

24 октября 2007 г.

ВНУТРЕННИЙ РЫНОК**Николай Подгузов****ВНЕШНИЙ РЫНОК****Николай Подгузов**

- Стратегия внутреннего рынка

- Стратегия внешнего рынка

ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК**Алексей Моисеев****НОВОСТИ**

- Стратегия валютного рынка

- АЛРОСА может приобрести акции компании Полус Золото, долговая нагрузка возрастет
- Интерпрайп: финансовая отчетность за первую половину 2007 г. по МСФО

ВНУТРЕННИЙ РЫНОК**Николай Подгузов +7 495 783-5673**

Стратегия внутреннего рынка

Торговля на рынке рублевых облигаций во вторник носила оживленный характер. Ставки денежного рынка несколько снизились, объемы операций прямого РЕПО Банка России оставались невысокими, ситуация на внешних рынках также улучшилась, и на этом фоне спрос на рублевые долговые инструменты увеличился. Однако из-за стремления отдельных участников рынка зафиксировать прибыль на сильном рынке заметного изменения котировок облигаций не произошло. В первом эшелоне большие торговые обороты были зафиксированы в выпусках Газпром-8, Газпром-9, РЖД-5, РЖД-6, ЛУКОЙЛ-3, ЛУКОЙЛ-4. Также пользовались спросом инструменты региональных операторов связи: ЮТК-3, ЮТК-5, Северо-Западный Телеком-4, ВолгаТелеком-4. Возобновились покупки облигаций Седьмой Континент-2. Кроме этого выпуска, в сегменте обязательств операторов розничных сетей мы обращаем внимание на облигации Магнит Финанс-1, доходность которых на уровне 9.0% при дюрации один год представляется нам привлекательной. Облигации холдинга Объединенные кондитеры также выглядят недооцененными, предлагая премию на уровне 100 б. п. к выпуску ВБД-2.

Второй день подряд наблюдаются высокие торговые обороты в выпуске Банк Русский Стандарт-4, доходность которого существенно выросла на фоне фиксации прибыли крупным иностранным участником рынка. В текущих условиях приобрести эти облигации можно с доходностью около 13.25%, что, на наш взгляд, является хорошей компенсацией за кредитный риск эмитента. Из других событий в сегменте банковских облигаций отметим продажи рублевых еврооблигаций УРСА Банк 10, где ликвидация позиции иностранного инвестора состоялась по цене 92.0 (доходность 13.65%). В результате доходность этого инструмента почти на 200 б. п. превысила аналогичный показатель сопоставимого по дюреции выпуска УРСА Банк-7. Мы рекомендуем инвесторам открывать длинные позиции в обязательствах УРСА Банк 10 по цене 92-94.

Во вторник состоялось дебютное размещение облигаций банка Тинькофф Кредитные Системы (ТКС Банк) объемом 1.5 млрд руб. ТКС Банк – новый бизнес-проект в сегменте потребительского кредитования. По итогам конкурса ставка купона нового выпуска к оферте через полтора года была установлена на уровне 18.0%. Однако даже при такой довольно высокой ставке эмитенту удалось разместить облигации всего на 272 млн руб. Результаты этого размещения показывают, что после коррекции на рынке в августе-сентябре инвесторы менее склонны к покупкам долговых обязательств с высоким риском. На наш взгляд, сегментация рынка в зависимости от кредитного качества эмитента должна продолжиться. В нынешних условиях преимущество при выходе на долговой рынок должны получить наиболее прозрачные с финансовой точки зрения эмитенты. Возрастет ценность кредитных рейтингов, будут предъявляться новые требования к проспектам эмиссии, которые будут предусматривать положения, дисциплинирующие финансовую деятельность заемщика на период обращения облигаций.

В ближайшее время наибольшим успехом будут пользоваться размещения эмитентов первого-второго эшелона. В частности, в ближайшее время должны начаться размещения обязательств сотовых операторов МТС и ВымпелКом. Срок обращения дебютного выпуска рублевых облигаций ВымпелКома может составить три года, ориентир организаторов по доходности нового выпуска – 8.68%. Такой уровень доходности представляется весьма привлекательным, но, скорее всего, по результатам аукциона ставка доходности окажется существенно ниже заявленной.

Николай Подгузов
Телефон: 783 5673

Стратегия внешнего рынка

Несмотря на частичное восстановление американского рынка акций после резкого падения в конце прошлой недели, доходности американских казначейских обязательств во вторник возобновили падение, усиливая ожидания снижения ставки ФРС США на заседании Комитета по операциям на открытых рынках 31 октября. Новым поводом для беспокойства инвесторов стали очередные сообщения о возможных банкротствах американских строительных компаний и финансовых институтов, занимающихся выдачей ипотечных кредитов. По итогам дня доходность двухлетних КО США уменьшилась на 4 б. п., составив 3.82%. Если сегодняшние данные по динамике продаж домов на вторичном рынке в сентябре окажутся слабыми, ожидания дальнейшего замедления темпов роста экономики США могут возрасти.

Во вторник большую часть дня на развивающемся рынке облигаций преобладали позитивные настроения, что проявилось в заметном сокращении спрэдов высокодоходных обязательств к базовым активам. По итогам дня спрэд EMBI+ к КО США сократился на 2 б. п., а совокупный доход индекса вырос на 0.18%. Индикативный суверенный выпуск Россия 30 торговался на уровне 113.0, спрэд выпуска к базовым активам оставался широким – 122 б. п. Корпоративные еврооблигации при этом пользовались довольно высоким спросом. В лидерах роста вновь оказались долговые инструменты Газпрома и ТНК. Покупки выпуска Газпром 18 были отмечены на уровне 101.375, цена покупки выпуска ТНК-BP 18 увеличилась до 99.25. Вместе с тем, в сегменте еврооблигаций операторов сотовой связи и промышленных компаний инвестиционная активность оставалась низкой при широких спредах между котировками на покупку и продажу.

Николай Подгузов
Телефон: 783 5673

Страна	EMBI+	Изменение, %			EMBI+спрэд	Изменение за день, б.п.
		1-День	1-Неделя	С начала года по сегодняшний день		
EMBI+ Global	428.8	0.18	0.49	5.28	204.0	-2.00
Аргентина	111.0	0.33	-0.45	-12.6	388.0	0.00
Бразилия	632.1	0.090	0.79	8.94	177.0	-2.00
Мексика	370.2	0.100	0.83	6.02	115.0	-2.00
Россия	471.0	0.16	0.81	4.84	128.0	-2.00
RUBI CORP	196.2	0.17	0.47	3.06	289.0	-2.00
ЮАР	150.6	0.31	0.76	5.59	126.0	-8.00
Турция	277.2	0.26	0.13	7.17	224.0	-5.00
Украина	231.3	0.090	0.63	5.93	198.0	-2.00

Источник: Bloomberg

Стратегия валютного рынка

Российские власти предлагают все новые меры для повышения уровня ликвидности в банковской системе страны. В частности, А. Кудрин вчера предложил разместить на депозитах в российских банках свободные бюджетные средства, а также средства в распоряжении государственной управляющей компании (Внешэкономбанка), которая осуществляет управление пенсионными накоплениями граждан. Мы по-прежнему считаем, что использование свободных государственных средств для поддержания коммерческих банков, несомненно, окажет положительное влияние на финансовую систему, но усугубит проблему концентрации ликвидности у нескольких крупнейших банков. Довольно сложно представить, что, например, региональный банк, занимающий сотое место по объему активов, получит бюджетные средства в качестве депозитов.

Ставки российского денежного рынка снизились до уровня прошлой недели – 3-4%, несмотря на осуществление налоговых выплат. Мы практически не сомневаемся, что сегодня или завтра ставки снова увеличатся с приближением новых налоговых платежей. Спрос на аукционах РЕПО Банка России остается очень низким – объем заимствований составил всего 4 млрд руб.

Алексей Моисеев
Телефон: 258 7946

АЛРОСА может приобрести акции компании Полюс Золото, долговая нагрузка возрастет

По информации агентства Reuters, министр финансов и председатель совета директоров АК АЛРОСА А. Кудрин сообщил, что компания получила предложение о покупке блокирующего пакета акций золотодобывающей компании Полюс Золото. По его словам, стороны еще не достигли договоренности, однако мы хотели бы подчеркнуть, что эта покупка может привести к значительному росту долговой нагрузки АК АЛРОСА. В августе новостные агентства уже опубликовали сообщение главы ВТБ А. Костина о согласии банка предоставить алмазной монополии кредит в объеме USD2 млрд для покупки акций компании Полюс Золото.

Соотношение Чистый долг/ЕБИТДА АК АЛРОСА составляет около 2, и мы ожидаем повышения этого показателя из-за потребности в масштабных капиталовложениях для органического роста. По нашему мнению, увеличение объема заимствований на USD2 млрд в связи с приобретением акций Полюс Золото плохо вписывается в балансовый отчет компании, поскольку долговая нагрузка может возрасти до уровня 4 и выше.

Осуществится ли сделка, пока неизвестно, но мы считаем, что комментарий г-на Кудрина окажет умеренно негативное влияние на кредитный профиль и котировки облигаций АК АЛРОСА.

В настоящее время доходность еврооблигаций АК АЛРОСА сопоставима с показателями обязательств ЛУКОЙЛа, ВымпелКома и МТС. Если долговая нагрузка алмазодобывающей компании все же увеличится в связи с приобретением акций Полус Золото, ее облигации окажутся под давлением, хотя снижение котировок вряд ли будет резким и значительным. Даже учитывая возможное повышение долговой нагрузки, мы не ожидаем негативных решений со стороны международных рейтинговых агентств, поскольку на рейтинги АК АЛРОСА (BB- по шкале S&P, Ba2 по шкале Moody's) большее влияние оказывает фактор государственной поддержки.

Максим Раскоснов
Телефон: 725-5227

АЛРОСА: основные показатели по МСФО

USD млрд, если не указано иное	2006	2005
Выручка	3.47	3.42
EBITDA	1.07	1.17
Рентабельность EBITDA	30.8%	34.2%
Совокупный долг	2.37	1.76
Чистый долг	2.13	1.55
Совокупный долг/EBITDA	2.21	1.50
Чистый долг/EBITDA	1.99	1.32

Источники: данные компании, оценка Ренессанс Капитала

Интерпайп: финансовая отчетность за первую половину 2007 г. по МСФО

Корпорация Интерпайп, крупнейший украинский производитель труб и железнодорожных колес, представила вчера высокие финансовые результаты за первое полугодие 2007 г. по международным стандартам. Мы положительно оцениваем развитие компании, которая демонстрирует рост рентабельности и удерживает долговую нагрузку на умеренном уровне.

- Рост выручки составил 29% благодаря увеличению объема производства труб на 13.3% и железнодорожных колес – на 4.5%.
- Рентабельность осталась практически без изменений: 26.7% против 27.1% в первой половине 2006 г. Рентабельность EBITDA Интерпайпа оказалась выше показателя ТМК в основном за счет сегмента производства железнодорожных колес, который принес компании 22.1% выручки и 31.8% валовой прибыли в первом полугодии. В январе-июне 2007 г. денежные потоки корпорации оказались отрицательными из-за существенного увеличения оборотного капитала, однако мы не считаем это серьезной проблемой, учитывая ее высокую рентабельность и низкую долговую нагрузку.
- Долговая нагрузка остается консервативной, соотношение Долг/EBITDA в годовом исчислении составляет 1.4 (1.1 в 2006 г.). В настоящее время Интерпайп планирует инвестировать USD600 млн в создание электрометаллургического производства, в результате чего, по нашим оценкам, долговая нагрузка компании возрастет до 2 в 2008 г. Согласно документам, представленным при размещении облигаций, инвестиции достигнут максимального объема в 2008 г., после чего потребности в капиталовложениях будут относительно небольшими. Таким образом, мы считаем долговую политику компании сбалансированной и не видим серьезной угрозы неожиданного роста долговой нагрузки.

Представленная финансовая отчетность вряд ли окажет существенное влияние на котировки облигаций Интерпайпа, так как результаты в целом соответствуют прогнозам. За последние два месяца спред выпуска Интерпайп 10 к ТМК 09 расширился с 100 б. п. до 150 б. п., и мы считаем, что при текущих ценовых уровнях облигации Интерпайпа выглядят привлекательно.

Анастасия Головач
Телефон: +38 (044) 492-7382
Максим Раскоснов
Телефон: 725-5227

Интерпайп: основные показатели по МСФО

USD млн, если не указано иное	1 пол. 2006	1 пол. 2007
Выручка	651	838
Модифицированная EBITDA	176.11	223.87
Рентабельность EBITDA	27.1%	26.7%
Долг	188.79	305.01
Долг/EBITDA	1.07	1.36

Источники: данные компании, оценка Ренессанс Капитала

Ликвидность

Индикатор	Текущее значение показателя	Предыдущее значение показателя	Изменение
Индикаторы ликвидности			
Остатки средств на кор. счетах кредитных организаций в ЦБ РФ (по РФ), млрд руб.	430.4	409.2	21.2
Остатки средств на кор. счетах кредит. орг. в ЦБ РФ (Московский регион), млрд руб.	286.8	272.5	14.3
Остатки денежных средств кредит. орг. на депозитных счетах в ЦБ РФ, млрд руб.	389.5	388.2	1.30
Сальдо операций ЦБ РФ с банковским сектором, млрд руб.	28.7	32.4	-3.70
Золотовалютные резервы Российской Федерации, USD млрд	434.0	424.8	9.20
Денежная масса, млрд руб.	3 749.8	3 716.8	33.0
Денежный рынок			
Ставки по кредиту "overnight" (% годовых) *	3.5/4.0	4.5/5.5	н/д --
EUBOR - 6 месяцев	4.61	4.61	-0.0012
LIBOR - 6 month	4.94	4.93	0.014
MosPrimeRate - 1 месяц - % годовых	6.93	6.86	0.070
MosPrimeRate - 2 месяца - % годовых	7.04	7.05	-0.0100
MosPrimeRate - 3 месяца - % годовых	7.24	7.23	0.0100
MosPrimeRate - 6 месяца - % годовых	7.14	7.16	-0.020
РЕПО			
Аукционное доразмещение ОБР - средневзвешенная ставка (% годовых)***	5.10	5.09	0.0100
Прямое РЕПО сроком на 1 день - средневзвешенная ставка (% годовых)**	6.04	6.04	0.0040
Прямое РЕПО сроком на 1 день - объем сделок, млрд руб.**	4.14	3.73	0.41
FOREX			
EUR/USD	1.4259	1.4177	0.0082
Официальный курс EUR/RUB (ЦБ РФ)	35.3999	35.5330	-0.13
Официальный курс USD/RUB (ЦБ РФ)	24.9225	24.8066	0.12
Объем торгов на валютном рынке (ММВБ) – расчеты с поставкой «сегодня» - в млн. долларов США	1,072.1380	829.1290	243.0
Объем торгов на валютном рынке (ММВБ) – расчеты с поставкой «завтра» - в млн. долларов США	2,304.6240	2,919.6460	-615.0
Беспоставочный форвардный контракт RUB/USD, % ставка (180 дней)*	6.03 / 6.17	6.06 / 6.22	н/д --
Долговой рынок - (ММВБ)			
Объем торгов корпоративными и муниципальными облигациями (включая РПС), млрд руб.*	11.2	10.2	1.00
Объем биржевых торгов (суверенные рублевые заимствования), млрд руб.*	81.8	101.2	-19.4

* Данные за последний торговый день.

** По итогам аукциона за 23.10.2007.

***По итогам аукциона за 11.10.2007. Дата оферты - .

Сырьевые товары

Показатель	Ед. изм.	Цена	Изменение %	Изм. за неделю, %	Изм. за месяц, %	Изм. за три месяца, %	С начала года по сегодняшний день, %
Нефть							
BRENT	USD/брл	82.7	-1.44	-1.56	5.60	8.80	37.6
URALS	USD/брл	80.1	-0.73	-1.33	5.80	6.90	43.1
WTI	USD/брл	86.6	-1.13	-1.19	3.80	15.9	41.8
Металлы							
Алюминий	USD/т	2 476.0	-0.11	1.13	5.20	-10.5	-12.5
Золото	USD/унц.	759.0	0.28	0.55	3.90	11.4	19.2
Никель	USD/т	31 750.0	--	-0.16	-1.70	-4.90	-4.70
Сталь (холодный прокат)	USD/т	635.0	--	--	0.00	3.30	9.50
Сталь (горячий прокат)	USD/т	587.5	--	--	4.00	6.80	16.3

Доходность рублевых облигаций

Долговой инструмент	Цена	Изм. за день	Доход-	Изм. за день	Номинальный	Z	Дата	Дюра-	Дата	Ставка	Объем	Объем	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/ Fitch)
	% от номинала	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.	оферты	ция	погашения	%	млн.руб.	млн.руб.	
Государственные													
ОФЗ 25057	102.88	-0.12	6.16	5.61	--	--		2.06	20.01.10	7.40	40 817	14.51	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 25058	100.10	-0.33	6.24	66.9	--	--		0.51	30.04.08	6.30	40 655	1.98	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 25059	99.96	-0.042	6.26	1.49	--	--		2.92	19.01.11	6.10	41 000	84.96	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 25060	99.85	0.00	6.04	0.020	--	--		1.44	29.04.09	5.80	41 000	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 25061	99.46	-0.041	6.17	1.91	--	--		2.35	05.05.10	5.80	37 926	12.16	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 26198	98.70	0.00	6.31	0.010	--	--		4.24	02.11.12	6.00	42 117	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 26199	99.72	-0.037	6.31	0.95	--	--		4.13	11.07.12	6.10	37 688	179.15	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 27026	100.10	0.00	6.36	-0.24	--	--		1.32	11.03.09	7.00	16 000	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 28002	101.77	0.00	5.35	-3.24	--	--		0.39	12.03.08	10.00	8 800	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 28003	102.15	0.00	5.49	-2.56	--	--		0.48	16.04.08	10.00	8 800	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 28004	105.70	0.00	6.19	-0.67	--	--		1.42	13.05.09	10.00	8 800	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 28005	107.82	0.00	4.95	-0.83	--	--		1.48	03.06.09	10.00	9 028	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46001	102.99	0.10	5.27	-18.5	--	--		0.62	10.09.08	10.00	60 000	61.72	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46002	108.95	-0.050	6.04	1.21	--	--		3.46	08.08.12	9.00	62 000	5.45	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46003	108.56	-0.092	5.91	3.90	--	--		2.01	14.07.10	10.00	37 298	116.76	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46005	49.02	0.00	7.01	0.19	--	--		10.51	09.01.19	0.00	27 477	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46010	76.21	0.00	8.60	0.19	--	--		13.40	17.05.28	0.00	30 000	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46011	88.00	0.00	7.01	0.16	--	--		12.40	20.08.25	0.00	30 000	0.01	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46012	66.50	0.00	7.33	0.100	--	--		14.40	05.09.29	1.57	40 000	--	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46014	108.31	0.050	6.29	-1.11	--	--		4.97	29.08.18	9.00	58 290	30.16	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46017	105.87	-0.17	6.36	2.66	--	--		6.20	03.08.16	8.50	80 000	28.57	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46018	110.79	-0.26	6.47	2.85	--	--		8.38	24.11.21	9.00	125 068	19.02	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46019	60.85	0.00	7.04	0.23	--	--		8.60	20.03.19	0.00	26 000	0.61	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46020	101.94	0.094	6.86	-0.78	--	--		12.65	06.02.36	6.90	79 056	7.59	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 46021	99.66	-0.079	6.43	1.06	--	--		7.43	08.08.18	7.50	49 864	14.95	BBB+/Baa2/BBB+
ОФЗ 48001	104.90	0.00	6.99	-0.020	--	--		6.40	31.10.18	7.75	24 099	--	BBB+/Baa2/BBB+
Информационные технологии													
Ситроникс-1	100.28	-0.097	10.01	7.75	395	391	24.03.09	1.35	21.09.10	10.00	3 000	0.50	--/B3/B-
Тензор	98.45	0.00	15.63	1.67	939	966	20.05.08	0.55	17.11.09	12.20	500	--	--/--/--
Машиностроение													
АвтоВАЗ-3	99.57	0.00	8.52	0.30	231	253	24.06.08	0.65	22.06.10	7.70	5 000	--	--/--/--
АвтоВАЗ-4	98.50	0.00	9.02	0.22	298	289	26.05.09	1.48	20.05.14	7.80	5 000	--	--/--/--
Автоприбор	99.65	-0.19	31.13	1 136.5	2 564	2 563	31.10.07	0.02	29.04.09	12.80	500	--	--/--/--
Вагонмаш-1	100.20	-1.80	13.53	303.3	731	754		0.63	19.06.08	13.50	300	0.00	--/--/--
Вагонмаш-2	97.90	-0.50	14.93	90.6	871	894	18.06.08	0.63	15.12.10	11.00	1 000	--	--/--/--
Вега-Инвест	98.95	0.48	16.31	-150.4	1 095	1 041	04.03.08	0.36	02.03.10	12.75	700	--	--/--/--
ВКМ	98.94	-0.95	11.86	171.5	564	589		0.59	04.06.08	9.75	1 000	--	--/--/--
Волгабурмаш	98.76	-0.50	16.01	62.0	986	997		0.93	08.10.08	14.00	600	0.00	--/--/--
ГАЗ-фин	100.08	0.026	8.32	-9.21	294	245	12.02.08	0.31	08.02.11	8.49	5 000	30.02	--/--/--
Гидромашсервис	99.24	0.38	11.52	-70.3	529	555	27.05.08	0.57	24.11.09	9.90	1 000	--	--/--/--
ГС Сухого	98.49	0.12	8.90	-6.85	281	275	24.09.09	1.81	26.03.17	7.85	5 000	5.91	--/--/--
ГТ-ТЭЦ-3	99.66	0.020	11.49	-4.39	540	555		0.49	18.04.08	10.45	1 500	45.75	--/--/--
ГТ-ТЭЦ-4	97.00	-0.30	12.94	20.3	686	679		1.71	02.09.09	10.71	2 000	1.26	--/--/--
ЕПК-1	100.10	0.00	9.44	-0.14	329	339		0.92	02.10.08	9.35	1 000	--	--/--/--
ИжАвто-2	97.23	-0.20	12.84	21.5	672	677	11.12.08	1.07	09.06.11	9.79	2 000	9.60	--/--/--
ИжМаш-2	100.62	0.80	12.65	-139.9	643	666		0.62	17.06.08	13.35	1 000	6.14	--/--/--
Иркут-3	102.70	0.25	7.83	-10.1	162	161		2.61	16.09.10	8.74	3 250	0.11	--/Ba1/--
Камаз-2	99.50	0.00	9.22	0.15	306	318	19.09.08	0.89	17.09.10	8.45	1 500	0.22	--/--/--
Кировский завод	99.18	-0.23	10.40	27.6	424	436	24.09.08	0.90	24.03.10	9.20	1 500	--	--/--/--
КМПО-Финанс	98.00	-0.11	12.02	14.7	586	598	16.09.08	0.88	16.03.10	9.30	1 000	--	--/--/--
Криогенмаш-2	99.79	0.00	10.27	0.070	407	427		0.69	08.07.08	9.75	500	--	--/--/--
Криогенмаш-Фин-1	99.15	0.00	12.93	0.76	672	695	17.06.08	0.63	15.12.09	11.20	1 000	--	--/--/--
Курганмашзавод-1	99.44	-0.065	10.67	11.8	445	468	12.06.08	0.62	10.06.10	9.50	2 000	--	--/--/--
ЛБР-Интерфинтрейд	99.95	-0.18	15.47	33.7	924	950	29.05.08	0.57	26.11.09	14.90	300	0.00	--/--/--
Ломот-3	99.58	0.45	13.41	-58.5	725	738	10.09.08	0.86	05.09.09	12.50	1 000	--	--/--/--
МиГ-1	98.40	0.00	9.13	0.23	308	300		1.50	03.06.09	7.85	1 000	--	--/--/--
МиГ-2	99.50	-0.025	10.47	8.09	512	456	11.03.08	0.38	06.09.11	8.90	3 000	--	--/--/--
Мотовил.заводы	99.30	-0.080	10.23	7.40	414	415		1.19	22.01.09	9.40	1 500	18.17	--/--/--
Моторостроитель	100.00	0.00	10.24	0.00	418	413		1.34	19.03.09	10.00	800	--	--/--/--
Моторостроитель-2	98.34	1.10	11.77	-105.3	568	569	15.01.09	1.16	15.07.10	10.00	1 000	--	--/--/--
ОЗНА-1	99.85	0.11	12.07	-84.4	662	633	11.12.07	0.13	08.12.09	10.80	500	1.47	--/--/--
ОМЗ-5	102.32	0.33	7.57	-19.6	149	142	01.09.09	1.74	30.08.11	8.80	1 500	--	CCC+/--/--
ПМЗ	99.35	-0.050	10.94	8.06	474	493	22.07.08	0.73	21.07.09	9.60	1 200	--	--/--/--
Промтрактор	99.60	0.100	10.01	-15.8	380	401		0.67	03.07.08	9.20	1 500	6.10	--/--/--
Промтрактор-2	100.60	0.62	10.68	-37.3	458	452	20.10.09	1.85	18.10.11	10.75	3 000	43.61	--/--/--
Протон-1	100.02	0.00	8.64	0.040	253	257	16.12.08	1.09	12.06.12	8.50	1 000	--	--/--/--
ПТПА-Финанс	99.80	0.30	14.18	-508.1	870	856	14.11.07	0.06	11.11.09	10.60	500	0.40	--/--/--
Росвертол	99.98	0.050	9.56	-52.7	410	387	27.11.07	0.10	26.05.09	9.30	800	--	--/--/--
СалютЭнерг	99.81	0.15	11.08	-90.5	565	530		0.17	25.12.07	9.80	3 000	--	--/--/--
Сатурн-1	99.85	0.00	11.12	0.030	555	520		0.42	23.03.08	10.50	1 500	--	--/--/--
Сатурн-2	99.80	0.00	9.97	0.31	444	405	21.03.08	0.41	20.09.11	9.25	2 000	--	--/--/--
Сатурн-3	98.10	-0.82	10.85	84.1	473	478	06.12.08	1.06	06.06.14	8.75	3 500	--	--/--/--
СевСтАвто	101.55	0.21	7.36	-10.7	123	119		2.07	21.01.10	8.00	1 500	--	--/--/--
СевСтАвто-2	97.30	0.15	9.01	-6.54	282	281	21.07.10	2.48	17.07.13	7.70	3 000	48.65	--/--/--
СОК-Автокомп	98.55	0.00	15.66	2.00	966	971		0.48	24.04.08	12.00	1 100	--	--/--/--
СТИН-фин-1	100.45	-0.065	14.86	15.4	911	893		0.44	01.04.08	15.50	300	0.01	--/--/--
ТВЗ-3	99.25	0.00	10.68	0.58	447	470	20.06.08	0.64	18.06.10	9.25	1 000	--	--/--/--
Трансмаш-2	99.14	0.44	9.51	-38.2	343	342	12.02.09	1.25	10.02.11	8.60	4 000	0.00	--/--/--
УМПО	99.75	-1.75	10.11	287.4	389	412	19.06.08	0.64	17.12.09	9.50	4 000	0.00	--/--/--
УОМЗ-1	98.58	-0.22	11.02	22.1	491	495	11.12.08	1.07	10.06.10	9.40	1 000	1.58	--/--/--
УралВагЗФ	99.54	-0.090	10.16	10.8	400	411		0.92	30.09.08	9.40	2 000	8.01	--/--/--
УралВагЗФ-2	100.05	-0.010	10.20</										

Долговой инструмент	Цена	Изм. за день	Доход-ность	Изм. за день	Номинальный спред	Z спред	Дата oferty	Дюра-ция	Дата погашения	Ставка купона	Объем выпуска	Объем торгов	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/ Fitch)
ДиПОС-1	98.70	-1.30	13.02	219.1		681 703	24.06.08	0.65	19.06.12	10.60	2 000	--	--/--/--
Золото Селигдара-2	98.75	-1.25	15.49	214.5		928 950	25.06.08	0.64	21.12.11	13.00	500	--	--/--/--
Инпром-2	99.61	0.080	9.33	-7.33		323 324	15.01.09	1.17	15.07.10	8.80	1 000	11.74	--/--/--
Инпром-3	99.50	0.15	9.66	-15.1		353 360	19.11.08	1.01	18.05.11	8.95	1 300	--	--/--/--
Кокс	99.80	-0.055	9.27	3.64		321 314		1.61	16.07.09	8.95	3 000	--	--/--/--
Кокс-2	98.84	-0.15	9.46	7.25		331 327	18.03.10	2.20	15.03.12	8.70	5 000	--	--/--/--
Магnezит	99.00	-0.100	9.37	9.96		326 330		1.10	18.12.08	8.25	1 500	--	--/--/--
Магnezит-2	99.89	0.95	9.02	-75.4		297 291	28.03.09	1.37	28.03.11	8.75	2 500	0.00	--/--/--
МаирИнв-2	99.90	0.40	11.95	-442.6		649 626		0.10	27.11.07	10.80	1 000	1.00	--/--/--
МаирИнв-3	97.75	-0.082	13.95	9.89		781 787		1.02	01.04.09	11.15	2 000	--	--/--/--
Макси-Групп	99.10	0.090	17.02	-25.2		1 165 1,112	13.03.08	0.39	12.03.09	14.00	3 000	0.00	--/--/--
Металлсервис-1	99.56	0.00	11.56	0.39		533 559	28.05.08	0.57	23.05.12	10.50	1 500	1.00	--/--/--
Метар Фин	98.40	1.40	16.20	-262.3		998 1,022	12.06.08	0.61	10.06.10	12.95	500	--	--/--/--
Мечел	99.78	0.00	8.38	9.36		291 271		0.08	22.11.07	5.50	2 000	--	--/--/--
Мечел-2	102.00	-0.100	7.69	4.26		151 149	16.06.10	2.37	12.06.13	8.40	5 000	1.76	--/--/--
МЗ Серова	100.00	0.00	8.93	-0.030		286 283		1.29	27.02.09	8.75	2 000	6.00	--/--/--
НижЛенское-1	98.40	0.15	14.71	-23.9		850 871		0.68	08.07.08	12.00	400	--	--/--/--
НижЛенское-2	98.25	-0.75	14.69	56.5		865 857		1.48	18.06.09	13.00	550	--	--/--/--
НМЗ им. Кузьмина	99.65	0.00	10.95	0.13		477 493	15.08.08	0.79	14.02.10	10.25	1 200	--	--/--/--
НОК-2	98.96	-0.29	13.96	36.9		780 792	25.09.08	0.90	22.09.11	12.30	400	0.40	--/--/--
ОМК-1	100.30	-0.070	8.85	11.7		263 287		0.62	12.06.08	9.20	3 000	--	--/--/--
РМК-Финанс-1	99.08	0.00	9.39	0.030		323 320		2.25	06.04.10	8.75	3 000	--	--/--/--
РОССКАТ-1	97.78	0.33	12.62	-30.6		652 653	21.01.09	1.18	21.07.10	10.30	1 200	--	--/--/--
РусАл-3	99.10	-0.40	8.40	48.5		224 236		0.90	21.09.08	7.20	6 000	10.16	--/--/--
СвобСокол-2	100.12	0.00	10.19	-5.05		472 453		0.08	22.11.07	11.75	600	--	--/--/--
СвобСокол-3	99.52	0.00	12.39	0.14		626 633	25.11.08	1.01	24.05.11	11.57	1 200	3.98	--/--/--
СПК-1	98.38	0.88	12.43	-94.2		630 637	25.11.08	1.02	25.05.10	10.46	1 000	--	--/--/--
ТМК-2	100.05	0.0050	7.70	-0.44		165 159		1.36	24.03.09	7.60	3 000	0.22	BB-/Ba3/--
ТМК-3	100.10	-0.055	7.73	17.3		235 184	19.02.08	0.33	15.02.11	7.95	5 000	9.01	BB-/Ba3/--
ТЧМ-2	99.50	0.00	12.93	11.9		747 722		0.11	02.12.07	8.00	1 000	--	--/--/--
Урал. завод прециз. сплавов	96.75	-0.25	18.28	50.2		1 206 1,230	12.06.08	0.61	10.06.10	12.00	1 500	--	--/--/--
Уралэлектромедь	98.88	0.080	8.97	-3.99		283 279	02.03.10	2.17	28.02.12	8.25	3 000	106.78	--/--/--
ХайлендГолд	99.62	-0.68	14.34	175.2		862 841		0.44	02.04.08	12.75	750	--	--/--/--
ЧТПЗ-1	100.83	-0.42	8.31	67.9		209 232	18.06.08	0.63	16.06.10	9.50	3 000	--	--/--/--
Недвижимость													
Адамант	98.00	-1.41	16.14	266.0		992 1,016		0.59	05.06.08	12.10	500	0.00	--/--/--
Адамант-2	98.80	0.39	13.04	-43.0		691 698	20.11.08	1.01	20.05.10	11.25	2 000	2.96	--/--/--
Артуг	100.00	0.00	13.12	-0.50		768 735	19.12.07	0.16	17.12.08	13.00	500	--	--/--/--
ГлМосСтрой-2	100.07	0.020	11.91	-4.17		633 599	24.03.08	0.42	17.03.11	10.00	4 000	0.32	--/--/--
Девелопмент-Юг-1	100.25	0.00	12.35	-0.060		612 639	20.05.08	0.55	18.05.10	12.50	1 000	--	--/--/--
ДКС ФЖС РБ	99.89	0.00	13.29	3.08		783 760	27.11.07	0.10	24.11.09	12.00	500	--	--/--/--
ИнкомФин-1	97.85	-0.65	19.29	182.5		1 362 1,336	28.03.08	0.43	28.03.09	13.10	1 250	--	--/--/--
Камская дол.-3	100.25	0.12	12.95	-22.1		673 697	09.06.08	0.61	04.06.09	12.80	500	2.71	--/--/--
Красный Богатырь	99.50	0.00	12.95	1.36		757 707	14.02.08	0.31	11.02.10	11.00	2 000	--	--/--/--
ЛенСпецСМУ-1	99.65	0.00	12.16	0.52		649 622	24.04.08	0.43	22.04.10	11.25	1 000	--	B/--/--
ЛенСпецСМУ-2	99.45	-0.45	12.10	67.9		591 610	23.07.08	0.72	20.01.10	11.19	1 500	--	B/--/--
ЛСР Групп	100.10	-0.070	9.94	18.3		442 402		0.41	20.03.08	10.00	1 000	--	--/B1/--
ЛСР Инвест	100.50	0.15	10.04	-27.0		382 406	03.06.08	0.59	08.12.09	10.70	2 000	50.25	--/--/--
ЛСР-Инвест-2	97.66	-0.089	10.08	6.29		402 394	16.07.09	1.61	14.07.11	8.35	3 000	3.21	--/--/--
Макромир-2	99.00	0.50	13.53	-80.9		733 753	08.07.08	0.68	03.07.12	11.65	1 500	--	--/--/--
Метрострой	100.25	0.00	8.00	-0.43		233 207	28.03.08	0.43	23.09.11	8.47	1 500	--	--/--/--
МИАН-Дев	89.00	-0.99	29.31	172.2		2 314 2,328	02.09.08	0.83	02.03.10	12.37	2 000	0.41	--/--/--
М-Индустрия	103.50	-0.25	11.40	8.39		513 515		3.11	16.08.11	12.25	1 000	--	--/--/--
Миракс	100.23	-0.070	10.42	9.40		425 440		0.80	19.08.08	10.50	1 000	1.50	--/B2/B
Миракс-2	101.50	0.42	10.35	-26.0		427 420		1.76	17.09.09	10.99	3 000	--	--/B2/B
Мизель-1	99.38	0.00	13.41	0.37		721 740	15.07.08	0.70	13.07.10	12.13	1 500	--	--/--/--
МОРЕ-Плаза-1	97.00	-0.50	17.06	78.5		1 087 1,105	05.08.08	0.76	03.08.10	12.25	1 000	23.28	--/--/--
Пеноплэкс	99.38	0.29	12.58	-48.8		636 659	19.06.08	0.63	17.12.09	11.25	1 500	0.10	--/--/--
ПИК-5	99.63	0.63	10.77	-216.7		539 485		0.32	20.05.08	9.20	1 120	2.99	--/--/--
РИГрупп	98.53	0.030	14.63	-4.25		842 864	26.06.08	0.65	26.12.09	11.85	1 200	38.08	--/--/--
Рубин	99.65	-0.20	15.04	47.7		901 910	15.04.08	0.48	13.10.09	13.75	1 200	0.00	--/--/--
Сибкадеминвест-1	96.92	0.40	15.55	-38.6		946 947	30.01.09	1.19	30.07.10	12.30	1 000	--	--/--/--
Сибкадемстрой-1	97.50	0.45	18.11	-95.6		1 187 1,215	13.05.08	0.53	12.05.09	12.50	500	--	--/--/--
Спецстрой-2-1	100.02	0.00	8.71	0.13		248 274	22.05.08	0.56	20.05.10	8.59	2 000	--	--/--/--
СУ-155 3	99.60	0.00	11.80	0.66		643 592	20.02.08	0.33	15.02.12	10.30	3 000	4.98	--/--/--
Сувар-Казань	99.15	-0.050	15.03	14.1		928 910	01.04.08	0.44	31.03.09	12.50	900	10.41	--/--/--
Сэтл Групп-1	100.21	0.41	11.97	-12.5		569 570		3.49	15.05.12	11.70	1 000	0.58	--/--/--
ТехНиколь	99.20	0.050	11.82	-9.30		558 586	14.05.08	0.54	11.11.09	10.00	1 500	3.17	--/--/--
ТехНиколь-2	96.68	-0.025	12.05	1.86		597 590	10.09.09	1.75	07.03.12	9.70	3 000	--	--/--/--
ХМ СтройРесурс-1	100.00	--	13.42	--		742 745	15.04.09	1.41	13.10.10	13.00	3 000	--	--/--/--
ЮСКК	100.48	0.00	12.56	-0.35		635 656		0.66	01.07.08	13.00	600	--	--/--/--
Нефтегазовые													
Газпром-4	102.91	-0.080	6.94	3.68		81 76		2.12	10.02.10	8.22	5 000	19.70	BBB/A3/BBB-
Газпром-6	100.36	0.015	6.84	-0.96		77 70		1.69	06.08.09	6.95	5 000	--	BBB/A3/BBB-
Газпром-7	100.00	-0.12	6.90	6.43		81 74		1.86	29.10.09	6.79	5 000	0.75	BBB/A3/BBB-
Газпром-8	100.25	0.15	7.05	-4.48		76 78		3.46	27.10.11	7.00	5 000	442.83	BBB/A3/BBB-
Газпром-9	101.43	0.31	7.06	-6.29		73 74		5.13	12.02.14	7.23	5 000	1 056.72	BBB/A3/BBB-
Газэкс	98.34	-0.0050	13.58	2.03		737 760	19.06.08	0.63	13.12.10	10.50	1 000	--	--/--/--
Газэнергосеть-1	97.15	0.032	8.94	-0.86		264 266		3.87	20.06.12	8.00	1 500	--	--/--/--
Интегра-1	98.00	-1.50	12.43	126.1		637 633		1.33	20.03.09	10.50	2 000	0.03	--/--/--
Интегра-2	99.78	-0.73	11.10	41.2		500 494	01.12.09	1.87	29.11.11	10.70	3 000	--	--/--/--
Итера	99.95	-0.050	10.23	43.5		478 450		0.12	07.12.07	9.75	2 000	3.50	--/--/--
Комплекс	98.17	1.17	15.52	-177.0		934 951	07.08.08	0.76	04.02.10	12.50	1 000	--	--/--/--
Лукойл-2	100.60	-0.16	7.05	8.62		95 89		1.90	17.11.09	7.25	6 000	17.43	BBB-/Baa2/BBB-
Лукойл-3	100.52	0.14	7.07	-3.99		78 80		3.56	08.12.11	7.10	8 000	270.90	BBB-/Baa2/BBB-
Лукойл-4	101.70	-0.10	7.18	2.15		84 85		4.92	05.12.13	7.40	6 000	157.67	BBB-/Baa2/BBB-
Марийский НПЗ	98.00	0.00	13.41	0.42		730 734		1.07	16.12.08	11.10	800	--	--/--/--
Марийский НПЗ-2	100.00	0.75	12.30	-128.4		608 631	19.06.08	0.63	16.12.10	12.00	1 500	107.02	--/--/--
Мособлгаз-1	96.15	0.00	13.18	1.12		705 712	14.11.08	1.00	17.05.11	8.80	2 500	--	--/--/--
Мособлгаз-фин	100.00	-0.25	10.99	38.3		479 495		0.69	21.12.08	10.75	1 000	0.35	--/--/--
Мособлгаз-фин-2	98.00	0.025	10.14	-0.84		387 389		3.14					

Долговой инструмент	Цена	Изм. за	Доход-	Изм. за	Номинальный	Z	Дата	Дюра-	Дата	Ставка	Объем	Объем	Кредитный	
		день		ность										день
	% от	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.		лет		%	млн.руб.	млн.руб.	(S&P/Moody's/ Fitch)	
Стройтрансгаз-2	96.75	0.14	9.57	-3.96		327	329		3.89	13.07.12	8.49	5 000	--	--/--/--
Тоап	98.02	3.52	15.88	-680.6		966	990	12.06.08	0.61	10.12.09	12.00	2 000	33.87	--/--/--
Топпром-1	99.85	0.20	13.45	-47.0		741	750	18.04.08	0.48	16.04.10	12.50	500	9.98	--/--/--
Удмнефтопродукт	99.40	0.29	10.63	-37.7		445	460		0.83	01.09.08	9.50	1 500	0.67	--/--/--
Фазтон-Аэро	98.79	0.00	15.56	4.56		1 016	970	31.01.08	0.27	30.07.09	10.50	1 000	--	--/--/--
Потребительские товары и Розничная торговля														
Автомир-2	97.66	-0.050	13.35	5.67		723	727	24.12.08	1.10	23.06.10	10.75	2 000	1.46	--/--/--
Азбука вкуса	99.71	0.00	12.76	1.66		735	692	22.01.08	0.25	21.07.09	10.99	1 000	--	--/--/--
АЛПИ-Инвест	97.08	0.00	15.34	1.11		916	932	22.08.08	0.81	21.08.09	10.99	1 500	--	--/--/--
Алькор и Ко	99.40	0.00	15.70	10.0		1 026	996	11.12.07	0.13	08.12.09	10.75	1 500	0.06	--/--/--
Аптеки 36.6	99.00	-0.025	14.00	5.77		779	800	01.07.08	0.67	30.06.09	9.89	3 000	0.15	--/--/--
Арбат	98.89	0.54	12.62	-92.8		641	663		0.64	20.06.08	10.50	1 500	2.27	--/--/--
Атлант-М-1	99.25	0.27	26.06	-433.9		2 058	2 043	15.11.07	0.06	13.11.08	12.52	1 000	--	--/--/--
Банана-Мама	99.99	-0.019	12.61	224.8		711	711	26.10.07	0.01	23.10.09	11.25	1 000	--	--/--/--
Банана-Мама-2	96.97	-0.055	14.57	5.72		849	848	12.02.09	1.23	12.08.10	11.50	1 500	2.05	--/--/--
Бахетле-1-1	99.50	0.00	12.50	0.52		627	653	21.05.08	0.55	19.05.10	11.25	1 000	--	--/--/--
Белазкомплект	96.58	0.00	21.07	4.65		1 508	1 512	24.04.08	0.47	22.10.09	12.60	500	--	--/--/--
Виват-1	95.00	-1.50	18.47	191.3		1 233	1 242	21.10.08	0.97	20.04.10	12.00	1 000	0.00	--/--/--
Виктория	99.45	-0.050	11.14	4.68		505	505		1.20	29.01.09	10.40	1 500	0.05	--/--/--
Виктория-2	100.01	0.060	11.16	-3.17		504	499		2.08	16.02.10	10.89	1 500	12.94	--/--/--
Восток-Сервис	99.40	-0.20	12.94	58.1		757	703	13.03.08	0.39	10.09.09	10.99	1 500	9.94	--/--/--
Дет мир-Ц	98.00	-0.23	9.06	4.48		271	271		5.54	26.05.15	8.50	1 150	0.01	--/--/--
ДжЭф Си	96.00	0.00	14.12	1.26		797	806	23.10.08	0.94	20.10.11	9.25	2 000	--	--/--/--
Дикая Орхидея	99.85	0.020	13.88	-3.15		768	788	10.07.08	0.69	09.04.09	13.00	1 000	--	--/--/--
Дикси	95.01	0.91	11.35	-35.8		509	511		2.96	17.03.11	9.25	3 000	19.00	--/--/--
Диксис	99.50	0.00	13.38	2.34		797	754	20.01.08	0.24	20.07.09	11.00	1 800	--	--/--/--
Домо-Фин	99.52	0.12	14.45	-41.6		907	857		0.31	14.02.08	12.50	1 000	0.23	--/--/--
Евросеть-2	99.66	-0.0012	13.46	9.13		800	774	04.12.07	0.12	02.06.09	10.25	3 000	21.83	--/--/--
Единая Европа	99.00	0.00	12.20	0.26		606	615	16.10.08	0.96	14.10.10	10.75	1 200	--	--/--/--
Заводы Гросс-1	98.97	-0.16	15.57	40.1		955	963	17.04.08	0.48	22.04.10	12.50	1 000	1.31	--/--/--
ИКС 5	98.10	-0.40	8.57	17.8		239	237	06.07.10	2.44	01.07.14	7.60	9 000	0.98	--/--/--
Имплозия	98.20	-0.30	14.20	45.9		801	819		0.74	30.07.08	11.25	300	--	--/--/--
Инком-Лада-1	99.81	-0.19	14.99	257.7		952	933		0.08	22.11.07	12.00	700	1.15	--/--/--
Инком-Лада-2	99.90	0.060	12.88	-21.1		750	701	15.02.08	0.31	12.02.10	12.00	1 400	26.97	--/--/--
Инком-Лада-3	98.01	0.51	12.94	-38.5		689	681	12.06.09	1.50	10.06.11	11.00	2 000	98.01	--/--/--
Искрасофт-2	102.00	-0.86	12.66	44.6		653	648		2.07	02.03.10	13.30	300	0.01	--/--/--
Карусель	99.29	-0.26	10.85	32.8		469	481	18.09.08	0.88	12.09.13	9.75	3 000	48.12	--/--/--
Кондитер-Курск-1	98.75	0.00	14.27	1.08		805	830	04.06.08	0.60	02.06.10	11.44	750	--	--/--/--
Копейка-1	96.62	-0.0050	15.77	3.56		955	978		0.64	17.06.08	9.40	1 200	--	CC/--/--
Копейка-2	93.19	0.12	15.23	-10.8		915	913	18.02.09	1.25	15.02.12	8.70	4 000	8.11	CC/--/--
Копейка-3	95.25	-0.020	15.68	4.77		950	966	20.08.08	0.79	15.02.12	9.80	4 000	--	CC/--/--
Кора	99.35	0.00	15.76	3.46		1 035	994	15.01.08	0.23	14.07.09	12.00	1 000	--	--/--/--
Лаверна	100.40	0.90	10.82	-106.4		467	477	09.10.08	0.94	08.04.10	11.00	1 000	20.08	--/--/--
М.Видео	100.00	1.68	10.03	-2 400.1		456	437	21.11.07	0.08	18.11.09	10.00	2 000	10.00	--/--/--
Магнит	100.41	0.11	9.12	-11.4		299	305		1.01	19.11.08	9.34	2 000	74.08	--/--/--
Магнит-2	97.92	-0.38	9.38	18.9		323	320	26.03.10	2.23	23.03.12	8.20	5 000	4.41	--/--/--
Магнолия-1	98.50	0.00	14.84	0.87		864	883	24.07.08	0.71	22.07.10	11.95	1 000	--	--/--/--
Марта-1	98.00	-0.090	19.41	20.8		1 317	1 344		0.55	22.05.08	14.84	700	--	--/--/--
Марта-2	99.62	0.13	15.38	-103.6		993	966	07.12.07	0.12	06.12.09	12.00	1 000	--	--/--/--
Марта-3	98.24	0.15	20.49	-58.8		1 510	1 464	01.02.08	0.28	02.08.11	13.00	2 000	5.13	--/--/--
Матрица	98.11	0.11	14.30	-11.2		817	823		1.05	10.12.08	12.00	1 200	0.26	--/--/--
Махеев-1	98.25	0.45	15.88	-84.4		966	990	05.06.08	0.59	03.06.10	12.30	600	--	--/--/--
МИР-Фин-1	99.90	0.00	11.19	0.60		575	540		0.18	27.12.07	10.50	1 000	0.25	--/--/--
Монетка	99.75	0.00	15.01	18.4		953	938	15.11.07	0.06	14.05.09	10.70	1 000	--	--/--/--
Мосмарт-1	98.12	0.18	15.72	-40.1		965	977	17.04.08	0.48	12.04.12	11.00	2 000	--	--/--/--
НовЧерем-2	99.91	0.060	11.99	-13.4		587	605		0.49	22.04.08	11.30	300	0.00	--/--/--
Новые Черемушки-1	99.95	0.00	11.30	-0.70		516	525	14.10.08	0.95	11.10.11	10.95	1 000	--	--/--/--
Объединенные кондитеры-1	97.35	0.100	9.07	-4.56		290	287	19.05.10	2.31	16.05.12	7.70	3 000	--	--/--/--
Паркет-Холл 1	100.25	0.058	13.62	-3.13		749	744		2.11	30.03.10	13.10	300	--	--/--/--
Патерсон-Инвест	98.60	0.20	12.81	-34.4		659	682	19.06.08	0.64	17.12.09	10.00	2 000	--	--/--/--
Полесье-1	100.25	0.00	12.84	-0.21		660	688	13.05.08	0.53	11.05.10	12.75	500	--	--/--/--
Протек	96.60	-0.98	11.09	58.9		500	493	04.11.09	1.83	02.11.11	8.90	5 000	--	--/--/--
Рубеж-Плюс-1	98.75	0.00	13.65	0.35		752	758	02.12.08	1.03	01.06.10	12.00	1 000	--	--/--/--
Русское море-1	99.60	0.35	10.51	-59.9		430	453	19.06.08	0.64	14.06.12	9.50	2 000	13.75	--/--/--
Самохвал	99.76	0.00	12.26	0.54		627	631	23.04.08	0.47	21.10.09	11.40	1 500	--	--/--/--
Санвэй	99.60	-0.050	10.64	5.27		451	457		1.04	03.12.08	10.00	1 000	0.51	--/--/--
Седьмой Континент-2	98.04	0.090	9.30	-6.15		325	317	18.06.09	1.54	14.06.12	7.80	7 000	14.12	--/--/--
Сибирский Берег-1	100.02	0.00	10.49	-0.080		427	450	23.06.08	0.65	18.06.12	10.14	1 500	--	--/--/--
Сорус	99.85	0.030	14.25	-50.2		876	868	08.11.07	0.04	05.11.09	10.20	1 200	13.83	--/--/--
Спортмастер-1	98.50	0.63	10.55	-66.3		442	448	21.11.08	1.02	21.05.10	8.80	3 000	--	--/--/--
Столич.гастрономы	100.00	0.00	8.76	0.040		258	273	21.08.08	0.81	20.08.09	8.60	1 500	0.50	--/--/--
Техносила	98.25	0.025	13.51	-3.37		728	753	29.05.08	0.58	26.05.11	10.00	2 000	--	--/--/--
ТОП-Книга-2	97.69	-1.06	13.13	110.5		701	706	11.12.08	1.06	09.12.10	10.51	1 500	--	--/--/--
Уфаойл-Оптан-1	97.99	0.19	17.15	-44.1		1 108	1 121	17.04.08	0.48	15.04.10	12.00	1 500	4.91	--/--/--
Холидей Финанс-1	98.70	0.20	13.04	-24.3		688	699	02.10.08	0.92	01.04.10	11.15	1 500	1.97	--/--/--
ЭФКО-2	99.40	0.20	13.19	-83.4		779	734	25.01.08	0.26	22.01.10	10.50	1 500	11.68	--/--/--
ЮТС-2	97.60	0.00	14.40	0.62		826								

Долговой инструмент	Цена	Изм. за	Доход-	Изм. за	Номинальный	Z	Дата	Дюра-	Дата	Ставка	Объем	Объем	Кредитный
		день		ность									
	% от	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.		лет		%	млн.руб.	млн.руб.	(S&P/Moody's/ Fitch)
МКХ-2	99.50	0.00	11.71	-1.34	634	582	26.02.08	0.34	25.08.09	12.90	1 000	--	--/--/--
Натур Продукт-2	100.15	0.00	9.79	-1.64	435	403	18.12.07	0.15	16.06.09	10.75	1 000	--	--/--/--
Нутринвестхолд-1	98.92	-0.15	11.75	27.9	553	577	10.06.08	0.62	09.06.09	9.50	1 200	--	B/--/--
ОСТ-2	99.74	1.20	13.74	-422.5	836	780		0.31	08.05.08	12.50	1 000	0.00	--/--/--
ОХЗ-инвест	99.60	0.00	13.88	0.44	764	791	21.05.08	0.56	18.11.09	12.50	900	--	--/--/--
Очаково-2	98.42	-0.53	10.61	65.9	445	457		0.89	19.09.08	8.50	1 500	--	--/--/--
Парнас-М-2	98.76	2.76	11.98	-169.3	588	582	19.11.09	1.85	17.11.11	10.80	1 000	10.37	--/--/--
Пивдом-1	100.00	0.00	13.42	0.080	727	737	23.10.08	0.91	22.04.10	13.00	1 000	--	--/--/--
Ресторанс-2	100.00	0.00	10.37	0.030	417	438		0.68	02.07.08	10.00	400	--	--/--/--
Ресторанс-3	99.82	0.040	11.32	-7.09	509	535	30.05.08	0.58	26.11.10	10.75	1 000	--	--/--/--
Ретал	97.00	0.00	13.20	0.76	708	713	10.12.08	1.06	09.12.09	9.90	1 000	--	--/--/--
Рост-Лайн-1	99.00	0.50	14.69	-81.2	849	869	10.07.08	0.68	08.07.10	12.75	1 000	--	--/--/--
РусТекстиль-2	97.48	-0.020	16.03	3.09	989	996		0.99	05.03.09	12.75	1 000	41.77	--/--/--
РусТекстиль-3	99.99	-0.010	15.03	0.54	894	888		1.79	20.10.09	14.50	1 200	9.03	--/--/--
САН Интербрю-2	99.30	-0.35	8.59	22.2	252	245		1.70	13.08.09	8.00	4 000	23.83	--/--/--
Синергия	99.95	0.00	11.41	0.48	541	546	23.04.08	0.48	22.04.09	10.70	1 000	--	--/--/--
Синергия-2	97.70	0.68	13.11	-65.0	702	703	22.01.09	1.18	22.07.10	10.70	2 000	0.00	--/--/--
Спартак-Казань	100.00	0.00	13.20	0.020	780	736		0.25	23.01.08	13.00	500	--	--/--/--
Талосто	99.60	0.070	10.57	-5.83	450	447		1.30	06.03.09	10.00	1 000	--	--/--/--
Черемушки	99.49	0.10	13.09	-30.5	773	719	03.03.08	0.36	02.03.09	11.30	700	--	--/--/--
Черкизово	99.59	-0.41	9.33	29.1	328	320	02.06.09	1.49	31.05.11	8.85	2 000	45.81	--/--/--
Эрконпродукт	99.00	0.00	14.53	1.83	916	863	13.03.08	0.39	10.09.09	11.40	1 200	--	--/--/--
Юнимилк	98.50	-0.78	10.92	49.5	484	477	08.09.09	1.74	06.09.11	9.75	2 000	--	--/--/--
Яковлевский	100.00	0.00	19.94	422.4	1 442	1 444		0.04	31.10.08	12.00	1 000	--	--/--/--
Региональные и муниципальные													
Ангарск	101.50	-0.50	11.71	95.4	547	567		0.55	21.11.08	14.00	150	--	--/--/--
Башкирия-5	102.09	1.22	7.02	-67.0	92	86		1.85	04.11.09	8.02	1 000	53.09	BB/Ba1/--
Белгор.обл.-1	102.65	0.00	8.32	-2.65	224	237		0.49	29.04.08	13.50	320	--	--/--/--
Белгор.обл.-3	100.00	-0.075	8.64	2.99	242	242		2.68	10.11.10	8.38	2 000	0.06	--/--/--
Белгор.обл.-4	97.66	0.00	8.86	0.010	258	260		3.38	19.10.11	8.24	1 020	--	--/--/--
Волгогр.обл.-2	101.95	0.022	8.59	-2.99	245	249		0.96	11.06.09	10.99	600	--	B+/--/--
Волгогр.обл.-3	102.14	-0.027	8.66	2.02	254	256		1.07	17.06.10	11.00	700	--	B+/--/--
Волгогр.обл.-4	99.80	-0.100	8.35	4.60	219	216		2.30	19.05.10	8.10	550	--	B+/--/--
Волгогр.обл.-5	100.75	0.32	7.91	-11.3	165	166		2.96	15.05.12	8.35	1 000	--	--/--/--
Волгоград	101.00	0.00	8.02	-0.54	182	201		0.72	17.07.08	9.20	450	--	--/--/--
Волгоград-2	101.53	0.00	8.80	-0.18	269	263		1.97	21.12.09	9.65	600	--	--/--/--
Ворон. обл.-4	102.50	0.025	9.54	-0.74	324	326		3.75	25.06.12	10.00	1 000	--	--/--/--
Ворон.обл.-1	100.79	-0.030	7.64	10.4	219	188		0.14	15.12.07	13.00	600	31.83	--/--/--
Ворон.обл.-2	105.46	-0.090	8.55	5.39	251	242		1.50	18.06.09	12.00	500	--	--/--/--
Ворон.обл.-3	105.00	0.00	8.81	-0.10	255	257		3.08	27.06.11	10.25	500	30.58	--/--/--
Иркут.обл.-3	100.85	0.00	8.14	-0.31	203	204		1.10	17.12.09	9.00	1 500	--	B+/--/--
Иркут.обл.-4	99.84	0.00	7.99	0.040	198	197		0.48	23.10.08	8.00	900	--	B+/--/--
Иркут.обл.-5	99.05	-0.35	8.14	25.5	210	199		1.46	24.11.10	7.75	3 000	12.77	B+/--/--
Иркут.обл.-6	99.60	-0.0020	8.22	0.12	218	208		1.47	26.05.10	8.00	1 200	--	B+/--/--
Казань-3	100.75	-0.020	7.78	1.22	170	163		1.72	29.08.09	8.00	2 300	58.13	--/--/--
Калуж.обл.-1	100.25	0.00	7.51	-2.73	208	173		0.17	24.12.07	9.00	300	--	--/--/--
Карелия-10	98.88	0.025	8.59	-1.01	237	237		2.69	14.04.11	8.27	500	--	B+/--/BB+
Карелия-9	99.37	0.00	8.39	-0.020	227	222		2.00	02.06.10	8.15	500	--	B+/--/BB+
Кировская обл.-1	100.42	0.100	7.96	-16.5	174	192		0.66	22.12.08	8.39	400	--	--/--/BB
Кировская обл.-2	100.24	0.00	8.53	0.030	247	241		1.36	24.09.09	8.45	600	--	--/--/BB
Клин-3	97.80	-0.020	10.38	0.97	419	417		2.50	25.08.10	9.10	300	--	B/--/--
Коми-5	100.95	0.0020	7.48	-10.9	205	171		0.17	24.12.07	13.00	500	2.54	--/Ba2/BB-
Коми-6	108.82	-3.18	8.31	118.4	211	210		2.60	14.10.10	12.50	700	--	--/Ba2/BB-
Коми-7	105.00	-0.85	7.86	19.1	154	155		4.33	22.11.13	10.00	1 000	0.32	--/Ba2/BB-
Коми-8	95.08	-2.70	8.25	52.3	190	190		5.70	03.12.15	8.00	1 000	16.26	--/Ba2/BB-
Костром.обл.-4	101.12	0.060	8.23	-18.9	287	232		0.38	11.03.08	11.00	800	0.15	--/--/--
Краснояр.кр.-3	98.96	0.060	7.28	-6.61	113	124		0.93	01.10.08	6.00	3 000	5.96	--/--/--
Красноярск-3	99.91	0.070	7.74	-7.82	160	168		0.97	18.10.08	7.50	1 000	2.64	--/--/--
Курганская обл.	99.76	-0.095	9.71	5.30	359	354		1.96	17.12.09	9.25	500	20.95	--/--/--
Лен.обл.-2	117.96	-0.12	7.60	3.41	139	138		2.57	08.12.10	14.01	800	19.11	BB/--/B+
Лен.обл.-3	125.75	0.25	7.54	-4.25	120	120		5.02	05.12.14	12.50	1 300	--	BB/--/B+
Липецкая обл.-2	99.20	0.00	8.44	0.020	224	222		2.53	19.07.11	7.95	1 500	--	--/--/BB-
Липецкая обл.-3	99.88	0.00	7.71	0.020	161	155		1.87	14.10.09	7.50	300	--	--/--/BB-
Липецкая обл.-4	98.55	0.00	7.84	0.080	165	164		2.48	15.07.10	7.10	500	--	--/--/--
Магадан-1	103.75	0.00	6.83	-1.31	66	79		0.86	15.09.08	11.00	450	--	--/--/--
Магадан-2	101.81	0.00	9.53	-0.10	337	333		2.30	31.05.10	10.00	300	--	--/--/--
Марий Эл	99.86	-0.055	8.61	3.97	257	248		1.48	23.05.09	8.25	500	--	--/--/--
МО-4	105.86	-0.51	7.02	35.5	98	91		1.40	21.04.09	11.00	9 600	--	BB/Ba2/--
МО-5	106.83	0.080	7.02	-3.87	87	83		2.22	30.03.10	10.00	12 000	81.84	BB/Ba2/--
МО-6	106.04	0.15	7.14	-5.14	88	90		3.09	19.04.11	9.00	12 000	901.38	BB/Ba2/--
МО-7	104.37	0.00	7.27	-0.030	94	95		5.02	16.04.14	8.00	16 000	--	BB/Ba2/--
Мос-29	101.61	-0.17	7.40	26.8	117	142		0.60	05.06.08	10.00	5 000	0.19	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-36	103.00	0.00	7.35	-0.59	123	128		1.08	16.12.08	10.00	4 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-38	110.75	-0.13	6.31	3.97	8	9		2.74	26.12.10	10.00	5 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-39	109.95	0.55	6.27	-10.1	-7	-6		5.23	21.07.14	10.00	10 000	336.01	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-40	100.48	0.00	--	--	--	--		0.01	26.10.07	10.00	5 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-41	105.65	-0.33	6.43	12.6	24	22		2.47	30.07.10	10.00	10 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-43	100.70	0.00	9.00	-0.73	277	304		0.55	17.05.08	10.00	5 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-44	108.70	-0.17	6.53	2.65	18	18		5.73	24.06.15	10.00	20 000	2.18	BBB+/Baa1/BBB+
Мос-47	104.60	0.00	5.96	-0.77	-8	-15		1.40	28.04.09	10.00	10 000	--	BBB+/Baa1/BBB+
Нижегор.обл.-2	101.30	-0.025	7.44	3.69	126	142		0.50	02.11.08	9.99	2 500	0.34	--/--/BB-
Нижегор.обл.-3	101.94	0.00	7.60	-0.060	138	137		2.66	20.10.11	8.70	2 000	--	--/--/BB-
Новосиб.обл.-2	100.60	-0.020	7.43	3.16	197	173		0.10	29.11.07	13.30	2 000	33.07	--/--/BB-
Новосиб.обл.-3	100.70	0.027	7.57	-2.61	148	146		1.20	15.12.09	8.50	2 500	29.02	--/--/BB-
Новосибирск-3	107.50	0.19	7.41	-12.4	136	128		1.57	14.07.09	12.00	1 000	--	B+/--/--
Новосибирск-4	100.78	0.39	8.39	-17.2	221	219		2.40	24.06.10	8.60	1 500	--	B+/--/--
Одинцовский район-2	99.81	-0.22	10.83	21.2	472	476		1.11	24.12.08	10.25	350	1.43	--/--/--
Пензенская обл.-1	102.40	0.00	7.91	-0.35	186	179		1.39	13.10.09	9.45	800	--	--/--/BB
Самар.обл.-2	98.60	0.00	7.57	0.080	136	136		2.62	09.09.10	6.82	2 000	--	BB/Ba1/--
Самар.обл.-3	101.17	-0.17	7.44	5.49	117	119		3.30	11.08.11	7.60	4 500	28.73	BB/Ba1/--
Самар.обл.-4	99.00	-0.060	7.43	1.64	112	115		4.00	20.06.12	6.98	5 000	--	BB/Ba1/--
Тамбовская обл.	100.50	0.00	7.64	-0.19	149	160		0.90	27.09.08	8.00	400	--	--/--

Долговой инструмент	Цена % от номинала	Изм. за день	Доход-ность	Изм. за день	Номинальный спред	Z спред	Дата oferty	Дюра-ция	Дата погашения	Ставка купона	Объем выпуска	Объем торгов	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/ Fitch)
		п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.	лет	%	млн.руб.	млн.руб.			
Томск-2	98.50	0.23	10.25	-15.9	420	410		1.52	20.05.10	7.58	500	3.45	--/--/--
Тулская обл.-1	101.85	0.17	7.52	-11.6	147	139		1.58	28.06.09	8.50	1 500	0.99	--/--/--
Удмуртия	99.83	0.030	8.51	-2.84	240	243		1.12	27.12.08	8.20	1 000	--	--/--/--
Удмуртия-2	99.88	0.14	8.60	-3.81	230	232		3.91	10.07.12	8.40	1 500	--	--/--/--
Уфа-4	101.26	0.035	8.28	-6.97	205	230		0.59	03.06.08	10.28	500	--	B+/-/--
Уфа-5	100.00	-0.20	8.55	10.7	243	238		1.96	18.12.09	8.38	500	10.00	B+/-/--
Хабар.кр.-6	100.03	0.027	7.48	-2.70	136	135		1.10	24.11.09	8.00	1 000	--	--/--/--
ХМАО-2	102.95	0.17	6.94	-31.3	71	97		0.57	27.05.08	12.00	3 000	20.80	BBB/-/--
Чебоксары-2	98.20	0.00	10.52	0.13	446	438		1.63	20.07.09	8.99	250	--	--/--/--
Чувашия-4	105.57	0.00	8.27	-0.81	221	217		1.34	27.03.09	12.33	750	--	--/Ba2/--
Чувашия-5	99.70	0.11	8.10	-3.51	184	186		3.13	05.06.11	7.85	1 000	--	--/Ba2/--
Чувашия-6	99.01	1.51	8.10	-43.5	180	182		3.83	17.04.12	7.99	1 000	86.24	--/Ba2/--
Якутия	101.05	-0.36	7.94	8.39	162	163		4.49	11.04.13	7.95	2 500	27.71	B+/-/B+
Якутия-10	102.60	-0.60	8.10	96.2	188	211		0.63	17.06.08	12.00	800	--	B+/-/B+
Якутия-6	104.70	-0.23	7.59	12.5	151	143		1.77	13.05.10	10.00	2 000	--	B+/-/B+
Якутия-7	100.49	0.00	7.91	0.010	159	161		4.29	17.04.14	7.80	2 500	--	B+/-/B+
ЯНАО	102.00	1.50	7.42	-207.9	124	141		0.76	03.08.08	10.00	1 800	0.04	BB+/-/--
Яр.обл.-4	104.44	0.00	7.31	-0.55	127	119		1.45	26.05.09	10.50	1 000	--	--/--/--
Яр.обл.-5	100.25	0.00	7.44	-0.070	133	136		1.13	30.12.08	7.75	500	--	--/--/--
Яр.обл.-6	98.75	-0.020	7.99	1.03	185	179		2.18	19.04.11	7.75	2 000	30.61	--/--/--
Яр.обл.-7	100.15	0.033	7.74	-1.85	162	157		2.06	30.03.10	8.50	3 500	45.07	--/--/--
Ярославль-1	99.04	-0.020	9.99	1.51	394	385		1.53	17.12.09	9.00	400	--	--/--/--
Сельское хозяйство													
Агрика	99.00	0.20	14.67	-50.6	892	874	01.04.08	0.44	29.09.09	11.80	1 000	0.00	--/--/--
Агроком	94.50	0.00	15.85	1.34	974	978	23.12.08	1.10	21.06.11	10.00	1 500	--	--/--/--
АгроСоюз	100.00	0.24	13.95	-18.8	791	783		1.42	21.05.09	13.28	500	3.25	--/--/--
Агрохолдинг	99.18	0.22	14.68	-35.2	849	868	18.07.08	0.71	24.07.09	12.75	1 000	1.48	--/--/--
Аркада-1	98.22	-1.38	17.27	291.4	1 103	1 129		0.53	28.06.08	13.20	600	0.42	--/--/--
Аркада-2	98.68	-0.22	15.23	26.1	909	916		0.97	20.02.09	13.31	700	35.52	--/--/--
Аркада-3	98.12	-0.020	16.47	2.99	1 031	1 043	02.10.08	0.91	31.03.11	13.65	1 200	2.77	--/--/--
Белгранкорм-1	99.00	0.00	21.28	23.6	1 582	1 556	04.12.07	0.12	02.12.08	10.90	700	--	--/--/--
Белый фрегат	99.95	0.00	15.59	0.23	1 014	984	13.12.07	0.14	17.12.09	14.50	1 000	0.00	--/--/--
Волшебный Край	99.50	0.00	16.32	10.5	1 086	1 060	04.12.07	0.12	02.12.08	11.50	500	--	--/--/--
Зерн.комп. Настюша	100.94	0.00	11.23	-0.56	501	524	20.06.08	0.63	18.12.09	12.50	1 000	--	--/--/--
Мираторг-1	98.15	0.19	14.21	-27.4	802	819	07.08.08	0.76	02.08.12	11.25	2 500	--	--/--/--
Митлэнд	100.00	0.00	13.06	-0.22	768	718	19.02.08	0.32	16.02.10	12.50	1 000	--	--/--/--
Моссельпром	98.66	0.23	14.24	-24.1	812	817		1.05	12.12.08	12.50	1 000	28.07	--/--/--
Мяскорп Евросервис-1	99.52	0.00	17.40	5.45	1 196	1 164		0.15	18.12.07	13.25	1 500	3.12	--/--/--
ОГО-агро-2	98.00	0.0050	15.48	-0.060	935	940		1.05	25.02.09	12.95	1 200	0.49	--/--/--
ОГО-агро-3	99.00	0.61	15.53	-102.3	932	954	04.07.08	0.67	09.07.10	13.50	1 500	1.20	--/--/--
ПАВА-2	101.05	0.050	10.90	-11.4	466	494	09.05.08	0.52	21.10.11	12.50	1 000	0.85	--/--/--
Разгуляй-2	100.00	0.70	10.48	-175.4	473	455	01.04.08	0.44	27.09.11	10.25	2 000	1.50	--/--/--
Разгуляй-3	98.82	-0.43	12.26	36.2	620	616	20.03.09	1.33	16.03.12	10.99	3 000	1.39	--/--/--
Русагро	100.00	0.00	8.65	0.040	245	264		0.72	19.07.08	8.50	1 000	55.79	--/--/--
Русские масла-2	97.50	-2.50	16.01	314.1	986	997	02.10.08	0.92	29.03.12	12.50	1 000	--	--/--/--
СахарКомп	97.26	-0.20	18.91	46.2	1 267	1 295	13.05.08	0.53	10.11.09	12.75	2 000	--	--/--/--
Сиб.аграрн.группа	99.58	0.080	17.86	-92.7	1 239	1 219	21.11.07	0.08	20.05.09	11.50	400	--	--/--/--
Содружество	97.88	0.00	12.01	0.25	593	586		1.76	22.10.09	10.45	2 500	--	--/--/--
Телекоммуникации													
Артел	99.70	0.00	12.76	0.14	656	675	18.07.08	0.71	17.07.09	12.00	200	--	--/--/--
ВолгаТел-2	100.49	-0.26	7.86	25.1	174	180	02.12.08	1.06	30.11.10	8.20	3 000	72.32	BB-/---/--
ВолгаТел-3	103.04	1.39	7.03	-74.3	92	85		1.91	30.11.10	8.50	2 300	177.64	BB-/---/--
ВолгаТел-4	100.80	0.055	7.74	-3.40	166	159	08.09.09	1.75	03.09.13	7.99	3 000	215.67	BB-/---/--
ДальСвязь-2	102.52	0.065	7.88	-3.02	172	168	02.06.10	2.26	30.05.12	8.85	2 000	--	--/--/B+
ДальСвязь-3	100.99	0.013	7.63	-1.70	148	155		0.91	03.06.09	8.60	1 500	--	--/--/B+
МГТС-4	99.84	0.00	7.58	0.15	151	163	23.04.08	0.48	22.04.09	7.10	1 500	--	BB-/Ba3/--
МГТС-5	99.76	0.020	7.65	-3.30	142	168	27.05.08	0.58	25.05.10	7.10	1 500	--	BB-/Ba3/--
МегаФон-3	101.42	0.58	6.28	-127.6	25	34		0.48	15.04.08	9.25	3 000	--	BB/Ba3/BB+
Радионет	99.98	0.00	11.76	-0.14	558	573		0.82	27.08.08	11.45	600	--	--/--/--
СЗТ-3	100.52	0.00	7.93	-1.13	256	204	28.02.08	0.34	24.02.11	9.25	3 000	--	BB-/---/BB-
СЗТ-4	103.42	2.81	7.13	-99.4	87	89		2.96	08.12.11	8.10	2 000	103.42	BB-/---/BB-
СибТел-5	100.95	0.00	7.38	-0.93	131	143		0.48	25.04.08	9.20	3 000	--	--/--/B+
СибТел-6	100.20	-0.25	7.75	29.7	159	171	18.09.08	0.89	16.09.10	7.85	2 000	0.13	--/--/B+
СибТел-7	102.10	-0.100	7.34	6.71	130	122		1.46	20.05.09	8.65	2 000	--	--/--/B+
СМАРТС-3	99.20	0.20	15.58	-25.3	942	954	30.09.08	0.91	29.09.09	14.10	1 000	--	--/--/--
УРСИ-4	100.02	-0.050	9.13	181.3	364	363		0.02	01.11.07	9.99	3 000	11.31	BB-/---/B+
УРСИ-5	100.75	0.12	7.72	-26.2	166	178		0.48	17.04.08	9.19	2 000	--	BB-/---/B+
УРСИ-6	100.50	0.00	7.85	-0.15	172	178	20.11.08	1.02	17.11.11	8.20	2 000	--	BB-/---/B+
УРСИ-7	100.75	-0.100	7.97	7.78	191	186	17.03.09	1.34	13.03.12	8.40	3 000	--	BB-/---/B+
ЦентрТелеграф-3	101.50	0.00	8.91	-0.17	286	281		1.36	01.04.09	9.75	700	--	B/--/--
ЦТК-4	110.23	0.15	7.83	-9.53	176	169		1.65	21.08.09	13.80	5 623	21.44	B+/-/---/B-
ЦТК-5	100.00	-0.25	8.23	31.5	207	220	02.09.08	0.84	30.08.11	8.09	3 000	4.00	B+/-/---/B-
ЮТК-3	100.02	0.015	8.67	-0.94	258	252		1.84	10.10.09	9.00	3 500	117.74	B-/B1/--
ЮТК-4	102.05	0.019	8.68	-1.88	261	255		1.30	09.12.09	10.00	5 000	59.94	B-/B1/--
ЮТК-5	97.46	0.19	8.84	-8.49	267	264	02.06.10	2.35	30.05.12	7.55	2 000	91.62	--/--/--
Транспортные													
Авиакомпания S7	99.00	-1.10	11.88	102.2	579	580	20.01.09	1.17	17.07.12	10.70	2 300	--	--/--/--
ДВТГ-1	99.90	0.00	11.10	-0.050	501	501	03.02.09	1.21	03.08.10	10.75	1 000	--	--/--/--
КААД-2	99.95	0.84	11.18	-1 108.9	572	552	22.11.07	0.08	22.05.08	10.50	3 000	0.81	B/--/--
КД Авиа-1	99.05	0.00	15.60	1.36	963	965	23.04.08	0.47	21.04.10	13.00	1 000	--	--/--/--
ММК-ТрансФин	98.95	0.00	13.44	0.69	724	744		0.69	10.07.08	11.50	650	--	--/--/--
РЖД 12	101.69	0.00	7.73	-0.080	161	153		2.00	30.06.12	8.38	12 570	--	BBB+/A3/BBB+
РЖД-2	100.20	0.00	6.02	-3.82	57	30		0.12	05.12.07	7.75	4 000	10.02	BBB+/A3/BBB+
РЖД-3	102.80	-1.20	7.00	62.1	89	83		1.92	02.12.09	8.33	4 000	261.66	BBB+/A3/BBB+
РЖД-5	99.85	0.00080	6.90	-0.040	81	81		1.20	22.01.09	6.67	10 000	1 053.26	BBB+/A3/BBB+
РЖД-6	101.06	0.13	7.08	-4.99	85	86		2.70	10.11.10	7.35	10 000	422.51	BBB+/A3/BBB+
РЖД-7	102.51	-0.079	7.07	1.91	76	78		4.17	07.11.12	7.55	5 000	126.60	BBB+/A3/BBB+
Трансаэро	98.20	0.20	12.55	-17.7	647	646		1.22	05.02.09	10.66	2 500	--	--/--/--
Усть-Луга	98.10	0.096	11.29	-5.09	516	511		2.05	11.02.10	9.90	600	--	--/--/--
ЭйрЮнион	99.76	0.010	18.75	2.27	1 327	1 314	13.11.07	0.06	10.11.09	13.50	1 500	2.75	--/--/--
ЮТэйр-2	99.10	0.00	12.40	2.09	705	650	11.03.08	0.38	10.03.09	9.45	1 000	2.06	--/--/--
ЮТэйр-3	97.75	-0.25	12.92	26.3	680	685	16.12.08	1.08	14.12.10	10.40	2 000	--	--/--/--
Финансовые													
АБН АМРО 10													

Долговой инструмент	Цена	Изм. за	Доход-	Изм. за	Номинальный	Z	Дата	Дюра-	Дата	Ставка	Объем	Объем	Кредитный
		день		день									
	% от	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.		лет		%	млн.руб.	млн.руб.	(S&P/Moody's/ Fitch)
Автовазбанк-1	98.99	2.99	15.07	-815.8	931	914	04.04.08	0.44	02.04.10	11.95	800	20.03	--/Caa1/--
АИЖК	103.95	0.00	7.35	-0.85	122	128		1.03	01.12.08	11.00	1 070	--	--/--/--
АИЖК (Кем. обл.)-2	100.10	0.28	9.16	-10.9	293	292		2.73	23.08.11	9.00	1 000	0.00	--/--/--
АИЖК Респ. Алтай-1	100.25	0.00	11.61	-0.040	546	542		2.19	13.04.10	11.25	300	--	--/--/--
АИЖК-2	107.05	0.00	7.70	-0.37	158	153		2.04	01.02.10	11.00	1 500	--	--/--/--
АИЖК-3	103.60	0.00	7.38	-0.37	131	121		1.64	15.10.10	9.40	2 250	--	--/--/--
АИЖК-4	104.76	0.16	7.60	-4.56	131	133		3.57	01.02.12	8.70	900	--	--/--/--
АИЖК-5	100.04	0.070	7.54	-1.96	124	127		3.84	15.10.12	7.35	2 200	133.06	--/--/--
АИЖК-6	99.92	-0.070	7.62	1.61	130	131		4.68	15.07.14	7.40	2 500	--	--/--/--
АИЖК-7	100.98	-0.12	7.71	2.31	137	137		5.51	15.07.16	7.68	4 000	30.30	--/--/--
АИЖК-8	101.15	0.050	7.62	-1.03	128	126		5.24	15.06.18	7.63	5 000	48.54	--/--/--
АИЖК-9	100.14	-0.060	7.67	1.23	134	134	15.02.15	5.12	15.02.17	7.49	5 000	2.15	--/--/--
АИЖК-А	99.60	0.070	7.34	-3.80	123	113		1.95	15.02.39	6.94	2 900	0.01	--/A3/--
АК БАРС-2	99.00	0.30	9.04	-26.5	295	295		1.20	22.01.09	8.00	1 500	1.98	--/Ba2/BB-
Акибанк	98.58	0.00	15.16	1.92	916	922	24.04.08	0.48	23.04.09	11.60	600	--	--/--/--
Альянс-1	100.07	0.00	8.91	0.010	273	271	23.06.10	2.37	20.06.12	8.76	3 000	--	--/--/--
Банк Москвы 09	99.55	0.00	7.62	0.050	152	146		1.91	25.11.09	7.25	5 000	--	--/A3/BBB
Банк НФК	98.80	0.00	46.77	263.2	4 128	4 121	07.11.07	0.04	12.05.09	9.80	1 000	--	B/--/--
Банк РК	98.95	-0.24	12.07	32.1	590	604	02.09.08	0.84	02.03.10	10.45	2 000	--	B-/B1/B-
Банк РК 08 (CLN)	96.00	0.00	19.24	4.52	1 300	1 328		0.53	12.05.08	10.50	2 660	--	B-/B1/B-
Банк Россия-1	99.00	0.00	10.67	0.47	447	466	19.07.08	0.72	21.07.10	9.00	1 500	--	--/--/B-
Банк Союз-1	99.90	0.00	9.80	0.25	371	385		0.49	24.04.08	9.25	1 000	--	B-/B1/--
Банк Союз-2	99.96	-0.065	9.55	16.2	374	362	04.04.08	0.45	05.10.09	8.37	2 000	2.30	B-/B1/--
Банк СПб	98.50	0.31	11.88	-53.5	566	589	19.06.08	0.64	22.06.09	9.00	1 000	3.94	--/Ba3/--
БанкЖилФин	100.00	0.00	9.53	0.100	410	376	21.12.07	0.16	19.12.08	9.25	500	--	--/--/CCC+
БанкПроектФинанс	98.08	-1.79	13.77	165.5	768	768		1.21	12.02.09	11.50	500	0.98	--/--/--
ВБРР	112.30	0.00	3.56	-0.87	-253	-260		1.82	11.10.09	10.00	575	--	--/Baa3/--
Возрождение	100.62	0.23	8.83	-11.2	269	265		2.16	03.03.10	8.95	3 000	--	--/Ba3/--
Восточный Экспресс Банк	98.21	-0.79	15.50	225.5	1 001	958	19.03.08	0.40	17.03.10	10.30	1 500	5.72	--/B3/--
ВТБ 09	99.82	0.018	7.26	-1.34	121	114		1.42	13.04.09	7.00	10 000	--	BBB/A2/BBB+
ВТБ-4	101.93	2.25	1.54	-567.1	-397	-438	20.03.08	0.41	19.03.09	6.30	5 000	234.44	BBB+/A2/BBB+
ВТБ-5	99.40	0.00	7.32	0.55	120	138	24.04.08	0.49	17.10.13	5.90	15 000	--	BBB+/A2/BBB+
ВТБ-6	99.88	0.00	6.05	0.020	-14	5	16.07.08	0.72	06.07.16	5.75	10 000	--	BBB+/A2/BBB+
Газбанк	99.83	0.0050	12.91	0.94	744	726	20.11.07	0.08	25.11.08	10.50	750	4.19	--/B2/--
Газпромбанк 10	99.50	-0.21	7.62	10.4	148	144		2.15	22.02.10	7.25	10 000	--	BBB/A3/--
Газпромбанк-1	98.40	0.38	7.80	-13.8	155	157		2.92	27.01.11	7.10	5 000	--	BBB-/Baa2/--
Газпромбанк-2	99.95	0.00	7.09	1.27	162	139	28.11.07	0.10	20.11.13	6.54	5 000	--	BBB-/Baa2/--
Глобэксбанк	97.95	-0.57	17.23	173.9	1 186	1 132	13.03.08	0.39	15.03.10	11.00	2 000	--	--/--/--
ГПБ-Ипотека	99.95	0.025	8.26	-1.12	207	203		2.48	29.12.36	8.00	3 000	4.39	--/Baa2/--
ДельтаКредит-1	100.50	0.00	6.94	0.00	83	78		1.95	01.12.09	7.09	1 500	--	--/Baa2/--
Еврокоммерц	99.80	0.100	12.94	-64.1	750	717	21.12.07	0.16	18.12.09	11.50	1 000	19.96	--/B2/--
Еврокоммерц-3	95.75	0.00	13.99	1.00	788	792	19.12.08	1.09	18.06.10	9.48	3 000	--	--/B2/--
Жилсоципотека	99.93	0.00	14.31	-112.9	879	881		0.04	22.10.09	11.50	600	--	--/--/--
Жилсоципотека-2	98.85	0.22	13.98	-51.5	791	803	17.04.08	0.48	14.10.10	11.00	1 500	--	--/--/--
ЖК-Финанс	99.40	0.25	19.06	-174.2	1 362	1 329	20.12.07	0.16	24.12.09	14.00	1 000	--	--/--/--
Зенит-2	99.17	-0.21	9.26	17.8	318	316		1.26	16.02.09	8.39	2 000	39.67	--/Ba3/B
Зенит-3	99.95	-0.029	9.32	52.2	384	370	14.11.07	0.06	09.11.11	8.45	3 000	57.97	--/Ba3/B
Зенит-4	99.60	-0.021	9.24	5.36	343	331	04.04.08	0.45	06.04.10	8.13	3 000	25.05	--/Ba3/B
Инвестторгбанк-2	100.10	0.00	10.39	-0.21	425	434		0.95	14.10.08	10.25	350	--	--/--/--
ИнтехБанк-1	99.98	0.00	12.43	-0.010	624	642	31.07.08	0.74	30.07.09	12.10	500	--	--/--/--
Кедр КБ-2	99.83	0.63	12.08	-177.1	666	616	18.03.08	0.40	15.09.09	11.15	1 000	39.93	--/B2/--
КИТ Фин	100.00	0.00	10.07	0.14	463	431	18.12.07	0.15	18.12.08	10.00	2 000	1.00	CCC+/-/--
КИТ Фин-2	99.72	-0.37	10.57	45.9	441	453	17.09.08	0.88	23.03.10	10.00	2 000	5.99	CCC+/-/--
КМБ-Банк-2	99.69	0.094	8.19	-9.22	207	212	03.12.08	1.06	30.11.11	7.75	3 400	--	--/Baa2/--
Кредит Европа	100.06	0.00	7.99	0.060	180	197	06.08.08	0.77	03.02.10	7.94	3 500	--	--/Ba1/--
Локо-Банк-2	100.20	0.00	10.63	-0.28	451	468		0.49	22.04.08	10.65	500	--	--/B2/B-
Мастер-Банк-2	99.99	0.038	11.81	-7.06	558	584		0.56	23.05.08	11.50	1 000	101.69	--/--/--
Мастер-Банк-3	100.00	-0.025	11.86	21.4	641	614	05.12.07	0.12	30.11.11	11.75	1 200	48.50	--/--/--
МДМ-Банк-3	99.72	0.020	9.00	-2.27	285	295	02.10.08	0.92	01.10.09	8.50	6 000	6.28	BB/Ba1/BB
Медведь-Фин	100.00	0.93	13.41	-127.4	724	738	03.09.08	0.82	01.09.10	12.80	750	10.00	--/--/--
МЗБ	99.80	0.00	14.96	12.9	949	933	16.11.07	0.07	17.11.09	11.65	800	--	--/--/--
МИА-2	99.58	0.00	9.47	0.30	329	346		0.77	09.08.08	8.60	1 000	--	--/--/--
МИА-3	98.58	0.33	9.39	-27.7	332	330	26.02.09	1.28	24.02.12	7.95	1 500	--	--/--/--
МИА-4	100.00	--	9.31	--	305	314	08.10.09	1.85	01.10.15	9.00	2 000	--	--/Ba2/--
МКБ-2	100.02	0.35	10.28	-302.5	482	455	06.12.07	0.12	04.06.09	10.40	1 000	--	--/B1/B-
МКБ-3	98.12	-0.025	11.62	2.89	551	555	17.12.08	1.09	16.06.10	9.55	2 000	--	--/B1/B-
МЛК	97.61	0.00	15.27	0.32	922	914		1.54	23.07.09	12.90	550	--	--/--/--
ММБ-2	100.85	0.00	3.72	-2.53	-166	-215	13.02.08	0.31	11.02.09	6.50	3 000	--	BBB+/-/A-
Москоммерцбанк	99.66	0.015	12.48	-7.01	703	676	05.12.07	0.12	10.12.08	9.30	1 000	--	--/--/--
Москоммерцбанк-2	99.12	0.00	9.72	0.35	355	370	19.08.08	0.80	15.02.11	8.40	3 000	--	--/--/--
Москоммерцбанк-3	94.92	0.00	12.54	0.65	649	641	17.06.09	1.53	12.06.13	8.70	5 000	--	--/--/--
МосОблИпотАгентство-1	98.22	0.00	10.07	0.100	392	386		2.17	21.12.10	9.00	1 500	--	--/Ba2/--
МосОблИпотАгентство-2	97.55	-0.43	26.60	375.6	2 116	2 083	19.12.07	0.15	07.09.11	7.99	3 000	2.37	--/Ba2/--
МосОблИпотАгентство-3	96.75	0.00	11.12	0.80	501	505	13.12.08	1.09	14.06.14	7.75	5 000	--	--/--/--
Мособлтраст	99.45	2.97	9.69	-277.1	360	357		1.21	26.09.09	9.00	3 000	43.17	B/--/--
Мособлтраст-2	95.62	0.00	12.81	0.58	675	670	26.03.09	1.36	26.03.11	8.99	4 000	--	B/--/--
Номос-7	99.85	-0.050	9.34	35.5	390	357	18.12.07	0.15	16.06.09	8.25	3 000	0.11	--/Ba3/B+
Оргрзбанк	100.10	0.00	6.00	0.020	-8	-10		1.26	10.02.09	6.00	500	--	--/--/B-
Оренбург. ИЖК	100.70	0.00	9.22	-0.040	294	296		3.33	21.02.12	9.24	1 000	--	--/--/--
Открытие	99.00	0.050	12.57	-5.42	643	651		0.99	11.11.08	11.00	200	--	--/--/--
Петрокоммерц-2	98.84	-0.100	9.39	6.31	331	324		1.74	31.08.09	8.50	3 000	--	B+/Ba3/--
ПробизБанк-5	100.00	0.00	8.90	-0.12	285	278		1.39	29.04.09	9.69	1 000	--	--/--/B-
Промсвб-4	99.50	0.00	31.84	254.8	2 635	2 634		0.02	01.11.07	8.20	600	--	B+/Ba3/B+
Промсвб-5	97.60	-0.017	9.89	1.57	385	377	21.05.09	1.46	17.05.12	7.99	4 500	--	B+/Ba3/B+
ПЭБ	102.92	0.00	5.50	-4.70	-13	-42	26.03.08	0.42	23.09.09	12.50	500	--	--/--/--
Ренинс Финанс	99.00	-0.19	13.17	50.0	742	725	01.04.08	0.44	30.03.10	10.40	750	--	--/--/--
Росбанк 09	100.12	0.00	8.08	-0.010	199	193		1.82	30.09.09	8.00	7 000	--	BB-/Ba2/BB-
Росбанк-1	100.26	0.26	7.66	-21.9	159	157		1.26	15.02.09	7.89	3 000	--	BB-/Ba2/BB-
РСХБ-1	99.80	-0.050	7.74	8.92	152	1							

Долговой инструмент	Цена	Изм. за	Доход-	Изм. за	Номинальный	Z	Дата	Дюра-	Дата	Ставка	Объем	Объем	Кредитный
		день		день									
	% от	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.	лет			%	млн.руб.	млн.руб.	(S&P/Moody's/ Fitch)
	номинала												
РТК-Лизинг-4	100.15	-0.050	8.62	10.9	274	269		0.46	08.04.08	8.80	2 250	0.03	--/--/--
РТК-Лизинг-5	98.00	0.00	9.78	0.19	371	362		1.71	12.08.10	8.35	2 250	19.60	--/--/--
Рус.Межд.Банк	99.32	0.00	12.78	1.00	673	683	26.04.08	0.48	27.04.09	11.00	1 000	--	--/--/--
РусСтанд-4	98.22	-0.30	13.83	98.2	847	793		0.36	03.03.08	8.25	3 000	545.82	BB-/Ba2/BB-
РусСтанд-5	96.65	-0.20	12.97	27.7	681	694	11.09.08	0.87	09.09.10	8.50	5 000	7.73	BB-/Ba2/BB-
РусСтанд-6	95.31	0.00	12.48	0.76	640	639	11.02.09	1.25	09.02.11	8.15	6 000	--	BB-/Ba2/BB-
РусСтанд-7	98.31	-0.090	13.10	27.0	749	718	25.03.08	0.42	20.09.11	8.50	5 000	19.66	BB-/Ba2/BB-
РусСтанд-8	96.50	0.50	12.49	-59.3	635	644	17.10.08	0.97	13.04.12	8.25	5 000	--	BB-/Ba2/BB-
Русфинанс-1	101.64	0.00	6.19	-0.36	7	12		1.06	02.12.08	7.65	1 500	--	BB+/Baa2/--
Русфинанс-2	101.35	1.80	6.31	-176.2	19	24		1.06	02.12.08	7.50	1 500	--	BB+/Baa2/--
Русфинанс-3	99.12	0.00	8.32	0.100	229	220		1.45	13.05.09	7.55	4 000	--	BB+/Baa2/--
Русфинанс-4	97.45	0.075	9.18	-3.74	304	300		2.13	12.02.10	7.74	4 000	--	BB+/Baa2/--
Русь-Банк	98.00	0.48	11.90	-40.1	584	580		1.34	19.03.09	10.00	1 400	0.09	--/--/--
Русь-Банк-2	97.75	-0.20	12.77	28.1	659	674	22.08.08	0.81	22.02.10	9.50	2 000	1.06	--/--/--
СБ банк	99.64	0.090	10.32	-6.10	427	419		1.56	02.07.09	9.85	1 500	7.45	--/--/--
СБ банк-2	98.90	0.100	11.60	-16.8	538	562	13.06.08	0.62	11.06.10	9.50	1 000	--	--/--/--
Связь-Банк-1	97.00	0.00	11.57	0.46	552	545	23.04.09	1.39	21.04.11	8.90	2 000	--	--/B2/--
Северная Казна-1	99.65	0.00	10.47	-0.16	438	432		1.78	01.10.09	10.75	1 000	--	--/--/--
СКБ-Банк-1	98.00	0.00	13.60	1.35	739	761	19.06.08	0.64	24.06.10	9.75	1 000	0.98	--/--/--
Славинвестбанк-2	100.00	0.00	9.71	0.17	357	366		0.95	27.10.08	9.00	900	--	--/B1/B
Собинбанк	100.00	0.00	12.04	-0.35	657	643	14.11.07	0.06	13.05.09	12.00	1 048	--	--/--/--
Солидарность	98.80	-0.33	23.21	362.7	1 776	1 749	04.12.07	0.12	01.12.09	10.75	1 000	0.99	--/B3/--
Солидарность-2	98.03	0.00	15.72	2.46	960	978	22.04.08	0.49	20.04.10	10.70	950	--	--/B3/--
Спуртб-1	100.00	0.00	9.49	0.45	402	387		0.06	15.11.07	9.25	500	--	--/--/B-
Спуртб-2	98.57	0.78	13.84	-147.5	762	786	05.06.08	0.60	31.05.12	10.74	1 000	10.84	--/--/--
Тат-Инк	100.00	0.00	11.17	-0.12	578	531		0.29	06.02.08	11.00	500	--	--/--/--
Татфондбанк-3	100.00	0.00	10.29	0.39	482	463	20.11.07	0.08	19.05.09	10.00	1 500	15.00	--/B2/--
ТКС Банк-1	100.00	--	18.81	--	1 267	1 276	21.10.08	0.96	22.10.10	18.00	1 500	272.55	--/--/--
Транскапиталбанк	99.00	0.00	11.39	0.88	516	541	29.05.08	0.58	01.06.09	9.20	800	--	--/--/--
ТрансКредитБанк-1	96.80	-0.40	8.85	18.4	267	265		2.39	15.06.10	7.29	3 000	1.94	BB/Ba3/--
ТрансКредитБанк-2	97.72	0.15	8.98	-10.2	293	285	16.06.09	1.54	12.06.12	7.28	3 000	22.88	BB/Ba3/--
ТрансФин-М-2	99.75	0.00	11.08	0.18	490	506	15.08.08	0.79	10.08.12	10.50	1 500	--	--/--/--
ТуранАлем Фин-1	100.13	0.00	7.82	-0.010	173	167		1.85	06.10.09	7.75	3 000	--	--/--/--
УБРиР-2	98.33	0.33	13.41	-55.1	720	741	03.07.08	0.68	02.07.09	10.25	1 000	5.90	B-/B3/--
УралЛизЦентр	100.00	0.00	13.24	77.7	774	774	24.10.07	0.00	28.10.09	11.50	1 000	--	--/--/--
УРСА Банк 10 (9.125%)	94.75	0.00	12.09	0.25	596	592		2.12	26.02.10	9.12	5 000	--	--/Ba1/B
УРСА Банк-2	97.04	1.04	10.79	-107.9	468	472		1.09	12.12.08	7.60	1 500	--	--/Ba3/B
УРСА Банк-3	98.79	-0.11	10.69	7.96	465	456		1.48	04.06.09	9.60	3 000	65.20	--/Ba3/B
УРСА Банк-5	99.19	-0.19	10.57	6.21	429	431		3.38	18.10.11	10.05	3 000	354.92	--/Ba3/B
УРСА Банк-6	99.28	0.00	9.45	0.89	335	351		0.49	24.04.08	7.65	1 500	--	--/Ba3/B
УРСА Банк-7	94.80	-0.085	11.37	5.13	524	519	21.01.10	2.05	19.07.12	8.40	5 000	180.12	--/Ba3/B
ФинансБизнесГрупп-1	100.00	0.00	10.24	0.020	406	404		2.37	05.07.10	10.00	3 000	--	--/--/--
ХКФБ-2	96.93	-0.14	11.78	11.5	574	566	12.05.09	1.42	11.05.10	9.25	3 000	--	B+/Ba3/--
ХКФБ-3	98.20	0.37	12.07	-47.4	591	603	18.09.08	0.87	16.09.10	9.45	3 000	1.00	B+/Ba3/--
ХКФБ-4	98.55	-0.052	12.04	6.56	590	600	15.10.08	0.94	12.10.11	9.95	3 000	26.61	BB+/Ba3/--
Центр-Инвест	100.03	0.010	9.37	-24.8	389	379	10.11.07	0.05	11.11.09	10.00	1 500	0.50	--/B1/--
Экспобанк	99.81	0.085	12.36	-52.9	693	658	25.12.07	0.17	29.12.09	10.75	1 000	0.37	--/B3/--
Электроника-1	99.41	-0.090	13.48	22.1	749	759		0.47	13.04.08	11.75	500	19.34	--/--/--
Элемент Лизинг	99.80	0.00	13.61	0.060	803	769	26.03.08	0.42	24.03.10	12.50	600	--	--/--/--
Элемент-1	100.00	0.00	11.01	0.050	563	515		0.29	08.02.08	10.60	200	--	--/--/--
ЮЛК-Финанс-1	99.25	0.00	16.72	1.46	1 108	1 078	23.04.08	0.43	28.04.10	14.00	1 000	--	--/--/--
Юниаструм-1	99.34	0.040	13.43	-12.3	806	755	19.02.08	0.33	17.02.09	11.00	1 000	--	--/B2/--
Юниаструм-2	98.98	-1.04	12.39	120.8	625	634	17.10.08	0.96	19.04.10	10.90	1 500	--	--/B2/--
Химические													
ВМУ-Фин.	99.90	0.044	11.72	-25.7	629	594	25.12.07	0.17	22.12.09	11.00	1 500	0.00	--/--/--
Дорогобуж-1	100.75	0.00	7.48	-0.42	126	150		0.62	11.06.08	8.60	900	--	--/--/--
КуйбАзот-2	99.60	0.60	9.13	-22.1	288	290		2.95	04.03.11	8.80	2 000	0.10	--/--/--
Никосхим-Инв-2	98.01	-0.060	13.08	4.31	701	693		1.64	20.08.09	11.25	1 500	117.68	--/--/--
Нитол-2	99.02	0.020	12.64	-1.07	654	647		1.88	15.12.09	11.75	2 200	6.75	--/--/--
НКНХ-4	102.00	0.00	8.65	-0.29	260	254	30.03.09	1.37	26.03.12	9.99	1 500	4.64	--/--/B+
Нэфис-2	99.50	0.00	11.27	0.36	506	529	18.06.08	0.63	16.12.09	10.20	1 000	--	--/--/--
САНОС-2	102.55	0.15	8.80	-8.46	270	264		1.83	10.11.09	10.00	3 000	11.79	--/--/--
Сибур	99.65	0.18	8.04	-9.80	194	188	05.11.09	1.86	01.11.12	7.70	1 500	2.01	--/Ba2/BB
СНХЗ	97.85	0.30	13.73	-19.4	764	758		1.77	29.09.09	12.00	1 000	4.89	--/--/--
УралХимКомп	100.34	0.00	9.46	-1.48	406	362	25.01.08	0.25	21.01.11	10.50	500	--	--/--/--
Энергетика													
Атомстройэкспорт-1	99.99	1.02	7.90	-72.1	186	177	26.05.09	1.48	24.05.11	7.75	1 500	0.03	--/--/--
Башкирэн-3	98.75	-0.75	9.58	61.7	352	348	19.03.09	1.33	09.03.11	8.30	1 500	0.10	--/--/--
ГидроОГК-1	102.07	0.017	7.58	-0.58	131	133		3.19	29.06.11	8.10	5 000	46.95	--/Baa3/--
ЕЭСК-2	98.50	-0.42	9.66	20.6	350	347	08.04.10	2.26	05.04.12	8.74	1 000	--	--/--/--
Кубаньэнерго-1	98.91	0.11	8.63	-6.41	254	246		1.83	21.07.10	7.85	3 000	0.99	--/--/--
Ленэнерго-2	99.28	0.030	8.93	-0.87	264	266		3.60	27.01.12	8.54	3 000	--	--/--/--
Ленэнерго-3	98.70	0.00	8.55	0.030	225	227		3.70	18.04.12	8.02	3 000	--	--/--/--
Мосэнерго	100.03	-0.065	7.66	3.83	157	151	15.09.09	1.79	13.09.11	7.54	5 000	0.94	BB/--/--
Мосэнерго-2	100.11	-0.29	7.76	8.24	147	149	23.02.12	3.73	18.02.16	7.65	5 000	0.08	BB/--/--
МОЭСК	99.50	0.069	8.37	-2.17	209	211		3.37	06.09.11	8.05	6 000	1.47	--/--/--
ОГК 2-1	98.16	-0.64	8.65	28.4	247	245		2.42	01.07.10	7.70	5 000	--	--/--/--
ОГК 5	99.35	0.00	8.02	0.060	193	187	01.10.09	1.84	29.09.11	7.50	5 000	0.20	--/Ba3/--
ОГК 6-1	97.83	0.00	8.72	0.16	256	252	22.04.10	2.24	19.04.12	7.55	5 000	--	--/--/--
Пермэнерго-1	98.40	1.10	9.05	-51.4	288	285	25.05.10	2.31	22.05.12	8.15	1 000	14.76	--/--/--
Татэнерго-1	100.18	-0.070	9.33	18.6	396	342		0.39	13.03.08	9.65	1 500	3.54	--/--/--
ТГК 6-1	99.39	0.015	9.52	-3.16	416	364	26.02.08	0.34	21.02.12	7.40	2 000	--	--/--/--
ТГК-1	98.70	0.15	8.53	-7.28	238	234	16.03.10	2.22	11.03.14	7.75	4 000	5.00	--/--/--
ТГК-10-1	98.64	0.036	8.67	-2.35	262	254	18.06.09	1.55	17.06.10	7.60	3 000	34.52	--/--/--
ТГК-4-1	99.30	0.20	8.23	-13.9	218	210	04.06.09	1.51	31.05.12	7.60	5 000	12.84	--/--/--
Тюменьэнерго-2	98.50	0.00	8.56	0.070	241	238	01.04.10	2.26	29.03.12	7.70	2 700	--	--/--/--
ФСК-1	100.30	-0.0053	6.84	-0.17	140	108		0.15	18.12.07	8.80	5 000	85.31	BB+/Baa2/--
ФСК-2	102.91	0.010	7.15	-0.56	98	95		2.39	22.06.10	8.25	7 000	16.46	BB+/Baa2/--
ФСК-3	100.24	-0.13	6.98	12.3	87	91		1.09	12.12.08	7.10	7 000	2.29	BB+/Baa2/--

Долговой инструмент	Цена	Изм. за день	Доходность	Изм. за день	Номинальный спрэд	Z спрэд	Дата oferty	Дюрация	Дата погашения	Ставка купона	Объем выпуска	Объем торгов	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/Fitch)
	% от номинала	п.п.	%	б.п.	б.п.	б.п.		лет		%	млн.руб.	млн.руб.	
Другие													
Автобан Инв	100.00	0.00	13.63	0.050	747	760		0.88	23.09.08	13.00	250	--	--/--/--
АиФ	99.77	0.070	13.44	-45.6	801	768	19.12.07	0.16	17.06.09	11.75	1 500	5.00	--/--/--
АСПЭК-1	99.36	2.86	13.34	-370.4	719	730	01.10.08	0.90	31.03.10	12.00	1 500	0.77	--/--/--
АЦБК-Инв-3	100.00	0.00	12.55	0.10	653	661	17.04.08	0.48	14.04.11	12.00	1 500	6.00	--/--/--
Востокцемент	99.75	0.00	15.35	10.4	989	969	22.11.07	0.08	19.11.09	12.00	800	--	--/--/--
Грейс-1	100.00	0.00	13.91	0.040	779	784	11.12.08	1.04	07.06.12	13.50	300	--	--/--/--
ДЗ-Фин	96.82	-0.100	17.59	23.8	1 136	1,162		0.56	23.05.08	11.00	400	--	--/--/--
Еврокоммерц-2	96.85	-0.049	15.33	11.6	911	935	12.06.08	0.62	10.06.10	9.49	3 000	--	--/B2/--
Искитим-2	100.05	0.050	11.57	-135.3	609	601	07.11.07	0.04	05.11.08	12.50	500	8.82	--/--/--
Концерн КАРО	99.85	0.00	13.07	0.17	686	708	24.06.08	0.64	22.12.09	12.50	700	--	--/--/--
Космос-1	99.05	0.30	13.15	-51.6	693	716	19.06.08	0.63	16.06.11	11.25	2 000	--	--/--/--
ЛР-Инвест-1	100.00	0.00	9.94	-0.020	388	381	21.07.09	1.66	17.07.12	10.00	500	--	--/--/--
Миннеско Новосиб	101.00	0.00	13.61	-0.050	751	744		1.84	10.12.09	13.75	500	--	--/--/--
МуниципИнвестКомп	98.14	-1.66	16.13	228.4	996	1,011	01.09.08	0.83	01.03.10	13.20	500	10.45	--/--/--
НЛК	98.00	0.00	21.03	8.11	1 563	1,518		0.27	31.01.08	12.45	500	0.20	--/--/--
РКС-1	100.00	0.00	10.45	-0.16	440	451	16.04.08	0.48	15.04.09	10.20	1 500	6.00	--/--/--
РыбКабЗав	100.00	-0.020	11.16	6.21	580	527	04.03.08	0.36	28.02.12	10.75	1 000	2.02	--/--/--
Салаватстекло	100.50	0.00	10.58	-1.05	497	466		0.42	25.03.08	11.60	750	--	--/--/--
Салаватстекло-2	100.00	0.00	10.76	0.19	467	460		1.79	28.10.09	9.28	1 200	--	--/--/--
СамарРезерЗавод	99.63	0.13	15.50	-96.2	1 005	975	13.12.07	0.14	10.12.09	12.50	600	6.91	--/--/--
Севкабель-2	99.75	0.00	13.25	5.19	779	753	04.12.07	0.12	28.11.08	10.50	1 000	--	--/--/--
Севкабель-3	99.38	-0.62	12.50	76.9	634	645	30.09.08	0.90	27.03.12	11.25	1 500	--	--/--/--
СЗЛК	97.75	0.060	14.83	-7.51	866	880	02.09.08	0.84	02.03.10	11.50	1 000	--	--/--/--
СибЦемент	101.00	0.00	8.19	-0.58	197	221		0.62	12.06.08	9.70	800	--	--/--/--
ТАИФ-1	97.52	-2.45	11.74	312.2	557	570	11.09.08	0.87	09.09.10	8.42	4 000	--	--/--/--
Терна-Фин-1	98.70	0.70	9.98	-495.4	454	422	18.12.07	0.15	16.12.08	1.00	500	--	--/--/--
Терна-Фин-2	99.90	-0.030	14.94	77.6	946	936	09.11.07	0.05	04.11.11	12.60	1 500	16.99	--/--/--
ТК Фин	100.00	-0.49	10.75	60.5	459	472		0.88	18.09.08	10.50	1 000	8.62	--/--/--
Томск-Инвест-1	99.00	0.00	14.28	0.40	813	823	23.10.08	0.93	22.04.10	12.50	500	--	--/--/--
Уникум	98.86	0.075	21.01	-41.5	1 557	1,525	18.12.07	0.15	15.12.09	12.50	1 000	--	--/--/--

* в качестве ККД (ключевой кривой доходности) используется кривая доходности ОФЗ

Доходность еврооблигаций

Долговой инструмент	Цена % от номинала	Изм. за день п.п.	Доходность к погашению / оферте %	Изм. за день б.п.	Дюрация лет	Спрэд к суверенной кривой доходности		Спрэд к КО США		Дата погашения	Ставка купона %	Объем выпуска млн.	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/Fitch)
						Номинальный б.п.	Z-спрэд б.п.	Номинальный б.п.	Z-спрэд б.п.				
Внешние российские суверенные долговые обяз.													
Agies 07	100.18	0.00	--	--	0.00	--	--	--	--	25.10.07	5.410	2 000 EUR	AAA/Aaa/--
Agies 09	106.01	0.0081	4.49	-0.79	1.93	--	--	--	--	25.10.09	7.750	1 000 EUR	AAA/Aaa/--
Agies 14	127.37	0.25	4.93	-3.82	5.47	-62	-65	77	74	25.10.14	9.600	2 436 USD	AAA/Aaa/--
МинФин-V	98.67	0.054	5.47	-9.15	0.54	28	24	134	138	14.05.08	3.000	2 837 USD	BBB+/Baa2/--
МинФин-VII	92.15	-0.011	5.42	0.55	3.36	8	3.35	150	154	14.05.11	3.000	1 750 USD	BBB+/Baa2/--
МинФин-VIII	99.88	0.021	6.21	-28.3	0.04	101	101	247	244	14.11.07	3.000	1 322 USD	BBB+/Baa2/BBB
Россия 10	104.16	-0.00027	5.16	-0.62	1.37	--	--	122	134	31.03.10	8.250	2 820 USD	BBB+/Baa2/BBB+
Россия 18	142.09	0.16	5.70	-1.68	7.12	--	--	137	124	24.07.18	11.000	3 466 USD	BBB+/Baa2/BBB+
Россия 28	180.25	0.089	5.95	-0.50	10.30	--	--	145	126	24.06.28	12.750	2 500 USD	BBB+/Baa2/BBB+
Россия 30	113.02	-0.11	5.65	1.43	7.00	--	--	133	118	31.03.30	7.500	18 400 USD	BBB+/Baa2/BBB+
Российские корпоративные еврооблигации													
Алроса 08	100.92	-0.013	6.33	1.57	0.51	114	110	219	222	06.05.08	8.125	500 USD	BB-/Ba2/--
Алроса 14	110.78	0.24	6.92	-4.14	5.30	139	134	278	273	17.11.14	8.875	500 USD	BB-/Ba2/--
ВБД ПП 08 (7.5%)	99.83	0.019	7.81	-3.35	0.54	262	258	368	372	14.05.08	7.500	150 USD	BB-/Ba3/--
ВБД ПП 08 (8.5%)	100.36	0.017	7.83	-3.23	0.55	265	260	371	377	21.05.08	8.500	150 USD	BB-/Ba3/--
Вымпелком 09	105.51	-0.0090	6.39	0.070	1.51	122	111	249	262	16.06.09	10.000	450 USD	BB+/Ba2/--
Вымпелком 10	103.47	0.14	6.34	-6.63	2.11	111	102	253	252	11.02.10	8.000	300 USD	BB+/Ba2/--
Вымпелком 11	105.52	0.16	6.77	-4.59	3.49	142	137	283	287	22.10.11	8.375	300 USD	BB+/Ba2/--
Вымпелком 16	104.61	0.30	7.51	-4.61	6.16	190	186	328	318	23.05.16	8.250	600 USD	BB+/Ba2/--
Газпром 09	109.20	0.027	5.55	-2.06	1.85	34	24	173	173	21.10.09	10.500	700 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 10 (EURO)	106.08	0.016	5.41	-0.78	2.71	--	--	--	--	27.09.10	7.800	1 000 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 12 (EURO)	94.13	-0.040	5.83	1.00	4.48	--	--	--	--	09.12.12	4.560	1 000 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 13-1	115.90	0.087	6.09	-1.92	4.34	66	61	206	208	01.03.13	9.625	1 750 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 13-2	97.49	0.15	5.56	-6.42	2.41	31	18	175	167	22.07.13	4.505	1 222 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 13-3	99.40	0.18	5.93	-8.97	1.98	71	56	211	205	22.07.13	5.625	646 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 14-1 (EURO)	94.48	-0.035	6.01	0.73	5.37	--	--	--	--	25.02.14	5.030	780 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 14-2 (EURO)	95.72	0.23	6.04	-4.11	5.87	--	--	--	--	31.10.14	5.364	700 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 15 (EURO)	98.03	0.051	6.11	-0.83	6.19	--	--	--	--	01.06.15	5.875	1 000 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 16	99.06	0.42	6.35	-6.26	6.88	67	66	204	196	22.11.16	6.212	1 350 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 17 (5.44) (EURO)	93.49	0.31	6.24	-4.28	7.62	--	--	--	--	02.11.17	5.440	500 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 17 (EURO)	91.87	0.022	6.21	-0.29	7.37	--	--	--	--	22.03.17	5.136	500 EUR	BBB/A3/BBB-
Газпром 20	103.23	0.24	6.33	-6.39	3.78	95	79	236	218	01.02.20	7.201	1 250 USD	BBB+/-/BBB
Газпром 22	99.13	0.34	6.60	-3.77	9.44	72	75	214	193	07.03.22	6.510	1 300 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 34	127.99	0.82	6.42	-5.40	11.99	40	90	186	174	28.04.34	8.625	1 200 USD	BBB/A3/BBB-
Газпром 37	106.88	0.90	6.75	-6.71	12.86	70	126	216	210	16.08.37	7.288	1 250 USD	BBB/A3/--
Газпромнефть 09	105.67	0.018	5.85	-2.52	1.15	69	58	186	211	15.01.09	10.750	500 USD	BB+/Ba1/--
Евраз 09	106.53	0.11	6.88	-6.85	1.63	170	159	301	309	03.08.09	10.875	300 USD	BB-/Ba3/BB
Евраз 15	101.85	0.37	7.93	-6.33	5.84	235	230	374	363	10.11.15	8.250	750 USD	BB-/Ba3/BB
Еврохим 12	97.94	0.28	8.44	-7.89	3.77	306	302	447	450	21.03.12	7.875	300 USD	BB/-/BB-
Казаньоргсинтез 11	99.78	0.095	9.32	-2.89	3.29	398	391	540	541	30.10.11	9.250	200 USD	B/-/B
Комтех 11	98.82	-0.0069	10.78	0.000060	1.51	559	548	692	704	19.06.11	10.000	150 USD	B/-/B
КузБасРазрезУголь 10	99.68	0.42	9.13	-17.8	2.41	387	378	531	530	12.07.10	9.000	200 USD	--/B3/--
Лукойл 17	96.64	0.62	6.84	-9.15	7.11	114	113	251	240	07.06.17	6.356	500 USD	BBB-/Baa2/BBB-
Лукойл 22	95.87	0.81	7.11	-9.29	9.20	125	126	265	244	07.06.22	6.656	500 USD	BBB-/Baa2/BBB-
МегаФон 09	102.65	0.12	6.63	-6.19	1.94	142	132	282	282	10.12.09	8.000	375 USD	BB/Ba3/BB+
ММК 08	101.44	0.018	6.47	-2.42	0.97	130	122	244	275	21.10.08	8.000	300 USD	BB/Ba2/BB
МТС 08	100.96	-0.034	5.93	9.35	0.26	73	71	189	189	30.01.08	9.750	400 USD	BB-/Ba2/--
МТС 10	104.60	0.27	6.64	-10.1	2.69	136	129	279	281	14.10.10	8.375	400 USD	BB-/Ba2/--
МТС 12	103.69	0.28	6.98	-7.58	3.64	161	156	302	305	28.01.12	8.000	400 USD	BB-/Ba2/--
НКНХ 15	98.35	0.100	9.11	-0.00037	2.75	382	374	525	526	22.12.15	8.500	200 USD	--/B1/B+
НМТП 12	97.75	0.12	7.59	-3.29	3.85	220	215	361	363	17.05.12	7.000	300 USD	BB+/Ba1/--
НорНикель 09	102.48	0.016	5.74	-1.03	1.83	54	44	192	194	30.09.09	7.125	500 USD	BBB-/Baa2/BBB-
Распадская 12	98.23	0.27	7.97	-7.32	3.82	258	253	399	401	22.05.12	7.500	300 USD	--/Ba3/B+
Рольф 10	97.36	0.16	9.38	-6.95	2.39	413	404	556	556	28.06.10	8.250	250 USD	BB-/Ba3/--
Северсталь 09	102.42	0.019	6.67	-1.89	1.27	152	140	272	293	24.02.09	8.625	325 USD	BB/Ba2/BB-
Северсталь 14	108.23	0.44	7.62	-8.39	5.07	211	207	350	350	19.04.14	9.250	375 USD	BB/Ba2/BB-
Северстальтранс 10	99.20	0.077	9.01	-0.00050	1.54	384	373	512	524	22.06.10	8.500	175 USD	--/Ba3/--
Синек 15	103.29	-0.0098	6.88	0.000019	4.03	147	143	287	290	03.08.15	7.700	250 USD	--/Ba1/BB+
Система 08	101.51	0.067	6.90	-16.6	0.47	172	168	277	277	14.04.08	10.250	350 USD	B+/-/BB-
Система 11	104.86	0.35	7.17	-12.1	2.85	187	180	330	332	28.01.11	8.875	350 USD	B+/-/BB-
ТМК 09	101.95	0.037	7.39	-2.25	1.81	219	209	356	359	29.09.09	8.500	300 USD	BB-/Ba3/--
ТНК-ВР 07	100.20	0.13	3.58	-475.6	0.03	-162	-162	-15	-16	06.11.07	11.000	400 USD	BB+/Ba2/BBB-
ТНК-ВР 12	95.42	0.28	7.36	-7.76	3.89	196	193	337	341	20.03.12	6.125	500 USD	BB+/Ba2/BBB-
ТНК-ВР 17	91.66	0.67	7.90	-10.9	6.98	221	220	358	349	20.03.17	6.625	800 USD	BB+/Ba2/BBB-
ТНК-ВР 11	98.82	0.24	7.24	-7.55	3.29	190	184	332	335	18.07.11	6.875	500 USD	BB+/Ba2/BBB-
ТНК-ВР 13	100.48	0.55	7.39	-12.5	4.51	194	190	333	337	13.03.13	7.500	600 USD	BB+/Baa2/BBB-
ТНК-ВР 16	97.57	0.63	7.89	-10.3	6.40	225	223	363	354	18.07.16	7.500	1 000 USD	BB-/Ba2/BBB-
ТНК-ВР 18	99.56	0.72	7.94	-10.4	7.24	223	222	360	348	13.03.18	7.875	1 100 USD	BB+/Baa2/BBB-
Транснефть 12	100.01	0.29	6.10	-7.21	4.05	69	66	209	213	27.06.12	6.103	500 USD	BBB+/A2/--
Транснефть 12 (EURO)	98.62	0.016	5.64	-0.38	4.18	--	--	--	--	27.06.12	5.381	700 EUR	BBB+/A2/--
Транснефть 14	96.38	0.39	6.37	-7.64	5.36	83	82	222	225	05.03.14	5.670	1 300 USD	BBB+/A2/--
Центр-Инвест 09	97.29	-0.46	11.08	36.7	1.37	592	580	715	732	03.04.09	9.000	175 USD	--/B1/--
Российские банковские еврооблигации													
Абсолют Банк 09	102.54	0.030	6.87	-2.50	1.39	172	160	294	312	07.04.09	8.750	200 USD	--/Baa3/A-
Абсолют Банк 10	104.08	0.10	7.26	-4.81	2.22	202	193	344	344	30.03.10	9.125	175 USD	--/Baa3/A-
АК Барс Банк 08	99.45	0.033	8.59	-3.18	0.95	342	333	455	488	27.10.08	8.000	175 USD	--/Ba2/B+
АК Барс Банк 10	97.67	0.14	9.24	-6.10	2.39	399	391	543	542	28.06.10	8.250	250 USD	BB-/Ba2/BB-
АльфаБанк 08	99.76	0.11	8.09	-16.4	0.66	292	286	399	412	02.07.08	7.750	250 USD	BB/Ba1/BB-
АльфаБанк 09	98.30	0.094	8.84	-5.29	1.84	364	354	502	503	10.10.09	7.875	400 USD	BB/Ba1/BB-
АльфаБанк 12	95.55	0.35	9.40	-9.77									

Долговой инструмент	Цена	Изм. за день	Доходность к погашению / оферте	Изм. за день	Дюрация	Спрэд к суверенной кривой доходности		Спрэд к КО США		Дата погашения	Ставка купона	Объем выпуска	Кредитный рейтинг (S&P/Moody's/Fitch)
						Номинальный	Z-спрэд	Номинальный	Z-спрэд				
	% от номинала	п.п.	%	б.п.	лет	б.п.	б.п.	б.п.	б.п.	%	млн.		
Банк Москвы 09	103.66	0.96	5.95	-52.7	1.81	75	65	212	214	28.09.09	8.000	250 USD	--/Baa2/BBB
Банк Москвы 10	101.62	0.29	6.78	-10.4	2.73	150	142	293	294	26.11.10	7.375	300 USD	--/Baa2/BBB
Банк Москвы 13	98.95	0.28	7.57	-6.41	4.50	211	207	351	353	13.05.13	7.335	500 USD	--/A3/BBB
Банк Москвы 15	99.11	0.019	7.83	-0.00064	2.72	254	247	397	399	25.11.15	7.500	300 USD	--/A3/BBB-
Банк Москвы 17	94.42	-0.058	8.31	0.00017	3.83	292	287	433	435	10.05.17	6.807	400 USD	--/Baa1/BBB-
Банк Санкт-Петербург 09	98.82	0.046	10.14	-2.46	1.86	494	483	632	633	25.11.09	9.501	125 USD	--/Ba3/B
Банк Союз 10	95.50	-0.026	11.64	1.59	2.09	642	632	783	782	16.02.10	9.375	125 USD	B-/B1/--
БИН Банк 09	97.79	-0.46	11.07	33.3	1.43	591	579	715	731	18.05.09	9.500	200 USD	B-/--/B-
ВТБ 08	100.83	0.031	6.10	-3.03	1.08	93	84	209	237	11.12.08	6.875	550 USD	BBB/A2/BBB+
ВТБ 11	104.52	0.24	6.19	-6.87	3.50	84	79	225	229	12.10.11	7.500	450 USD	BBB/A2/BBB+
ВТБ 15	101.30	0.065	5.69	-0.00031	2.12	47	37	188	188	04.02.15	6.315	750 USD	BBB+/A2/BBB+
ВТБ 16 (EURO)	95.14	-0.00083	5.82	0.000015	3.06	--	--	--	--	15.02.16	4.250	500 EUR	BBB+/A2/BBB+
ВТБ 35	98.83	0.31	6.34	-2.45	13.15	28	87	174	167	30.06.35	6.250	1 000 USD	BBB+/A2/BBB+
ГазпромБанк 08	100.93	0.012	6.29	-1.54	0.96	112	103	226	257	30.10.08	7.250	1 050 USD	BB+/A3/--
ГазпромБанк 11	102.75	0.071	7.10	-2.29	3.15	177	171	319	321	15.06.11	7.970	300 USD	BB+/A3/--
ГазпромБанк 15	96.39	0.32	7.10	-5.55	6.23	148	147	286	280	23.09.15	6.500	1 000 USD	BBB-/A3/--
Кредит Европа 08	100.44	0.034	7.47	-3.26	1.07	231	222	347	375	12.12.08	7.900	250 USD	--/Ba1/--
МБРР 08	99.91	-0.026	8.84	7.64	0.35	365	363	477	476	03.03.08	8.625	150 USD	--/B1/B+
МБРР 09	98.85	0.031	9.54	-1.97	1.55	437	425	565	576	29.06.09	8.800	100 USD	--/B1/B+
МБРР 16	95.00	0.00	10.67	0.000011	2.94	537	530	679	681	10.03.16	8.875	60 USD	--/B2/B+
МДМ Банк 07	99.87	0.0031	8.54	-0.13	0.11	334	333	469	468	07.12.07	7.500	250 USD	BB/Ba1/BB
МДМ Банк 10	97.69	0.12	8.91	-6.19	2.06	369	359	509	509	25.01.10	7.765	425 USD	BB/Ba1/BB
МДМ Банк 11	101.09	0.36	9.39	-11.7	3.15	406	400	549	550	21.07.11	9.750	200 USD	BB/Ba1/BB
МежПромБанк 10 (9.5%)	98.00	0.11	10.49	-5.35	2.08	526	517	667	667	12.02.10	9.500	150 USD	B+/B1/B
МКБ 09	98.87	0.00023	10.89	0.010	1.84	569	559	707	708	21.10.09	10.250	100 USD	--/B1/B-
МНБ 08	98.93	0.034	5.99	-4.53	0.67	82	76	190	202	30.06.08	4.375	150 USD	--/Baa2/BBB
Номос 09	98.38	0.34	9.39	-24.1	1.43	423	411	547	563	12.05.09	8.250	150 USD	--/Ba3/B+
Номос 10	96.54	-0.083	9.92	4.44	2.07	470	460	611	610	02.02.10	8.188	200 USD	--/Ba3/B+
Номос 16	98.00	0.32	10.38	-0.0010	3.38	503	497	645	647	20.10.16	9.750	125 USD	--/B1/B+
Петрокоммерц 09 (8%)	97.94	0.019	9.58	-1.20	1.36	442	430	564	582	27.03.09	8.000	225 USD	B+/Ba3/--
Петрокоммерц 09 (8.75%)	97.83	0.066	9.89	-3.38	1.94	468	457	607	607	17.12.09	8.750	425 USD	B+/Ba3/--
Промсвязьбанк 10	97.83	-0.0081	9.36	0.41	2.65	408	400	551	553	04.10.10	8.500	200 USD	B+/Ba3/B+
Промсвязьбанк 11	96.78	0.17	9.74	-5.37	3.43	439	434	581	584	20.10.11	8.750	225 USD	B+/B1/B-
Промсвязьбанк 12	97.74	-0.0013	10.25	0.070	3.65	488	482	629	630	23.05.12	9.625	200 USD	B-/B1/B-
Промстройбанк 08	100.64	0.088	5.99	-12.2	0.74	81	75	190	208	29.07.08	6.875	300 USD	--/A2/BBB+
Промстройбанк 15	98.85	-0.26	6.64	0.00099	2.71	135	128	278	280	29.09.15	6.200	400 USD	--/A3/BBB
Ренессанс 08	101.10	0.046	6.86	-5.08	0.95	169	160	283	314	31.10.08	8.000	100 USD	BB-/Ba3/BB-
Ренессанс 09	97.25	0.40	10.26	-22.5	1.85	506	495	644	645	17.11.09	8.750	250 USD	BB-/Ba3/BB-
Ренессанс 10	92.59	0.18	12.84	-8.41	2.34	759	750	903	902	27.06.10	9.500	300 USD	BB-/Ba3/BB-
Рос.БанкРазвит. 08	100.08	0.27	6.38	-35.9	0.78	121	114	231	250	11.08.08	6.500	170 USD	BBB/Baa2/--
Росбанк 09	102.17	0.10	7.66	-10.8	1.01	249	239	364	385	24.09.09	9.750	300 USD	BB-/Ba2/BB-
РСХБ 10	101.55	0.13	6.31	-4.72	2.76	103	95	246	247	29.11.10	6.875	350 USD	--/Baa2/BBB+
РСХБ 13	103.39	0.26	6.44	-5.49	4.56	98	94	238	240	16.05.13	7.175	700 USD	--/A3/BBB+
РСХБ 16	99.43	0.26	7.14	-0.00076	3.46	178	173	320	323	21.09.16	6.970	500 USD	--/--/BBB+
РСХБ 17	95.31	0.54	6.98	-8.08	7.05	128	128	266	255	15.05.17	6.299	1 250 USD	BBB+/A3/BBB+
Рус.Стандарт 08	99.54	-0.074	9.10	16.4	0.49	391	387	496	496	21.04.08	8.125	300 USD	BB-/Ba2/BB-
Рус.стандарт 09 (EURO)	95.30	0.042	9.42	-2.15	1.83	--	--	--	--	16.09.09	6.825	400 EUR	BB-/Ba2/BB-
Рус.Стандарт 10 (7.5%)	93.09	-0.086	10.27	3.82	2.68	499	492	643	644	07.10.10	7.500	500 USD	BB-/Ba2/BB-
Рус.Стандарт 10 (8.485%)	94.70	0.063	10.81	-2.62	2.38	556	547	699	698	29.06.10	8.485	400 USD	BB-/Ba2/BB-
Рус.Стандарт 11	94.57	0.31	10.51	-10.8	2.97	520	512	662	663	05.05.11	8.625	350 USD	BB-/Ba2/BB-
Рус.Стандарт 15	91.42	0.13	12.24	-0.00051	2.70	696	688	839	840	16.12.15	8.875	200 USD	BB-/Ba2/BB-
Рус.Стандарт 16	93.70	0.79	11.72	-0.0026	3.31	638	631	780	781	01.12.16	9.750	200 USD	BB-/Ba2/BB-
Сбербанк 11	100.07	0.34	5.91	-9.49	3.57	54	50	196	199	14.11.11	5.930	750 USD	--/A2/BBB+
Сбербанк 13	101.58	0.31	6.14	-6.71	4.63	67	64	207	210	15.05.13	6.480	500 USD	--/A2/BBB+
Сбербанк 15	100.33	0.095	6.07	-0.00045	2.15	84	75	225	225	11.02.15	6.230	1 000 USD	--/A2/BBB+
Славинвест 09	96.36	0.042	11.82	-2.04	1.93	661	650	800	800	21.12.09	9.875	100 USD	--/B1/B
Татфондбанк 10	98.50	0.21	10.45	-9.52	2.28	520	511	663	662	26.04.10	9.750	200 USD	--/B2/--
Транскапитал 10	96.30	0.18	10.83	-8.19	2.22	559	550	701	701	10.05.10	9.125	175 USD	--/B1/--
Транскапитал 17	92.43	0.10	12.60	-0.00029	3.80	722	715	863	863	18.07.17	10.514	100 USD	--/B2/--
ТрансКредитБанк 10	97.45	0.15	8.12	-6.53	2.31	287	279	430	430	16.05.10	7.000	400 USD	BB-/Ba3/--
Траст ИБ 09	94.06	0.68	12.80	-42.3	1.81	760	749	897	899	05.10.09	9.250	150 USD	--/--/B-
УРСА Банк 08	100.21	0.019	9.34	-3.41	0.54	416	411	521	527	19.05.08	9.750	175 USD	--/Ba3/B
УРСА Банк 09	97.58	0.0046	10.73	-0.030	1.42	557	545	681	697	12.05.09	9.000	351 USD	--/Ba3/B
УРСА Банк 11 (12.0%)	100.70	0.28	11.77	-8.64	3.29	643	636	785	785	30.12.11	12.000	130 USD	--/Ba3/B
УРСА Банк 11 (8.3%) (EURO)	92.22	0.12	10.48	-3.64	3.32	--	--	--	--	16.11.11	8.300	300 EUR	--/Ba3/B
ХКФБ 08 (8.625%)	99.47	0.061	9.41	-9.15	0.66	424	418	531	544	30.06.08	8.625	275 USD	B/Ba3/--
ХКФБ 08 (9.125%)	99.92	0.16	9.31	-61.4	0.27	412	410	527	527	04.02.08	9.125	150 USD	B/Ba3/--
ХКФБ 10	99.52	0.059	9.63	-2.71	2.16	440	430	581	580	11.04.10	9.500	200 USD	B/Ba3/--
CLN													
АвтоВАЗ 08	99.67	0.12	9.21	-25.5	0.48	402	398	508	507	20.04.08	8.500	250 USD	--/--/--
Дон Строй 10	101.35	0.00	8.59	-0.000026	0.95	342	334	456	488	03.11.10	10.000	150 USD	--/--/--
Интер РАО 08	100.00	0.00	7.71	0.060	0.38	253	249	363	362	12.03.08	7.750	150 USD	--/--/--
Иркут 09	99.65	-0.23	8.50	16.8	1.40	334	322	457	474	10.04.09	8.250	125 USD	--/Ba1/--
ИСД 10	97.00	0.00	10.47	0.090	2.59	519	511	663	663	23.09.10	9.250	150 USD	--/B1/B+
Миракс 08	98.75	0.00	13.43	2.84	0.34	824	821	936	935	27.02.08	9.700	100 USD	--/B2/B
Нутритэк 07	100.00	0.00	10.27	0.020	0.10	507	507	645	643	30.11.07	10.500	100 USD	B/--/--
Ритэо 10	95.75	0.00	11.84	0.15	2.40	659	650	802	801	25.07.10	10.000	280 USD	--/B3/--
САНОС 08	100.00	0.00	8.73	0.13	0.54	354	350	470	475	12.05.08	8.750	50 USD	--/--/--
САНОС 09	98.38	0.00	9.05	0.21	1.49	388	376	514	527	28.05.09	7.950	100 USD	--/--/--
СУЭК 08	100.90	0.51	7.67	-54.1	0.97	250	242	364	396	24.10.08	8.625	175 USD	--/--/--
Фуршет 09	100.00	0.00	10.26	0.000017	0.06	506	505	658	658	07.11.09	10.500	75 USD	--/--/--

Календарь

Дата	Событие	Влияние на ликвидность, млн руб.
24.10.2007	Выплата купона по облигациям ОФЗ 25057	753.0
	Выплата купона по облигациям МО-7	638.2
	Выплата купона по облигациям ОФЗ 25059	623.5
	Выплата купона и погашение облигаций Иркутская обл.-4	201.5
	Выплата купона по облигациям Ленэнерго-3	120.0
	Выплата купона и погашение облигаций ЮПК-Финанс-1	104.9
	Выплата купона по облигациям Самохвал	85.3
	Выплата купона по облигациям КД Авиа-1	64.8
	Выплата купона и оферта на выкуп по облигациям Уральский лизинговый центр-1	57.3
	Выплата купона по облигациям Синергия	53.4
	Выплата купона по облигациям МГТС-4	53.1
	Выплата купона по облигациям Интурист-1	44.9
	Выплата купона по облигациям Арнест Финанс-1	28.7
	Выплата купона по облигациям Белгородская область-4	21.0
25.10.2007	Аукционное доразмещение ОБР-3 Банком России	5 000.0
	Выплата купона по облигациям ВТБ-5	220.7
	Выплата купона по облигациям ОГК 6-1	188.3
	Выплата купона и погашение облигаций ЛенСпецСМУ-1	156.1
	Выплата купона по облигациям Содружество-Финанс-1	130.3
	Выплата купона по облигациям Группа Джей Эф Си-1	92.2
	Выплата купона по облигациям Нижегород. обл.-3	86.8
	Выплата купона по облигациям СОК-Автокомпонент-1	65.8
	Выплата купона по облигациям Пивдом-1	64.8
	Выплата купона по облигациям Якутия-7	48.6
	Выплата купона по облигациям Связь-Банк-1	44.4
	Выплата купона по облигациям Акибанк-1	34.7
	Выплата купона по облигациям Жилсоципотека	34.4
	Выплата купона по облигациям Белазкомплект Плюс	31.4
	Выплата купона по облигациям Магнолия-1	29.8
	Выплата купона по облигациям УРСА Банк-6	28.6
	Выплата купона по облигациям Банк Союз-1	23.1
	Выплата купона по облигациям МЛК-Финанс	17.7
	Выплата купона по облигациям Томск-Инвест-1	15.6
	Уплата акцизов и НДС	--
26.10.2007	Выплата купона и погашение облигаций Москва-40	5 126.0
	Выплата купона и погашение облигаций Евросервис Финанс-1	639.9
	Выплата купона по облигациям Сибирьтелеком-5	137.6
	Выплата купона и оферта на выкуп по облигациям Яковлевский	59.8
	Выплата купона по облигациям Банана-Мама	56.1
	Выплата купона по облигациям Рус.Межд.Банк	55.2
	Выплата купона по облигациям УралХимКомп	13.1
28.10.2007	Выплата купона по облигациям Москва-47	252.1
29.10.2007	Выплата купона по облигациям Славинвестбанк-2	40.4
	Уплата налога на прибыль организаций	--
30.10.2007	Оферта на выкуп по облигации Банана-Мама	--
	Оферта на выкуп по облигации Рубин	--

Планируемые выпуски

Время размещения	Выпуск	Срок обращения, лет	Объем, млн руб.
19 ноября	Электроника АКБ-2	3	500.0
ноябрь	ВТБ Лизинг Финанс	7	8 000.0
2007	АвиаБалт-1	3	1 000.0
2007	Агама Трэйд-1	3	1 000.0
2007	Агрика Продукты Питания-2	3	2 000.0
2007	АК Барс Банк-3	3	3 000.0
2007	АК Барс Банк-4	5	5 000.0
2007	Арка-Финанс-1	5	1 000.0
2007	Банк Авангард	3	1 000.0
2007	Банк Возрождения-2	3	5 000.0
2007	Банк Казанский-6	3	10 000.0
2007	Банк Казанский-6	3	1 000.0
2007	Банк Москвы-2	5	10 000.0
2007	Банк Москвы-3	10	10 000.0
2007	Банк Российский Капитал	2	500.0
2007	Банк Солидарность-3	3	1 500.0
2007	ВИМ-Авиа-1	5	2 000.0
2007	ВКМ-Лизинг Финанс	3	1 000.0
2007	ВСП Инвест-1	5	5 000.0
2007	Вулкан Финанс	-	1 000.0
2007	ВымпелКом-Инвест-1	5	10 000.0
2007	ВымпелКом-Инвест-2	5	5 000.0
2007	Глобэкс-Финанс	3	4 000.0
2007	Голдер-Электроникс	3	1 000.0
2007	Дальневосточный Банк-1	3	1 500.0
2007	Дело-Центр	3	1 500.0
2007	ЕБРР-3	3-5	5 000.0
2007	Европлан-1	3	2 000.0
2007	Европлан-2	3	2 500.0
2007	Екатеринбургский мясокомбинат	3	500.0
2007	Желдорипотека-1	3	1 500.0
2007	Желдорипотека-2	4	2 500.0
2007	Запсибкомбанк	3	1 500.0
2007	Зерновая компания Настюша-2	3	1 000.0
2007	ИВИ-Финанс	3	1 000.0
2007	ИКС 5-3	7	8 000.0
2007	ИнвестКапиталБанк-1	2	500.0
2007	Инвестсбербанк	3.5	1 200.0
2007	Интер РАО ЕЭС	10	10 000.0
2007	Итера-Финанс-1	5	5 000.0
2007	КААД-3	6	3 000.0
2007	КамаБанк	2	500.0
2007	Камаз-Финанс-3	5	6 500.0
2007	Кировская область	-	1 500.0
2007	Кировский завод-2	3	1 500.0
2007	КИТ Финанс-3	3	5 000.0
2007	КИТ Финанс-4	5	3 000.0
2007	Комин-Финанс-1	3	2 500.0
2007	Корпорация Строймонтаж-1	3	1 200.0
2007	Кортон-Финанс	3	3 000.0
2007	Космос-Групп-1	3	2 000.0
2007	Красноярский край-4	5	5 000.0
2007	Кредит Европа Банк-2	3	4 000.0
2007	Кредит Европа Банк-3	3	4 000.0
2007	КЧХК-Финанс-1	3	3 000.0
2007	КЧХК-Финанс-2	3	3 500.0
2007	Лаверна-2	5	1 500.0
2007	Леноблгаз-Финанс-1	3	1 000.0
2007	Ливиз-Финанс	3	600.0
2007	Линкор	3	1 000.0
2007	ЛЭКстрой-1	3	1 500.0
2007	ЛЭКстрой-2	3	2 500.0
2007	Матрица-2	3	2 000.0
2007	МБРР	5	3 000.0
2007	МБРР-2	5	3 000.0
2007	МБРР-3	5	3 000.0
2007	МДМ-Банк-4	5	4 000.0
2007	МДМ-Банк-5	5	4 000.0
2007	Межпромбанк-1	10	3 000.0
2007	Метрострой Инвест-2	5	2 500.0
2007	Минеральные удобрения	-	950.0
2007	Мир-Финанс-2	5	3 000.0
2007	Мосинжстрой	3	3 000.0
2007	Москва-45	-	15 000.0
2007	Москва-46	-	10 000.0
2007	Московская лизинговая компания	3	550.0
2007	Московская областная инвестиционная трасовая компания-2	4	4 000.0
2007	Московская областная инвестиционная трасовая компания-3	3	3 000.0
2007	Московская объединенная электросетевая компания	5	8 300.0
2007	Московская топливная компания	-	750.0
2007	Московский Залоговый Банк-2	3	1 500.0
2007	Мособлгаз-1	4	2 500.0
2008	Мособлтрастинвест-3	3	3 000.0
2007	Мострансавто-Финанс-1	5	7 500.0
2007	МТС-1	5	10 000.0
2007	МТС-2	7	10 000.0
2007	МТС-3	10	10 000.0
2007	Нижне-Ленское-Инвест-3	5	1 000.0
2007	Нижновэнерго	5	2 000.0
2007	Новая перевозочная компания Финанс	-	1 500.0
2007	Новосибирск-4	5-7	1 500.0
2007	Номос-Банк-8	3	3 000.0
2007	НФК-Банк	3	1 000.0
2007	Пензенская область-2	3	1 000.0
2007	Первый республиканский банк-1	3	700.0
2007	Петрокоммерц Банк-3	5	5 000.0

Время размещения	Выпуск	Срок обращения, лет	Объем, млн руб.
2007	Петрокоммерц Банк-4	3	3 000.0
2007	Пивоварня Москва-Эфес-1	3	6 000.0
2007	Пробизнесбанк LPN	3	3 000.0
2007	ПТПА-Финанс-2	5	1 000.0
2007	ПЭБ Лизинг-2	5	500.0
2007	Реалтэкс-финанс-1	3	1 500.0
2007	Ренессанс Капитал Банк-2	4	3 000.0
2007	Ренессанс Капитал Банк-3	4	4 000.0
2007	РИГрупп-2	3	1 500.0
2007	Роснефть-1	5	15 000.0
2007	Роснефть-2	5	15 000.0
2007	Роснефть-3	7	15 000.0
2007	Российские Коммунальные Системы-2	3	2 500.0
2007	Рос-Финанс	3	3 000.0
2007	Руснефть-2	5	7 000.0
2007	Руснефть-3	7	7 000.0
2007	СанвэйГрупп-2	4	1 500.0
2007	Связь-Банк-1	4	2 000.0
2007	Связь-Банк-2	3	3 000.0
2007	Северная Казна Банк-2	3	1 500.0
2007	Сенатор	5	1 000.0
2007	Сибкадеминвест-2	6	2 000.0
2007	Сибирский Берег-Финанс-1	5	1 500.0
2007	Синтерра-1	5	3 000.0
2007	Славинвестбанк-3	3	5 000.0
2007	Славинвестбанк-4	5	5 000.0
2007	Славинвестбанк-5	5	3 000.0
2007	Сорус Капитал-2	4	1 500.0
2007	СУИхолдинг-1	3	1 300.0
2007	ТД Перекресток	-	9 000.0
2007	Тинькофф-Инвест	3	1 000.0
2007	Трансгарант	4	3 000.0
2007	ТрансКонтейнер-1	5	5 000.0
2007	УРСА Банк-8	7	10 000.0
2007	Хендэ-Финанс-1	4	1 000.0
2007	ХКФБ-5	5	4 000.0
2007	Центр-Капитал	2	1 000.0
2007	ЧТПЗ-2	5	7 000.0
2007	ЧТПЗ-3	7	8 000.0
2007	Эталонбанк	3	1 500.0
2007	Эфирное-2	4	1 500.0
2007	Юниаструм Банк-3	5	2 000.0

Ключевые доходности рублевых облигаций

Уровень доходности на кривой ОФЗ

Дюрация	Текущая	1 мес. назад	6 мес. назад	Инструмент	Погашение	Доходность	Дюрация
1 год	6.06%	6.35%	5.56%	ОФЗ 28002	12.03.2008	5.35%	0.39
2 года	6.16%	6.46%	5.90%	ОФЗ 25058	30.04.2008	6.24%	0.51
3 года	6.23%	6.52%	6.09%	ОФЗ 25060	29.04.2009	6.04%	1.44
4 года	6.27%	6.56%	6.22%	ОФЗ 25061	05.05.2010	6.17%	2.35
5 лет	6.31%	6.58%	6.31%	ОФЗ 25059	19.01.2011	6.26%	2.92
6 лет	6.34%	6.59%	6.38%	ОФЗ 26199	11.07.2012	6.31%	4.13
7 лет	6.36%	6.60%	6.42%	ОФЗ 46017	03.08.2016	6.36%	6.20
8 лет	6.38%	6.62%	6.45%	ОФЗ 46021	08.08.2018	6.43%	7.43
9 лет	6.42%	6.63%	6.47%	ОФЗ 46018	24.11.2021	6.47%	8.38
10 лет	6.46%	6.64%	6.48%	ОФЗ 46020	06.02.2036	6.86%	12.7
11 лет	6.49%	6.65%	6.50%				
12 лет	6.50%	6.67%	6.52%				
13 лет	6.52%	6.64%	6.56%				
14 лет	6.53%	6.61%	6.62%				

Уровень доходности на московской кривой

Дюрация	Текущая	1 мес. назад	6 мес. назад	Инструмент	Погашение	Доходность	Дюрация
1 год	5.58%	5.90%	5.69%	Мос-47	28.04.2009	5.96%	1.40
2 года	6.22%	6.20%	5.98%	Мос-41	30.07.2010	6.43%	2.47
3 года	6.42%	6.48%	6.15%	Мос-38	26.12.2010	6.31%	2.74
4 года	6.42%	6.65%	6.27%	Мос-39	21.07.2014	6.27%	5.23
5 лет	6.33%	6.75%	6.36%	Мос-44	24.06.2015	6.53%	5.73
6 лет	6.27%	6.80%	6.44%				
7 лет	6.38%	6.83%	6.52%				

ЗАО «Ренессанс Капитал», 125009, Москва, Вознесенский пер. 22

© 2007 ЗАО «Ренессанс Капитал» (далее «РК»). Все права защищены. Настоящая публикация носит исключительно информационный характер и не является предложением о продаже или попыткой со стороны РК купить или продать какие-либо ценные бумаги, на которые в публикации может содержаться ссылка, или предоставить какие-либо инвестиционные рекомендации или услуги. Такие предложения могут быть сделаны исключительно в соответствии с применимым законодательством. Прошлая доходность не является показателем доходности инвестиций в будущем. Настоящая публикация основана на информации, которую мы считаем надежной, однако мы не утверждаем, что все приведенные сведения абсолютно точны. Мы не несем ответственности за использование клиентами информации, содержащейся в настоящей публикации, а также за операции с ценными бумагами, упоминающимися в ней. Мы не берем на себя обязательство регулярно обновлять информацию, которая содержится в настоящей публикации или исправлять возможные неточности. РК и его аффилированные лица, директора, партнеры и сотрудники, в том числе лица, участвующие в подготовке и выпуске этого материала, имеют право покупать и продавать упоминающиеся в материале ценные бумаги и производные инструменты от них. На ценные бумаги номинированные в иностранной валюте могут оказывать влияние обменные курсы валют, изменение которых может вызвать снижение стоимости инвестиций в эти активы. Инвестирование в российские ценные бумаги несет значительный риск и инвесторы должны проводить собственное исследование надежности эмитентов.

ЗАО «Ренессанс Капитал» обладает следующими лицензиями профессионального участника рынка ценных бумаг Российской Федерации:

брокерская деятельность - лицензия от 12.07.2001 г. №177-05370-100000

дилерская деятельность - лицензия от 12.07.2001 г. №177-05386-010000

депозитарная деятельность - лицензия от 11.07.2001 г. №177-05399-000100

Раскрытие информации

Подтверждение аналитиков и отказ от ответственности

Настоящий отчет подготовлен аналитиком (ами), чье имя (чьи имена) указано (ы) на титульном листе настоящего отчета с целью предоставления справочной информации о компании или компаниях (собираетельно «Компания») и ценных бумаг, являющихся предметами настоящего отчета. Каждый аналитик подтверждает, что все позиции, изложенные в настоящем отчете в отношении какой-либо ценной бумаги или эмитента, точно отражают личные взгляды этого аналитика касательно любого анализируемого эмитента/ценной бумаги.

Любые рекомендации или мнения, представленные в настоящем отчете, являются суждением на момент публикации настоящего отчета. Настоящий отчет был подготовлен независимо от Компании, и любые рекомендации и мнения, представленные в настоящем отчете, отражают исключительно точку зрения аналитика. При всей осторожности, соблюдаемой для обеспечения точности изложенных фактов, справедливости и корректности представленных рекомендаций и мнений, ни один из аналитиков, Компания, ее директора и сотрудники не устанавливали подлинность содержания настоящего отчета и, соответственно, ни один из аналитиков, Компания, ее директора и сотрудники не несут какой-либо ответственности за содержание настоящего отчета, в связи с чем информация, представленная в настоящем отчете, не может считаться точной, справедливой и полной.

Ни одно лицо не несет какой-либо ответственности за какие-либо потери, возникшие в результате какого-либо использования настоящего отчета или его содержания, либо возникшие в какой-либо связи с настоящим отчетом. Каждый аналитик и/или связанные с ними лица мог предпринять действия в соответствии либо использовать информацию, содержащуюся в настоящем отчете, а также результаты аналитической работы, на основании которых составлен настоящий отчет, до его публикации. Информация, представленная в настоящем документе, не может служить основанием для принятия инвестиционных решений любым его получателем или иным лицом в отношении ценных бумаг Компании. Настоящий отчет не является оценкой стоимости бизнеса Компании, ее активов либо ценных бумаг для целей, предусмотренных законодательством Российской Федерации и иных стран СНГ в сфере деятельности по оценке стоимости.

Каждый аналитик подтверждает, что никакая часть полученного вознаграждения не была, не является и не будет связана прямо или косвенно с определенной рекомендацией (ями) или мнением (ями), представленными в данном отчете. Вознаграждение аналитикам определяется в зависимости от деятельности и услуг, направленных на обеспечение выгоды инвесторам, являющимся клиентами Renaissance Securities (Cyprus) Limited, RenCap Securities, Inc., Renaissance Capital Limited, а также дочерних компаний («Фирма»). Как и все сотрудники Фирмы, аналитики получают вознаграждение в зависимости от рентабельности деятельности Фирмы, которая включает выручку от ведения прочих видов деятельности подразделениями Фирмы.

Каждый аналитик, аффилированные компании либо иные лица являются или могут являться членами группы андеррайтеров в отношении предлагаемых к продаже ценных бумаг Компании. Каждый аналитик имеет право в будущем участвовать в публичном выпуске ценных бумаг Компании.