

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный Обзор

Корпоративные новости:

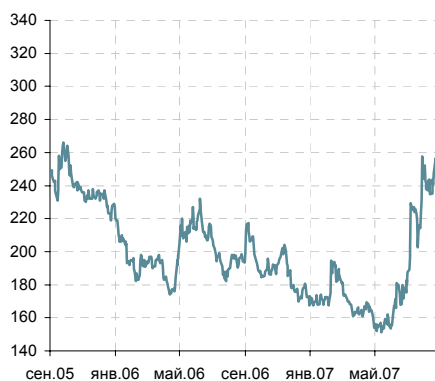
X5 – выборочные результаты первого полугодия 2007 г. // *Подробнее стр. 3 /*

ЮТК – результаты первого полугодия 2007 г. // *Подробнее стр. 3 /*

Оглавление:

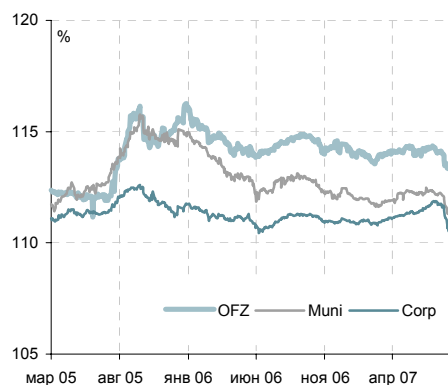
| | |
|---------------------------|---|
| Новости одной строкой | 2 |
| Корпоративные новости | 3 |
| Российский долговой рынок | 4 |
| Торговые идеи | 5 |
| Приложения | 6 |

Динамика EMBIG Sovereign Spread



Источник: J.P. Morgan

Динамика ценовых индексов ZETBI



Источник: Банк ЗЕНИТ

Яков Яковлев
y.yakovlev@zenit.ru

Ольга Ефремова
o.efremova@zenit.ru

Мария Сулима
m.sulima@zenit.ru

www.zenit.ru

Новости одной строкой

Дальневосточный банк утвердил решение о выпуске облигаций серии 01 общим объемом 1.5 млрд. руб. на три года. /cbonds/

Deutsche Bank банк отложил намеченное на начало сентября размещение облигаций на 3 млрд. руб. до улучшения рыночной конъюнктуры. Срок обращения бумаг составит пять лет. /cbonds/

ЗАО "Национальный капитал" в начале октября начнет размещение облигаций первой серии объемом 3 млрд. рублей. Срок обращения бумаг составит пять лет. /rusbonds/

ОАО «Полипласт» планирует размещение дебютного выпуска облигаций на сумму 1 млрд. руб. Срок обращения выпуска составит три года. /rusbonds/

ОАО "Федеральная сетевая компания" в ближайшие полгода планирует выпуск евробондов. /rusbonds/

ОАО «Балтинвестбанк» разместит облигационный выпуск в объеме 1 млрд. руб., срок обращения – три года. Средства, привлеченные в ходе размещения, будут направлены на расширение программ кредитования корпоративных клиентов, в том числе предприятий малого и среднего бизнеса. /rusbonds/

Динамика ценовых индексов ZETBI

| | Индекс | день | неделя |
|--------------|--------|--------|--------|
| Zetbi OFZ | 112,71 | -0,03% | -0,05% |
| Zetbi Muni | 110,55 | 0,01% | -0,25% |
| Zetbi Corp | 109,90 | -0,03% | -0,26% |
| Zetbi Corp10 | 116,55 | -0,08% | -0,22% |

Источник: Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в субфедеральном сегменте

| Инструмент | Объем, млн. руб. | Изменение цены, б.п. |
|------------|------------------|----------------------|
| ТверОбл 05 | 155,60 | 0,02 |
| МГор47-об | 116,51 | -0,06 |
| Саха(Якут) | 94,81 | -0,33 |
| КалужОбл-2 | 78,34 | -0,05 |
| Якут-07 об | 60,58 | -0,10 |

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в корпоративном сегменте

| Инструмент | Объем, млн. руб. | Изменение цены, б.п. |
|------------|------------------|----------------------|
| ТалостоФ-1 | 991,36 | 0,01 |
| СевСтАвто2 | 837,44 | -0,34 |
| РусСтанд-4 | 398,23 | -0,07 |
| Кокс 02 | 287,63 | 0,48 |
| РосселхозБ | 254,10 | - |

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Корпоративные новости

X5

X5 представила финансовые результаты деятельности за первое полугодие 2007 г. Чистая выручка выросла на 49% до \$2.348 млн. (или 43% (про-форма) без учета деятельности сети Меркадо). При росте валовой прибыли на 53% до \$ 617 млн., валовая рентабельность повысилась с 25.6% до 26.3%. Рост EBITDA на 74% до \$212 млн. (с учетом новой опционной программы для менеджмента) обусловил маржу на уровне 9% по сравнению с 9.7% за аналогичный период прошлого года (без учета расходов на опцион показатель составил \$234 млн.). В целом показатели выручки и EBITDA соответствуют нашим финансовым прогнозам на год. Исходя из наших оценок, Долг/EBITDA по итогам текущего года составит 2.5-3.0x. Показатель чистой прибыли компания не раскрыла.

За первое полугодие выручка Like-for-Like в долларовом выражении выросла на 23%, что было в первую очередь связано с 10% увеличением покупательского потока, а также с 13% повышением стоимости продуктовой корзины. Рост сопоставимых продаж в рублевом выражении составил 16% при 6% повышении стоимости покупательской корзины на фоне укрепления курса рубля.

Также в отчетном периоде X5 закончила интеграцию сети Меркадо, приобретенной в ноябре прошлого года, и на настоящий момент 10 магазинов сети работают под брэндом «Перекресток», семь – под брэндом «Пятерочка». В результате продолжения региональной экспансии совокупная торговая площадь за истекший период увеличилась на 50 тыс. кв. м. В рамках экспансии был получен контроль над 40 магазинами, ранее работавшими по франшизе в Челябинске.

Сегодня X5 проводит телефонную конференцию по обнародованным данным, основные моменты которой мы осветим завтра.

ЮТК отчитался за 1 полугодие 2007 года по МСФО.

Выручка ЮТК за 1 полугодие 2007г. выросла на 17.7% по сравнению с аналогичным периодом прошлого года и составила 16.3 млрд руб. Основными факторами роста оборотов стали доходы от внутризональной связи, увеличившиеся на 48% (до 1.8 млрд руб.) за счет действия принципа «платит звонящий» и доходы от услуг широкополосного доступа в Интернет (ШПД), рост которых составил 65% (до 1.1 млрд руб.) на фоне 2-кратного роста абонентской базы (до 107 тыс. чел.). Кроме того, в 1 полугодии на 7.2% выросли доходы от услуг местной связи (до 4.5 млрд руб.), чему способствовал весьма успешный переход с 1 февраля к работе по тарифным планам, а также увеличение числа основных телефонных аппаратов (ОТА) на 2.7 тыс.

Рост EBITDA за отчетный период составил 28.5%, до 3.8 млрд. руб. Чистая прибыль выросла на 117% до 719 млн руб. Продолжение жесткой политики по контролю расходов позволило компании увеличить показатели рентабельности. Так EBITDA margin выросла с 34.6% до 38.7%, рентабельность чистой прибыли увеличилась вдвое – с 4.5% до 9%.

Что касается долговой нагрузки, то в 1 полугодии объем финансовых обязательств ЮТК практически не изменился по сравнению с началом года и составил 19.4 млрд руб. В результате на фоне роста доходов немного снизилась относительная долговая нагрузка: Долг/ EBITDA сократился с 2.9x до 2.55x.

В целом, результаты ЮТК свидетельствуют о постепенном улучшении ее финансового состояния, хотя компания по-прежнему имеет самый высокий уровень долговой нагрузки среди МРК. В частности, у единственного из отчитавшихся на сегодняшний день за 1 п.г. 2007г. телекомов, ЦТК, Долг/ EBITDA почти вдвое ниже. При этом по динамике операционных показателей и рентабельности ЦТК находится на одном уровне с южным оператором. На наш взгляд, существующая премия в доходности бумаг ЮТК по отношению к облигациям ЦТК на уровне 50б.п. немного ниже справедливого уровня, отражающего разницу в долговой нагрузке.

Мария Сулима
m.sulima@zenit.ru

Даниил Иванов
daniil.ivanov@zenit.ru

| | 1П 2007 | ЮТК | ЦТК |
|---------------------------|---------|--------------|--------------|
| Выручка, млн. руб. | | 9820 | 16331 |
| изменение | | 14,9% | 17,8% |
| EBITDA, млн. руб. | | 3804 | 5966 |
| изменение | | 28,5% | 26,6% |
| EBITDA margin | | 38,7% | 36,5% |
| Чистая прибыль | | 719 | 1294 |
| изменение | | 117,6% | 529,8% |
| net margin | | 7,3% | 7,9% |
| Долг, млн. руб. | | 19440 | 17979 |
| изменение | | -2,7% | -10,2% |
| Долг/EBITDA | | 2,55 | 1,51 |

Источник: данные компаний

Торговые идеи

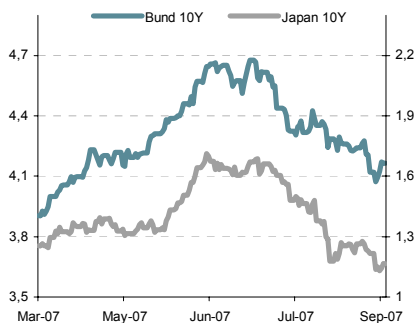
- **Севкабель-Финанс-3** – выпуск сохраняет премию в доходности к отраслевым аналогам (порядка 50 б.п.), рекомендуем к ПОКУПКЕ в защитный портфель
- **УМПО-2** - Рекомендуем сохранять позиции в бумаге. На фоне ближайшего выпусков аналога (НПО Сатурн), текущий купон УМПО остается наиболее высоким (на уровне 9.5% годовых).
- **Л'этуаль** – бумага торгуется с очень короткой дюрацией к оферте в конце текущего года. На наш взгляд, выпуск интересен с точки зрения соотношения «риск-доходность» ввиду достаточно высокого купона в 10.75% и неплохих финансовых характеристик. Мы рекомендуем ДЕРЖАТЬ бумагу до оферты.
- **Инком-Авто-2** – Мы считаем данный выпуск достаточно интересным, чтобы ДЕРЖАТЬ его в портфеле до оферты, учитывая высокую ставку купона на уровне 12%, а также короткую дюрацию.
- **НИТОЛ-2** - несмотря на то, что эффект от инвестиционной проявится только в среднесрочной перспективе, тот факт, что в настоящее время компания придерживается намеченного плана мероприятий и достигает при этом запланированных результатов, поддерживает нашу позитивную оценку кредитного качества эмитента. Исходя из этого, мы рекомендуем сохранять позиции в бумаге, которая выглядит довольно привлекательно на фоне других выпусков третьего эшелона с точки зрения соотношения риск/доходность".
- **Карусель** – Реализация опциона на покупку Карусели по-прежнему весьма вероятна, в связи с чем существующая значительная разница в текущих доходностях выпусков Х5 и Карусели не оправдана. Рекомендуем бумаги Карусели к ПОКУПКЕ.
- Завершение консолидации активов увеличивает вероятность продажи контрольного пакета **Трансмашхолдинга** ОАО «РЖД», в связи с чем текущая премия бумаг Трансмашхолдинг-2 к сопоставимым по дюрации бумагам будущей материнской компании выглядит завышенной. Рекомендуем бумаги Трансмашхолдинг-2 к ПОКУПКЕ.
- **Техносила** – после продаж в августе бумаги выглядят интересно для покупки. Хотя нельзя утверждать, что текущий спред к ОФЗ в 600 б.п. сузится до исторически справедливого уровня в 500 б.п. в ближайшей перспективе, потенциал отыграть часть падения несомненно есть. С фундаментальной точки зрения, компания выглядит вполне стабильно, что подтверждают данные последней управленческой отчетности за 1пг.2007.
- **Седьмой Континент-2** – рекомендуем к ПОКУПКЕ. Бумага недооценена относительно выпусков других крупных ритейлеров, ИКС-5 и Магнита, которым Седьмой Континент уступает только с точки зрения масштабов бизнеса. Премию за «размер» можно оценить на уровне 30-50 б.п. максимум. При этом, фактор сделки с фондом TRG Capital, который уже озвучил планы вложить в развитие сети до 7 млрд. долл., может сократить эту премию до нуля.

Приложение 1. Индикаторы мировых рынков

| Инструмент | Дата | Значение | Изменение, б.п. | | |
|------------------|-----------|----------|-----------------|--------|--------|
| | | | день | месяц | год |
| UST 2 yr | 9/14/2007 | 4,04 | 1 | -15 | -82 |
| UST 10 yr | 9/14/2007 | 4,46 | -1 | -23 | -33 |
| UST 30 yr | 9/14/2007 | 4,72 | -1 | -27 | -19 |
| Bund 2 yr | 9/14/2007 | 3,99 | 0 | 3 | 33 |
| Bund 10 yr | 9/14/2007 | 4,17 | 0 | -12 | 39 |
| Bund 30 yr | 9/14/2007 | 4,43 | -1 | -6 | 46 |
| Fed Fund | 9/13/2007 | 5,25 | 0 | 0 | 0 |
| Libor 1 mo | 9/13/2007 | 5,75 | -14 | 2,5 | 28 |
| Libor 6 mo | 9/13/2007 | 5,51 | -5 | 5,9 | 3 |
| Libor 12 mo | 9/13/2007 | 5,13 | -1 | -12 | -28 |
| S&P 500 | 9/14/2007 | 1484,25 | 0,02% | 2,65% | 12,45% |
| Nasdaq Composite | 9/14/2007 | 2602,18 | 0,04% | 3,88% | 16,40% |
| RTS | 9/14/2007 | 1943,25 | 0,55% | 4,44% | 25,32% |
| EURUSD | 9/17/2007 | 1,3880 | 0,03% | 3,01% | 9,24% |
| USDJPY | 9/17/2007 | 115,24 | -0,10% | 0,75% | -2,30% |
| USDRUB | 9/17/2007 | 25,33 | -0,02% | -1,70% | -5,37% |
| EURRUB | 9/17/2007 | 35,16 | -0,02% | 1,25% | 3,38% |
| Brent 1m Future | 9/17/2007 | 75,95 | -0,35% | 7,82% | 19,93% |
| Gold | 9/17/2007 | 711,28 | 0,52% | 8,13% | 22,78% |

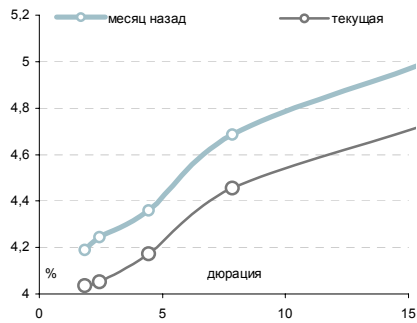
Источник: Bloomberg

Динамика доходности 10Y немецких и японских облигаций



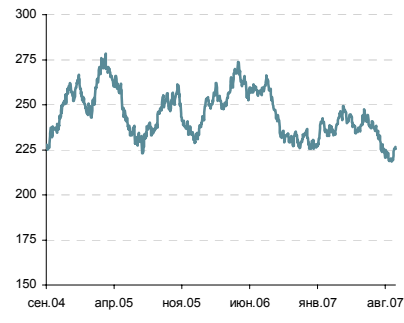
Источник: Bloomberg

Кривая доходности US Treasuries



Источник: Bloomberg

Спред между UST10 и UST10 с защитой от инфляции



Источник: Bloomberg

| Bond | Date | Current Spread | Change, bp | | | | YTM |
|-----------------|-----------|----------------|------------|------|-------|-------|------|
| | | | day | week | month | year | |
| Russia-30* | 9/14/2007 | 112,04% | -10 | 26 | 242 | 84 | 5,79 |
| UMS-31* | 9/13/2007 | 129,86% | -10 | 44 | 649 | 482 | 5,94 |
| Turkey-30* | 9/14/2007 | 154,53% | 36 | 152 | 460 | 469 | 7,01 |
| Venezuela-27* | 9/13/2007 | 101,06% | 144 | 334 | 367 | -2078 | 9,13 |
| EMBIG | 9/14/2007 | 234 | -1 | -13 | -1 | 63 | - |
| EMBIG Russia | 9/14/2007 | 144 | 3 | -9 | 1 | 45 | - |
| EMBIG Brazil | 9/14/2007 | 197 | -2 | -6 | 2 | 7 | - |
| EMBIG Mexico | 9/14/2007 | 135 | 1 | -5 | 4 | 20 | - |
| EMBIG Turkey | 9/14/2007 | 237 | 1 | -9 | 6 | 30 | - |
| EMBIG Venezuela | 9/14/2007 | 467 | -1 | -45 | -12 | 284 | - |

* - Указаны котировки

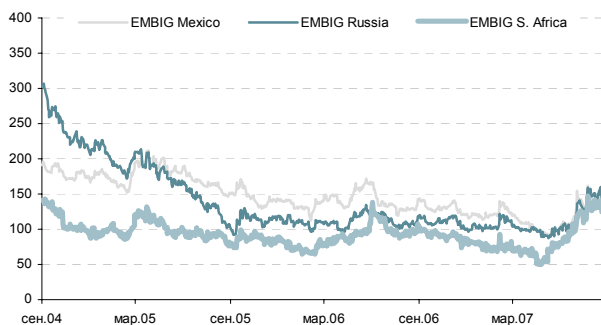
Источник: J.P. Morgan, Bloomberg

Динамика цен на нефть сорта Brent



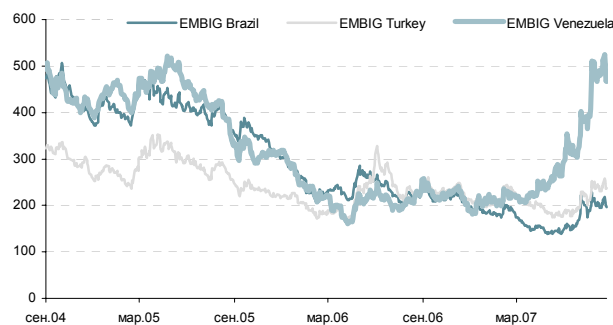
Источник: Bloomberg

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов

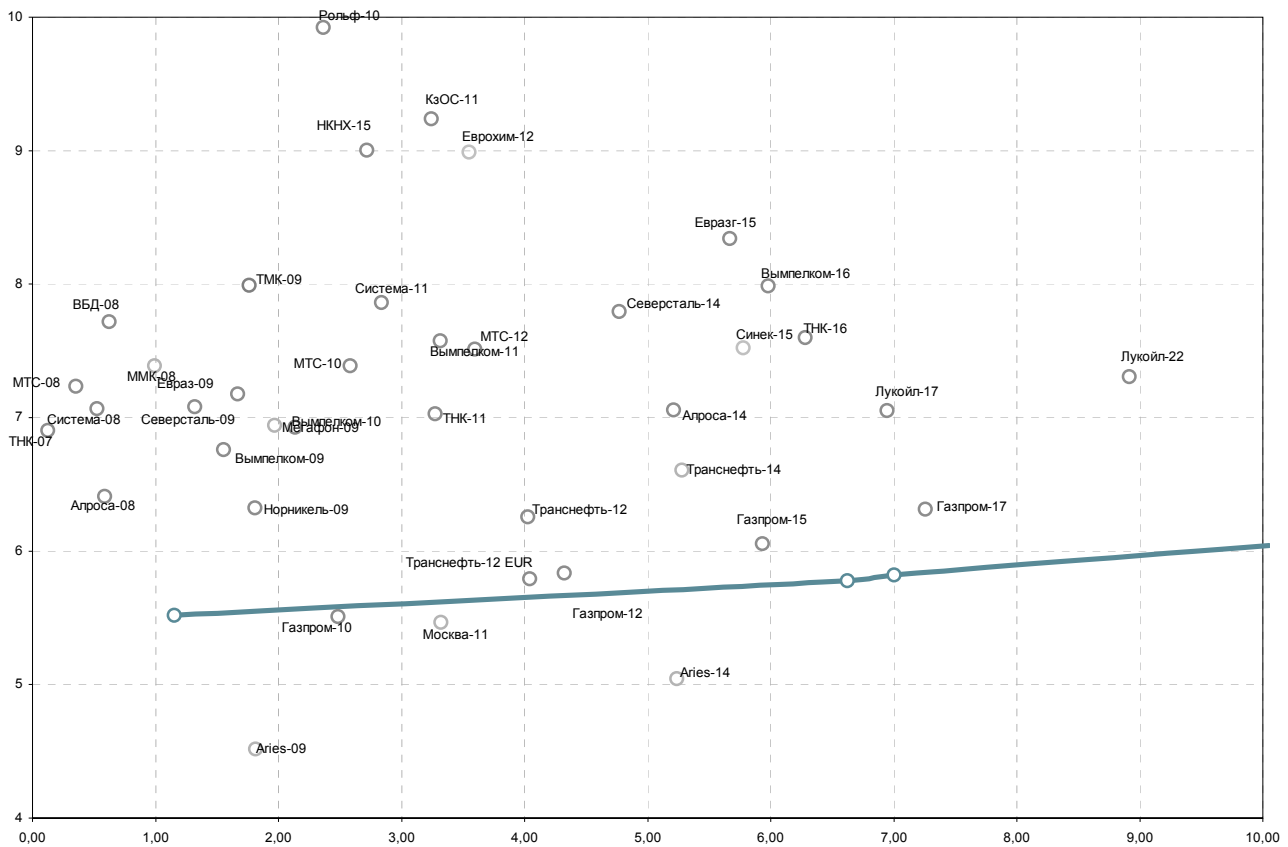


Источник: J.P. Morgan



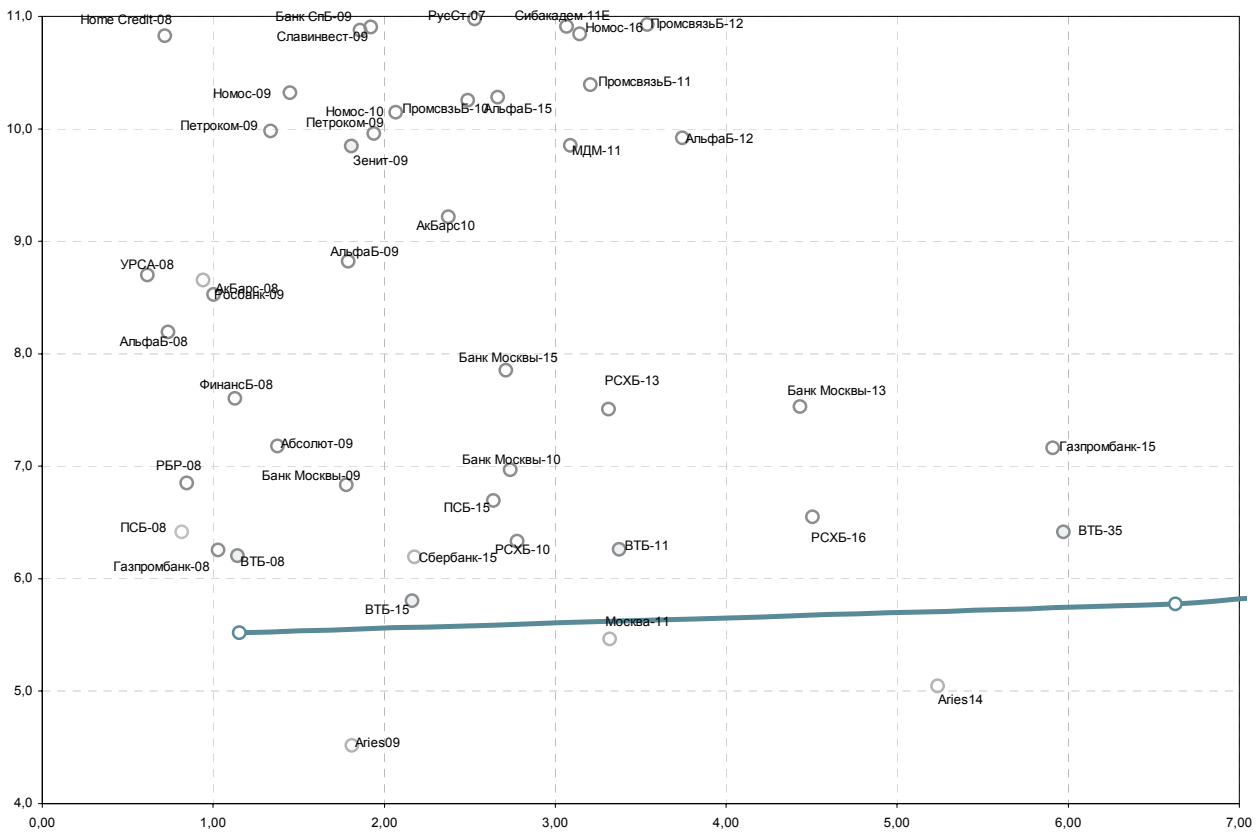
Приложение 2. Российский рынок еврооблигаций

Кривая доходности российских еврооблигаций: Нефинансовый сектор



Источник: Bloomberg

Кривая доходности российских еврооблигаций: Банки



Источник: Bloomberg



Котировки российских еврооблигаций

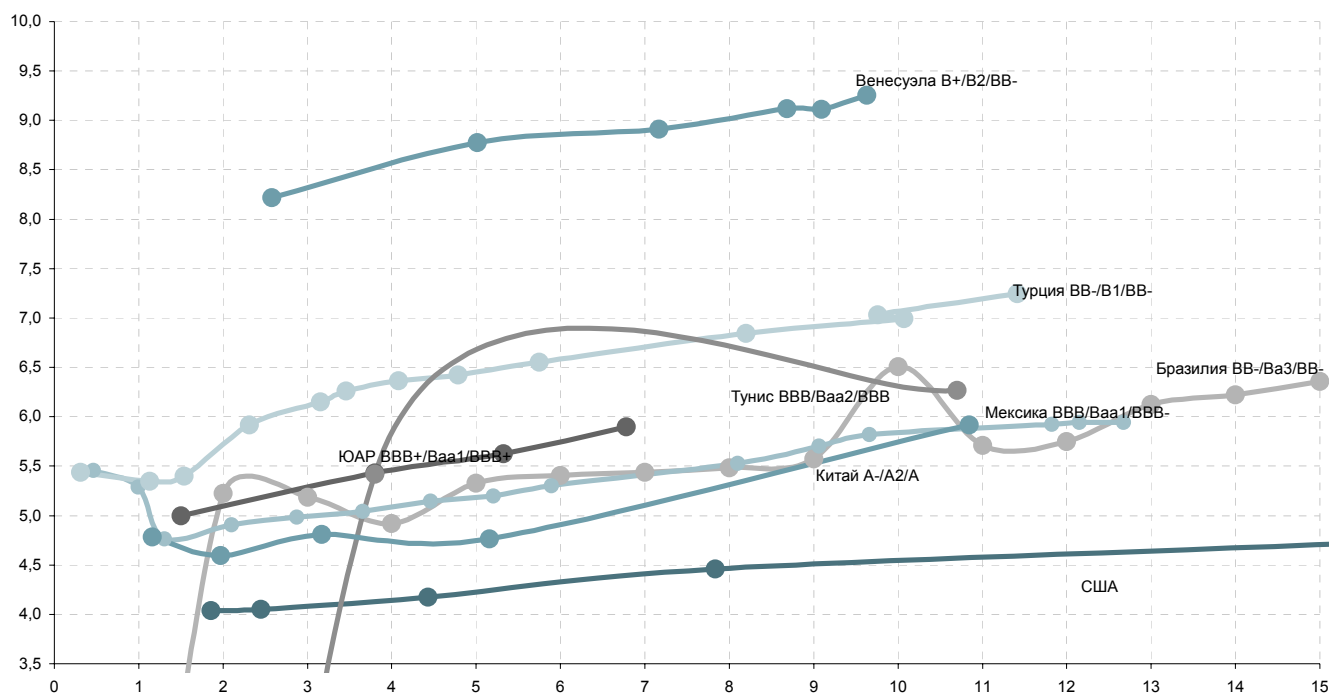
| | Maturity | Size, mln | Coupon, % | Rating | Bid | Offer | YTM, % | Modified Duration | Spread to Treasury, bp |
|---------------------------|------------|-----------|-----------|-------------------|--------|--------|--------|-------------------|------------------------|
| Sovereign | | | | | | | | | |
| Russia-10 \$ | 3/31/2010 | 2 767 | 8,250 | Baa2/BBB+/BBB+ | 103,09 | 103,31 | 5,49 | 1,15 | 280 |
| Russia-18 \$ | 7/24/2018 | 3 467 | 11,000 | Baa2/BBB+/BBB+ | 140,96 | 141,21 | 5,83 | 7,00 | 135 |
| Russia-28 \$ | 6/24/2028 | 2 500 | 12,750 | Baa2/BBB+/BBB+ | 178,46 | 178,71 | 6,05 | 10,05 | 144 |
| Russia-30 \$ | 3/31/2030 | 20 310 | 7,500 | Baa2/BBB+/BBB+ | 111,96 | 112,11 | 5,79 | 6,63 | 116 |
| Minfin-8 \$ | 11/14/2007 | 1 322 | 3,000 | BBB+/NR | 99,53 | 99,55 | 6,03 | 0,15 | 205 |
| Minfin-5 \$ | 5/14/2008 | 2 837 | 3,000 | Baa2/BBB+/BBB+ | 98,16 | 98,20 | 5,85 | 0,63 | 158 |
| Minfin-7 \$ | 5/14/2011 | 1 750 | 3,000 | Baa2/BBB+/BBB+ | 91,31 | 91,52 | 5,66 | 3,28 | 148 |
| Aries-07 EUR | 10/25/2007 | 2 000 | FRN | Aaa/AAA | 100,28 | 100,38 | 4,09 | 0,10 | - |
| Aries-09 EUR | 10/25/2009 | 1 000 | 7,750 | Aaa/AAA | 106,07 | 106,32 | 4,58 | 1,81 | 58 |
| Aries-14 \$ | 10/25/2014 | 2 436 | 9,600 | Aaa/AAA | 126,48 | 126,88 | 5,08 | 5,24 | 78 |
| Regional | | | | | | | | | |
| Moscow-11 EUR | 10/12/2011 | 374 | 6,450 | Baa1/-/BBB+ | 103,24 | 103,49 | 5,50 | 3,32 | 144 |
| Oil & Gas | | | | | | | | | |
| Gazprom-09 \$ | 10/21/2009 | 700 | 10,500 | BBB | 108,73 | 109,03 | 5,91 | 1,81 | 187 |
| Gazprom-10 EUR | 9/27/2010 | 1 000 | 7,800 | BBB/BBB- | 105,96 | 106,21 | 5,55 | 2,48 | 151 |
| Gazprom-13 \$ | 3/1/2013 | 1 750 | 9,625 | BBB | 115,60 | 115,85 | 6,18 | 4,30 | 198 |
| Gazprom-15 EUR | 6/1/2015 | 1 000 | 5,875 | A3 | 98,39 | 98,89 | 6,10 | 5,93 | 197 |
| Gazprom-17 EUR | 11/2/2017 | 500 | 5,440 | BBB/BBB- | 93,19 | 93,59 | 6,35 | 7,26 | 216 |
| Gazprom-20 \$ | 2/1/2020 | 1 250 | 7,201 | BBB+/BBB | 102,73 | 102,98 | 6,85 | 8,10 | 236 |
| Gazprom-22 \$ | 3/7/2022 | 1 300 | 6,510 | BBB/BBB- | 98,17 | 98,42 | 6,70 | 9,21 | 217 |
| Gazprom-34 \$ | 4/28/2034 | 1 200 | 8,625 | A3/BBB/BBB- | 126,85 | 127,10 | 6,48 | 11,66 | 180 |
| Lukoil-17 \$ | 6/7/2017 | 500 | 6,356 | (P)Baa2/BBB-/BBB- | 94,80 | 95,14 | 7,08 | 6,94 | 262 |
| Lukoil-22 \$ | 6/7/2022 | 500 | 6,656 | (P)Baa2/BBB-/BBB- | 93,68 | 94,17 | 7,34 | 8,91 | 281 |
| Sibneft-09 \$ | 1/15/2009 | 500 | 10,750 | Ba1/BB+ | 105,31 | 105,61 | 6,36 | 1,21 | 225 |
| TNK-07 \$ | 11/6/2007 | 700 | 11,000 | Baa2/BB+/BBB- | 100,45 | 100,48 | 7,03 | 0,13 | 305 |
| TNK-11 \$ | 7/18/2011 | 500 | 6,875 | Baa2/BB+/BBB- | 99,22 | 99,47 | 7,07 | 3,28 | 295 |
| TNK-16 \$ | 7/18/2016 | 1 000 | 7,500 | Baa2/BB+/BBB- | 99,09 | 99,34 | 7,62 | 6,28 | 322 |
| Transneft-12 EUR | 6/27/2012 | 700 | 5,381 | A2/BBB+/- | 100,28 | 98,31 | 5,82 | 4,04 | 176 |
| Transneft-12 \$ | 6/27/2012 | 500 | 6,103 | A2/BBB+/- | 102,73 | 99,35 | 6,29 | 4,02 | 212 |
| Transneft-14 \$ | 3/5/2014 | 1 300 | 5,670 | A2/BBB+/- | 94,88 | 95,13 | 6,63 | 5,28 | 236 |
| Telecommunications | | | | | | | | | |
| MegaFon-09 \$ | 12/10/2009 | 375 | 8,000 | Ba3/BB | 101,87 | 102,12 | 7,01 | 1,97 | 296 |
| MTS-08 \$ | 1/30/2008 | 400 | 9,750 | Ba3/BB- | 100,80 | 100,85 | 7,31 | 0,35 | 321 |
| MTS-10 \$ | 10/14/2010 | 400 | 8,375 | Ba3/BB- | 102,40 | 102,65 | 7,44 | 2,58 | 336 |
| MTS-12 \$ | 1/28/2012 | 400 | 8,000 | Ba3/BB- | 101,51 | 101,76 | 7,55 | 3,59 | 341 |
| Sistema-08 \$ | 4/14/2008 | 350 | 10,250 | B+/BB- | 101,64 | 101,73 | 7,14 | 0,52 | 295 |
| Sistema-11 \$ | 1/28/2011 | 350 | 8,875 | B3/B+/BB- | 102,62 | 102,91 | 7,91 | 2,83 | 383 |
| Vimpelcom-09 \$ | 6/16/2009 | 450 | 10,000 | Ba2/BB+ | 104,96 | 105,21 | 6,83 | 1,55 | 277 |
| Vimpelcom-10 \$ | 2/11/2010 | 300 | 8,000 | Ba2/BB+ | 102,06 | 102,31 | 6,99 | 2,13 | 294 |
| Vimpelcom-11 \$ | 10/22/2011 | 300 | 8,375 | Ba2/BB+ | 102,51 | 102,76 | 7,61 | 3,31 | 348 |
| Vimpelcom-16 \$ | 5/23/2016 | 600 | 8,250 | Ba2/BB+ | 101,36 | 101,61 | 8,01 | 5,98 | 361 |
| Industrials | | | | | | | | | |
| Alrosa-08 \$ | 5/6/2008 | 500 | 8,125 | Ba2/BB- | 100,93 | 101,03 | 6,49 | 0,59 | 230 |
| Alrosa-14 \$ | 11/17/2014 | 500 | 8,875 | Ba2/BB- | 109,80 | 110,05 | 7,08 | 5,21 | 278 |
| Eurochem-12 \$ | 3/21/2012 | 300 | 7,875 | -/BB-/BB- | 95,70 | 95,95 | 9,03 | 3,55 | 487 |
| Evrzholding-09 \$ | 8/3/2009 | 325 | 10,875 | Ba3/BB | 106,09 | 106,34 | 7,25 | 1,665 | 320 |
| Evrzholding-15 \$ | 11/10/2015 | 750 | 8,250 | B2/BB | 99,21 | 99,46 | 8,36 | 5,666 | 400 |
| Kazanorgsintez-11 \$ | 10/30/2011 | 200 | 9,250 | -/B-/B | 99,52 | 100,02 | 9,31 | 3,24 | 518 |
| Nornickel-09 \$ | 9/30/2009 | 500 | 7,125 | Baa2/BBB- | 101,25 | 101,50 | 6,39 | 1,81 | 235 |
| MMK-08 \$ | 10/21/2008 | 300 | 8,000 | Ba2/BB/BB | 100,46 | 100,62 | 7,47 | 0,99 | 333 |
| Severstal-09 \$ | 2/24/2009 | 325 | 8,625 | Ba2/BB | 101,71 | 102,05 | 7,21 | 1,32 | 311 |
| Severstal-14 \$ | 4/19/2014 | 375 | 9,250 | Ba2/BB/BB- | 106,87 | 107,37 | 7,84 | 4,77 | 357 |
| SINEK-15 | 8/3/2015 | 250 | 7,700 | Ba1/BB+ | 100,78 | 101,03 | 7,54 | 5,779 | 320 |
| SUEK-08 | 10/24/2008 | 175 | 8,625 | - | 100,23 | 100,49 | 8,26 | 0,992 | 413 |
| TMK-08 \$ | 9/29/2009 | 300 | 8,500 | B1/BB-/ | 100,68 | 100,93 | 8,06 | 1,759 | 402 |
| Consumer/Retail | | | | | | | | | |
| WBD-08 \$ | 5/21/2008 | 150 | 8,500 | Ba3/BB-/ | 100,38 | 100,48 | 7,79 | 0,63 | 361 |
| Rolf-10 \$ | 6/28/2010 | 250 | 8,250 | Ba3/BB-/ | 95,51 | 96,01 | 10,03 | 2,36 | 597 |
| Banks | | | | | | | | | |
| Absolut-09 \$ | 4/7/2009 | 200 | 8,750 | Baa3/-/A- | 102,03 | 102,25 | 7,26 | 1,38 | 317 |
| Ak Bars-08 \$ | 10/27/2008 | 175 | 8,000 | Ba2/-/BB- | 99,29 | 99,44 | 8,61 | 1,00 | 447 |
| Ak Bars-10 \$ | 6/28/2010 | 250 | 8,250 | Ba2/BB-e/- | 97,40 | 97,65 | 9,27 | 2,38 | 521 |
| Alfa Bank-08 \$ | 7/2/2008 | 250 | 7,750 | Ba1/BB/BB- | 99,47 | 99,65 | 8,32 | 0,73 | 415 |
| Alfa Bank-09 \$ | 10/10/2009 | 400 | 7,875 | Ba1/-/BB- | 97,89 | 98,25 | 8,92 | 1,79 | 488 |
| Alfa Bank-12 \$ | 6/25/2012 | 500 | 8,200 | Ba1/BB-/ | 93,08 | 93,58 | 9,99 | 3,74 | 582 |
| Alfa Bank-15 \$ | 12/9/2015 | 225 | 8,625 | Ba2/B+/B+ | 95,28 | 95,53 | 10,53 | 2,66 | 625 |

| | | | | | | | | | |
|------------------------|------------|-------|-------|-------------|--------|--------|-------|------|-----|
| Bank of Moscow-09 \$ | 9/28/2009 | 250 | 8,000 | A3/-/BBB | 101,92 | 102,17 | 6,90 | 1,78 | 286 |
| Bank of Moscow-10 \$ | 9/21/2005 | 300 | 7,375 | A3/-/BBB | 100,88 | 101,13 | 7,01 | 2,74 | 293 |
| Bank of Moscow-13 \$ | 5/13/2013 | 500 | 7,335 | A3/-/BBB | 98,86 | 99,11 | 7,56 | 4,43 | 333 |
| Bank of Moscow-15 \$ | 11/25/2015 | 300 | 7,500 | Baa1/-/BBB- | 98,76 | 99,01 | 8,46 | 2,71 | 382 |
| Bank SpB-09 \$ | 11/25/2009 | 125 | 9,501 | Ba3/-/B | 97,12 | 97,37 | 10,94 | 1,86 | 690 |
| Bank Soyuz-10 \$ | 2/16/2010 | 125 | 9,375 | WR/-/B- | 96,01 | 96,26 | 11,24 | 2,07 | 720 |
| Bank ZENIT-09 \$ | 2/16/2010 | 200 | 8,750 | Ba3/-/B | 97,49 | 97,94 | 9,97 | 1,81 | 593 |
| Gazprombank-08 \$ | 10/30/2008 | 1 050 | 7,250 | A3/BBB- | 100,88 | 101,04 | 6,33 | 1,03 | 220 |
| Gazprombank-15 \$ | 9/23/2015 | 1 000 | 6,500 | WR/NR | 95,75 | 96,00 | 7,19 | 5,91 | 283 |
| HCFB-08 \$ | 2/4/2008 | 150 | 9,125 | Ba3/B+ | 99,21 | 99,27 | 11,13 | 0,36 | 702 |
| ICB-08 \$ | 7/29/2008 | 300 | 6,875 | A2/-/BBB | 100,24 | 100,36 | 6,49 | 0,82 | 234 |
| ICB-15 \$ | 9/29/2015 | 400 | 6,200 | A3/-/BBB- | 98,41 | 98,66 | 7,32 | 2,64 | 267 |
| MDM-11 \$ | 7/21/2011 | 200 | 9,750 | Ba2/B+/B+ | 99,29 | 99,66 | 9,91 | 3,09 | 579 |
| MBRD-09 \$ | 6/29/2009 | 100 | 8,800 | B1/-/B+ | 97,96 | 98,19 | 9,99 | 1,57 | 594 |
| Nomos-09 \$ | 5/12/2009 | 150 | 8,250 | Ba3/B+ | 96,56 | 96,92 | 10,44 | 1,45 | 637 |
| Nomos-10 \$ | 2/2/2010 | 200 | 8,188 | Ba3/B+ | 95,70 | 95,95 | 10,21 | 2,07 | 616 |
| Nomos-16 \$ | 10/20/2016 | 125 | 9,750 | B1/B+ | 96,19 | 96,44 | 11,05 | 3,14 | 675 |
| Petrocommerce-09 \$ | 3/27/2009 | 225 | 8,000 | Ba3/B+ | 96,93 | 97,27 | 10,10 | 1,34 | 602 |
| Petrocommerce-09 \$ | 12/17/2009 | 425 | 8,750 | Ba3/B+ | 97,34 | 97,59 | 10,03 | 1,94 | 598 |
| Promsviazbank-10 \$ | 10/4/2010 | 200 | 8,750 | Ba3/B+ | 95,91 | 96,16 | 10,30 | 2,49 | 623 |
| Promsviazbank-11 \$ | 10/20/2011 | 225 | 8,750 | Ba3/B+ | 94,37 | 94,62 | 10,44 | 3,21 | 630 |
| Promsviazbank-12 \$ | 5/23/2012 | 200 | 9,625 | B1/B- | 95,06 | 95,31 | 10,96 | 3,54 | 679 |
| Renaissance-09 \$ | 11/17/2009 | 250 | 8,750 | Ba3/-/B | 95,48 | 95,94 | 11,02 | 1,85 | 698 |
| Rusagrobank-10 \$ | 11/29/2010 | 350 | 6,875 | A3/BBB+ | 101,28 | 101,53 | 6,38 | 2,78 | 230 |
| Rusagrobank-13 \$ | 5/16/2013 | 700 | 7,175 | A3/BBB+ | 102,66 | 102,91 | 6,58 | 4,50 | 236 |
| Rusagrobank-16 \$ | 9/21/2016 | 500 | 6,970 | Baa1/BBB | 97,92 | 98,17 | 7,97 | 3,31 | 342 |
| Russian Standard-07 \$ | 9/28/2007 | 300 | 7,800 | Ba2/BB- | 100,00 | 100,00 | 7,52 | 0,02 | 354 |
| Russian Standard-08 \$ | 4/21/2008 | 300 | 8,125 | Ba2/BB- | 98,63 | 98,72 | 10,49 | 0,54 | 630 |
| Russian Standard-10 \$ | 10/7/2010 | 500 | 7,500 | Ba2/BB- | 90,94 | 91,19 | 11,03 | 2,53 | 696 |
| Russian Standard-11 \$ | 5/5/2011 | 350 | 8,625 | Ba2/BB- | 91,18 | 91,43 | 11,63 | 2,89 | 752 |
| Russian Standard-15 \$ | 12/16/2015 | 200 | 8,875 | Ba3/B | 90,50 | 90,75 | 11,40 | 5,38 | 703 |
| Russian Standard-9 E | 9/16/2009 | 400 | 6,825 | Ba2/BB- | 92,07 | 92,46 | 11,39 | 1,73 | 739 |
| Rosbank-09 \$ | 9/24/2009 | 300 | 9,750 | Ba2/BB | 101,74 | 101,99 | 8,73 | 1,77 | 478 |
| Slavinvestbank-09 \$ | 12/21/2009 | 100 | 9,875 | B1/-/B-/*+ | 97,71 | 97,96 | 10,97 | 1,92 | 692 |
| Sibacadembank-09 \$ | 5/12/2009 | 351 | 9,000 | Ba3/-/B | 96,30 | 96,52 | 11,44 | 1,43 | 737 |
| Sibacadembank-11 \$ | 11/16/2011 | 300 | 8,300 | -/-/B | 91,07 | 91,57 | 10,99 | 3,07 | 693 |
| Sberbank-15 | 2/11/2015 | 1 000 | 6,230 | A2/BBB | 99,82 | 100,07 | 6,98 | 2,18 | - |
| Tatfondbank-10 \$ | 4/26/2010 | 200 | 9,750 | B2/-/- | 98,31 | 98,81 | 10,39 | 2,16 | 634 |
| Vneshtorgbank-08 | 12/11/2008 | 550 | 6,875 | A2/BBB+ | 100,59 | 100,76 | 6,28 | 1,14 | 216 |
| Vneshtorgbank-11 | 10/12/2011 | 450 | 7,500 | A2/BBB+ | 104,13 | 104,38 | 6,30 | 3,37 | 217 |
| Vneshtorgbank-15 | 2/4/2015 | 750 | 6,315 | A2/BBB | 100,86 | 101,11 | 7,07 | 2,16 | 181 |
| Vneshtorgbank-35 | 6/30/2035 | 1 000 | 6,250 | A2/BBB+ | 97,61 | 97,86 | 6,43 | 5,97 | 229 |
| Ursa bank-08 \$ | 5/19/2008 | 175 | 9,750 | - | 100,48 | 100,64 | 8,83 | 0,61 | 465 |

Источник: Bloomberg

Приложение 3. Еврооблигации развивающихся рынков

Кривые доходностей еврооблигаций развивающихся рынков



Источник: Bloomberg

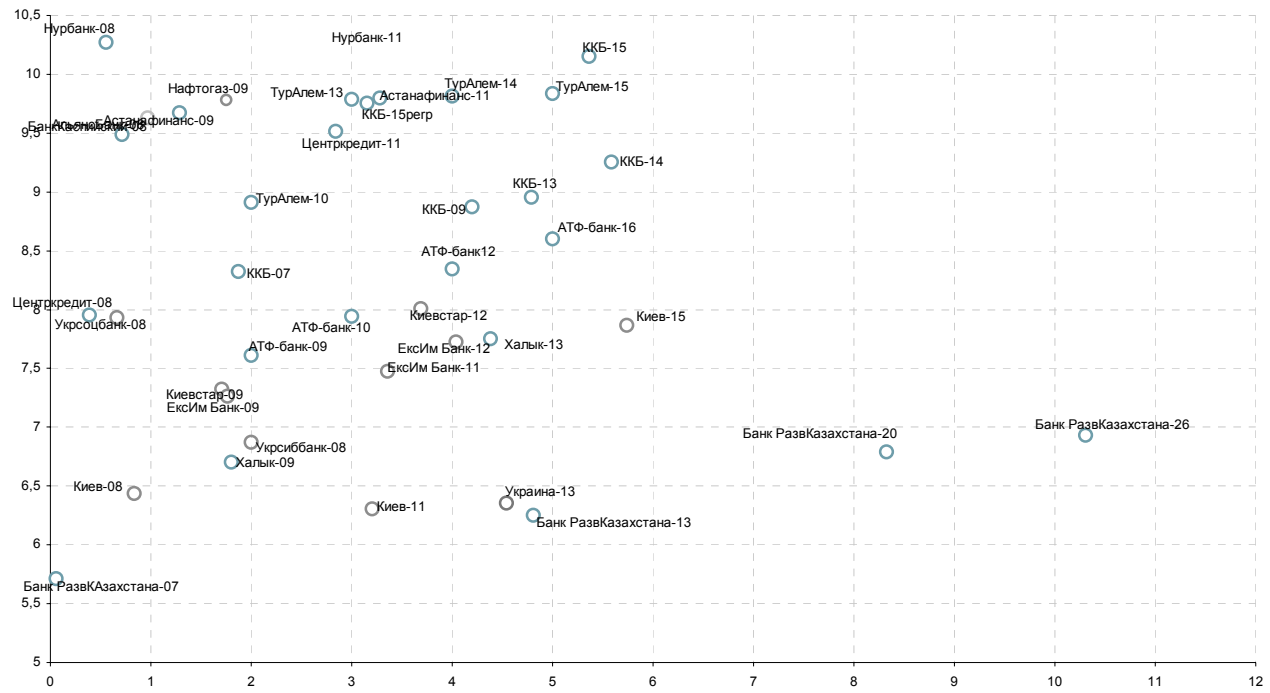
Котировки еврооблигаций развивающихся рынков

| | Maturity | Size, mln | Coupon, % | Rating | Bid Price | Ask Price | YTM, % | Modified Duration |
|---------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------|-----------|--------|-------------------|
| Brazil | | | | | | | | |
| A-Bond | 1/15/2018 | 4 509 | 8,00 | BB+/Ba1/- | 110,85 | 111,10 | 6,51 | 4,72 |
| Brazil-40 | 8/17/2040 | 5 157 | 11,00 | BB+/Ba1/BB+ | 132,82 | 132,97 | 5,75 | 5,63 |
| Turkey | | | | | | | | |
| Turkey-30 | 1/15/2030 | 1 500 | 11,88 | BB-/Ba3/BB- | 154,33 | 154,73 | 6,99 | 10,07 |

Источник: Bloomberg

Приложение 4. Еврооблигации стран СНГ

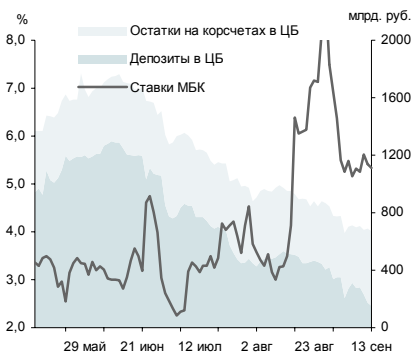
Кривая доходности еврооблигаций стран СНГ



Источник: Bloomberg

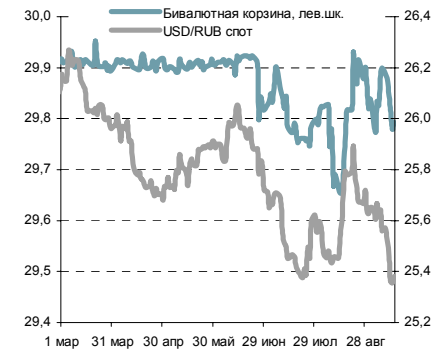
Приложение 5. Индикаторы российского рынка облигаций

Показатели рублевой ликвидности



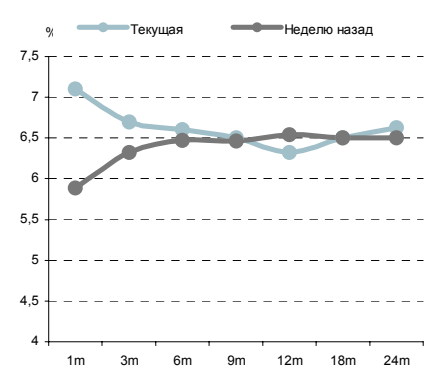
Источник: Reuters, ЦБ РФ

Динамика валютного рынка



Источник: Reuters

Кривая доходности NDF на курс руб./долл.

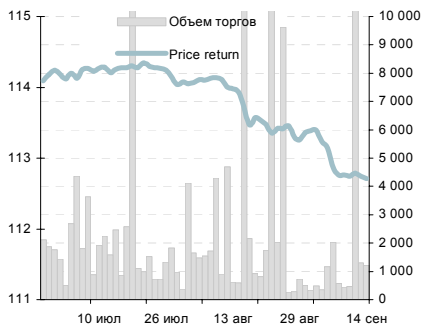


Источник: Reuters

| Инструмент | Дюрация, лет | Доходность по срвзв цене, % год | Цена, % | | НКД (%) | Изм срвзв цены, б.п. | |
|--------------|--------------|------------------------------------|---------|--------|---------|----------------------|--------|
| | | | посл | ср взв | | день | неделя |
| SU25058RMFS7 | 0,62 | 6,10 | 100,20 | 100,20 | 0,760 | 0,0023 | -0,134 |
| SU25061RMFS1 | 2,45 | 6,27 | 99,20 | 99,20 | 0,588 | 0,3742 | -0,050 |
| SU26199RMFS8 | 4,17 | 6,60 | 98,65 | 98,60 | 0,969 | -0,061 | -0,898 |
| SU46018RMFS6 | 8,41 | 6,82 | 107,90 | 107,96 | 0,049 | -0,127 | -0,086 |
| SU46020RMFS2 | 12,59 | 7,07 | 99,30 | 99,40 | 0,567 | -0,199 | -0,715 |
| МГор40-об | 0,13 | 1,63 | 101,05 | 101,05 | 1,370 | - | - |
| МГор29-об | 0,71 | 9,75 | 100,20 | 100,30 | 2,767 | - | - |
| МГор38-об | 2,86 | 6,32 | 112,70 | 111,05 | 2,192 | - | -0,5 |
| МГор44-об | 5,82 | 6,69 | 108,25 | 108,06 | 2,247 | - | -0,19 |
| РЖД-02обл | 0,24 | 7,19 | 100,10 | 100,10 | 2,123 | - | 0 |
| ФСК ЕЭС-03 | 1,20 | 7,52 | 99,56 | 99,65 | 1,770 | - | -0,25 |
| ГАЗПРОМ А6 | 1,80 | 6,96 | 100,15 | 100,18 | 0,685 | 0,08 | 0,28 |
| ГАЗПРОМ А8 | 3,56 | 7,35 | 99,20 | 99,23 | 2,570 | -0,26 | -0,46 |
| АИЖК 9об | 5,55 | 7,88 | 99,10 | 99,10 | 0,616 | -0,07 | -0,3 |

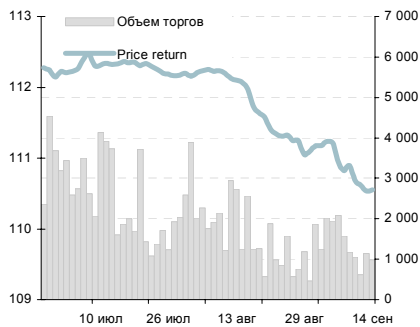
Источник: ММВБ, расчеты Банка ЗЕНИТ

Динамика ценового индекса ZETBI OFZ и объема торгов в сегменте



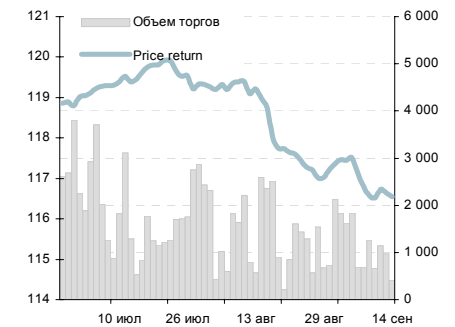
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика ценового индекса ZETBI Muni и объема торгов в сегменте



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индекса ZETBI Corp 10 и объема торгов в сегменте *



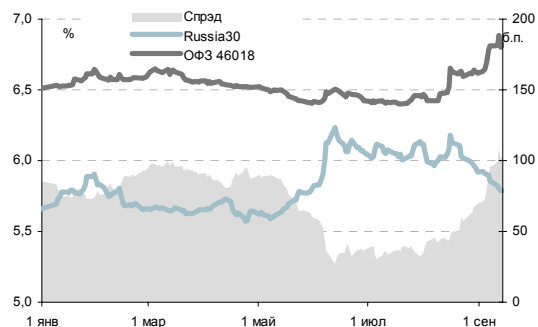
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Ближайшие первичные размещения

| Дата | Эмитент | Сумма, млн.р. | Организатор |
|---------|-------------------------------|---------------|-------------------------|
| 20 сен | Ладыя Финанс | 500 | Русские Фонды |
| 3 кв 07 | Генерирующая компания | 2 000 | Банк ЗЕНИТ |
| 3 кв 07 | Провиант Финанс | 1 000 | Атон, Ист Кэпитал |
| 3 кв 07 | УК Сенатор | 1 000 | Ист Кэпитал |
| 3 кв 07 | Агрика ПП-2 | 2 500 | Ак Барс Банк |
| 3 кв 07 | Строймонтаж | 1 200 | Банк ЗЕНИТ |
| 3 кв 07 | Камаз - Финанс-3 | 6 500 | Банк ЗЕНИТ, Тройка Диаг |
| 3 кв 07 | Мир Финанс-2 | 3 000 | Банк Москвы |
| 3 кв 07 | Дальневост. генерир. компания | 5 000 | КИТ Финанс |

Источник: ММВБ, расчеты Банка ЗЕНИТ

Динамика спреда ОФЗ 46018 и Russia 30



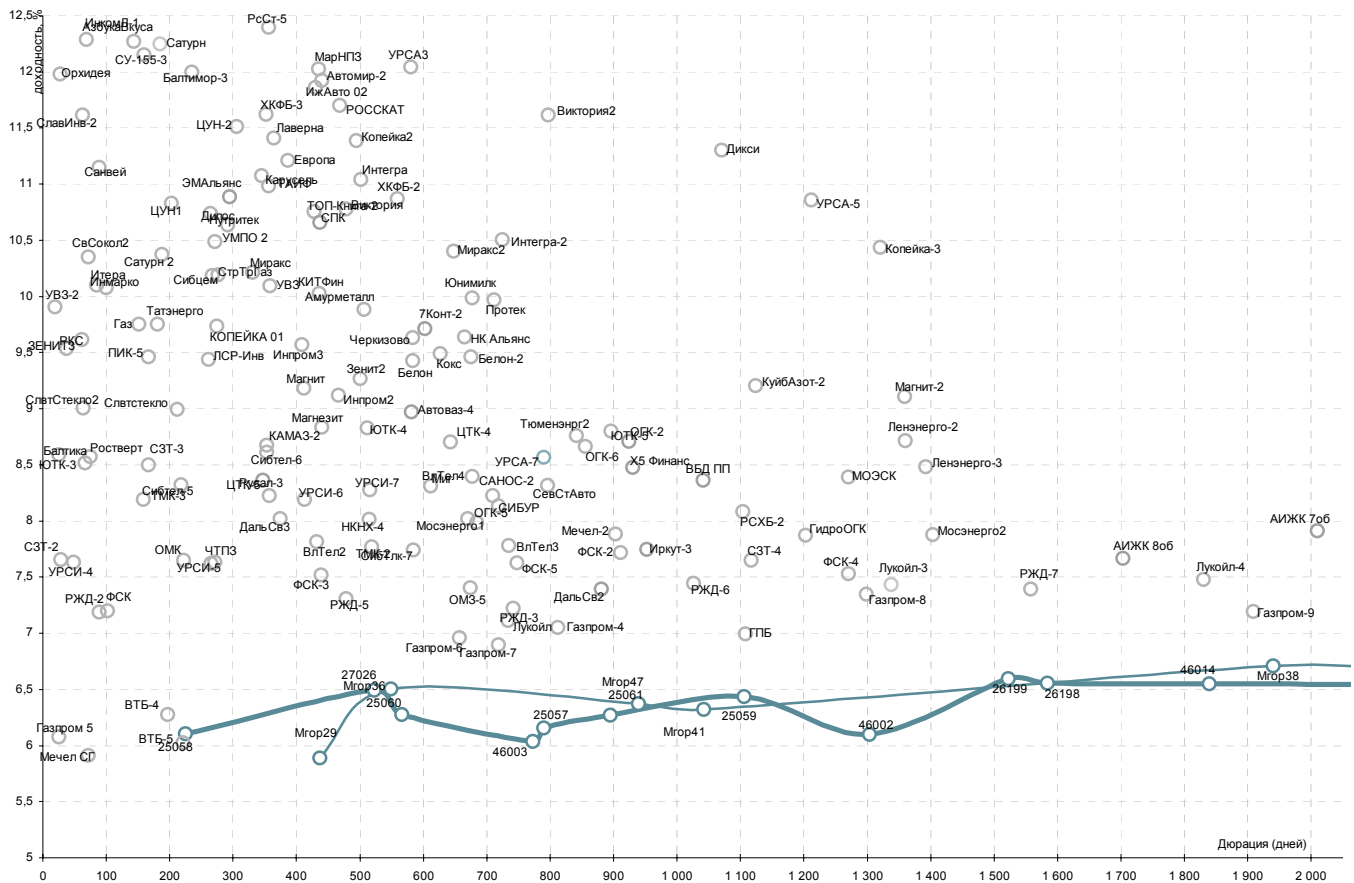
Источник: ММВБ, Bloomberg, расчеты Банка ЗЕНИТ

* Объем торгов для ZETBI Corp 10 соответствует только входящим в индекс бумагам



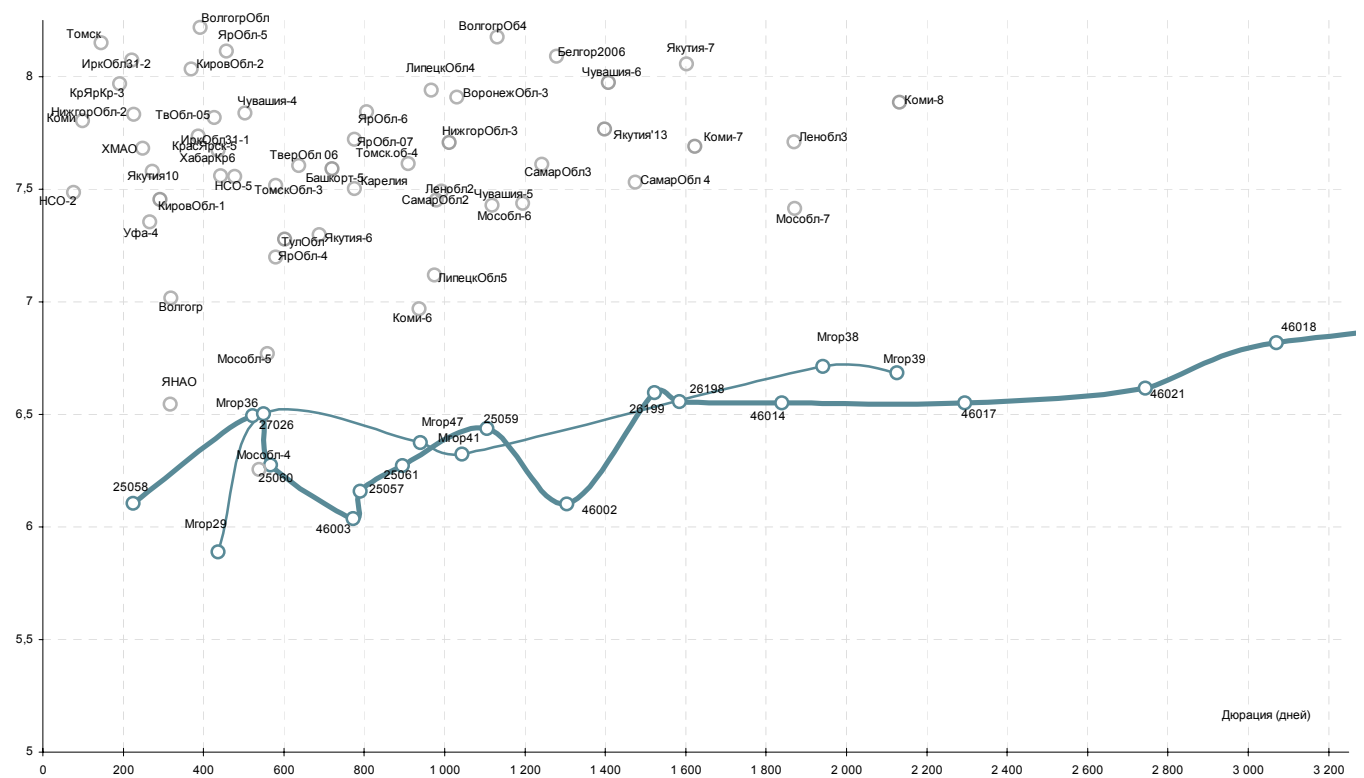
Приложение 6. Российский долговой рынок

Кривая доходности корпоративных облигаций



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Кривая доходности субфедеральных облигаций



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ



Котировки российских облигаций

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | Изм срвзв цены | | Доходность по срвзв цене, % год | | Дюрация, лет |
|----------------------------------|-------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|----------------|-------|---------------------------------|-----------|--------------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | НКД (%) | день | неделя | погашение | |
| Государственные облигации | | | | | | | | | | | | | |
| SU46001RMFS2 | 12.12.2007 | 10,00 | 362 | | 15 | 125,90 | 102,86 | 102,93 | 0,054 | -0,10 | 0,73 | 6,06 | 0,72 |
| SU25058RMFS7 | 31.10.2007 | 6,30 | 229 | | 3 | 35,34 | 100,20 | 100,20 | 0,760 | 0,00 | -0,13 | 6,10 | 0,62 |
| SU27026RMFS2 | 12.12.2007 | 7,00 | 544 | | 1 | 0,10 | 100,00 | 100,00 | 0,038 | -0,34 | -1,10 | 6,49 | 1,43 |
| SU25060RMFS3 | 31.10.2007 | 5,80 | 593 | | 2 | 3,93 | 99,45 | 99,49 | 0,699 | 0,16 | 0,22 | 6,28 | 1,55 |
| SU46003RMFS8 | 16.01.2008 | 10,00 | 1034 | | 16 | 52,20 | 108,95 | 108,67 | 1,589 | 0,54 | 0,07 | 6,04 | 2,12 |
| SU25057RMFS9 | 24.10.2007 | 7,40 | 859 | | 1 | 0,00 | 103,00 | 103,00 | 1,034 | 0,66 | 0,21 | 6,16 | 2,16 |
| SU25061RMFS1 | 07.11.2007 | 5,80 | 964 | | 1 | 1,00 | 99,20 | 99,20 | 0,588 | 0,37 | -0,05 | 6,27 | 2,45 |
| SU25059RMFS5 | 24.10.2007 | 6,10 | 1223 | | 4 | 7,72 | 99,40 | 99,44 | 0,852 | -0,22 | -0,37 | 6,44 | 3,03 |
| SU46002RMFS0 | 13.02.2008 | 9,00 | 1790 | | 2 | 30,72 | 109,00 | 108,98 | 0,740 | -0,02 | 0,27 | 6,10 | 3,57 |
| SU26199RMFS8 | 17.10.2007 | 6,10 | 1762 | | 19 | 335,44 | 98,65 | 98,60 | 0,969 | -0,06 | -0,90 | 6,60 | 4,17 |
| SU26198RMFS0 | 04.11.2007 | 6,00 | 1876 | | 9 | 14,33 | 98,03 | 97,62 | 5,162 | -0,14 | -0,68 | 6,56 | 4,34 |
| SU46014RMFS5 | 12.03.2008 | 9,00 | 4002 | | 3 | 5,36 | 107,50 | 107,21 | 0,049 | -0,29 | -0,15 | 6,55 | 5,04 |
| SU46017RMFS8 | 14.11.2007 | 8,50 | 3246 | | 6 | 2,06 | 105,00 | 104,90 | 0,699 | -0,31 | -0,17 | 6,55 | 6,29 |
| SU46021RMFS0 | 20.02.2008 | 7,50 | 3981 | | 2 | 4,45 | 98,40 | 98,49 | 0,473 | - | -0,06 | 6,62 | 7,52 |
| SU46018RMFS6 | 12.12.2007 | 9,00 | 5185 | | 36 | 416,09 | 107,90 | 107,96 | 0,049 | -0,13 | -0,09 | 6,82 | 8,41 |
| SU46020RMFS2 | 13.02.2008 | 6,90 | 10372 | | 36 | 186,80 | 99,30 | 99,40 | 0,567 | -0,20 | -0,72 | 7,07 | 12,59 |
| Субфедеральные облигации | | | | | | | | | | | | | |
| МГор40-об | 26.10.2007 | 10,00 | 42 | | 0 | 0,00 | 101,05 | 101,05 | 1,370 | - | - | 1,63 | 0,13 |
| МГор43-об | 17.11.2007 | 10,00 | 246 | | 0 | 0,00 | 104,90 | 104,90 | 0,767 | - | 0,00 | 3,05 | 0,69 |
| МГор29-об | 05.12.2007 | 10,00 | 265 | | 0 | 0,00 | 100,20 | 100,30 | 2,767 | - | - | 9,75 | 0,71 |
| МГор41-об | 30.01.2008 | 10,00 | 1050 | | 7 | 29,42 | 106,80 | 106,14 | 1,260 | -0,61 | -1,51 | 6,37 | 2,57 |
| МГор38-об | 26.12.2007 | 10,00 | 1199 | | 0 | 0,00 | 112,70 | 111,05 | 2,192 | - | -0,50 | 6,32 | 2,86 |
| МГор39-об | 21.01.2008 | 10,00 | 2502 | | 2 | 0,22 | 108,25 | 107,87 | 1,507 | -0,03 | -0,53 | 6,71 | 5,32 |
| МГор44-об | 24.12.2007 | 10,00 | 2840 | | 4 | 1,41 | 108,25 | 108,06 | 2,247 | - | -0,19 | 6,69 | 5,82 |
| Башкорт5об | 07.11.2007 | 8,02 | 782 | | 0 | 0,00 | 101,10 | 101,10 | 2,813 | - | 0,00 | 7,59 | 1,97 |
| ИркОбл31-1 | 20.09.2007 | 9,50 | 825 | | 0 | 0,00 | 101,50 | 101,50 | 2,213 | - | 0,00 | 7,67 | 1,19 |
| ИркОбл31-2 | 24.10.2007 | 8,00 | 405 | | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 3,112 | - | 0,00 | 8,07 | 0,61 |
| ИркОбл31-3 | 28.11.2007 | 7,75 | 1167 | | 3 | 16,80 | 98,90 | 98,90 | 1,083 | - | -0,35 | 8,32 | 1,57 |
| Казань 3 | 29.09.2007 | 8,04 | 925 | | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,679 | - | - | 8,20 | 2,26 |
| Казань06об | 28.11.2007 | 8,00 | 715 | | 1 | 10,05 | 99,25 | 99,28 | 0,351 | - | -0,42 | 8,67 | 1,82 |
| КОМИ 5в об | 24.09.2007 | 13,00 | 101 | | 0 | 0,00 | 101,48 | 101,48 | 2,921 | - | 0,11 | 7,80 | 0,27 |
| КОМИ 6в об | 14.10.2007 | 13,50 | 1126 | | 1 | 1,36 | 113,00 | 113,00 | 5,659 | - | 0,10 | 6,97 | 2,56 |
| КОМИ 7в об | 23.11.2007 | 10,00 | 2261 | | 1 | 0,55 | 105,95 | 105,95 | 3,123 | -1,45 | -2,05 | 7,69 | 4,45 |
| КировОбл 1 | 21.09.2007 | 8,39 | 465 | | 0 | 0,00 | 100,90 | 100,90 | 1,954 | - | 0,00 | 7,46 | 0,80 |
| Мос.обл.4в | 23.10.2007 | 11,00 | 585 | | 1 | 1,09 | 107,40 | 107,40 | 1,567 | - | 0,40 | 6,25 | 1,48 |
| Мос.обл.5в | 02.10.2007 | 10,00 | 928 | | 4 | 1,15 | 106,30 | 105,18 | 4,493 | 0,38 | 0,07 | 6,77 | 1,53 |
| Мос.обл.6в | 23.10.2007 | 9,00 | 1313 | | 3 | 7,77 | 105,40 | 105,30 | 3,526 | -0,05 | 0,05 | 7,43 | 3,06 |
| Мос.обл.7в | 24.10.2007 | 8,00 | 2406 | | 3 | 58,13 | 103,70 | 103,70 | 3,112 | 0,08 | -0,33 | 7,41 | 5,12 |
| Томск.об-2 | 13.10.2007 | 10,00 | 29 | | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 4,219 | - | -0,13 | 9,07 | 0,09 |
| Томск.об-3 | 39395 | 8 | 787 | | 0 | 0 | 99,15 | 99,15 | 2,805 | - | 0 | 7,52 | 1,59 |
| Томск 1 | 22.11.2007 | 12,00 | 69 | | 0 | 0,00 | 101,60 | 101,60 | 0,723 | - | - | 8,15 | 0,40 |
| Уфа-2004об | 04.12.2007 | 10,03 | 263 | | 0 | 0,00 | 101,99 | 101,99 | 2,775 | - | 0,00 | 7,36 | 0,73 |
| ХантМан5об | 26.11.2007 | 12,00 | 256 | | 0 | 0,00 | 103,00 | 103,00 | 3,584 | - | -1,00 | 7,68 | 0,68 |
| Якут-10 об | 18.09.2007 | 12,00 | 277 | | 0 | 0,00 | 103,50 | 103,50 | 2,860 | - | 0,00 | 7,58 | 0,74 |
| ЯрОбл-05 | 30.12.2007 | 7,75 | 473 | | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 1,614 | - | 0,06 | 8,11 | 1,25 |
| ЯрОбл-04 | 24.11.2007 | 10,50 | 620 | | 0 | 0,00 | 105,00 | 105,00 | 3,222 | - | 0,00 | 7,20 | 1,59 |
| ЯрОбл-06 | 23.10.2007 | 7,75 | 1313 | | 4 | 55,05 | 99,05 | 99,05 | 3,036 | 0,00 | -0,16 | 7,85 | 2,21 |
| ЯрОбл-07 | 02.10.2007 | 8,50 | 928 | | 0 | 0,00 | 100,30 | 100,30 | 1,700 | - | 0,10 | 7,72 | 2,13 |
| Корпоративные облигации | | | | | | | | | | | | | |
| Машиностроение | | | | | | | | | | | | | |
| АВТОВА3 об | 13.02.2008 | 1,00 | 334 | - | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,90 | 0,082 | - | 0,00 | 1,11 | 0,96 |
| АВТОВА3об3 | 25.12.2007 | 7,70 | 1012 | 284 | 0 | 0,00 | 99,35 | 99,35 | 1,688 | - | -0,60 | - | 8,73 |
| АВТОВА3об4 | 27.11.2007 | 7,80 | 2440 | 620 | 0 | 0,00 | 98,40 | 98,46 | 2,308 | - | -0,98 | - | 8,97 |
| Автоприбор | 31.10.2007 | 12,80 | 593 | 47 | 0 | 0,00 | 99,20 | 99,17 | 4,734 | - | -0,04 | - | 18,40 |
| Вагонмаш 1 | 20.12.2007 | 13,50 | 279 | - | 0 | 0,00 | 100,20 | 100,33 | 3,144 | - | -1,10 | 4,19 | 0,27 |
| Вагонмаш 2 | 19.12.2007 | 11,00 | 1188 | 278 | 0 | 0,00 | 97,50 | 97,50 | 2,592 | - | -0,98 | - | 15,02 |
| ВКМ-Фин1об | 05.12.2007 | 9,75 | 264 | - | 0 | 0,00 | 100,15 | 100,15 | 2,671 | - | 1,15 | 9,72 | 0,70 |
| ВолгоБур01 | 10.10.2007 | 11,00 | 390 | 26 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,70 | 4,701 | - | 0,48 | - | 14,43 |
| ГАЗФин 01 | 12.02.2008 | 8,49 | 1243 | 151 | 7 | 35,55 | 99,65 | 99,47 | 0,721 | -0,08 | -0,52 | - | 9,75 |
| ГИДРОМАШС1 | 27.11.2007 | 9,90 | 802 | 256 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,929 | - | 0,00 | - | 10,10 |
| ГСС 01 | 27.09.2007 | 7,85 | 3481 | 741 | 2 | 15,08 | 96,85 | 96,88 | 3,635 | -0,20 | -0,92 | - | 9,80 |
| ГТ-ТЭЦ 3об | 19.10.2007 | 10,45 | 217 | - | 4 | 0,54 | 99,79 | 99,70 | 4,209 | -0,25 | -0,15 | 11,25 | 0,57 |
| ГТ-ТЭЦ 4об | 05.03.2008 | 10,71 | 719 | - | 9 | 0,57 | 99,95 | 99,55 | 0,264 | -0,35 | -0,29 | 11,27 | 1,82 |
| ЕПК-1 | 04.10.2007 | 9,35 | 384 | 20 | 0 | 0,00 | 99,95 | 99,95 | 4,150 | - | 0,00 | - | 9,64 |
| ИжАвто 02 | 13.12.2007 | 9,79 | 1364 | 454 | 0 | 0,00 | 98,00 | 98,00 | 2,468 | - | -1,00 | - | 11,86 |
| Ижмаш 02 | 18.12.2007 | 13,35 | 277 | - | 2 | 0,42 | 100,10 | 100,10 | 3,230 | - | -0,83 | 13,49 | 0,73 |
| ИРКУТ-03об | 20.09.2007 | 8,74 | 1098 | - | 4 | 36,99 | 103,00 | 103,00 | 4,214 | -0,40 | -0,89 | 7,75 | 2,61 |
| Камаз-Фин2 | 21.09.2007 | 8,45 | 1099 | 371 | 0 | 0,00 | 99,95 | 99,95 | 4,051 | - | 0,05 | - | 8,68 |
| Киров.зд1 | 26.09.2007 | 9,20 | 922 | 376 | 0 | 0,00 | 99,92 | 99,91 | 4,285 | - | 0,01 | - | 9,50 |
| КМЗ-Фин 01 | 13.12.2007 | 9,50 | 1000 | 272 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,30 | 2,395 | - | -0,48 | - | 10,73 |
| КМПО-Фин01 | 18.09.2007 | 9,30 | 914 | 368 | 0 | 0,00 | 99,32 | 99,31 | 4,535 | - | 0,31 | - | 10,28 |
| Криоген 02 | 08.01.2008 | 9,75 | 298 | - | 0 | 0,00 | 99,65 | 99,65 | 1,763 | - | 0,00 | 10,41 | 0,84 |
| КриогенФ 1 | 18.12.2007 | 11,20 | 823 | 277 | 1 | 4,60 | 99,55 | 99,55 | 2,670 | - | -0,05 | - | 12,13 |
| ЛОМО 03 | 16.09.2007 | 12,50 | 722 | 362 | 0 | 0,00 | 100,10 | 100,10 | 6,096 | - | 0,00 | - | 12,77 |
| МетарФ 01 | 13.12.2007 | 12,95 | 1000 | 272 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,264 | - | 0,45 | - | 13,29 |
| МиГ-ф 02 | 11.03.2008 | 8,90 | 1453 | 179 | 0 | 0,00 | 100,56 | 100,56 | 0,073 | - | - | - | 8,19 |
| МиГ-ф обл. | 05.12.2007 | 7,85 | 628 | - | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 2,151 | - | - | 8,31 | 1,68 |
| Мотовил3-1 | 24.01.2008 | 9,40 | 496 | - | 14 | 0,57 | 100,14 | 100,16 | 1,288 | 0,06 | 0,26 | 9,47 | 1,29 |
| МоторФин-1 | 20.09.2007 | 12,00 | 552 | 6 | 1 | 0,01 | 99,00 | 99,00 | 5,786 | -0,10 | -0,07 | 11,04 | 69,55 |
| МоторФин-2 | 17.01.2008 | 10,00 | 1035 | 489 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,562 | - | 0,00 | - | 10,23 |
| ОЗНА-Фин01 | 11.12.2007 | 10,80 | 816 | 88 | 0 | 0,00 | 99,20 | 98,45 | 2,781 | - | -1,15 | - | 16,95 |
| ОМЗ-5 об | 04.03.2008 | 8,80 | 1446 | 718 | 1 | 0,39 | 102,75 | 102,75 | 0,241 | - | 0,65 | - | 7,41 |
| ПМЗ 01 | 23.10.2007 | 9,60 | | | | | | | | | | | |

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | НКД (%) | Изм срвзв цены | | Доходность по срвзв цене, % год | | Дюрация, лет |
|---|-------------|---------------------|------------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|----------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|
| | | | пога-шения | оферты | | | посл | ср взв | | день | неделя | пога-шение | оферта | |
| ПромТр02об | 23.10.2007 | 10,75 | 1495 | 767 | 2 | 4,19 | 100,50 | 100,50 | 4,212 | 0,08 | -0,58 | - | 10,74 | 1,86 |
| ПТПА-Ф1 | 14.11.2007 | 10,60 | 789 | 243 | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,66 | 3,514 | - | 0,00 | - | 11,38 | 0,67 |
| РОССКАТ-К1 | 23.01.2008 | 10,30 | 1041 | 495 | 1 | 5,00 | 98,65 | 98,65 | 1,439 | -1,35 | - | - | 11,70 | 1,28 |
| Ростверт1 | 27.11.2007 | 9,30 | 620 | 74 | 0 | 0,00 | 100,10 | 100,10 | 2,752 | - | -0,29 | - | 8,57 | 0,21 |
| Рыбкaб-1 | 04.12.2007 | 10,75 | 1628 | 172 | 0 | 0,00 | 98,70 | 98,70 | 0,295 | - | -1,95 | - | 14,33 | 0,47 |
| СалютЭнерг | 25.12.2007 | 9,80 | 102 | - | 1 | 0,06 | 99,90 | 99,90 | 2,148 | -0,35 | -0,10 | 9,96 | - | 0,28 |
| СатурнНПО | 22.09.2007 | 8,90 | 191 | - | 0 | 0,00 | 98,00 | 98,50 | 4,243 | - | -1,30 | 12,25 | - | 0,51 |
| СатурнНПО2 | 21.09.2007 | 9,25 | 1467 | 189 | 0 | 0,00 | 99,55 | 99,55 | 4,460 | - | 0,00 | - | 10,37 | 0,51 |
| СатурнНПО3 | 07.12.2007 | 8,75 | 2457 | 448 | 0 | 0,00 | 98,00 | 98,00 | 2,349 | - | -0,42 | - | 10,78 | 1,17 |
| СевКаб 02 | 04.12.2007 | 10,50 | 441 | 81 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 0,259 | - | 0,50 | - | 12,76 | 0,22 |
| СевКаб 03 | 02.10.2007 | 11,25 | 1656 | 382 | 2 | 51,03 | 100,00 | 100,00 | 2,250 | 0,00 | 0,20 | - | 11,73 | 0,98 |
| СевКаб обл | 06.10.2007 | 12,50 | 22 | - | 0 | 0,00 | 99,60 | 99,80 | 2,329 | - | -0,15 | 15,34 | - | 0,06 |
| СевСтАвто | 24.01.2008 | 8,00 | 860 | - | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,67 | 1,096 | - | -1,24 | 8,32 | - | 2,18 |
| СевСтАвто2 | 23.01.2008 | 7,70 | 2133 | 1041 | 30 | 837,44 | 99,25 | 99,66 | 1,076 | - | - | - | 7,98 | 2,59 |
| СОКАвто 01 | 25.10.2007 | 12,00 | 223 | - | 0 | 0,00 | 99,55 | 99,55 | 4,636 | - | -0,20 | 13,12 | - | 0,59 |
| СРЗ-фин 01 | 13.12.2007 | 12,50 | 818 | 90 | 2 | 0,10 | 99,00 | 99,00 | 3,151 | -0,83 | -0,75 | - | 16,21 | 0,25 |
| ТВЗ 03 | 21.12.2007 | 9,25 | 1008 | 280 | 0 | 0,00 | 100,80 | 100,40 | 2,129 | - | -0,70 | - | 8,86 | 0,75 |
| ТензорФ-01 | 20.11.2007 | 12,20 | 795 | 249 | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 3,844 | - | 0,00 | - | 12,42 | 0,68 |
| Трансмаш-1 | 01.12.2007 | 1,00 | 78 | - | 0 | 0,00 | 97,03 | 97,02 | 0,288 | - | - | 14,66 | - | 0,22 |
| Трансмаш-2 | 14.02.2008 | 8,60 | 1245 | 517 | 5 | 0,01 | 100,50 | 100,50 | 0,683 | - | 0,48 | - | 8,38 | 1,36 |
| УЗПС 01 | 13.12.2007 | 12,00 | 1000 | 272 | 0 | 0,00 | 98,40 | 97,81 | 3,025 | - | -0,69 | - | 15,70 | 0,72 |
| УМПО 2 | 20.12.2007 | 9,50 | 825 | 279 | 0 | 0,00 | 99,45 | 99,45 | 2,212 | - | -0,15 | - | 10,49 | 0,74 |
| УралВагЗФ | 02.10.2007 | 9,40 | 382 | - | 8 | 7,78 | 99,45 | 99,55 | 4,224 | -0,18 | -0,68 | 10,10 | - | 0,98 |
| УралВагЗФ2 | 03.10.2007 | 9,35 | 1117 | 19 | 11 | 13,96 | 99,95 | 99,95 | 4,175 | 0,04 | 0,01 | - | 9,91 | 0,05 |
| ЭМАльянс 1 | 11.01.2008 | 10,00 | 1393 | 301 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 1,726 | - | -0,05 | - | 10,89 | 0,81 |
| ЭнергмашФ1 | 27.11.2007 | 11,50 | 1530 | 256 | 0 | 0,00 | 100,30 | 100,30 | 3,403 | - | -0,70 | - | 11,30 | 0,69 |
| Атомстройэкспорт | 27.11.2007 | 7,75 | 1348 | 627 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,293 | - | - | - | - | 0,00 |
| Металлургия, горнодобывающая, трубная промышленность | | | | | | | | | | | | | | |
| Амурмет-01 | 28.02.2008 | 9,80 | 531 | - | 3 | 3,52 | 100,20 | 100,19 | 0,403 | - | -0,46 | 9,88 | - | 1,39 |
| Амурмет-02 | 28.02.2008 | 9,15 | 896 | - | 1 | 0,00 | 100,20 | 100,20 | 0,351 | 0,30 | 0,50 | 9,27 | - | 2,24 |
| Белон 01 | 05.12.2007 | 9,10 | 628 | - | 0 | 0,00 | 100,30 | 99,80 | 2,493 | - | -0,30 | 9,43 | - | 1,60 |
| Белон 02 | 28.02.2008 | 9,25 | 1623 | 713 | 0 | 0,00 | 100,30 | 100,00 | 0,380 | - | 0,00 | - | 9,46 | 1,85 |
| ДиПОС 01 | 25.12.2007 | 10,60 | 1740 | 284 | 0 | 0,00 | 100,15 | 100,15 | 2,323 | - | 0,00 | - | 10,63 | 0,80 |
| Инпром 02 | 17.01.2008 | 8,80 | 1035 | 489 | 3 | 1,52 | 100,10 | 99,83 | 1,374 | -0,16 | -0,37 | - | 9,12 | 1,28 |
| Инпром 03 | 21.11.2007 | 8,95 | 1342 | 432 | 7 | 9,74 | 100,05 | 99,54 | 2,795 | -0,46 | -0,39 | - | 9,57 | 1,12 |
| Кокс 01 | 17.01.2008 | 8,95 | 671 | - | 0 | 0,00 | 99,45 | 99,44 | 1,398 | - | -0,42 | 9,49 | - | 1,72 |
| Кокс 02 | 20.09.2007 | 8,70 | 1644 | 916 | 12 | 287,63 | 99,45 | 99,49 | 4,195 | 0,48 | -0,26 | - | 9,13 | 2,21 |
| Магнезит 1 | 20.12.2007 | 8,25 | 461 | - | 4 | 34,49 | 99,51 | 99,51 | 1,921 | - | -0,43 | 8,84 | - | 1,20 |
| Магнезит 2 | 09.10.2007 | 8,75 | 1291 | 567 | 0 | 0,00 | 99,55 | 99,53 | 3,716 | - | 0,13 | - | 9,28 | 1,44 |
| МаирИнв-02 | 27.11.2007 | 10,80 | 74 | - | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,50 | 3,196 | - | -1,20 | 17,80 | - | 0,21 |
| МаирИнв-03 | 03.10.2007 | 11,15 | 565 | - | 1 | 1,04 | 99,00 | 99,00 | 4,979 | - | -1,14 | 12,45 | - | 1,07 |
| Максиг 01 | 13.03.2008 | 14,00 | 545 | 181 | 13 | 8,02 | 99,93 | 99,95 | 0,038 | 0,75 | 0,04 | - | 14,10 | 0,50 |
| Метзавод | 29.02.2008 | 8,75 | 532 | - | 0 | 0,00 | 97,70 | 97,70 | 0,336 | - | 0,05 | 10,76 | - | 1,40 |
| Метсерв-Ф1 | 28.11.2007 | 10,50 | 1713 | 257 | 4 | 33,75 | 99,20 | 99,20 | 3,078 | - | 0,03 | - | 12,00 | 0,68 |
| Мечел 2об | 19.12.2007 | 8,40 | 2098 | 1006 | 2 | 2,07 | 101,60 | 101,60 | 1,979 | -0,10 | -0,94 | - | 7,89 | 2,47 |
| МечелСГ1об | 22.11.2007 | 5,50 | 69 | - | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,90 | 1,703 | - | - | 5,91 | - | 0,20 |
| НижЛенинв | 08.01.2008 | 12,00 | 298 | - | 1 | 0,01 | 99,50 | 99,50 | 2,170 | - | -0,40 | 12,85 | - | 0,79 |
| НижЛенинв2 | 20.12.2007 | 13,00 | 643 | - | 0 | 0,00 | 100,30 | 100,30 | 3,027 | - | 0,00 | 13,18 | - | 1,61 |
| НМЗ 1 обл. | 15.02.2008 | 10,25 | 884 | 336 | 0 | 0,00 | 98,90 | 98,96 | 0,814 | - | 0,00 | - | 11,72 | 0,95 |
| НОК-02 | 27.09.2007 | 12,30 | 1469 | 377 | 0 | 0,00 | 100,59 | 100,58 | 5,695 | - | 0,00 | - | 12,03 | 0,99 |
| ОМК 1 об | 06.12.2007 | 9,20 | 272 | - | 0 | 0,00 | 101,21 | 101,21 | 2,495 | - | 0,91 | 7,62 | - | 0,73 |
| РМК-ФИН 01 | 09.10.2007 | 8,75 | 935 | - | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,75 | 3,764 | - | 0,00 | 9,05 | - | 2,31 |
| РусАлФ-Зв | 21.09.2007 | 7,20 | 373 | - | 0 | 0,00 | 99,95 | 99,16 | 3,492 | - | -0,08 | 8,23 | - | 0,98 |
| СвобСокол2 | 22.11.2007 | 11,75 | 69 | - | 0 | 0,00 | 100,20 | 100,20 | 3,638 | - | 0,20 | 10,35 | - | 0,20 |
| СвобСокол3 | 27.11.2007 | 11,57 | 1348 | 438 | 0 | 0,00 | 99,98 | 99,97 | 3,423 | - | -0,03 | - | 11,90 | 1,13 |
| СПК об.01 | 27.11.2007 | 10,20 | 984 | 438 | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,75 | 3,018 | - | - | - | 10,66 | 1,20 |
| ТМК-02 обл | 25.09.2007 | 7,60 | 557 | - | 8 | 10,77 | 100,00 | 99,96 | 3,561 | 0,32 | 0,18 | 7,77 | - | 1,42 |
| ТМК-03 обл | 19.02.2008 | 7,95 | 1250 | 158 | 12 | 210,51 | 99,85 | 99,88 | 0,523 | - | -0,10 | - | 8,19 | 0,43 |
| ТЧМ 02обл. | 02.12.2007 | 8,00 | 79 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,279 | - | - | 7,93 | - | 0,40 |
| УГМК-УЭМО1 | 04.03.2008 | 8,25 | 1628 | 900 | 0 | 0,00 | 100,20 | 100,20 | 0,226 | - | 0,25 | - | 8,32 | 2,28 |
| ХайлендГФ1 | 03.10.2007 | 12,75 | 201 | - | 2 | 46,51 | 100,09 | 100,09 | 2,515 | - | 0,18 | 13,17 | - | 0,53 |
| ЧТПЗ 01об | 19.12.2007 | 9,50 | 1006 | 278 | 0 | 0,00 | 101,45 | 101,45 | 2,238 | - | 0,95 | - | 7,63 | 0,74 |
| Нефтегазовая отрасль | | | | | | | | | | | | | | |
| Альянс-01 | 19.09.2007 | 8,92 | 1461 | 733 | 0 | 0,00 | 99,10 | 99,10 | 0,000 | - | 0,00 | - | 9,64 | 1,82 |
| АСПЭК-01 | 03.10.2007 | 12,00 | 929 | 383 | 0 | 0,00 | 99,74 | 99,72 | 2,367 | - | 0,91 | - | 12,86 | 0,99 |
| ГАЗПРОМ А4 | 13.02.2008 | 8,22 | 880 | - | 52 | 35,44 | 102,80 | 102,81 | 0,676 | 0,08 | -0,46 | 7,05 | - | 2,23 |
| ГАЗПРОМ А5 | 09.10.2007 | 7,58 | 25 | - | 1 | 0,00 | 100,09 | 100,09 | 3,260 | -0,01 | 0,02 | 6,07 | - | 0,07 |
| ГАЗПРОМ А6 | 07.02.2008 | 6,95 | 692 | - | 6 | 14,21 | 100,15 | 100,18 | 0,685 | 0,08 | 0,28 | 6,96 | - | 1,80 |
| ГАЗПРОМ А7 | 01.11.2007 | 6,79 | 776 | - | 2 | 17,39 | 100,00 | 100,00 | 2,493 | 0,00 | -0,20 | 6,90 | - | 1,97 |
| ГАЗПРОМ А8 | 01.11.2007 | 7,00 | 1504 | - | 8 | 23,88 | 99,20 | 99,23 | 2,570 | -0,26 | -0,46 | 7,35 | - | 3,56 |
| ГАЗПРОМ А9 | 20.02.2008 | 7,23 | 2343 | - | 1 | 0,00 | 100,80 | 100,80 | 0,456 | 0,30 | 0,20 | 7,20 | - | 5,23 |
| ГАЗЭКСФ 1 | 20.12.2007 | 10,50 | 1189 | 279 | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,50 | 2,445 | - | 0,35 | - | 10,01 | 0,75 |
| ГЭС 01 | 26.12.2007 | 8,00 | 1741 | - | 1 | 2,99 | 98,00 | 98,00 | 1,732 | 0,00 | -1,51 | 8,70 | - | 3,98 |
| ИнтеграФ-1 | 21.09.2007 | 10,50 | 553 | - | 1 | 20,91 | 99,65 | 99,65 | 5,034 | - | -0,85 | 11,04 | - | 1,37 |
| ИнтеграФ-2 | 04.12.2007 | 10,70 | 1537 | 809 | 0 | 0,00 | 101,20 | 100,85 | 2,961 | - | -1,08 | - | 10,51 | 1,98 |
| КмплФин 01 | 07.02.2008 | 12,50 | 874 | 328 | 1 | 0,50 | 98,50 | 98,50 | 1,233 | -0,50 | -0,50 | - | 14,81 | 0,87 |
| Лукойл2обл | 20.11.2007 | 7,25 | 795 | 67 | 1 | 10,28 | 100,50 | 100,50 | 2,284 | -0,09 | -0,35 | 7,11 | - | 4,40 |
| Лукойл3обл | 13.12.2007 | 7,10 | 1546 | - | 10 | 2,02 | 99,35 | 99,26 | 1,790 | -0,10 | -0,26 | 7,43 | - | 3,67 |
| Лукойл4обл | 13.12.2007 | 7,40 | 2274 | - | 31 | 82,53 | 100,15 | 100,26 | 1,865 | -0,19 | -0,01 | 7,48 | - | 5,01 |
| МарийНПЗ | 18.12.2007 | 11,10 | 459 | - | 0 | 0,00 | 99,15 | 99,29 | 2,646 | - | -0,41 | 12,03 | - | 1,19 |
| МарийНПЗ 2 | 20.12.2007 | 12,00 | 1189 | 279 | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,61 | 2,795 | - | -1,02 | - | 14,39 | 0,74 |
| МособгазФ1 | 20.12.2007 | 10,75 | 464 | - | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,80 | 2,474 | - | -0,45 | 11,30 | - | 0,80 |
| МособгазФ2 | 25.12.2007 | 9,25 | 1745 | - | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 2,027 | - | 0,00 | 9,79 | - | 3,29 |
| Мособлгаз1 | 15.11.2007 | 8,80 | 1341 | 244 | 0 | 0,00 | 98,30 | 98,30 | 2,893 | - | 0,14 | - | 11,79 | 0,65 |
| НКАльянс1 | 19.09.2007 | 8,92 | 1461 | - | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 4,326 | - | - | - | - | 0,00 |
| РуссНефть1 | 14.12.2007 | 9,25 | 1183 | 455 | 6 | 1,72 | 88,90 | 88,99 | 2,306 | 0,26 | 2,92 | - | 20,54 | 1,18 |
| СахатрнфГ1 | 05.12.2007 | 11,90 | 810 | 264 | 0 | 0,00 | 100,80 | 100,80 | 3,260 | - | 0,00 | - | 10,96 | 0,70 |
| СтрТргаз01 | 26.12.2007 | 9,60 | 285 | - | 14 | 20,46 | 99,8 | | | | | | | |

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | | Изм срвзв | | Доходность по | | Дюрация, лет | |
|---|-------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|-----------|--------|---------------|--------|--------------|------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | НКД (%) | день | неделя | погашение | оферта | | |
| ТоппромИн1 | 19.10.2007 | 12,50 | 945 | 217 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 1,918 | - | -0,23 | - | 14,04 | 0,58 | |
| Удмнефтпр | 01.12.2007 | 9,50 | 353 | - | 2 | 50,17 | 100,00 | 100,00 | 0,338 | - | -0,11 | 9,84 | - | 0,93 | |
| УфаойлОП-1 | 18.10.2007 | 12,00 | 944 | 216 | 1 | 0,00 | 98,25 | 98,25 | 4,866 | 0,00 | -0,08 | - | 15,72 | 0,56 | |
| ФазтонаФ 1 | 31.01.2008 | 10,50 | 685 | 139 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,237 | - | - | - | 10,44 | 0,44 | |
| Пищепром | | | | | | | | | | | | | | | |
| АгрикаГП 1 | 02.10.2007 | 11,80 | 746 | 200 | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 5,302 | - | 0,03 | - | 12,02 | 0,53 | |
| Агроком 01 | 25.12.2007 | 10,00 | 1376 | 466 | 0 | 0,00 | 94,00 | 94,25 | 2,192 | - | - | - | 15,63 | 1,21 | |
| Агрохолд 1 | 19.10.2007 | 12,75 | 679 | 308 | 6 | 1,99 | 99,00 | 99,45 | 1,956 | 0,45 | -0,09 | - | 14,13 | 0,80 | |
| Аладушкин2 | 28.11.2007 | 12,30 | 1531 | 803 | 2 | 0,36 | 101,00 | 101,21 | 3,606 | 0,36 | 0,21 | - | 11,98 | 1,93 | |
| Аркада-01 | 26.12.2007 | 13,20 | 288 | - | 0 | 0,00 | 99,20 | 99,20 | 2,785 | - | -0,60 | 15,06 | - | 0,64 | |
| Аркада-02 | 21.02.2008 | 13,31 | 525 | - | 1 | 0,01 | 99,98 | 99,98 | 0,839 | - | -0,02 | 13,75 | - | 1,08 | |
| Аркада-03 | 04.10.2007 | 13,65 | 1294 | 384 | 2 | 0,01 | 99,50 | 99,50 | 6,058 | 0,00 | 0,44 | - | 14,66 | 0,96 | |
| Балтика1об | 20.11.2007 | 8,75 | 67 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,757 | - | -0,15 | 8,52 | - | 0,19 | |
| Балтимор03 | 15.11.2007 | 11,25 | 244 | - | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,71 | 3,699 | - | -0,19 | 12,00 | - | 0,64 | |
| Белгркор-1 | 04.12.2007 | 10,90 | 445 | 81 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,299 | - | 3,84 | - | 10,88 | 0,23 | |
| БелФрегат1 | 13.12.2007 | 14,50 | 825 | 90 | 4 | 0,34 | 100,00 | 99,80 | 0,040 | - | -0,63 | - | 15,33 | 0,25 | |
| БородинФ-1 | 19.12.2007 | 10,50 | 824 | 278 | 0 | 0,00 | 99,59 | 99,59 | 2,474 | - | 0,00 | - | 11,32 | 0,76 | |
| ВБД ПП 2об | 19.12.2007 | 9,00 | 1188 | - | 0 | 0,00 | 102,25 | 102,25 | 2,121 | - | -0,25 | 8,36 | - | 2,85 | |
| ВолшКрай-1 | 04.12.2007 | 11,50 | 445 | 81 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,182 | - | - | - | 11,16 | 0,23 | |
| ВостСервФ1 | 13.03.2008 | 10,99 | 727 | 181 | 2 | 35,97 | 99,99 | 99,99 | 0,030 | - | -0,11 | - | 11,01 | 0,50 | |
| ВТК 1 | 21.12.2007 | 12,50 | 826 | 98 | 1 | 0,01 | 99,50 | 99,50 | 2,877 | - | 0,00 | - | 14,03 | 0,27 | |
| Держава-Ф | 29.01.2008 | 13,50 | 1047 | 319 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,664 | - | - | 13,94 | - | 13,90 | 0,84 |
| ДжейЭфСиг1 | 25.10.2007 | 9,25 | 1497 | 405 | 0 | 0,00 | 97,00 | 97,03 | 3,573 | - | -1,97 | - | 12,52 | 1,05 | |
| ДжейЭфСи 2 | 04.12.2007 | 5,00 | 81 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,384 | - | 0,00 | 4,95 | - | 0,27 | |
| ДымКолбПр1 | 02.11.2007 | 10,99 | 777 | 231 | 0 | 0,00 | 99,60 | 99,60 | 4,005 | - | -0,30 | - | 11,94 | 0,62 | |
| Евросервис | 18.09.2007 | 13,25 | 95 | - | 0 | 0,00 | 99,96 | 99,97 | 3,158 | - | 0,00 | 14,02 | - | 0,27 | |
| ЗавГ росс01 | 18.10.2007 | 12,50 | 951 | 216 | 0 | 0,00 | 99,79 | 99,79 | 1,952 | - | 1,02 | - | 13,48 | 0,57 | |
| Инмарко 1 | 21.12.2007 | 10,50 | 462 | 98 | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 2,416 | - | 0,32 | - | 10,08 | 0,27 | |
| КАРАТ 02 | 19.12.2007 | 12,00 | 824 | 96 | 1 | 4,08 | 99,50 | 99,50 | 2,630 | - | 0,00 | - | 14,20 | 0,28 | |
| ЛекФин 2об | 19.02.2008 | 5,00 | 522 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,329 | - | - | - | - | 0,00 | |
| МельнКомб | 28.02.2008 | 4,00 | 531 | - | 0 | 0,00 | 99,97 | 100,00 | 0,164 | - | 4,99 | 1,29 | - | 1,45 | |
| Митлэнд-01 | 20.11.2007 | 12,50 | 886 | 158 | 0 | 0,00 | 99,99 | 99,99 | 0,822 | - | -0,01 | - | 13,10 | 0,43 | |
| МСельПром1 | 14.12.2007 | 12,50 | 455 | - | 1 | 0,51 | 99,00 | 99,00 | 3,116 | -0,14 | -0,41 | 13,80 | - | 1,16 | |
| НастюшаЗК1 | 21.12.2007 | 12,50 | 826 | 280 | 0 | 0,00 | 100,00 | 99,98 | 2,877 | - | -0,02 | - | 12,85 | 0,74 | |
| Нордтекс-1 | 26.10.2007 | 12,00 | 413 | 42 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 4,603 | - | 0,70 | - | 19,27 | 0,13 | |
| НутрИнв1об | 11.12.2007 | 9,50 | 634 | 270 | 0 | 0,00 | 99,40 | 99,41 | 0,078 | - | -0,48 | - | 10,74 | 0,73 | |
| ОбКондФ-01 | 21.11.2007 | 7,70 | 1706 | 978 | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,05 | 2,405 | - | - | - | 8,25 | 2,48 | |
| ОГО-агро-2 | 26.02.2008 | 12,95 | 530 | - | 5 | 0,32 | 99,00 | 99,00 | 0,639 | 0,00 | -0,40 | 14,33 | - | 1,16 | |
| ОГО-агро-3 | 04.01.2008 | 13,50 | 1029 | 294 | 2 | 0,51 | 99,00 | 99,00 | 2,589 | 0,00 | -0,03 | - | 15,33 | 0,77 | |
| ОСТ-2об | 08.11.2007 | 12,50 | 237 | - | 0 | 0,00 | 99,60 | 99,60 | 4,350 | - | -0,04 | 13,81 | - | 0,43 | |
| ОХЗ-Инв 01 | 21.11.2007 | 12,50 | 796 | 250 | 0 | 0,00 | 99,99 | 99,99 | 0,788 | - | 0,00 | - | 13,11 | 0,70 | |
| Очаково-02 | 21.09.2007 | 8,50 | 371 | - | 0 | 0,00 | 96,10 | 96,10 | 4,075 | - | -0,90 | 16,65 | - | 0,53 | |
| ПАВА 01 об | 15.09.2007 | 1,00 | 275 | 1 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,247 | - | - | - | - | 0,00 | |
| ПАВА 02 об | 11.11.2007 | 12,50 | 1498 | 238 | 0 | 0,00 | 102,30 | 102,30 | 1,096 | - | 0,00 | - | 9,27 | 0,66 | |
| Парнас-М 2 | 22.11.2007 | 10,80 | 1525 | 797 | 4 | 11,87 | 97,90 | 98,00 | 0,651 | - | 0,21 | - | 12,39 | 1,96 | |
| ПИВДОМ 01 | 25.10.2007 | 13,00 | 951 | 405 | 0 | 0,00 | 99,30 | 99,30 | 5,022 | - | - | - | 14,07 | 1,10 | |
| РазгуляйФ1 | 04.10.2007 | 1,00 | 384 | - | 0 | 0,00 | 81,00 | 81,00 | 0,444 | - | 0,00 | 22,97 | - | 1,07 | |
| РазгуляйФ2 | 02.10.2007 | 10,25 | 1474 | 200 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 4,605 | - | -0,25 | - | 11,48 | 0,53 | |
| РЕСТОРАНСЗ | 30.11.2007 | 10,75 | 1169 | - | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 3,092 | - | 0,05 | - | - | 0,00 | |
| Рост-Лайн1 | 10.01.2008 | 12,75 | 1028 | 300 | 0 | 0,00 | 100,10 | 100,10 | 2,236 | - | 0,00 | - | 12,98 | 0,85 | |
| РубПлсРег1 | 04.12.2007 | 12,00 | 991 | 445 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 3,321 | - | 0,00 | - | 12,80 | 1,14 | |
| Русагро 01 | 18.01.2008 | 8,50 | 309 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,304 | - | - | 8,67 | - | 0,93 | |
| РусМасла-2 | 04.10.2007 | 12,50 | 1658 | 384 | 0 | 0,00 | 99,05 | 99,45 | 5,548 | - | 0,45 | - | 13,48 | 0,97 | |
| РусМоре-01 | 20.09.2007 | 9,50 | 1735 | 279 | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,90 | 2,212 | - | 0,40 | - | 9,98 | 0,74 | |
| РусТекс 2 | 06.03.2008 | 12,75 | 538 | - | 0 | 0,00 | 98,00 | 97,07 | 0,280 | - | -1,53 | 16,23 | - | 1,10 | |
| РусТекс 3 | 23.10.2007 | 12,00 | 767 | 39 | 6 | 2,41 | 100,20 | 100,00 | 4,701 | 0,25 | 0,10 | - | 11,47 | 0,11 | |
| СанвэйГ 01 | 05.12.2007 | 10,00 | 446 | 82 | 0 | 0,00 | 99,65 | 99,66 | 2,740 | - | 0,00 | - | 11,15 | 0,24 | |
| СанИнтБрю2 | 14.02.2008 | 8,00 | 699 | - | 0 | 0,00 | 99,25 | 99,25 | 0,636 | - | 0,00 | 8,60 | - | 1,82 | |
| СахарКо 01 | 13.11.2007 | 12,75 | 788 | 242 | 0 | 0,00 | 99,25 | 99,25 | 4,262 | - | -0,25 | - | 14,38 | 0,64 | |
| СБ-Финанс1 | 24.09.2007 | 10,14 | 1739 | 283 | 0 | 0,00 | 100,02 | 100,01 | 2,250 | - | 0,00 | - | 10,51 | 0,78 | |
| Синергия-1 | 24.10.2007 | 10,70 | 586 | 40 | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,75 | 4,163 | - | -0,20 | - | 12,44 | 0,11 | |
| Синергия-2 | 24.01.2008 | 10,70 | 1042 | 496 | 21 | 182,08 | 99,63 | 99,63 | 1,466 | - | - | - | 11,28 | 1,28 | |
| СодружФ-1 | 25.10.2007 | 10,45 | 769 | - | 2 | 1,50 | 99,39 | 99,39 | 4,037 | - | 0,39 | 11,06 | - | 1,87 | |
| СОРУС КАП1 | 08.11.2007 | 10,20 | 783 | 55 | 2 | 1,46 | 99,50 | 99,53 | 1,006 | -0,11 | 0,53 | - | 13,25 | 0,15 | |
| ТалостоФ-1 | 07.03.2008 | 10,00 | 539 | - | 100 | 991,36 | 100,00 | 99,97 | 0,192 | - | -0,02 | 10,27 | - | 1,41 | |
| Черемушки | 03.03.2008 | 11,30 | 535 | 171 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,341 | - | 0,00 | - | 13,46 | 0,49 | |
| Черкизово1 | 04.12.2007 | 8,85 | 1355 | 627 | 0 | 0,00 | 99,10 | 99,10 | 2,449 | - | -0,69 | - | 9,63 | 1,60 | |
| Эрконпрод1 | 13.03.2008 | 11,40 | 727 | 181 | 2 | 4,95 | 99,00 | 99,00 | 0,031 | -0,43 | -0,50 | - | 13,55 | 0,50 | |
| ЭФКО-02 об | 25.01.2008 | 10,50 | 861 | 133 | 4 | 42,03 | 99,50 | 99,85 | 1,410 | - | -0,15 | - | 10,78 | 0,36 | |
| ЭФКО-02 об | 25.01.2008 | 10,50 | 861 | 133 | 4 | 42,03 | 99,50 | 99,85 | 1,410 | - | -0,15 | - | 10,78 | 0,36 | |
| Югтранзит2 | 27.11.2007 | 11,50 | 438 | - | 0 | 0,00 | 101,00 | 97,29 | 3,403 | - | - | 14,26 | - | 1,23 | |
| Юнимилк 01 | 11.03.2008 | 9,75 | 1453 | 725 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,080 | - | -0,68 | - | 9,99 | 1,85 | |
| Потребительские товары, розничная торговля | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7Контин-02 | 20.12.2007 | 7,80 | 1735 | 643 | 6 | 53,60 | 97,30 | 97,30 | 1,816 | -0,13 | -0,29 | - | 9,71 | 1,65 | |
| АвтомирФ-1 | 04.03.2008 | 1,00 | 718 | - | 0 | 0,00 | 99,85 | 99,85 | 0,027 | - | - | 1,25 | - | 1,90 | |
| АвтомирФ-2 | 26.12.2007 | 10,75 | 1013 | 467 | 3 | 20,27 | 98,99 | 98,99 | 2,327 | - | -0,04 | - | 11,93 | 1,20 | |
| АЛПИ-Инв-1 | 22.02.2008 | 10,99 | 707 | 343 | 1 | 0,01 | 98,51 | 98,51 | 0,632 | -1,03 | -0,14 | - | 13,11 | 0,91 | |
| Алькор-01 | 11.12.2007 | 10,75 | 816 | 88 | 0 | 0,00 | 99,40 | 99,40 | 2,768 | - | 0,05 | - | 12,93 | 0,24 | |
| АлтЗвб об | 01.01.2008 | 9,89 | 655 | 291 | 0 | 0,00 | 98,30 | 98,30 | 1,978 | - | -1,25 | 11,24 | - | 0,78 | |
| Арбат 01 | 21.12.2007 | 10,50 | 280 | - | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,50 | 2,416 | - | -0,51 | 12,94 | - | 0,74 | |
| Атлант-М 1 | 15.11.2007 | 12,25 | 426 | - | 0 | 0,00 | 98,00 | 98,00 | 4,027 | - | -1,51 | 13,71 | - | 1,09 | |
| БАНАНА-М-1 | 26.10.2007 | 11,25 | 770 | 42 | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,70 | 4,315 | - | -0,10 | - | 13,12 | 0,13 | |
| БАНАНА-М-2 | 14.02.2008 | 11,50 | 1063 | 517 | 0 | 0,00 | 97,45 | 97,45 | 0,914 | - | -0,65 | - | 13,97 | 1,34 | |
| Бахетле-1 | 21.11.2007 | 11,25 | 978 | 250 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 3,514 | - | -0,34 | - | 12,33 | 0,66 | |
| Бразерск 1 | 21.09.2007 | 12,50 | 833 | 98 | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,37 | 2,877 | - | -0,65 | - | 15,75 | 0,26 | |
| Вежа-Инв-1 | 04.03.2008 | 12,75 | 900 | 172 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,349 | - | 0,09 | - | 14,96 | 0,47 | |
| Виват-фин1 | 23.10.2007 | 12,00 | 949 | 403 | 0 | 0,00 | 99,30 | 99,28 | 4,701 | - | 0,03 | - | 13,09 | 1,03 | |
| ВикторияФ | 31.01.2008 | 10,40 | 503 | - | 0 | 0,00 | 99,85 | 99,85 | 1,225 | - | -0,40 | 10,7 | | | |

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | | Изм срвзв | | Доходность по | | Дюрация, день |
|--------------------------------------|-------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|-----------|--------|---------------|--------|---------------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | НКД (%) | день | неделя | погашение | оферта | |
| Домоцентр1 | 10.01.2008 | 11,50 | 1028 | 482 | 0 | 0,00 | 99,45 | 99,45 | 2,016 | - | -0,05 | - | 12,29 | 1,24 |
| Европа-01 | 18.10.2007 | 10,75 | 1126 | 398 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 4,359 | - | 0,00 | - | 11,21 | 1,06 |
| ЕВРОПА-01 | 18.10.2007 | 10,75 | 1126 | 398 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 4,359 | - | 0,00 | - | 11,21 | 1,06 |
| Евросеть-2 | 04.12.2007 | 10,25 | 627 | 81 | 17 | 21,00 | 98,20 | 97,85 | 2,836 | -0,42 | 1,23 | - | 19,80 | 0,22 |
| ИКС5Фин 01 | 08.01.2008 | 7,60 | 2482 | 1026 | 1 | 0,00 | 98,25 | 98,25 | 1,374 | 0,75 | 0,35 | - | 8,48 | 2,55 |
| ИмплозияФ1 | 30.01.2008 | 11,25 | 320 | - | 5 | 12,97 | 99,99 | 99,99 | 1,356 | 0,41 | 0,04 | 11,55 | - | 0,85 |
| ИнкомЛада1 | 22.11.2007 | 12,00 | 69 | - | 2 | 0,03 | 99,90 | 99,93 | 0,723 | 0,33 | -0,02 | 12,29 | - | 0,19 |
| ИнкомЛада2 | 16.11.2007 | 12,00 | 882 | 154 | 0 | 0,00 | 99,60 | 99,60 | 0,921 | - | -0,05 | - | 13,60 | 0,42 |
| ИнкомЛада3 | 14.12.2007 | 11,00 | 1365 | 637 | 1 | 76,13 | 97,95 | 98,95 | 0,000 | - | 0,00 | - | 12,18 | 1,59 |
| Карус. Ф 01 | 20.09.2007 | 9,75 | 2190 | 370 | 4 | 4,67 | 99,45 | 99,03 | 4,701 | - | -0,76 | - | 11,07 | 0,94 |
| КОПЕЙКА 01 | 18.09.2007 | 9,40 | 277 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,241 | - | 0,00 | 9,73 | - | 0,75 |
| КОПЕЙКА 02 | 21.11.2007 | 8,70 | 1615 | 523 | 4 | 30,26 | 96,80 | 97,07 | 0,548 | 0,07 | -0,68 | - | 11,39 | 1,35 |
| КОПЕЙКА 03 | 21.11.2007 | 9,80 | 1615 | 341 | 0 | 0,00 | 99,10 | 99,10 | 0,618 | - | -0,74 | 10,44 | 10,14 | 3,62 |
| КОРА УК 01 | 16.10.2007 | 12,00 | 669 | 123 | 12 | 1,06 | 99,20 | 98,60 | 1,940 | - | -1,10 | - | 17,34 | 0,30 |
| Лаверна 01 | 11.10.2007 | 11,00 | 937 | 391 | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,88 | 4,671 | - | -0,02 | - | 11,41 | 1,13 |
| МагнитФ 01 | 21.11.2007 | 9,34 | 432 | - | 0 | 0,00 | 100,35 | 100,37 | 2,917 | - | -0,38 | 9,19 | - | 1,13 |
| МагнитФ 02 | 28.09.2007 | 8,20 | 1652 | 924 | 0 | 0,00 | 97,35 | 97,40 | 3,774 | - | -2,10 | 9,11 | 9,59 | 3,72 |
| МагнитФ 02 | 28.09.2007 | 8,20 | 1652 | 924 | 0 | 0,00 | 97,35 | 97,40 | 3,774 | - | -2,10 | 9,11 | 9,59 | 3,72 |
| Магнолия-1 | 25.10.2007 | 11,95 | 1042 | 314 | 5 | 37,56 | 99,60 | 99,60 | 1,637 | 0,97 | - | - | 13,02 | 0,82 |
| МартаФин 1 | 22.11.2007 | 14,84 | 251 | - | 1 | 0,01 | 97,05 | 97,05 | 4,594 | -0,95 | -1,18 | 20,45 | - | 0,65 |
| МартаФин 2 | 07.12.2007 | 12,00 | 814 | - | 0 | 0,00 | 98,45 | 98,45 | 3,255 | - | -0,97 | 13,20 | - | 1,96 |
| МартаФин 3 | 31.01.2008 | 13,00 | 1418 | 139 | 8 | 26,43 | 97,60 | 97,59 | 1,496 | 0,29 | -0,08 | - | 19,60 | 0,38 |
| МатрицаФ-1 | 12.12.2007 | 12,00 | 453 | - | 2 | 1,10 | 97,00 | 97,00 | 3,058 | 0,50 | -0,58 | 15,22 | - | 1,16 |
| МвидеоФ-01 | 21.11.2007 | 10,00 | 796 | 68 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,123 | - | - | - | 9,77 | 0,27 |
| МИРФинанс1 | 27.12.2007 | 10,50 | 104 | - | 0 | 0,00 | 99,91 | 99,91 | 2,273 | - | 0,01 | 10,58 | - | 0,29 |
| МонеткаФ-1 | 15.11.2007 | 10,70 | 608 | 62 | 0 | 0,00 | 99,40 | 99,40 | 3,518 | - | -0,30 | - | 13,63 | 0,18 |
| МОСМАРТФ 1 | 18.10.2007 | 11,00 | 1672 | 216 | 0 | 0,00 | 96,50 | 96,50 | 4,460 | - | -2,73 | - | 18,14 | 0,57 |
| НатурПрод2 | 18.12.2007 | 10,75 | 641 | 95 | 0 | 0,00 | 100,00 | 99,89 | 2,562 | - | -0,20 | - | 10,90 | 0,27 |
| НовЧерем 2 | 23.10.2007 | 11,30 | 221 | - | 14 | 9,66 | 97,99 | 98,00 | 1,610 | -2,00 | -2,00 | 15,63 | - | 0,58 |
| Орхидея 01 | 11.10.2007 | 10,70 | 573 | 27 | 1 | 1,02 | 99,89 | 99,89 | 1,876 | 0,19 | -0,09 | - | 11,98 | 0,07 |
| Патэрсон 1 | 20.09.2007 | 10,00 | 825 | 279 | 0 | 0,00 | 99,35 | 99,35 | 2,329 | - | -0,15 | - | 11,34 | 0,74 |
| ПротекФин1 | 07.11.2007 | 8,90 | 1510 | 782 | 0 | 0,00 | 98,40 | 98,40 | 3,121 | - | 0,15 | - | 9,97 | 1,95 |
| ПятерочкаФ | 14.11.2007 | 11,45 | 971 | - | 0 | 0,00 | 109,30 | 109,30 | 3,796 | - | - | 7,88 | - | 2,49 |
| ПятерочФ 2 | 18.12.2007 | 9,30 | 1187 | - | 0 | 0,00 | 103,70 | 103,70 | 2,217 | - | 0,00 | 8,15 | - | 2,88 |
| САМОХВАЛ-1 | 24.10.2007 | 11,40 | 768 | 222 | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 4,435 | - | 0,08 | - | 11,58 | 0,58 |
| СпортМ-Ф-1 | 23.11.2007 | 8,80 | 980 | 434 | 0 | 0,00 | 100,19 | 100,19 | 2,700 | - | - | - | 8,82 | 1,28 |
| ТехИнвст-1 | 29.11.2007 | 10,00 | 1350 | 258 | 2 | 0,55 | 97,00 | 97,00 | 2,904 | -0,30 | -1,00 | - | 15,08 | 0,68 |
| Топкнига-1 | 07.02.2008 | 0,00 | 510 | - | 0 | 0,00 | 125,00 | 105,83 | 0,000 | - | - | - | - | 0,00 |
| Топкнига-2 | 13.12.2007 | 10,51 | 1182 | 454 | 10 | 0,51 | 100,00 | 100,00 | 2,649 | -0,50 | 0,00 | - | 10,76 | 1,17 |
| УНИКУМ-Ф 1 | 18.12.2007 | 12,50 | 823 | 95 | 1 | 0,01 | 98,70 | 98,70 | 2,979 | 0,29 | -0,08 | - | 17,21 | 0,26 |
| ХолидФин1 | 04.10.2007 | 11,15 | 930 | 384 | 4 | 7,79 | 98,70 | 98,85 | 4,949 | - | -0,22 | - | 12,71 | 0,97 |
| Строительство, стройматериалы | | | | | | | | | | | | | | |
| АдаманФ1об | 06.12.2007 | 12,10 | 265 | - | 1 | 1,34 | 99,80 | 99,80 | 3,282 | -0,10 | -0,18 | 12,71 | - | 0,70 |
| АдаманФ2об | 22.11.2007 | 11,25 | 979 | 433 | 1 | 0,50 | 99,70 | 99,70 | 0,678 | 0,05 | -0,15 | - | 12,03 | 1,12 |
| Востокем1 | 22.11.2007 | 12,00 | 797 | 69 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,715 | - | -0,01 | - | 11,58 | 0,19 |
| ГлМосСтр-2 | 20.09.2007 | 11,50 | 1280 | 6 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,93 | 5,545 | - | 0,03 | - | 13,59 | 0,02 |
| ДКС ФЖС-1 | 27.11.2007 | 12,00 | 802 | 74 | 11 | 0,72 | 99,82 | 99,81 | 3,551 | - | -0,05 | - | 12,52 | 0,20 |
| ЖК-Финанс1 | 20.09.2007 | 14,00 | 832 | 97 | 3 | 0,51 | 98,09 | 98,00 | 3,260 | -0,50 | -1,90 | - | 23,80 | 0,26 |
| ИнкомФин01 | 27.09.2007 | 13,10 | 561 | 196 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 6,065 | - | -0,20 | 13,93 | 13,91 | 0,52 |
| Искитим-02 | 07.11.2007 | 12,50 | 418 | 54 | 5 | 0,52 | 100,00 | 100,00 | 1,267 | - | 0,00 | - | 12,34 | 0,15 |
| КамскДол 2 | 17.10.2007 | 13,50 | 33 | - | 2 | 0,12 | 100,45 | 100,45 | 2,108 | -0,04 | 0,01 | 8,32 | - | 0,09 |
| КамскДол 3 | 12.12.2007 | 12,80 | 629 | 269 | 1 | 0,91 | 100,45 | 100,45 | 0,035 | 0,05 | 0,00 | - | 12,72 | 0,71 |
| КосмосФин1 | 20.12.2007 | 11,25 | 1371 | 279 | 0 | 0,00 | 99,50 | 98,75 | 2,620 | - | 0,00 | - | 13,37 | 0,74 |
| ЛСР-Инв 01 | 04.12.2007 | 10,70 | 816 | 263 | 2 | 44,66 | 101,00 | 101,00 | 2,961 | - | 0,00 | - | 9,44 | 0,71 |
| ЛСР-Инв 02 | 17.01.2008 | 8,35 | 1399 | 671 | 0 | 0,00 | 97,75 | 97,75 | 1,304 | - | 0,32 | - | 9,94 | 1,72 |
| Метрострой | 28.09.2007 | 8,47 | 1470 | 196 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,899 | - | - | - | 8,62 | 0,71 |
| МИАН-Дев-1 | 04.03.2008 | 12,37 | 900 | 354 | 0 | 0,00 | 95,00 | 95,00 | 0,339 | - | 0,00 | - | 18,93 | 0,96 |
| М-ИНДУСТР | 19.02.2008 | 12,25 | 1432 | - | 3 | 8,74 | 105,45 | 105,45 | 0,805 | 0,35 | 0,95 | 10,79 | - | 3,23 |
| Миракс 01 | 19.02.2008 | 10,50 | 340 | - | 5 | 20,23 | 99,52 | 100,45 | 0,690 | - | -0,05 | 10,22 | - | 0,91 |
| Миракс 02 | 20.09.2007 | 10,99 | 734 | - | 0 | 0,00 | 101,50 | 101,50 | 5,299 | - | -0,10 | 10,40 | - | 1,78 |
| МИЭЛЬ-Ф 01 | 15.01.2008 | 12,13 | 1033 | 305 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,961 | - | 0,00 | - | 12,45 | 0,83 |
| ММ-Фин 02 | 08.01.2008 | 11,65 | 1754 | 298 | 2 | 86,44 | 99,00 | 99,00 | 2,107 | - | -0,40 | - | 13,34 | 0,79 |
| МОИА 01 | 21.12.2007 | 9,00 | 1194 | - | 0 | 0,00 | 95,00 | 95,05 | 2,096 | - | -4,94 | 11,59 | - | 2,27 |
| МОИА 02 | 08.03.2008 | 7,99 | 1454 | 96 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,153 | - | -2,00 | 8,52 | 11,82 | 0,27 |
| МОИТК-01 | 27.09.2007 | 9,00 | 743 | - | 2 | 2,85 | 97,40 | 97,58 | 4,191 | -0,42 | -1,05 | 11,25 | - | 1,25 |
| МОРЕ-П 01 | 05.02.2008 | 12,25 | 1054 | 326 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,275 | - | - | - | 12,59 | 0,86 |
| ПИК-5об | 20.11.2007 | 9,20 | 249 | - | 0 | 0,00 | 100,02 | 100,02 | 0,605 | - | 0,00 | 9,46 | - | 0,46 |
| ПТПА-Ф1 | 14.11.2007 | 10,60 | 789 | 243 | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,66 | 3,514 | - | 0,00 | - | 11,38 | 0,67 |
| РУБИН-01 | 16.10.2007 | 12,15 | 760 | 32 | 0 | 0,00 | 99,45 | 99,45 | 4,993 | - | 0,03 | - | 17,29 | 0,09 |
| СибАкИнв-1 | 01.02.2008 | 12,30 | 1050 | 504 | 0 | 0,00 | 98,55 | 98,55 | 1,415 | - | -0,70 | - | 13,91 | 1,30 |
| СибакСтр01 | 13.11.2007 | 12,50 | 606 | 242 | 9 | 2,37 | 96,00 | 96,46 | 4,178 | - | -1,89 | - | 19,15 | 0,63 |
| СибЦем 01 | 13.12.2007 | 9,70 | 272 | - | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 2,445 | - | 0,00 | 10,19 | - | 0,73 |
| СпецСтр2 1 | 22.11.2007 | 8,59 | 979 | 251 | 0 | 0,00 | 100,06 | 100,03 | 2,659 | - | 0,00 | - | 8,70 | 0,71 |
| СУ-155 Зоб | 20.02.2008 | 10,30 | 1615 | 159 | 1 | 0,50 | 99,20 | 99,20 | 0,649 | 0,00 | -0,44 | - | 12,16 | 0,44 |
| СуварКаз-1 | 02.10.2007 | 12,50 | 564 | 200 | 6 | 2,31 | 99,00 | 99,09 | 5,616 | -0,13 | -0,61 | - | 14,76 | 0,52 |
| СэтлГрупп1 | 19.11.2007 | 11,70 | 1705 | 248 | 2 | 0,02 | 100,15 | 100,15 | 3,686 | 0,00 | 0,15 | - | 13,32 | 0,65 |
| Терна-Ф 01 | 18.09.2007 | 1,00 | 459 | 95 | 0 | 0,00 | 96,00 | 96,00 | 0,238 | - | - | - | 12,44 | 0,38 |
| Терна-Ф 02 | 09.11.2007 | 12,60 | 1512 | 56 | 3 | 20,69 | 97,50 | 97,51 | 4,350 | -1,69 | -1,67 | - | 28,30 | 0,15 |
| ТехНикольФ | 13.03.2008 | 9,70 | 1636 | 727 | 0 | 0,00 | 98,40 | 98,40 | 0,027 | - | -0,22 | - | 10,89 | 1,86 |
| ТНИКОЛЬ-Ф1 | 14.11.2007 | 10,00 | 789 | 243 | 0 | 0,00 | 99,20 | 99,20 | 3,315 | - | 0,00 | - | 11,54 | 0,65 |
| ЦУН 01 обл | 25.10.2007 | 11,25 | 951 | 223 | 0 | 0,00 | 100,25 | 100,25 | 4,346 | - | 0,00 | - | 10,83 | 0,56 |
| ЦУН 02 обл | 23.01.2008 | 11,19 | 859 | 313 | 0 | 0,00 | 99,85 | 99,85 | 1,564 | - | 1,15 | - | 11,51 | 0,84 |

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | НКД (%) | Изм срвзв цены | | Доходность по срвзв цене, % год | | Дюрация, лет |
|--------------------------|--------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|----------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | | день | неделя | погашение | оферта | |
| Телекоммуникации | | | | | | | | | | | | | | |
| Артели 01 | 18.01.2008 | 12,00 | 672 | 308 | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,70 | 1,841 | - | - | - | 12,71 | 0,95 |
| ВлгТлкВТ-2 | 04.12.2007 | 8,20 | 1173 | 445 | 0 | 0,00 | 100,60 | 100,60 | 2,269 | - | 0,00 | - | 7,82 | 1,18 |
| ВлгТлкВТ-3 | 04.12.2007 | 8,50 | 1173 | - | 1 | 19,62 | 101,70 | 101,70 | 2,352 | - | -0,79 | 7,78 | - | 2,01 |
| ВлгТлкВТ-4 | 11.12.2007 | 7,99 | 2181 | 725 | 3 | 2,99 | 99,70 | 99,72 | 0,066 | -0,28 | -0,78 | - | 8,40 | 1,85 |
| ДальСвз2об | 05.12.2007 | 8,85 | 1720 | 992 | 0 | 0,00 | 103,80 | 103,80 | 2,425 | - | 0,00 | - | 7,39 | 2,41 |
| ДальСвз3об | 05.12.2007 | 8,60 | 628 | - | 0 | 0,00 | 100,79 | 100,72 | 2,356 | - | 0,37 | 8,02 | - | 1,02 |
| МГТС-04 об | 24.10.2007 | 7,10 | 586 | 222 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,762 | - | - | - | 7,20 | 0,74 |
| МГТС-05 об | 27.11.2007 | 7,10 | 984 | 256 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,101 | - | 1,00 | - | 7,20 | 0,69 |
| МегаФон3об | 16.10.2007 | 9,25 | 214 | - | 0 | 0,00 | 100,60 | 100,60 | 3,801 | - | -0,60 | 8,33 | - | 0,57 |
| РАДИОНЕТ-1 | 26.02.2008 | 11,45 | 348 | - | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,70 | 0,533 | - | -0,05 | 12,12 | - | 0,93 |
| СЗТелек2об | 03.10.2007 | 7,50 | 19 | - | 0 | 0,00 | 99,98 | 99,98 | 1,480 | - | 0,00 | 7,66 | - | 0,08 |
| СЗТелек3об | 29.11.2007 | 9,25 | 1259 | 167 | 0 | 0,00 | 100,45 | 100,45 | 0,380 | - | - | - | 8,50 | 0,46 |
| СЗТелек4об | 13.12.2007 | 8,10 | 1546 | 454 | 1 | 0,00 | 102,00 | 102,00 | 0,022 | 1,00 | - | 7,65 | - | 3,06 |
| СЗТелек4об | 13.12.2007 | 8,10 | 1546 | 454 | 1 | 0,00 | 102,00 | 102,00 | 0,022 | 1,00 | - | 7,65 | - | 3,06 |
| СибТлк-5об | 26.10.2007 | 9,20 | 224 | - | 0 | 0,00 | 100,60 | 100,60 | 3,529 | - | 0,07 | 8,32 | - | 0,60 |
| СибТлк-6об | 20.09.2007 | 7,85 | 1098 | 370 | 0 | 0,00 | 99,40 | 99,43 | 3,785 | - | -0,01 | - | 8,62 | 0,97 |
| СибТлк-7об | 21.11.2007 | 8,65 | 614 | - | 0 | 0,00 | 101,65 | 101,65 | 2,702 | - | 0,00 | 7,74 | - | 1,60 |
| СМАРТС 03 | 02.10.2007 | 14,10 | 746 | 18 | 10 | 0,75 | 99,00 | 98,13 | 6,335 | -0,37 | -1,00 | - | 49,81 | 0,05 |
| УралСвзИн4 | 01.11.2007 | 9,99 | 48 | - | 5 | 0,47 | 100,35 | 100,27 | 3,668 | - | -0,12 | 7,63 | - | 0,13 |
| УралСвзИн5 | 18.10.2007 | 9,19 | 216 | - | 0 | 0,00 | 101,09 | 101,00 | 3,726 | - | 0,00 | 7,65 | - | 0,61 |
| УрСИ сер06 | 22.11.2007 | 8,20 | 1525 | 433 | 0 | 0,00 | 100,20 | 100,17 | 2,539 | - | -0,33 | - | 8,19 | 1,13 |
| УрСИ сер07 | 18.09.2007 | 8,40 | 1642 | 550 | 0 | 0,00 | 100,40 | 100,40 | 4,096 | - | 0,00 | - | 8,28 | 1,41 |
| ЦентрТел-4 | 19.02.2008 | 13,80 | 707 | - | 14 | 99,30 | 109,00 | 109,23 | 0,945 | -0,09 | -1,04 | 8,70 | - | 1,76 |
| ЦентрТел-5 | 04.03.2008 | 8,09 | 1446 | 354 | 1 | 2,00 | 99,90 | 99,90 | 0,222 | - | -0,51 | - | 8,36 | 0,95 |
| ЦНТ-03 обл | 03.10.2007 | 9,75 | 565 | - | 1 | 5,14 | 100,90 | 100,90 | 1,923 | - | 0,90 | 9,43 | - | 1,43 |
| ЮТК-03 об. | 09.10.2007 | 10,90 | 757 | 25 | 12 | 30,37 | 100,13 | 100,13 | 4,718 | -0,02 | -0,04 | - | 8,59 | 0,07 |
| ЮТК-04 об. | 12.12.2007 | 10,00 | 817 | - | 1 | 4,33 | 102,00 | 102,00 | 0,055 | -0,46 | -1,00 | 8,83 | - | 1,40 |
| ЮТК-05 об. | 05.12.2007 | 7,55 | 1720 | 992 | 3 | 11,59 | 97,00 | 97,45 | 2,068 | - | -1,30 | - | 8,80 | 2,45 |
| Транспорт | | | | | | | | | | | | | | |
| ДВТГ-Ф 01 | 05.02.2008 | 10,75 | 1054 | 508 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,82 | 1,119 | - | 0,00 | - | 11,17 | 1,34 |
| КААД-2 | 22.11.2007 | 10,50 | 251 | 69 | 4 | 51,57 | 100,05 | 100,05 | 3,251 | - | 0,22 | - | 9,91 | 0,19 |
| КДавиаФин1 | 24.10.2007 | 13,00 | 950 | 222 | 1 | 0,21 | 99,30 | 99,30 | 5,058 | 0,40 | -0,25 | - | 14,68 | 0,58 |
| РЖД-02обл | 05.12.2007 | 7,75 | 82 | - | 0 | 0,00 | 100,10 | 100,10 | 2,123 | - | 0,00 | 7,19 | - | 0,24 |
| РЖД-03обл | 05.12.2007 | 8,33 | 810 | - | 3 | 20,95 | 102,70 | 102,48 | 2,282 | - | -0,52 | 7,22 | - | 2,03 |
| РЖД-05обл | 24.01.2008 | 6,67 | 496 | - | 9 | 77,49 | 99,20 | 99,34 | 0,914 | -0,03 | -0,36 | 7,31 | - | 1,31 |
| РЖД-06обл | 14.11.2007 | 7,35 | 1153 | - | 11 | 30,55 | 99,95 | 100,09 | 2,437 | -0,21 | -0,18 | 7,45 | - | 2,81 |
| РЖД-07обл | 14.11.2007 | 7,55 | 1881 | - | 0 | 0,00 | 101,20 | 101,20 | 2,503 | - | -0,30 | 7,40 | - | 4,27 |
| Сибирь-01 | 22.01.2008 | 10,70 | 1768 | 494 | 0 | 0,00 | 99,68 | 99,68 | 1,524 | - | 0,00 | - | 11,24 | 1,30 |
| ТрансаэроФ | 07.02.2008 | 10,66 | 510 | - | 0 | 0,00 | 99,09 | 98,95 | 1,051 | - | -0,69 | 11,80 | - | 1,33 |
| Усть-Луга1 | 15.11.2007 | 9,90 | 881 | - | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,50 | 0,787 | - | - | 10,02 | - | 2,17 |
| ЭйрЮнион01 | 13.11.2007 | 13,50 | 788 | - | 7 | 1,72 | 99,45 | 99,35 | 1,147 | 0,21 | -0,21 | 12,66 | - | 1,61 |
| ЮТэйр-Ф 03 | 18.12.2007 | 10,40 | 1187 | 459 | 4 | 2,27 | 96,20 | 96,27 | 2,479 | -0,04 | -1,68 | - | 14,16 | 1,18 |
| финансовый сектор | | | | | | | | | | | | | | |
| Абсолют 02 | 01.10.2007 | 8,00 | 290 | - | 0 | 0,00 | 100,81 | 100,81 | 1,622 | - | 0,00 | 7,18 | - | 0,81 |
| АВТОВАЗБ-1 | 05.10.2007 | 11,95 | 931 | 203 | 8 | 3,88 | 98,77 | 99,10 | 2,292 | -0,50 | -0,60 | - | 14,35 | 0,53 |
| АИЖК 1об | 01.12.2007 | 11,00 | 444 | - | 1 | 42,77 | 106,50 | 106,50 | 3,164 | - | - | 6,03 | - | 1,28 |
| АИЖК 2об | 01.02.2008 | 11,00 | 871 | - | 0 | 0,00 | 106,75 | 106,75 | 1,326 | - | - | 7,99 | - | 2,15 |
| АИЖК 3об | 15.10.2007 | 9,40 | 1127 | - | 1 | 3,17 | 104,20 | 104,20 | 1,571 | -0,31 | -0,90 | 7,14 | - | 1,71 |
| АИЖК 4об | 01.11.2007 | 8,70 | 1601 | - | 0 | 0,00 | 105,00 | 105,00 | 1,049 | - | 0,00 | 7,56 | - | 3,69 |
| АИЖК 5об | 15.10.2007 | 7,35 | 1858 | - | 0 | 0,00 | 99,37 | 99,37 | 1,228 | - | -0,63 | 7,71 | - | 4,24 |
| АИЖК 6об | 15.10.2007 | 7,40 | 2496 | - | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,05 | 1,237 | - | 0,00 | 7,60 | - | 4,74 |
| АИЖК 7об | 15.10.2007 | 7,68 | 3227 | - | 2 | 2,52 | 99,96 | 99,96 | 1,284 | -0,05 | -0,24 | 7,91 | - | 5,50 |
| АИЖК 8об | 15.09.2007 | 7,63 | 3927 | 2374 | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,80 | 1,902 | - | 0,00 | 7,69 | - | 4,67 |
| АИЖК 9об | 15.11.2007 | 7,49 | 3442 | 2711 | 1 | 1,99 | 99,10 | 99,10 | 0,616 | -0,07 | -0,30 | 7,88 | - | 7,89 |
| АК БАРС-02 | 24.01.2008 | 8,00 | 496 | - | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,88 | 1,096 | - | 0,00 | 9,07 | - | 1,32 |
| АКИБАНК-1 | 25.10.2007 | 11,60 | 587 | 223 | 1 | 10,34 | 98,96 | 98,96 | 4,481 | - | -0,50 | - | 13,82 | 0,58 |
| АльянсФин1 | 26.12.2007 | 8,76 | 1741 | 1013 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,894 | - | - | - | 8,94 | 2,48 |
| БанкСЮЮ301 | 25.10.2007 | 9,25 | 223 | - | 14 | 51,65 | 100,75 | 100,46 | 1,267 | -0,54 | -0,39 | 8,73 | - | 0,59 |
| БанкСЮЮ302 | 04.10.2007 | 8,37 | 752 | 21 | 2 | 1,35 | 99,85 | 99,85 | 3,738 | -0,06 | -0,10 | 8,62 | - | 11,16 |
| БПФ-01 | 15.11.2007 | 11,50 | 517 | - | 0 | 0,00 | 99,70 | 99,70 | 0,914 | - | -0,03 | 12,25 | - | 1,32 |
| ВБРР Обл. | 06.10.2007 | 10,00 | 758 | - | 0 | 0,00 | 112,24 | 112,24 | 1,918 | - | - | 4,20 | - | 2,00 |
| ВТБ - 4 об | 20.09.2007 | 6,30 | 552 | 188 | 0 | 0,00 | 100,55 | 100,06 | 3,038 | - | 0,00 | - | 6,27 | 0,54 |
| ВТБ - 5 об | 25.10.2007 | 5,90 | 2225 | 223 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,808 | - | 0,20 | - | 6,03 | 0,61 |
| ВТБ - 6 об | 17.10.2007 | 5,75 | 3218 | 306 | 0 | 0,00 | 100,30 | 99,86 | 0,914 | - | 0,00 | - | 6,05 | 0,86 |
| Газбанк 01 | 20.11.2007 | 10,50 | 438 | 67 | 0 | 0,00 | 99,99 | 99,99 | 3,308 | - | -0,20 | - | 10,23 | 0,19 |
| ГазпромБ 1 | 31.01.2008 | 7,10 | 1231 | - | 2 | 49,42 | 100,65 | 100,65 | 0,836 | 2,40 | 1,40 | 7,00 | - | 3,04 |
| ГазпромБ 2 | 28.11.2007 | 6,54 | 2259 | 75 | 1 | 203,83 | 100,05 | 100,05 | 1,917 | - | 0,00 | - | 6,22 | 0,24 |
| ДельтаКр-1 | 04.12.2007 | 7,09 | 809 | - | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,50 | 1,962 | - | - | 7,00 | - | 2,52 |
| ДельтаКр-1 | 04.12.2007 | 7,09 | 809 | - | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,50 | 1,962 | - | - | 7,00 | - | 2,52 |
| ЕврокомФК1 | 21.12.2007 | 11,50 | 826 | 98 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 2,647 | - | -0,15 | - | 11,21 | 0,28 |
| ЕврокомФК3 | 21.12.2007 | 9,48 | 1008 | 462 | 1 | 10,20 | 99,90 | 99,90 | 2,182 | - | 0,10 | - | 9,77 | 1,20 |
| ЖилФин об1 | 21.09.2007 | 9,25 | 462 | 98 | 0 | 0,00 | 99,89 | 99,89 | 2,129 | - | - | - | 9,92 | 0,32 |
| Зенит 2обл | 16.02.2008 | 8,39 | 521 | - | 0 | 0,00 | 99,10 | 99,10 | 0,644 | - | -0,10 | 9,27 | - | 1,37 |
| Зенит 3обл | 14.11.2007 | 8,45 | 1517 | 61 | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,76 | 2,801 | - | -0,10 | - | 9,62 | 0,17 |
| Зенит 4обл | 04.10.2007 | 8,13 | 935 | 203 | 0 | 0,00 | 99,40 | 99,40 | 3,631 | - | -0,08 | - | 9,44 | 0,54 |
| ИмпэксБ-02 | 20.10.2007 | 1,00 | 219 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,400 | - | - | 1,28 | - | 1,01 |
| Инвестторг | 16.10.2007 | 10,25 | 396 | - | 0 | 0,00 | 100,15 | 100,15 | 4,212 | - | - | - | - | 0,00 |
| КБРенКап-1 | 04.03.2008 | 10,45 | 900 | 354 | 0 | 0,00 | 100,40 | 100,40 | 0,286 | - | 0,00 | - | 10,27 | 0,97 |
| Кедр-02 | 18.09.2007</ | | | | | | | | | | | | | |

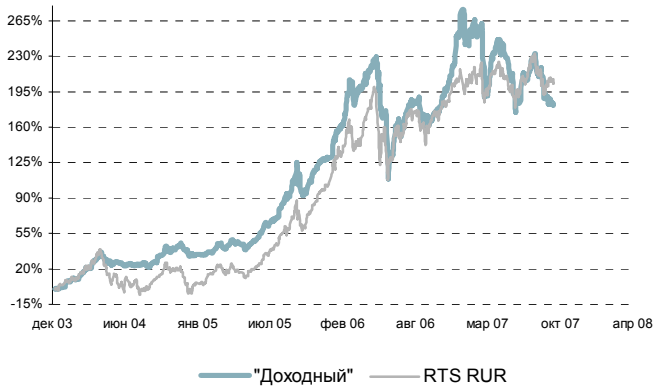
| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | НКД (%) | Изм срвзв цены | | Доходность по срвзв цене, % год | | Дюрация, лет |
|-------------------|-------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|----------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | | день | неделя | погашение | оферта | |
| МИА-Зобл | 29.11.2007 | 7,95 | 1623 | 531 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,327 | - | 0,30 | - | 8,19 | 1,39 |
| МКБ 02обл | 06.12.2007 | 10,40 | 629 | 83 | 1 | 0,00 | 99,40 | 99,40 | 2,821 | - | -0,50 | - | 12,76 | 0,23 |
| ММБ 02обл. | 13.02.2008 | 6,50 | 516 | - | 0 | 0,00 | 100,85 | 100,85 | 0,534 | - | - | - | - | 0,00 |
| МОИА 01 | 21.12.2007 | 9,00 | 1194 | - | 0 | 0,00 | 95,00 | 95,05 | 2,096 | - | -4,94 | 11,59 | - | 2,27 |
| МОИА 02 | 08.03.2008 | 7,99 | 1454 | 96 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,153 | - | -2,00 | 8,52 | 11,82 | 0,27 |
| МоскомцБ | 05.12.2007 | 9,30 | 453 | 82 | 0 | 0,00 | 100,09 | 100,09 | 2,548 | - | -0,11 | - | 8,68 | 0,23 |
| МоскомцБ-2 | 19.02.2008 | 8,40 | 1250 | 340 | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,80 | 0,552 | - | - | - | 8,77 | 1,01 |
| НОМОС 7в | 18.12.2007 | 8,25 | 641 | 95 | 3 | 14,72 | 99,60 | 99,60 | 1,966 | -0,43 | -0,25 | - | 9,64 | 0,26 |
| Открытие01 | 13.11.2007 | 11,00 | 424 | - | 0 | 0,00 | 99,05 | 99,05 | 0,934 | - | -0,45 | 13,10 | - | 0,64 |
| ПРББ-5 | 31.10.2007 | 9,69 | 593 | - | 0 | 0,00 | 100,04 | 100,04 | 3,584 | - | - | - | 9,00 | 1,62 |
| Промсвб-04 | 01.11.2007 | 8,20 | 48 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,010 | - | - | 8,00 | - | 0,19 |
| Промсвб-05 | 22.11.2007 | 7,99 | 1707 | 615 | 0 | 0,00 | 98,80 | 98,80 | 2,474 | - | -1,20 | - | 8,95 | 1,58 |
| РМБ | 26.10.2007 | 11,00 | 591 | 225 | 2 | 2,58 | 99,10 | 98,98 | 4,249 | 0,08 | -0,74 | - | 13,12 | 0,59 |
| РОСБАНК-1 | 15.02.2008 | 7,89 | 520 | - | 0 | 0,00 | 101,00 | 101,00 | 0,627 | - | 0,00 | 7,13 | - | 1,37 |
| РосселхБ 2 | 21.11.2007 | 7,85 | 1251 | - | 8 | 60,31 | 100,00 | 100,00 | 0,495 | - | 0,11 | 8,08 | - | 3,02 |
| РосселхБ 3 | 21.02.2008 | 7,34 | 3436 | 888 | 7 | 94,81 | 98,30 | 98,34 | 0,442 | 0,13 | -0,11 | - | 8,27 | 2,26 |
| РосселхозБ | 05.12.2007 | 7,20 | 264 | - | 1 | 254,10 | 100,10 | 100,10 | 0,178 | - | - | 7,29 | - | 1,04 |
| РТК-ЛИЗ 4с | 09.10.2007 | 8,80 | 207 | - | 0 | 0,00 | 100,25 | 100,25 | 3,785 | - | 0,00 | 8,31 | - | 0,41 |
| РТК-ЛИЗ 5с | 14.02.2008 | 8,35 | 1063 | - | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,664 | - | -0,75 | 9,11 | - | 1,83 |
| РусСтанд-4 | 03.03.2008 | 8,25 | 171 | - | 10 | 398,23 | 97,90 | 97,93 | 0,271 | -0,07 | -0,99 | 12,90 | - | 0,47 |
| РусСтанд-5 | 13.03.2008 | 8,50 | 1091 | 363 | 0 | 0,00 | 96,77 | 96,77 | 0,023 | - | -0,23 | - | 12,40 | 0,98 |
| РусСтанд-6 | 13.02.2008 | 8,15 | 1244 | 516 | 2 | 34,83 | 94,00 | 94,00 | 0,670 | 0,39 | 0,21 | - | 13,33 | 1,35 |
| РусСтанд-7 | 25.09.2007 | 8,50 | 1467 | 193 | 3 | 61,15 | 97,93 | 97,93 | 3,982 | - | -0,07 | - | 13,05 | 0,51 |
| РусСтанд-8 | 19.10.2007 | 8,25 | 1673 | 399 | 1 | 0,02 | 96,60 | 96,60 | 3,323 | 1,00 | 1,62 | - | 11,97 | 1,03 |
| Русфинанс1 | 04.12.2007 | 7,65 | 445 | - | 0 | 0,00 | 101,15 | 101,15 | 2,117 | - | - | 7,07 | - | 1,69 |
| Русфинанс2 | 04.12.2007 | 7,50 | 445 | - | 0 | 0,00 | 101,35 | 101,35 | 2,075 | - | - | 6,62 | - | 1,41 |
| Русфинанс2 | 04.12.2007 | 7,50 | 445 | - | 0 | 0,00 | 101,35 | 101,35 | 2,075 | - | - | 6,62 | - | 1,41 |
| Русфинанс4 | 15.02.2008 | 7,74 | 882 | - | 0 | 0,00 | 99,95 | 99,22 | 0,594 | - | 0,00 | 8,26 | - | 1,26 |
| РусьБанк-1 | 20.09.2007 | 10,00 | 552 | - | 10 | 54,08 | 98,90 | 99,32 | 4,822 | -0,68 | -0,78 | 10,77 | - | 2,37 |
| РусьБанк-2 | 21.02.2008 | 9,50 | 892 | 343 | 9 | 21,82 | 98,55 | 98,70 | 0,599 | -0,38 | -1,74 | - | 11,28 | 0,92 |
| СвязьБанк1 | 25.10.2007 | 8,90 | 1315 | 587 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 1,219 | - | -0,20 | - | 9,92 | 1,50 |
| СевКазна-1 | 04.10.2007 | 10,75 | 748 | 20 | 9 | 42,74 | 99,71 | 99,73 | 2,091 | -0,17 | -0,32 | - | 15,40 | 0,05 |
| СКБ-банк 1 | 20.09.2007 | 9,75 | 1014 | 279 | 2 | 4,00 | 97,65 | 97,68 | 2,271 | - | -0,16 | - | 13,63 | 0,73 |
| СлавИнв 02 | 29.10.2007 | 9,00 | 409 | 45 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 3,378 | - | 0,00 | - | 11,62 | 0,17 |
| Солидарн-1 | 30.11.2007 | 10,75 | 809 | 77 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,295 | - | -0,84 | - | 15,96 | 0,21 |
| Солидарн-2 | 23.10.2007 | 10,70 | 949 | 221 | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,30 | 1,524 | - | 0,00 | - | 12,39 | 0,61 |
| Спурт 01об | 15.11.2007 | 9,25 | 62 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,735 | - | -0,28 | 9,19 | - | 0,18 |
| СудострБ-1 | 03.01.2008 | 9,85 | 657 | - | 0 | 0,00 | 99,00 | 98,95 | 1,916 | - | -0,89 | 10,76 | - | 1,67 |
| ТурАлемФ 1 | 09.10.2007 | 7,75 | 753 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,13 | 3,334 | - | - | 7,84 | - | 2,38 |
| ТурАлемФ 1 | 09.10.2007 | 7,75 | 753 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,13 | 3,334 | - | - | 7,84 | - | 2,38 |
| УБРиР-ф 02 | 04.10.2007 | 10,25 | 657 | - | 4 | 8,03 | 98,30 | 98,38 | 1,994 | - | -0,30 | - | - | 0,00 |
| УралЛЦ-01 | 24.10.2007 | 11,50 | 775 | 40 | 1 | 0,05 | 99,50 | 99,50 | 4,474 | - | 0,50 | 10,61 | 15,45 | 0,11 |
| УРСАБанк 2 | 14.12.2007 | 7,60 | 455 | - | 0 | 0,00 | 99,00 | 99,00 | 0,000 | - | - | 8,67 | - | 1,26 |
| УРСАБанк 3 | 06.12.2007 | 9,60 | 629 | - | 5 | 9,51 | 97,40 | 96,77 | 2,604 | - | -3,73 | 12,05 | - | 1,59 |
| УРСАБанк 5 | 23.10.2007 | 10,05 | 1495 | - | 14 | 43,22 | 97,70 | 98,25 | 3,937 | -3,17 | -3,70 | 10,86 | - | 3,32 |
| УРСАБанк 6 | 25.10.2007 | 7,65 | 223 | - | 0 | 0,00 | 99,75 | 99,76 | 1,048 | - | - | 8,23 | - | 0,72 |
| УРСАБанк 7 | 24.01.2008 | 8,40 | 1770 | 860 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,151 | - | - | - | 8,57 | 2,16 |
| ХКФ Банк-1 | 16.10.2007 | 1,00 | 32 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,411 | - | - | - | - | 0,00 |
| ХКФ Банк-2 | 13.11.2007 | 9,25 | 970 | 606 | 8 | 26,24 | 97,90 | 97,98 | 3,092 | 3,98 | -0,52 | - | 10,87 | 1,53 |
| ХКФ Банк-3 | 20.09.2007 | 9,45 | 1098 | 370 | 0 | 0,00 | 98,90 | 98,38 | 2,201 | - | 0,55 | - | 11,62 | 0,97 |
| ХКФ Банк-4 | 18.10.2007 | 9,95 | 1489 | 398 | 4 | 1,10 | 97,25 | 97,07 | 1,581 | 0,04 | -1,42 | - | 13,47 | 1,03 |
| Центр-инв1 | 08.11.2007 | 10,00 | 789 | 55 | 1 | 10,34 | 99,90 | 99,90 | 3,452 | - | -0,10 | - | 10,47 | 0,16 |
| Экспобанк1 | 25.09.2007 | 10,75 | 837 | 102 | 2 | 1,30 | 99,25 | 99,19 | 2,356 | 0,19 | 0,04 | - | 14,46 | 0,27 |
| Электрон01 | 13.10.2007 | 11,75 | 212 | - | 0 | 0,00 | 100,09 | 100,09 | 4,925 | - | 0,09 | 11,88 | - | 0,56 |
| Юниаструм | 19.02.2008 | 11,00 | 522 | - | 0 | 0,00 | 99,98 | 99,98 | 0,723 | - | 2,48 | 11,31 | - | 1,36 |
| Химия, ЛПК | | | | | | | | | | | | | | |
| АрнестФ-01 | 24.10.2007 | 9,60 | 593 | 222 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,50 | 3,735 | - | 0,00 | - | 10,68 | 0,60 |
| АЦБК-Инв 3 | 18.10.2007 | 9,95 | 1308 | 34 | 0 | 0,00 | 100,15 | 100,15 | 1,554 | - | 0,15 | - | 8,38 | 0,10 |
| ВМУ-Фин 01 | 25.12.2007 | 11,00 | 830 | 102 | 0 | 0,00 | 100,05 | 100,03 | 2,411 | - | -0,24 | - | 10,64 | 0,28 |
| ГОТЭК-2 | 20.12.2007 | 10,50 | 643 | 279 | 0 | 0,00 | 98,60 | 98,58 | 2,445 | - | -0,35 | - | 12,83 | 0,74 |
| ДЗ-Фин -1 | 23.11.2007 | 11,00 | 252 | - | 0 | 0,00 | 110,00 | 104,00 | 3,375 | - | - | 5,12 | - | 0,67 |
| Дорогобуж1 | 12.12.2007 | 8,60 | 271 | - | 0 | 0,00 | 100,50 | 100,50 | 2,191 | - | 0,00 | 8,04 | - | 0,74 |
| КуйбАзот-2 | 07.03.2008 | 8,80 | 1272 | - | 0 | 0,00 | 99,45 | 99,41 | 0,169 | - | 0,00 | 9,20 | - | 3,08 |
| Миннеско-1 | 13.12.2007 | 13,75 | 818 | 90 | 0 | 0,00 | 100,10 | 100,06 | 3,466 | - | -0,99 | 14,16 | 13,05 | 1,94 |
| НИКОСХИМ 2 | 15.11.2007 | 11,25 | 706 | - | 6 | 45,53 | 98,00 | 98,01 | 0,894 | -0,49 | -0,74 | 13,01 | - | 1,75 |
| НИТОЛ 01 | 18.12.2007 | 1,00 | 459 | - | 0 | 0,00 | 110,00 | 104,00 | 0,238 | - | - | - | - | 0,00 |
| НИТОЛ 02 | 18.12.2007 | 11,75 | 823 | 95 | 2 | 14,96 | 99,00 | 99,00 | 2,801 | - | -0,71 | 12,62 | 11,54 | 1,99 |
| НКНХ-04 об | 01.10.2007 | 9,99 | 1655 | 563 | 0 | 0,00 | 103,04 | 103,03 | 4,516 | - | -0,96 | - | 8,02 | 1,41 |
| НЭФИС-02 | 19.12.2007 | 10,20 | 824 | 278 | 0 | 0,00 | 99,60 | 99,60 | 2,403 | - | 0,10 | - | 10,99 | 0,75 |
| ПЕНОПЛЭКС-1 | 20.12.2007 | 11,25 | 825 | 279 | 21 | 33,43 | 97,12 | 97,13 | 2,620 | 0,00 | -1,97 | - | 15,88 | 0,74 |
| ПЭФ-Союз-1 | 09.10.2007 | 10,00 | 25 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 4,438 | - | - | 9,64 | - | 0,14 |
| РЕТАЛ-1 | 12.12.2007 | 9,90 | 817 | 453 | 3 | 2,02 | 98,63 | 98,65 | 2,522 | - | -0,74 | - | 11,37 | 1,17 |
| САНОС-02об | 13.11.2007 | 10,00 | 788 | 60 | 0 | 0,00 | 103,75 | 103,75 | 3,342 | - | 0,00 | 8,23 | - | 1,94 |
| СЗЛК-Фин-1 | 04.03.2008 | 11,50 | 900 | 354 | 0 | 0,00 | 97,00 | 97,00 | 0,315 | - | - | - | 15,46 | 0,95 |
| СИБУРХолд1 | 08.11.2007 | 7,70 | 1875 | 783 | 2 | 2,05 | 99,50 | 99,45 | 2,679 | - | -0,49 | - | 8,13 | 1,97 |
| Слвстекло2 | 31.10.2007 | 9,28 | 775 | 47 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 3,432 | - | 0,00 | - | 9,01 | 0,18 |
| Слвстекло | 25.09.2007 | 11,60 | 193 | - | 0 | 0,00 | 101,60 | 101,60 | 5,435 | - | - | 9,00 | - | 0,58 |
| СНХЗ Фин 1 | 02.10.2007 | 10,70 | 746 | 18 | 0 | 0,00 | 99,98 | 99,98 | 4,808 | - | 0,15 | - | 10,58 | 0,05 |
| Энергетика | | | | | | | | | | | | | | |
| БашкирэнЗв | 26.09.2007 | 8,30 | 1272 | 552 | 0 | 0,00 | 100,47 | 100,48 | 1,774 | - | -0,01 | - | 8,20 | 1,42 |
| ГидроОГК-1 | 02.01.2008 | 8,10 | 1384 | 6 | 6 | 32,90 | 101,18 | 101,20 | 1,598 | -0,10 | -0,83 | 7,87 | - | 3,29 |
| ЕЭСК-02 | 11.10.2007 | 8,74 | 1665 | 937 | 7 | 15,94 | 98,57 | 98,46 | 3,712 | 0,01 | -0,44 | - | 9,65 | 2,27 |
| Кубаньэн-1 | 23.01.2008 | 7,85 | 1041 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,097 | - | - | 8,00 | - | 1,94 |
| Ленэнерго02 | 01.02.2008 | 8,54 | 1596 | - | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,983 | - | 0,00 | 8,72 | - | 3,73 |
| Ленэнерго3 | 24.10.2007 | 8,02 | 1678 | - | 0 | 0,00 | 97,35 | 98,90 | 3,120 | - | 0,15 | 8,48 | - | 3,81 |
| Мосэнерго1 | 18.09.2007 | 7,54 | 1460 | 732 | 0 | 0,00 | 99,49 | 99,40 | 3,677 | - | -0,60 | - | 8,02 | 1,84 |
| Мосэнерго2 | 28.02.2008 | 7,65 | 3079 | 1623 | 0 | 0,00 | 99,84 | 99,70 | 0,314 | - | -0,79 | - | 7,88 | 3,84 |
| МОЭСК-01 | 11.03.2008 | 8,05 | 1453 | - | 1 | 4,97 | 99,43 | 99,43 | 0,066 | - | -0,86 | 8,39 | - | 3,48 |
| ОГК-2 01об | 03.01.2008 | 7,70 | | | | | | | | | | | | |

| Инструмент | Дата купона | Ставка купона, год. | Дней до | | Кол-во сделок | Сумма сделок, млн. руб. | Цена | | | Изм срвзв цены | | Доходность по срвзв цене, % год | | Дюрация, лет |
|---------------|-------------|---------------------|-----------|--------|---------------|-------------------------|--------|--------|---------|----------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|
| | | | погашения | оферты | | | посл | ср взв | НКД (%) | день | неделя | погашение | оферта | |
| ОГК-5 об-1 | 04.10.2007 | 7,50 | 1476 | 748 | 3 | 103,66 | 99,38 | 99,38 | 3,329 | 0,14 | 0,05 | - | 7,98 | 1,88 |
| ОГК-6 01об | 25.10.2007 | 7,55 | 1679 | 951 | 2 | 0,63 | 97,85 | 97,85 | 2,917 | -0,14 | -0,45 | - | 8,66 | 2,34 |
| Пермэнер01 | 27.11.2007 | 8,15 | 1712 | 984 | 0 | 0,00 | 98,10 | 99,03 | 2,412 | - | 0,03 | - | 8,74 | 2,42 |
| Татэнерго1 | 13.03.2008 | 9,65 | 181 | - | 6 | 1,57 | 99,90 | 99,95 | 0,026 | - | -0,42 | 9,75 | - | 0,50 |
| ТГК-1 01 | 18.09.2007 | 7,75 | 2370 | 914 | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,50 | 3,779 | - | -0,25 | - | 8,60 | 2,24 |
| ТГК-10 об1 | 20.12.2007 | 7,60 | 1007 | 643 | 13 | 101,98 | 98,00 | 97,96 | 1,770 | -0,04 | -1,05 | - | 9,06 | 1,65 |
| ТГК-4 об.1 | 06.12.2007 | 7,60 | 1721 | 629 | 2 | 5,03 | 98,30 | 98,30 | 2,061 | - | -0,02 | - | 8,86 | 1,62 |
| ТГК-6Инв-1 | 27.11.2007 | 7,40 | 1621 | 165 | 1 | 3,73 | 99,15 | 99,15 | 0,345 | -0,02 | -0,11 | - | 9,67 | 0,45 |
| ТГК-8 01 | 15.11.2007 | 8,00 | 1700 | 608 | 0 | 0,00 | 99,05 | 99,05 | 2,630 | - | -0,25 | - | 8,80 | 1,56 |
| Тюменэнерг2 | 04.10.2007 | 7,70 | 1658 | 930 | 0 | 0,00 | 98,00 | 98,00 | 3,418 | - | 0,00 | - | 8,76 | 2,31 |
| ФСК ЕЭС-01 | 18.12.2007 | 8,80 | 95 | - | 0 | 0,00 | 100,40 | 100,40 | 2,098 | - | 0,00 | 7,20 | - | 0,28 |
| ФСК ЕЭС-02 | 25.12.2007 | 8,25 | 1012 | - | 1 | 2,07 | 101,65 | 101,65 | 1,808 | -0,20 | -0,58 | 7,72 | - | 2,50 |
| ФСК ЕЭС-03 | 14.12.2007 | 7,10 | 455 | - | 1 | 81,10 | 99,56 | 99,65 | 1,770 | - | -0,25 | 7,52 | - | 1,20 |
| ФСК ЕЭС-04 | 11.10.2007 | 7,30 | 1483 | - | 6 | 35,43 | 99,65 | 99,67 | 3,100 | -0,07 | -0,36 | 7,53 | - | 3,48 |
| ФСК ЕЭС-05 | 04.12.2007 | 7,20 | 809 | - | 3 | 103,49 | 99,40 | 99,41 | 1,992 | 0,01 | -0,35 | 7,63 | - | 2,05 |
| Челябэнерг1 | 15.11.2007 | 8,40 | 972 | 244 | 0 | 0,00 | 100,38 | 100,38 | 2,762 | - | - | - | 7,98 | 0,72 |
| ЭнергСт-1 | 23.11.2007 | 9,50 | 1344 | 434 | 0 | 0,00 | 98,50 | 98,50 | 2,915 | - | -0,80 | - | 11,14 | 1,12 |
| ЭнергЦент1 | 10.01.2008 | 9,30 | 1031 | 482 | 0 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 1,631 | - | - | - | 9,50 | 1,26 |
| Якутскэн02 | 13.03.2008 | 8,59 | 1637 | 545 | 3 | 72,65 | 99,50 | 99,50 | 0,024 | 0,60 | 0,20 | - | 9,15 | 1,43 |
| Прочие | | | | | | | | | | | | | | |
| РКС-01 | 17.10.2007 | 9,70 | 579 | 33 | 0 | 0,00 | 99,90 | 99,98 | 3,960 | - | -0,26 | - | 9,54 | 0,10 |
| АиФМПфин 1 | 19.12.2007 | 11,75 | 642 | 96 | 0 | 0,00 | 99,50 | 99,48 | 2,768 | - | 0,11 | - | 13,41 | 0,27 |
| КАРО 01 | 25.12.2007 | 12,50 | 830 | 284 | 4 | 16,44 | 100,00 | 98,09 | 2,740 | -1,91 | -2,07 | - | 15,69 | 0,75 |
| Интурист-1 | 24.10.2007 | 9,00 | 950 | - | 0 | 0,00 | 101,50 | 101,50 | 3,501 | - | 0,00 | 8,52 | - | 2,34 |
| НЛК 01 | 31.01.2008 | 12,45 | 139 | - | 0 | 0,00 | 99,80 | 99,53 | 1,467 | - | -0,47 | 13,54 | - | 0,39 |
| ТАИФ-Фин01 | 13.03.2008 | 8,42 | 1091 | 363 | 0 | 0,00 | 97,90 | 97,90 | 0,023 | - | -0,15 | - | 10,98 | 0,98 |
| ТКФинанс 1 | 20.09.2007 | 10,50 | 370 | - | 0 | 0,00 | 100,49 | 100,49 | 5,063 | - | 0,00 | 10,24 | - | 0,98 |

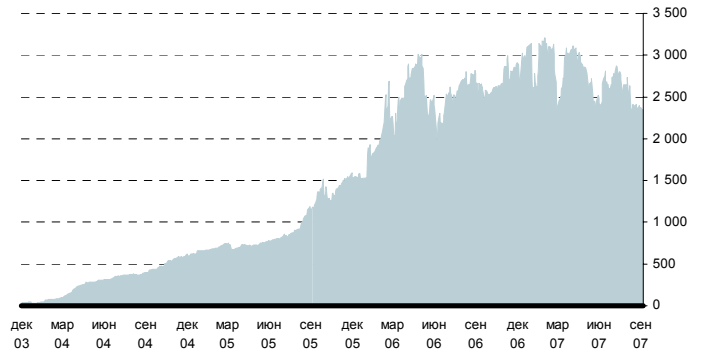
Источник: ММВБ, расчеты Банка ЗЕНИТ

Приложение 7. ОФБУ Банка ЗЕНИТ

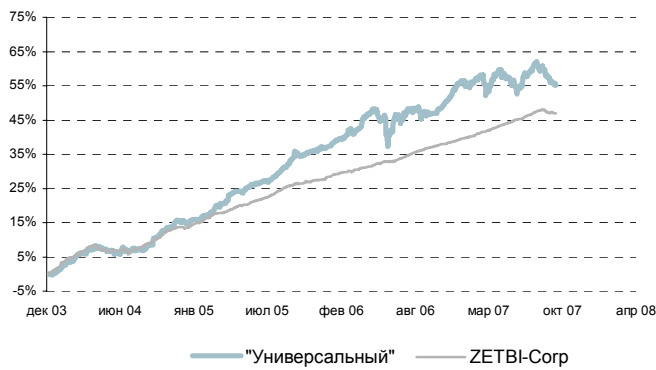
ОФБУ "Доходный"



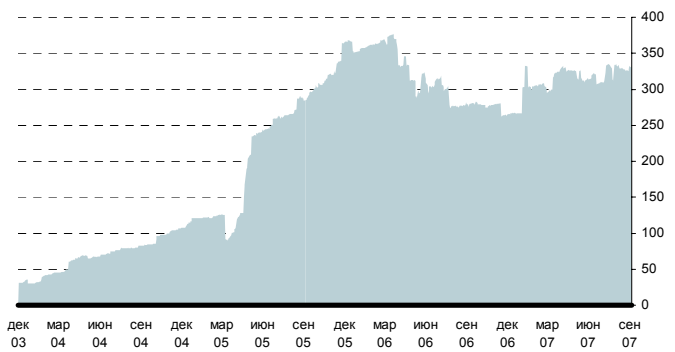
Стоимость чистых активов фонда "Доходный" млн. руб.



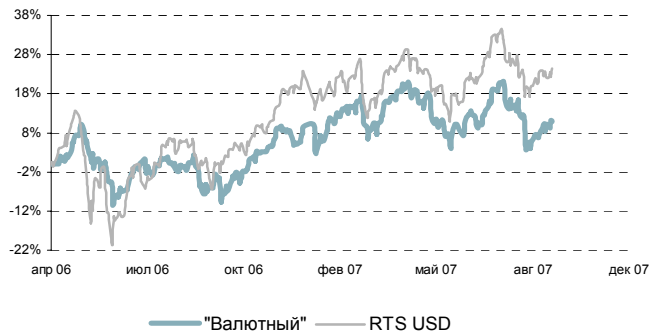
ОФБУ "Универсальный"



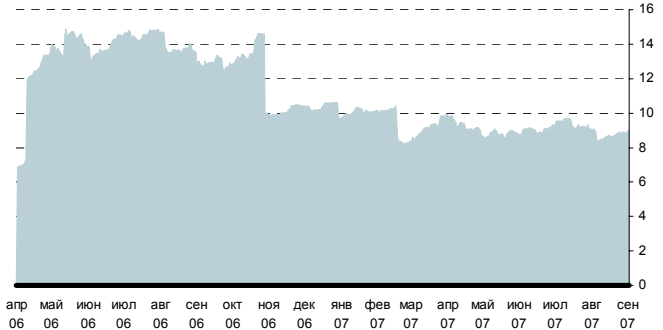
Стоимость чистых активов фонда "Универсальный" млн. руб.



ОФБУ "Валютный"



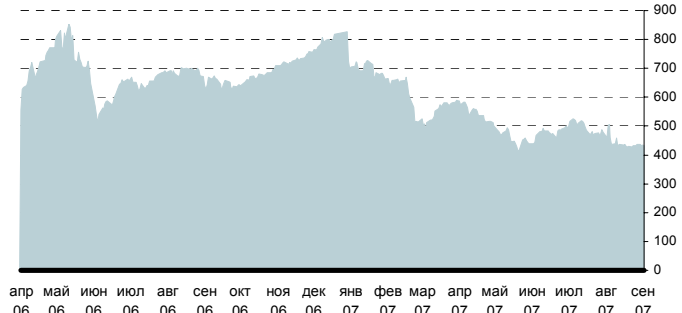
Стоимость чистых активов фонда "Валютный" млн. дол.



ОФБУ "Перспективный"

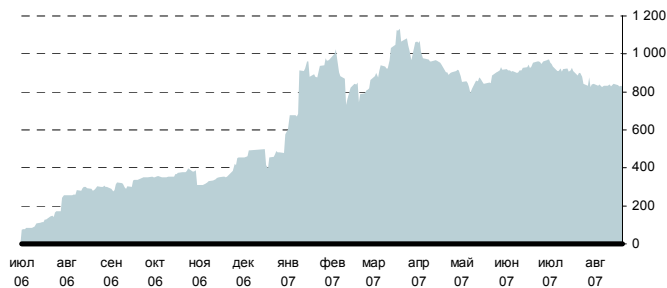


Стоимость чистых активов фонда "Перспективный" млн. руб.



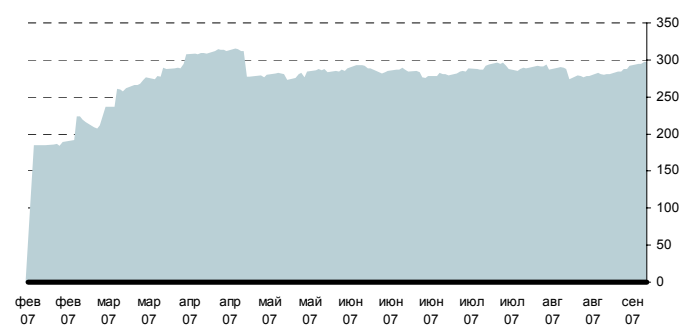
ОФБУ "Доходный II"

Стоимость чистых активов фонда "Доходный II" млн. руб.



ОФБУ "Вечные ценности"

Стоимость чистых активов фонда "Вечные ценности" млн. руб.



Изменение стоимости пая

| Фонд (ОФБУ) | Стратегия | С начала работы Фонда* | С начала года** | 1 день | 1 мес. | 6 мес.** | 1 год.** | Доля риска в цене, % | Коэффициент Шарпа ** |
|-----------------|-------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|----------|----------|----------------------|----------------------|
| Доходный | Агрессивная | 181,76% | -24,01% | -0,46% | -8,96% | -8,59% | 6,05% | 38,11 | 1,08 |
| Универсальный | Умеренная | 55,21% | -0,72% | -0,34% | -2,74% | 0,04% | 6,86% | 14,38 | 0,53 |
| Перспективный | Фонд производных инструментов | -22,48% | -28,45% | -0,54% | -8,41% | -10,06% | -4,95% | 10,19 | -2,23 |
| Валютный | Агрессивная | 10,91% | 1,23% | -0,24% | -1,10% | -1,20% | 17,77% | 7,30 | 0,09 |
| Доходный II | Агрессивная | 2,30% | -24,15% | -0,63% | -8,35% | -9,43% | 2,20% | 8,19 | 0,25 |
| Вечные ценности | Индексный фонд золота | -0,60% | - | -0,05% | 2,71% | 2,51% | - | 2,32 | - |
| RTS USD *** | Индекс РТС | 258,22% | 0,56% | 1,72% | 2,43% | 5,54% | 24,18% | 45,32 | 1,36 |
| RTS RUR*** | Индекс РТС рубли | 207,13% | -3,15% | 1,28% | 1,92% | 2,96% | 17,83% | 41,59 | 1,15 |
| ZETBI-Corp | Индекс облигаций | 46,94% | 5,29% | 0,00% | -0,65% | 3,36% | 7,94% | 10,87 | 0,50 |
| Золото | Котировка в ЦБ РФ | 3,64% | 7,32% | -0,66% | 5,37% | - | - | 1,86 | - |

(*) Начало работы ОФБУ "Доходный" и "Универсальный" - 08.12.2003

Начало работы ОФБУ "Валютный" и "Перспективный" - 11.04.2006

Начало работы ОФБУ "Доходный II" - 24.07.2006

Начало работы ОФБУ "Вечные ценности" - 09.02.2007

(**) Если в ячейке стоит "-", значит недостаточно статистических данных

(***) Для сравнения с рублевыми фондами используется индекс RTS RUR, для сравнения с валютным фондом - RTS USD

Инвестиционный Департамент

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

| | | |
|---|---------------------|--|
| Начальник Департамента | Роман Пивков | roman.pivkov@zenit.ru |
| Зам. Начальника Департамента | Кирилл Копелович | kopelovich@zenit.ru |
| Управление продаж | | sales@zenit.ru |
| Начальник управления | Константин Поспелов | konstantin.pospelov@zenit.ru |
| Зам. начальника | Алексей Третьяков | a.tretyakov@zenit.ru |
| Рублевые облигации | Роман Попов | r.popov@zenit.ru |
| Рублевые облигации | Дмитрий Елисеев | d.eliseev@zenit.ru |
| Рублевые облигации | Алексей Баранчиков | a.baranchikov@zenit.ru |
| Валютные облигации | Светлана Агиевец | s.agievets@zenit.ru |
| Аналитическое управление | Акции | research@zenit.ru |
| | Облигации | firesearch@zenit.ru |
| Рублевые облигации | Яков Яковлев | y.yakovlev@zenit.ru |
| Анализ кредитных рисков | Ольга Ефремова | o.efremova@zenit.ru |
| Анализ кредитных рисков | Наталья Толстошеина | n.tolstosheina@zenit.ru |
| Анализ кредитных рисков | Мария Сулима | m.sulima@zenit.ru |
| Анализ кредитных рисков | Даниил Иванов | daniil.ivanov@zenit.ru |
| Акции | Игорь Нуждин | i.nujdin@zenit.ru |
| Акции | Дмитрий Лукашов | d.lukashov@zenit.ru |
| Управление доверительного управления активами | | |
| Начальник управления | Сергей Матюшин | s.matyushin@zenit.ru |
| Брокерское обслуживание | Ирина Киреева | i.kireeva@zenit.ru |
| Брокерское обслуживание | Тимур Мухаметшин | t.mukhametshin@zenit.ru |
| Управление организации долгового финансирования | | ibcm@zenit.ru |
| Начальник управления | Валерий Голованов | v.golovanov@zenit.ru |
| Рублевые инструменты | Алексей Балашов | a.balashov@zenit.ru |
| Валютные инструменты | Антон Литвяков | a.litvyakov@zenit.ru |

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

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

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

Дополнительная информация и сопроводительная документация может быть предоставлена по запросу. © 2004 Банк ЗЕНИТ.