

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Политический туман в США рассеялся, но перспективы невзрачны

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Условия рынка улучшаются крайне медленно
- Рубль остается без идей на фоне волатильной нефти

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды завершили день хорошим ростом
- Локальный рынок продолжил выходные

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

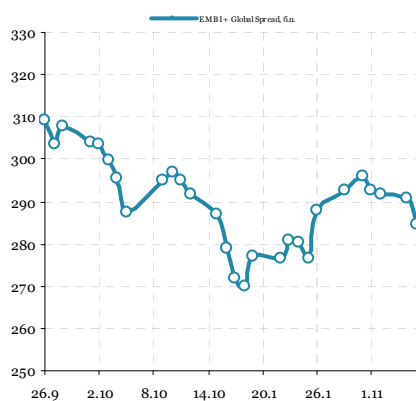
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.75	▲	0.07	1.39
UST 10-2Y sprd	145	▲	4	117
EMBI+ Glob.	284	▼	-6	270
EMBI+ Rus sprd	151	▲	4	141
Russia 30 yield	2.78	▼	-0.06	2.72
Денежный рынок				
Libor-3m	0.31	■	0.00	0.31
Euribor-3m	0.20	■	0.00	0.20
MosPrime-1m	6.73	■	0.00	6.19
Корсчета в ЦБ	659.5	▲	23.6	446
Депоз. в ЦБ	92.2	▼	-9.5	65
NDF RU 3m	6.3	▼	0.0	6
Валютный рынок				
USD/RUB	31.426	▼	-0.201	30.13
EUR/RUB	40.292	▼	-0.159	38.97
EUR/USD	1.281	▲	0.002	1.21
Корзина ЦБ	35.341	▼	-0.136	34.12
ДХУ Индекс	80.613	▼	-0.136	78.85
Фондовые индексы				
RTS	1449.0	▲	0.8%	1228
Dow Jones	13245.7	▲	1.02%	12101
DAX	7377.8	▲	0.70%	5969
Nikkei 225	8975	▼	-0.03%	8296
Shanghai Comp.	2106.0	▼	-0.01%	2004
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	109.8	▲	2.16%	88
Нефть Brent	111.1	▲	0.33%	89
Золото	1716.0	▲	0.63%	1540
CRB Index	297.2	▲	1.66%	267

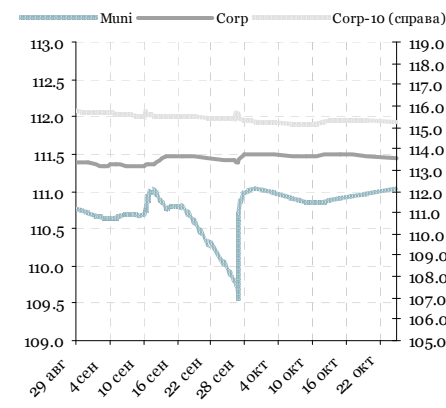
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	119.3	▲	1.03	107.5
Muni	111.0	▲	0.13	109.6
Corp	111.4	▼	-0.04	110.7
Corp-10	115.3	▼	-0.03	115.1
Total Return				
OFZ	273.5	▲	0.86	233.3
Muni	347.7	▲	1.24	324.8
Corp	346.0	▲	0.65	323.6
Corp-10	347.2	▲	0.86	324.6
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	462	▼	-231	0
Muni	981	▲	507	10
Corp	7 053	▲	2 082	19

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ООО «Альфа Укрфинанс» планирует 14 ноября начать сбор заявок инвесторов на трехлетние облигации 1-й серии объемом 3 млрд руб. Маркетингуемый диапазон ставки купона составляет 12,25-12,75% годовых, что соответствует доходности к годовой оферте в 12,63-13,16% годовых. /Интерфакс/

ОАО «Новатэк» договорилось о покупке 49% ЗАО «Нортгаз» за 1,375 млрд долл. /Bloomberg/

ОАО АФК «Система» предлагает заплатить за блокпакет ОАО «ПГК» на 10-20% больше (50-60 млрд руб.), чем мажоритарий ж/д оператора - группа UCL Владимира Лисина, которого ОАО «РЖД» ранее выбрало покупателем этих акций. /Интерфакс/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 06.11.2012 – вторник

Статистика Manufacturing	США:	ISM	Non-	• Выплата купона: АЛРОСА, 2020 (7.75%, 38.7 млн руб.), Банк Русский стандарт, БО-06 (9.4%, 236.9 млн руб.), Газпромбанк, 2019 (LPN) (7.25%, 18 млн руб.), Интурист, ВАО, 2013 (CLN) (10.5%, 4.9 тыс долл.), Стратегия-лизинг, 02 (8%, 9.9 млн руб.), РОСБАНК, 8 (А3) (6.9%, 172.9 млн руб.), РОСБАНК, 10 (А5) (7.4%, 185.5 млн руб.), Лукойл, 2014 (LPN) (6.375%, 28.6 млн долл.), Лукойл, 2019 (LPN) (7.25%, 21.7 млн руб.), Жилстрой (ранее ИК Стратегия), 02 (8%, 6.1 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 08 (8.25%, 79.1 млн руб.), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 2015 (LPN) (7%, 5 млн долл.), Россельхозбанк, 15 (8.75%, 436.3 млн руб.) • Оферта: ОТП Банк, БО-03 (4 млрд руб.), Европлан, 03 (5 млрд руб.)
-----------------------------	------	-----	------	--

Сегодня: 07.11.2012 – среда

Статистика Manufacturing	США:	ISM	Non-	• Выплата купона: АЛРОСА, 2020 (7.75%, 38.7 млн руб.), Банк Русский стандарт, БО-06 (9.4%, 236.9 млн руб.), Газпромбанк, 2019 (LPN) (7.25%, 18 млн руб.), Интурист, ВАО, 2013 (CLN) (10.5%, 4.9 тыс долл.), Стратегия-лизинг, 02 (8%, 9.9 млн руб.), РОСБАНК, 8 (А3) (6.9%, 172.9 млн руб.), РОСБАНК, 10 (А5) (7.4%, 185.5 млн руб.), Лукойл, 2014 (LPN) (6.375%, 28.6 млн долл.), Лукойл, 2019 (LPN) (7.25%, 21.7 млн руб.), Жилстрой (ранее ИК Стратегия), 02 (8%, 6.1 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 08 (8.25%, 79.1 млн руб.), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 2015 (LPN) (7%, 5 млн долл.), Россельхозбанк, 15 (8.75%, 436.3 млн руб.) • Оферта: ОТП Банк, БО-03 (4 млрд руб.), Европлан, 03 (5 млрд руб.)
-----------------------------	------	-----	------	--

Завтра: 08.11.2012 – четверг

Статистика claims, Continuing claims	США:	Initial	jobless	• Выплата купона: Красноярский край, 34004 (10.39%, 105.6 млн руб.), Росгосстрах, 02 (10.5%, 261.8 млн руб.), Газпром Капитал, 03 (7.5%, 561 млн руб.), Администрация города Краснодара, 34002 (9%, 49.4 млн руб.), Лизинговая компания УРАЛСИБ, БО-05 (11.5%, 71.6 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 01 (8.1%, 62.1 млн руб.), ТД Спартак-Казань, 03 (14%, 69.8 млн руб.) • Погашение: Красноярский край, 34004 (10.2 млрд руб.) • Размещение: Ростелеком, 17 (10 млрд руб.)
---	------	---------	---------	--

Внешний рынок долга

Политический туман в США рассеялся, но перспективы невзрачны

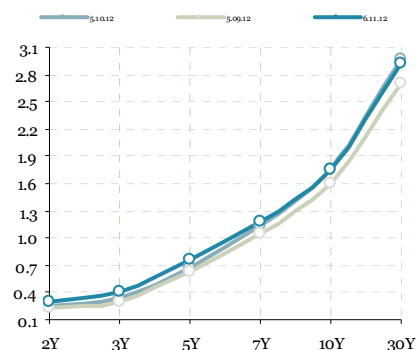
Вторник на международных площадках прошел спокойно на фоне сохранения выжидательной позиции инвесторов до объявления итогов выборов президента США. До выборов по рынкам доминировало мнение о том, что вне зависимости от того, кто будет президентом Штатов, для рынков важнее снятие политической неопределенности, тогда как для экономики должен будет наступить более благоприятный период.

Предварительные итоги президентских выборов должны улучшить настроения рынков, однако эйфория вряд ли наступит. Победа Барака Обамы не добавляет оптимизма в будущем, что обусловлено практически не изменившимся составом Конгресса. В Сенате демократы, как и прежде, завоевали большинство голосов, однако и Палата представителей сохраняет преобладание республиканцев. Это говорит о том, что Обама вновь будет вынужден согласовывать любые реформы с республиканским большинством, что в итоге вновь может вылиться лишь в зарабатывание политических очков, а не попыткой снизить давление на экономику. Таким образом, сам факт завершения предвыборной неопределенности является позитивным моментом для рискованных стратегий, однако итоги этих выборов не добавляют уверенности в среднесрочной перспективе.

Сегодня для рынков ключевым моментом станет голосование в греческом парламенте по ужесточению текущего плана экономии бюджета, подразумевающего сокращение расходов на дополнительные 13.5 млрд евро в 2013-2014 гг. Коалиционному правительству страны будет необходимо любыми способами получить одобрение депутатов, поскольку от этого решения будет зависеть, получит ли Греция очередной транш финансовой помощи (31.5 млрд евро) от «тройки» международных кредиторов. Дебаты будут продолжаться сегодня весь день, а голосование должно пройти уже после завершения российских торгов.

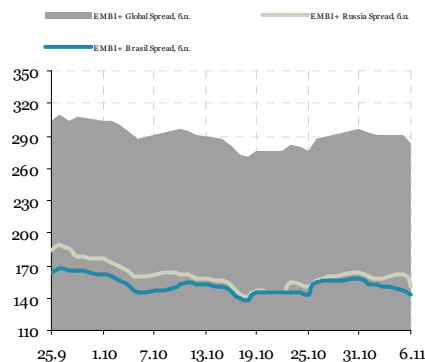
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



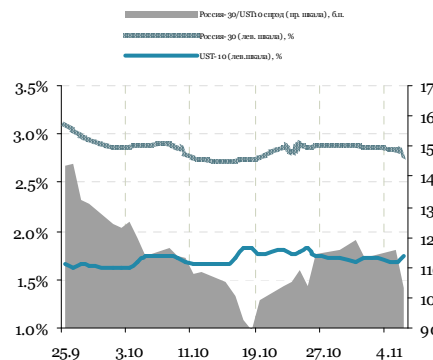
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



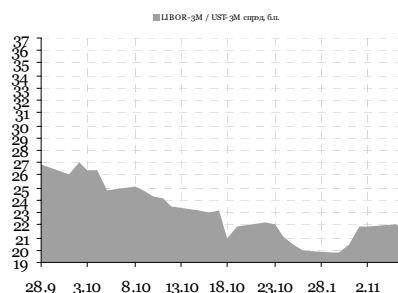
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Условия рынка улучшаются крайне медленно

Новая неделя на локальном денежно-кредитном рынке не принесла ничего нового. Условия рынка остались неизменными, фактор начала месяца для рынка в этот раз не проявился. На рынке МБК ставки по кредитам МБК держались на уровне 6.25% годовых, междилерское репо с облигациями обходилось в среднем под 6.30% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ регулятор полностью удовлетворил спрос со стороны банков. По 1-дневным операциям объем размещения составил 216 млрд руб., по 7-дневным – 1.4 трлн руб. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 50.1 млрд руб. до 787.7 млрд руб.

Российский денежно-кредитный рынок остается не в лучшей форме, традиционный приток бюджетных ресурсов в банковскую систему в начале месяца пока никак не сказывается на его условиях. На текущей неделе рынок должен продолжить медленное восстановление, ставки МБК по кредитам овернайт, вероятно, опустятся ниже 6.0% годовых.

Рубль остается без идей на фоне волатильной нефти

Валютные торги среды прошло безыдейно для рубля, курс бивалютной корзины снизился на 2 коп. до 35.47 руб. Нейтральное поведение рубля обусловлено аналогичной динамикой на внешних площадках. Впрочем, котировки нефти вчера подрастали, на момент российской сессии баррель Brent подорожал на 1 долл. До 109 долл., а позже ускорил рост до 111 долл. Сегодня рубль должен отыграть часть вчерашнего роста котировок нефти, а также снятие политической неопределенности в отношении США.

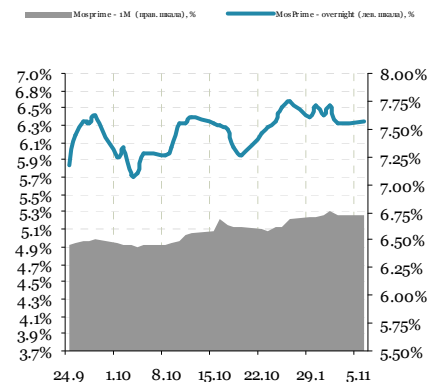
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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			
Вторник	Аукцион Казначейства	5 недель, 75 млрд руб., от 6.2% годовых	216
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26209 (10 лет), 35 млрд руб.	
	Возврат Казначейству	75 млрд руб.	
	Купоны ОФЗ	2.9 млрд руб.	
Четверг	Аукцион Казначейства	5 недель, 50 млрд руб., от 6.2% годовых	
Пятница	Возврат ВЭБу	10 млрд руб.	
	Возврат Казначейству	47 млрд руб.	

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

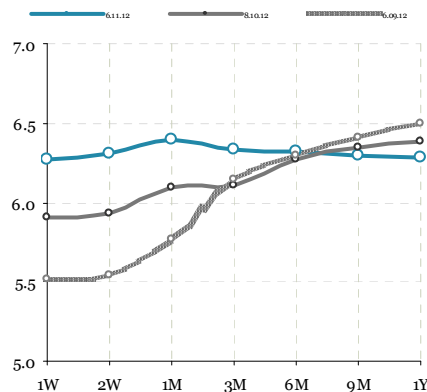
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды завершили день хорошим ростом

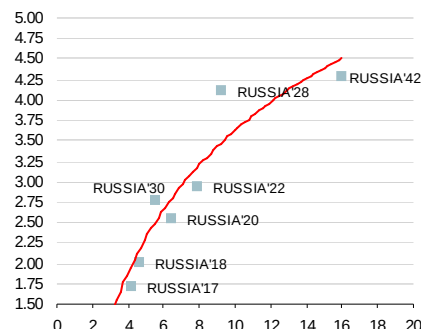
Российский сегмент завершил вторник бурным ростом на фоне заметно более умеренной динамики глобального спроса на риск. Котировки суверенных выпусков завершили день ростом в среднем почти на 50 бп по ценам, а спреды к UST сократились в среднем на 10 бп на фоне повышенной волатильности на рынке американских госбумаг. Дальний Россия'42 прибавил почти фигуру и завершал день на отметке 122%. Корпоративный сектор также в основном торговался в рост и завершил день примерно на 20 бп выше по ценам. В секторе госбумаг неплохой результат показали выпуски GAZPRU'22, дальний RURAIL'22, а также суборд VTB'22, прибавившие в ценах более 50 бп. Среди частных компаний схожий результат показали дальние выпуски Вымпелкома, а также дальний TMENRU'20, прибавившие в ценах более 50 бп.

Локальный рынок продолжил выходные

Локальный рынок неохотно входит в торговую неделю, несмотря неплохое состояние мировых площадок и некоторый рост спроса на риск. Спрос оставался подавленным на рынке ОФЗ, где цены в дальних ликвидных выпусках индикативно прибавили в среднем в районе 20 бп на фоне точечных сделок и минимальных торговых оборотов. Корпоративный сектор также не отличался активностью, которая к тому же была сконцентрирована на ближнем участке кривой. На средней дюрации заметный оборот прошел в выпуске ТЕЛЕ2 07 (УТР 9.42%/D 2.23г. +257 бп к ОФЗ), бида в котором в течение дня теряли в районе 50 бп.

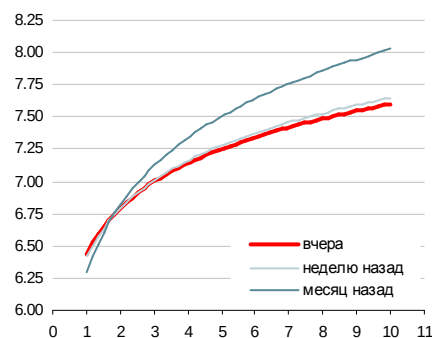
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



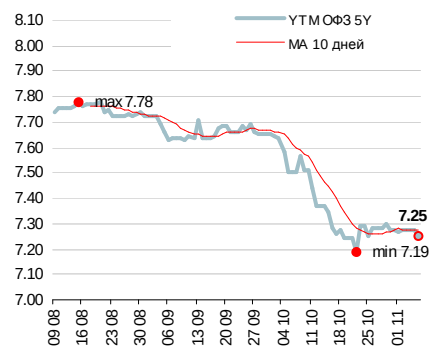
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



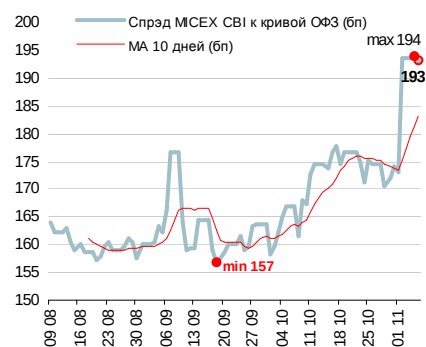
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



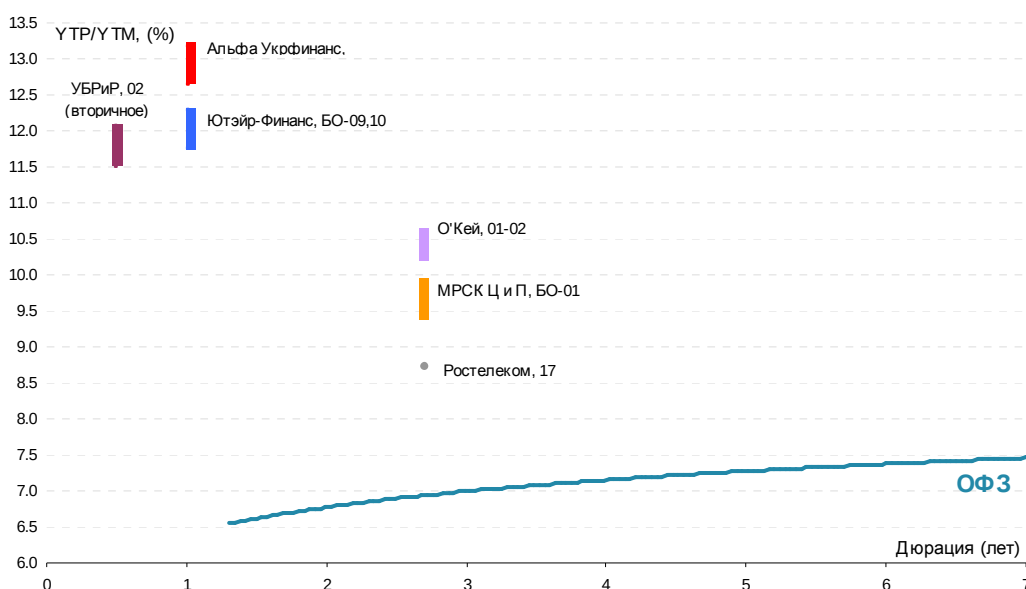
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Заккрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
УБРИР, 02 (вторичное)	B / - / -	да	2 000	11.50-12.05	02.11.2012	07.11.2012	нет / 0.48 г.	0.5 г. / 1.5 г.
Ростелеком, 17	BB+ / - / BBB-	да	10 000	8.73	01.11.2012	08.11.2012	да / 2.70 г.	3 г. / 5 лет
Нижне-Ленское-Инвест, 04	NR	нет	1 200	н/д	Конкурс	12.11.2012	н/д	1.5 г. / 5 лет
О'Кей, 01	- / - / B+	да	2 000	10.25-10.62	08.11.2012	13.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
О'Кей, 02	- / - / B+	да	3 000	10.25-10.62	08.11.2012	13.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
Ютэйр-Финанс, БО-09	NR	нет	1 500	11.74-12.28	14.11.2012	16.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Ютэйр-Финанс, БО-10	NR	нет	1 500	11.74-12.28	14.11.2012	16.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Альфа Укрфинанс, 01	NR	нет	3 000	12.63-13.16	16.11.2012	20.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Ba2 / -	да	4 000	9.41-9.94	XX.11.2012	XX.11.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds

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
Европлан, 03	- / - / BB-	да	3 500	1.5 / 100%	11.57-12.10	11.57	06.11.2012	нет / 1.84 г.
Русфинанс Банк, БО-03	- / Baa3 / BBB+	да	4 000	1.1 / 100%	9.73-10.25	10.25	02.11.2012	нет / 1.86 г.
АПРОСА, БО-01	BB- / Ba3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
АПРОСА, БО-02	BB- / Ba3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
Связь-Банк, БО-01	BB / - / BB	да	5 000	1.2 / 100%	9.20-9.46	9.20	01.11.2012	нет / 1 г.
ЮниКредит Банк, БО-05	BBB / - / BBB+	да	5 000	2.0 / 100%	9.31	9.31	30.10.2012	нет / 1.88 г.
Трансфин-М, БО-11	NR	нет	2 000	н/д / 100%	н/д	10.78	29.10.2012	нет / 2.64 г.
Роснефть, 04	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
Роснефть, 05	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
МОЭСК, БО-02	BB- / Ba2 / -	да	5 000	3.7 / 100%	8.99-9.20	8.99	29.10.2012	нет / 2.69 г.
Почта России, 02	- / - / BBB	да	3 000	1.1 / 100%	8.89-9.10	8.89	26.10.2012	нет / 2.7 г.
Почта России, 03	- / - / BBB	да	3 000	1.1 / 100%	8.89-9.10	8.89	26.10.2012	нет / 2.7 г.
Почта России, 04	- / - / BBB	да	3 000	1.1 / 100%	8.89-9.10	8.89	26.10.2012	нет / 2.7 г.
ЮниКредит Банк, БО-04	BBB / - / BBB+	да	5 000	2.0 / 100%	9.41-9.73	9.31	26.10.2012	нет / 1.88 г.
Внешпромбанк, БО-02	B / B2 / -	да	3 000	н/д / 100%	12.10-12.63	12.36	26.10.2012	нет / 1 г.
Группа ЛСР, 04	- / B2 / B	да	5 000	н/д / 56%	11.83-12.10	11.57	26.10.2012	нет / 1.84 г.
Банк Ингеза, БО-01	- / Ba1 / -	да	3 000	1.8 / 100%	9.73-10.25	9.99	25.10.2012	нет / 1.43 г.
РСХБ, 18	- / Baa1 / BBB	да	5 000	н/д / 100%	8.52-8.58	8.52	25.10.2012	нет / 1.88 г.
Российский Капитал, 03	- / - / B+	да	3 000	1.1 / 100%	10.78-11.30	11.09	25.10.2012	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 26198		02/11/12							5.66	0.00			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.23	100.29	100.28	0.02	25	175 876	5.84	0.21			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.19	100.20	100.20	-0.00	5	1 450	5.94	0.25			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.20	102.40	102.40		3	2 174	5.78	0.38			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.05	100.15	100.15	0.02	2	4 719	6.01	0.68			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.47	100.48	100.47	-0.01	4	24 000	6.17	0.92			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.69	100.75	100.68	-0.03	9	62 050	6.66	1.30	9	45	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.70	109.14	109.00	-0.30	3	7 852	6.67	1.63		50	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	108.75	109.25	108.00	-1.00	2	5 000	7.27	1.89	51	114	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.81	103.00	103.05		2	50 010	6.59	1.87		45	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.43	101.31	100.43	-0.11	4	105 010	6.93	2.33	6	82	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.15	101.17					6.92	2.45	3	82	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.45	101.52	101.49	0.01	6	85 010	6.94	2.86		85	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.20	98.35	98.35	-0.08	1	10	7.08	2.90	10	100	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.95	100.15	100.20	0.18	2	19	6.95	3.31		86	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	88.00						8.16	3.34	111	207	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.33	3.52	126	224	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.78	101.79	101.72	0.01	2	5 010	7.06	3.87		96	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.75	101.80	101.75	0.15	10	199 764	7.07	3.88		97	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.45	102.65	102.50	-0.10	3	12	7.05	4.48		92	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.55	92.60					7.36	4.52	16	123	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18		105.80					7.15	4.65		101	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.10	102.30	102.27	0.22	5	30 011	7.17	5.10		100	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		68.00					7.89	5.50	59	167	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	93.26	98.20	96.75	0.55	1	1	7.40	6.19	4	110	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.15	102.40	102.40	0.50	7	107 016	7.35	6.39		102	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	101.92	104.05	104.05	1.95	5	9 616	7.14	6.93		74	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		88.50					7.81	7.36	36	135	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	104.60	104.65	104.60	0.20	19	24 682	7.76	8.67	23	112	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36		88.60					8.15	10.87	51	123	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		105.00					6.51	11.21			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ	30/07/13	95.00	100.50	99.69	-0.01	2	100 000	7.56	0.71	129	126	15 000
---------------	----------	-------	--------	-------	-------	---	---------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО5	30/10/12							-3.74	0.00			10 000
НЛМК ВО1	04/12/12	100.12	100.20					6.40	0.08			5 000
НЛМК ВО6	05/03/13	100.01	100.18	100.00	-0.07	2	500	7.84	0.33		151	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.60	100.70				7.68	0.59	150	138	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.58	100.70				7.86	0.59	168	156	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.80	100.90				8.32	1.72	160	216	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.23	101.40				8.43	1.81	169	229	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.01	100.09				8.63	2.16	180	252	5 000

ММК

ММК ВО1	15/11/12	99.98	100.02					8.21	0.02			5 000
ММК ВО5	04/04/13	99.80	100.00	99.90	-0.05	9	4 137	8.03	0.41		171	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	99.85	100.05				8.40	0.75	210	211	5 000
ММК ВО4		27/02/14	98.91	99.03				8.46	1.25	190	224	5 000
ММК ВО6		10/06/14	97.25	97.60				8.89	1.57	222	271	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.25	97.80				8.94	1.60	226	277	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2	15/02/13	100.55	100.67	100.55	-0.08	5	6 822	7.77	0.28		144	10 000
Севсталь ВО4	15/02/13	100.55	100.68					7.43	0.28		110	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.08	100.29	100.16	-0.01	7	30 506	8.23	0.62	203	193	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.15	100.24	100.20		8	37 137	8.16	0.62	196	186	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.72	100.89	100.89	-0.11	7	300	8.84	2.33	197	273	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.72	101.01				8.78	2.35	191	267	3 000	

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.31	100.45	100.40	-0.10	1	3 000	8.25	0.37		193	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.31	100.40	100.40	-0.10	1	3 000	8.25	0.37		193	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.85	108.05	108.05	-0.10	1	527	9.09	1.77	236	294	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.81	108.09				9.07	1.77	234	292	10 000	
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.10	101.49				9.33	2.64	240	324	10 000	
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.10	101.70				9.64	2.64	271	355	5 000	
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	93.03	98.00				10.35	3.05	335	427	5 000	
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	93.03	100.00				10.35	3.04	335	427	15 000	

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.01	99.90	99.86	-0.01	2	42	9.26	2.15	243	315	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.50	99.85	99.85	0.16	3	8	9.27	2.15	244	316	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.00	99.96				9.26	2.16	243	315	10 000	

Мечел



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 BO1	11/11/11	09/11/12							10.71	0.01			5 000
Мечел BO2		12/03/13	98.95	99.00	99.00	-0.19	6	32	13.11	0.35		678	5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.10	108.00					-10.26	0.44			5 000
Мечел BO3		24/04/13	98.55	99.00	99.00	0.40	1	20	12.38	0.46		607	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.03	97.20	96.50		9	659	14.13	0.58	796	782	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.55	100.40					11.25	0.70	499	495	5 000
Мечел BO4	11/02/14	10/02/15	94.50	96.48					16.02	1.19	949	979	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	90.67	92.48	92.48	0.10	1	20	15.42	1.22	888	920	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.13	92.55					15.47	1.22	893	925	5 000
Мечел BO5		07/04/15							11.81	2.22	497	570	5 000
Мечел BO7		07/04/15							11.81	2.22	497	570	2 000
Мечел BO11		07/04/15							11.81	2.22	497	570	3 000
Мечел BO12		07/04/15							11.81	2.22	497	570	3 000
Мечел BO6		07/04/15							11.56	2.16	473	545	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	91.50	92.44					14.44	2.48	754	834	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.06	91.86					14.05	2.47	715	795	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	81.16	83.99					15.66	2.99	867	958	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.43	87.47					13.93	3.00	693	785	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	83.42	84.98	84.98	0.98	4	550	14.33	3.01	733	825	5 000
ТМК													
ТМК BO1		22/10/13	95.00	99.80	99.80	0.10	2	5 013	9.27	0.94	286	301	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.37	100.47	100.46	-0.14	16	4 037	8.77	0.64	255	247	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.25	98.00					13.49	1.04	703	724	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	90.28	91.79	91.79	0.74	6	56	15.58	1.44	895	939	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ BO1	05/06/12	04/12/12	100.15	100.44	100.06	-0.43	1	30	11.72	0.08			5 000
КОКС													
КОКС BO2		28/05/14	90.03	97.49	97.45	-0.21	2	34	10.79	1.43	417	460	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.82	93.30	93.44	0.14	17	4 060	14.37	1.26	781	815	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.60	88.41	88.41	-0.04	2	23	14.80	2.23	796	869	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12							-3.12	0.00			5 000
РЖД BO01		05/12/12	100.10	100.19	100.19	-0.05	2	3 100	6.95	0.08			15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13							7.68	0.97	125	142	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.00	109.21					7.72	1.23	117	150	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.20	102.30					8.00	2.03	120	188	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.14	99.44	99.44	0.14	3	35	8.17	2.66	124	208	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.27	99.40	99.30	-0.10	1	5 000	8.29	3.09	128	221	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	109	217	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.40	100.00					7.76	0.87	139	149	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.40	100.00					7.57	0.87	120	130	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	100.90	101.00	100.90	-0.25	6	6 802	8.03	1.47	139	184	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.12	101.30	101.15	-0.35	2	600	8.27	1.84	152	213	10 000
ФСК ЕЭС BO1	22/04/15	21/10/15	99.85	99.95	99.90		1	1 000	8.31	2.27	146	220	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.75	99.40					8.18	2.62	125	208	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.00	98.70					8.16	2.71	122	207	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	97.01						8.26	3.08	125	218	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	99.95	100.05					8.76	3.36	171	267	15 000
ФСК ЕЭС 21		06/10/27							8.94	3.81	183	284	00000 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	96.75	97.40					8.83	4.17	167	272	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	96.75	97.40					8.83	4.17	167	272	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.00	97.00					9.05	4.56	184	292	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.70	98.00					9.15	6.07	180	286	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.90	100.39					9.20	2.27	235	309	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.00	102.00					9.66	3.22	263	358	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	94.03	99.70	99.26	-0.04	12	90 296	10.02	0.95	360	376	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.68	244	329	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.30					9.37	2.96	238	329	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.20	100.00					9.19	2.96	220	311	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.59	222	322	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.46	3.60	237	337	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00						9.35	3.59	226	326	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16							8.25	1.32	167	204	7 000

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	
НЕФТЬ и ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14							7.48	0.01			15 000
Газпром А9		12/02/14	99.65	100.80					7.52	1.22	98	130	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.41	110.60					7.65	1.46	102	146	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							5.76	0.10			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							6.87	0.10		54	5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.00	100.10					7.51	1.03	106	126	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.55	101.00					8.97	0.19		264	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13							7.89	0.42		157	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13		101.12					7.26	0.42		94	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	92.00						8.41	2.05	161	229	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.54	100.75					8.46	2.84	149	237	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.20	100.60					8.47	2.86	150	238	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.60	102.20					8.77	4.23	160	266	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	97.00	98.74					8.86	4.46	167	273	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13		100.10	100.00		1	11 600	7.62	0.61	142	132	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.05	100.10	100.05	-0.10	6	11 695	8.50	2.65	157	241	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	100.00	100.10	100.00	-0.15	3	1 207	8.52	2.65	159	243	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.00	100.10	100.00	-0.15	2	2	8.52	2.65	159	243	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.20		99.50	-0.16	1	122	7.99	0.85	163	171	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.35	100.60	100.56	-0.14	2	196	7.48	0.12		115	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.30	100.60	100.50	-0.20	2	3	8.01	0.12		168	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.35	100.50	100.30	-0.22	1	3 000	9.81	0.12		348	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.20	101.72	101.25	0.10	2	105 593	8.27	1.01	182	202	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	100.20	100.99					8.58	2.07	177	246	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	95.01	100.22					10.25	0.71	398	395	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	96.92	99.10	98.52	-0.01	8	424	10.80	1.18	428	457	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	92.00	95.59					11.02	3.02	402	494	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	92.00	97.99					11.01	3.04	401	493	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	98.81	99.00	99.10	0.10	1	1	13.94	0.69	769	764	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50					9.52	3.10	251	344	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.25	100.55	100.55	-0.10	6	8 330	7.93	0.66	170	163	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.12	100.16	100.16	0.01	7	128 172	7.34	0.12		101	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.10	100.15	100.10	-0.05	2	3 250	7.69	0.22		136	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	100.00	100.04	100.00		1	1 500	7.81	0.35		148	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.70	100.07					7.53	0.35		120	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.96	100.06	100.00	-0.09	1	1	7.81	0.35		148	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.02	100.09					8.05	0.80	172	176	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.37	99.94					8.36	0.92	196	210	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.90	100.10	100.00		1	1	8.24	1.29	167	203	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.20	100.09	100.00	0.05	1	1	8.24	1.29	167	203	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90		100.00		10	1 000	8.68	2.59	176	258	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90		100.00		10	1 000	8.68	2.59	176	258	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90						8.34	0.54	221	203	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.99					9.39	1.91	262	326	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.17					8.20	0.77	189	191	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.05						7.58	0.17		125	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.38						8.01	0.31		168	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					7.70	0.47		139	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14							8.42	0.67	218	212	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					8.38	0.70	212	208	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17							7.69	1.05	123	145	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.95	1.17	243	272	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20							7.24	0.94	83	98	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.00	110.05					8.45	2.15	162	234	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32							8.73	2.70	179	264	00000 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32							8.73	2.70	179	264	00000 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.50	98.23					8.77	3.00	177	269	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21			100.00		10	820	8.68	3.37	163	259	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.61	96.85	96.84		7	284	8.89	4.16	173	278	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21							8.18	1.37	158	198	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	
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21		101.15	100.90	-0.10	2	25 001	8.47	1.85	172	233	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.75	101.15	100.90	0.10	2	40 800	8.47	1.86	172	233	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17		100.68					8.81	1.97	203	269	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		99.70					9.14	3.02	214	306	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21		100.00					9.14	3.02	214	306	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.50	101.00	100.25	0.23	1	1	8.67	1.33	209	246	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.30	100.65	100.35	-0.20	2	700	9.17	1.66	247	301	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.13	101.17	100.16	0.03	3	11 590	6.35	0.04			5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19		100.40					4.28	0.04			5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.33	100.40					7.71	0.25		138	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20		100.50					7.65	0.25		132	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.30	99.60					8.22	0.58	205	191	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.25	100.35					7.83	0.73	155	153	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.25	100.35					7.98	0.73	169	168	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.20	100.25	100.30		1	1	8.04	0.79	172	175	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.20	100.30	100.25	-0.05	5	30 201	8.11	0.79	179	182	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17							7.33	0.88	95	106	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	97.00	100.40	100.18	-0.12	1	1	8.16	0.96	174	190	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	99.85	100.89	100.70	-0.25	2	2	8.17	0.98	174	192	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.20	101.75	101.75	0.50	1	2	7.91	1.21	137	169	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18		100.50					8.49	1.66	179	233	5 000
РСХБ 18		13/10/22							9.00	1.88	224	286	
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22							8.53	1.88	177	239	00000 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.75	101.99	99.75	-0.50	1	5 000	8.85	2.24	200	274	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	98.15	97.95	-0.25	1	1	8.75	2.40	187	265	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.90	98.15	97.90	0.10	10	85	8.77	2.41	189	267	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.60	98.15					8.79	2.41	191	269	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							13.35	0.02			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							10.48	0.04			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.10						7.77	0.13		144	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.05	99.30	99.10	-0.15	5	4 300	8.23	0.69	198	193	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13		100.00					7.49	1.03	103	124	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.45	100.75					7.92	1.19	139	169	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.65	100.68	100.68	0.03	5	12	8.57	1.56	190	239	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	174	259	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	174	259	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	174	259	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	174	259	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14							7.84	1.13	134	161	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43		100.15					8.42	1.72	171	226	7 000
АИЖК А9		15/02/17		99.25		-0.45	1	25 000	8.26	1.82	152	212	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	99.40	99.25		1	4 300	8.34	1.87	158	220	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.30	99.50	99.32	-0.08	4	44	8.24	2.27	138	213	6 000
АИЖК А8		15/06/18	98.00	99.24					8.66	2.74	171	257	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30					8.60	2.96	161	252	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.10	99.32					8.51	3.03	151	243	7 000
АИЖК А21		15/02/20		101.00	100.95	-0.05	2	2 000 010	8.77	3.14	175	269	15 000
АИЖК А11		15/09/20		100.00					8.74	3.78	163	264	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	97.99					9.36	4.91	212	321	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	102.00					8.97	5.52	167	275	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	137	228	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13							8.98	1.02	253	273	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.18	100.18	-0.02	1	6 500	9.00	1.02	255	275	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14		100.00					9.58	1.61	290	341	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.00					9.51	1.61	283	334	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.91	100.15	100.05	-0.15	1	1	8.20	0.28		187	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.08					7.89	0.75	160	159	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.60	99.84					8.08	0.98	165	183	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.00	99.15	-0.85	2	805	9.08	1.39	247	288	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	99.60	100.25	100.02	0.01	1	5 000	8.10	0.60	192	180	10 000
МТС 1		17/10/13	99.10	99.75					8.04	0.93	164	178	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	98.70	98.98	98.80	-0.29	1	2 305	8.42	1.44	179	223	15 000
МТС 2		20/10/15	97.54	98.94	98.50	-0.09	1	1	8.50	2.68	156	241	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.75	99.00	99.00	-0.04	4	1 815	8.71	2.63	178	262	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.65	100.49					9.06	3.24	203	298	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	
МТС 7		07/11/17	98.60	99.30	99.00		1	20 000	9.15	3.99	201	305	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	101.00	101.30	100.92	0.10	1	1	7.99	0.68	175	169	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.65	97.95	97.95	0.19	1	1	8.93	1.56	226	275	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.00	99.75	99.50		1	251	9.29	2.17	246	318	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.10	99.75	99.50	0.25	1	167	9.29	2.16	246	318	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.55	99.60					9.29	2.16	246	318	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.51	98.00					9.09	2.65	216	300	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.51	98.30					9.30	2.65	237	321	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	99.80	100.20	100.30		3	111 000	8.03	1.81	129	189	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.49					7.76	0.59	158	146	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.60					7.96	0.50		165	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.50						8.41	1.20	188	219	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.50	101.69					7.60	1.20	107	138	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	99.80	99.95	99.51	-0.49	6	150 926	9.42	2.23	257	331	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.01	99.99					9.61	3.08	260	353	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.01	97.00	97.00		1	20	9.61	3.08	260	353	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.06	107.00					9.95	3.08	294	387	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.67	100.00					7.98	0.31		165	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	100.00	100.12					8.40	0.82	206	212	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50	100.12					8.24	0.82	190	196	1 000
Магнит БО-3		09/09/20	100.00	100.15	100.05	0.05	2	30 000	8.33	0.82	199	205	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	100.00	100.12					8.29	0.82	195	201	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.25	99.45					8.70	1.25	214	248	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.00						8.51	1.40	190	231	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.15	100.37	100.29	-0.96	1	1	8.97	2.58	205	287	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.00	100.00					7.90	1.47	127	171	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00						9.07	1.54	241	289	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.05	100.15					9.67	2.58	275	357	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	98.60	99.00					9.07	0.70	281	277	3 000
Копейка БО-2		01/10/13		100.30	100.28	0.22	5	93	8.95	0.87	258	268	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.11	99.49	99.49		2	20	11.29	0.51	519	498	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13							9.36	0.95	295	310	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.06	101.00					9.71	0.88	333	344	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.92	436	500	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.25	100.00	100.00	0.39	2	500	12.83	0.60	664	653	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.23	95.00					11.58	2.25	473	547	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.81	96.49					11.67	1.60	499	550	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14		99.85					9.57	1.70	286	341	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	90.01	96.00					10.90	1.16	438	467	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.04	100.17	100.04	-0.01	1	100	8.67	0.11		234	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.60	98.84					9.99	1.19	346	376	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	86.00	101.60					10.73	2.55	382	463	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.29	100.09	99.99	-0.01	2	10 000	9.39	0.10		306	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.40	99.64					9.95	0.78	363	366	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	97.01	99.70					11.54	0.93	513	528	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.45						8.78	0.82	244	250	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							8.03	0.12		170	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14		100.00	99.90	-0.10	1	4 000	9.42	0.46		311	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.00		99.72		4	122	9.07	0.46		276	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	99.90					8.14	0.85	178	186	5 000
СОЛЛЕРС													

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	
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.01	100.79					9.46	0.48		315	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.90	102.22	102.22		15	2 228	9.28	0.66	305	298	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.20	100.50	100.50	-0.05	3	3 852	10.75	2.03	395	463	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.95	100.17	99.90	-0.11	4	1 600	8.13	0.42		181	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.20					7.87	0.42		155	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.40	100.90					7.21	0.31		88	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.54	1.66	184	238	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	97.01	99.99					9.96	1.41	335	376	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.21	100.35	100.21	0.01	11	27 871	10.13	2.10	332	401	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.75	100.90	100.58	0.22	3	9	9.94	2.10	313	382	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.94	100.00	99.95		9	4 890	12.90	0.79	657	661	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.96	100.03	100.02	0.12	8	3 155	12.85	0.93	644	659	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.55	101.39					10.15	0.38		383	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.55	101.99					10.87	0.38		455	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.30						12.74	0.47		643	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.95	100.00	100.00		1	100	10.38	0.47		407	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.61	0.56	246	230	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	97.80						10.38	1.01	393	413	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							7.80	1.06	133	156	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.01	97.96					11.86	1.30	529	565	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.01	99.98					10.35	1.30	378	414	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16			103.40	0.10	3	3	8.69	3.17	167	261	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру гидро 1	22/04/16	12/04/21	94.01	99.40					8.52	3.08	151	244	10 000
Ру гидро 2	22/04/16	12/04/21	94.73	99.39					8.64	3.08	163	256	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16							8.61	0.29		228	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.15	100.39					7.80	0.08			5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	99.97	100.20	100.20	0.05	1	1	8.90	2.57	198	280	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60	100.60	0.40	1	2	8.39	2.26	154	228	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.30	100.50	100.54	-0.01	2	1 950	7.70	0.59	152	140	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	95.81						8.53	1.53	187	235	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	96.00					12.58	1.51	593	640	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	82.03	86.92					16.24	3.00	925	1 016	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.75	99.95	99.75	-0.16	2	2	9.25	2.64	232	316	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	94.03	99.47					10.19	1.69	349	403	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.64	0.13		131	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.00					8.96	0.64	275	266	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70	99.00					8.57	1.29	200	236	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.00	98.50	98.50	-0.65	6	3 302	10.41	0.75	412	411	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	81.00	81.97	81.00	-1.90	45	3 667	39.83	0.84	3348	3 355	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17		98.80	98.79	0.04	2	3 000	10.39	0.91	400	412	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	105.86						9.78	0.96	336	352	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	86.00						7.50	1.36	90	130	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	99.90	99.95	99.95	-0.05	1	100	8.46	0.81	213	217	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	95.25	101.70					7.42	0.48		111	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.61	98.20					10.93	0.79	461	464	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	100.00	100.49					9.02	2.35	215	291	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	98.50					9.22	2.64	229	313	5 000
АКРОН													

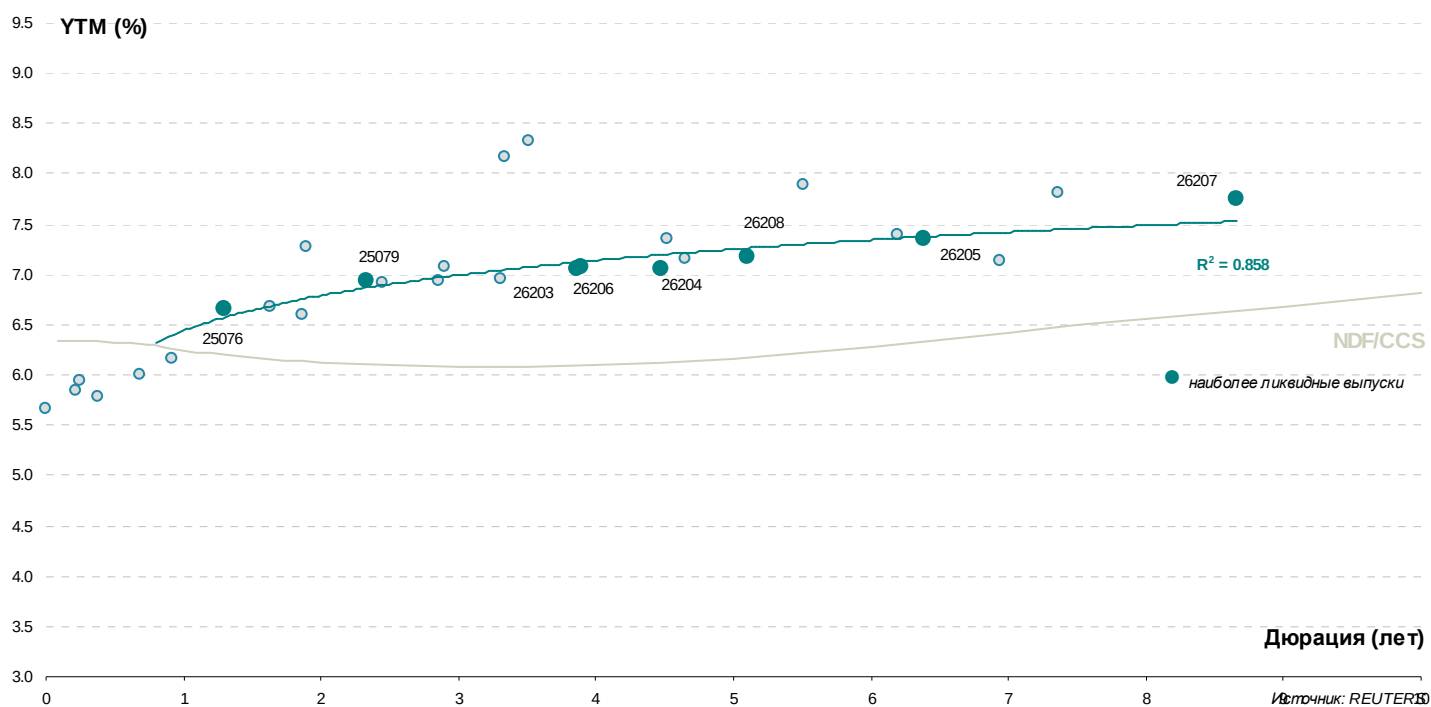
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.00	102.99					8.35	0.85	199	207	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.10	101.35					8.48	0.97	205	222	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	100.00					7.74	1.44	111	155	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	99.00					9.35	1.51	270	317	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.21	100.30	100.25	-0.10	2	10 000	9.88	2.61	296	378	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.20	98.69					9.83	1.36	323	363	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.20	100.35	100.20	0.10	4	1 400	9.00	0.24		267	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.12	0.61	393	382	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.20	100.35	100.20	-0.20	4	3 589	9.95	0.82	361	367	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.50						11.29	1.27	473	508	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.16	98.45	98.45	0.04	10	706	11.02	1.30	445	481	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	95.90	96.00	96.00		4	1 303	11.39	1.59	471	522	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.88	99.96					12.04	0.12		571	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	100.02	101.00					14.03	1.35	744	782	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.41	100.60	100.60	-0.20	4	205	9.02	0.08		269	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07	101.70					8.71	0.31		238	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.49					9.29	4.08	214	318	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.45					9.38	4.08	223	328	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	99.35					9.33	4.09	218	322	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.26	100.35	100.30	-0.05	2	1 434	7.58	0.06			19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.62	100.76	100.62	-0.06	1	4 918	7.91	0.33		158	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.80	100.10	100.10	0.05	2	1 500	8.45	1.65	176	228	20 000
АФК Система 4		15/03/16	95.65	99.03	98.41	-0.62	8	312	8.70	1.88	194	256	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	97.22	98.69	98.67	0.28	8	404	12.89	0.67	665	659	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.10	100.30					11.67	0.59	550	537	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.00	100.15	99.98		2	15	12.36	0.89	598	609	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14							8.31	0.50	222	200	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13							8.52	0.61	233	222	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13							8.70	0.65	248	240	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	97.00	98.50	98.29	-0.10	6	1 694	8.91	0.98	248	266	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	99.70	100.29	100.00	-0.10	1	3 000	9.50	1.72	279	334	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	96.50		96.45		2	5 001	9.60	1.90	284	347	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16		101.40					7.58	0.56	143	127	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.00	100.07	100.01	-0.14	8	50 001	8.60	0.87	223	233	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	97.50	99.70	99.60	-0.10	1	575	8.76	1.19	223	253	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.90	100.20					8.68	1.25	213	246	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.27	100.39	100.38	0.08	2	6 100	6.54	0.06			5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14		100.28	100.24	0.09	4	114	7.25	0.11		92	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.07	100.11	100.11	0.06	6	4 525	9.04	0.66	281	274	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.13	1.31	255	292	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.65	99.85					8.68	0.45		236	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	99.95	100.00	100.00	-0.15	3	18 001	8.91	0.58	274	260	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15			100.20		1	500	9.03	0.73	274	273	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/13	99.35	99.79					9.05	0.78	273	276	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.80	100.19					9.28	1.24	273	306	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.75	100.10					9.77	1.52	312	359	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.00	100.08	100.01	-0.02	1	1	8.34	0.02			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.96	99.98	99.97		15	54 974	7.82	0.05			5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.12	100.21					8.37	0.25		204	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.12	100.21					8.03	0.27		170	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13	86.00	99.90					8.91	0.42		259	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.31	100.45	100.30	-0.14	1	1	8.61	0.55	247	230	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.35	100.50	100.50		1	1 500	8.54	0.63	233	224	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.26	100.29	100.29	0.01	11	108 125	8.98	0.79	266	269	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.86	126	134	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.15	100.30					9.24	1.36	264	304	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	100.04	100.05	100.05	0.01	4	12 600	8.67	0.29		234	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	
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15	100.00	100.04	100.00	-0.06	3	6 578	8.86	0.29		253	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13		99.70					8.93	0.59	275	263	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	95.00	99.44	98.98	-0.03	2	94	9.69	1.19	316	346	5 000
Промсвязьбанк 7	06/09/14	06/09/15	100.16	100.29	100.15	-0.05	2	800	10.29	1.69	358	413	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	99.00	110.00					12.20	3.91	507	610	5 000
Банк СПб													
Банк СПб ВО1	09/10/12	09/04/13							8.26	0.04			5 000
Банк СПб ВО4	13/12/12	12/12/13			100.04	-0.16	4	4	8.11	0.10		178	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.90	100.30					8.93	0.86	257	265	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.00	100.26					9.36	0.90	297	309	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.30	100.20	-0.07	4	8 800	8.48	0.19		215	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.80	99.86	99.88		1	2	9.03	0.30		270	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.91	99.94	99.92	-0.02	5	55 100	9.64	0.47		333	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.70	99.89	99.80	0.60	1	1	10.21	0.86	384	394	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15		100.05					9.97	0.90		358	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.95	100.00	99.95	-0.05	3	4 500	10.54	1.37	394	434	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.05	98.30					10.61	1.50	397	442	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.50	100.55	100.55	-0.07	3	9 015	7.93	0.12		160	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15		101.25					8.87	0.80	254	258	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	99.89	101.00					9.50	0.77	319	321	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	99.89	100.58					9.41	1.23	286	319	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.60	99.90					9.24	0.83	289	296	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.96	100.09	100.02	-0.07	3	1 041	9.90	1.24	335	368	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.17	100.25					9.56	0.59	338	326	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14		100.20	100.00	-0.05	2	3 030	9.84	0.66	361	354	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.90	99.05	98.90	0.05	1	100	10.16	0.86	379	389	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15							10.95	1.02	450	470	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.50	101.00	100.50		3	3	11.48	1.03	502	523	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.30	100.45					11.19	1.23	464	497	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.70					11.10	1.95	432	497	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.80	101.40					11.56	1.99	477	544	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.35	98.79					12.37	0.72	609	607	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	99.77	100.50					13.09	0.73	681	679	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.30	100.39	100.30	0.04	2	2 000	12.89	0.45		657	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	09/07/15	100.31	100.40	100.40	0.10	3	4 190	13.63	0.66	740	733	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	103.96	104.29	104.20	-0.15	7	388	14.04	0.68	779	774	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	100.04	100.99	100.30	-0.70	3	9	14.27	0.84	792	799	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.61	102.69	102.61	0.01	28	6 120	14.20	0.95	779	794	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.05	100.40	100.50	0.10	14	5 446	13.97	1.19	744	774	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.85	99.90	99.90		11	1 349	14.82	0.72	854	852	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17							10.89	0.02			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22		100.00	100.00		9	5 751	8.87	0.86	250	259	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.25	100.40					9.51	1.69	280	335	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	96.87	100.00	100.02	0.12	2	400 000	7.62	0.96	120	136	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.25	101.00					7.96	1.19	143	174	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.14	1.21	160	192	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.54	2.09	173	242	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15							6.99	0.02			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.00	100.30	100.07	0.03	1	5 000	8.56	0.79	223	227	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	94.10	100.20					8.63	0.81	230	235	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.50					8.51	0.81	218	222	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.78	1.03	232	253	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.02	3.39	196	293	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.80	100.90					7.95	1.01	150	170	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.60	99.75					7.95	1.01	151	170	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		215	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14							-1.15	0.01			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.32					8.23	0.38		191	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	
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.35	100.48	100.48	0.08	4	5 010	9.08	0.97	265	282	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.53	0.48		122	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.00	100.49					10.76	0.74	447	446	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00						10.47	0.92	407	421	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14		100.57					11.16	1.31	458	495	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14		100.00					7.82	0.10		149	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.03	100.12	100.09	0.07	1	4 950	8.54	0.44		222	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14		101.00	99.25	0.45	3	3	9.01	0.93	260	275	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.97	100.03	100.03	-0.14	1	1	10.10	2.21	326	399	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10					7.98	1.34	139	177	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.91	99.05					8.99	0.64	277	269	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.65	99.85	99.70	-0.05	1	1	9.31	0.81	297	303	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		102.00					9.15	0.84	280	287	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15		100.22					9.24	0.84	289	296	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.20	101.00					9.31	0.96	289	305	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15		98.95					9.42	0.96	300	316	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.30	100.45	100.35	-0.20	1	1	8.91	0.73	263	261	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.25	97.45					9.16	1.51	251	298	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							9.39	1.85	264	325	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.15	100.28	100.20	-0.14	4	25 000	10.58	1.25	403	436	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.21	97.55	97.51	-0.08	9	383	10.48	1.32	390	427	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.96	96.00	95.96	-0.04	6	20 401	10.83	1.61	415	466	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.10	100.50					8.15	0.11		182	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60	100.20					10.50	0.53	437	419	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	98.75	99.15	98.80	-0.44	1	1	10.63	0.65	440	433	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	99.90	100.30					10.18	0.90	379	391	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.04					10.01	0.90	362	374	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	86.00						9.83	1.22	329	361	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.90	100.00	99.95	-0.10	2	2 000	10.27	1.19	374	404	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	94.01	97.99	97.37	0.05	2	76	10.32	1.41	370	412	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.66	99.85					9.43	0.91	304	316	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15							9.97	1.40	336	377	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.05	100.20					8.07	0.12		174	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.20					6.80	0.12		47	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.20	100.36					9.06	0.45		274	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.55	100.63	100.63	0.03	7	18 078	9.53	0.61	334	323	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						7.67	0.12		134	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	100.00	100.24	100.00		1	2 000	8.93	0.46		262	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	283	362	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	99.50	100.00	100.00		1	1	10.76	0.93	436	450	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	98.01	100.05	100.00	0.30	4	1 017	11.19	0.32		486	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.86	100.00	100.00		2	4	11.28	0.90	489	501	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14		99.90					9.45	0.24		312	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					11.38	0.43		506	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15		100.30					11.70	0.89	532	543	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.10	100.17	100.10	-0.05	3	5 000	9.31	0.12		298	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	93.00	97.00	96.95	0.20	2	200	10.20	1.61	352	403	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14		100.20	99.99	-0.01	3	7 802	9.98	0.43		366	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	
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13		100.20	100.00		2	2 000	9.97	0.46		366	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.26	100.07	99.92	-0.18	2	22 000	11.37	0.86	501	509	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.05	100.16					9.37	0.06			3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	98.00	100.50					12.46	0.81	612	618	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.10	100.19					9.16	0.25		283	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	98.00	100.15	100.00	-0.10	2	3	10.31	0.69	406	401	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15		100.37					10.55	0.74	426	425	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.50	100.19	100.00	0.02	1	1	9.70	0.53	358	339	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.15	99.45	99.35	-0.10	1	1	9.72	0.65	350	342	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15							10.31	0.90	392	404	2 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.70	99.85	99.85	0.24	5	28	9.37	0.92	297	311	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.80	100.09					9.46	0.92	306	320	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	99.91	100.14					11.81	0.48		550	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.10	100.15	100.15	-0.05	12	7 630	12.66	0.87	629	639	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14		100.10	99.85		1	1	11.10	0.12		477	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.05	100.24	100.05		2	10	12.75	0.75	646	645	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03		28/10/15							11.00	0.98	457	475	
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.13	100.16	100.13	0.01	4	2 722	10.11	0.06			2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.98	100.10					10.57	0.10		424	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.02	100.00	100.00	-0.08	3	343	11.48	0.29		515	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.01	100.30					10.46	0.31		413	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.60	99.70	99.70	0.05	2	4	12.08	0.42		576	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	99.75	100.05	100.05		1	2	13.38	0.91	699	711	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.63	100.00					12.42	1.06	595	618	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.91	100.10	100.10	0.10	1	50	12.57	1.36	597	637	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61		03/06/13	104.30	105.39					7.45	0.55	131	114	30 000
Москва 53		01/09/13		100.32					6.97	0.80	64	68	15 000
Москва 63		10/12/13	109.15	110.23					6.04	1.01			15 000
Москва 62		08/06/14	107.99	108.25	108.25	0.54	1	5	7.02	1.44	39	83	35 000
Москва 39		21/07/14	92.50	100.00	99.50	-0.30	1	910	7.44	1.61	76	127	10 000
Москва 64		24/06/15	98.20	98.99					7.52	2.39	64	142	20 000
Москва 44		16/11/15	105.59	113.77					7.35	2.50	45	125	40 000
Москва 56		22/09/16	96.75	98.15					7.75	3.43	69	166	20 000
Москва 49		14/06/17	97.25	97.50	97.50	0.15	2	100 000	7.80	3.90	67	170	25 000
Москва 48		11/06/22	90.75	91.19	91.18	0.48	6	1 005	8.05	6.84	64	166	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8		11/06/13	100.25	101.00	100.45	-0.05	1	4 195	8.35	0.57	219	204	19 000
Московская Обл 7		16/04/14	99.30	99.40	99.40	-0.10	2	42	8.62	1.38	202	242	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5		02/12/12	100.32	100.44	100.30	-0.10	2	5 000	8.38	0.07			3 000
Нижегородская Обл 4		17/11/12	100.04	102.05					6.04	0.03			3 000
Нижегородская Обл 6		07/10/15	99.27	100.20					8.46	1.77	173	231	5 000
Нижегородская Обл 7		16/11/16	90.02	103.00	102.75	-0.01	3	20 000	8.73	2.16	190	262	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6		10/05/13							7.71	0.48		140	2 000
Самарская Обл 5		19/12/13	101.39	101.75					8.12	1.06	165	188	8 000
Самарская Обл 7		30/11/16	97.50	98.75	97.70	-1.40	1	30 000	8.92	2.04	212	280	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.80	100.10	100.10	0.10	2	2 500	7.92	0.42		160	3 000
Якутия 9		19/09/13	100.71	102.00					7.60	0.60	142	130	2 000
Якутия 7		17/04/14	99.60	100.00					8.05	1.30	148	184	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12	86.00							0.10			2 000
Краснодар 02		05/11/15							8.87	1.10	238	263	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	99.62	99.95	99.95	0.20	1	5 000	8.24	1.32	166	203	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4		08/11/12							-5.62	0.01			10 000
Красноярский край 5		29/11/16	101.10	101.50					8.19	1.45	156	200	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	99.66						8.45	0.52	234	214	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	99.50					9.67	1.40	306	347	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	86.02	95.50					8.52	2.30	166	241	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							8.98	2.30	212	287	2 000

ОФЗ



Результаты торгов евробондами

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	106.270	106.600	1.05	0.92	2.39	0.14	64
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17	106.250	106.625	1.77	1.68	4.14		110
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18	146.917	149.472	2.21	1.83	4.55	0.02	133
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30	127.304	127.455	2.78	2.76	5.52	0.61	143
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20	116.375	116.875	2.58	2.51	6.42	0.38	132
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22	112.375	112.875	2.98	2.92	7.85	0.38	142
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28	197.947	199.053	4.16	4.10	9.25	0.55	220
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42	121.625	122.625	4.32	4.27	15.99	1.13	189
ГОСКOMPАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13	101.329	101.454	1.54	1.27	0.45	-0.01	126
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13	101.880	102.880	1.38	-0.79	0.44	0.20	110
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13	102.470	102.520	1.45	1.33	0.42	0.11	117
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13	104.201	104.701	1.65	0.98	0.71	-0.01	135
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14	110.778	111.528	2.52	2.00	1.29		221
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14	110.500	111.250	2.45	1.92	1.25		215
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14	109.593	109.718	2.41	2.34	1.62	-0.08	207
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15	107.357	107.836	2.57	2.42	2.82	0.10	212
GAZPR'16 4.95%	USD	23/05/16	106.897	107.897	2.89	2.60	3.23	0.21	238
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16	111.396	111.850	3.18	3.07	3.57	0.15	260
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18	122.531	123.523	3.54	3.36	4.57	0.23	272
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19	131.083	131.579	3.78	3.70	5.20	0.56	278
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20	111.998	112.332	3.19	3.09	2.95	0.03	241
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22	117.804	118.302	4.18	4.13	7.27	0.43	270
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22	105.625	106.375	4.24	4.14	7.77	-0.36	267
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34	142.454	143.502	5.29	5.23	11.86	1.05	312
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37	128.302	128.809	5.24	5.21	13.09	1.21	296
Газпром нефть									
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22	100.500	100.750	4.31	4.28	8.07	0.25	271
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13	104.426	106.426	1.69	-0.88	0.73	-0.03	139
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14	105.500	105.900	1.45	1.16	1.28	0.09	113
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18	129.000	130.000	3.14	2.98	4.72	-0.06	226
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17	110.891	111.361	3.07	2.97	3.96	0.09	243
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22	111.746	112.746	4.18	4.06	7.51	0.25	267
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17	101.531	102.531	5.02	4.80	4.42	0.51	431
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15	107.010	107.496	3.30	3.09	2.17	0.21	293
VTB'17 6%	USD	12/04/17	104.830	105.205	4.78	4.68	3.95	0.55	416
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18	105.468	106.468	5.12	4.91	4.54	-0.01	435
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18	107.825	108.320	5.23	5.13	4.62	0.32	442
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20	106.131	106.630	5.58	5.51	6.34	0.56	435
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22	103.549	104.299	6.46	6.36	7.37	0.01	498
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35	106.759	107.009	5.71	5.70	12.48	0.32	349
VTB' 9.5%	USD		100.558	101.558	9.41	9.26	6.56	-0.29	811
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13	102.630	102.880	2.13	1.65	0.49		185
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15	106.735	107.735	3.67	3.24	2.19	0.24	330
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15	103.000	104.000	4.89	4.54	2.76	0.25	449
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17	100.380	101.380	5.92	5.67	3.90	0.13	533
ВЭБ									
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17	108.669	109.169	3.18	3.06	3.84	0.14	256
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17	109.691	110.188	3.34	3.24	4.40	0.43	258
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20	118.261	118.759	4.10	4.03	6.11	-0.04	287
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22	111.625	112.625	4.53	4.41	7.46		301
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25	118.279	118.776	4.89	4.84	8.99	0.22	302
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13	103.351	103.476	2.58	2.39	0.62	-0.36	231
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14	105.765	106.058	3.38	3.24	1.96	0.15	304
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15	107.568	107.965	3.70	3.56	2.66	0.16	329
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16	110.976	111.276	3.92	3.83	3.13	-0.01	340
GAZPROM '17 5.625%	USD	17/05/17	103.766	104.141	4.69	4.60	3.96	0.15	405
GAZPROM '19 7.25%	USD	03/05/19	106.221	107.221	6.08	5.89	5.33	0.04	511
GPB EURO' 7.875%	USD		100.224	101.224	7.82	7.60	4.53	0.17	713
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13	102.771	103.818	1.79	-0.17	0.50	0.12	151

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.692	105.817	2.21	2.11	1.13		190
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.503	110.628	2.23	2.16	1.47		190
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		111.150	111.647	3.60	3.49	3.93	0.14	295
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		107.178	107.553	3.75	3.67	4.51	0.03	297
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		120.009	120.506	3.73	3.64	4.58	0.40	289
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		105.635	106.260	4.28	4.10	3.20	0.12	379
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		102.625	103.125	1.36	0.42	0.50	0.16	108
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.000	103.500	1.78	1.03	0.63	-0.07	149
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.439	107.688	2.59	2.49	2.48	-0.02	218
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.859	108.358	3.45	3.33	3.95	0.24	282
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		105.872	106.672	3.45	3.25	3.85	-0.03	283
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		106.053	106.491	4.13	4.05	5.64	0.04	306
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		109.035	109.660	4.44	4.36	6.86	0.25	305
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		112.225	113.225	4.49	4.37	7.23	0.49	302
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		100.022	100.772	5.12	5.03	7.92	0.01	355

ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ

Евраз

EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.882	103.382	2.51	1.44	0.46	0.22	224
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		108.630	109.109	5.11	4.95	2.64	-0.02	472
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		103.781	104.781	6.41	6.16	3.88	0.48	584
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		112.736	113.720	6.68	6.48	4.44	0.22	595
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.364	101.364	6.67	6.45	4.66	0.07	592

Металлоинвест

METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		102.625	103.125	5.70	5.55	3.29		523
--------------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	--	-----

НЛМК

NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		100.000	100.437	4.95	4.87	5.88	0.45	385
----------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	------	-----

Альянс Ойл

Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		107.250	107.850	6.48	6.21	2.12	0.47	619
---------------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	------	-----

Алроса

ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.800	111.100	3.31	3.16	1.83	0.12	296
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.345	115.091	5.51	5.40	6.24	0.18	427

Вымпелком

VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.709	102.916	2.60	2.17	0.48	-0.02	232
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.800	102.200	4.49	2.99	1.58	-0.09	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.460	106.460	4.33	4.33	2.93	0.18	388
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.587	112.088	4.66	4.52	3.06	0.21	419
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		104.490	105.490	5.08	4.83	3.82	-0.29	450
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.696	118.206	5.35	5.26	4.52	0.99	457
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.660	110.660	6.23	6.08	6.23	0.03	498
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		108.375	108.875	6.30	6.23	6.89	0.75	491

Лукойл

LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.350	108.750	2.07	1.87	1.90	-0.11	170
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.597	113.991	3.14	3.06	3.99	-0.02	248
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.063	121.063	3.94	3.79	5.74	-0.40	284
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.715	114.216	4.10	4.03	6.56	0.12	280
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.136	120.892	4.09	4.01	7.30	-0.03	259

МТС

MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		124.963	125.475	4.69	4.62	5.81	1.27	351
---------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	------	-----

НОВАТЭК

NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.750	107.250	3.11	2.96	2.98	0.24	265
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.000	117.500	4.15	4.08	6.54	-0.11	282

Северсталь

SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		105.500	105.800	2.03	1.63	0.70		175
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.750	110.000	2.34	2.18	1.38	0.13	203
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		104.825	105.825	4.81	4.53	3.33	-0.22	432
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		107.382	107.882	5.00	4.89	4.32	0.62	430
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		99.478	100.478	5.97	5.84	7.63	0.52	445

ТМК

TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		103.101	104.101	7.03	6.80	4.32	-0.01	634
--------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	-------	-----

Распадская

RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		104.376	105.376	6.60	6.35	3.87	0.14	604
-----------------	-----	----------	--	---------	---------	------	------	------	------	-----

ТНК-ВР

TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.250	105.250	0.94	-7.28			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.414	108.302	2.80	2.40	2.09	-0.02	243
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.029	116.037	3.15	2.89	3.26	0.51	263
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.570	114.557	3.26	3.04	3.87	0.59	263
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		120.682	121.692	3.59	3.40	4.51	1.04	278
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		120.584	121.628	3.95	3.80	5.82	-1.38	279

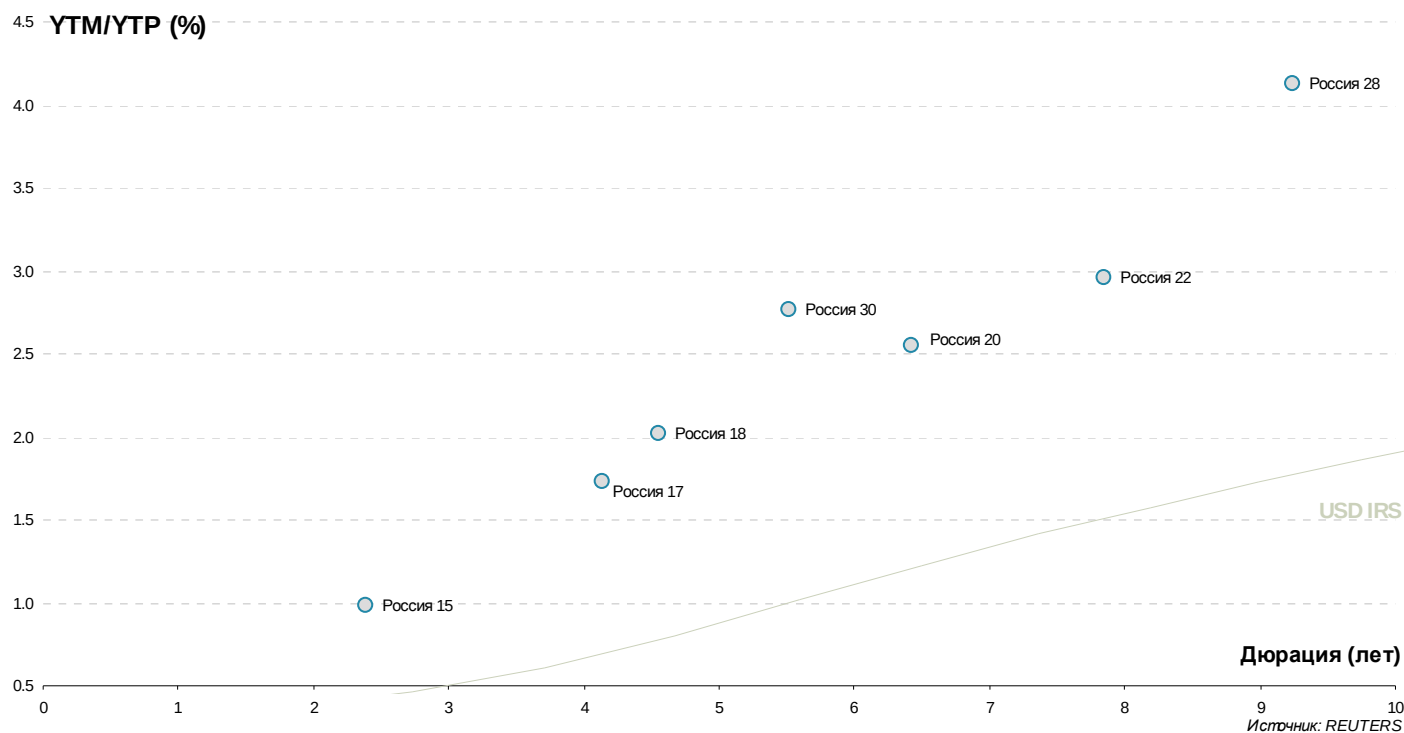
ЧАСТНЫЕ БАНКИ

Альфа-Банк

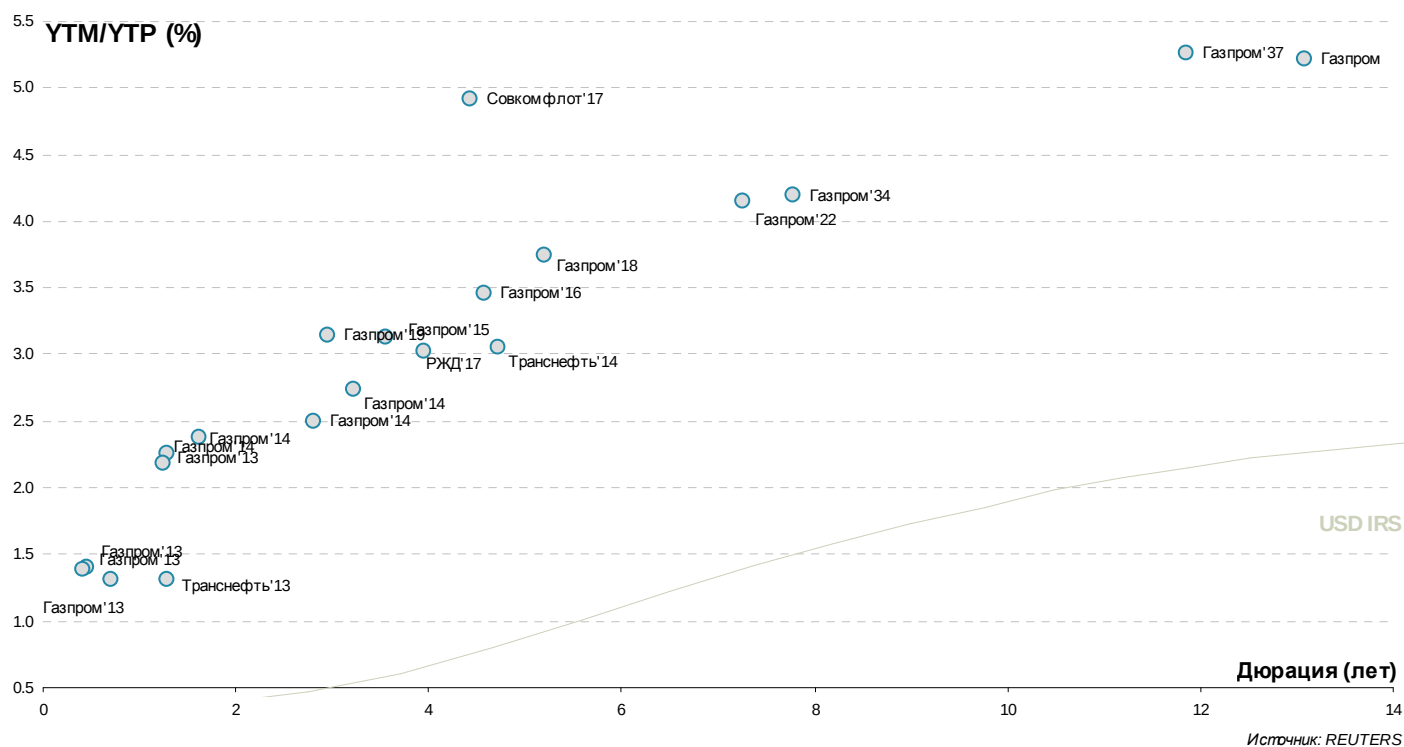
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.162	104.412	2.49	2.10	0.60	0.07	221
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.605	109.572	4.13	3.72	2.18	-0.02	378
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.387	100.387	6.46	6.19	3.77	-0.01	592
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.355	110.355	5.65	5.43	4.15	-0.17	499

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.355	110.355	5.65	5.43	4.15	-0.17	499
ALFA BANK'21 7.75%	USD	28/04/21		108.760	109.760	6.39	6.25	6.46	-0.11	513
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		100.450	100.575	4.79	3.65	0.11		475
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		101.997	102.247	4.33	4.06	0.93		407
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		104.754	105.754	6.94	6.57	2.66	-0.01	661
NOMOS BANK'19 10%	USD	26/04/19		100.272	101.272	9.94	9.73	4.90	0.13	918
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'18 12.5%	USD	31/01/18		101.500	102.500	5.49	1.30	0.23		539
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.883	105.133	3.44	3.09	0.66		318
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14		100.898	101.398	5.55	5.19	1.42	0.03	530
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		110.758	111.758	8.00	7.59	2.16	0.02	775
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		106.755	108.755	9.04	8.42	3.02	0.02	870
PROMSVYAZB'17 8.5%	USD	25/04/17		100.503	101.503	8.36	8.09	3.80	-0.01	787
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		102.792	104.281	4.85	3.73	1.31	-0.02	458

Россия



Госкомпании



YTM/UTP (%)

Дюрация (лет)

USD/IRS

Источник: REUTERS

Банк	Дюрация (лет)	YTM/UTP (%)
Сбербанк'13	0.8	0.8
Сбербанк'11	0.8	0.9
Сбербанк'13	0.8	1.4
Газпромбанк'13	0.8	2.5
Банк Москвы'11	0.8	1.9
Банк Москвы'13	0.8	2.1
ПСХБ'13	0.8	2.1
ПСХБ'14	1.8	2.1
ПСХБ'14	2.0	2.2
ВТБ'11	2.0	2.8
Газпромбанк'14	2.2	3.1
Банк Москвы'15	2.5	3.4
Сбербанк'13	2.8	2.6
Газпромбанк'15	3.0	3.6
ПСХБ'21	3.2	4.2
Сбербанк'15	3.8	3.1
ВТБ'12	4.0	4.8
ВТБ'15	4.5	5.0
ВТБ'18	4.5	5.2
ПСХБ'16	4.5	3.6
ПСХБ'17	4.8	3.7
ПСХБ'18	4.8	3.8
ВЭБ'16	4.5	3.2
ВЭБ'17	4.8	3.2
ВЭБ'20	6.2	4.1
ВЭБ'25	7.5	4.5
ВЭБ	9.0	4.9
ВТБ'20	7.0	6.4
ВТБ'35	12.5	5.7

YTM/YTP (%)

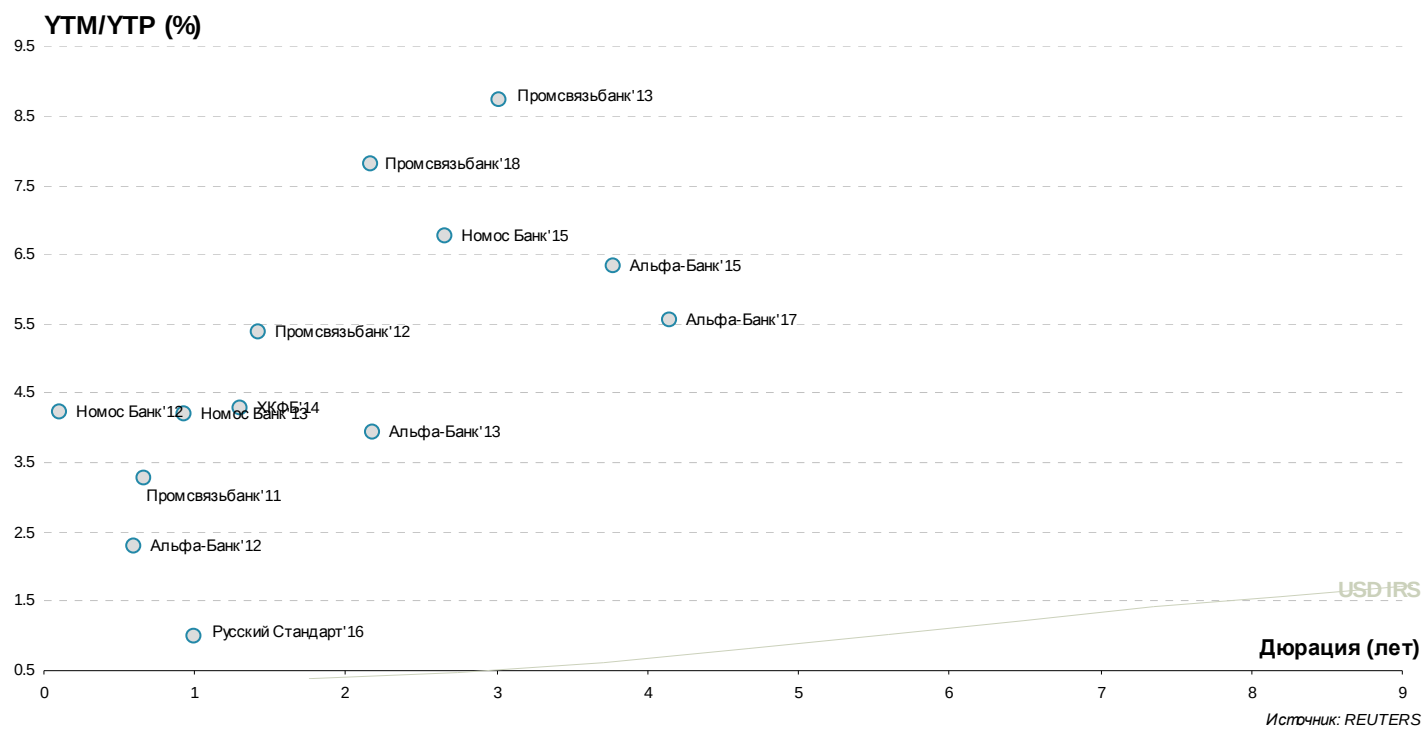
Дюрация (лет)

USD IRS

Источник: REUTERS

Компания	Дюрация (лет)	YTM/YTP (%)
Еврохим'12	0.5	1.8
Северсталь'13	1.0	1.8
Евраз'13	1.2	2.1
Северсталь'14	1.5	2.3
ВМП'11	1.5	2.5
ТНК'12	1.8	2.6
Алроса'14	1.8	3.2
ВМП'13	2.0	3.7
Альянс Ойл'15	2.2	6.3
ВМП'16	2.8	4.3
ВМП'15	3.0	5.0
Северсталь'17	3.2	4.6
ТНК'13	3.2	3.0
ТНК'15	3.8	3.1
ТНК'16	4.0	3.1
Лукойл'17	4.2	2.9
ВМП'18	4.2	5.6
Евраз'18	4.5	6.7
ВМП'18	4.5	6.5
Евраз'18	4.8	6.5
ВМП'21	4.8	5.3
Северсталь	5.0	5.0
МТС'12	5.8	4.6
Лукойл'19	5.8	3.9
ТНК'17	6.0	3.9
ВМП'20	6.2	6.1
Алроса'20	6.5	5.4
Лукойл'20	7.0	4.3
Лукойл'22	7.5	4.0

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 Гашигуллина

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.