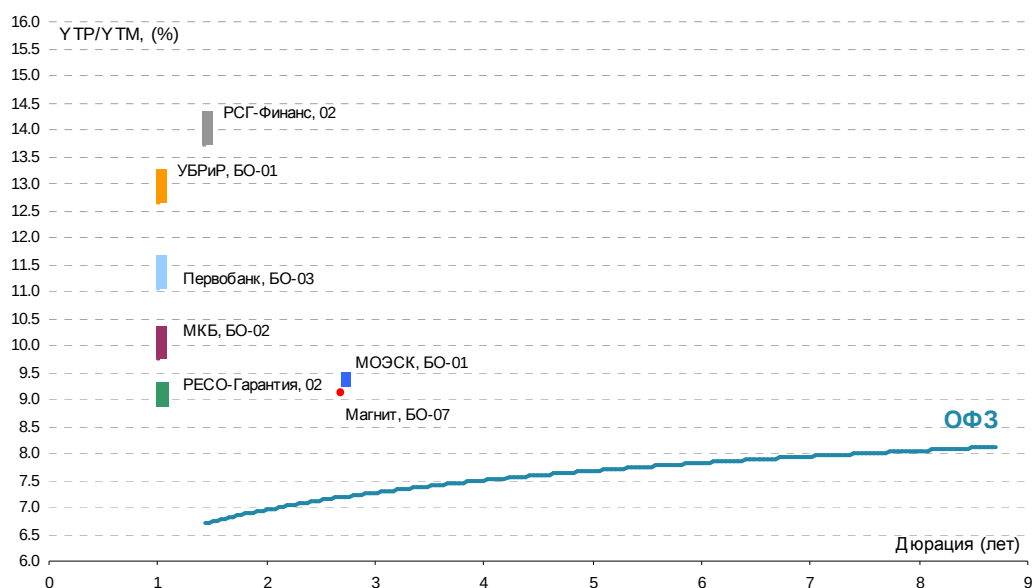
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Закрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
МОЭСК, БО-01	BB- / Ba2 / -	да	5 000	9.20-9.46	19.09.2012	21.09.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
Магнит, БО-07	BB- / - / -	да	5 000	9.10	18.09.2012	24.09.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
Трансфин-М, БО-09	NR	нет	2 000	Конкурс	н/д	24.09.2012	н/д	нет / 3 г.
Трансфин-М, БО-10	NR	нет	2 000	Конкурс	н/д	24.09.2012	н/д	нет / 3 г.
Первобанк, БО-03	- / B3 / -	да	2 000	11.04-11.57	20.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
РЕСО-Гарантия, 02	BB+ / - / -	да	5 000	8.89-9.20	21.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 10 лет
МКБ, БО-02	B+ / B1 / BB-	да	3 000	9.73-10.25	21.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
УБРиР, БО-01	B / - / -	да	2 000	12.63-13.16	26.09.2012	28.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
РСГ-Финанс, 02	B- / - / -	да	2 500	13.69-14.22	н/д	н/д	нет / 1.41 г.	1.5 г. / 3 г.

Источник: Bloomberg, Cbonds, Finam

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Bid cover/Размещ. объем	Ориентир УТР/УТМ	Фактическая УТР/УТМ	Дата размещения	Амортизация/Дюрация
НЛМК, 07	BBB- / Baa3 / BBB-	да	5 000	1.6 / 100%	8.68-8.78	8.68	17.09.2012	нет / 2.30 г.
Группа ЛСР, 03	- / B2 / B	да	3 000	1.8 / 100%	12.11-12.64	11.83	14.09.2012	нет / 1.42 г.
Росбанк, БО-04	- / Baa3 / BBB+	да	10 000	1.4 / 100%	9.25-9.52	9.52	12.09.2012	нет / 1.86 г.
НЛМК, БО-04	BBB- / Baa3 / BBB-	да	5 000	2.7 / 100%	8.47-8.68	8.42	10.09.2012	нет / 1.88 г.
Промсвязьбанк, БО-07	- / Ba2 / BB-	да	5 000	1.4 / 100%	10.25-10.78	10.41	06.09.2012	нет / 1.86 г.
Элемент Лизинг, БО-01	B / - / -	да	1 000	н/д / 100%	13.65-14.75	14.20	06.09.2012	нет / 1.78 г.
ВТБ, БО-08	BBB / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.14-8.40	8.19	04.09.2012	нет / 1 г.
Пробизнесбанк, 07	- / B2 / B-	да	2 000	н/д / 100%	11.57-12.10	12.10	04.09.2012	нет / 1 г.
РЕСО-Гарантия, 01	BB+ / - / -	да	5 000	2.2 / 100%	9.62-10.04	9.62	03.09.2012	нет / 1.86 г.
Альфа-Банк, БО-07	BB / Baa1 / BBB-	да	5 000	н/д / 100%	8.68-8.94	8.79	31.08.2012	нет / 1.44 г.
Банк Уралсиб, 05	BB- / B1 / BB-	да	7 000	н/д / 100%	9.57-10.09	9.94	31.08.2012	нет / 1.43 г.
Банк ЗЕНИТ, 08	- / Ba3 / B+	да	5 000	н/д / 100%	9.41-9.62	9.41	29.08.2012	нет / 1 г.
МСП Банк, 02	BBB / Baa2 / -	да	5 000	2.3 / 100%	9.20-9.73	9.41	23.08.2012	нет / 1.86 г.
Петрокоммерц, БО-02	B+ / Ba3 / -	да	3 000	1.5 / 100%	9.20-9.62	9.41	23.08.2012	нет / 1 г.
Петрокоммерц, БО-03	B+ / Ba3 / -	да	5 000	1.5 / 100%	9.72-10.14	9.94	23.08.2012	нет / 1.43 г.
Банк Восточный Экспресс, БО-04	- / B1 / -	да	3 000	1.4 / 100%	11.08-11.62	11.46	17.08.2012	нет / 1 г.
Запсибкомбанк, БО-02	B+ / - / -	да	2 000	н/д / 100%	12.36-12.89	12.89	17.08.2012	нет / 1 г.
Локо-Банк, БО-03	- / B2 / B+	да	3 000	н/д / 100%	10.51-11.04	11.04	14.08.2012	нет / 1 г.
Связной Банк, 01	- / B3 / -	да	2 000	н/д / 100%	14.22-14.76	14.76	09.08.2012	нет / 1 г.



Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ОФЗ													
ОФЗ 25069		19/09/12	100.01	100.01	100.01	-0.02	17	71 169	6.43	0.00			45 000
ОФЗ 25067		17/10/12	100.42	100.46	100.47	-0.02	2	23 222	5.42	0.08			45 000
ОФЗ 26198		02/11/12	99.95	100.02	99.90	-0.09	4	502	6.67	0.12	64		42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.42	100.43	100.43	0.01	14	204 049	5.94	0.35			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.27	100.29	100.29	0.01	11	69 545	5.99	0.39			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	103.10	103.30	103.12	-0.03	4	79 273	6.00	0.50			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.00	100.15					5.99	0.81			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13		100.46					6.35	1.04			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.76	100.80	100.80	0.03	19	30 536	6.63	1.43	8		155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.00	109.80	109.60	-0.25	4	100 015	6.70	1.77	14		45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.40	109.50	109.45		6	121 737	6.80	1.98	24		40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	99.10	103.08	103.08	-0.12	6	17 413	6.67	2.01	11		80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	99.85	100.03	99.86	-0.11	4	42	7.18	2.47	6	59	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	99.25	99.60	99.60		1	1	7.16	2.58	1	56	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	100.50	100.62	100.55	-0.05	2	91	7.29	2.99	2	66	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	97.18	97.40	97.17	-0.03	1	2 225	7.49	3.02	21	86	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	98.80	99.00	98.60	-0.05	5	3 282	7.45	3.44	7	76	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18		100.00					8.90	3.44	152	221	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.28	3.71	84	155	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	100.10	100.20	100.15	-0.15	8	203 986	7.49	3.86	2	74	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	100.05	100.20	100.10	-0.05	8	642 542	7.51	4.01	1	74	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	100.40	100.50	100.40	-0.10	3	475	7.55	4.44		71	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	90.10	90.40	90.40	0.15	1	500	7.74	4.65	12	87	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	96.37	97.47					7.83	4.77	19	94	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	99.67	99.77	99.67	-0.08	8	220 002	7.71	5.21	0	75	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							8.14	5.65	37	112	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	94.00	94.40	94.00		1	10 000	7.91	6.28	5	80	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	99.90	100.10	99.90	-0.30	3	50 006	7.76	6.27		65	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	99.10	99.30	99.30	-0.05	5	150 002	7.85	7.02		64	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		89.50					8.39	7.54	39	111	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	101.35	101.40	101.35	-0.35	20	470 413	8.15	8.71	4	72	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36		87.50					8.19	10.91		52	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		89.89					7.85	10.55		22	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.25	99.80	99.60	-0.20	11	296 945	7.61	0.85	134	113	15 000
НЛМК													
НЛМК ВО5		30/10/12	100.36	100.44	100.44	0.04	1	300	6.82	0.12		80	10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	100.48	100.55					7.10	0.21		89	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.20	100.35	100.20		6	35 222	7.42	0.46		106	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	86.00	100.90					7.61	0.73	146	117	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.70	100.80					7.61	0.73	146	117	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.30	101.75	101.30	0.05	4	16 402	8.44	1.95	151	188	10 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12	90.03						7.27	0.16		116	5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.95	100.17					7.79	0.52	190	141	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	86.00	100.20					8.34	0.89	203	184	5 000
ММК ВО4		27/02/14	86.02	99.70	99.19	-0.07	2	46	8.42	1.39	176	187	5 000
ММК ВО6		10/07/14			97.53	-0.42	1	1 000	8.88	1.70	206	233	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.60						8.93	1.74	209	238	5 000

Севсталь

Севсталь ВО1	20/09/11	18/09/12							7.67	0.00			15 000
Севсталь ВО2		15/02/13	101.00	101.05	101.00	2.00	2	3 186	7.34	0.41		99	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	101.00	101.07	101.00	-0.12	1	2 468	7.34	0.41		99	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15							7.76	0.74	160	131	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.50	100.60	100.47	-0.13	2	500	7.84	0.75	167	139	8 000
Алроса 23		18/06/15							8.56	2.42	146	197	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.18	101.48					8.61	2.43	151	202	3 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20							8.18	0.48		181	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20							7.94	0.48		157	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.85	108.15	108.15	-0.10	3	386	9.30	1.80	243	274	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.85	108.69					9.19	1.79	233	263	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	99.75	100.20					10.09	2.65	292	348	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	99.75	99.90					10.23	2.65	306	362	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	94.25	94.70					10.50	3.18	318	385	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	94.15	94.60	94.60	0.60	1	2 707	10.44	3.17	313	379	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.65	99.80	99.70	0.26	6	8 354	9.35	2.28	229	277	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.65	99.80	99.80	-0.03	4	10 002	9.30	2.28	224	272	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.65	99.80	99.80	-0.09	5	500	9.30	2.19	228	273	10 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Мечел													
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.41	100.50	99.41	-0.49	27	3 781	12.53	0.81	630	606	5 000
Мечел 5	16/10/12	09/10/18	100.05	100.35	100.05	-0.20	4	8 205	12.22	0.08			5 000
Мечел ВО1	11/11/11	09/11/12	99.01	100.00					8.29	0.14		222	5 000
Мечел ВО2		12/03/13	98.98	99.65	99.65	0.30	1	500	10.79	0.48		442	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.18	99.34					12.78	0.57	682	638	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.48	97.20	97.20	0.70	2	41	11.79	0.71	566	535	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	93.02	95.97	93.50	0.50	5	1 900	13.87	1.36	723	732	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	92.01	93.25	93.25	-1.05	2	1 159	14.09	1.36	745	754	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	96.02	96.90	96.90	0.40	3	5 500	13.12	1.33	649	657	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.56	2.52	443	496	5 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.56	2.18	454	499	2 000
Мечел ВО7		07/04/15							11.56	2.52	443	496	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.56	2.52	443	496	3 000
Мечел ВО12		07/04/15							11.56	2.52	443	496	3 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	89.06	91.99					13.81	2.61	665	721	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	91.00	92.50					13.57	2.60	641	697	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	84.03	87.49					13.74	3.14	643	709	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	86.01	92.00					12.38	3.14	507	573	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	85.03	87.49					13.31	3.16	600	666	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.75	100.10					9.13	1.03	270	259	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.60	100.80	100.82	0.01	8	250	8.40	0.77	220	194	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.15	98.99	97.15	-1.65	3	60	13.33	1.17	680	679	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	94.00	94.50					12.69	1.58	592	614	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.11	100.98					12.65	0.21		644	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	95.02	96.14	95.02	-0.70	7	20 080	12.38	1.57	562	583	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.81	93.00	93.00	-0.20	15	520	14.24	1.39	758	769	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.51	87.99					14.74	2.26	769	816	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 7		07/11/12	100.00	100.15	100.00	-0.15	1	22	7.59	0.14		153	5 000
РЖД ВО1		05/12/12	100.57	100.75					6.55	0.21		33	15 000
РЖД 9	18/05/11	13/11/13	99.45	99.75	99.45		1	4 000	7.53	1.10	105	99	15 000
РЖД 10		06/03/14	110.49	110.75	110.74	-0.06	8	106 050	7.26	1.37	61	71	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.46	102.52	102.55	-0.10	6	16 280	7.94	2.16	93	137	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.40	99.70	99.40		3	72	8.17	2.80	95	155	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.01	99.10	99.05	-0.15	6	46 999	8.36	3.22	103	170	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.92	100.22					8.31	4.75	67	142	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.80	100.30					7.47	0.97	109	94	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.80	100.30					7.47	0.97	109	94	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.30	101.40	101.30	-0.10	2	30 042	7.81	1.61	103	126	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	95.91	102.00					7.97	1.90	106	141	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.60	100.30	99.60	-0.05	1	42	8.06	2.65	89	145	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.20	98.70	98.75	0.25	2	125 001	8.12	2.75	92	151	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	99.71	99.72					8.36	3.09	107	172	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70					8.91	4.14	138	212	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70					8.91	4.14	138	212	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.40	97.00					8.94	4.69	132	206	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.00	97.25					9.25	6.19	141	215	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.01	100.00	99.80	0.78	1	10 000	9.29	2.31	223	271	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.00					9.83	3.80	237	309	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	94.04	99.10	98.86	-0.06	8	320	10.31	1.08	384	377	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	97.00	98.95					8.99	2.92	174	237	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.70					9.11	3.10	181	247	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.11	3.10	181	247	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	85.00						9.41	3.73	197	268	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32	86.00		98.60	-1.15	1	500	9.77	3.72	233	304	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.43	3.73	199	270	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16							9.36	1.40	269	281	7 000
НЕФТЬ и ГАЗ													
ГАЗПРОМ													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14	100.00	100.10	100.05	0.02	1	540	7.16	0.14	109		15 000
Газпром А9		12/02/14	99.10	100.60					7.04	1.35	40	49	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.51	110.80	110.55	-0.21	2	80 732	7.39	1.59	62	84	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12	100.55	100.65					6.57	0.24		30	5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							6.40	0.24		13	5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.00	101.50	100.15	0.08	3	2 550	7.39	1.16	87	85	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16		100.40					-0.53	0.33			8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.95	100.04					7.40	0.54	149	101	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.92	99.95	99.95	0.02	3	19 000	7.36	0.54	145	97	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.95	101.00	100.95		2	4 978	7.95	2.19	93	138	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.00	102.50	100.76	0.16	1	41	8.40	2.98	113	177	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.76	103.00	100.76	-0.04	3	30 239	8.40	2.99	113	177	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.00	109.99					8.79	4.36	122	196	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	97.46	98.95					8.68	4.42	110	184	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	99.66						7.62	0.75	145	117	10 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13							7.97	0.95	161	145	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	101.21	101.50	101.25	-0.07	3	165	7.37	0.25		108	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	101.21	108.00					7.37	0.25		108	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	101.21	101.27					7.29	0.25		100	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.71	101.90	102.70	0.95	1	1 000	7.10	1.15	59	56	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	100.85	102.50					8.66	2.20	163	209	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.25	99.85	99.75	0.05	4	37 863	10.28	0.84	401	380	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	97.00	99.60	98.15	-0.21	11	625	11.00	1.32	438	445	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	93.25	94.89					11.17	3.15	386	452	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	93.25	94.25	93.25	-0.65	1	1 000	11.41	3.16	410	476	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.41	99.70	99.70	0.10	4	1 230	12.93	0.82	668	645	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.58	3.23	225	292	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.60	100.70	100.69	0.10	6	12 194	7.88	0.78	168	142	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14							7.39	0.25		109	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.12	100.26	100.12	-0.10	1	50	7.81	0.35		148	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.73	100.00	100.00		1	16	7.82	0.48		145	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.80	100.00	100.00		2	115	7.82	0.48		145	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.05	100.10	100.05	0.13	4	2 886	7.71	0.48		134	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.65	99.75	99.65		2	3 029	7.96	1.04	153	142	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.90	100.15	99.95	-0.10	3	100 001	8.28	1.42	160	173	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.05	100.14	100.08	-0.11	2	50 001	8.18	1.42	150	163	5 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	186	165	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.15	100.15	0.95	1	60	8.86	2.05	189	230	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.15	100.15		5	12 010	8.18	0.91	185	167	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					8.43	0.83	217	195	5 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.42	99.50	99.50	-0.08	2	3 640	8.03	0.44		167	5 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.40	99.75					8.00	0.30		169	10 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	99.10						8.88	1.18	235	234	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.90	1.30	229	235	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	100.15	100.40					8.14	0.59	215	174	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	99.95					8.34	0.81	211	187	8 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.01	99.95					7.41	1.04	97	87	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	99.80	100.25	99.80	0.05	5	284 218	8.67	2.28	162	209	15 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21							8.75	3.02	147	212	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.36	132	200	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	95.71	96.53					9.09	4.13	157	230	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.10	99.43	99.39	-0.07	4	494	8.07	1.45	137	152	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.00	100.80					8.71	1.91	180	215	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.70	101.15					8.33	1.91	141	177	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.45	100.65	100.65	-0.04	6	50 104	8.86	2.11	187	229	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	85.00	99.50					9.24	3.02	196	261	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	98.20	98.50					9.41	3.02	213	278	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.52	100.00	99.51	-0.49	6	41 312	9.25	1.40	258	270	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.32	100.35	100.30	-0.15	2	1 020	9.22	1.80	235	266	5 000
РСХБ													
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.45	100.50					8.02	0.92	168	151	5 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.40		100.50	0.01	2	15 700	7.88	0.92	154	137	10 000
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.20	100.48					7.12	0.18		97	5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.20	100.47	100.40		3	964	7.81	0.18		166	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.60	100.80	100.64	-0.04	2	1 984	7.39	0.39		105	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.62	101.90	100.62	-0.06	5	13 954	7.45	0.39		111	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.20	99.30	99.30		1	494	7.99	0.71	186	155	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.27	100.60					8.04	0.86	175	155	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.27	100.60	100.27	-0.03	1	26	8.02	0.87	173	153	5 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.45	100.50	100.45	0.04	2	313	7.91	1.05	147	137	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.70	100.90	100.87	-0.03	8	30 355	8.07	1.07	161	153	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17		100.09	96.15	-3.95	1	2	11.87	0.98	548	534	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	100.59	101.60	101.60		3	38 188	8.17	1.34	154	162	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.00	100.49					15.12	1.80	825	856	5 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.95	100.04	100.03	-0.12	1	7 000	8.71	2.28	166	213	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.40	97.41					8.91	2.53	177	231	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.40	97.41					8.91	2.54	177	231	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.35	97.45	97.35		2	28	8.97	2.54	183	237	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							7.88	0.16		177	20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							6.01	0.18			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.25	100.38	100.30	0.01	3	30 000	7.40	0.27		110	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.20	99.50	99.27	0.02	2	17 690	7.79	0.82	154	131	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.70	99.80					8.11	1.17	159	157	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.30		100.65	0.19	2	39 400	8.14	1.32	152	159	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.45	100.70	100.48	-0.11	12	122 143	8.73	1.70	191	218	10 000
АИЖК													
АИЖК А5		15/10/12	100.00	100.13					4.69	0.07			2 000
АИЖК А6		15/07/14	99.30	100.10					8.08	1.32	146	153	3 000
АИЖК А8		15/06/18	95.03	98.59					8.42	2.88	118	180	5 000
АИЖК А9		15/02/17		98.90					8.29	1.95	136	173	5 000
АИЖК А7		15/07/16		100.70					8.28	1.97	134	172	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.50		99.50	0.50	1	26	8.15	2.41	105	156	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	98.80	99.10					8.55	3.10	125	191	7 000
АИЖК А10		15/11/18	95.04	99.05					8.63	3.09	133	199	6 000
АИЖК А21		15/02/20		101.50	101.05	-0.17	3	60 000	8.75	3.27	141	208	15 000
АИЖК А11		15/09/20	99.00	99.99					8.46	3.93	97	170	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.70	97.80					8.97	5.04	129	203	10 000
АИЖК А17		15/04/22	102.30	105.00					8.91	5.58	115	190	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	80	150	5 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.44	1.85	155	188	7 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	99.50						9.00	1.16	248	246	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	95.55						9.19	1.16	267	265	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.20					9.61	1.74	277	306	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14	86.00						9.61	1.74	277	306	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	100.15	100.30	100.15	-0.02	1	10	8.05	0.41		170	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.50	99.90					8.04	0.88	174	154	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.10	99.90					8.32	1.11	184	178	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.00	99.70					8.63	1.46	193	208	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.50	100.00	99.98	-0.02	1	5	8.74	3.38	137	206	15 000
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.30	100.90	100.30	-0.40	2	2	7.70	0.73	154	125	10 000
МТС 1		17/10/13	99.15	99.85					7.22	1.03	79	68	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.00	99.91					6.64	1.58		9	15 000
МТС 2		20/10/15	97.71	98.50	98.50	0.22	3	31	8.48	2.72	129	187	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.00	98.41	98.00	-0.41	6	2 999	9.08	2.76	187	247	15 000
МТС 7		07/11/17	98.70	99.00	98.70	-0.61	6	2 015	9.22	4.12	170	243	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	101.15	101.25	101.25	0.10	1	57 000	7.79	0.81	155	132	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.70	99.07	98.23	-0.12	2	48	8.65	1.70	183	210	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.25	99.50	99.05	-0.35	4	100 002	9.50	2.21	247	293	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.25	99.50	99.35	0.20	25	7 312	9.36	2.29	230	278	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.25	99.49	99.35	0.15	9	22 582	9.36	2.29	230	278	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.00	98.00	97.00		1	11 000	9.67	2.67	249	306	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	96.51	98.00	97.15	-0.05	4	29 725	9.61	2.67	243	300	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 13	21/10/11	17/10/12	99.61						12.09	0.17		596	2 000
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.00					8.37	0.72	223	193	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	84.01	100.00					11.04	0.88	473	454	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.50	101.70					8.44	1.33	181	189	3 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Офферы	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.70					7.65	1.33	102	110	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	99.55	99.98	99.80	0.15	3	20 046	9.28	2.26	223	270	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.27	96.00					9.92	3.21	259	326	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.26	96.99					10.17	3.22	284	351	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.26	97.00					10.05	3.22	272	339	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13		100.00	99.90	-0.10	1	340	7.82	0.44		146	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	100.10						8.30	0.96	193	178	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	100.10						8.42	0.96	205	190	1 000
Магнит БО-3		09/09/13							8.36	0.96	199	184	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.95	100.12	99.20	-0.88	1	20 000	9.33	0.96	296	281	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.45	99.56					8.62	1.39	196	207	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	99.10	99.80	99.15	-0.65	3	83 265	8.50	1.48	179	195	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	96.21						9.33	1.60	255	278	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00	99.80					9.26	1.67	245	271	9 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.50					21.75	0.82	1551	1 528	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.54	100.44	100.40	0.86	4	26	8.87	0.98	248	234	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	98.90	99.09					11.87	0.65	581	545	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	98.90						9.39	1.08	293	285	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.10	100.15					8.11	0.04			3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	2.05	416	457	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.71	100.00					12.82	0.74	666	637	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	92.00	93.98					12.62	2.39	553	603	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.26	95.50					11.99	1.73	515	544	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	85.00	100.00					8.16	1.84	128	160	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.65	94.74	94.65	-0.09	3	2 050	11.15	1.30	454	460	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	99.95	100.05					8.88	0.25		259	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.50	99.30	98.70	0.20	1	2	9.84	1.32	322	329	3 000
УВЗ													
Уралвагонзавод 1	13/12/12	07/12/17	100.01	100.10	99.88	-0.19	1	8 200	9.89	0.24		362	3 000
Уралвагонзавод 2	27/08/13	20/02/18	99.16	99.57					10.19	0.92	386	368	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.40	100.00					12.34	1.02	592	580	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13							9.76	1.77	291	320	5 000
ГСС													
ГСС 01	19/09/13	26/03/17							8.20	0.95	184	168	5 000
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13			100.00		15	600	8.34	0.26		204	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	93.00	100.00	99.35	-0.65	1	50 000	10.38	0.57	442	398	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	90.16		99.43		6	48	9.45	0.58	348	305	3 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.68	100.50					8.90	0.59	291	250	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.25	102.30	102.25	0.04	1	10	9.80	0.80	358	333	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.50	100.99	100.95		2	32	10.55	2.16	354	398	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.05	100.35					7.50	0.53	159	111	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.64	100.50					7.48	0.53	157	109	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	101.10					8.11	0.44		175	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.60	100.90					8.45	1.79	159	189	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	98.51	99.99					10.56	1.40	389	401	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.01	101.24					10.05	2.23	301	347	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.00	100.64	100.60	0.29	4	4	9.95	2.23	291	337	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.86	100.05	100.00	0.17	14	3 576	12.86	1.01	645	632	3 000
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	100.05	100.00	0.10	15	6 000	12.88	0.93	654	637	3 000
Ю-Тэйр													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.26	102.00					9.37	0.50		300	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.50	101.70					11.44	0.50		507	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.20	99.65					11.76	0.59	577	536	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.20	99.65					11.20	0.59	521	480	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.68	0.69	257	225	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.01						10.38	1.15	387	384	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							8.00	1.17	147	146	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	94.81	98.00					11.65	1.41	498	510	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	94.61	100.10					10.46	1.41	379	391	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16	94.00						8.74	3.23	141	208	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	99.00	99.40	99.00	-0.14	5	5 200	8.50	3.09	120	186	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	99.00	99.20	99.00		2	1 057	8.50	3.09	120	186	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	84.00						6.17	0.43			5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.55	100.75					7.59	0.22		136	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	101.00	100.00	-0.15	1	1	8.67	2.30	161	209	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.50	100.55	100.55	0.05	9	20 000	7.85	0.73	170	141	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	97.50						8.21	1.67	140	166	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	100.00					10.23	1.65	343	368	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.38	89.99					13.66	3.02	638	703	5 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.40	98.00					10.08	1.82	320	352	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	85.50	99.10					8.51	1.42	183	196	4 000
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.68	0.28		138	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.20					8.39	0.77	219	193	5 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.15	98.40	98.15	-0.15	5	24 888	10.55	0.88	425	405	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	87.71	87.78	87.78	0.28	30	6 508	24.82	0.98	1844	1 829	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.74					10.26	1.00	386	372	5 000
Иркутскэнерго													
Иркутэнерго-1		28/11/13							10.12	1.76	327	356	5 000
Иркутэнерго БО-1		08/04/14	86.00	100.30					8.98	1.45	229	243	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.35					8.36	0.94	201	184	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	239	248	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.51	98.60					10.12	0.93	378	361	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.00						9.09	2.48	197	250	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	97.00	97.01					9.58	2.78	237	297	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13							9.10	0.95	274	258	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.11	102.30					8.97	1.10	249	243	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	90.00	100.30					10.54	1.60	376	399	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.00	100.30					13.07	1.70	625	652	4 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.36	99.07					10.18	1.44	349	363	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.43	100.95					9.86	0.74	369	341	2 000
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.23	100.60					8.23	0.37		190	5 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.20	100.35	100.31	-0.09	5	356	9.89	0.95	353	337	2 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14							11.39	1.37	474	484	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	95.20	95.35	95.43	0.05	1	1 000	11.58	1.73	475	503	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14							11.50	0.25		521	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	101.35	101.82	101.60	-0.27	2	122	8.81	0.22		258	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07	102.80	102.80		1	2	8.30	0.44		194	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	97.60	98.99					9.58	4.22	204	278	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.10	99.00					10.13	4.21	259	333	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	97.60	98.45					9.61	4.21	207	281	15 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
СИСТЕМА													
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14		100.20					8.40	1.78	154	184	20 000
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	101.10	101.20	101.50	0.34	3	3 710	4.74	0.20			19 000
АФК Система 1		07/03/13	101.10	101.20	101.10	0.10	3	6 644	7.43	0.47		107	6 000
АФК Система 4		15/03/16	93.05	98.55	98.18	-0.19	12	1 597	8.78	2.02	182	222	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.30	99.69	99.65	-0.02	10	580	11.21	0.81	498	474	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.00	100.70					11.69	0.72	555	525	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.95	100.00	99.99	0.49	9	1 623	10.97	0.05			3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК БО-1	25/06/13	25/06/13		101.05					8.07	0.75	190	162	5 000
РОСБАНК БО-3	16/05/13	16/11/14	100.41	100.64					7.96	0.64	192	154	10 000
РОСБАНК БО-2		08/07/13		99.93					8.23	0.78	202	177	5 000
РОСБАНК АЗ	06/05/11	06/11/13	98.41		98.96	0.46	6	586	8.02	1.08	155	148	5 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14							9.71	1.96	278	315	5 000
АЛЬФА БАНК													
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	98.69	99.97					8.42	1.32	180	187	5 000
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	101.04	101.15	101.04	-0.13	3	12 500	7.85	0.70	173	142	5 000
Альфа-Банк БО7	28/02/14	31/08/15	100.00	100.25	99.98	-0.02	6	22 517	8.80	1.39	214	225	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк БО-1		29/11/12	100.70	100.97					7.81	0.20		162	5 000
МДМ Банк БО-4	16/12/12	16/12/14	100.25	100.30	100.25		7	58 309	8.51	0.24		223	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	97.00	100.25	100.18	-0.08	3	3 746	8.97	0.76	278	251	6 000
МДМ Банк БО-2		21/03/14							8.77	1.39	211	222	5 000
НОМОС Банк													
Номос БО-1	24/02/12	24/02/14	99.81	100.10					9.22	1.37	257	267	5 000
Номос 9	15/06/12	14/06/13	99.95	100.11					9.13	0.72	299	269	5 000
Номос БО-3	09/08/13	09/08/15	100.15	100.30	100.15	0.09	2	35 250	9.15	0.87	286	266	5 000
Номос 11	02/07/14	02/07/14	100.05	100.10					9.68	1.65	288	313	5 000
Номос БО-2	18/04/13	18/10/14	99.45	99.65	99.65		1	1 000	8.80	0.56	285	241	5 000
Номос 12	25/08/13	28/08/17	99.35	100.00	99.65	0.25	1	23 500	9.08	0.92	275	257	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк Зенит БО-2	22/09/12	22/09/13							7.64	0.96	127	112	5 000
Банк Зенит БО-3	15/11/12	15/11/14	100.12	100.18					8.01	0.16		190	3 000
Банк Зенит БО-6	26/11/12	26/05/14	99.83	99.89	99.86	-0.04	6	5 752	8.08	0.19		191	5 000
Банк Зенит БО-4	07/02/13	07/02/15	100.20	100.33					8.36	0.39		202	3 000
Банк Зенит БО-5	14/02/13	14/02/15	100.25	100.30					8.32	0.41		197	3 000
Банк Зенит БО-1	07/04/12	07/04/13	86.00	99.90					7.63	0.53	173	125	5 000
Банк Зенит 5	05/06/12	04/06/13	100.50	100.60	100.50		1	10	8.40	0.69	229	197	5 000
Банк Зенит 6	02/07/13	01/07/14	100.62	100.70					8.51	0.76	232	205	3 000
Банк Зенит 8	28/08/13	23/08/17							9.41	0.98	303	288	00000 000
Банк Зенит БО-7	12/04/14	12/04/15	100.02	100.17	100.10	0.02	2	26 797	9.33	1.44	264	278	5 000
ПРОМСВЯЗЬБАНК													
Промсвязьбанк БО-2	20/02/13	18/02/15	97.00	100.25					8.91	0.42		256	5 000
Промсвязьбанк БО-4	20/02/13	18/02/15	100.01	100.10	100.01	-0.14	5	35 944	8.89	0.42		254	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.50	99.58	99.50		2	5 445	9.13	0.73	298	269	5 000
Промсвязьбанк БО-3		04/02/14	98.95	99.15	99.25	0.04	5	8 252	9.39	1.32	277	284	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18							12.62	4.04	511	584	5 000
Банк СПБ													
Банк СПБ БО-2	26/03/12	23/09/13	99.54	100.10	100.10		2	196	9.09	0.95	273	257	5 000
Банк СПБ БО-1	09/10/12	09/04/13	99.51	100.20					17.77	0.13		1 173	5 000
Банк СПБ БО-4	13/12/12	12/12/13		100.56					8.58	0.24		231	3 000
МКБ													
МКБ 8	10/10/12	08/04/15	100.00	100.25					7.30	0.06			3 000
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.05	100.40					8.92	0.33		260	2 000
МКБ БО-4	15/10/12	15/04/14	99.92	99.98	99.98	0.02	11	12 485	8.30	0.07			5 000
МКБ БО-1	22/02/13	22/02/14	99.83	99.90	99.87	0.01	5	1 696	8.98	0.43		263	3 000
МКБ БО-3	27/04/13	27/04/15	99.80	99.95	99.92	-0.04	2	35 000	9.58	0.58	360	318	4 000
МКБ БО-5		23/06/14	98.00	98.10	98.10		15	18 460	10.66	1.63	387	411	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	101.00	101.35	101.30		1	100	7.46	0.25		116	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00						7.83	0.94	148	131	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.30	101.00	100.35	0.08	2	14 500	8.98	0.91	265	247	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.30	100.55	100.46	-0.09	3	10 001	9.56	1.36	291	301	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.75	99.82	99.82	0.02	24	7 100	9.14	0.96	277	261	5 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.20	100.30					9.46	0.59	347	306	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.10	100.20					9.70	0.79	348	323	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.80	98.90	98.80	-0.10	2	1 500	10.28	0.86	400	379	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	101.21	101.24	101.21	0.01	7	16 369	10.85	1.16	433	431	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					11.43	1.17	490	489	3 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.10	100.40					11.19	1.22	463	465	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	100.65	101.60					11.15	2.03	419	459	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.90	101.75	101.00	-0.65	1	2 500	11.48	2.13	448	491	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.30	98.40	98.30		13	7 975	12.32	0.85	604	583	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.40	100.50	100.50		3	559	12.63	0.86	635	614	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БО-3	21/08/12	18/02/14	100.03	100.10	100.18	0.18	5	22	14.31	1.32	769	776	2 000
ТКС БО-4	18/04/13	16/04/15	99.77	100.09	100.00	0.01	2	20	13.63	0.55	770	724	2 000
ТКС БО-6	16/07/13	14/07/15	100.02	100.14	100.14	0.04	18	6 383	14.11	0.79	789	764	2 000
ТКС 2		28/07/13	105.01	105.29	105.30	0.31	15	2 883	13.61	0.81	737	714	1 000
ТКС БО-1		20/09/13							14.14	0.91	781	763	2 000
ТКС БО-2	29/11/11	26/11/13	102.21	102.35	102.34	0.14	30	13 295	14.74	1.08	828	820	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.96	100.14	100.01	-0.14	32	18 293	14.69	0.85	841	820	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.10	100.29	100.20	-0.01	3	2 843	9.20	0.15		311	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.08					7.63	1.06	118	109	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	86.00	101.25					8.07	1.30	146	152	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.00	1.35	136	145	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.50					8.60	2.22	157	202	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00						8.13	0.15		203	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	99.90	100.00	99.90	-0.20	8	4 603	8.79	0.93	245	228	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	94.10	99.95					8.73	0.94	237	221	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	98.75					9.08	0.94	273	256	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.64	1.17	212	210	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00	98.00					9.16	3.61	174	244	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	101.03	101.15					8.00	1.15	149	146	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.60	102.00					7.90	1.19	136	136	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		218	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.28	100.38	100.38	0.05	13	35 099	8.27	0.14		220	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15							8.99	0.50		262	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	99.81	100.25	100.14	-0.05	1	1	9.46	1.06	301	292	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-2	27/09/12	25/09/14	100.08	100.20	100.10	-0.30	3	16 850	6.32	0.02			2 000
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.58	0.48		121	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.35	100.64	100.62	0.09	2	9 000	10.67	0.87	438	418	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	99.89					10.34	1.01	393	380	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	99.76	100.00					9.05	0.23		280	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.75	100.10	100.05	0.30	2	39 980	8.67	0.56	272	228	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	85.00	100.20					9.01	1.05	257	247	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.80	100.00					10.16	2.29	310	358	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14							8.44	1.42	176	189	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.12	100.15	100.12	0.02	3	25 000	9.33	0.97	295	280	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.12	100.15	100.11	-0.09	1	12 000	9.34	0.98	296	281	2 000
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.50	99.00					9.20	0.78	300	274	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.51	100.00					9.22	0.95	286	270	4 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.00	98.70					9.26	1.09	279	272	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15							9.75	1.10	328	321	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.30	100.39	100.34	0.08	7	50 080	9.02	0.86	273	253	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	96.60	97.30					9.29	1.64	249	274	5 000
Дельта Кредит 8	05/11/14	02/11/16											5 000
ОТП Банк													
ОТП Банк БО-3	01/11/12	30/10/14	100.23	100.25	100.25		12	110 200	8.38	0.12		235	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	99.56	100.00	99.80	-0.04	1	5 000	10.93	1.38	427	438	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	96.51	97.60	97.16		10	472	10.59	1.40	392	404	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.41	95.70					10.95	1.75	411	440	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.20	100.80					5.02	0.21			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60						10.49	0.67	441	406	3 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.95	100.00	99.96	0.01	1	5 000	8.94	0.06			2 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	98.10	99.25	99.25	-0.15	7	24 007	9.68	0.79	347	322	2 000
КредитЕвропа Банк													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.83	1.35	319	328	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.05	100.25					10.23	1.33	360	368	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	96.71	97.30	97.25	-0.01	5	834	10.23	1.49	351	368	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.80	100.24					9.29	1.00	289	275	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.45	100.58	100.55	0.07	3	30 000	9.83	0.74	366	338	3 000
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.97	0.25		168	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.97	0.25		168	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	99.80	100.14					9.81	0.56	387	342	2 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.71	101.00	100.30	-0.50	2	915	7.34	0.25		104	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	86.00	101.00					7.56	0.58	159	116	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	261	313	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/12	19/04/14	99.77	99.90					12.43	0.08		648	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.50	100.05	100.05		1	120	11.16	0.45		480	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.52	100.00					11.29	0.98	491	476	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14		100.15					9.13	0.38		279	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	100.05	100.45	100.23	0.48	1	15 000	10.56	0.54	464	417	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.05	100.14	100.14	0.04	2	811	9.68	0.25		338	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.01	97.00	97.00	0.20	3	30 000	10.03	1.75	319	348	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.25	100.35	100.23	0.03	1	5 000	9.07	0.19		290	3 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	86.00	100.31	100.20	-0.10	1	3 000	9.43	0.39		309	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00		100.14	0.05	4	31	10.14	0.82	389	366	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	99.75	100.25	100.10	-0.03	3	15 001	10.89	0.88	459	439	3 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.69	100.00					10.04	0.26		374	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.30	100.50	100.32		3	12 050	12.45	0.88	615	595	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.60	100.20	100.20	0.20	1	6 000	10.85	1.20	431	431	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.86	100.03	100.02		2	11 000	8.52	0.08			2 000
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.05	100.67					9.67	0.20		348	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.80	100.00					10.12	0.24		385	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.01	100.20	100.01	-0.24	1	2 000	11.53	0.42		518	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.00	100.30	100.00		2	143	10.52	0.44		416	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.60	99.65	99.65	0.02	2	2 050	12.01	0.53	611	563	2 000

РЕГИОНАЛЬНЫЕ

МОСКВА

Москва 54	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#N/A The record could not be found	#3HAЧ!	#3HAЧ!	#3HAЧ!	found 000
Москва 61	03/06/13	106.00	106.19	106.19	5.11	2	30	6.12	0.68	2		30 000
Москва 53	01/09/13	100.00	100.25					6.89	0.94	54	37	15 000
Москва 63	10/12/13	109.38	110.23					6.42	1.15			15 000
Москва 62	08/06/14	108.10	108.85	108.85	0.60	8	856	7.11	1.58	35	56	35 000
Москва 39	21/07/14	92.41						7.51	1.74	67	96	10 000
Москва 64	24/06/15	97.90	99.10					7.49	2.52	36	89	20 000
Москва 44	16/11/15							7.58	2.63	41	98	40 000
Москва 56	22/09/16							8.26	3.44	88	157	20 000
Москва 49	14/06/17	96.00	97.00	95.70	-1.79	1	6	8.27	4.02	77	150	25 000
Москва 48	11/06/22	89.50	89.99					8.33	6.95	39	113	30 000

МОС ОБЛ

Московская Обл 8	11/06/13	100.85	109.90	101.50	-1.05	1	10	6.95	0.71	82	51	19 000
Московская Обл 7	16/04/14	99.41	99.70	99.70	0.24	5	15 520	8.37	1.46	167	182	16 000

НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ

Нижегородская Обл 5	02/12/12	100.90	101.35					7.23	0.21		103	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12	98.52	100.10	100.10	0.28	1	27	7.16	0.16		104	3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15	99.80	100.15					8.28	1.83	140	172	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16	102.90	103.19					8.72	2.29	166	214	8 000

САМАРСКАЯ ОБЛ

Самарская Обл 5	19/12/13							7.84	1.17	131	130	8 000
-----------------	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Самарская Обл 6		10/05/13	104.40	104.70	104.64	0.01	2	25 500	7.72	0.62	170	131	2 000
Самарская Обл 7		30/11/16	97.82	97.92	97.92		1	1	8.74	2.17	172	217	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.75	100.20	100.20		8	33 150	7.48	0.31		117	3 000
Якутия 9		19/09/13							7.37	0.54	146	98	2 000
Якутия 7		17/04/14	98.02	100.62					8.12	1.22	156	158	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12	86.00	99.85						0.33			2 000
Краснодар 02		05/11/15	100.60	101.95					8.68	1.24	211	214	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14							8.18	1.40	151	163	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4		08/11/12	100.15	100.70	100.45	-0.10	9	92 200	7.28	0.14		121	10 000
Красноярский край 5		29/11/16	101.85	101.95	101.85	0.10	15	120 741	8.10	1.59	133	155	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	98.05	100.50					6.93	0.65	86	51	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	98.70					9.16	1.47	246	261	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	81.02	95.00					8.51	2.39	142	192	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							9.01	2.43	191	242	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.50	104.30					8.65	2.56	150	205	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12							7.28	0.25		99	3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.81	101.49	101.01	-0.20	1	6 534	9.28	1.94	235	272	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16							9.60	2.33	253	302	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.50	103.50	101.50	-0.30	2	5 000	9.21	1.79	235	265	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	99.35	100.40					7.49	0.64	144	107	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.00	99.50	99.55		1	15 000	8.19	1.24	162	165	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.00	100.50					8.95	2.29	189	237	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	99.30	100.00	100.00		2	2 000	8.42	1.20	187	188	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	100.80	101.35					6.40	0.25		10	2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	103.90	104.75	103.90	-0.40	1	21	7.60	1.18	107	106	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	87.00	103.01					8.69	1.90	178	213	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 5		26/12/13							8.84	1.15	233	230	4 000
Тверская Обл 6		12/06/14	103.00	103.95					8.02	0.89	171	152	3 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.10	98.39	98.25		1	57	9.52	2.58	237	292	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



Результаты торгов еврообондами

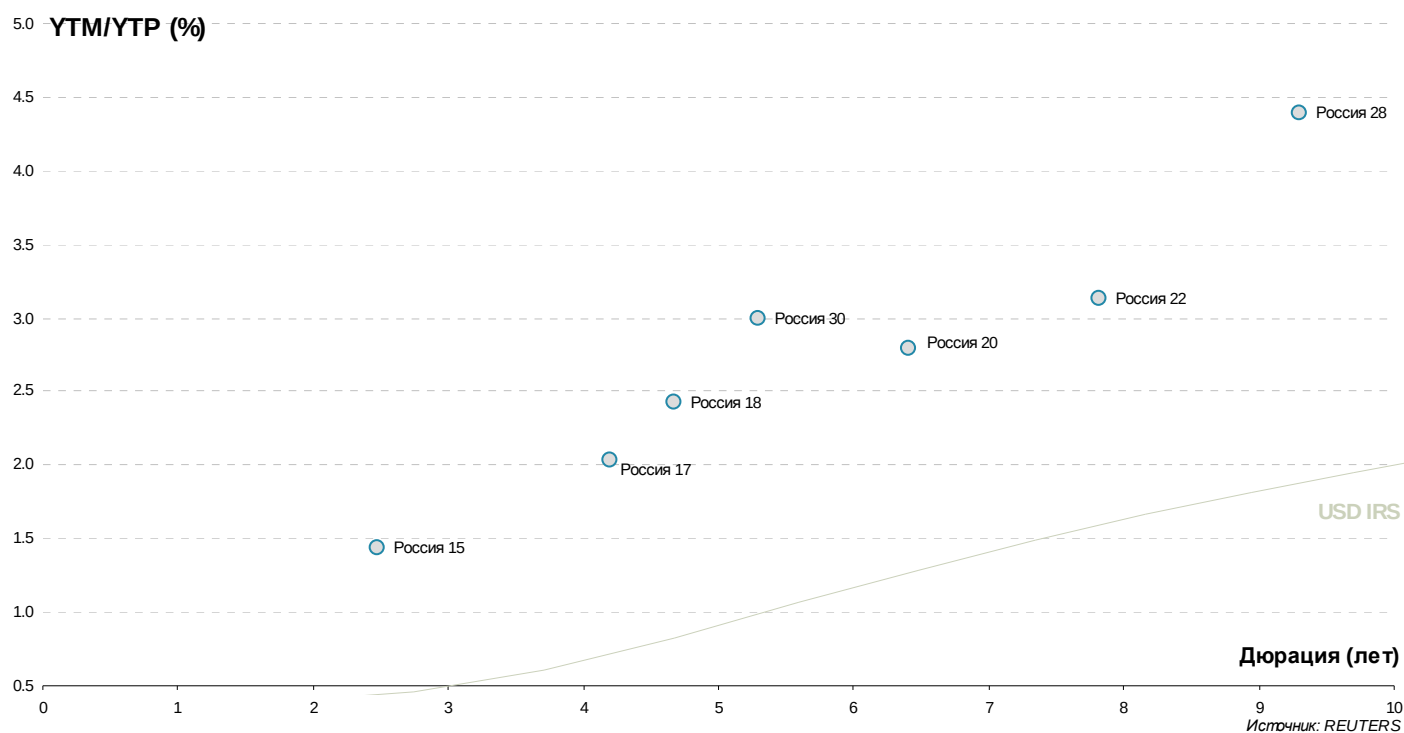
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
РОССИЯ										
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		105.375	105.750	1.51	1.37	2.48	0.25	109
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.000	105.500	2.09	1.98	4.20		138
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		145.833	147.111	2.51	2.33	4.67	0.24	158
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		125.245	125.494	3.01	2.97	5.30	0.15	158
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		114.875	115.250	2.81	2.76	6.41	0.50	147
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		111.000	111.375	3.16	3.11	7.82	0.50	149
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		193.592	194.908	4.43	4.36	9.30	0.19	238
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		118.000	118.625	4.52	4.48	15.54	0.75	197
ГОСКOMPАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.577	101.702	1.78	1.57	0.58		143
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		102.625	103.125	1.07	0.23	0.58		71
RBS D'13 9.625%	USD	01/03/13		103.500	103.750	1.68	1.14	0.44	0.05	132
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		103.000	103.500	1.89	1.01	0.54		155
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		105.079	105.398	1.52	1.17	0.84	0.08	118
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		111.630	112.380	2.63	2.15	1.39	-0.25	229
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		111.630	112.380	2.39	1.90	1.38		206
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		110.541	110.788	2.29	2.17	1.75	0.11	193
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.836	107.332	2.83	2.68	2.95	0.03	237
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.936	112.407	3.13	3.02	3.70	-0.15	252
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.073	123.068	3.71	3.54	4.55	-0.18	283
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.869	131.571	3.89	3.79	5.15	-0.17	282
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.469	119.488	4.13	4.01	7.41	0.19	254
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		142.254	143.300	5.31	5.25	11.64	0.38	302
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		127.286	127.787	5.30	5.27	13.18	0.48	291
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		105.164	107.164	1.74	-0.44	0.86	-0.02	140
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.827	106.326	1.60	1.27	1.42	0.16	124
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		130.374	130.749	3.02	2.96	4.85	-0.06	207
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.570	112.056	2.99	2.88	3.99	-0.39	230
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		101.512	102.512	5.03	4.81	4.44	-0.48	427
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		100.500	100.650	1.89	0.58	0.11	0.15	170
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.373	107.867	3.31	3.11	2.31	0.01	293
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		107.245	107.620	4.78	4.71	4.68	-0.22	394
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		109.454	109.953	4.95	4.85	4.76	-0.20	406
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		107.918	108.420	5.33	5.26	6.30	-0.23	399
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.996	107.493	5.70	5.66	12.63	-0.45	335
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.998	103.248	2.61	2.22	0.63		227
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.250	106.750	4.02	3.81	2.32	-0.25	364
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.119	100.119	7.09	6.64	2.32	0.02	681
ВЭБ										
VEB LEAS'16 5.125%	USD	27/05/16		104.003	104.303	3.95	3.86	3.36	-0.49	343
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.308	109.809	3.47	3.37	4.53	-0.27	265
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.505	119.005	4.10	4.04	6.25	-0.25	278
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		119.126	119.627	4.82	4.77	9.13	-0.15	284
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		104.375	104.750	2.16	1.69	0.75	-0.13	182
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.239	106.589	3.33	3.17	2.09	-0.22	296
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.313	108.711	3.56	3.43	2.71	-0.12	313
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		103.570	103.945	1.65	1.09	0.64	-0.19	131
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		106.009	106.507	2.45	2.08	1.27	-0.12	210
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		111.041	111.439	2.41	2.19	1.61	-0.33	206
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.647	111.147	3.78	3.67	4.06	-0.70	308
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.957	119.458	3.99	3.90	4.71	-0.45	309
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		102.490	103.115	5.25	5.06	3.32	-0.50	476
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		103.320	103.570	1.33	0.96	0.64	-0.06	98
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.650	104.025	1.74	1.27	0.77	-0.22	139
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.934	108.233	2.54	2.43	2.61	0.01	212
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.091	108.590	3.45	3.33	3.99	-0.33	277
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.975	109.600	4.46	4.38	6.99	0.26	298

ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ

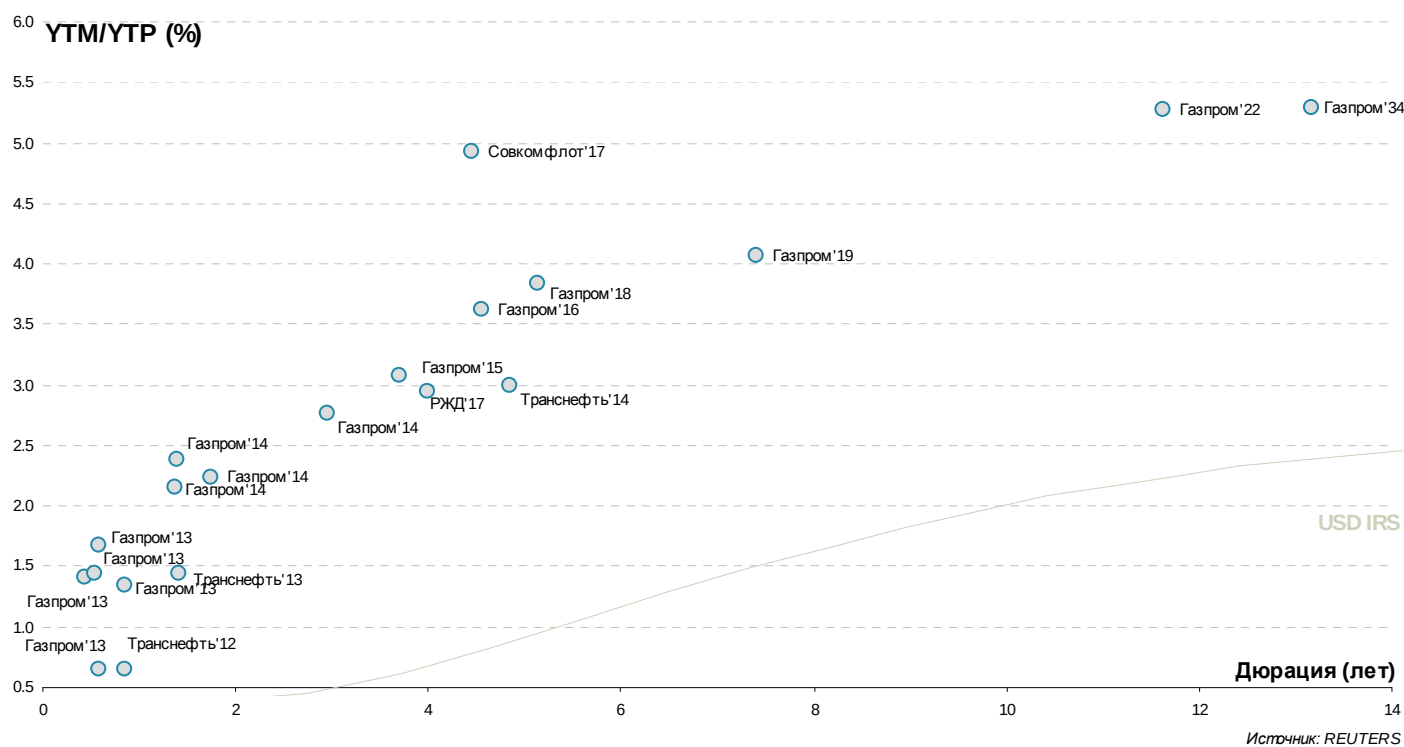
Евраз

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		103.600	103.850	2.69	2.28	0.57	-0.06	237
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.625	110.250	4.90	4.69	2.77	0.08	449
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		112.875	113.375	6.70	6.60	4.39	-0.42	591
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		101.375	101.625	6.45	6.40	4.64	-0.03	563
Альянс Ойл										
ALLIANCE OIL'15 9.875%	USD	11/03/15		106.500	107.500	6.97	6.54	2.26		667
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		111.300	111.781	3.39	3.17	1.97	-0.02	303
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		112.842	113.847	5.75	5.60	6.15	-0.24	443
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		103.450	103.825	2.61	2.01	0.59	-0.05	228
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		105.710	105.710	4.64	4.64	3.06	-0.29	419
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.149	111.664	4.89	4.75	3.19	-0.32	441
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		116.181	116.693	5.71	5.61	4.47	-0.42	488
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.000	110.000	6.34	6.20	6.36	2.12	499
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.743	109.042	2.14	2.00	1.98	-0.02	176
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.962	114.367	3.14	3.06	4.12	0.08	242
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		121.084	121.599	3.84	3.76	5.71	-0.34	263
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		114.016	114.525	4.08	4.01	6.52	0.14	269
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.173	120.936	4.11	4.03	7.43	0.44	248
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		122.478	122.993	5.08	5.01	5.92	-0.33	381
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.767	107.067	3.19	3.10	3.12	-0.23	271
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.500	118.000	4.11	4.05	6.68	-0.13	269
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.700	106.950	1.82	1.54	0.83	0.18	147
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.625	110.000	2.96	2.73	1.46	1.54	262
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		107.138	107.640	5.09	4.98	4.32	-0.25	433
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.725	103.725	7.13	6.90	4.45	-0.25	639
ТНК										
TNK-BP'13 7.5%	USD	13/03/13		103.002	106.002	1.18	-4.77			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.058	109.002	2.71	2.31	2.22	-0.13	232
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		116.264	116.771	2.97	2.84	3.40	-0.15	242
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.799	114.814	3.30	3.07	4.00	-0.16	263
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.659	122.699	3.50	3.31	4.65	-0.17	263
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.721	122.792	3.84	3.69	5.96	-0.13	258
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		105.000	105.250	2.54	2.22	0.74	-0.13	221
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		107.163	108.155	4.91	4.50	2.31	0.14	456
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		108.990	109.990	5.78	5.56	4.13	-0.40	507
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		101.500	101.625	2.86	2.35	0.24		252
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		102.029	102.529	4.55	4.09	1.04		426
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		105.756	106.756	6.65	6.30	2.69	-0.24	630
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.999	105.249	4.43	4.13	0.79		413
PSB FINANC'14 6.2%	USD	25/04/14		100.243	100.743	6.03	5.70	1.51		577
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		110.995	111.995	8.10	7.71	2.30	0.73	784
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		106.992	108.992	9.03	8.43	3.16	-0.12	867
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.253	103.753	4.72	4.37	1.44		441

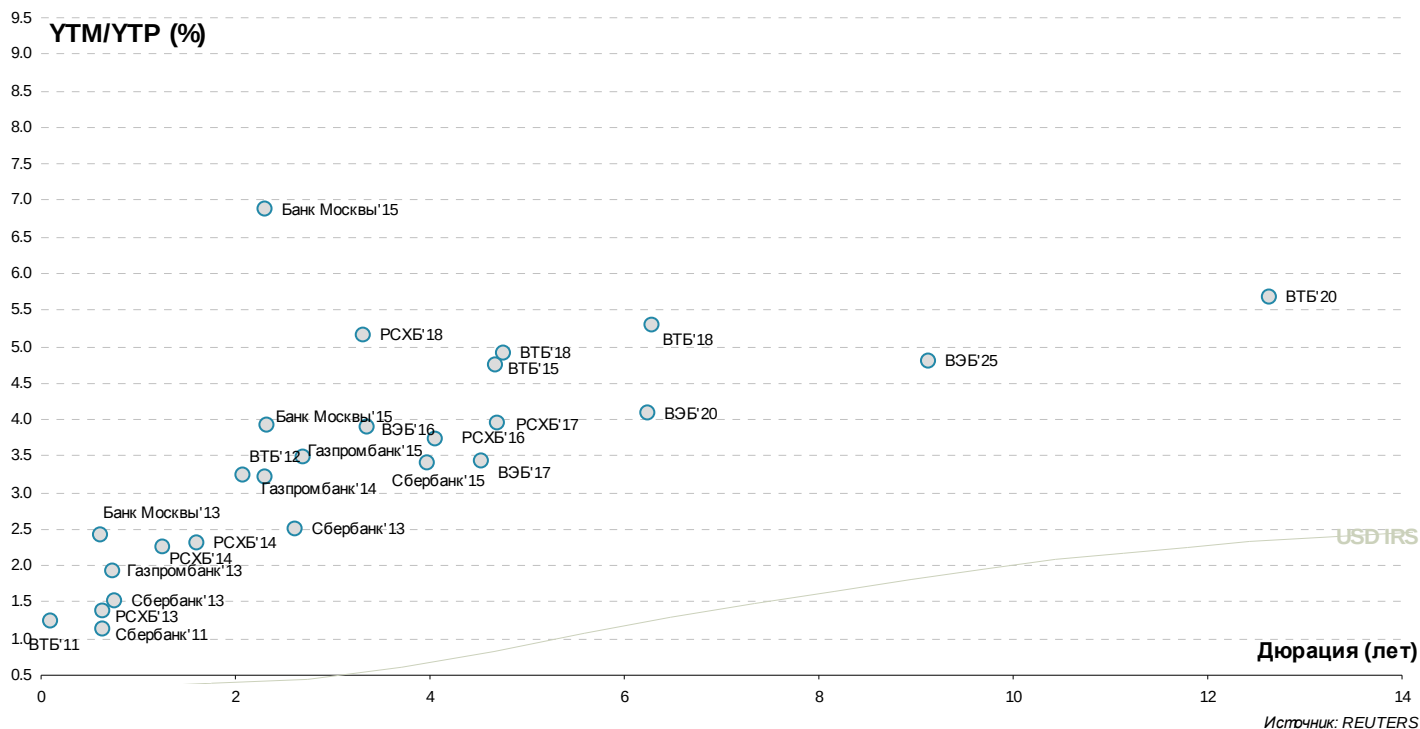
Россия



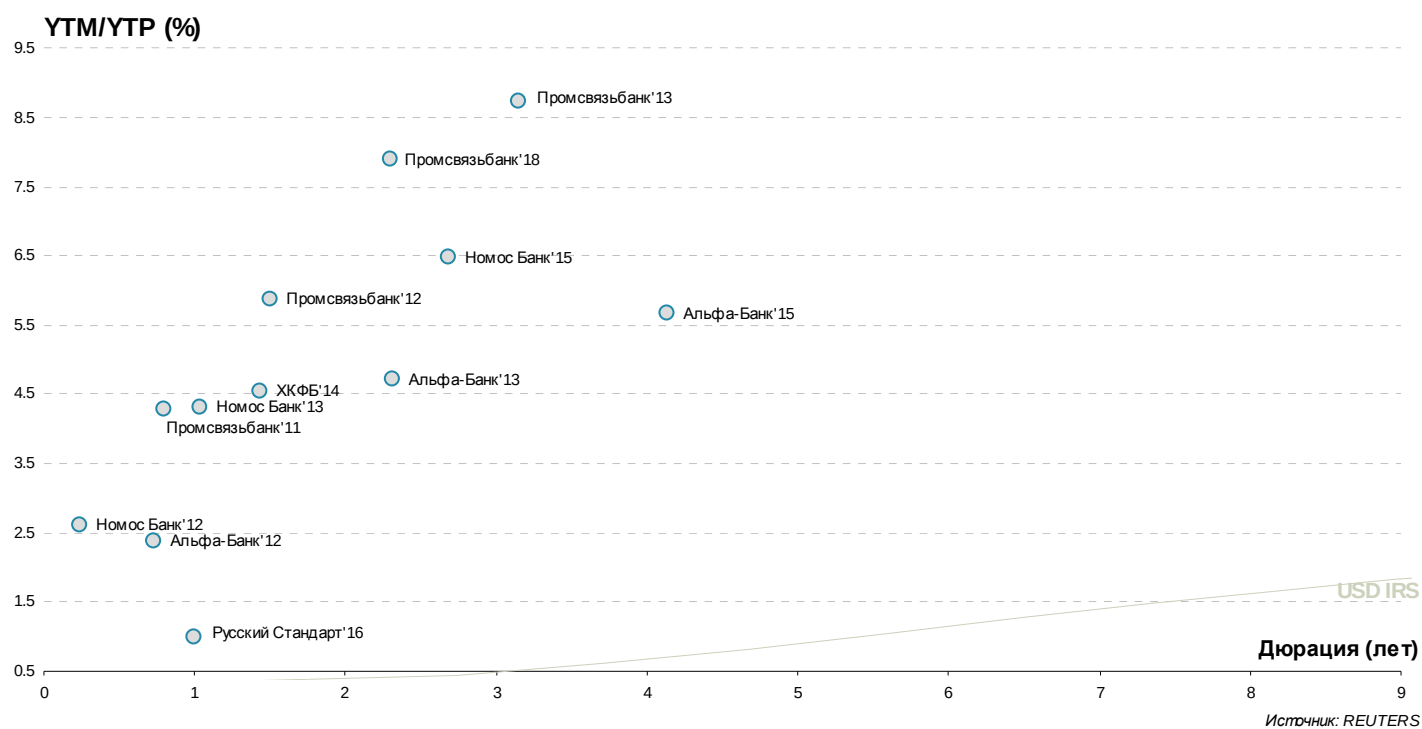
Госкомпании



Госбанки



Частные банки



Инвестиционный Департамент

Россия, 129110, Москва, Банный пер, дом 9
тел. 7 495 937 07 37, факс 7 495 937 07 36
WEB: <http://www.zenit.ru>

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

kopelovich@zenit.ru
konstantin.pospelov@zenit.ru

Управление продаж

Валютные и рублевые облигации
Валютные и рублевые облигации
Валютные и рублевые облигации
Валютные и рублевые облигации

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

j.shabanova@zenit.ru
m.simagin@zenit.ru
a.valkanov@zenit.ru
y.parshina@zenit.ru

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

v.evstifeev@zenit.ru
k.sychev@zenit.ru
e.cherdakov@zenit.ru
d.chepragin@zenit.ru
eugenia.lobacheva@zenit.ru

Управление рынков долгового капитала

ibcm@zenit.ru

Рублевые облигации

Денис Ручкин
Андрей Пашкевич
Фарида Ахметова
Марина Никишова
Вера Панова
Алексей Басов
Екатерина Гашигулина

d.ruchkin@zenit.ru
a.pashkevich@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
[e.gashigullina@zenit.ru](mailto.e.gashigullina@zenit.ru)

Каждый аналитик, задействованный в написании данного обзора, подтверждает, что все положения отражают его собственное мнение в отношении финансовых инструментов или эмитентов. Вознаграждение аналитиков не связано напрямую или косвенно с мнениями или рекомендациями, изложенными в данном обзоре. Банк ЗЕНИТ не несет ответственности за операции третьих лиц, совершенные на основе мнений аналитиков, изложенных в данном обзоре. Мнение Банка может не совпадать с мнением аналитика, изложенным в данном обзоре.

Информация, представленная в обзоре, основана на источниках, которые Банк ЗЕНИТ признает надежными, тем не менее, Банк не несет ответственности за ее достоверность и полноту. Описания финансовых инструментов и эмитентов не претендуют на полноту. Прошлые показатели не являются гарантией своего повторения в будущем. Обзор не имеет отношения к инвестиционным целям или финансовой ситуации третьих лиц. Все мнения и рекомендации, основанные на представленной информации, соответствуют дате выхода обзора и могут быть изменены без уведомления. Обзор предоставляется исключительно в информационных целях и не является предложением купить или продать соответствующие финансовые инструменты. Инвесторы должны самостоятельно принимать инвестиционные решения, используя обзор лишь в качестве одного из средств, способствующих принятию взвешенных решений. Обзор подготовлен Банком ЗЕНИТ для распространения среди профессиональных участников рынка и институциональных инвесторов. Не являющиеся профессиональными участниками инвесторы должны искать возможность дополнительной консультации перед принятием инвестиционного решения. Обзор может содержать информацию и рекомендации касательно финансовых инструментов, недоступных для покупки или продажи непрофессиональными участниками рынка.

Банк ЗЕНИТ может выступать маркетмейкером по одному или нескольким финансовым инструментам, упомянутым в данном обзоре и иметь по ним длинные или короткие позиции. Банк ЗЕНИТ также может предоставлять услуги финансового советника и выступать организатором и андеррайтером по проектам корпоративного финансирования одной из указанных в обзоре компаний.

Дополнительная информация и сопроводительная документация может быть предоставлена по запросу. © 2012 Банк ЗЕНИТ.