

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки сохраняют позитивный запал в надеждах на саммит ЕС

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Стаки МБК близки к локальным максимумам
- Рубль продолжает медленное укрепление

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды подешевели на фоне роста доходностей UST
- Локальный рынок на волне роста

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

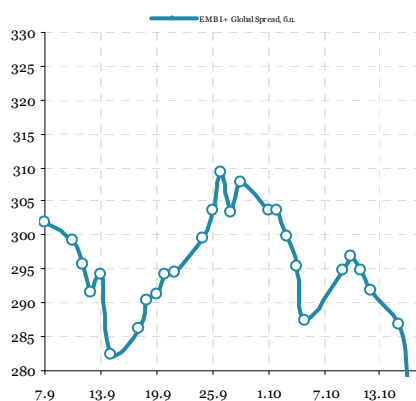
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.82	▲	0.10	1.39
UST 10-2Y sprd	152	▲	7	117
EMBI+ Glob.	272	▼	-7	272
EMBI+ Rus sprd	143	▼	-6	151
Russia'30 yield	2.74	▲	0.01	2.72
Денежный рынок				
Libor-3m	0.32	▼	0.00	0.32
Euribor-3m	0.21	▼	0.00	0.21
MosPrime-1m	6.63	▼	-0.06	5.86
Корсчета в ЦБ	934.5	▲	57.1	446
Депоз. в ЦБ	85.4	▲	11.1	61
NDF RU 3m	6.3	▼	0.0	6
Валютный рынок				
USD/RUB	30.757	▼	-0.114	29.31
EUR/RUB	40.357	▲	0.072	38.70
EUR/USD	1.312	▲	0.006	1.21
Корзина ЦБ	35.012	▼	-0.021	33.54
DXU Индекс	79.016	▼	-0.389	78.71
Фондовые индексы				
RTS	1514.0	▲	0.6%	1228
Dow Jones	13557.0	▲	0.04%	12101
DAX	7400.0	▲	0.07%	5969
Nikkei 225	8807	▲	2.00%	8296
Shanghai Comp.	2105.6	▲	1.24%	2004
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	112.2	▼	-0.04%	88
Нефть Brent	113.2	▼	-0.26%	89
Золото	1750.2	▼	-0.15%	1540
CRB Index	307.8	▲	0.53%	267

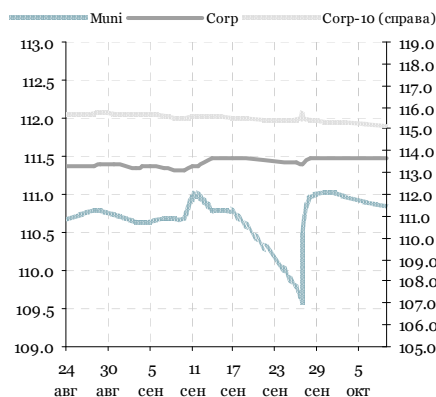
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	117.5	▲	0.52	107.5
Muni	110.8	▼	-0.11	109.6
Corp	111.5	▼	-0.02	110.7
Corp-10	115.1	▼	-0.26	115.1
Total Return				
OFZ	270.6	▲	2.87	233.3
Muni	345.7	▲	0.26	324.8
Corp	344.8	▲	0.66	323.6
Corp-10	345.2	▲	0.51	324.6
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	411	▼	-326	0
Muni	1 015	▼	-332	10
Corp	7 234	▲	998	19

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Минфин РФ разместил пятнадцатилетние ОФЗ серии 26207 на сумму 19,6 млрд руб. при объеме предложения 20 млрд руб. и объеме спроса 118,8 млрд руб., а также пятилетние ОФЗ серии 25080 на сумму 19,1 млрд руб. при объеме предложения 20 млрд руб. и объеме спроса 38,4 млрд руб. Доходность по цене отсечения по ОФЗ 26207 составила 7,91% годовых и по средневзвешенной цене - 7,9% годовых, а по ОФЗ 25080 - 6,99% годовых и 6,98% годовых соответственно.

Банк ВТБ разместил еврооблигации на 1 млрд. юаней с погашением в 2015 году с доходностью 4,5% годовых. Спрос на бумаги превысил предложение в 1,5 раза. /Финам/

ОАО «ВЭБ-лизинг» 23 октября текущего года планирует начать размещение 2-х выпусков облигаций USD-05 и USD-06 по 100 млн долл. каждый. /Финам/

ОАО «АИЖК» приняло решение разместить три выпуска облигаций серии А28 на общую сумму 4 млрд руб. со сроком погашения 15.01.2029 г., облигации серии А29 на общую сумму 5 млрд руб. со сроком погашения 15.10.2030 г. и облигации серии А30 на общую сумму 6 млрд руб. со сроками погашения: 50% от номинальной стоимости облигаций - 01.03.2031 г., 30% - 01.03.2032 г. и 20% - 01.03.2033 г. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 17.10.2012 – среда

Статистика США: Housing starts, Building permits

- **Выплата купона:** Россия, 25067 (11.3%, 1.2 млрд руб.), ING Commercial Banking Россия, 01 (8.03%, 101.2 млн руб.), Ростелеком, 13 (6.5%, 32.4 млн руб.), РОСНАНО, 04 (8.6%, 428.8 млн руб.), РОСНАНО, 05 (8.6%, 428.8 млн руб.), Чувашия, 34009 (9.25%, 34.6 млн руб.), Московская область, 26007 (8%, 638.2 млн руб.), ХКФ Банк, 05 (8.5%, 84.7 млн руб.), Россия, 26200 (6.1%, 760.5 млн руб.), Объединенные кондитеры-Финанс, 02 (10.5%, 157 млн руб.), Россия, 26201 (6.55%, 767.5 млн руб.)
- **Оферта:** ВБД ПП, БО-01 (3 млрд руб.), ВБД ПП, БО-02 (3 млрд долл.), ВБД ПП, БО-03 (3 млрд руб.), ВБД ПП, БО-08 (5 млрд руб.), Московский Кредитный банк, 08 (3 млрд руб.), Новоластунское, 01 (23 млн руб.), АИЖК, 22 (15 млрд долл.)
- **Погашение:** Россия, 25067 (45 млрд руб.), Ростелеком, 13 (2 млрд руб.)
- **Размещение:** МРСК Центра, БО-01 (4 млрд руб.)

Сегодня: 18.10.2012 – четверг

Статистика России: Unemployment Rate, Retail sales

Статистика США: Initial jobless claims, Continuing claims

Статистика Китая: Industrial production, Real GDP

- **Выплата купона:** Мой Банк, 05 (12%, 299.2 млн руб.), СИБМЕТИНВЕСТ, 01 (13.5%, 673.2 млн руб.), ТрансКредитБанк, 06 (8.25%, 164.5 млн руб.), Восточный Экспресс Банк, БО-05 (10%, 99.7 млн руб.), ИФК РФА-Инвест, 02 (8.2%, 20.4 млн руб.), ТКС Банк, БО-04 (13.25%, 99.1 млн руб.), КИТ Финанс Капитал, 01 (11%, 16.5 млн руб.), Республика Коми, 34009 (7.5%, 78.9 млн руб.), КБ Центр-инвест, БО-02 (9.7%, 72.5 млн руб.), НОМОС-БАНК, БО-02 (8%, 200.5 млн руб.), Татфондбанк, БО-02 (8.75%, 87 млн руб.), Ростелеком, 14 (11.4%, 28.4 млн руб.), Связь-Банк, 05 (9.5%, 236.8 млн руб.), ИнтрастБанк, 01 (12.5%, 31.3 млн руб.), ВТБ, 05 (7.4%, 276.7 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 35002 (7.8%, 34 млн руб.), МТС, 01 (7%, 349 млн руб.), КБ МИА (ОАО), 05 (7.9%, 39.4 млн руб.)
- **Оферта:** Банк Национальная Факторинговая Компания (ЗАО), БО-01 (2 млрд руб.), КБ МИА (ОАО), 04 (2 млрд долл.)
- **Погашение:** Ростелеком, 14 (1 млрд руб.)
- **Размещение:** АК БАРС БАНК, БО-01 (500 млн руб.), Газпромбанк, 10 (10 млрд руб.), Газпромбанк, 11 (10 млрд руб.), Газпромбанк, 12 (10 млрд руб.), Внешэкономбанк, 19 (10 млрд руб.)

Завтра: 19.10.2012 – пятница

- **Выплата купона:** Крайинвестбанк, БО-01 (9.25%, 69.6 млн руб.), ОПК "ОБОРОНПРОМ", 01 (8%, 841.3 млн руб.), СЗКК, 03 (6.73%, 167.8 млн руб.), СЗКК, 04 (6.73%, 167.8 млн руб.), Каркаде, 02 (13%, 48.6 млн руб.), Северсталь, 2014 (LPN) (9.25%, 17.3 млн долл.), КБ Нефтяной альянс, 01 (11%, 13.8 млн руб.), ДельтаКредит, 2035-A (RMBS, FRN) (1.269%, 39.7 тыс руб.)
- **Оферта:** Мечел, 05 (5 млрд руб.), Московский Кредитный банк, БО-04 (5 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Рынки сохраняют позитивный запал в надеждах на саммит ЕС

Глобальные рынки остаются в рамках растущего тренда уже третий день подряд. Настроения инвесторов определяет неплохая статистика из США, поддерживающие новости по Испании, а также надежды на эффективность стартового сегодня 2-дневного саммита лидеров ЕС.

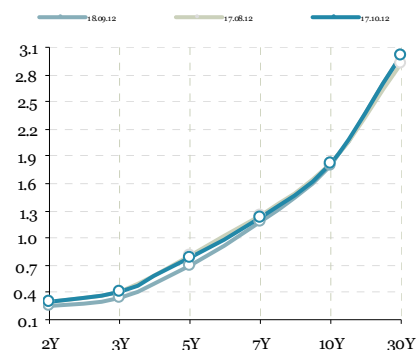
В среду утром поддержать оптимизм на рынках смогло сообщение агентства Moody's, которое завершило пересмотр суверенного рейтинга страны и, отказавшись от его дальнейшего понижения, подтвердило оценку на уровне «Ваа3» с сохранением негативного прогноза. Позже, в пику мнению Ангелы Меркель, французский президент заявил о том, что Испании вправе узнать мнение не после обращения за финансовой помощью, а до. С одной стороны это является очередным свидетельством разногласий ключевых лидеров ЕС в преддверии саммита, с другой – видимостью каких-либо подвижек в этом вопросе.

Статистика из США вчера также сохраняла поддержку рискованных стратегий. Сектор недвижимости в стране подает все более отчетливые признаки начала восстановления после продолжительной стагнации. Так, число домов, возведение которых началось в сентябре, выросло на 15% к августу, составив 872 тыс. Судя по уже опубликованным отчетам американских банков, объемы ипотечного кредитования в прошлом квартале заметно возросли, что позволяет надеяться здесь на дальнейшее улучшение.

Сегодня стартует саммит ЕС, ключевыми темами которого должны стать развитие идеи создания единого банковского регулятора в регионе, а также ситуации в Греции. Испании должно быть отведено меньше времени, поскольку основные чиновники страны ранее отвергали идею о скором обращении за помощью.

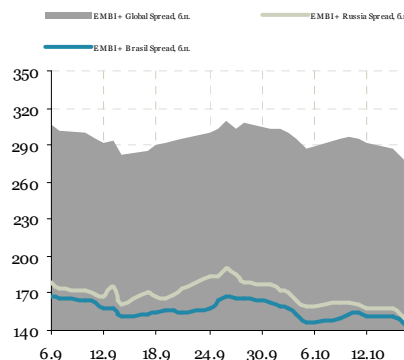
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



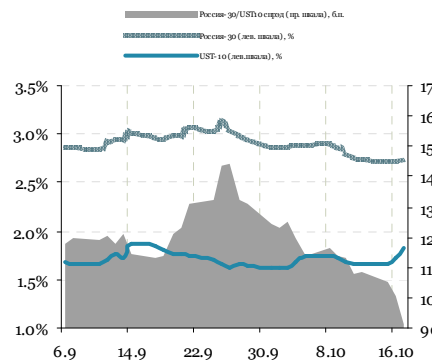
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



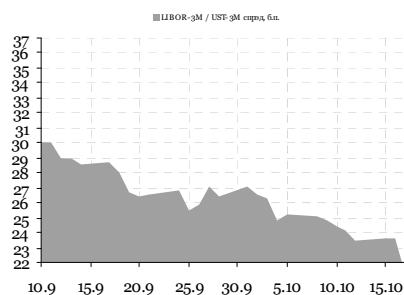
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Стаки МБК близки к локальным максимумам

Условия локального денежно-кредитного рынка вчера существенно не изменились ввиду отсутствия важных событий на рынке. Ставки по кредитам овернайт на рынке МБК держались на уровне 6.25% годовых, междилерское репо на 1 день обходилось в среднем под 6.30% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ регулятор полностью удовлетворил заявки на 1-дневные операции на сумму 144 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 68.2 млрд руб., составив 1019.9 млрд руб.

Следующий налоговый платеж должен завершиться в начале следующей недели, когда пройдет уплата НДС. До этого периода условия рынка, вероятно, останутся неизменными, а ставки по 1-дневным кредитам МБК в пределах 6.00-6.50% годовых.

Рубль продолжает медленное укрепление

Торги на валютном рынке вчера завершились вновь в пользу рубля, который укрепился по отношению к бивалютной корзине еще на 5 коп. до отметки 35.07 руб. Внешний фон оставался поддерживающим, несмотря на понижательную коррекцию в нефтяных котировках, после публикации данных о запасах нефти в США. За день стоимость барреля Brent снизилась почти на 2 долл. до отметки 113.7 долл. Сохранение спроса на риск на международных площадках и дефицит ликвидности на внутреннем денежно-кредитном рынке остаются основными факторами для динамики рубля.

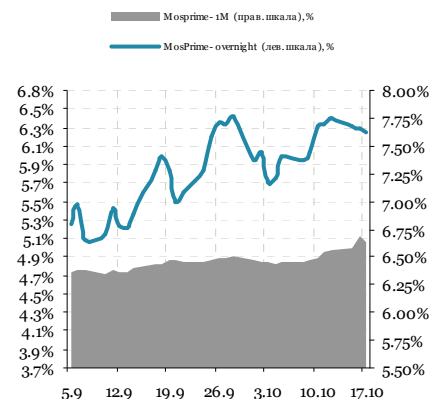
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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.)
Вторник	Аукцион Казначейства	37 млрд руб. на 3 месяца.
Среда	Аукционы ОФЗ	ОФЗ 26207 (15 лет) – 20 млрд руб. ОФЗ 26080 (5 лет) – 20 млрд руб.
	Погашение ОФЗ	ОФЗ 25067 (45 млрд руб.)
	Выплата купонов ОФЗ	3 млрд руб.
	Возврат Казначейству	5.7 млрд руб.
Четверг		
Пятница	Возврат Казначейству	17.5 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

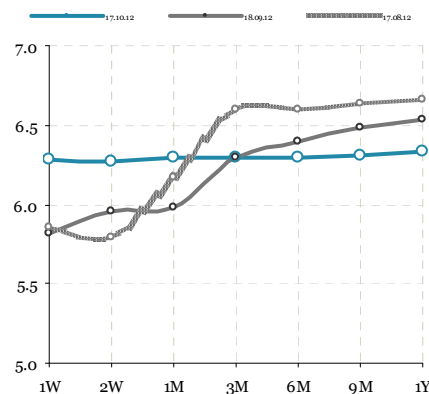
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды подешевели на фоне роста доходностей UST

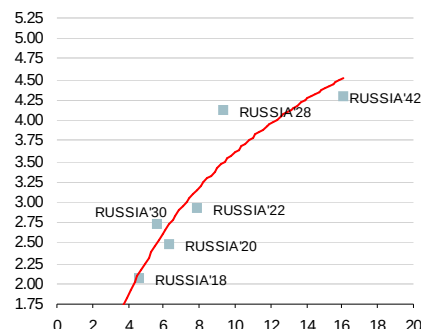
Российский сегмент в среду показал смешанную динамику, которая была в большей степени предопределена ростом доходностей UST. Российские суверенные выпуски потеряли в ценах в среднем в районе 20 бп, тем не менее, спреды сузились со стороны UST в пределах 5-7 бп. Корпоративный сектор показал смешанную динамику; лучше рынка выглядели дальние выпуски Альфа Банка, где биды подросли в среднем на 50 бп, более чем на 25 бп подросли биды в дальних выпусках Лукойла, а также выпуске НЛМК.

Локальный рынок на волне роста

Рынок рублевого долга продолжает показывать опережающую динамику, оставаясь основным бенефициаром роста спроса на рублевый риск. Вчера сегмент ОФЗ завершил день со средним результатом в районе +20 бп по ценам на дальнем участке кривой, а доходности в очередной раз обновили минимальные отметки. Повышенный в течение последних 2-х недель спрос на госбумаги позволил Минфину провести сверхудачный аукцион, в ходе которого инвесторам был предложен и полностью размещен расширенный объем 40 (20+20) млрд руб. в 5- и 15-летних выпусках 25080 и 26207. Заявленные объемы были переподписаны соответственно в 2 и 6 раз, а фактические доходности размещений были на 5 бп ниже заявленных накануне ориентиров (6.98% и 7.90% соответственно), что не помешало дальнейшему выпуску прибавить в цене к концу дня еще порядка 30 бп. Корпоративный сегмент на вторичке выглядел не особенно активно; на среднем участке кривой спрос был замечен в выпусках ВЭБ 9, Вымпелком 4 и МОЭСК 01, прибавивших в ценах в районе 20 бп, в финансовом секторе основная активность была сосредоточена в верхнем сегменте доходности, где покупали новый выпуск Банка СПБ БО8 (+20 бп), а также выпуск ОТП Банк БО2 (+5 бп).

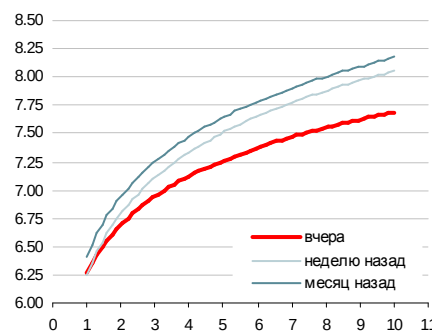
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



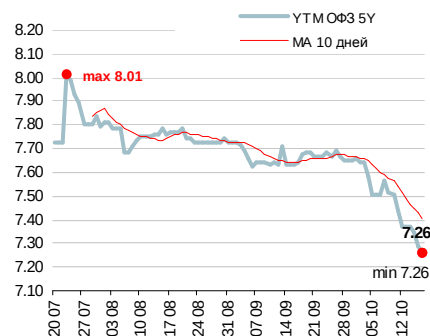
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



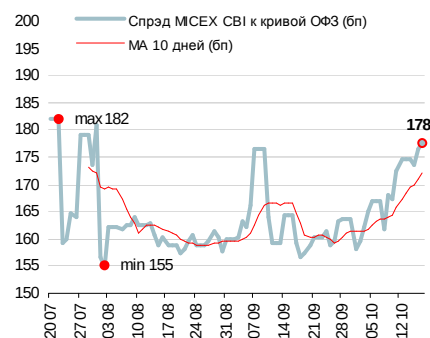
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спред индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ

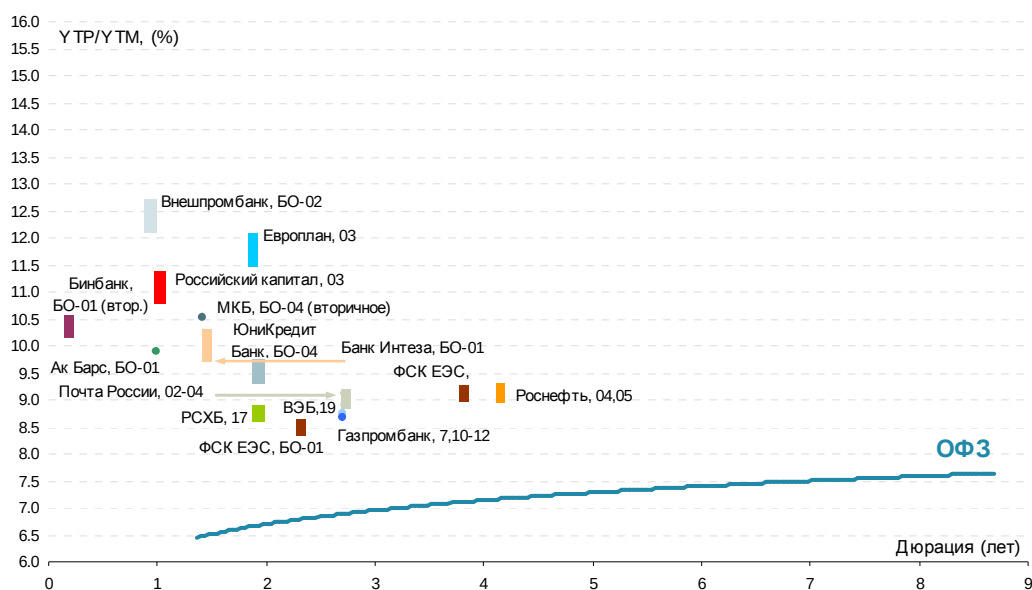


Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Заккрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
ВЭБ, 19	BBB / Baa1 / BBB	да	10 000	8.73	11.10.2012	18.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 20 лет
Газпромбанк, 10	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.68	12.10.2012	18.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 5 лет
Газпромбанк, 11	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.68	12.10.2012	18.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Газпромбанк, 12	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.68	12.10.2012	18.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 10 лет
Ак Барс, БО-01	- / B1 / BB-	да	5 000	9.88	16.10.2012	18.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Бинбанк, БО-01 (вторичное)	B / B2 / B-	да	2 500	10.23-10.54	16.10.2012	18.10.2012	нет / 0.17 г.	2 мес. / 2.17 г.
МКБ, БО-04 (вторичное)	B+ / B1 / BB-	да	5 000	10.51	18.10.2012	19.10.2012	нет / 1.42 г.	нет / 1.5 г.
Газпромбанк, 07	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.68	16.10.2012	22.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 4 г.
РСХБ, 17	- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.63-8.84	18.10.2012	23.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Крайинвестбанк, БО-01 (вторичное)	B+ / - / B+	да	1 500	10.77	22.10.2012	23.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 1.5 г.
ФСК ЕЭС, БО-01	BBB / Baa2 / -	да	10 000	8.37-8.58	19.10.2012	24.10.2012	нет / 2.3 г.	2.5 г. / 3 г.
ФСК ЕЭС, 21	BBB / Baa2 / -	да	10 000	8.99-9.20	19.10.2012	24.10.2012	нет / 3.8 г.	4.5 г. / 15 лет
Банк Интеза, БО-01	- / Ba1 / -	да	3 000	9.73-10.25	23.10.2012	25.10.2012	нет / 1.42 г.	1.5 г. / 3 г.
Почта России, 02	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 03	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 04	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
ЮниКредит Банк, БО-04	BBB / - / BBB+	да	5 000	9.41-9.73	24.10.2012	26.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 3 г.
Российский Капитал, 03	- / - / B+	да	3 000	10.78-11.30	19.10.2012	XX.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Роснефть, 04	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.99-9.31	XX.10.2012	XX.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
Роснефть, 05	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.99-9.31	XX.10.2012	XX.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
Внешпромбанк, БО-02	B / B2 / -	да	3 000	12.10-12.63	XX.10.2012	XX.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Европлан, 03	- / - / BB-	да	3 000	11.57-12.10	30.10.2012	01.11.2012	нет / 1.84 г.	2 г. / 5 лет

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds



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 25067		17/10/12								6.79	0.00		45 000
ОФЗ 26198		02/11/12	100.00	100.01	100.00	0.01	46	430 113	5.83	0.04			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.30	100.31	100.31	-0.01	37	556 292	6.01	0.27			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.22	100.23	100.23	0.07	24	359 811	5.99	0.31			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.63	102.70	102.64	0.04	5	25 001	6.03	0.43			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.00	100.10	100.10	0.00	1	15 000	6.10	0.74	3		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.55	100.41	0.01	1	1 000	6.26	0.97	1		47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.77	100.85	100.83	-0.01	24	2 460 543	6.57	1.35	12	27	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.31	109.39	109.30	-0.05	9	324 803	6.65	1.69	6	37	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.25	109.30	109.25	-0.10	19	207 983	6.75	1.95	7	48	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.82	103.03	102.85	-0.20	7	25 761	6.73	1.93	6	46	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.44	100.60	100.55	0.10	30	575 011	6.88	2.39	8	61	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.13	100.20	100.20	0.22	10	113 451	6.91	2.50	8	64	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.30	101.50	101.40		9	65 658	6.98	2.92	5	71	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.15	98.44	98.30	-0.05	10	470 599	7.09	2.95	16	82	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.85	100.20	99.87	-0.43	11	405 093	7.06	3.36	5	77	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	80.00	100.00					8.95	3.36	194	266	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.02	3.57	97	172	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.95	102.00	101.90		16	272 999	7.02	3.79		70	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.85	101.85	102.00	0.15	14	950 014	7.01	3.94		68	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.69	102.75	102.75		10	171 176	7.00	4.54		61	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	82.80	92.80	92.00	0.11	17	564 950	7.35	4.58	14	95	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	99.20	99.50	99.20	-0.30	4	41	7.30	4.70	8	89	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.10	102.30	102.15	0.15	10	140 337	7.20	5.15		73	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		67.90					7.23	5.54		70	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.00	96.00	95.70	0.75	13	1 652 102	7.59	6.21	20	96	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.30	102.50	102.40	0.15	16	126 073	7.35	6.22		72	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	102.30	102.45	102.40	0.60	25	200 141	7.38	6.99		63	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	74.00	88.20					8.02	7.42	52	121	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	103.50	103.65	103.40	0.40	40	646 207	7.90	8.69	30	90	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	87.60	89.50	88.20	1.20	2	200 002	8.20	10.93	45	86	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29	67.00	90.00					7.89	10.55	17	61	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	95.00	99.70					7.67	0.77	157	137	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО5		30/10/12	100.10	100.12	100.10	-0.04	4	2 061	7.84	0.04			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	100.26		100.27	-0.05	6	22 050	7.66	0.13		142	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.00	100.25	100.19	0.19	1	1	7.33	0.38		101	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.60	100.75					7.94	0.65	195	163	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.60	100.75					7.78	0.65	179	147	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.00	100.45	100.15		3	21 792	8.32	1.78	170	204	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.00	101.75					8.31	1.87	166	203	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.20	100.35	100.27	0.05	2	2	8.54	2.22	178	227	5 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12	99.90	100.00	99.93	-0.07	3	251	7.85	0.08			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.90	100.10					7.79	0.46		146	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.05	100.20					8.14	0.81	201	184	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.20	99.32					8.37	1.31	194	207	5 000
ММК ВО6		10/06/14	83.00						8.90	1.62	234	261	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.70	97.95					8.84	1.66	226	256	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.60	100.75	100.55	-0.19	3	8 040	8.13	0.33		181	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13		100.80					7.53	0.33		121	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.27	100.40	100.30	-0.10	2	7 473	8.03	0.67	201	172	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.35	100.49					7.76	0.68	174	145	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.30	101.55	101.30	-0.15	3	15 133	8.67	2.39	187	240	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.25	101.55					8.56	2.40	175	229	3 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.40	100.60	100.40	0.38	3	3 050	8.42	0.43		210	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	98.01	100.55					8.04	0.43		172	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19							9.13	1.72	253	285	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19							9.10	1.72	250	282	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.40	101.70	101.10	-0.75	2	11	9.75	2.57	290	348	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.50	101.70					9.75	2.57	290	348	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	93.00	102.99					10.14	3.10	318	386	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	95.50	101.99	95.50	0.50	1	50 001	10.14	3.09	318	386	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.90	99.99	99.96	0.05	3	1 086	9.22	2.21	247	295	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.90	100.00	99.90	0.10	4	20 569	9.25	2.21	250	298	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.90	100.00	99.85	0.10	1	720	9.27	2.21	251	300	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 BO1	11/11/11	09/11/12	99.56	99.97	99.94		5	34 280	9.13	0.06			5 000
Мечел BO2		12/03/13	98.77	99.29	99.28	0.18	22	52 402	11.92	0.40		560	5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.51	100.00					11.78	0.49		545	5 000
Мечел BO3		24/04/13							14.36	0.49		803	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.35	96.65	96.60	0.45	2	501	13.38	0.63	740	707	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	98.80	100.20					11.58	0.73	551	528	5 000
Мечел BO4	11/02/14	10/02/15	96.00	96.99	96.99	1.24	2	5	13.18	1.25	678	688	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	92.01	92.77					15.41	1.28	899	911	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.12	92.48	92.27	-0.03	1	3 300	15.34	1.28	892	904	5 000
Мечел BO5		07/04/15	99.50						11.82	2.22	506	555	5 000
Мечел BO7		07/04/15	99.50						11.82	2.22	506	555	2 000
Мечел BO11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	506	555	3 000
Мечел BO12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	506	555	3 000
Мечел BO6		07/04/15	99.50						11.56	2.22	480	529	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	91.05	92.39					14.35	2.52	751	808	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.52	91.96					14.13	2.52	729	786	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	83.03	83.80	83.80	-0.10	1	25	14.77	3.05	782	850	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	84.00	87.47					13.42	3.06	646	715	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	84.03	86.49	85.98	0.48	5	726	13.83	3.07	687	756	5 000
ТМК													
ТМК BO1		22/10/13	99.36	100.10	100.00	0.11	1	10 000	9.04	0.95	281	273	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.60	100.65	100.63	0.20	15	15 386	8.57	0.69	253	226	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.25	98.40					12.33	1.09	601	602	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.82	92.50	92.00		4	22 005	15.20	1.50	869	891	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ BO1	05/06/12	04/12/12	100.16	100.69	100.45	0.29	1	15	8.98	0.13		274	5 000
КОКС													
КОКС BO2		28/05/14	93.01	98.50	98.46	0.05	4	82	9.98	1.49	347	369	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.00	93.25	93.07	0.07	13	2 237	14.48	1.31	805	818	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.48	88.45	88.00	-0.50	9	934	14.92	2.28	815	865	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12	99.99	100.05	100.05	0.01	8	18 950	6.67	0.06			5 000
РЖД BO		05/12/12	100.17	100.47					7.35	0.13		111	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.52	99.65	99.65	0.05	7	4 310 054	7.37	1.02	109	106	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.65	109.75	109.65	-0.15	8	77 507	7.65	1.29	123	135	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.70	102.87	102.70	0.05	4	1 423	7.83	2.08	111	156	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.40	99.60					8.08	2.72	120	181	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.87	100.00	99.87	0.02	1	4 450	8.09	3.15	112	181	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	109	190	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.85	100.25					7.37	0.93	116	106	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.85	100.20					7.41	0.93	120	110	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.10	101.15	101.10		3	2 996	7.91	1.53	139	162	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	96.50	102.00	101.75	0.74	2	2	7.95	1.82	132	167	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.25	99.45					8.12	2.67	125	185	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.50	98.60					8.23	2.67	136	196	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	99.65						8.38	3.01	143	211	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.25	100.50	100.25	0.10	5	1 002	8.70	3.42	168	240	15 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70					8.92	4.06	179	258	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	97.10	97.70	97.10	-0.05	1	3 000	8.90	4.06	177	256	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.50	96.70	96.70		2	3 700	8.88	4.62	167	248	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.91	97.69	97.25	0.25	2	501	9.16	6.12	177	254	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.20	100.35	100.30	0.20	6	88 740	9.06	2.23	230	279	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.00					9.84	3.80	275	352	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.05	101.99	98.93	-0.12	7	13 818	10.32	1.01	405	401	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.73	249	311	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	98.90					9.36	3.02	241	309	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.11	3.02	216	284	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	85.00		100.15	0.15	2	30 000	9.31	3.65	224	300	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32			100.15	0.15	2	55 000	9.31	3.65	224	300	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.35	3.65	229	304	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	100.11	101.00	100.40	0.25	4	10 192	8.10	1.38	164	181	7 000

НЕФТЬ И ГАЗ

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													
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14	100.00	100.08					7.51	0.06			15 000
Газпром А9		12/02/14		102.70					7.47	1.27	106	117	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.60	110.25	110.00		1	63 000	7.45	1.51	93	116	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							6.98	0.16		72	5 000
Лукойл БО-7		13/12/12			100.34	-0.06	1	1	6.98	0.16		72	5 000
Лукойл 4		05/12/13	98.51	100.15					7.42	1.08	111	111	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.31	100.95					7.41	0.25		110	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.97	100.00	99.95	-0.05	5	37 501	7.38	0.48		105	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.95	100.00	99.95	-0.10	2	2	7.38	0.48		105	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	92.00	100.85					7.98	2.11	125	171	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.50	100.60	100.50	-0.24	7	390	8.49	2.90	157	222	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.70	100.90	100.70	-0.10	1	2 986	8.42	2.91	149	215	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.00	109.97					8.60	4.28	144	224	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	94.80	98.91	99.00	1.79	1	500	8.61	4.52	141	222	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13		100.00	100.00		1	25 000	7.62	0.67	161	131	10 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40	99.53	99.49	0.02	3	628	7.98	0.91	178	167	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.50	100.90	100.86	0.25	5	332	7.29	0.17		103	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.50	100.95	100.50	-0.47	1	1	9.49	0.17		323	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.50	100.98	100.80	0.10	1	3 031	7.66	0.17		140	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.60	101.75	101.65	0.05	1	20 000	7.94	1.07	164	163	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.30						8.37	2.12	164	210	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.80	100.35					10.26	0.76	417	396	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	97.55	99.30	98.83	-0.13	10	8 036	10.47	1.24	408	417	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	93.01	95.59					10.63	3.08	367	436	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	93.01	97.99					10.81	3.09	385	453	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	98.91	99.00	99.00		7	417	14.00	0.75	792	770	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50					9.59	3.15	262	331	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.50	100.79	100.50		8	16 414	8.07	0.71	202	177	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.16	100.23	100.23	0.01	5	3 396	7.36	0.18		109	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.15	100.19	100.15	0.01	1	1 600	7.59	0.27		128	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	97.50						7.81	0.40		149	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.80		100.10		8	38 498	7.55	0.40		123	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	100.09	100.07	0.07	1	5 000	7.62	0.40		130	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	99.75	100.26					7.99	0.85	183	169	10 000
ВТБ 5		17/10/13							7.77	0.96	154	146	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15							8.16	1.35	171	186	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.06	100.19					8.12	1.35	167	182	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.96						8.69	2.64	183	242	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	85.02						8.69	2.64	183	242	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	197	184	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.15	100.00	-0.52	1	30 000	8.93	1.97	225	266	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.20					8.09	0.83	195	179	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.60	99.74					8.02	0.23		172	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.51	99.65					7.92	0.36		160	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	100.15	100.50					8.25	0.52	240	192	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.40					8.41	0.73	235	211	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.25	99.20		1	1 000	8.21	0.75	212	191	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.50					7.66	1.10	134	135	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.10					8.93	1.22	254	263	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20							7.68	0.96	144	137	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.15	100.35	100.35	0.15	1	20 000	8.40	2.20	165	213	15 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.95	98.13	98.30	0.20	16	100 607	8.66	3.06	170	239	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.42	165	238	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20							8.86	4.05	173	252	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.00	99.50	99.20	0.45	1	20 000	8.25	1.43	177	196	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.89	101.25	101.00	0.07	1	500	8.42	1.83	178	214	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.50	101.00					8.51	1.83	187	223	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.50	100.65					8.82	2.03	212	255	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.00	99.75					9.01	3.07	205	274	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	99.35	100.00					9.07	3.07	211	280	5 000
МСП 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	
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.21	100.34	100.34	-0.51	6	5 031	8.62	1.38	216	233	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.65	100.80	100.65	0.07	14	1 661	8.99	1.72	239	271	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.11	100.30					6.97	0.10		75	5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.25	100.30					7.39	0.10		117	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.00	101.00					5.70	0.31			5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.00	100.80					9.13	0.31		282	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.70					7.45	0.63	147	114	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.80					7.53	0.78	142	123	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.40					7.87	0.79	175	157	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	98.54	100.40	100.40	1.90	2	3 600	7.95	0.84	179	165	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.00	100.65	100.44	0.09	3	661	7.90	0.84	174	160	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						8.04	0.94	182	173	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.00	100.45					7.88	0.98	163	157	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	101.00					7.91	0.99	165	160	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	100.75	101.79					8.60	1.26	219	230	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	85.04	100.00					8.47	1.72	187	219	5 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.75	101.00	100.25		1	1 020	8.61	2.29	183	234	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	98.20	98.20	0.18	3	10 000	8.62	2.45	180	235	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.65	98.55	97.65	-1.13	1	1	8.87	2.46	205	260	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.65	98.55	97.65	-0.37	1	1	8.86	2.46	204	259	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							8.86	0.08			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							5.31	0.10			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.10	100.25					7.45	0.19		118	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.15	99.39					7.71	0.75	163	141	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.90	100.00	99.97	0.02	6	27 663	7.91	1.09	160	160	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	86.00						8.19	1.24	179	189	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.75	100.85	100.75	-0.06	22	39 308	8.54	1.62	198	225	10 000
АИЖК													
АИЖК А5		15/10/12							6.37	0.01			2 000
АИЖК А6		15/07/14	99.50	99.70					7.88	1.19	151	158	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.78	180	214	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.95					8.10	1.87	145	182	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.25	99.75					8.30	1.93	163	203	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.50	99.75					8.15	2.33	136	188	6 000
АИЖК А8		15/06/18	97.95	98.50					8.43	2.79	153	216	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30	99.25	0.25	2	10 000	8.56	3.02	161	229	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.20	99.40	99.40	0.15	1	200	8.45	3.08	149	218	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.59	3.19	161	231	15 000
АИЖК А11		15/09/20	99.50	99.90					8.71	3.84	161	239	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.00	97.30	97.30	-0.20	2	225	9.10	4.96	184	265	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	102.15					8.94	5.58	161	240	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	130	192	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	86.00	100.23	100.20		1	828	8.99	1.08	268	268	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.20					8.99	1.08	268	268	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.45	1.66	287	317	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.45	1.66	287	317	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.80	100.15					8.09	0.33		177	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.80	100.10	100.10	0.30	8	984	7.90	0.80	178	160	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.80	100.00	99.82	-0.14	1	2 560	8.12	1.03	184	181	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14							8.46	1.38	200	217	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.50	100.75	100.50	0.05	1	8 000	7.33	0.65	133	102	10 000
МТС 1		17/10/13							7.24	0.95	101	93	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.10	99.30	99.30	0.10	4	65 000	8.04	1.50	153	175	15 000
МТС 2		20/10/15	97.54	98.30	98.30	0.30	29	5 987	8.58	2.64	172	231	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.01	99.25					8.65	2.68	178	238	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.50	100.00					8.97	3.30	197	268	15 000
МТС 7		07/11/17	98.75	99.50	99.40	0.35	14	10 595	9.04	4.05	191	270	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.20	101.15	101.15	0.15	1	1	7.77	0.73	170	147	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.09	99.24					8.52	1.62	196	223	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.50	100.00	99.50	-0.30	4	5 401	9.29	2.23	253	302	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.85	99.90	99.90	0.10	7	7 205	9.09	2.21	234	282	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.51	99.98	99.98	0.33	21	249 290	9.05	2.21	230	278	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.75	98.50					9.24	2.70	236	297	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.04	98.50	98.35	0.05	1	650	9.14	2.70	226	287	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 13	21/10/11	17/10/12							350.17	0.17		34 390	2 000

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	
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	99.70					7.42	0.64	144	111	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.75					7.94	0.55	205	162	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00	101.25					8.74	1.25	234	244	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.25					8.40	1.25	200	210	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.15	100.25	100.17	0.17	1	260	9.11	2.28	234	284	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.01	97.00	97.00		4	1 950	9.60	3.14	263	332	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.01	107.00					9.95	3.14	298	367	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.10	97.00					9.61	3.14	264	333	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.80	99.85					7.84	0.36		152	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.50						8.34	0.88	216	203	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50						8.39	0.88	221	208	1 000
Магнит БО-3		09/09/20	99.50	100.25					8.25	0.88	207	194	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	100.00	100.17					8.25	0.88	207	194	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	98.70						9.31	1.31	288	301	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.05						8.42	1.40	195	213	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.38	100.45	100.40	-0.20	5	9 001	8.93	2.63	207	266	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.40	99.00					9.25	1.52	273	296	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	98.02	100.00	98.65	-0.09	3	25 002	9.00	1.59	245	271	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.40	100.75	100.15	-0.25	4	110 001	9.66	2.64	280	339	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13							8.94	0.74	286	264	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	100.00	100.12	100.08	-0.08	7	2 342	9.21	0.92	300	290	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.11	99.35					11.91	0.57	600	559	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.15	101.00					9.25	1.00	299	294	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	99.81	100.81					9.72	0.94	350	341	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.97	445	486	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.61	100.00					12.90	0.66	690	659	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.01	94.49	93.50	0.50	18	5 155	11.77	2.31	499	550	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	96.00	96.50	96.50	0.50	1	2 147	11.25	1.66	467	497	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14		100.50					9.97	1.76	336	369	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.90	96.99					10.86	1.22	447	456	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.00	100.05					7.80	0.17		154	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.70	98.85	98.85		1	10	9.77	1.24	337	347	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.01	101.60					10.15	2.62	329	388	2 000
УВЗ													
Уралвагонзавод 1	13/12/12	07/12/17	99.29	100.20					11.02	0.16		476	3 000
Уралвагонзавод 2	27/08/13	20/02/18	99.25	99.70	99.70	0.03	1	150	9.51	0.84	336	321	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.50	100.00					11.56	0.94	534	525	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13							9.76	1.77	314	348	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	86.00						8.31	0.18		204	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14							9.20	0.49		287	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	94.01	103.00	99.42		4	112	9.65	0.50		332	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.15	0.90	195	184	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.06	100.50	100.40	-0.10	2	5 570	8.64	0.52	279	231	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.20	102.50					9.48	0.72	342	318	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.28	100.79	100.75	0.10	4	4	10.63	2.08	391	436	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.05	100.15					7.73	0.47		140	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	100.07	100.15	100.10	0.03	3	61 634	7.67	0.47		134	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	100.75	100.62	-0.13	2	11 509	7.83	0.36		151	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.51	101.00	100.79		2	5 305	8.50	1.71	190	222	3 000
Глобалтранс													

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	
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.99					9.76	1.46	326	347	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.25	100.75					9.89	2.15	315	362	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.25	100.90	100.86		4	8	9.81	2.15	307	354	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.88	100.00	100.00	0.10	17	17 976	12.85	0.85	669	655	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13							13.00	0.93	678	669	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.41	101.69	101.20		1	500	10.01	0.43		369	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.41	101.99					11.58	0.43		526	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.35	99.85					10.91	0.52	506	458	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.35	99.85					10.69	0.52	484	436	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15	94.00						8.47	0.61	251	215	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.50						10.37	1.07	407	406	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	97.50	101.99					7.02	1.12	69	71	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.01	97.49	97.00		1	50	11.77	1.36	532	547	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.02	99.95					10.32	1.36	387	402	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.74	3.15	177	246	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21							8.44	3.01	149	217	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21							8.46	3.01	151	219	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	94.00	98.00					7.38	0.35		106	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.32	100.47	100.47	0.12	3	2 100	6.76	0.14		51	5 000
МОЗСК													
МОЗСК БО1		18/09/15	100.33	100.45	100.40	0.10	8	145 884	8.82	2.62	196	255	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60					8.40	2.22	164	213	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.46	100.70					7.87	0.65	188	156	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14			98.35	-0.10	1	100 000	8.32	1.59	177	203	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.01	99.95					10.62	1.57	408	433	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.01	91.34					13.89	2.93	696	762	5 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.50	96.96					10.92	1.74	431	464	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.65	0.19		137	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.25	99.00					8.48	0.69	245	217	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.68	100.00					16.47	1.34	1003	1 017	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	97.05	98.70	98.70	-0.01	5	14	10.00	0.80	388	370	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	85.06	85.26	85.26	-0.73	62	2 282	30.29	0.89	2410	2 398	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17		98.26	98.25	0.28	2	410	10.95	0.96	471	464	5 000
Иркутскэнерго													
Иркутэнерго-1		28/11/13	103.10	106.59					13.92	1.02	765	761	5 000
Иркутэнерго БО-1		08/04/14	86.00	100.30	98.20	-0.20	1	1	9.13	1.42	265	284	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.15	100.01	0.11	1	8 000	8.39	0.86	222	209	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	258	273	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.61	99.75					11.05	0.85	489	475	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	99.50	105.00					9.00	2.40	219	273	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	94.00	100.00					9.20	2.70	232	293	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	98.70	103.68					4.36	0.90			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.40	102.10					7.95	1.02	167	164	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.76	100.30					9.31	1.51	279	302	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	97.31	100.30					9.31	1.51	279	302	4 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.48	99.21					10.14	1.42	366	385	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.20	100.50					9.01	0.29		270	5 000
ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.40	100.95	100.30	-0.25	2	470	10.24	0.66	423	393	2 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.28	100.40	100.36		5	1 008	9.78	0.87	360	348	2 000
ЛСР Групп 3	14/03/14	08/09/17	100.80	101.00					11.15	1.33	471	485	3 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14	98.45	98.60	98.56	0.01	8	1 194	10.89	1.35	444	459	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	96.15	96.24	96.15	0.08	6	50 211	11.20	1.65	463	492	2 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Офтеры	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.80	99.95	99.94	-0.01	3	758	11.52	0.17		525	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	101.00	101.20					7.05	0.14		80	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	102.00		102.05		3	70 995	9.05	0.36		273	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.45					9.29	4.14	215	294	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	98.90					9.51	4.14	237	316	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	99.50	98.80	0.39	3	3 200	9.40	4.14	226	305	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.55	100.74	100.60	-0.01	3	23 099	7.26	0.12		103	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.76	100.88	100.80	-0.08	3	11 500	7.71	0.39		139	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	100.30	101.40	100.30	-0.08	2	510	8.33	1.70	174	205	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.60	99.90	98.82	0.13	8	998	8.45	1.94	178	218	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.90	99.10	99.06	-0.01	8	1 002	12.14	0.73	608	584	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.17	100.30	100.14	-0.11	1	5	12.06	0.64	607	575	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.96	100.25	100.00	0.05	1	2 000	12.35	0.95	612	604	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	86.01	100.48	100.45	-0.10	3	5 000	8.28	0.56	238	196	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	86.00	100.50					8.03	0.67	202	172	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	86.00						8.89	0.70	285	258	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.00	98.56	98.52	0.03	6	888	8.56	1.01	229	225	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15		100.89	100.49	-0.01	1	20 000	9.21	1.78	259	293	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	95.30	97.45	96.80	0.20	1	40 000	9.34	1.88	269	307	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	100.61	101.24	100.97	-0.03	1	1	7.78	0.62	182	146	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.06	100.11	100.11	0.01	7	15 273	8.49	0.93	227	218	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.70	100.00	99.95	0.30	10	509	8.45	1.24	205	215	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.00	100.40	100.30	0.25	2	29	8.53	1.31	210	223	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.61	100.74	100.74	0.14	2	241	6.30	0.12		7	5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.18	100.20	100.18	-0.01	3	272	8.41	0.16		215	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.00	100.25	100.21	0.10	3	136	8.92	0.72	287	262	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	99.30	100.35					9.10	1.37	264	280	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14							8.59	0.48		226	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	100.05	100.15	100.05	-0.10	1	1	8.82	0.64	284	251	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.30					8.93	0.79	281	263	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/13	99.75	99.95	99.95	0.24	1	59	8.72	0.84	257	242	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	100.00	100.18					9.16	1.29	274	286	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.85	101.00					9.54	1.58	300	325	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.04	100.06	100.05		2	59 282	8.11	0.08			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.90	99.93	99.90	-0.01	14	18 976	8.23	0.11		200	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.16	100.23	100.23	0.08	3	23 000	8.23	0.31		192	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.15	100.23	100.19	-0.01	1	10 000	8.41	0.33		209	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13	86.10	99.75					8.09	0.47		176	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.36	100.50	100.40	0.05	1	3 348	8.48	0.61	253	216	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.45	100.55					8.60	0.68	257	229	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.31	100.35	100.31	0.01	10	39 713	8.99	0.84	283	269	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.63	0.91	142	132	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.25		100.30	0.10	3	29 797	9.18	1.42	270	289	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк ВО2	20/02/13	18/02/15	100.05	100.53	100.04	-0.19	6	14 001	8.76	0.35		244	5 000
Промсвязьбанк ВО4	20/02/13	18/02/15	100.05	100.37					8.57	0.35		225	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.56	99.75	99.60		13	19 809	9.05	0.65	306	274	5 000
Промсвязьбанк ВО3		04/02/14	99.00	99.49	99.45	-0.01	4	45 178	9.24	1.24	284	294	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.36	100.49	100.49	0.19	2	2	10.09	1.75	348	381	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	99.00	101.50					12.41	3.97	529	608	5 000
Банк СПб													
Банк СПб ВО1	09/10/12	09/04/13							8.27	0.04			5 000
Банк СПб ВО4	13/12/12	12/12/13	100.10		100.10	0.05	1	1 040	7.88	0.16		162	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	100.05	100.20	100.05	0.05	11	576	9.13	0.91	292	282	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.26	100.39	100.35	0.19	6	132 781	9.32	0.95	309	301	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.35	100.20		3	10 000	8.74	0.25		243	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.81	99.90	99.87	-0.03	3	10 000	9.02	0.35		270	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.94	99.98	99.95	-0.05	12	55 000	9.56	0.50	372	323	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.90	99.97					10.09	0.92	388	378	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	100.00	100.05	100.00		2	159 999	9.98	0.96	375	367	3 000

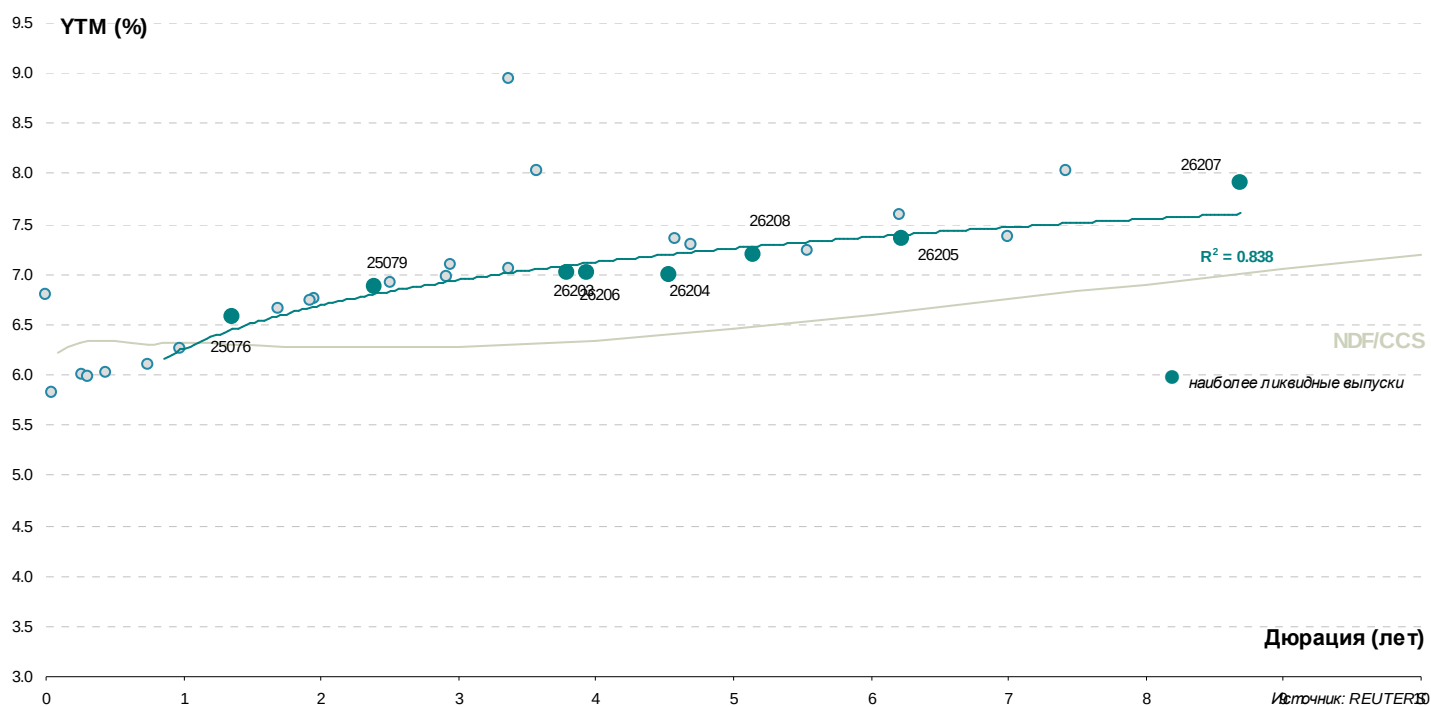
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.97	100.05	99.95		1	3 000	10.55	1.42	407	426	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.20	98.35	98.20	0.09	3	2 130	10.64	1.55	410	435	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.77	100.82	100.77	-0.17	2	350	8.16	0.17		189	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	99.85	100.26	100.00		5	6	9.08	0.86	291	278	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.15	100.20	100.15	-0.10	3	591	9.19	0.83	305	289	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15		100.57					9.65	1.28	323	335	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.75	99.90	99.82	0.07	1	450	9.15	0.88	296	284	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.12	100.20	100.01	-0.09	12	45 500	9.91	1.30	349	361	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.20	100.17	0.07	1	50 000	9.48	0.51	363	315	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.00	100.20	100.12	0.12	1	50 000	9.65	0.71	360	335	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.90	99.50	98.92	0.12	3	42 654	10.06	0.92	385	375	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.95	101.07	100.95	-0.12	6	12 323	11.04	1.08	473	473	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00	100.00	-1.00	1	1	12.00	1.09	569	569	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.30	100.60	100.50	0.10	1	700	10.99	1.14	465	469	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.50	101.55	101.52		1	2 500	11.17	2.01	448	490	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.61	101.55					11.68	2.05	497	541	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.45	98.60	98.45	-0.32	7	55 916	12.30	0.78	620	600	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.46	100.60	100.45	-0.10	3	450	12.61	0.78	650	631	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.04	100.20	100.20	0.10	5	205	14.27	1.24	787	797	2 000
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15							14.03	0.47		770	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	09/07/15	100.35	100.60	100.60	0.15	5	4 499	13.37	0.71	732	707	2 000
ТКС БАНК 2		28/07/13	104.60	104.75	104.75	-0.05	9	509	13.70	0.73	763	740	1 000
ТКС БАНК ВО1		20/09/13	101.30	103.99	102.00	1.50	2	4	12.20	0.89	601	589	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.61	102.80	102.75	0.22	38	8 545	14.17	1.00	791	786	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.90	99.94	99.94	0.01	23	1 704	14.76	0.78	866	846	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.08	100.18	100.18	0.03	1	1	7.95	0.07			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22							8.89	0.98	264	258	00000 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.32	100.70	100.40	0.15	1	10	9.36	1.75	275	308	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	99.90	100.00	100.00	-0.05	3	450	7.64	0.98	139	133	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.80	101.05					7.99	1.22	160	169	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	86.00	99.50					8.00	1.27	159	170	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.52	2.14	179	225	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	100.64					9.28	0.07			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.20	100.70	100.20	-0.03	1	1	8.41	0.85	225	211	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.15	100.38	100.15	-0.35	4	4	8.47	0.86	230	217	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.00	100.00					8.37	0.86	220	207	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	85.61						8.60	1.09	229	229	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.01	3.39	199	272	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.95	101.01	101.00	0.03	2	20 000	7.94	1.07	164	163	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.75	99.75	0.05	1	3 623	7.88	1.06	158	157	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		217	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.16	100.21	100.16	-0.07	6	8 548	8.37	0.06			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.20	100.35	100.23	-0.12	3	16 194	8.61	0.44		228	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.50	100.68	100.55	0.15	7	61 007	9.02	0.98	277	271	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13		102.00					7.55	0.48		122	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.21	100.60	100.63	0.13	2	30 022	10.58	0.79	446	428	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13							10.36	0.93	414	405	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.45	100.50	100.45	0.10	2	15 000	11.14	1.36	468	484	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	94.00	100.11					7.45	0.15		120	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.05	100.25	100.05	-0.20	1	1	8.66	0.49		233	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							7.05	0.97	81	74	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15							10.10	2.21	335	383	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10					8.46	1.39	199	217	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90	99.20					8.83	0.70	279	252	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.95	100.00	100.00	0.08	1	1 000	8.92	0.87	275	262	4 000

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	
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		102.00	100.13	-0.29	2	3 000	9.29	0.89	310	298	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.35	100.50					8.96	0.90	277	265	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.20	101.00					9.24	1.01	297	293	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00						9.24	1.02	297	293	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.45	100.59	100.55		1	20 000	8.68	0.78	257	238	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.30	97.90	97.90	0.07	2	86	8.75	1.56	221	246	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	100.10	100.23					6.01	0.04			4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.17	100.39	100.35	0.05	14	109 055	10.46	1.30	403	416	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.10	97.54	97.51	-0.05	8	852	10.41	1.38	395	412	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.90	96.19					10.60	1.67	402	432	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.20	100.50					9.24	0.13		300	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.90	100.00	100.00		4	10 002	9.69	0.59	376	337	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	98.75	99.25	98.76	-0.29	4	26 716	10.54	0.71	449	423	2 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.90	100.10	100.10	0.15	2	25 000	-28.82	1.41			2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.05	100.09	100.06	0.01	4	1 107	9.97	0.95	374	366	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.82	1.27	341	352	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.15	100.25	100.15	0.05	22	26 009	10.09	1.25	369	379	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.45	97.60	97.56	0.36	3	505	10.10	1.41	362	381	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.51	99.90					9.75	0.96	351	344	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.08					8.14	0.17		188	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.20					7.34	0.17		108	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15							9.28	0.48		295	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.60	100.75	100.70	0.10	2	10 000	9.50	0.66	349	319	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70		100.50	0.25	1	6 108	5.59	0.18			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22							9.97	0.50		364	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.73	2.44	291	346	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14							10.80	0.94	458	449	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	90.02	100.00	100.00	0.09	1	1	11.23	0.38		491	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.51	100.00	98.52	-1.43	2	3	13.05	0.95	682	674	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30						8.26	0.30		195	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	96.10		100.15	0.30	2	13 354	10.69	0.49		436	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.10	100.22					8.94	0.17		267	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	90.01	99.00	96.75		2	35 000	10.27	1.67	369	399	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14		100.20	100.20	0.20	1	6	9.53	0.48		320	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13							10.00	0.50		367	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.01	100.07	100.00		1	5 000	11.28	0.91	507	497	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.15	100.40					8.71	0.11		248	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	100.25					12.06	0.85	589	576	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.25	100.20		2	2 721	9.25	0.31		294	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	99.98						10.24	0.75	416	394	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15		100.35	100.35	0.04	1	5 000	10.52	0.80	440	422	3 000
УБРиР													
УБРР 2	29/10/12	01/05/14	100.00	100.05	100.00		1	12	9.50	0.03			2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.10	100.13	100.10		2	660	12.75	0.93	654	644	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.30	100.00	99.75		1	10	11.34	0.18		507	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.25	100.45	100.45	0.14	5	25 104	12.22	0.80	610	592	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	99.95	100.00	100.00	-0.08	15	55 928	12.34	0.12		611	2 000

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	
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.01	100.00					10.08	0.16		382	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.98	100.00	99.97	-0.04	13	25 830	11.61	0.34		529	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.00	100.08	100.08	0.01	3	25 720	10.24	0.36		392	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.45	99.89	99.50		1	250	12.50	0.48		617	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.70	99.00	99.00	0.25	11	143	12.01	1.12	568	570	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14							12.65	1.36	620	635	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61		03/06/13	104.74	105.60	104.74	-0.85	2	2	7.39	0.60	144	107	30 000
Москва 53		01/09/13	100.10	100.25					6.98	0.86	81	68	15 000
Москва 63		10/12/13	109.15	110.00					6.82	1.07	52	51	15 000
Москва 62		08/06/14	108.01	108.50	108.50	-0.05	5	1 367	7.06	1.50	55	77	35 000
Москва 39		21/07/14	98.45	99.91					7.30	1.66	72	102	10 000
Москва 64		24/06/15	98.20	99.09	99.04	0.48	4	27 000	7.53	2.44	71	126	20 000
Москва 44		16/11/15	112.10	113.77	113.77		1	45	7.43	2.56	59	116	40 000
Москва 56		22/09/16	97.00	97.90					7.74	3.48	70	144	20 000
Москва 49		14/06/17	96.29	97.20	97.20	0.19	1	5 000	7.87	3.95	76	154	25 000
Москва 48		11/06/22	90.50	90.80	90.50		7	5 464	8.17	6.89	71	144	30 000
МОС ОБЛ													
Московская Обл 8		11/06/13	100.83	101.10	100.90	-0.20	1	1	7.67	0.63	170	136	19 000
Московская Обл 7		16/04/14	99.80	99.95	99.80		12	32 329	8.31	1.44	182	202	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5		02/12/12	100.50	100.75	100.75	0.20	4	563	6.61	0.13		37	3 000
Нижегородская Обл 4		17/11/12	99.25	102.05					7.18	0.08		96	3 000
Нижегородская Обл 6		07/10/15	99.80	100.25	100.20	0.40	3	966	8.23	1.82	159	195	5 000
Нижегородская Обл 7		16/11/16	103.00	103.05	103.00	-0.10	3	12 768	8.64	2.21	188	237	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6		10/05/13	103.85	104.00	104.00		2	3 509	7.87	0.54	199	154	2 000
Самарская Обл 5		19/12/13	101.70	102.39					8.01	1.12	168	170	8 000
Самарская Обл 7		30/11/16		98.30	98.30	0.30	1	1	8.58	2.10	186	231	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.76	100.40					7.62	0.48		129	3 000
Якутия 9		19/09/13	101.35	102.00					7.80	0.65	180	149	2 000
Якутия 7		17/04/14							8.12	1.14	178	182	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12	86.00	99.87	99.87		1	500		0.16			2 000
Краснодар 02		05/11/15	100.25	100.75	100.75		1	100	8.52	1.16	216	222	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	100.02	100.55					8.21	1.38	175	192	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4		08/11/12	100.15	100.19					8.00	0.06			10 000
Красноярский край 5		29/11/16	101.80	102.35					8.03	1.51	151	174	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	98.30	100.55					8.14	0.57	222	182	1 000
Коми Респ 9		18/10/14							9.59	1.39	313	330	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	86.02	96.00					8.65	2.31	187	238	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							8.99	2.35	220	272	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.50	104.99					9.00	2.48	217	273	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12	100.05	100.30	100.30	0.15	5	68 214	7.45	0.18		118	3 000
Костромская область 6		17/11/16	101.10	101.39	101.10	0.10	2	2	9.20	1.86	255	292	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16	103.00	103.50					9.47	2.32	269	320	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	102.00	102.23	102.00		5	7	8.87	1.72	227	259	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.32	100.35					7.61	0.56	170	129	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.70	99.85					8.06	1.18	169	176	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.94	101.00	101.00	0.05	2	5 001	8.70	2.21	195	243	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	98.95	100.00	100.00		2	215	8.40	1.12	207	209	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	100.37	101.35					6.14	0.18			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	103.10	104.10					8.12	1.10	180	181	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	101.80	102.00	102.25		1	2	8.13	1.83	149	185	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	100.00	103.40					9.03	0.81	290	273	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13	106.30	107.49					9.10	1.11	277	279	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.22	98.50	98.49	-0.06	4	34	9.43	2.50	260	316	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ

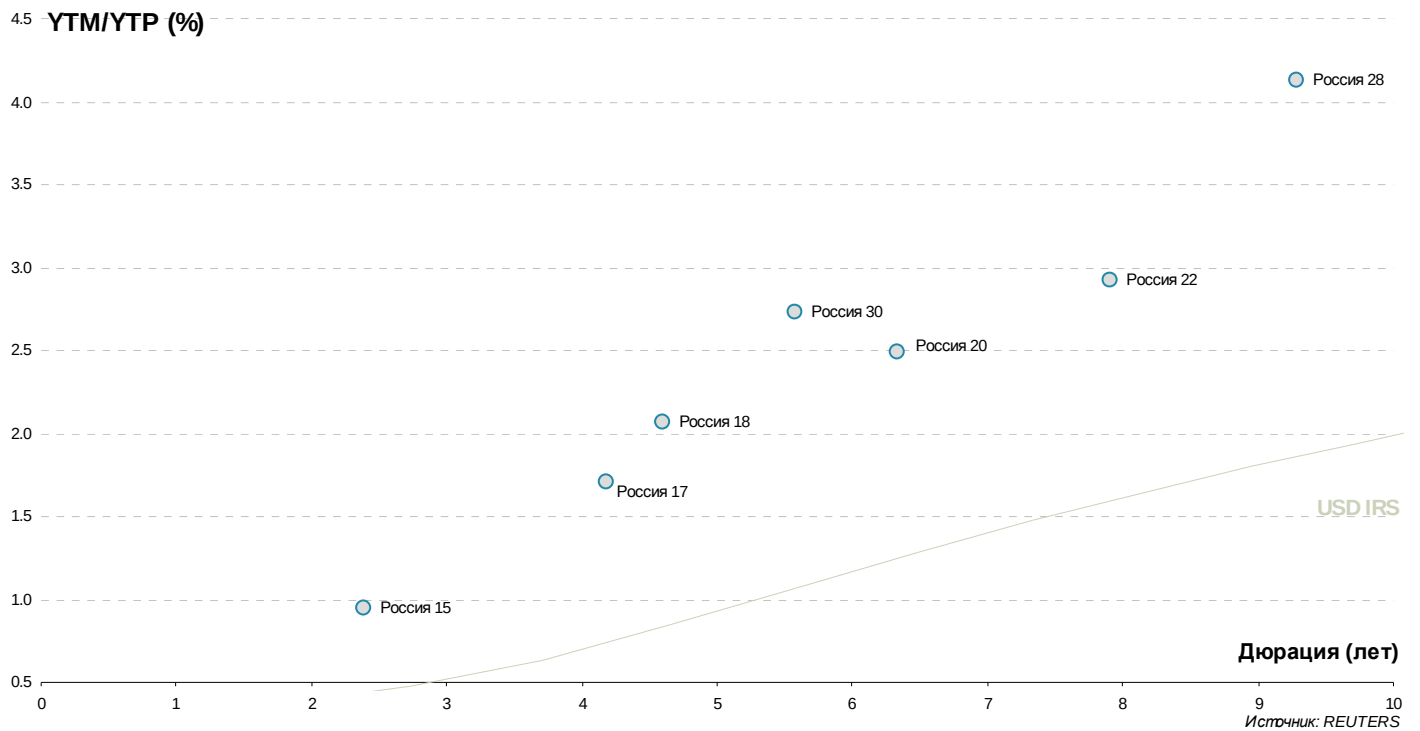


Результаты торгов еврообондами

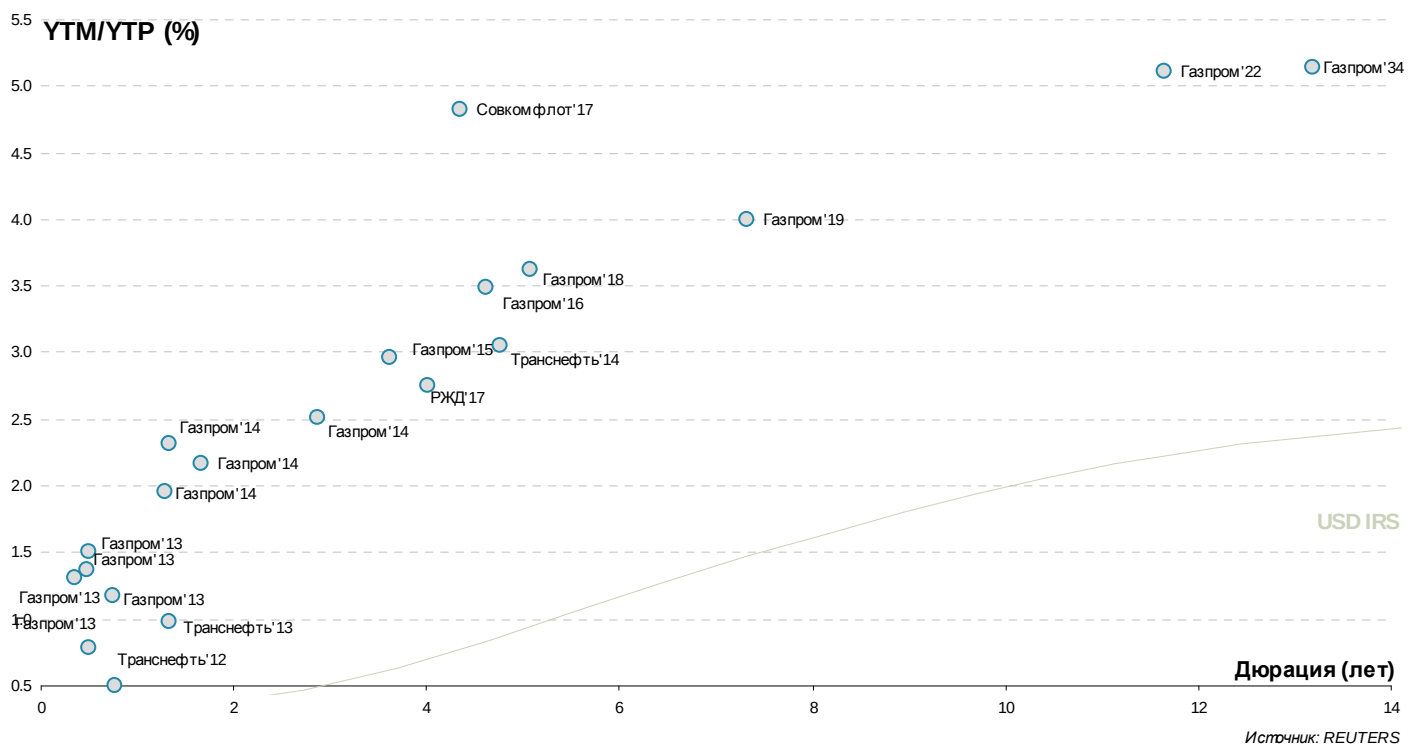
Выпуск	Валюта	Дата	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения	Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
РОССИЯ									
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15	106.500	106.830	1.01	0.88	2.40	0.25	59
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17	106.347	106.803	1.76	1.66	4.18	-0.01	105
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18	147.650	148.850	2.15	1.98	4.60	0.01	123
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30	127.677	127.938	2.75	2.71	5.57	0.29	133
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20	116.880	117.380	2.52	2.46	6.33		119
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22	112.833	113.167	2.94	2.90	7.90	0.12	132
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28	198.139	199.417	4.16	4.09	9.30	-0.01	212
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42	121.981	122.179	4.30	4.29	16.04	0.13	178
ГОСКOMPАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13	101.423	101.548	1.63	1.38	0.50	-0.02	135
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13	101.880	102.880	1.77	-0.20	0.49		149
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13	102.901	103.016	1.47	1.16	0.36	-0.06	119
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13	102.762	102.812	1.42	1.31	0.47	-0.03	114
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13	104.598	105.098	1.49	0.87	0.76		121
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14	111.063	111.813	2.57	2.07	1.34		227
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14	111.200	111.950	2.22	1.71	1.29		192
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14	109.802	110.802	2.43	1.89	1.67	-0.18	210
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15	107.429	107.915	2.58	2.43	2.87	0.09	212
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16	112.179	112.642	3.02	2.91	3.62	0.07	241
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18	122.525	123.523	3.58	3.40	4.62	0.03	271
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19	132.096	132.599	3.66	3.59	5.07	-0.27	260
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22	119.178	119.686	4.03	3.97	7.33	0.12	246
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34	145.051	146.126	5.14	5.08	11.65	1.24	286
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37	129.682	130.197	5.15	5.12	13.20	-0.14	278
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13	104.686	106.686	1.71	-0.71	0.77	-0.04	142
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14	105.868	106.868	1.33	0.63	1.33	-0.08	102
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18	129.586	129.961	3.08	3.02	4.76	-0.15	215
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17	112.158	112.639	2.81	2.70	4.01	-0.04	212
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17	101.907	102.907	4.94	4.72	4.36	-0.08	419
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12	99.900	99.925	9.58	8.61	0.03		1 009
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15	107.094	107.589	3.32	3.11	2.22	0.03	295
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18	106.512	107.512	4.91	4.70	4.60	-0.05	408
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18	109.389	109.890	4.94	4.84	4.67	-0.24	406
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20	107.609	108.106	5.37	5.29	6.40	-0.37	405
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35	107.039	107.435	5.69	5.66	12.55	-0.07	337
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13	102.903	103.153	2.08	1.64	0.54		180
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15	107.200	108.200	3.52	3.11	2.24	0.17	316
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15	99.044	100.044	7.14	6.67	2.23	-0.05	686
ВЭБ									
VEB'16 5.125%	USD	27/05/16	104.942	105.942	3.65	3.36	3.28	0.41	313
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17	110.276	110.780	3.24	3.14	4.45	-0.19	243
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20	119.889	120.390	3.89	3.82	6.17	-0.10	258
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25	120.378	120.876	4.70	4.65	9.07	0.14	273
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13	103.900	104.300	2.15	1.58	0.67		187
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14	106.108	106.356	3.28	3.16	2.01	0.11	292
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15	108.089	108.489	3.56	3.42	2.70	-0.11	313
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13	102.986	104.033	1.85	0.06	0.55	0.04	157
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14	105.913	106.038	2.21	2.11	1.18	0.04	191
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14	110.905	111.030	2.18	2.10	1.52	-0.09	186
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17	112.022	112.520	3.43	3.32	3.98	0.02	273
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18	120.431	120.934	3.68	3.59	4.63	0.43	278
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21	105.472	106.097	4.35	4.16	3.24	-0.02	384
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13	102.684	102.983	1.68	1.16	0.55	-0.44	140
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13	103.213	103.520	1.79	1.35	0.68	-0.09	151
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15	108.053	108.444	2.41	2.27	2.52	-0.09	199
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17	108.340	108.840	3.35	3.24	4.00	0.09	268
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21	109.558	110.558	4.38	4.25	6.91	0.01	290
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		103.350	103.650	2.18	1.60	0.49		190
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		110.108	110.602	4.66	4.49	2.69	-0.29	424
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		115.096	116.112	6.22	6.02	4.32	0.18	542
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		103.209	104.209	6.06	5.85	4.57	0.17	523
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		107.500	108.000	6.43	6.21	2.17		613
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		111.332	111.796	3.17	2.96	1.88	-0.07	283
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		115.668	116.176	5.33	5.25	6.09	0.53	402
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.900	103.250	2.74	2.08	0.50		247
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		107.250	107.250	4.10	4.10	2.98	0.03	365
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		112.188	112.699	4.53	4.38	3.11	0.19	404
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		118.970	119.491	5.14	5.04	4.40	0.27	430
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		110.880	111.880	6.06	5.91	6.29	0.38	475
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.849	109.045	1.92	1.83	1.90	-0.07	156
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		114.669	115.070	2.94	2.85	4.04	-0.01	226
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		121.927	122.442	3.68	3.61	5.63	-0.31	255
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		115.020	115.530	3.93	3.86	6.44	0.19	255
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		122.232	123.007	3.87	3.78	7.37	-0.07	231
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		123.890	124.398	4.85	4.78	5.85	0.08	360
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		108.000	108.500	2.76	2.61	3.03		227
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		115.877	116.502	4.31	4.22	6.59		297
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.450	106.750	1.29	0.92	0.75	0.19	101
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		110.063	110.688	2.35	1.95	1.43	-0.04	203
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		108.973	109.486	4.67	4.56	4.24	0.03	391
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		103.774	104.774	6.88	6.66	4.37	0.04	614
ТНК										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.520	105.520	1.03	-6.20			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.244	109.158	2.50	2.11	2.14	-0.11	212
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		116.259	116.757	2.88	2.75	3.31	-0.16	233
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.885	115.896	3.00	2.77	3.92	-0.13	232
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.949	122.979	3.39	3.20	4.57	-0.19	253
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		122.004	123.068	3.76	3.62	5.87	-0.60	253
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.498	104.748	2.45	2.09	0.65	0.06	218
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.957	109.945	4.05	3.64	2.23	0.18	369
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		110.438	111.188	5.43	5.27	4.20	0.82	470
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		100.900	101.025	3.23	2.44	0.15	-0.10	299
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		101.692	102.192	4.74	4.23	0.98	0.04	450
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		106.369	107.369	6.38	6.03	2.71	0.01	602
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.869	105.119	3.91	3.57	0.71	-0.06	365
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14		101.253	101.753	5.32	4.98	1.42		507
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		112.734	113.734	7.27	6.88	2.21	-0.01	699
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		107.968	109.968	8.68	8.08	3.07	-0.03	832
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.496	103.996	4.40	4.04	1.36	0.15	414

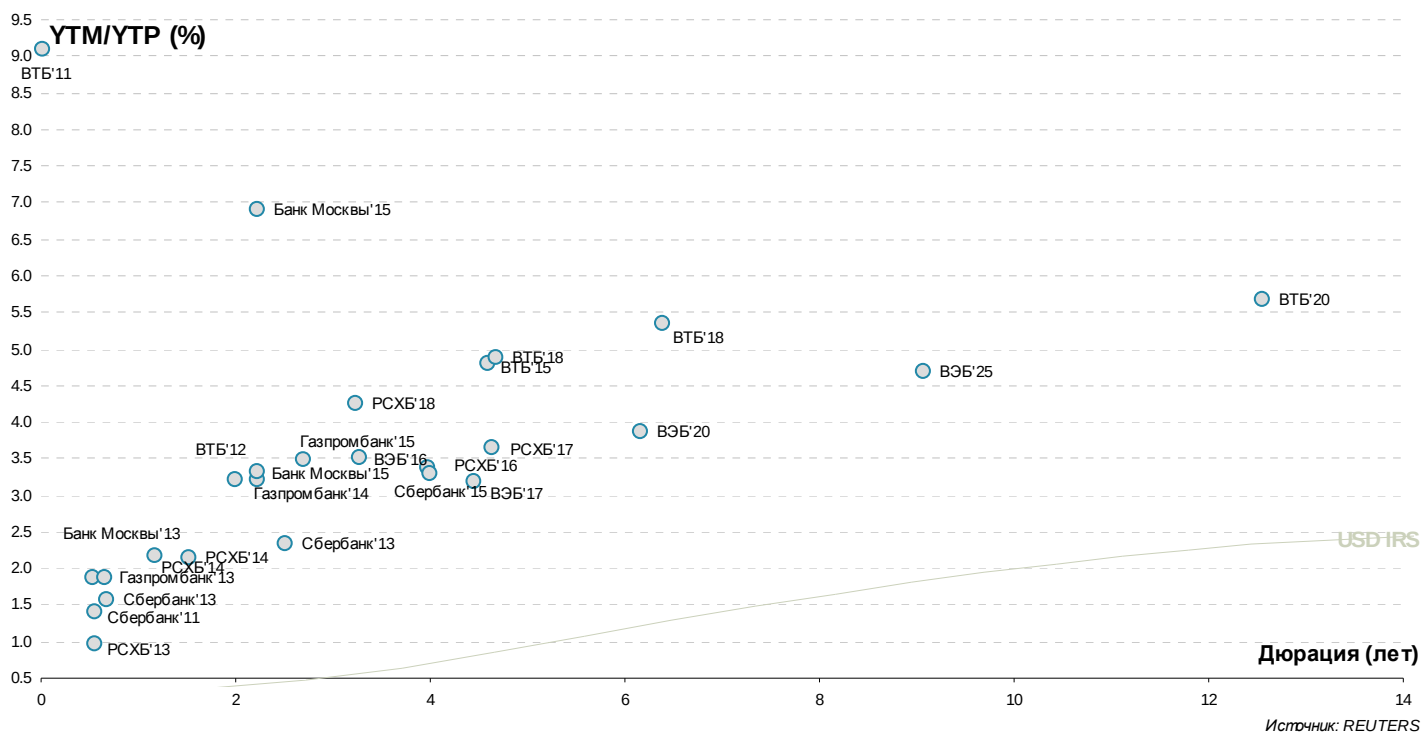
Россия



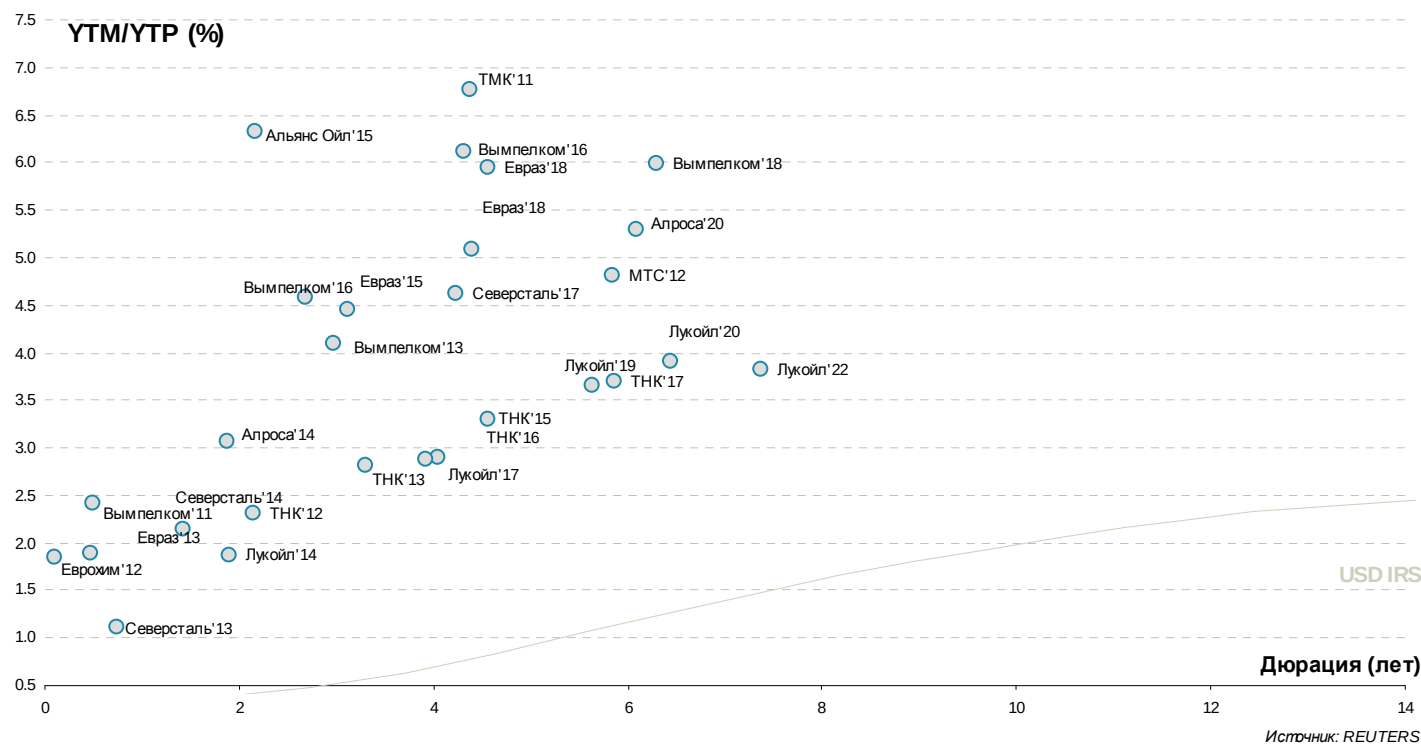
Госкомпании



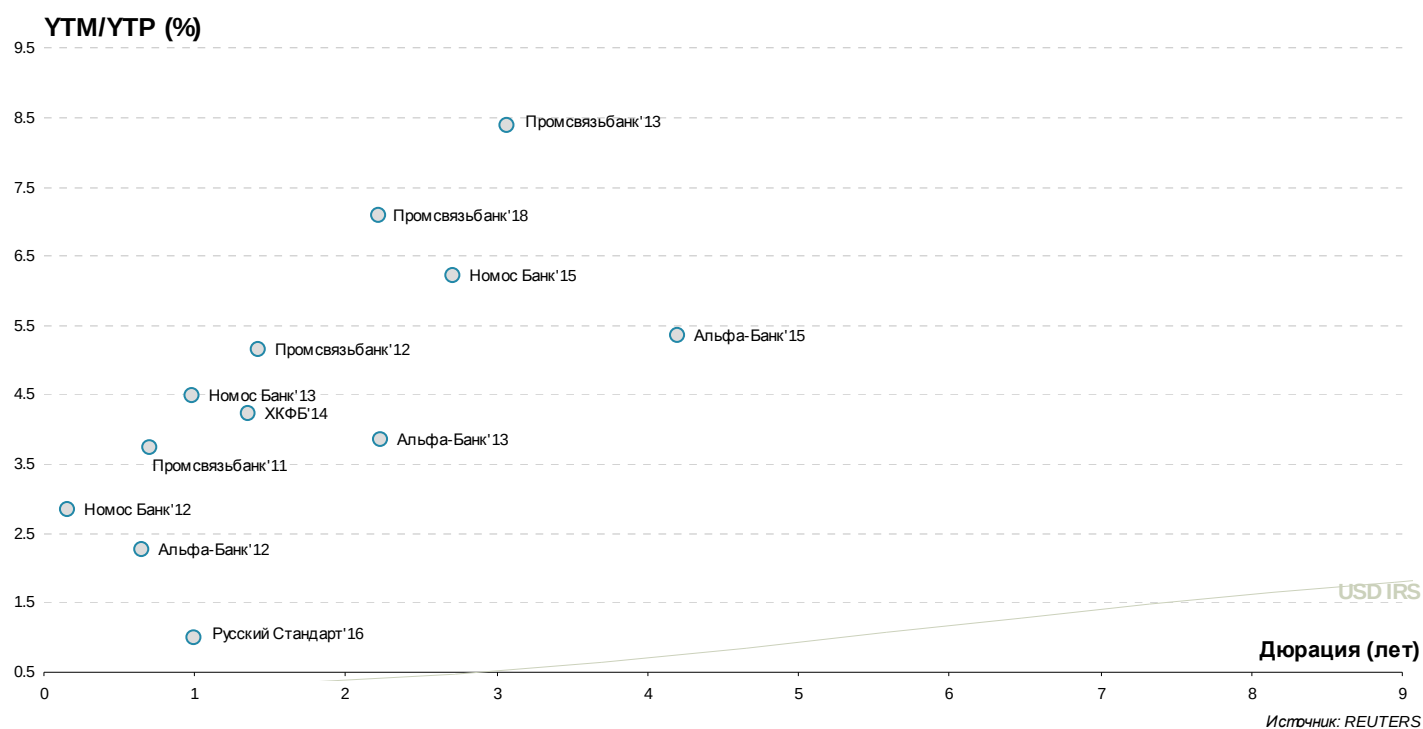
Госбанки



Частные компании



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

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
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.