

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Вопрос по источнику докапитализации Испанских банков решен

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Рынок стабилен, но впереди уплата крупных налогов
- Рубль остается под давлением

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды РФ: суверенный сектор продолжает снижение
- Рублевый долг: незначительные продажи

Корпоративные события /стр. 6/

- АЛРОСА: нейтральная отчетность за 1К12, бумаги компании не выглядят привлекательно

Первичный рынок /стр. 8/

Приложения

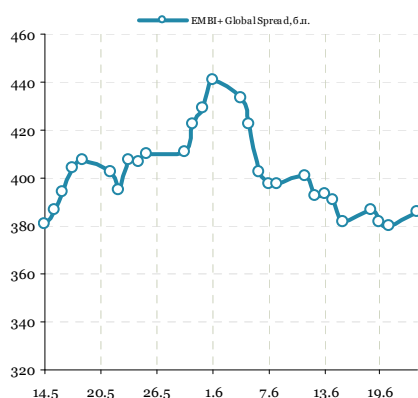
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 9/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 17/
- Результаты торгов евробондами /стр. 23/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 25/

Динамика ключевых показателей

| | знач. | Δ за день | за 6 месяцев: | |
|----------------------------|---------|-----------|---------------|-------|
| | | | MIN. | MAX. |
| Внешний рынок долга | | | | |
| UST-10 yield | 1.62 | ▼ -0.04 | 1.45 | 2.38 |
| UST 10-2Y sprd | 132 | ▼ -3 | 121 | 200 |
| EMBI+ Glob. | 386 | ▲ 5 | 316 | 441 |
| EMBI+ Rus sprd | 280 | ▼ -2 | 219 | 339 |
| Russia 30 yield | 4.02 | ▲ 0.04 | 3.82 | 4.67 |
| Денежный рынок | | | | |
| Libor-3m | 0.47 | ■ 0.00 | 0.47 | 0.58 |
| Euribor-3m | 0.66 | ▼ 0.00 | 0.66 | 1.42 |
| MosPrime-1m | 6.84 | ▼ -0.02 | 5.67 | 7.03 |
| Корсчета в ЦБ | 673.5 | ▲ 32.9 | 0 | 1153 |
| Депоз. в ЦБ | 64.6 | ▼ -6.0 | 0 | 757 |
| NDF RU 3m | 6.8 | ▲ 0.0 | 5 | 7 |
| Валютный рынок | | | | |
| USD/RUB | 33.195 | ▲ 0.599 | 28.97 | 33.67 |
| EUR/RUB | 41.593 | ▲ 0.225 | 38.43 | 41.81 |
| EUR/USD | 1.254 | ▼ -0.017 | 1.24 | 1.35 |
| Корзина ЦБ | 37.317 | ▲ 0.327 | 33.33 | 37.28 |
| DXU Индекс | 82.29 | ▲ 0.707 | 78.27 | 83.04 |
| Фондовые индексы | | | | |
| RTS | 1306.9 | ▼ -2.6% | 1228 | 1755 |
| Dow Jones | 12573.6 | ▼ -1.96% | 11766 | 13279 |
| DAX | 6259.6 | ▼ -1.32% | 5671 | 7158 |
| Nikkei 225 | 8824 | ▼ -0.29% | 8296 | 10255 |
| Shanghai Comp. | 2292.9 | ▼ -1.40% | 2148 | 2461 |
| Сырьевые рынки | | | | |
| Нефть Urals | 86.5 | ▼ -1.30% | 87 | 125 |
| Нефть Brent | 89.2 | ▼ -0.02% | 89 | 126 |
| Золото | 1566.3 | ▲ 0.10% | 1540 | 1784 |
| CRB Index | 267.2 | ▼ -2.11% | 267 | 326 |

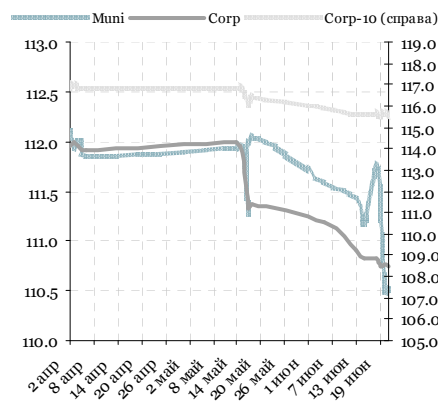
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETVI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETVI

| | знач. | Δ за день | за 6 месяцев: | |
|---|-------|-----------|---------------|--------|
| | | | MIN. | MAX. |
| Price Return | | | | |
| OFZ | 107.5 | ▼ -0.02 | 107.5 | 112.7 |
| Muni | 110.5 | ▲ 0.04 | 110.5 | 115.1 |
| Corp | 110.7 | ▼ -0.03 | 110.7 | 114.5 |
| Corp-10 | 115.6 | ▼ -0.02 | 115.5 | 122.2 |
| Total Return | | | | |
| OFZ | 236.1 | ▲ 0.02 | 230.7 | 243.2 |
| Muni | 334.9 | ▲ 0.20 | 320.8 | 337.5 |
| Corp | 334.2 | ▼ 0.00 | 318.6 | 336.2 |
| Corp-10 | 336.0 | ▲ 0.04 | 320.6 | 336.2 |
| Объем торгов в сегменте (млн руб.) | | | | |
| OFZ | 482 | ▼ -96 | 0 | 27 809 |
| Muni | 528 | ▼ -953 | 10 | 6 146 |
| Corp | 5 364 | ▼ -1 733 | 19 | 44 858 |

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ОАО ГК «Русское море» установило купон по биржевым облигациям серии БО-01 на 1 млрд руб. в размере 12,50% годовых. /Bloomberg/

ОАО «Сбербанк РФ» размещает семилетние евробонды на 1 млрд долл. с доходностью 5,18% годовых. /Интерфакс/

Совет директоров ОАО «Северсталь» одобрил выпуск рублевых облигаций на сумму до 80 млрд руб. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 21.06.2012 – четверг

Статистика США: PMI Manufacturing, Initial claims, Continuing claims, Existing home sales

Статистика Еврзоны: Consumer Confidence

- Выплата купона: Департамент Финансов Тверской области, 34005 (15%, 3 млн руб.), БизнесЛайт, 01 (12%, 26.9 млн руб.), ХМАО, 25007 (10.4%, 103.7 млн руб.), ХМАО, 25008 (10.8%, 107.7 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 34004 (8.75%, 218.1 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 34004 (9.75%, 38.9 млн руб.), АЛРОСА, 21 (8.25%, 164.5 млн руб.), АЛРОСА, 23 (8.95%, 156.1 млн руб.), Еврофинансы-Недвижимость, 02 (3%, 16.4 млн руб.), Карелия, 34013 (9.71%, 42.1 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-03 (9.45%, 35.3 млн руб.), Национальный капитал, БО-01 (8.2%, 20.4 млн руб.), Национальный капитал, БО-02 (8.2%, 20.4 млн руб.), Волгоград, 34005 (9.5%, 23.6 млн руб.), Россия, 36004(ГСО-ППС) (7.6%, 1.9 млрд руб.), Связь-Банк, 03 (8.5%, 211.9 млн руб.), Костромская область, 34005 (9%, 26.9 млн руб.), Министерство финансов Самарской области, 35005 (9.3%, 86.5 млн руб.)

- Оферта: ЭнеЛ ОГК-5, БО-15 (4 млрд руб.)

- Погашение: МДМ Банк, 2012-А (ABS, DPR, FRN) (350 млн долл.)

Сегодня: 22.06.2012 – пятница

- Выплата купона: АиФ – МедиаПресса - финанс, 02 (12.75%, 63.5 млн руб.), Риэл-лизинг Инвест, 01 (8.5%, 84.7 млн руб.), ВТБ, БО-06 (8.5%, 211.9 млн руб.), МТС, 2020 (LPN) (8.625%, 32.3 млн долл.), Гражданские самолеты Сухого, БО-01 (8.25%, 123.4 млн руб.), Теле2-Санкт-Петербург, 01 (8.4%, 209.4 млн руб.), Теле2-Санкт-Петербург, 02 (8.4%, 209.4 млн руб.), Теле2-Санкт-Петербург, 03 (8.4%, 125.6 млн руб.), Запсибкомбанк, БО-01 (9.75%, 97.2 млн руб.), Россия, 35010(ГСО-ППС) (7%, 2.8 млрд руб.), КБ МИА (ОАО), 01 (10%, 5.4 млн руб.), НКНХ, 2015 (LPN) (8.2%, 20.4 млн руб.)

- Размещение: ИС-брокер, 01 (115 млн руб.)

25.06.2012 – понедельник

Статистика США: New home sales

- Выплата купона: Московский Кредитный банк, БО-05 (9.2%, 230.6 млн руб.), ВТБ, 2013, CNY (LPN) (2.95%, 14.8 млн руб.), Кокс, 2016 (LPN) (7.75%, 13.5 млн долл.), Россия, 2028 (12.75%, 159.4 млн долл.), Москва, 44 (8%, 802.2 млн руб.), Мособлгаз-финанс, 02 (9.25%, 55.6 млн руб.), Московская область, 2012 (CLN) (9%, 315 млн руб.), Альфа-Банк, 2013 (LPN) (9.25%, 18.5 млн долл.), Мособлгаз-финанс, 02 (9.75%, 97.2 млн руб.), РЖД, 15 (10.38%, 776.4 млн руб.), АКБ РОСБАНК, БО-01 (7.4%, 185.5 млн руб.), Администрация города Томска, 34003 (8.2%, 20.4 млн руб.), Национальный капитал, БО-03 (8.2%, 20.4 млн руб.), Национальный капитал, БО-04 (8.2%, 20.4 млн руб.), ИСО ГПБ-Ипотека Два, А (7.5%, 22.8 млн руб.), ИСО ГПБ-Ипотека Два, Б (16.4%, 21.6 млн руб.), Кузбассэнерго-Финанс, 01 (8.05%, 401.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-С, RUB (RMBS, FRN) (12%, 2.7 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-С, RUB (RMBS, Step Up) (10.5%), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Да, RUB (RMBS) (12%, 3.3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (12%, 1.1 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-В, RUB (RMBS, FRN) (9%, 3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А1, RUB (RMBS, Step Up) (7.35%, 11.8 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-В, RUB (RMBS, Step Up) (7.75%, 2 млн руб.), Альфа-Банк, 2012 (LPN) (8.2%, 20.5 млн долл.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А2 (RMBS, Step Up) (7.5%, 1.9 млн руб.), Воронежская область, 34001 (9%, 40.4 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-А (RMBS) (8.75%, 21.9 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-В (RMBS) (9%, 4.6 млн руб.)

- Погашение: Мособлгаз-финанс, 02 (3 млрд руб.), Альфа-Банк, 2012 (LPN) (500 млн долл.), Воронежская область, 34001 (1 млрд руб.)

- Оферта: Банк ГПБ-Ипотека, 2047-С, RUB (RMBS, Step Up) (329 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Да, RUB (RMBS) (329 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (263 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А1, RUB (RMBS, Step Up) (5.11 млрд руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-В, RUB (RMBS, Step Up) (311.8 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А2 (RMBS, Step Up) (850 млн руб.)

Внешний рынок долга

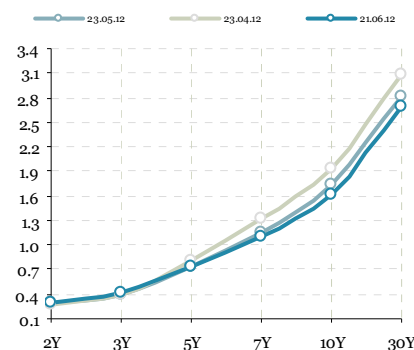
Вопрос по источнику докапитализации Испанских банков решен

Европейские проблемы остаются на повестке дня мировых рынков. При этом, ухудшающаяся в глобальном масштабе экономическая статистика толкает вниз цен на сырьевых рынках. Между тем, европейские чиновники продолжают предпринимать точечные антикризисные меры, воздерживаясь от комплексного подхода. Прошедшее вчера заседание министров финансов еврозоны внесло некоторую ясность в отношении докапитализации испанских банков. Согласно независимому аудиту, банковскому сектору Испании потребуется 51-62 млрд евро в капитал. Эти средства будут предоставляться через EFSF до тех пор, когда начнет работу фонд ESM. Как ожидается, уже в понедельник испанские власти официально обратятся к европейскому правительству с просьбой об оказании финансовой помощи.

Среды бродивших рыночных слухов стоит отметить спекуляции на тему появившейся в СМИ информации о том, что на прошедшем вчера заседании Управляющего совета ЕЦБ было принято решение о смягчении требований к принимаемым в обеспечение по кредитам Банка ипотечных бумаг. Эта мера направлена на поддержку испанских банков, у которых на балансе имеется в больших количествах секьюритизированные ипотечные займы, под которые пока невозможно получить рефинансирование в ЕЦБ.

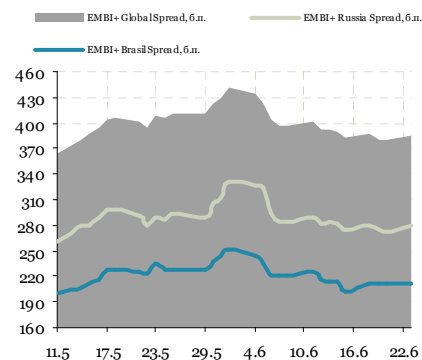
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



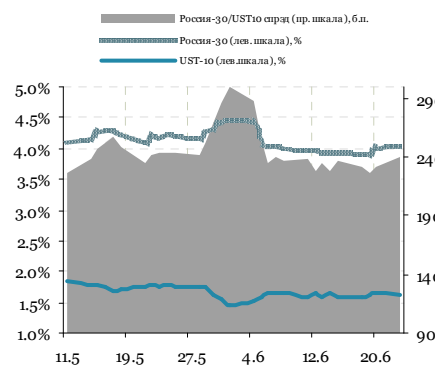
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



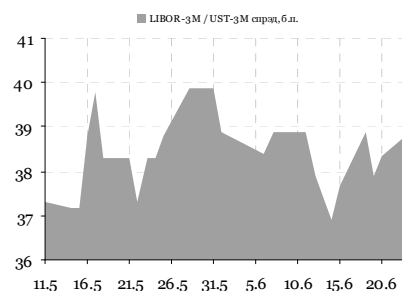
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Рынок стабилен, но впереди уплата крупных налогов

Условия локального денежно-кредитного рынка вчера практически не изменились на фоне отсутствия значимых отвлечений ликвидности. Впрочем, давление от слабеющего рубля по-прежнему ограничивает радужные перспективы рынка. На рынке МБК стоимость кредитов overnight составила порядка 6.25% годовых, 1-дневное междилерское репо на ММВБ обходилось в среднем под 6.15% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли 390 млрд руб. при спросе в 424 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 26.9 млрд руб., составив 738.1 млрд руб.

Дальнейшее развитие налогового периода при одновременном сохранении девальвационных ожиданий грозит усилением напряженности на локальном денежно-кредитном рынке. На следующей неделе предстоит уплата двух крупных налоговых платежей – НДС и налога на прибыль, которые вполне способны вновь ухудшить условия рынка.

Рубль остается под давлением

Валютные торги четверга вновь прошли под давлением снижающихся котировок нефти на мировых площадках. Как итог, рубль ускорил темпы снижения, поскольку девальвационные опасения стремительно растут при приближении котировок Brent к рубежу в 90 долл. за барр. По итогам дня курс бивалютной корзины вырос на 36 коп., закрывшись на отметке 36.85 руб. Дальнейшее ослабление котировок нефти начнет оказывать давление на рубль в многократном размере.

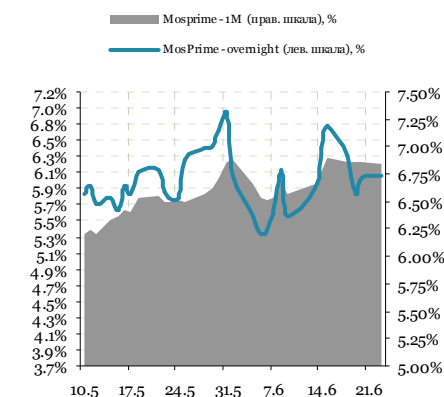
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

| Дата | Аукционы ЦБ и Фонда ЖКХ, поступление и возврат средств на счета комбанков, уплата налогов | | Прямое репо с ЦБ РФ, 1 день, млрд руб. |
|-------------|---|--|--|
| Понедельник | | | 487 |
| Вторник | | | 422 |
| Среда | Уплата налогов | НДС, 1/3 за I квартал (~180 млрд руб.) | 336 |
| | Аукцион ОФЗ | ОФЗ 26208, 7 лет, 39 млрд руб. | |
| | Выплата купонов ОФЗ | 8.4 млрд руб. | |
| Четверг | | | 390 |
| Пятница | | | |

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

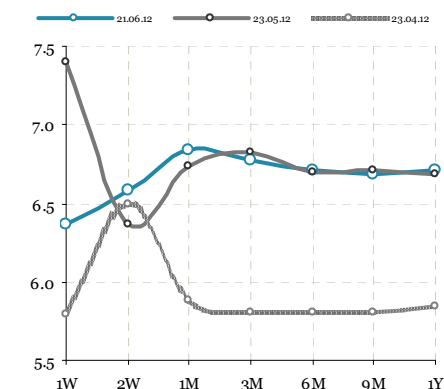
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды РФ: суверенный сектор продолжает снижение

Долговые спреды развивающихся экономик продолжают расширяться из-за ухудшения перспектив глобальной экономики и продолжающейся неопределенности в еврозоне. Учитывая опережающее ослабление нефтяных котировок именно сырьевые EM оказываются под наибольшим давлением. Так, глобальный спред EMBI+ вчера расширился на 5 бп до 375 бп., тогда как российский – на 12 бп до 237 бп. Котировки выпуска Russia 30 опустились на полфигуры до 119.56% (YTM 3.99%, +9 бп).

В корпоративном сегменте ситуация была более стабильной. Большинство выпусков здесь не продемонстрировало видимых изменений, лишь в дальнем сегменте наиболее ликвидных выпусков подешевело на 20-30 бп.

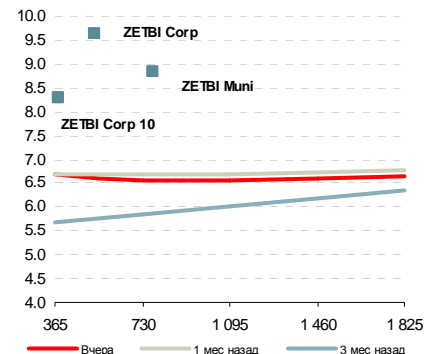
Рублевый долг: незначительные продажи

Локальный долговой рынок вчера чувствовал определенное давление от слабеющего рубля и котировок нефти, однако масштаб продаж оказался не слишком значительным. В секторе госбумаг среди наиболее ликвидных выпусков лишь котировки ОФЗ 26206 и ОФЗ 26207 снизились на 25 бп и 30 бп соответственно, тогда как лидирующие по объему ОФЗ 25076 и ОФЗ 26208 не продемонстрировали изменений.

В корпоративном секторе наблюдалась аналогичная картина. В не слишком ликвидных бумагах второго-третьего уровня отмечались точечные продажи, однако наиболее расторганные выпуски они не затронули. Наибольший интерес был проявлен к выпускам Эшел ОГК-5 Б-15, РСХБ БО-1, АФК Система 3, котировки которых практически не изменились по отношению к закрытию среды.

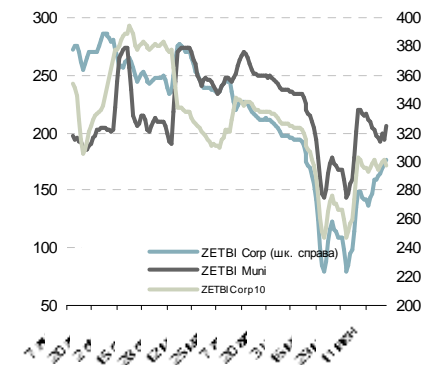
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Доходности кривой валютных свопов



Источник: Bloomberg

Спреды индексов ZETBI к валютным свопам



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Корпоративные события

АЛРОСА: нейтральная отчетность за 1К12, бумаги компании не выглядят привлекательно

Вчера АЛРОСА (ВВ-/Ваз/ВВ-), мировой лидер по добычи алмазов, опубликовала финансовые и операционные результаты за 1К12. Мы оцениваем раскрытые показатели как нейтральные. В отчетности за 1К12 АЛРОСА продемонстрировала достаточно высокие темпы роста выручки, обусловленные ростом объемов реализации и цен на алмазы. Вместе с тем, в отчетном периоде АЛРОСА существенно нарастила долг, что, на фоне снижения операционной рентабельности, привело к росту долговой нагрузки компании на конец 1К12.

- В 1К12 выручка АЛРОСА выросла на 25.7% по сравнению с 1К11 и составила 37 200 млн. руб. Рост выручки был обусловлен, главным образом, повышением цен на ювелирные алмазы, на долю которых пришлось 64% общих продаж в физическом и 98% в денежном выражении. В 1К12 средняя цена реализации ювелирных алмазов выросла на 24.3% по сравнению с 1К11 (до 183.9 долл. за карат), тогда как объем реализации сохранился на уровне предыдущего года и составил около 6.1 млн. карат (+1.7% к 1К11). В отношении технических алмазов отметим, что в 1К12 средняя цена реализации выросла вдвое по сравнению с 1К11 (до 8.8 долл. за карат), а объем реализации вырос до 3.4 млн. карат (+9.7% к 1К11).
- Операционная прибыль компании по итогам 1К12 увеличилась до 14 235 млн. руб. (+17.3% к 1К11), показатель ЕБИТДА – 16 191 млн. руб. (+15.4% к 1К11). Вместе с тем, опережающий рост себестоимости продаж (+29.9% к 1К11), а также SG&A-расходов (+80%) и прочих операционных расходов (+46.5%) привел к снижению операционной рентабельности компании в отчетном периоде до 38.3% (-2.7 пп к 1К11), рентабельности по ЕБИТДА – до 43.5% (-3.9 пп к 1К11).
- В 1К12 АЛРОСА получила денежный поток до изменений в оборотном капитале в размере 15 671 млн. руб. (+20.4% к 1К11), из которых 3 459 млн. руб. было направлено на пополнение оборотного капитала (в 1К11 компания, наоборот, высвободила из оборотного капитала 2 379 млн. руб.), выплату по налогу на прибыль составили 4 362 млн. руб. В результате, в 1К12 чистый операционный денежный поток АЛРОСА снизился до 7 850 млн. руб. (-40.4% к 1К11) и был практически полностью направлен на финансирование капитальных инвестиций, тогда как отток по инвестиционной деятельности в целом составил в 1К12 около 38 947 млн. руб. (рост в 7.2 раза к 1К11), а для его финансирования были использованы поступления от финансовой деятельности в размере 35 444 млн. руб. (в 1К11 отток составил 2 763 млн. руб.).
- В 1К12 расходы компании на финансирование CAPEX составили 6 979 млн. руб. (0.4x ЕБИТДА за 1К12), тогда как за весь 2011 г. АЛРОСА инвестировала порядка 21 420 млн. руб. (0.3x ЕБИТДА за 2011 г.). Около 66.1% всех расходов в 1К12 было направлено на поддержание существующих мощностей, оставшаяся часть – на развитие новых, в т.ч. подземных, рудников («Мир», «Айхал», «Удачный» и рудники «Севералмаза»).
- На конец 1К12 общий долг АЛРОСА заметно вырос по сравнению с началом года и достиг 126 941 млн. руб. (+32.9% к 2011 г.), при этом в структуре долга компании резко выросла доля краткосрочных обязательств – до 43.8% (против 21% на конец 2011 г.). Рост долга и ухудшение его временной структуры было обусловлено досрочным исполнением сделки по обратному выкупу газовых активов у ВТБ (90% в ЗАО «Геотрансгаз и ООО «Уренгойская газовая компания») и долей миноритариев в этих компаниях, на что АЛРОСА потратила суммарно около 1.1 млрд. долл., профинансировав эти расходы за счет размещения 2-х выпусков коротких еврокоммерческих бумаг (ЕСР) на 1 млрд. долл. Увеличение долга привело к росту долговой нагрузки АЛРОСА до 1.9x в терминах Долг/ЕБИТДА (на конец 2011 г. показатель составлял 1.5x), что ниже целевого верхнего предела (2x), заявленного менеджментом, и является приемлемым для компании уровнем.

Евгений Чердаков
e.cherdakov@zenit.ru

Финансовые показатели АЛРОСА по МСФО за 1К12

| млн. руб. | 1К12 | 1К11 | % |
|--------------------------------------|--------|---------|---------|
| Выручка | 37 200 | 29 600 | 25.7% |
| ЕБИТДА | 16 191 | 14 035 | 15.4% |
| Операционная прибыль | 14 235 | 12 138 | 17.3% |
| Чистая прибыль | 12 688 | 11 710 | 8.4% |
| Рентабельность по ЕБИТДА | 43.5% | 47.4% | -3.9 пп |
| Операционная рентабельность | 38.3% | 41.0% | -2.7 пп |
| Чистая рентабельность | 34.1% | 39.6% | -5.5 пп |
| Операц. ден.поток до изм. обор. кап. | 15 671 | 13 021 | 20.4% |
| Чистые инвестиции в обор. кап. | 3 459 | (2 379) | - |
| Чистый операцион. денеж. поток | 7 850 | 13 165 | -40.4% |
| Чистое увеличение денег. средств | 4 347 | 5 020 | -13.4% |

| млн. руб. | 1К12 | 2011 | % |
|---------------------------|---------|---------|---------|
| Активы | 289 669 | 240 964 | 20.2% |
| в т.ч. денежные средства | 16 034 | 12 014 | 33.5% |
| Долг | 126 941 | 95 553 | 32.9% |
| доля краткосрочного долга | 43.8% | 21.0% | 22.8 пп |
| Чистый долг | 110 907 | 83 539 | 32.8% |
| Капитал | 125 884 | 113 097 | 11.3% |
| CAPEX | 6 979 | 21 420 | - |
| CAPEX/ЕБИТДА | 0.4x | 0.3x | - |
| Долг/ЕБИТДА LTM | 1.9x | 1.5x | - |
| Ч. Долг/ЕБИТДА LTM | 1.6x | 1.3x | - |
| ЕБИТДА/Процентные платежи | 19.6x | 8.9x | - |
| Долг/Капитал | 1.0x | 0.8x | - |

Источник: Данные Компании,
расчеты Банка ЗЕНИТ

Операционные показатели АЛРОСА в 1К12

| млн. карат | 1К12 | 1К11 | % |
|------------|------|------|--------|
| Добыча | 8.1 | 10.0 | -19.0% |
| Реализация | 9.5 | 9.1 | 4.4% |

Источник: Данные Компании,
расчеты Банка ЗЕНИТ

- Отметим, что, в связи с выкупом газовых активов, менеджмент компании заявил, что считает газовый бизнес непрофильным активом и намерен искать покупателя на контрольный пакет добывающих компаний, а за счет вырученных средств предполагается погасить часть привлеченного за счет размещения ЕСП долга (во 2П12 АЛРОСА предстоит погасить обязательств на 1 364 млн. долл., из которых задолженность по ЕСП составляет 954 млн. долл.). В то же время, одним из вариантов развития событий может стать обмен газовых активов АЛРОСА на алмазодобывающие активы Лукойла (месторождение им. Гриба в Архангельской области, запуск промышленной добычи запланирован на 4К13). Наконец, в 2012 г. может состояться IPO АЛРОСА. Согласно заявлению Минэкономразвития, до конца года предлагается разместить 14% акций АЛРОСА на ММВБ (7% из федерального пакета и 7% из пакета Якутии), что позволит определить справедливую рыночную стоимость акций в условиях увеличенного free-float, а привлеченные средства частично могут быть направлены на снижение долговой нагрузки компании.

На сложившихся уровнях доходности, мы не видим каких-либо идей в ближних евробондах АЛРОСА'14, которые торгуются с дисконтом около 100 бп к выпуску Северсталь'16. На рублевом рынке выпуски АЛРОСА выглядят более привлекательно: короткие выпуски компании торгуются уже на уровне бумаг Северстали. Вместе с тем, наиболее ликвидные рублевые выпуски АЛРОСА торгуются с дисконтом 100-150 бп к сопоставимым по дюрации выпускам Евраза, что, на наш взгляд, выглядит неоправданно широко с точки зрения разницы в кредитном качестве компаний и делает бумаги Евраза более интересной покупкой.

Первичный рынок

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Ломбард ЦБ | Объем эмиссии, млн. руб. | Ориентир УТР/УТМ | Закрытие книги | Дата размещения | Амортизация/Дюрация | Оферта/Погашение |
|------------------------------|------------------|------------|--------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------------|------------------|
| Русское море, БО-01 | NR | нет | 1 000 | 11.83-12.89 | 21.06.2012 | 26.06.2012 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| Управление отходами - НН, 01 | NR | нет | 1 000 | н/д | 25.06.2012 | 27.06.2012 | нет / н/д | н/д / 10 лет |

Источник: Bloomberg, Cbonds, Finam

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Ломбард ЦБ | Объем эмиссии, млн. руб. | Bid cover/Размещ объем | Ориентир УТР/УТМ | Фактическая УТР/УТМ | Дата размещения | Амортизация/Дюрация |
|---------------------------------|------------------|------------|--------------------------|------------------------|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Металлинвестбанк, 01 | - / B2 / - | да | 1 500 | н/д / 100% | 9.99-10.51 | 10.41 | 19.06.2012 | нет / 0.5 г. |
| Синергия, БО-03 | - / - / B | да | 2 000 | н/д / 100% | 11.04-11.57 | 11.30 | 06.06.2012 | да / 2.36 г. |
| Кит Финанс Капитал, 03 | NR | нет | 1 150 | н/д / 100% | 11.30 | 11.30 | 29.05.2012 | нет / 3 г. |
| СМП Банк, 01 | - / B3 / - | да | 3 000 | 1.2 / 100% | 10.25-10.78 | 10.50 | 29.05.2012 | нет / 0.5 г. |
| Ютэйр-Финанс, БО-08 | NR | нет | 1 500 | н/д / 100% | 10.31 | 10.31 | 29.05.2012 | нет / 2.66 г. |
| Ютэйр-Финанс, БО-16 | NR | нет | 1 000 | н/д / 100% | 9.00 | 9.00 | 29.05.2012 | нет / 1.87 г. |
| Домашние Деньги, 01 | NR | нет | 1 000 | н/д / 100% | 19.92 | 19.92 | 03.05.2012 | нет / 2.44 г. |
| Банк Русский Стандарт, БО-06 | B+ / Baa3 / B+ | да | 5 000 | н/д / 100% | 9.47-10.00 | 9.62 | 03.05.2012 | нет / 1.44 г. |
| НМТП, БО-02 | BB- / Baa3 / - | да | 4 000 | 3.0 / 100% | 9.73-10.25 | 9.20 | 02.05.2012 | нет / 2.70 г. |
| ФСК ЭЭС, 12 | BBB / Baa2 / - | да | 10 000 | 1.4 / 100% | 8.37-8.58 | 8.26 | 27.04.2012 | нет / 3.49 г. |
| Банк Кольцо Урала, 01 | B- / - / - | да | 1 000 | н/д / 100% | 11.56-12.09 | 11.83 | 27.04.2012 | нет / 1 г. |
| Азиатско-Тихоокеанский Банк, 01 | - / B2 / - | да | 1 500 | 2.8 / 100% | 10.93-11.46 | 10.50 | 27.04.2012 | нет / 1 г. |
| МКБ, БО-03 | B+ / B1 / B+ | да | 4 000 | н/д / 100% | 9.46-9.73 | 9.46 | 27.04.2012 | нет / 1 г. |
| Ютэйр-Финанс, БО-06 | NR | нет | 1 500 | н/д / 100% | 10.17-10.38 | 10.38 | 25.04.2012 | нет / 1 г. |
| Ютэйр-Финанс, БО-07 | NR | нет | 1 500 | н/д / 100% | 10.17-10.38 | 10.38 | 25.04.2012 | нет / 1 г. |
| Связь-Банк, 04 | BB / - / BB | да | 5 000 | н/д / 100% | 8.94-9.20 | 8.94 | 25.04.2012 | нет / 1 г. |
| Трансмашхолдинг, БО-01 (втор.) | NR | нет | 3 000 | н/д / 100% | 9.75-10.25 | н/д | 25.04.2012 | нет / 1.7 г. |
| ЛК Уралсиб, БО-07 | - / - / BB- | да | 2 000 | 1.4 / 100% | 11.08-11.46 | 11.46 | 25.04.2012 | да / 1.50 г. |
| УОМЗ, 04 | B- / - / - | да | 1 500 | 0.8 / 80% | 10.78-11.30 | 10.78 | 24.04.2012 | нет / 1.44 г. |
| Ленэнерго, 04 | - / Baa2 / - | да | 3 000 | 5.1 / 100% | 9.20-9.73 | 8.68 | 24.04.2012 | нет / 2.71 г. |
| Каркаде, 02 | - / - / B+ | да | 1 500 | н/д / 100% | 12.55-13.65 | 13.65 | 20.04.2012 | да / 1.51 г. |
| ТКС Банк, БО-04 | - / B2 / B | да | 1 500 | 1.9 / 100% | 13.96-14.50 | 13.70 | 19.04.2012 | нет / 1 г. |
| Центр-инвест, БО-2 | - / Baa3 / - | да | 1 500 | 1.1 / 100% | 9.41-9.93 | 9.93 | 19.04.2012 | нет / 1 г. |
| Связь-Банк, 05 | BB / - / BB | да | 5 000 | н/д / 100% | 9.73 | 9.73 | 19.04.2012 | нет / 2.69 г. |
| С-Петербург Телеком, 07 | - / - / BB+ | да | 6 000 | н/д / 100% | 9.47-9.73 | 9.31 | 17.04.2012 | нет / 2.69 г. |
| РСХБ, 16 | - / Baa1 / BBB | да | 10 000 | н/д / 100% | 8.58-8.78 | 8.73 | 16.04.2012 | нет / 2.71 г. |



Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|------------|--------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| ОФЗ | | | | | | | | | | | | | |
| ОФЗ 26199 | | 11/07/12 | 99.97 | 100.01 | 99.97 | -0.04 | 13 | 168 093 | 6.74 | 0.06 | | | 44 000 |
| ОФЗ 25073 | | 01/08/12 | 100.06 | 100.08 | 100.08 | 0.04 | 34 | 1 029 275 | 6.17 | 0.12 | | | 150 000 |
| ОФЗ 46002 | | 08/08/12 | 97.00 | | | | | | 8.81 | 0.13 | 211 | | 62 000 |
| ОФЗ 25069 | | 19/09/12 | 101.01 | 101.10 | | | | | 6.21 | 0.25 | | | 45 000 |
| ОФЗ 25067 | | 17/10/12 | 96.50 | 101.50 | 101.64 | 0.01 | 2 | 7 815 | 6.31 | 0.32 | | | 45 000 |
| ОФЗ 26198 | | 02/11/12 | 92.00 | | 99.80 | | 2 | 4 766 | 6.44 | 0.37 | | | 42 000 |
| ОФЗ 25072 | | 23/01/13 | 100.30 | | | | | | 6.54 | 0.58 | 125 | | 150 000 |
| ОФЗ 25078 | | 06/02/13 | 99.30 | 100.30 | 100.12 | 0.12 | 2 | 80 500 | 6.59 | 0.62 | 121 | | 100 000 |
| ОФЗ 25065 | | 27/03/13 | 103.85 | 104.25 | 104.25 | 0.05 | 1 | 232 | 6.43 | 0.73 | 83 | | 46 000 |
| ОФЗ 26200 | | 17/07/13 | | 99.55 | 99.30 | -0.10 | 1 | 10 000 | 6.95 | 1.04 | 85 | 30 | 50 000 |
| ОФЗ 26201 | | 16/10/13 | 85.58 | | | | | | 6.17 | 1.27 | | | 47 000 |
| ОФЗ 25076 | | 13/03/14 | 99.85 | 99.89 | 99.89 | -0.10 | 28 | 674 677 | 7.29 | 1.63 | 57 | 69 | 155 000 |
| ОФЗ 25068 | | 20/08/14 | 109.00 | 109.50 | | | | | 7.36 | 1.92 | 42 | 78 | 45 000 |
| ОФЗ 26202 | | 17/12/14 | 103.00 | 108.90 | 108.90 | 0.05 | 2 | 2 | 7.46 | 2.22 | 31 | 89 | 40 000 |
| ОФЗ 25071 | | 26/11/14 | 101.55 | 101.80 | 101.57 | -0.08 | 1 | 2 000 | 7.52 | 2.25 | 35 | 95 | 80 000 |
| ОФЗ 25079 | | 03/06/15 | | 99.00 | 99.81 | 0.86 | 10 | 500 005 | 7.20 | 2.71 | | 64 | 150 000 |
| ОФЗ 25075 | | 15/07/15 | 98.50 | 98.70 | 98.50 | | 2 | 3 400 | 7.57 | 2.74 | 13 | 101 | 150 000 |
| ОФЗ 25077 | | 20/01/16 | 98.00 | 99.19 | 99.18 | 0.03 | 4 | 7 502 | 7.76 | 3.12 | 14 | 120 | 150 000 |
| ОФЗ 46017 | | 03/08/16 | 95.00 | 95.70 | 95.70 | -0.10 | 3 | 25 003 | 7.97 | 3.21 | 31 | 141 | 80 000 |
| ОФЗ 26203 | | 03/08/16 | 96.75 | 97.00 | 96.90 | | 2 | 52 500 | 7.94 | 3.56 | 14 | 137 | 150 000 |
| ОФЗ 48001 | | 31/10/18 | | | | | | | 8.80 | 3.75 | 93 | 222 | 24 000 |
| ОФЗ 46019 | | 20/03/19 | | | | | | | 4.82 | 4.07 | | | 26 000 |
| ОФЗ 25080 | | 19/04/17 | | 97.90 | | | | | 8.22 | 4.09 | 23 | 164 | 150 000 |
| ОФЗ 26206 | | 14/06/17 | 97.55 | 97.65 | 97.80 | | 4 | 2 503 | 8.10 | 4.25 | 6 | 151 | 150 000 |
| ОФЗ 26204 | | 15/03/18 | 97.40 | 97.60 | 97.50 | -0.20 | 2 | 2 501 | 8.21 | 4.67 | 4 | 160 | 150 000 |
| ОФЗ 46021 | | 08/08/18 | | 89.50 | | | | | 6.37 | 4.72 | | | 107 000 |
| ОФЗ 46014 | | 29/08/18 | | 96.00 | | | | | 8.01 | 4.84 | | 139 | 62 000 |
| ОФЗ 26208 | | 27/02/19 | 95.90 | 96.08 | 96.00 | -0.17 | 32 | 537 484 | 8.46 | 5.24 | 13 | 182 | 150 000 |
| ОФЗ 46005 | | 09/01/19 | | | | | | | 8.33 | 6.04 | | 164 | 27 000 |
| ОФЗ 46018 | | 24/11/21 | 87.00 | 93.57 | | | | | 8.03 | 6.36 | | 131 | 133 000 |
| ОФЗ 26205 | | 14/04/21 | 95.00 | 95.20 | 95.15 | -0.05 | 24 | 409 851 | 8.56 | 6.44 | | 184 | 150 000 |
| ОФЗ 46022 | | 19/07/23 | | 105.00 | | | | | 7.53 | 7.44 | | 74 | 45 000 |
| ОФЗ 26207 | | 03/02/27 | 95.35 | 95.85 | 95.75 | 0.25 | 4 | 50 001 | 8.85 | 8.44 | | 198 | 150 000 |
| ОФЗ 46012 | | 05/09/29 | | 91.50 | | | | | 6.30 | 11.21 | | | 40 000 |
| ОФЗ 46020 | | 06/02/36 | 84.01 | 89.25 | 84.00 | -2.00 | 1 | 112 | 8.68 | 10.56 | | 165 | 135 000 |

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

| | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------|----------|--------|--------|--------|-------|----|---------|-------|------|-----|-----|--------|
| НорНикель | | | | | | | | | | | | | |
| НорНикель ВОЗ | | 30/07/13 | 99.45 | 99.70 | | | | | 7.71 | 1.06 | 158 | 106 | 15 000 |
| НЛМК | | | | | | | | | | | | | |
| НЛМК ВО5 | | 30/10/12 | 101.05 | 101.28 | 101.12 | 0.04 | 2 | 250 001 | 7.64 | 0.36 | | 89 | 10 000 |
| НЛМК ВО1 | | 04/12/12 | 101.00 | 101.10 | 101.00 | 0.05 | 2 | 4 385 | 7.61 | 0.46 | | 89 | 5 000 |
| НЛМК ВО6 | | 05/03/13 | 99.65 | 100.01 | 99.80 | 0.15 | 4 | 205 002 | 8.18 | 0.69 | 265 | 150 | 10 000 |
| НЛМК ВО2 | 19/06/13 | 17/12/14 | 100.01 | 100.95 | | | | | 8.70 | 0.98 | 269 | 205 | 5 000 |
| НЛМК ВО3 | 19/06/13 | 17/12/14 | 100.40 | 100.80 | 100.50 | 0.23 | 1 | 25 000 | 8.39 | 0.98 | 238 | 174 | 5 000 |
| НЛМК ВО7 | | 11/11/14 | 100.20 | 100.98 | 100.45 | -0.02 | 8 | 215 000 | 8.92 | 2.19 | 179 | 235 | 10 000 |
| ММК | | | | | | | | | | | | | |
| ММК ВО2 | 14/12/11 | 12/12/12 | | | | | | | -0.01 | 1.00 | | | 10 000 |
| ММК ВО1 | | 15/11/12 | | | | | | | 8.85 | 0.41 | | 211 | 5 000 |
| ММК ВО5 | | 04/04/13 | 99.55 | 99.64 | 99.60 | | 7 | 84 758 | 8.33 | 0.77 | 264 | 166 | 8 000 |
| ММК ВО8 | 15/08/13 | 12/02/15 | | | | | | | 8.44 | 1.10 | 227 | 180 | 5 000 |
| ММК ВО4 | | 27/02/14 | 85.02 | | | | | | 7.79 | 1.58 | 111 | 119 | 5 000 |
| ММК ВО6 | | 10/07/14 | | | | | | | 9.90 | 1.88 | 298 | 332 | 5 000 |
| ММК ВО7 | | 22/07/14 | 95.25 | 95.60 | 95.50 | -0.50 | 3 | 100 000 | 9.91 | 1.92 | 297 | 333 | 5 000 |
| Севсталь | | | | | | | | | | | | | |
| Севсталь ВО1 | 20/09/11 | 18/09/12 | 100.00 | 100.03 | 100.03 | 0.03 | 6 | 19 995 | 7.44 | 0.25 | | 66 | 15 000 |
| Севсталь ВО2 | | 15/02/13 | 101.10 | 101.50 | 100.95 | -0.35 | 1 | 6 | 8.37 | 0.64 | 295 | 168 | 10 000 |
| Севсталь ВО4 | | 15/02/13 | 101.10 | 101.49 | | | | | 8.13 | 0.64 | 271 | 144 | 5 000 |
| Алроса | | | | | | | | | | | | | |
| Алроса 21 | 25/06/13 | 18/06/15 | | | | | | | 8.69 | 0.96 | 269 | 204 | 8 000 |
| Алроса 22 | 28/06/13 | 23/06/15 | 100.01 | 100.14 | 100.10 | 0.10 | 14 | 13 701 | 8.40 | 0.97 | 239 | 175 | 8 000 |
| Алроса 23 | | 18/06/15 | | | | | | | 9.11 | 2.60 | 174 | 255 | 7 000 |
| Алроса 20 | | 23/06/15 | 100.38 | 100.45 | 100.38 | -0.03 | 10 | 50 000 | 9.10 | 2.62 | 173 | 254 | 3 000 |
| Евраз | | | | | | | | | | | | | |
| Евраз 1 | 22/03/13 | 13/03/20 | 100.15 | 100.70 | | | | | 9.13 | 0.73 | 351 | 246 | 10 000 |
| Евраз 3 | 22/03/13 | 13/03/20 | 98.01 | 101.18 | | | | | 9.35 | 0.73 | 373 | 268 | 5 000 |
| Сибметинвест 1 | 16/10/14 | 10/10/19 | 106.80 | 107.30 | | | | | 10.33 | 2.04 | 330 | 376 | 10 000 |
| Сибметинвест 2 | 16/10/14 | 10/10/19 | 106.00 | 108.99 | | | | | 10.33 | 2.04 | 330 | 376 | 10 000 |
| Евраз 2 | 26/10/15 | 19/10/20 | 97.70 | 98.90 | | | | | 10.85 | 2.89 | 334 | 429 | 10 000 |
| Евраз 4 | 26/10/15 | 19/10/20 | 99.90 | 103.50 | | | | | 11.14 | 2.89 | 363 | 458 | 5 000 |
| Евраз 5 | 06/06/16 | 27/05/21 | 94.00 | 102.99 | | | | | 10.54 | 3.42 | 280 | 397 | 5 000 |
| Евраз 7 | 02/06/16 | 25/05/21 | 93.00 | 95.00 | 93.00 | | 1 | 4 | 10.89 | 3.41 | 315 | 432 | 15 000 |
| Металлоинвест | | | | | | | | | | | | | |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|-----------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| Металлоинвест 1 | 16/03/15 | 07/03/22 | 97.75 | 99.49 | | | | | 10.15 | 2.43 | 288 | 358 | 5 000 |
| Металлоинвест 5 | 16/03/15 | 07/03/22 | 98.00 | 99.10 | 98.50 | 0.10 | 1 | 3 000 | 9.86 | 2.43 | 259 | 329 | 10 000 |
| Металлоинвест 6 | 19/03/15 | 10/03/22 | 98.00 | 99.60 | 98.20 | 0.10 | 3 | 9 200 | 9.99 | 2.44 | 271 | 342 | 10 000 |
| Мечел | | | | | | | | | | | | | |
| Мечел 4 | 26/07/12 | 21/07/16 | 100.36 | 100.95 | 100.85 | -0.20 | 7 | 312 201 | 10.47 | 0.10 | | 380 | 5 000 |
| Мечел 5 | 16/10/12 | 09/10/18 | 100.31 | 100.98 | 100.40 | -0.30 | 5 | 443 102 | 11.67 | 0.32 | | 491 | 5 000 |
| Мечел ВО1 | 11/11/11 | 09/11/12 | 99.00 | 99.74 | | | | | 11.89 | 0.39 | | 515 | 5 000 |
| Мечел ВО2 | | 12/03/13 | 97.35 | 98.90 | | | | | 14.69 | 0.70 | 913 | 801 | 5 000 |
| Мечел ВО3 | | 24/04/13 | 97.40 | 98.80 | | | | | 13.21 | 0.82 | 744 | 655 | 5 000 |
| Мечел 2 | 15/06/11 | 12/06/13 | 96.10 | 96.25 | 96.25 | 0.05 | 6 | 26 114 | 11.90 | 0.96 | 591 | 525 | 5 000 |
| Мечел 15 | 18/02/14 | 09/02/21 | 93.50 | 94.51 | | | | | 13.08 | 1.55 | 643 | 647 | 5 000 |
| Мечел 16 | 18/02/14 | 09/02/21 | 93.50 | 94.40 | 94.50 | 0.99 | 1 | 400 | 12.33 | 1.55 | 568 | 572 | 5 000 |
| Мечел ВО4 | 11/02/14 | 10/02/15 | 96.00 | 98.75 | 96.00 | -2.00 | 1 | 2 | 13.43 | 1.50 | 682 | 682 | 5 000 |
| Мечел ВО5 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 423 | 499 | 5 000 |
| Мечел ВО6 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | | | | | 2 000 |
| Мечел ВО7 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 423 | 499 | 2 000 |
| Мечел ВО11 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 423 | 499 | 3 000 |
| Мечел ВО12 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 423 | 499 | 3 000 |
| Мечел 13 | 01/09/15 | 25/08/20 | 93.75 | 98.49 | | | | | 12.80 | 2.73 | 537 | 624 | 5 000 |
| Мечел 14 | 01/09/15 | 25/08/20 | 90.06 | 92.00 | 91.02 | -3.73 | 3 | 3 | 13.99 | 2.71 | 657 | 743 | 5 000 |
| Мечел 17 | 02/06/16 | 27/05/21 | 88.02 | 90.00 | | | | | 12.33 | 3.40 | 460 | 576 | 5 000 |
| Мечел 18 | 02/06/16 | 27/05/21 | 80.00 | 89.90 | | | | | 11.24 | 3.41 | 350 | 467 | 5 000 |
| Мечел 19 | 07/06/16 | 01/06/21 | 81.60 | 89.80 | | | | | 13.84 | 3.43 | 609 | 727 | 5 000 |
| ТМК | | | | | | | | | | | | | |
| ТМК ВО1 | | 22/10/13 | 99.01 | 99.10 | 99.10 | 0.06 | 5 | 65 | 9.79 | 1.28 | 341 | 316 | 5 000 |
| СУЭК | | | | | | | | | | | | | |
| СУЭК 1 | 05/07/13 | 26/06/20 | 98.27 | 100.87 | 100.85 | 0.97 | 7 | 20 222 | 8.65 | 0.98 | 264 | 200 | 10 000 |
| РМК | | | | | | | | | | | | | |
| РМК 3 | 17/12/13 | 15/12/15 | 97.01 | 98.74 | | | | | 13.07 | 1.42 | 654 | 645 | 3 000 |
| РМК 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 93.01 | 95.74 | | | | | 12.27 | 1.83 | 539 | 569 | 5 000 |
| ЧТПЗ | | | | | | | | | | | | | |
| ЧТПЗ ВО1 | 05/06/12 | 04/12/12 | 100.30 | 100.84 | 100.15 | 0.03 | 2 | 113 | 12.49 | 0.46 | | 577 | 5 000 |
| КОКС | | | | | | | | | | | | | |
| КОКС ВО2 | | 28/05/14 | 90.00 | 98.00 | 95.55 | -0.28 | 2 | 8 | 11.64 | 1.81 | 477 | 506 | 5 000 |
| Русал | | | | | | | | | | | | | |
| Русал 7 | 03/03/14 | 22/02/18 | 92.40 | 93.10 | 93.44 | 1.04 | 6 | 299 | 13.09 | 1.58 | 641 | 649 | 15 000 |
| Русал 8 | 15/04/15 | 05/04/21 | 87.51 | 87.80 | 87.50 | | 6 | 11 095 | 14.49 | 2.50 | 718 | 793 | 15 000 |

ИНФРАСТРУКТУРА

| | | | | | | | | | | | | | |
|---------------------|----------|----------|--------|--------|--------|-------|---|---------|-------|------|-----|-----|--------|
| РЖД | | | | | | | | | | | | | |
| РЖД 7 | | 07/11/12 | 100.20 | 100.34 | 100.34 | -0.01 | 2 | 850 | 6.72 | 0.38 | | | 5 000 |
| РЖД ВО1 | | 05/12/12 | 100.85 | 101.04 | 101.04 | 0.19 | 4 | 53 040 | 7.17 | 0.46 | | 45 | 15 000 |
| РЖД 9 | 18/05/11 | 13/11/13 | 98.65 | 98.95 | 98.68 | 0.03 | 8 | 50 001 | 8.06 | 1.35 | 160 | 144 | 15 000 |
| РЖД 10 | | 06/03/14 | 111.25 | 111.31 | 111.32 | 0.05 | 6 | 252 000 | 7.93 | 1.52 | 130 | 132 | 15 000 |
| РЖД 23 | 29/01/15 | 16/01/25 | 101.90 | 102.08 | | | | | 8.24 | 2.31 | 104 | 167 | 15 000 |
| РЖД 11 | | 18/11/15 | 97.25 | 97.54 | | | | | 8.92 | 3.04 | 134 | 236 | 15 000 |
| РЖД 16 | 06/06/16 | 05/06/17 | 97.16 | 97.45 | | | | | 8.37 | 3.47 | 61 | 180 | 15 000 |
| РЖД 19 | 16/07/18 | 08/07/24 | 99.77 | 100.07 | | | | | 8.34 | 4.75 | 14 | 172 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС | | | | | | | | | | | | | |
| ФСК ЕЭС 6 | 26/09/13 | 15/09/20 | 99.00 | 99.09 | 99.00 | 0.07 | 1 | 43 000 | 8.14 | 1.22 | 182 | 151 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 8 | 26/09/13 | 15/09/20 | 99.00 | 99.35 | 99.00 | -0.05 | 1 | 43 000 | 8.14 | 1.22 | 182 | 151 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 18 | 09/06/14 | 27/11/23 | 100.50 | 101.50 | 100.60 | -0.30 | 4 | 16 339 | 8.33 | 1.85 | 143 | 175 | 15 000 |
| ФСК ЕЭС 15 | 23/10/14 | 12/10/23 | 100.50 | 100.94 | 100.94 | | 1 | 600 | 8.46 | 2.14 | 136 | 189 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 10 | 24/09/15 | 15/09/20 | 96.90 | 97.50 | 97.50 | 0.20 | 1 | 1 | 8.82 | 2.89 | 131 | 226 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 7 | 27/10/15 | 16/10/20 | 96.00 | 96.35 | 96.10 | -0.46 | 1 | 100 000 | 9.06 | 2.99 | 150 | 250 | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 9 | 24/10/17 | 16/10/20 | 96.00 | 96.70 | | | | | 8.64 | 4.39 | 55 | 204 | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 11 | 24/10/17 | 16/10/20 | 96.00 | 96.70 | | | | | 9.03 | 4.39 | 94 | 243 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 19 | 18/07/18 | 06/07/23 | 94.25 | 96.75 | | | | | 9.36 | 4.73 | 117 | 274 | 20 000 |
| ФСК ЕЭС 13 | | 22/06/21 | | 99.00 | | | | | 8.60 | 6.18 | 4 | 190 | 10 000 |
| Росавтодор | | | | | | | | | | | | | |
| Росавтодор 1 | | 29/11/16 | 100.80 | 101.20 | | | | | 9.81 | 3.80 | 192 | 323 | 3 000 |
| Росводоканал | | | | | | | | | | | | | |
| Росводоканал 3 | 11/11/13 | 09/11/15 | 96.02 | 100.00 | 97.96 | -0.20 | 4 | 12 | 10.88 | 1.33 | 444 | 426 | 3 000 |
| Водоканал | | | | | | | | | | | | | |
| Водоканал 1 | | 09/12/15 | | 99.50 | | | | | 8.99 | 3.06 | 140 | 243 | 2 000 |
| Западный СД | | | | | | | | | | | | | |
| Западный СД 1 | 29/04/16 | 13/05/31 | 98.50 | 99.45 | | | | | 9.35 | 3.34 | 164 | 278 | 5 000 |
| Западный СД 2 | 29/04/16 | 13/05/31 | 98.50 | 99.45 | | | | | 9.27 | 3.28 | 159 | 270 | 5 000 |
| Западный СД 3 | 24/02/17 | 06/02/32 | 84.58 | | | | | | 9.78 | 3.81 | 189 | 320 | 5 000 |
| Западный СД 4 | 24/02/17 | 06/02/32 | 86.00 | | 98.40 | -0.10 | 2 | 50 000 | 9.80 | 3.80 | 191 | 322 | 5 000 |
| Западный СД 5 | 24/02/17 | 06/02/32 | | | | | | | 9.49 | 3.81 | 160 | 291 | 5 000 |
| Почта России | | | | | | | | | | | | | |
| Почта России 1 | 25/03/14 | 22/03/16 | 97.00 | 98.15 | | | | | 10.06 | 1.64 | 333 | 346 | 7 000 |

НЕФТЬ и ГАЗ

ГАЗПРОМ

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|--------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| Газпром А13 | | 26/06/12 | | | | | | | 5.64 | 0.02 | | | 10 000 |
| Газпром Капитал-3 | 08/11/12 | 06/11/14 | 100.00 | 100.05 | 100.00 | -0.05 | 6 | 36 870 | 7.61 | 0.39 | | 87 | 15 000 |
| Газпром А9 | | 12/02/14 | 95.80 | 99.00 | | | | | 8.17 | 1.55 | 152 | 156 | 5 000 |
| Газпром А11 | | 24/06/14 | | | | | | | 8.17 | 1.73 | 137 | 158 | 5 000 |
| Лукойл | | | | | | | | | | | | | |
| Лукойл БО-1 | | 06/08/12 | 100.73 | 100.84 | 100.84 | 0.06 | 1 | 250 | 6.64 | 0.13 | | | 5 000 |
| Лукойл БО-2 | | 06/08/12 | 100.70 | 101.00 | 100.84 | -0.11 | 2 | 138 699 | 6.64 | 0.13 | | | 5 000 |
| Лукойл БО-3 | | 06/08/12 | | | | | | | 6.87 | 0.13 | | 18 | 5 000 |
| Лукойл БО-4 | | 06/08/12 | 100.70 | 100.85 | 100.84 | 0.04 | 2 | 21 301 | 6.64 | 0.13 | | | 5 000 |
| Лукойл БО-5 | | 06/08/12 | | 100.85 | | | | | 6.95 | 0.13 | | 26 | 5 000 |
| Лукойл БО-6 | | 13/12/12 | | 101.00 | | | | | 7.84 | 0.48 | | 113 | 5 000 |
| Лукойл БО-7 | | 13/12/12 | | 101.29 | | | | | 7.84 | 0.48 | | 113 | 5 000 |
| Лукойл 4 | | 05/12/13 | 99.30 | 99.55 | 99.60 | | 3 | 499 | 7.84 | 1.41 | 132 | 122 | 6 000 |
| Газпром нефть | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром нефть 3 | 23/07/12 | 12/07/16 | 100.63 | 100.70 | 100.69 | -0.05 | 3 | 2 869 | 6.94 | 0.09 | | 27 | 8 000 |
| Газпром нефть БО-5 | | 09/04/13 | | 99.75 | | | | | 7.73 | 0.79 | 202 | 106 | 10 000 |
| Газпром нефть БО-6 | | 09/04/13 | 99.40 | 99.75 | 99.30 | 0.18 | 3 | 25 050 | 8.21 | 0.79 | 250 | 154 | 10 000 |
| Газпром нефть 11 | 03/02/15 | 25/01/22 | 99.40 | 99.90 | 99.70 | 0.05 | 1 | 11 000 | 8.55 | 2.34 | 133 | 198 | 10 000 |
| Газпром нефть 8 | | 02/02/16 | 99.00 | 99.75 | 99.00 | | 1 | 191 | 9.02 | 3.10 | 141 | 246 | 10 000 |
| Газпром нефть 9 | 08/02/16 | 26/01/21 | 99.00 | 110.10 | 99.00 | | 1 | 1 582 | 9.02 | 3.11 | 141 | 246 | 10 000 |
| Газпром нефть 10 | 05/02/18 | 26/01/21 | 95.00 | 110.04 | | | | | 8.68 | 4.39 | 59 | 208 | 10 000 |
| Газпром нефть 4 | 10/04/18 | 09/04/19 | 94.25 | 98.90 | | | | | 9.76 | 4.64 | 160 | 315 | 10 000 |
| НОВАТЭК | | | | | | | | | | | | | |
| НОВАТЭК БО-1 | | 25/06/13 | 99.00 | 100.20 | 100.05 | 0.15 | 2 | 100 | 7.59 | 0.96 | 160 | 94 | 10 000 |
| ТАТНЕФТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Татнефть БО-1 | | 20/09/13 | 98.50 | 99.00 | | | | | 8.70 | 1.20 | 240 | 207 | 5 000 |
| Башнефть | | | | | | | | | | | | | |
| Башнефть 1 | 18/12/12 | 13/12/16 | 102.20 | 102.35 | 102.20 | -0.04 | 10 | 10 580 | 8.04 | 0.50 | | 133 | 15 000 |
| Башнефть 2 | 18/12/12 | 13/12/16 | 102.20 | 102.30 | | | | | 7.98 | 0.50 | | 127 | 15 000 |
| Башнефть 3 | 18/12/12 | 13/12/16 | 102.25 | 102.47 | 102.25 | 0.08 | 4 | 12 220 | 7.94 | 0.50 | | 123 | 20 000 |
| Башнефть БО1 | 05/12/13 | 02/12/14 | 101.05 | 101.09 | 101.09 | 0.09 | 10 | 47 262 | 8.72 | 1.39 | 221 | 210 | 10 000 |
| Башнефть 4 | 13/02/15 | 04/02/22 | 99.70 | 100.20 | 99.80 | 0.05 | 4 | 201 501 | 9.28 | 2.35 | 206 | 271 | 10 000 |
| НК Альянс | | | | | | | | | | | | | |
| НК Альянс 3 | 30/07/13 | 21/07/20 | 95.00 | 100.00 | | | | | 10.63 | 1.04 | 453 | 398 | 5 000 |
| НК Альянс БО-1 | | 04/02/14 | 95.31 | 99.82 | 97.80 | | 11 | 60 242 | 11.03 | 1.50 | 443 | 442 | 5 000 |
| НК Альянс 4 | 07/06/16 | 01/06/21 | 89.00 | 99.98 | | | | | 11.73 | 3.40 | 400 | 516 | 5 000 |
| НК Альянс 6 | 10/06/16 | 04/06/21 | 90.01 | 96.00 | | | | | 11.73 | 3.41 | 399 | 516 | 7 000 |
| Сахатранснефтегаз | | | | | | | | | | | | | |
| Сахатрнфг2 | | 26/07/13 | 99.50 | 99.79 | | | | | 13.18 | 1.01 | 711 | 653 | 3 000 |
| БК Евразия | | | | | | | | | | | | | |
| БК Евразия 1 | 22/06/16 | 20/06/18 | 95.01 | | | | | | 9.87 | 3.33 | 216 | 330 | 5 000 |
| ГОСБАНКИ | | | | | | | | | | | | | |
| ВТБ | | | | | | | | | | | | | |
| ВТБ 6 | 11/07/12 | 06/07/16 | 99.99 | 100.02 | 100.00 | | 16 | 69 930 | 7.34 | 0.06 | | | 15 000 |
| ВТБ БО-6 | 21/12/12 | 19/12/14 | | | | | | | 8.01 | 0.49 | | 130 | 10 000 |
| ВТБ БО-7 | 25/01/13 | 23/01/15 | 99.90 | 100.18 | | | | | 8.51 | 0.59 | 320 | 181 | 10 000 |
| ВТБ БО-1 | | 15/03/13 | 99.55 | 99.60 | 99.60 | 0.20 | 18 | 41 985 | 8.42 | 0.72 | 283 | 175 | 5 000 |
| ВТБ БО-2 | | 15/03/13 | 99.41 | 100.00 | 99.60 | -0.05 | 6 | 74 000 | 8.42 | 0.72 | 283 | 175 | 5 000 |
| ВТБ БО-5 | | 15/03/13 | 99.60 | 99.89 | 99.75 | | 1 | 2 989 | 8.19 | 0.72 | 260 | 152 | 10 000 |
| ВТБ 5 | | 17/10/13 | 98.60 | 99.50 | | | | | 8.80 | 1.26 | 243 | 217 | 15 000 |
| ВТБ БО-03 | 18/03/14 | 17/03/15 | 98.37 | 100.49 | | | | | 8.91 | 1.64 | 218 | 231 | 5 000 |
| ВТБ БО-04 | 18/03/14 | 17/03/15 | 98.35 | 100.50 | | | | | 9.35 | 1.64 | 262 | 275 | 5 000 |
| ВТБ 24 3 | 30/05/12 | 29/05/13 | 99.50 | | | | | | 9.28 | 0.92 | 335 | 262 | 6 000 |
| ВТБ 24 1-ИП | 14/12/11 | 10/12/14 | 99.20 | 101.00 | | | | | 9.32 | 2.26 | 215 | 275 | 15 000 |
| ВТБ 24 5 | 23/08/12 | 20/02/14 | 99.82 | 99.88 | 99.88 | | 3 | 27 000 | 7.66 | 0.18 | | 93 | 8 000 |
| ВТБ-Лизинг 3 | 10/09/13 | 07/06/16 | 98.55 | 99.50 | 98.76 | 0.01 | 1 | 1 | 8.34 | 1.06 | 221 | 170 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 4 | 12/03/13 | 07/06/16 | 98.77 | 99.40 | | | | | 8.71 | 0.68 | 319 | 203 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 2 | 08/01/13 | 07/07/15 | 98.85 | 99.82 | | | | | 8.82 | 0.47 | | 210 | 10 000 |
| ВТБ-Лизинг 9 | 05/02/14 | 02/08/17 | 98.10 | 99.50 | | | | | 7.41 | 1.29 | 101 | 78 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 7 | 04/06/14 | 30/11/16 | 99.50 | 100.50 | | | | | 8.19 | 1.52 | 156 | 158 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 8 | 07/08/12 | 01/08/17 | 99.94 | 100.00 | 100.00 | | 2 | 5 380 | 7.98 | 0.13 | | 129 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 1 | 07/11/13 | 06/11/14 | 99.60 | 100.40 | | | | | 7.93 | 1.04 | 184 | 128 | 8 000 |
| ВЭБ | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ 8 | 22/10/13 | 13/10/20 | 98.00 | 99.40 | | | | | 7.75 | 1.29 | 135 | 112 | 15 000 |
| ВЭБ 21 | 10/03/15 | 17/02/32 | 99.00 | 99.48 | 99.50 | 0.65 | 5 | 230 501 | 8.79 | 2.44 | 152 | 222 | 15 000 |
| ВЭБ 9 | 24/03/16 | 18/03/21 | 96.02 | 96.45 | | | | | 9.39 | 3.26 | 171 | 282 | 15 000 |
| ВЭБ 10 | 27/09/16 | 21/09/21 | | | | | | | 8.67 | 3.61 | 85 | 210 | 15 000 |
| ВЭБ 6 | 17/10/17 | 13/10/20 | 92.23 | 95.49 | | | | | 9.36 | 4.36 | 128 | 276 | 10 000 |
| ВЭБ-Лизинг | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ-Лизинг 3 | 11/04/14 | 02/04/21 | | 98.00 | 97.50 | 0.18 | 2 | 100 000 | 9.22 | 1.70 | 244 | 263 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 8 | 28/10/14 | 19/10/21 | 99.55 | 100.50 | | | | | 11.05 | 2.16 | 394 | 448 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 9 | 29/10/14 | 20/10/21 | 99.75 | 100.50 | 100.10 | 1.10 | 1 | 5 000 | 8.94 | 2.16 | 183 | 237 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 6 | | 31/01/17 | 99.50 | 100.10 | 99.88 | -0.17 | 3 | 5 000 | 9.25 | 2.25 | 208 | 268 | 10 000 |
| ВЭБ-Лизинг 4 | 08/04/16 | 02/04/21 | | 99.00 | | | | | 9.41 | 3.27 | 173 | 284 | 5 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| ВЭБ-Лизинг 5 | 08/04/16 | 02/04/21 | | 100.00 | | | | | 9.34 | 3.27 | 166 | 277 | 5 000 |
| МСП Банк | | | | | | | | | | | | | |
| МСП Банк 01 | 27/03/14 | 17/03/22 | 98.91 | 99.50 | | | | | 9.53 | 1.65 | 280 | 293 | 5 000 |
| РСХБ | | | | | | | | | | | | | |
| РСХБ БО-1 | 29/08/12 | 28/08/13 | 99.88 | 100.00 | 99.88 | -0.11 | 3 | 10 900 | 7.91 | 0.19 | | 117 | 5 000 |
| РСХБ БО-5 | 29/08/12 | 28/08/13 | 99.99 | 100.00 | 99.99 | 0.02 | 7 | 12 936 | 7.30 | 0.19 | | 56 | 10 000 |
| РСХБ 8 | 22/11/12 | 14/11/19 | 100.90 | 101.10 | | | | | 7.53 | 0.42 | | 80 | 5 000 |
| РСХБ 9 | 22/11/12 | 14/11/19 | 100.20 | 101.25 | | | | | 7.78 | 0.42 | | 105 | 5 000 |
| РСХБ 10 | 06/02/13 | 29/01/20 | 100.40 | 101.90 | 100.63 | 0.13 | 2 | 7 455 | 8.09 | 0.61 | 272 | 140 | 5 000 |
| РСХБ 11 | 07/02/13 | 30/01/20 | 100.62 | 101.45 | 100.65 | 0.04 | 2 | 5 001 | 8.06 | 0.61 | 269 | 137 | 5 000 |
| РСХБ 7 | 11/06/13 | 05/06/18 | 98.25 | 98.75 | 98.25 | -0.40 | 3 | 51 095 | 8.95 | 0.96 | 296 | 230 | 5 000 |
| РСХБ БО-2 | 06/08/13 | 03/02/15 | | 99.75 | 99.72 | 0.17 | 3 | 70 000 | 8.63 | 1.07 | 249 | 199 | 5 000 |
| РСХБ БО-3 | 08/08/13 | 05/02/15 | | 99.75 | 99.45 | 0.55 | 5 | 55 003 | 8.89 | 1.08 | 274 | 225 | 5 000 |
| РСХБ БО-6 | 01/05/12 | 29/10/13 | 97.00 | 99.84 | | | | | 8.98 | 1.30 | 257 | 235 | 10 000 |
| РСХБ 15 | 05/11/13 | 26/10/21 | 99.95 | 100.34 | 99.91 | 0.01 | 11 | 51 305 | 9.00 | 1.32 | 258 | 238 | 10 000 |
| РСХБ 4 | 02/10/13 | 27/09/17 | | 105.00 | | | | | 7.63 | 1.23 | 129 | 100 | 10 000 |
| РСХБ 3 | 13/02/14 | 09/02/17 | 100.40 | 101.44 | 100.20 | -0.30 | 2 | 280 001 | 9.31 | 1.52 | 268 | 270 | 10 000 |
| РСХБ 6 | 15/08/14 | 09/02/18 | 86.00 | 98.50 | | | | | 8.29 | 2.08 | 123 | 172 | 5 000 |
| РСХБ 16 | 13/04/15 | 04/04/22 | 97.00 | 100.20 | 98.40 | 0.40 | 1 | 1 | 9.41 | 2.52 | 209 | 285 | 10 000 |
| РСХБ 14 | 07/07/15 | 29/06/21 | 95.25 | 97.25 | | | | | 9.65 | 2.67 | 225 | 309 | 10 000 |
| РСХБ 12 | 09/07/15 | 01/07/21 | 95.25 | 97.00 | 95.25 | -0.25 | 1 | 7 | 9.75 | 2.68 | 235 | 319 | 5 000 |
| РСХБ 13 | 10/07/15 | 02/07/21 | 95.25 | 97.24 | | | | | 9.03 | 2.68 | 162 | 247 | 5 000 |
| Газпромбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Газпромбанк 4 | | 15/11/12 | | | | | | | 7.08 | 0.41 | | 34 | 20 000 |
| Газпромбанк 5 | | 22/11/12 | | | | | | | 7.08 | 0.42 | | 35 | 20 000 |
| Газпромбанк БО-4 | 24/12/12 | 20/12/14 | 100.20 | 100.39 | 100.20 | 0.05 | 12 | 157 257 | 8.26 | 0.51 | 314 | 155 | 10 000 |
| Газпромбанк БО-2 | 22/07/13 | 18/07/14 | 98.30 | 98.60 | 98.30 | -0.20 | 1 | 1 | 8.59 | 1.04 | 249 | 194 | 10 000 |
| Газпромбанк БО-1 | | 08/12/13 | 99.10 | 99.60 | 99.60 | -0.10 | 1 | 10 | 8.20 | 1.41 | 168 | 158 | 10 000 |
| Газпромбанк БО-3 | 05/02/14 | 01/02/15 | 99.90 | 100.05 | 100.10 | 0.20 | 3 | 50 004 | 8.60 | 1.51 | 199 | 199 | 10 000 |
| АИЖК | | | | | | | | | | | | | |
| АИЖК А5 | | 15/10/12 | 99.40 | 100.00 | 99.95 | | 1 | 6 400 | 7.71 | 0.32 | | 95 | 2 000 |
| АИЖК А6 | | 15/07/14 | | | | | | | 7.97 | 1.48 | 138 | 136 | 3 000 |
| АИЖК А8 | | 15/06/18 | 95.00 | 99.80 | 99.56 | 1.76 | 9 | 1 348 | 8.00 | 3.06 | 41 | 144 | 5 000 |
| АИЖК А9 | | 15/02/17 | 98.70 | 99.70 | 98.70 | | 1 | 1 000 | 8.35 | 2.16 | 124 | 178 | 5 000 |
| АИЖК А7 | | 15/07/16 | | 100.20 | | | | | 7.66 | 2.18 | 54 | 109 | 4 000 |
| АИЖК А19 | 15/05/15 | 15/11/24 | 97.00 | 98.50 | | | | | 9.09 | 2.61 | 172 | 253 | 6 000 |
| АИЖК А18 | 15/04/16 | 15/07/23 | 96.00 | 97.00 | | | | | 9.45 | 3.27 | 177 | 288 | 7 000 |
| АИЖК А10 | | 15/11/18 | 91.76 | 99.90 | | | | | 8.62 | 3.28 | 93 | 205 | 6 000 |
| АИЖК А21 | | 15/02/20 | 96.60 | 99.65 | | | | | 9.09 | 3.43 | 134 | 252 | 15 000 |
| АИЖК А11 | | 15/09/20 | 97.50 | 100.00 | | | | | 8.99 | 4.09 | 100 | 241 | 10 000 |
| АИЖК А16 | | 15/09/21 | 95.00 | 99.00 | 97.70 | 1.68 | 1 | 1 000 | 8.99 | 5.19 | 67 | 235 | 10 000 |
| АИЖК А17 | | 15/04/22 | 102.30 | 103.50 | | | | | 8.76 | 5.67 | 32 | 209 | 8 000 |
| АИЖК А20 | | 15/12/27 | 99.80 | 102.50 | | | | | 8.88 | 8.37 | | 202 | 5 000 |
| АИЖК-11 А1 | 15/09/14 | 15/09/43 | 100.00 | 100.10 | | | | | 8.53 | 2.07 | 148 | 196 | 7 000 |
| АИЖК-11 А2 | 15/03/19 | 15/09/43 | | | | | | | | | | | 7 000 |
| ГЛОБЭКС | | | | | | | | | | | | | |
| ГЛОБЭКС БО-3 | 08/06/12 | 08/12/13 | | | | | | | 9.20 | 1.41 | 268 | 258 | 3 000 |
| ГЛОБЭКС БО-5 | 08/06/12 | 08/12/13 | | 100.78 | | | | | 9.20 | 1.41 | 268 | 258 | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-4 | 01/08/12 | 01/08/14 | | 99.91 | | | | | 7.88 | 0.12 | | 120 | 3 000 |
| ГЛОБЭКС БО-6 | 01/08/12 | 01/08/14 | | | | | | | 7.79 | 0.12 | | 111 | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-1 | 16/02/11 | 16/02/13 | 99.75 | 100.10 | | | | | 8.86 | 0.64 | 343 | 217 | 5 000 |
| ГЛОБЭКС БО-2 | 22/01/12 | 22/07/13 | 100.75 | 101.04 | 101.00 | | 1 | 3 000 | 9.10 | 1.02 | 303 | 245 | 5 000 |
| Транскредитбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Транскредитбанк 2 | | 12/06/12 | | | | | | | 7.89 | 0.01 | | | 3 000 |
| Транскредитбанк 5 | | 12/08/13 | 99.40 | 100.40 | | | | | 8.62 | 1.09 | 246 | 198 | 3 000 |
| Транскредитбанк БО-1 | | 17/11/13 | 98.50 | 100.00 | | | | | 9.10 | 1.35 | 264 | 248 | 5 000 |
| Транскредитбанк 6 | | 17/04/14 | 98.00 | 98.80 | | | | | 9.17 | 1.71 | 238 | 258 | 4 000 |
| ТЕЛЕКОМЫ | | | | | | | | | | | | | |
| МТС | | | | | | | | | | | | | |
| МТС 5 | 26/07/12 | 19/07/16 | 100.53 | 100.65 | 100.60 | 0.02 | 3 | 12 830 | 7.48 | 0.10 | | 81 | 15 000 |
| МТС 3 | 20/06/13 | 12/06/18 | 100.00 | 100.35 | | | | | 8.16 | 0.98 | 214 | 151 | 10 000 |
| МТС 1 | | 17/10/13 | 98.90 | 99.00 | | | | | 8.24 | 1.28 | 186 | 161 | 10 000 |
| МТС 4 | 19/05/11 | 13/05/14 | 97.71 | 98.00 | 98.00 | | 4 | 126 505 | 8.77 | 1.82 | 189 | 219 | 15 000 |
| МТС 2 | | 20/10/15 | 96.50 | 99.00 | 99.00 | | 1 | 1 | 8.26 | 2.96 | 71 | 170 | 10 000 |
| МТС 8 | 12/11/15 | 03/11/20 | 97.05 | 97.25 | 97.20 | 0.09 | 9 | 87 469 | 9.33 | 3.01 | 177 | 277 | 15 000 |
| МТС 7 | | 07/11/17 | 96.51 | 97.20 | 96.51 | -0.99 | 3 | 171 | 9.77 | 4.36 | 169 | 317 | 10 000 |
| Вымпелком | | | | | | | | | | | | | |
| Вымпелком Инв 1 | | 19/07/13 | 100.20 | 101.50 | | | | | 8.93 | 1.01 | 286 | 228 | 10 000 |
| Вымпелком 3 | 12/07/11 | 08/07/14 | 96.10 | 96.15 | 96.10 | 0.10 | 7 | 25 316 | 9.76 | 1.87 | 285 | 318 | 10 000 |
| Вымпелком 2 | 23/03/15 | 14/03/22 | 96.80 | 99.00 | 96.95 | 0.10 | 1 | 30 000 | 10.39 | 2.45 | 311 | 382 | 10 000 |
| Вымпелком 1 | 17/03/15 | 08/03/22 | 96.80 | 97.15 | 96.95 | -0.44 | 3 | 35 002 | 10.40 | 2.44 | 313 | 383 | 10 000 |
| Вымпелком 4 | 17/03/15 | 08/03/22 | 96.95 | 97.40 | 96.95 | | 8 | 35 037 | 10.40 | 2.44 | 313 | 383 | 15 000 |
| Вымпелком 6 | | 13/10/15 | 91.12 | 94.80 | 94.80 | -0.70 | 4 | 5 | 10.44 | 2.91 | 292 | 388 | 10 000 |
| Вымпелком 7 | | 13/10/15 | 94.80 | 95.00 | 95.00 | -0.40 | 2 | 2 | 10.36 | 2.91 | 284 | 380 | 10 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|----------------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| Ростелеком | | | | | | | | | | | | | |
| Ростелеком 13 | 21/10/11 | 17/10/12 | | | | | | | | 7.64 | 0.50 | 93 | 2 000 |
| Ростелеком 8 | | 03/09/13 | 95.26 | 100.49 | | | | | | 8.38 | 0.72 | 279 | 171 |
| Ростелеком 1 | 18/08/11 | 08/08/13 | | | | | | | | 9.84 | 0.88 | 396 | 318 |
| Ростелеком 11 | | 24/07/19 | 100.55 | 100.75 | 100.57 | -0.18 | 5 | 197 | 12.08 | 4.41 | 399 | 548 | 3 000 |
| СПБ Теле2 | | | | | | | | | | | | | |
| ТЕЛЕ2 4 | 10/02/14 | 31/01/22 | 96.00 | 100.00 | 100.10 | 0.10 | 11 | 2 000 | 9.02 | 1.52 | 240 | 241 | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 5 | 10/02/14 | 31/01/22 | 96.00 | 100.60 | | | | | 9.02 | 1.52 | 240 | 241 | 4 000 |
| ТЕЛЕ2 7 | 14/04/15 | 05/04/22 | 85.00 | 100.50 | | | | | 9.67 | 2.51 | 236 | 311 | 6 000 |
| ТЕЛЕ2 1 | 17/06/16 | 11/06/21 | | | | | | | 10.29 | 3.32 | 259 | 372 | 5 000 |
| ТЕЛЕ2 3 | 17/06/16 | 11/06/21 | | | | | | | 10.03 | 3.32 | 233 | 346 | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 2 | 17/06/16 | 11/06/21 | | | | | | | 10.11 | 3.32 | 241 | 354 | 5 000 |
| ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ | | | | | | | | | | | | | |
| ВБД | | | | | | | | | | | | | |
| ВБД ПП 3 | | 27/02/13 | 99.40 | 100.00 | | | | | 8.51 | 0.67 | 301 | 183 | 5 000 |
| МАГНИТ | | | | | | | | | | | | | |
| Магнит БО-1 | | 09/09/13 | | 100.25 | | | | | 8.59 | 1.16 | 233 | 195 | 1 000 |
| Магнит БО-2 | | 09/09/13 | | 100.25 | | | | | 8.86 | 1.16 | 260 | 222 | 1 000 |
| Магнит БО-3 | | 09/09/13 | 99.61 | 99.80 | 99.80 | 0.55 | 3 | 25 | 8.59 | 1.16 | 233 | 195 | 2 000 |
| Магнит БО-4 | | 09/09/13 | 99.30 | 99.96 | | | | | 9.04 | 1.16 | 278 | 240 | 2 000 |
| Магнит БО-5 | | 28/02/14 | 89.15 | 99.45 | | | | | 9.11 | 1.58 | 243 | 251 | 5 000 |
| Магнит БО-6 | | 22/04/14 | | 98.95 | | | | | 9.14 | 1.73 | 234 | 255 | 5 000 |
| Х5 | | | | | | | | | | | | | |
| Х5 Финанс 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 96.50 | 97.00 | | | | | 9.68 | 1.85 | 279 | 310 | 8 000 |
| Х5 Финанс 1 | | 01/07/14 | 86.00 | 95.00 | | | | | 9.40 | 1.84 | 251 | 282 | 9 000 |
| Копейка | | | | | | | | | | | | | |
| Копейка БО-1 | 24/07/12 | 23/07/13 | 100.06 | 100.10 | 100.10 | 0.07 | 6 | 47 350 | 8.60 | 0.09 | | 193 | 3 000 |
| Копейка БО-2 | | 01/10/13 | 99.25 | 99.75 | 99.75 | -0.11 | 6 | 5 185 | 9.53 | 1.20 | 323 | 290 | 3 000 |
| ИНТУРИСТ | | | | | | | | | | | | | |
| Интурист 2 | 22/05/12 | 21/05/13 | 98.11 | 99.95 | 98.10 | -0.20 | 2 | 2 | 12.60 | 0.89 | 671 | 594 | 2 000 |
| Черкизово | | | | | | | | | | | | | |
| Черкизово БО-3 | | 08/11/13 | 98.50 | 98.90 | | | | | 9.64 | 1.33 | 320 | 302 | 3 000 |
| Синергия | | | | | | | | | | | | | |
| Синергия БО-1 | 04/10/12 | 03/10/13 | 99.00 | 101.00 | 100.00 | | 1 | 551 | 9.89 | 0.29 | | 312 | 3 000 |
| Детский мир | | | | | | | | | | | | | |
| Детский мир 1 | | 26/05/15 | 92.51 | 96.50 | | | | | 10.58 | 2.64 | 320 | 402 | 1 000 |
| Мираторг | | | | | | | | | | | | | |
| Мираторг БО-1 | | 29/07/14 | 92.60 | 94.49 | | | | | 13.33 | 1.90 | 640 | 675 | 3 000 |
| МАШИНОСТРОЕНИЕ | | | | | | | | | | | | | |
| АТОМЭНЕРГОПРОМ | | | | | | | | | | | | | |
| Атомэнергопром 6 | | 15/08/14 | | 100.00 | | | | | 7.48 | 1.95 | 52 | 91 | 10 000 |
| КАМАЗ | | | | | | | | | | | | | |
| Камаз БО-1 | 17/12/12 | 16/12/13 | | | | | | | 9.76 | 0.49 | | 305 | 2 000 |
| Камаз БО-2 | | 04/02/14 | 93.00 | 99.25 | | | | | 10.56 | 1.51 | 395 | 395 | 3 000 |
| УВЗ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралв агонзав од 1 | 13/12/12 | 07/12/17 | 99.45 | 100.20 | 99.65 | | 1 | 500 | 10.25 | 0.48 | | 354 | 3 000 |
| Уралв агонзав од 2 | 27/08/13 | 20/02/18 | 97.50 | 98.15 | 98.15 | 0.55 | 1 | 30 | 10.91 | 1.12 | 470 | 427 | 3 000 |
| ИРКУТ | | | | | | | | | | | | | |
| Иркут БО-1 | | 10/09/13 | | | | | | | 9.76 | 1.77 | 293 | 317 | 5 000 |
| ГСС | | | | | | | | | | | | | |
| ГСС 01 | 20/09/12 | 26/03/17 | | 100.00 | | | | | 9.17 | 0.25 | | 239 | 5 000 |
| Сухого ГС БО-1 | 21/12/12 | 20/12/13 | | | | | | | 8.42 | 0.48 | | 171 | 3 000 |
| Сухого ГС БО-2 | 23/04/13 | 22/04/14 | | | | | | | 9.05 | 0.82 | 328 | 239 | 3 000 |
| Сухого ГС БО-3 | 23/04/13 | 22/04/14 | 99.16 | 100.20 | 99.38 | -0.58 | 2 | 6 | 9.21 | 0.82 | 343 | 255 | 3 000 |
| СОЛЛЕРС | | | | | | | | | | | | | |
| Соллерс БО-2 | 02/05/12 | 01/05/13 | 99.23 | 99.90 | | | | | 14.90 | 0.84 | 909 | 824 | 2 000 |
| Соллерс 2 | | 17/07/13 | 102.00 | 102.68 | 102.70 | 0.45 | 4 | 735 | 10.01 | 0.99 | 398 | 336 | 3 000 |
| Гидромашсервис | | | | | | | | | | | | | |
| ГМС 02 | | 13/02/15 | 99.86 | 100.20 | 100.16 | 0.10 | 3 | 3 | 10.95 | 2.30 | 376 | 438 | 3 000 |
| ТРАНСПОРТ | | | | | | | | | | | | | |
| Аэрофлот | | | | | | | | | | | | | |
| Аэрофлот БО-1 | | 08/04/13 | 99.65 | 99.95 | 100.09 | 0.09 | 2 | 100 | 7.75 | 0.78 | 204 | 108 | 6 000 |
| Аэрофлот БО-2 | | 08/04/13 | | 100.80 | | | | | 8.83 | 0.78 | 312 | 216 | 6 000 |
| Трансконтейнер | | | | | | | | | | | | | |
| Трансконтейнер 1 | | 26/02/13 | 100.65 | 101.15 | | | | | 8.10 | 0.67 | 261 | 142 | 3 000 |
| Трансконтейнер 2 | | 04/06/15 | 100.48 | 100.98 | | | | | 8.58 | 2.04 | 155 | 201 | 3 000 |
| Глобалтранс | | | | | | | | | | | | | |
| Нов ПеревозКом 1 | | 10/07/15 | 98.50 | 99.50 | | | | | 9.93 | 1.50 | 333 | 332 | 3 000 |
| Нов ПеревозКом БО-01 | | 03/03/15 | 98.90 | 100.00 | | | | | 10.81 | 2.36 | 358 | 424 | 5 000 |
| Нов ПеревозКом БО-02 | | 03/03/15 | | 99.99 | 99.10 | 0.14 | 5 | 8 500 | 10.65 | 2.37 | 342 | 408 | 5 000 |
| Трансаэро | | | | | | | | | | | | | |
| ТРАНСАЭРО 1 | 25/04/12 | 23/10/13 | 99.64 | 99.99 | 99.64 | -0.16 | 2 | 2 | 13.17 | 1.26 | 681 | 654 | 3 000 |
| ТРАНСАЭРО БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 99.42 | 99.74 | 99.60 | -0.25 | 9 | 2 807 | 13.24 | 1.12 | 704 | 660 | 3 000 |
| Ю-Тэйр | | | | | | | | | | | | | |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|---|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| Ю-Тэйр БО-1 | 26/03/13 | | 100.50 | 102.20 | | | | | 11.58 | 0.72 | 599 | 491 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-2 | 26/03/13 | | 100.50 | 102.49 | | | | | 9.39 | 0.72 | 380 | 272 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-3 | 19/12/13 | | | | | | | | 7.90 | 1.38 | 141 | 128 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-4 | 26/03/14 | | 95.76 | 97.50 | 97.39 | -0.07 | 2 | 14 | 11.07 | 1.61 | 436 | 447 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-5 | 26/03/14 | | 96.30 | 97.50 | 96.50 | 0.50 | 6 | 5 100 | 11.69 | 1.61 | 498 | 509 | 2 000 |
| Ю-Тэйр 5 | 21/07/16 | | | | | | | | 8.79 | 3.40 | 106 | 222 | 2 000 |
| ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ | | | | | | | | | | | | | |
| РУСГИДРО | | | | | | | | | | | | | |
| Русгидро 1 | 22/04/16 | 12/04/21 | | 98.95 | 97.50 | -1.00 | 1 | 70 000 | 8.97 | 3.33 | 126 | 240 | 10 000 |
| Русгидро 2 | 22/04/16 | 12/04/21 | | 98.79 | | | | | 8.54 | 3.33 | 83 | 197 | 5 000 |
| МОСЭНЕРГО | | | | | | | | | | | | | |
| Мосэнерго 2 | 21/02/13 | 18/02/16 | 95.40 | 96.40 | 95.50 | | 1 | 45 555 | 8.15 | 0.67 | 265 | 147 | 5 000 |
| Мосэнерго 3 | 06/12/12 | 28/11/14 | 101.05 | 101.80 | | | | | 8.01 | 0.46 | | 129 | 5 000 |
| ЛЕНЭНЕРГО | | | | | | | | | | | | | |
| Ленэнерго 4 | 21/04/15 | 18/04/17 | 97.51 | | 99.90 | 0.49 | 1 | 40 000 | 8.71 | 2.55 | 137 | 215 | 3 000 |
| ЭНЭЛ ОГК-5 | | | | | | | | | | | | | |
| ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15 | 19/06/12 | 18/06/13 | 100.25 | 100.34 | 100.30 | 0.05 | 19 | 354 709 | 8.35 | 0.98 | 234 | 170 | 4 000 |
| ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18 | | 25/06/14 | 95.50 | | | | | | 8.65 | 1.85 | 176 | 207 | 5 000 |
| КузбасЭнерго | | | | | | | | | | | | | |
| КузбасЭнерго-Фин 1 | 23/06/14 | 14/06/21 | | | | | | | 10.39 | 1.85 | 349 | 381 | 10 000 |
| КузбасЭнерго-Фин 2 | 21/04/16 | 15/04/21 | 87.06 | 95.50 | | | | | 11.46 | 3.28 | 378 | 489 | 5 000 |
| МРСК ЮГА | | | | | | | | | | | | | |
| МРСК Юга 2 | 30/08/11 | 26/08/14 | 95.02 | 99.96 | | | | | 11.58 | 1.99 | 458 | 501 | 6 000 |
| ТГК-1 | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-1 01 | 13/03/12 | 11/03/14 | | 97.70 | | | | | 10.43 | 1.62 | 372 | 383 | 4 000 |
| ТГК-1 03 | 26/06/12 | 14/12/21 | 100.00 | | 100.00 | | 1 | 10 000 | 10.28 | 0.02 | | | 2 000 |
| ТГК-1 02 | 02/07/13 | 01/07/14 | | 98.55 | | | | | 8.63 | 0.98 | 261 | 198 | 5 000 |
| ТГК-9 | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-9 1 | 12/08/13 | 07/08/17 | 97.00 | 97.99 | 97.95 | 0.30 | 5 | 2 312 | 10.27 | 1.09 | 411 | 363 | 7 000 |
| ТГК-2 | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-2 БО-1 | | 17/09/13 | 83.77 | 84.93 | 84.93 | -0.10 | 81 | 6 551 | 25.02 | 1.17 | 1875 | 1 838 | 5 000 |
| ТГК-5 | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-5 1 | 11/10/13 | 06/10/17 | 97.50 | 97.74 | 97.60 | 0.25 | 1 | 2 800 | 11.03 | 1.25 | 468 | 440 | 5 000 |
| Иркутскэнерго | | | | | | | | | | | | | |
| Иркутэнерго-1 | | 28/11/13 | | | | | | | 11.06 | 1.76 | 423 | 447 | 5 000 |
| Иркутэнерго БО-1 | | 08/04/14 | 86.00 | | | | | | 9.99 | 1.69 | 322 | 340 | 3 000 |
| ЯКУТСКЭНЕРГО | | | | | | | | | | | | | |
| Якутскэнерго БО-1 | | 03/09/13 | 99.70 | 100.10 | | | | | 8.63 | 1.15 | 239 | 199 | 3 000 |
| ГЭС | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром-газэнергосеть 1 | | 20/06/12 | | | | | | | 8.03 | 0.00 | | | 2 000 |
| Газпром-газэнергосеть 2 | | 23/04/13 | | | | | | | 9.03 | 1.36 | 256 | 241 | 2 000 |
| ТГК-6 | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-6 1 | 29/08/13 | 24/08/17 | 97.34 | 100.75 | | | | | 9.39 | 1.13 | 317 | 275 | 5 000 |
| ХИМИЧЕСКИЕ | | | | | | | | | | | | | |
| ЕВРОХИМ | | | | | | | | | | | | | |
| Еврохим 2 | 30/06/15 | 26/06/18 | 91.00 | 100.00 | | | | | 9.91 | 2.61 | 254 | 335 | 5 000 |
| Еврохим 3 | 18/11/15 | 14/11/18 | 90.00 | 100.00 | | | | | 8.78 | 3.02 | 121 | 222 | 5 000 |
| АКРОН | | | | | | | | | | | | | |
| Акрон 2 | 22/09/11 | 19/09/13 | 98.20 | 98.99 | | | | | 9.98 | 1.19 | 369 | 335 | 4 000 |
| Акрон 3 | 23/05/12 | 20/11/13 | 100.03 | 100.99 | 100.99 | 0.27 | 5 | 10 167 | 9.29 | 1.35 | 283 | 267 | 4 000 |
| Акрон 4 | 27/05/14 | 18/05/21 | 93.00 | | | | | | 8.21 | 1.82 | 134 | 163 | 4 000 |
| Акрон 5 | 27/05/14 | 18/05/21 | 93.00 | | | | | | 11.18 | 1.82 | 431 | 460 | 4 000 |
| КУАЗ | | | | | | | | | | | | | |
| КУАЗ-Инвест 4 | 10/04/14 | 07/04/16 | 97.00 | 97.50 | 97.40 | 0.72 | 3 | 1 066 | 10.46 | 1.68 | 369 | 386 | 2 000 |
| СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ | | | | | | | | | | | | | |
| ЛСР | | | | | | | | | | | | | |
| ЛСР Групп БО-1 | 26/06/12 | 25/06/13 | 100.05 | 100.35 | | | | | 10.66 | 0.94 | 470 | 401 | 2 000 |
| ЛСР ппа ЛСР 2 | 31/01/13 | 01/08/13 | 99.50 | 99.80 | 99.50 | 0.10 | 8 | 168 291 | 10.90 | 0.59 | 558 | 420 | 5 000 |
| ЛСР Групп БО-2 | | 10/09/13 | 99.30 | 99.80 | 99.76 | | 2 | 6 | 10.45 | 1.15 | 421 | 381 | 2 000 |
| ЛСР Групп БО-3 | | 20/03/14 | 95.56 | 96.29 | 96.25 | | 10 | 2 664 | 12.27 | 1.61 | 556 | 567 | 2 000 |
| ЛСР Групп БО-5 | | 24/07/14 | 92.68 | 93.26 | 92.70 | -0.13 | 1 | 100 | 12.92 | 1.89 | 600 | 634 | 2 000 |
| РеноваСтройГрупп | | | | | | | | | | | | | |
| РСГ-Финанс-1 | 19/12/12 | 18/06/14 | 98.80 | 98.95 | 98.90 | | 10 | 26 812 | 13.72 | 0.49 | | 701 | 3 000 |
| ЛенСпецСМУ | | | | | | | | | | | | | |
| ЛенСпецСМУ 1 | | 07/12/12 | 102.91 | 103.30 | | | | | 9.87 | 0.46 | | 315 | 2 000 |
| ЛенСпецСМУ БО-2 | | 23/05/13 | 103.05 | 104.95 | | | | | 9.39 | 0.67 | 390 | 271 | 2 000 |
| ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ | | | | | | | | | | | | | |
| РОСНАНО | | | | | | | | | | | | | |
| РОСНАНО 1 | | 20/12/17 | | | | | | | 10.22 | 4.24 | 218 | 363 | 8 000 |
| РОСНАНО 2 | | 20/12/17 | | | | | | | 10.25 | 4.27 | 220 | 366 | 10 000 |
| РОСНАНО 3 | | 20/12/17 | | | | | | | 10.25 | 4.25 | 221 | 366 | 15 000 |
| СИСТЕМА | | | | | | | | | | | | | |
| АФК Система 2 | 14/08/12 | 12/08/14 | 101.06 | 101.13 | 101.06 | -0.09 | 7 | 17 755 | 7.50 | 0.15 | | 79 | 20 000 |
| АФК Система 3 | 29/11/12 | 24/11/16 | 101.90 | 102.00 | 102.00 | 0.10 | 3 | 11 301 | 7.95 | 0.44 | | 122 | 19 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|-----------------------------|----------|-------------------------------|-----------|-------------------------------|--------|-------------------------------|---------------|-------------------------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| АФК Система 1 | | 07/03/13 | 100.95 | 101.70 | 100.85 | -0.39 | 1 | 2 000 | 8.64 | 0.69 | 310 | 196 | 6 000 |
| АФК Система 4 | | 15/03/16 | 97.60 | 99.90 | 97.82 | | 6 | 16 534 | 8.86 | 2.19 | 173 | 229 | 20 000 |
| ПРОФМЕДИА | | | | | | | | | | | | | |
| ПрофМедиа Финанс 1 | 18/07/13 | 16/07/15 | 99.28 | 99.69 | 99.27 | -0.43 | 6 | 180 | 11.54 | 1.00 | 549 | 489 | 3 000 |
| СИТРОНИКС | | | | | | | | | | | | | |
| Ситроникс БО-1 | 19/06/12 | 18/06/13 | 100.00 | 100.19 | 100.19 | -0.02 | 3 | 604 | 12.14 | 0.97 | 614 | 549 | 2 000 |
| Ситроникс БО-2 | 08/10/12 | 07/10/13 | 99.40 | 99.50 | 99.50 | -0.20 | 15 | 3 354 | 12.74 | 0.30 | | 597 | 3 000 |
| ЧАСТНЫЕ БАНКИ | | | | | | | | | | | | | |
| РОСБАНК | | | | | | | | | | | | | |
| РОСБАНК БО-1 | 25/06/12 | 25/06/13 | | | | | | | 8.13 | 0.01 | | | 5 000 |
| РОСБАНК БО-3 | 16/05/13 | 16/11/14 | | 101.50 | | | | | 8.70 | 0.88 | 283 | 204 | 10 000 |
| РОСБАНК БО-2 | | 08/07/13 | | | | | | | 9.09 | 0.99 | 305 | 244 | 5 000 |
| РОСБАНК А3 | 06/05/11 | 06/11/13 | 90.00 | 98.24 | 97.11 | -0.07 | 4 | 162 | 9.37 | 1.33 | 293 | 275 | 5 000 |
| РОСБАНК А5 | 06/05/11 | 07/11/14 | | | | | | | 9.26 | 2.21 | 212 | 269 | 5 000 |
| АЛЬФА БАНК | | | | | | | | | | | | | |
| Альфа-Банк 1 | 04/02/14 | 02/02/16 | 97.50 | 99.10 | | | | | 9.11 | 1.51 | 250 | 250 | 5 000 |
| Альфа-Банк 2 | 07/06/13 | 02/12/16 | 100.00 | 100.65 | 100.65 | -0.10 | 2 | 52 650 | 8.71 | 0.94 | 275 | 206 | 5 000 |
| МДМ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| МДМ Банк 7 | | 19/07/12 | 100.31 | 100.35 | | | | | 7.21 | 0.08 | | | 5 000 |
| МДМ Банк БО-1 | | 29/11/12 | 100.66 | 101.90 | | | | | 9.28 | 0.44 | | 255 | 5 000 |
| МДМ Банк БО-4 | 16/12/12 | 16/12/14 | 100.20 | 100.60 | 100.56 | | 2 | 80 | 8.48 | 0.49 | | 177 | 5 000 |
| МДМ Банк 8 | 09/07/13 | 09/04/15 | | 100.35 | | | | | 9.03 | 1.01 | 297 | 238 | 6 000 |
| МДМ Банк БО-2 | | 21/03/14 | 86.00 | 98.85 | | | | | 9.06 | 1.64 | 233 | 246 | 5 000 |
| НОМОС Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Номос БО-1 | 24/02/12 | 24/02/14 | | 99.90 | | | | | 9.36 | 1.55 | 271 | 275 | 5 000 |
| Номос 9 | 15/06/12 | 14/06/13 | 99.95 | 100.10 | 100.04 | 0.09 | 3 | 6 500 | 8.89 | 0.96 | 290 | 224 | 5 000 |
| Номос 11 | 04/07/12 | 02/07/14 | 99.94 | 100.08 | 100.01 | 0.05 | 3 | 7 340 | 7.14 | 0.04 | | | 5 000 |
| Номос БО-2 | 18/04/13 | 18/10/14 | 99.35 | 100.00 | | | | | 8.40 | 0.81 | 265 | 173 | 5 000 |
| Номос 12 | 25/08/13 | 28/08/17 | 98.85 | 99.50 | | | | | 9.33 | 1.12 | 313 | 269 | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ | | | | | | | | | | | | | |
| Банк Зенит БО-1 | 07/04/12 | 07/04/13 | | | | | | | 7.62 | 0.78 | 192 | 95 | 5 000 |
| Банк Зенит 5 | 05/06/12 | 04/06/13 | 100.00 | 100.10 | | | | | 9.16 | 0.93 | 321 | 250 | 5 000 |
| Банк Зенит 6 | 03/07/12 | 01/07/14 | 100.00 | 100.02 | 100.02 | 0.02 | 2 | 10 320 | 7.43 | 0.04 | | | 3 000 |
| Банк Зенит БО-2 | 22/09/12 | 22/09/13 | 99.96 | 99.99 | 99.96 | 0.01 | 2 | 7 000 | 7.99 | 0.26 | | 121 | 5 000 |
| Банк Зенит БО-6 | 26/11/12 | 26/05/14 | 99.60 | 99.70 | 99.70 | 0.04 | 6 | 3 459 | 8.10 | 0.44 | | 137 | 5 000 |
| Банк Зенит БО-3 | 15/11/12 | 15/11/14 | 100.15 | 100.24 | 100.13 | -0.07 | 1 | 1 450 | 8.55 | 0.41 | | 181 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-4 | 07/02/13 | 07/02/15 | 100.00 | 100.15 | | | | | 8.89 | 0.61 | 352 | 220 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-5 | 14/02/13 | 14/02/15 | 100.00 | 100.20 | | | | | 9.06 | 0.63 | 364 | 237 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-7 | 12/04/14 | 12/04/15 | 99.35 | 99.65 | 99.35 | -0.15 | 1 | 3 000 | 9.81 | 1.68 | 305 | 321 | 5 000 |
| ПРОМСВЯЗЬБАНК | | | | | | | | | | | | | |
| Промсвязьбанк БО-2 | 20/02/13 | 18/02/15 | 99.65 | 99.80 | | | | | 9.40 | 0.65 | 395 | 271 | 5 000 |
| Промсвязьбанк БО-4 | 20/02/13 | 18/02/15 | 99.51 | 100.00 | | | | | 9.73 | 0.65 | 428 | 304 | 5 000 |
| Промсвязьбанк 6 | | 17/06/13 | 98.50 | 99.20 | 98.50 | 0.25 | 10 | 121 000 | 10.12 | 0.97 | 411 | 347 | 5 000 |
| Промсвязьбанк БО-3 | | 04/02/14 | 95.00 | 98.79 | | | | | 9.55 | 1.51 | 294 | 294 | 5 000 |
| Банк СПБ | | | | | | | | | | | | | |
| Банк СПБ БО-2 | 26/03/12 | 23/09/13 | 99.51 | 100.20 | 99.60 | -0.80 | 1 | 1 600 | 9.54 | 1.20 | 325 | 291 | 5 000 |
| Банк СПБ БО-1 | 09/10/12 | 09/04/13 | | | | | | | 10.12 | 0.30 | | 336 | 5 000 |
| Банк СПБ БО-4 | 13/12/12 | 12/12/13 | 99.80 | 101.16 | | | | | 8.67 | 0.48 | | 196 | 3 000 |
| МКБ | | | | | | | | | | | | | |
| МКБ 8 | 10/10/12 | 08/04/15 | | 100.10 | | | | | 8.05 | 0.34 | | 130 | 3 000 |
| МКБ 7 | 17/07/12 | 14/07/15 | 100.05 | 100.30 | | | | | 7.67 | 0.07 | | | 2 000 |
| МКБ 6 | | 07/08/12 | 100.13 | 100.15 | 100.15 | 0.02 | 3 | 385 200 | 8.25 | 0.13 | | 156 | 2 000 |
| МКБ БО-4 | 15/10/12 | 15/04/14 | 99.74 | 99.82 | 99.84 | 0.07 | 6 | 806 | 8.63 | 0.32 | | 187 | 5 000 |
| МКБ БО-1 | 22/02/13 | 22/02/14 | 99.40 | 99.77 | | | | | 8.89 | 0.65 | 343 | 220 | 3 000 |
| МКБ БО-5 | | 23/06/14 | | | | | | | 11.69 | 1.79 | 484 | 510 | 5 000 |
| ПЕТРОКОММЕРЦ | | | | | | | | | | | | | |
| Петрокоммерц 7 | 20/02/11 | 22/08/12 | 98.95 | 99.99 | | | | | 8.45 | 0.17 | | 173 | 3 000 |
| Петрокоммерц 6 | | 22/08/12 | | 100.06 | | | | | 7.50 | 0.17 | | 78 | 3 000 |
| Петрокоммерц 5 | 19/12/12 | 21/12/14 | | 102.10 | 102.10 | 0.50 | 2 | 3 250 | 8.53 | 0.50 | | 182 | 5 000 |
| Петрокоммерц БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 99.00 | 101.59 | | | | | 9.40 | 1.14 | 317 | 276 | 3 000 |
| Банк УРАЛСИБ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб 04 | 13/09/13 | 10/03/17 | 99.65 | 99.70 | 99.70 | | 9 | 73 400 | 9.19 | 1.17 | 293 | 255 | 5 000 |
| ЛК УРАЛСИБ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб Лизинг БО-3 | | 29/10/13 | 100.05 | 100.45 | | | | | 9.60 | 0.70 | 404 | 292 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-1 | | 28/02/14 | 99.67 | 99.95 | | | | | 10.08 | 0.90 | 418 | 342 | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-4 | | 03/07/14 | 97.75 | 98.00 | 98.00 | 0.05 | 1 | 400 | 11.02 | 0.96 | 502 | 437 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-5 | | 05/02/15 | 100.30 | 100.55 | 100.30 | 0.05 | 8 | 26 508 | 11.73 | 1.25 | 537 | 510 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-6 | | 10/02/15 | 100.00 | 101.00 | | | | | 11.13 | 1.27 | 475 | 450 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-2 | | 12/01/15 | 100.70 | 101.40 | | | | | 11.56 | 2.22 | 442 | 499 | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-9 | | 17/02/15 | 100.50 | 101.20 | | | | | 11.62 | 2.31 | 442 | 505 | 2 000 |
| КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ | | | | | | | | | | | | | |
| РенКап 3 | #N/A | The record could not be found | #N/A | The record could not be found | #N/A | The record could not be found | #N/A | The record could not be found | #3НАЧ! | #3НАЧ! | #3НАЧ! | found | 000 |
| РенКап БО-3 | 05/08/13 | 05/08/14 | 97.30 | 97.55 | 97.50 | | 10 | 12 601 | 12.70 | 1.05 | 658 | 605 | 3 000 |
| ТКС БАНК | | | | | | | | | | | | | |

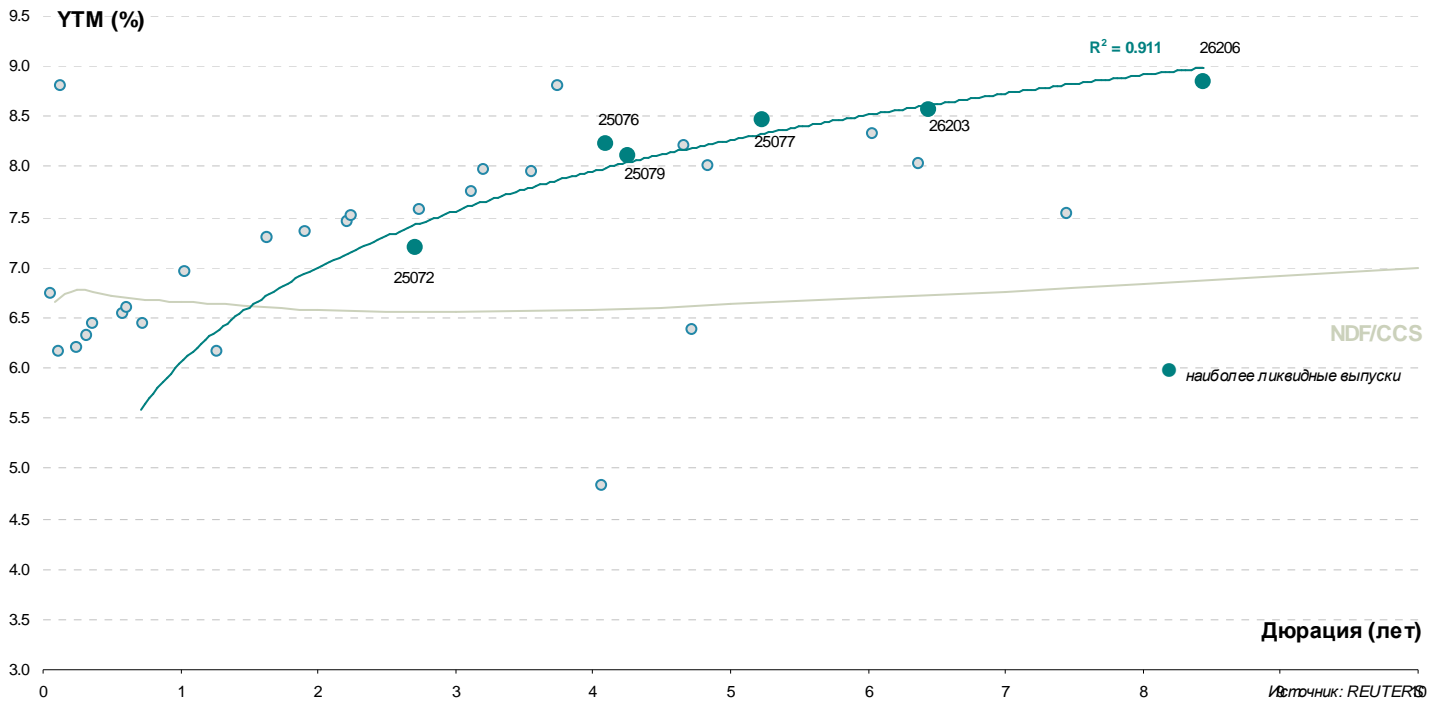
| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. | |
|------------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|--------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | | |
| ТКС БО-3 | 21/08/12 | 18/02/14 | 100.13 | 100.40 | 100.41 | 0.06 | 8 | 1 201 | 11.55 | 0.17 | | 483 | 2 000 | |
| ТКС БО-4 | 18/04/13 | 16/04/15 | 100.01 | 100.26 | 100.28 | 0.16 | 1 | 146 | 13.23 | 0.80 | | 750 | 2 000 | |
| ТКС 2 | | 28/07/13 | 107.11 | 107.45 | 107.46 | 0.06 | 3 | 15 | 12.90 | 0.98 | | 688 | 1 000 | |
| ТКС БО-1 | | 20/09/13 | 101.00 | 101.80 | 101.00 | -0.80 | 1 | 1 | 13.72 | 1.16 | | 747 | 2 000 | |
| ТКС БО-2 | 29/11/11 | 26/11/13 | 104.15 | 104.26 | 104.15 | -0.14 | 9 | 1 861 | 13.65 | 1.33 | | 721 | 2 000 | |
| РОСГОССТРАХ | | | | | | | | | | | | | | |
| Росгосстрах 1 | 23/07/12 | 16/07/15 | 99.61 | 99.89 | 99.86 | 0.16 | 4 | 262 | 11.75 | 0.09 | | 508 | 4 000 | |
| Росгосстрах 2 | 12/11/12 | 02/11/17 | 99.00 | 99.50 | 99.50 | -0.30 | 1 | 40 | 12.11 | 0.40 | | 537 | 5 000 | |
| ЕАБР | | | | | | | | | | | | | | |
| ЕАБР 3 | 29/10/13 | 25/10/16 | | 99.70 | 99.50 | -0.20 | 1 | 40 000 | 8.04 | 1.30 | | 163 | 141 | 5 000 |
| ЕАБР 1 | 03/02/14 | 28/01/19 | 98.00 | | | | | | 8.77 | 1.52 | | 215 | 216 | 5 000 |
| ЕАБР 4 | 11/02/14 | 06/02/18 | | | | | | | 9.08 | 1.54 | | 244 | 247 | 5 000 |
| ЕАБР 2 | 26/02/15 | 21/02/19 | 99.00 | 100.24 | 100.50 | -0.05 | 1 | 5 000 | 8.55 | 2.42 | | 128 | 198 | 5 000 |
| Юникредит Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| Юникредит Банк 4 | 13/11/12 | 10/11/15 | 98.00 | 99.49 | | | | | 7.77 | 0.42 | | 104 | | 10 000 |
| Юникредит Банк БО02 | 30/08/13 | 27/02/15 | 99.65 | 100.20 | | | | | 9.04 | 1.13 | | 282 | 240 | 5 000 |
| Юникредит Банк БО03 | 04/09/13 | 04/03/15 | 93.80 | 110.00 | | | | | 8.68 | 1.15 | | 244 | 204 | 5 000 |
| Юникредит Банк 5 | 03/09/13 | 01/09/15 | 97.00 | 100.50 | 97.70 | 0.03 | 1 | 1 | 9.78 | 1.15 | | 354 | 314 | 5 000 |
| Юникредит Банк БО01 | 11/12/13 | 10/12/14 | | | 100.00 | | 1 | 1 | 9.20 | 1.41 | | 268 | 258 | 5 000 |
| Юникредит Банк 1 | | 07/09/16 | | 98.00 | | | | | 9.12 | 3.61 | | 130 | 255 | 5 000 |
| Райффайзен | | | | | | | | | | | | | | |
| Райффайзен 4 | 06/12/11 | 03/12/13 | 100.00 | | 100.80 | 0.30 | 1 | 64 000 | 8.32 | 1.39 | | 181 | 170 | 10 000 |
| Райффайзен БО-7 | | 27/11/13 | 98.60 | 99.99 | | | | | 8.42 | 1.38 | | 193 | 180 | 5 000 |
| ИНГ Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| ИНГ Банк 2 | 12/08/12 | 18/11/14 | | | | | | | 8.48 | 0.25 | | | 170 | 5 000 |
| РуссСтандарт | | | | | | | | | | | | | | |
| РуссСтандарт БО-1 | 09/11/12 | 07/11/14 | 100.00 | 101.00 | 100.96 | 0.09 | 4 | 190 | 8.57 | 0.39 | | | 183 | 5 000 |
| РуссСтандарт БО-2 | 26/03/13 | 24/03/15 | 98.00 | 99.98 | | | | | 9.75 | 0.74 | | 411 | 308 | 5 000 |
| Вост-Экспресс | | | | | | | | | | | | | | |
| Вост-Экспр Банк БО-5 | 19/04/12 | 17/10/13 | 99.10 | | | | | | 10.23 | 1.25 | | 387 | 360 | 2 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-1 | 10/03/11 | 07/03/13 | | 100.00 | | | | | 7.62 | 0.69 | | 208 | 94 | 1 000 |
| ЖФ Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| ЖФ Банк 6 | 11/12/12 | 10/06/14 | 99.51 | 99.85 | 98.75 | -0.95 | 1 | 240 | 10.89 | 0.47 | | | 417 | 5 000 |
| ЖФ Банк 5 | 19/10/11 | 17/04/13 | | | | | | | 9.45 | 0.79 | | 372 | 278 | 4 000 |
| ЖФ Банк БО-3 | 22/10/13 | 22/04/14 | | | | | | | 8.98 | 1.27 | | 261 | 235 | 4 000 |
| ЖФ Банк 7 | 26/04/12 | 23/04/15 | 99.05 | 99.25 | | | | | 10.46 | 2.48 | | 316 | 389 | 5 000 |
| БНП Париба | | | | | | | | | | | | | | |
| БНП Париба 1 | | 29/03/14 | | 99.50 | | | | | 7.68 | 1.67 | | 93 | 108 | 2 000 |
| РусфинансБанк | | | | | | | | | | | | | | |
| РусфинансБанк 8 | 17/09/12 | 14/09/15 | 99.55 | 100.00 | | | | | 9.30 | 0.24 | | | 252 | 2 000 |
| РусфинансБанк 9 | 18/09/12 | 15/09/15 | 86.00 | 100.00 | | | | | 8.63 | 0.25 | | | 185 | 2 000 |
| РусфинансБанк БО-01 | 04/07/13 | 04/07/14 | 98.15 | 98.20 | | | | | 9.08 | 0.99 | | 305 | 243 | 4 000 |
| РусфинансБанк БО-02 | 06/09/13 | 06/03/15 | | 101.00 | | | | | 9.76 | 1.15 | | 352 | 312 | 4 000 |
| РусфинансБанк 10 | 12/11/13 | 10/11/15 | | 101.00 | | | | | 9.06 | 1.34 | | 261 | 244 | 2 000 |
| РусфинансБанк 11 | 13/11/13 | 11/11/15 | | | | | | | 9.05 | 1.34 | | 260 | 243 | 2 000 |
| ОТП Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| ОТП Банк БО-3 | 01/11/12 | 30/10/14 | 100.60 | 100.70 | 100.70 | 0.05 | 1 | 1 500 | 8.64 | 0.37 | | | 189 | 4 000 |
| ОТП Банк БО-2 | 04/03/14 | 03/03/15 | 98.80 | 99.20 | | | | | 11.45 | 1.56 | | 479 | 484 | 6 000 |
| ОТП Банк 2 | | 25/03/14 | 95.15 | 95.30 | 95.26 | -0.10 | 5 | 582 | 11.59 | 1.64 | | 486 | 499 | 3 000 |
| ОТП Банк БО-1 | | 29/07/14 | 93.30 | 93.60 | 93.60 | -0.08 | 3 | 272 | 11.77 | 1.92 | | 483 | 519 | 5 000 |
| СКБ-Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| СКБ-Банк БО-4 | 05/12/12 | 05/06/13 | 100.52 | 101.00 | 100.50 | -0.40 | 1 | 250 | 9.82 | 0.46 | | | 310 | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-3 | 28/05/13 | 26/11/13 | 99.50 | 99.95 | 99.85 | 0.25 | 2 | 18 000 | 9.89 | 0.92 | | 397 | 323 | 3 000 |
| СКБ-Банк БО-5 | 11/10/12 | 10/04/14 | 100.00 | 100.10 | 100.03 | 0.04 | 1 | 10 500 | 8.25 | 0.31 | | | 149 | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-6 | 09/07/13 | 08/07/14 | 97.71 | 98.28 | | | | | 10.52 | 0.99 | | 448 | 387 | 2 000 |
| КредитЕвропа Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| КредЕврБанк 6 | 21/08/12 | 18/02/14 | 99.80 | 100.02 | | | | | 8.36 | 0.17 | | | 164 | 4 000 |
| КредЕврБанк БО-2 | 10/02/14 | 10/02/15 | 98.50 | 99.00 | | | | | 10.57 | 1.50 | | 396 | 396 | 5 000 |
| КредЕврБанк БО-1 | | 27/04/14 | 93.00 | 98.00 | | | | | 9.50 | 1.73 | | 269 | 291 | 5 000 |
| Банк Интеза | | | | | | | | | | | | | | |
| Интеза 03 | 11/10/13 | 13/04/15 | 99.00 | 100.00 | | | | | 10.03 | 1.25 | | 368 | 340 | 5 000 |
| Центр-Инвест | | | | | | | | | | | | | | |
| ЦентрИнвест 2 | 26/06/12 | 24/06/14 | | | | | | | 12.48 | 0.02 | | | | 3 000 |
| ЦентрИнвест БО-1 | 18/12/12 | 17/06/14 | 99.35 | 99.75 | | | | | 9.23 | 0.50 | | | 252 | 2 000 |
| ЦентрИнвест БО-5 | 18/12/12 | 17/06/14 | 99.35 | 99.75 | | | | | 9.90 | 0.52 | | 477 | 319 | 1 000 |
| ЦентрИнвест БО-2 | 18/04/13 | 16/04/15 | 99.60 | 99.99 | | | | | 10.10 | 0.81 | | 435 | 343 | 2 000 |
| Связь-Банк | | | | | | | | | | | | | | |
| СвязьБанк 03 | 20/12/12 | 09/12/21 | | | | | | | 8.68 | 0.48 | | | 197 | 5 000 |
| СвязьБанк 05 | | 07/04/22 | | | | | | | 10.00 | 2.67 | | 260 | 344 | |
| Крайинвестбанк | | | | | | | | | | | | | | |
| Крайинвестбанк БО-1 | 19/10/12 | 19/04/14 | 99.10 | 99.30 | 99.30 | | 2 | 5 500 | 11.69 | 0.33 | | 493 | | 2 000 |
| Судостроительный банк | | | | | | | | | | | | | | |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|----------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| Судостр 03 | 05/09/11 | 03/09/12 | 99.04 | | | | | | 10.09 | 0.21 | | 334 | 2 000 |
| Судостр БО01 | 03/03/13 | 03/03/14 | 99.80 | 100.10 | | | | | 11.25 | 0.67 | 575 | 457 | 2 000 |
| Судостр 04 | 10/04/12 | 08/10/13 | 98.04 | 99.47 | | | | | 11.72 | 1.22 | 539 | 509 | 2 000 |
| Меткомбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Меткомбанк БО-1 | 02/02/13 | 02/08/14 | | | | | | | 12.18 | 0.60 | 684 | 549 | 2 000 |
| Меткомбанк 01 | 13/04/13 | 15/04/15 | 99.10 | 99.65 | 99.10 | -0.10 | 1 | 5 000 | 12.25 | 0.79 | 653 | 558 | 2 000 |
| Абсолют банк | | | | | | | | | | | | | |
| Абсолют банк 5 | 30/07/14 | 27/07/16 | 95.00 | 97.30 | | | | | 10.99 | 1.92 | 404 | 441 | 2 000 |
| Татфондбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Татфондбанк БО-1 | 28/06/12 | 26/12/13 | | | | | | | 9.04 | 0.02 | | | 2 000 |
| Татфондбанк БО-2 | 18/10/12 | 17/04/14 | 97.00 | 99.70 | | | | | 9.37 | 0.33 | | 261 | 2 000 |
| Татфондбанк БО-3 | 29/11/12 | 27/11/14 | 100.50 | 100.95 | 100.50 | 0.30 | 1 | 250 | 11.33 | 0.44 | | 460 | 2 000 |
| Татфондбанк 7 | 16/12/11 | 14/12/12 | 100.00 | 101.00 | 101.00 | 0.60 | 3 | 101 | 8.00 | 0.48 | | 129 | 1 000 |
| Татфондбанк БО-4 | 19/02/13 | 17/02/15 | 99.05 | 99.97 | 99.27 | -0.70 | 4 | 16 100 | 12.77 | 0.64 | 734 | 608 | 3 000 |
| Татфондбанк 6 | 28/02/12 | 26/02/13 | 99.00 | 100.51 | | | | | 10.02 | 0.66 | 454 | 334 | 2 000 |
| Татфондбанк БО-5 | 09/04/13 | 07/04/15 | 99.36 | 99.65 | 99.45 | -0.25 | 1 | 10 000 | 12.05 | 0.78 | 635 | 538 | 2 000 |
| РЕГИОНАЛЬНЫЕ | | | | | | | | | | | | | |
| МОСКВА | | | | | | | | | | | | | |
| Москва 45 | 27/06/12 | | 100.03 | 100.10 | 100.50 | 0.49 | 6 | 157 | -15.94 | 0.02 | | | 15 000 |
| Москва 54 | 05/09/12 | | 100.11 | 100.25 | | | | | 7.00 | 0.21 | | 25 | 15 000 |
| Москва 61 | 03/06/13 | | 106.00 | 108.20 | 107.00 | -0.90 | 4 | 341 | 7.53 | 0.90 | 163 | 87 | 30 000 |
| Москва 53 | 01/09/13 | | | 101.00 | | | | | 7.06 | 1.15 | 82 | 42 | 15 000 |
| Москва 63 | 10/12/13 | | 111.25 | 111.50 | | | | | 6.67 | 1.35 | 21 | 5 | 15 000 |
| Москва 62 | 08/06/14 | | 109.01 | 109.74 | | | | | 7.59 | 1.77 | 75 | 100 | 35 000 |
| Москва 39 | 21/07/14 | | 98.25 | 99.45 | | | | | 7.46 | 1.91 | 52 | 88 | 10 000 |
| Москва 64 | 24/06/15 | | | | | | | | 8.32 | 2.65 | 93 | 176 | 20 000 |
| Москва 44 | 16/11/15 | | 111.00 | 113.90 | | | | | 9.17 | 2.87 | 167 | 261 | 40 000 |
| Москва 56 | 22/09/16 | | 95.02 | 95.85 | | | | | 8.47 | 3.68 | 63 | 190 | 20 000 |
| Москва 49 | 14/06/17 | | 95.00 | 96.30 | | | | | 8.36 | 4.27 | 31 | 177 | 25 000 |
| Москва 48 | 11/06/22 | | 88.00 | 89.29 | | | | | 8.43 | 7.18 | | 166 | 30 000 |
| МОС ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Московская Обл 8 | 11/06/13 | | 100.21 | 100.50 | | | | | 8.13 | 0.95 | 215 | 148 | 19 000 |
| Московская Обл 7 | 16/04/14 | | 98.51 | 99.00 | 99.00 | 0.25 | 9 | 510 760 | 8.78 | 1.71 | 199 | 219 | 16 000 |
| НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Нижегородская Обл 5 | 02/12/12 | | 101.75 | 102.50 | | | | | 7.69 | 0.45 | | 97 | 3 000 |
| Нижегородская Обл 4 | 17/11/12 | | 98.02 | 102.05 | | | | | 8.14 | 0.41 | | 141 | 3 000 |
| Нижегородская Обл 6 | 07/10/15 | | 99.01 | 100.00 | | | | | 8.60 | 2.07 | 155 | 203 | 5 000 |
| Нижегородская Обл 7 | 16/11/16 | | 101.75 | 102.05 | 101.83 | -0.07 | 5 | 90 000 | 9.29 | 2.53 | 196 | 273 | 8 000 |
| САМАРСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Самарская Обл 5 | 19/12/13 | | | | | | | | 8.95 | 0.16 | | 224 | 8 000 |
| Самарская Обл 4 | 20/06/12 | | | | | | | | -0.36 | 0.00 | | | 5 000 |
| Самарская Обл 6 | 10/05/13 | | 102.00 | 108.10 | | | | | 7.80 | 0.84 | 200 | 114 | 2 000 |
| Самарская Обл 7 | 30/11/16 | | 97.95 | 100.50 | 97.95 | 0.10 | 5 | 877 608 | 8.64 | 2.38 | 140 | 207 | 12 000 |
| ЯКУТИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Якутия 1 | 11/04/13 | | | 100.65 | | | | | 8.18 | 0.54 | 298 | 148 | 3 000 |
| Якутия 9 | 19/09/13 | | | | | | | | 7.64 | 0.77 | 195 | 97 | 2 000 |
| Якутия 7 | 17/04/14 | | 99.35 | 100.11 | | | | | 7.84 | 1.44 | 129 | 123 | 3 000 |
| КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ | | | | | | | | | | | | | |
| Краснодарский край 2 | 14/12/12 | | 98.60 | | | | | | | 0.53 | | | 2 000 |
| Краснодар 02 | 05/11/15 | | | 101.50 | | | | | 8.83 | 1.48 | 224 | 222 | 1 000 |
| Краснодарский край 3 | 27/09/14 | | 99.30 | 100.29 | | | | | 8.63 | 1.64 | 190 | 203 | 4 000 |
| КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ | | | | | | | | | | | | | |
| Красноярский край 4 | 08/11/12 | | 101.10 | 101.20 | 101.20 | 0.38 | 5 | 400 | 7.39 | 0.38 | | 65 | 10 000 |
| Красноярский край 5 | 29/11/16 | | 100.80 | 102.00 | 101.15 | -1.55 | 1 | 2 800 | 8.71 | 1.82 | 183 | 213 | 9 000 |
| КОМИ | | | | | | | | | | | | | |
| Коми Респ 7 | 22/11/13 | | | 101.15 | | | | | 8.39 | 0.90 | 249 | 173 | 1 000 |
| Коми Респ 9 | 18/10/14 | | 97.10 | 98.80 | | | | | 8.61 | 1.72 | 182 | 202 | 2 000 |
| Коми Респ 8 | 03/12/15 | | | 96.00 | | | | | 8.59 | 2.55 | 125 | 203 | 1 000 |
| Коми Респ 10 | 15/12/16 | | | | | | | | 8.82 | 2.68 | 141 | 226 | 2 000 |
| УДМУРТИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Удмуртия 05 | 24/11/16 | | | | | | | | 8.87 | 2.81 | 140 | 231 | 2 000 |
| КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Костромская область 5 | 20/12/12 | | | | | | | | 8.22 | 0.48 | | 151 | 3 000 |
| Костромская область 6 | 17/11/16 | | 99.82 | 100.00 | 99.80 | -0.10 | 5 | 5 314 | 9.94 | 2.14 | 285 | 337 | 4 000 |
| ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Вологодская обл. 02 | 14/12/16 | | 103.50 | 104.20 | 104.00 | -0.50 | 1 | 1 | 9.40 | 2.58 | 205 | 284 | 3 000 |

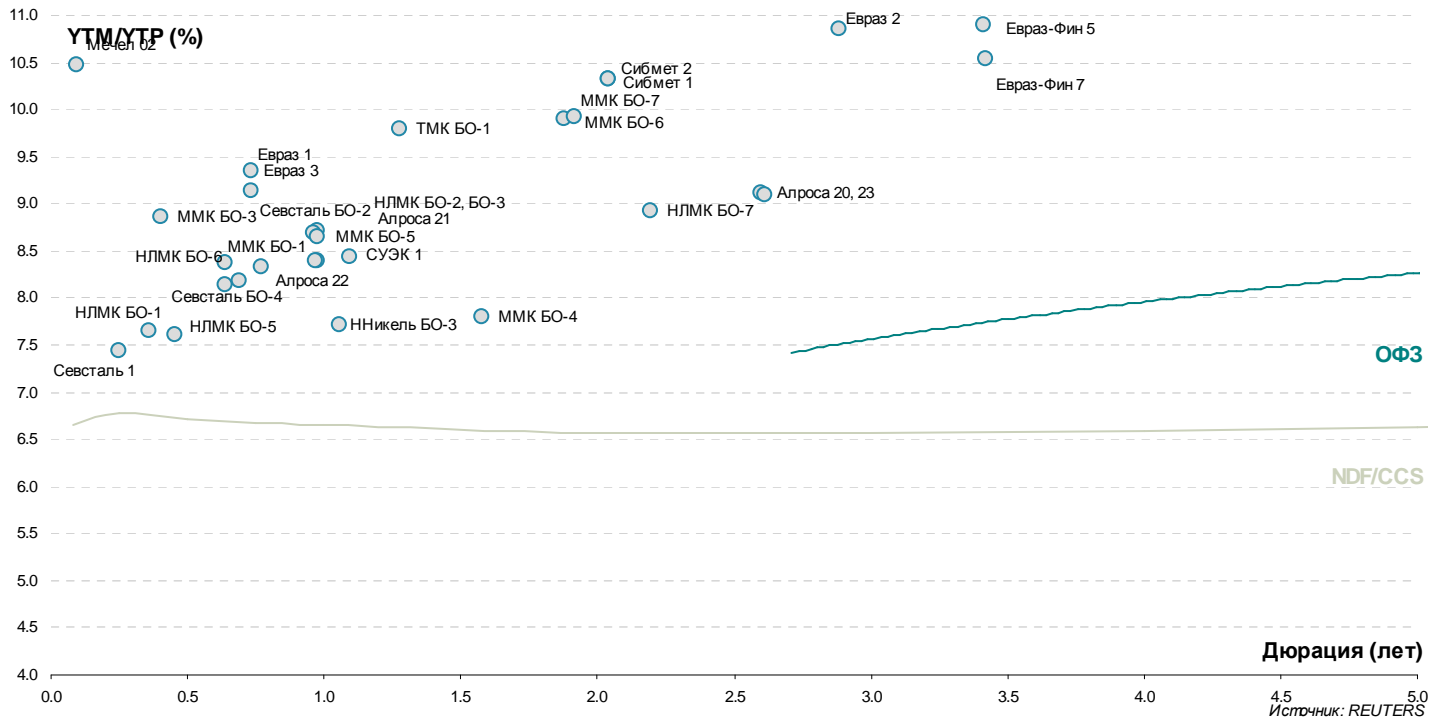
| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спрэд к (бп) | | Объем млн руб. |
|-----------------------------|--------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|--------------|--------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | ОФЗ | свопам | |
| РЕСП КАРЕЛИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Карелия 14 | | 30/11/16 | 101.00 | 101.90 | | | | | 9.06 | 2.04 | 203 | 249 | 1 000 |
| ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Ярославская Обл 9 | | 16/05/13 | 99.30 | 103.15 | | | | | 7.55 | 0.62 | 215 | 86 | 3 000 |
| Ярославская Обл 10 | | 15/04/14 | 99.10 | 99.70 | | | | | 8.23 | 1.46 | 166 | 162 | 3 000 |
| РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Рязанская Обл 1 | | 27/11/14 | | | | | | | 8.48 | 1.45 | 192 | 187 | 2 000 |
| ХМАО | | | | | | | | | | | | | |
| ХМАО-Югра 7 | | 20/12/12 | | | | | | | 7.22 | 0.48 | | 50 | 2 000 |
| ХМАО-Югра 8 | | 19/12/13 | | | | | | | 7.60 | 1.36 | 113 | 98 | 2 000 |
| СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Свердловская обл. 01 | | 11/12/16 | 101.10 | 101.90 | 101.15 | | 1 | 3 056 | 8.88 | 2.10 | 181 | 231 | 3 000 |
| ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Тверская Обл 5 | | 26/12/13 | | | | | | | 8.99 | 1.34 | 254 | 237 | 4 000 |
| Тверская Обл 6 | | 12/06/14 | 103.00 | 104.50 | | | | | 13.03 | 1.12 | 683 | 639 | 3 000 |
| Тверская Обл 7 | | 15/12/15 | 97.35 | 97.80 | 97.60 | 0.60 | 2 | 2 | 9.73 | 2.77 | 228 | 317 | 3 000 |

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

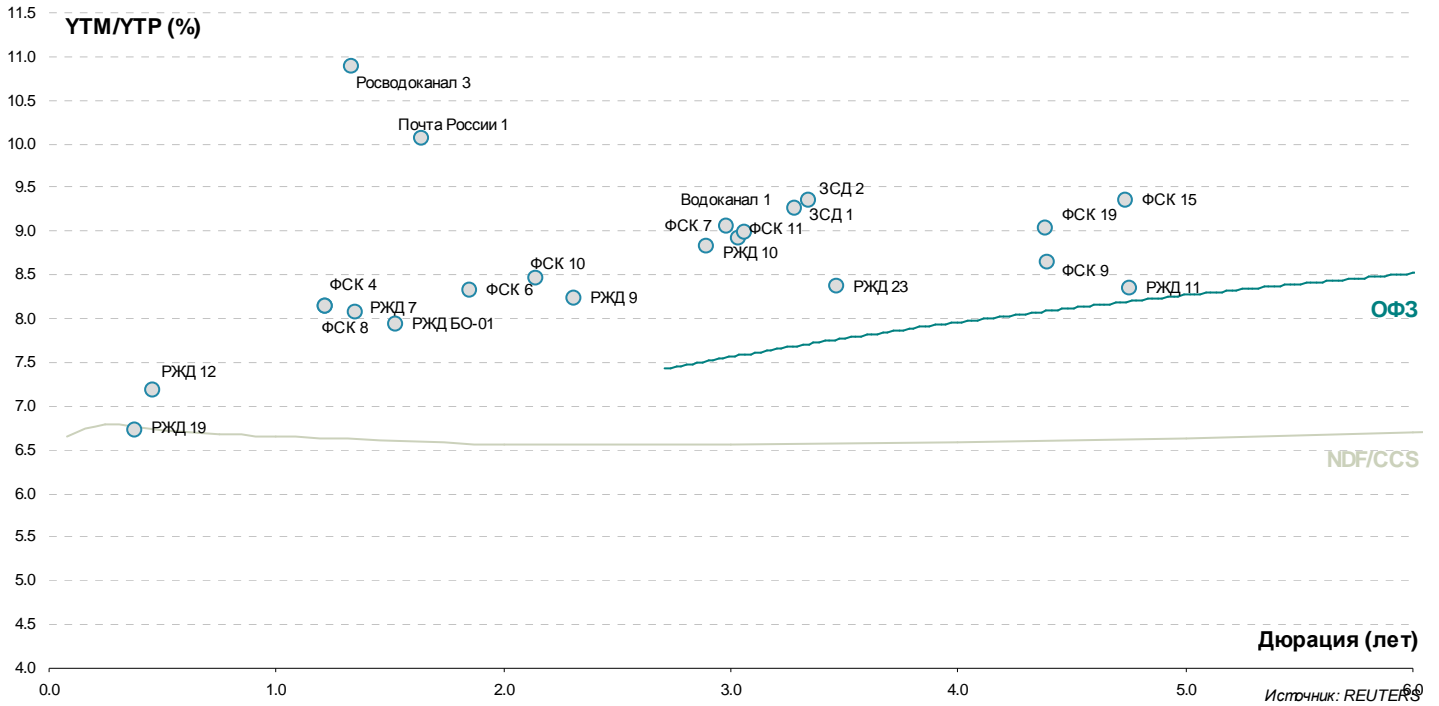
ОФЗ



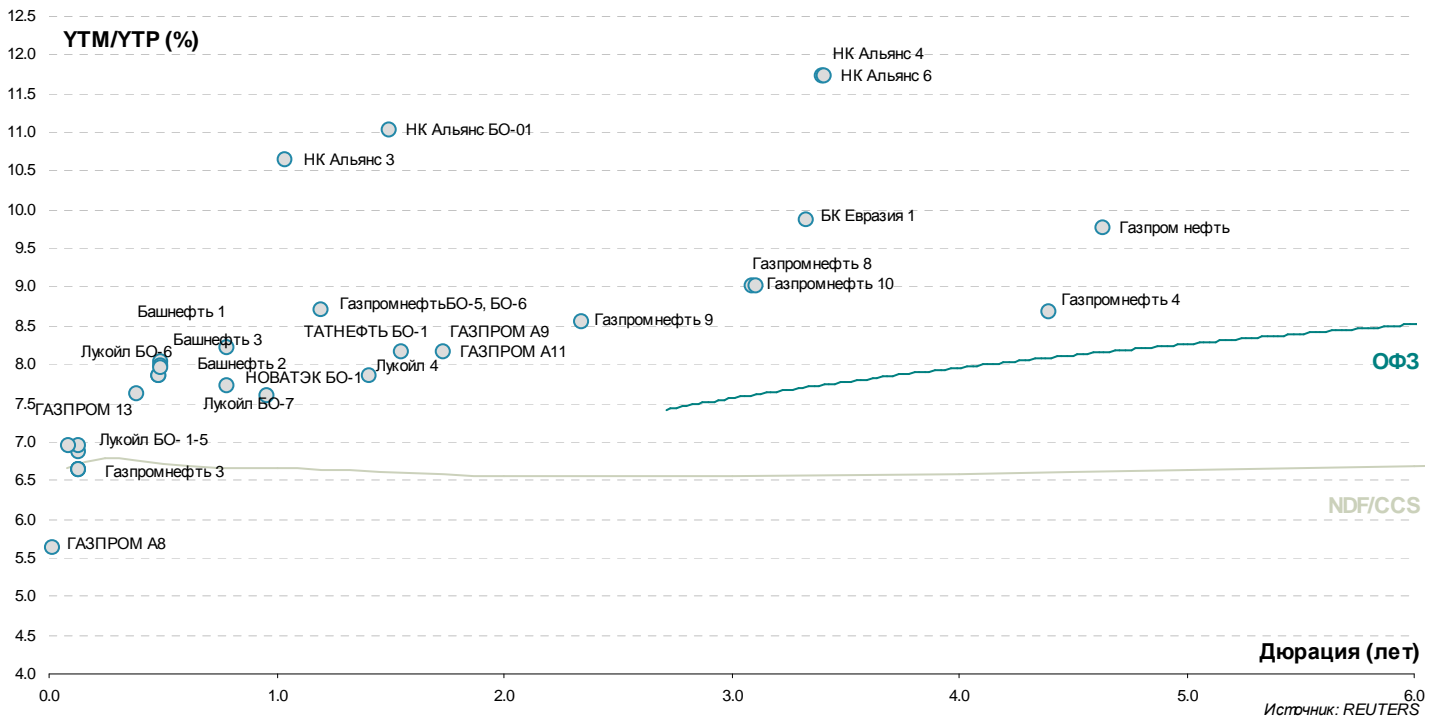
Металлургическая и горнодобывающая промышленность



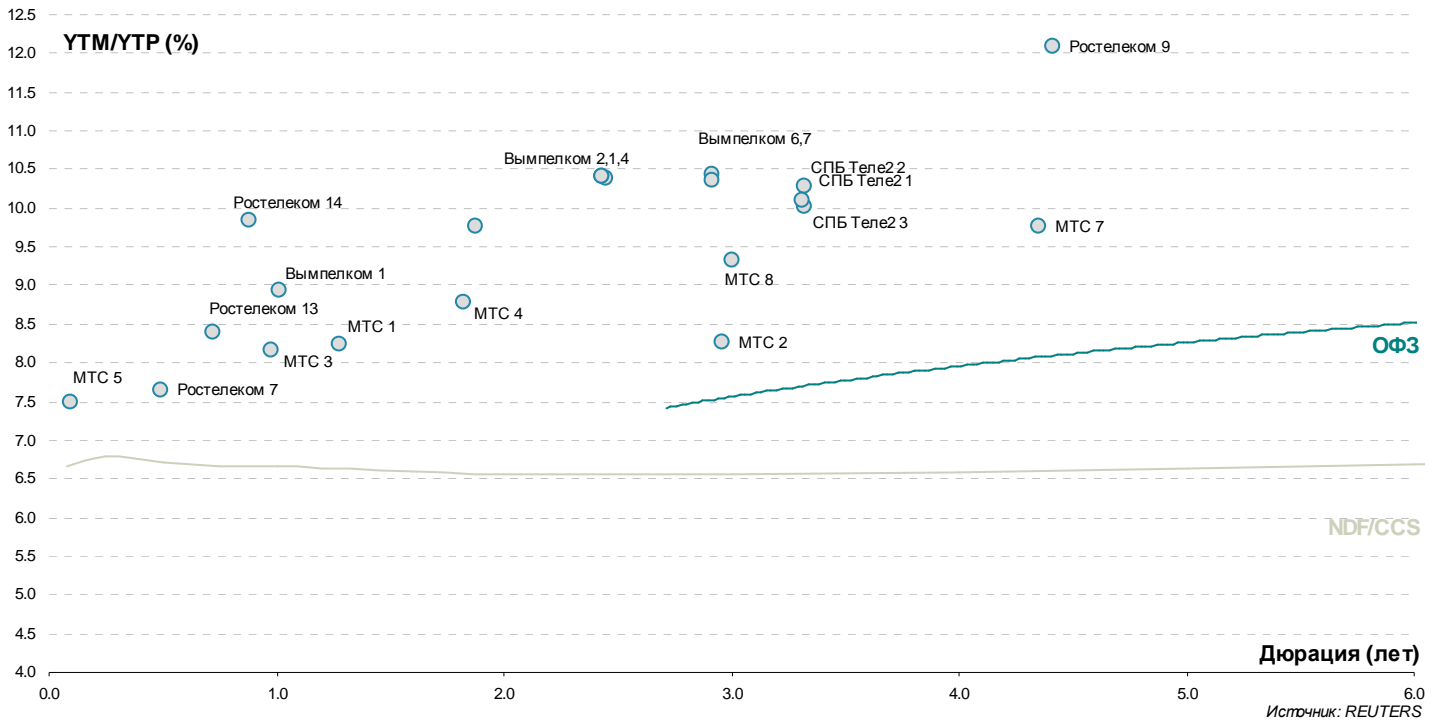
Инфраструктура



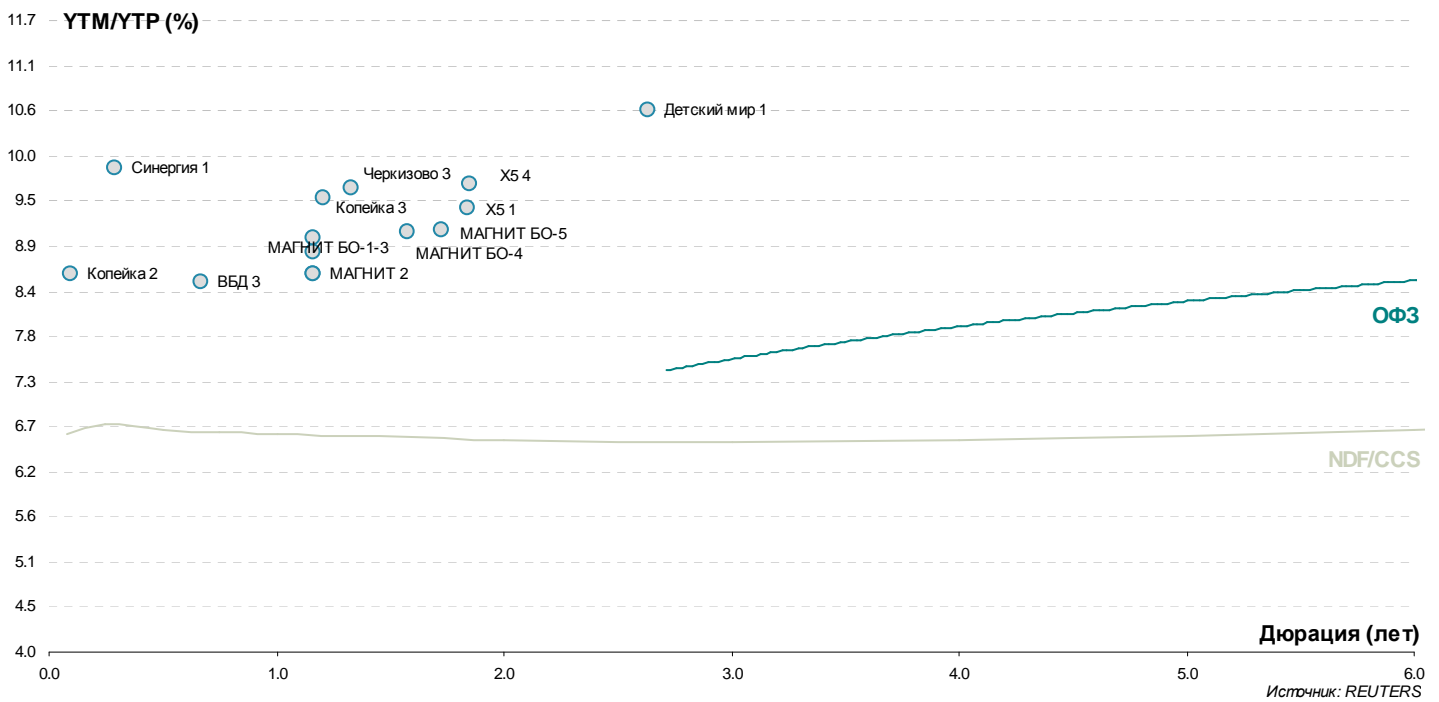
Нефть и Газ



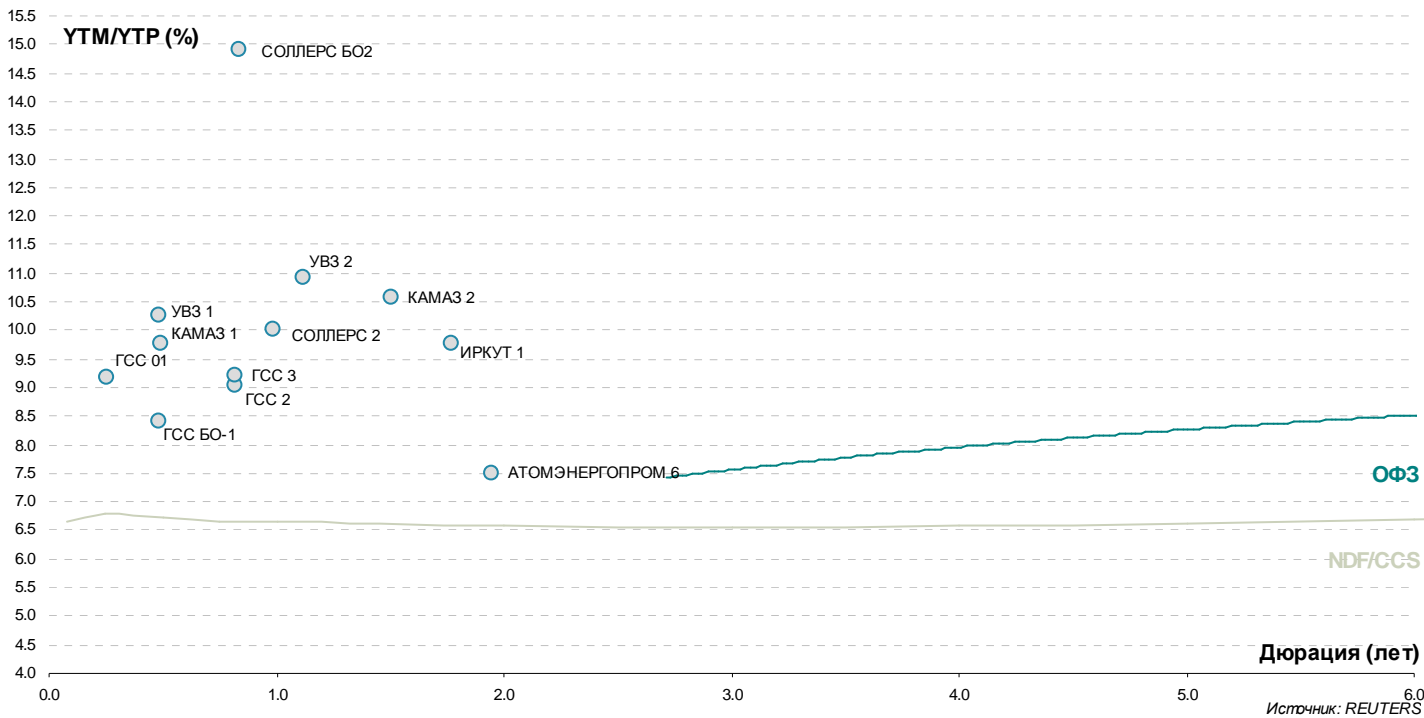
Телекомы



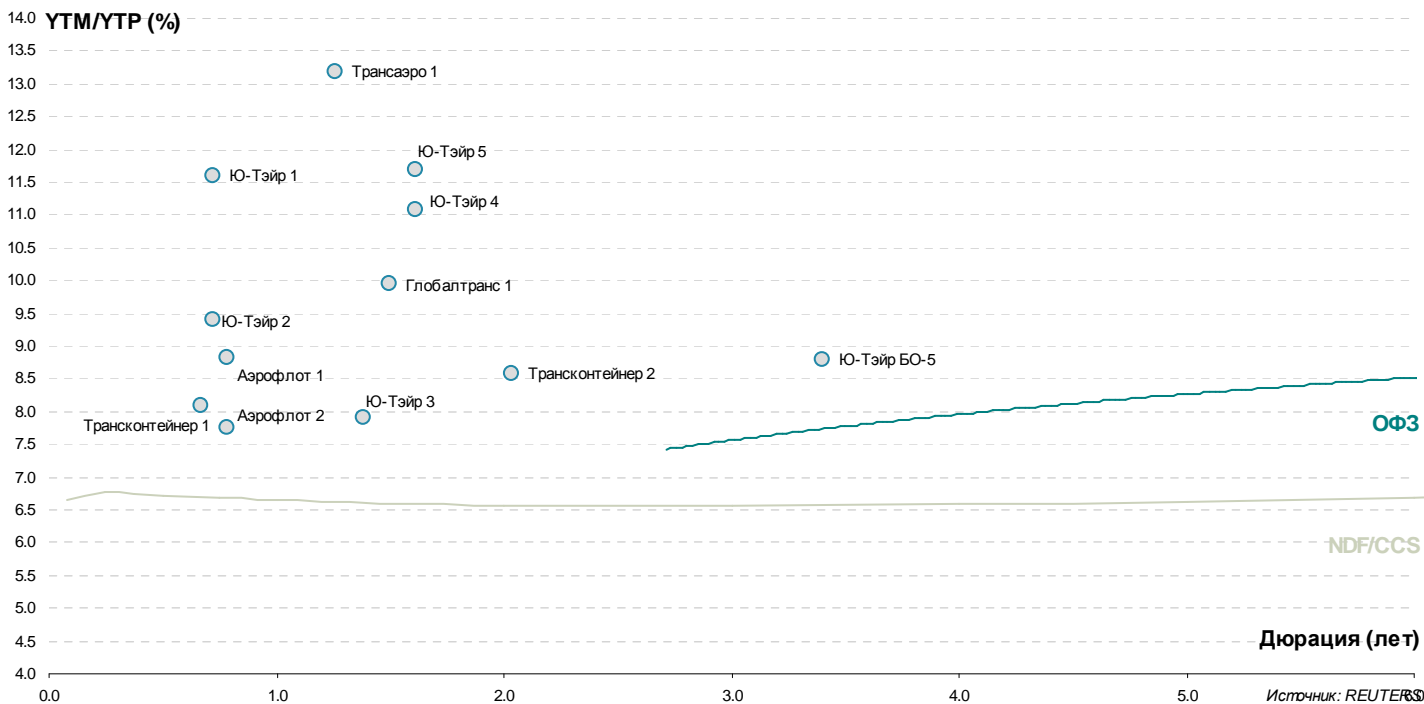
Потребительские, Торговля



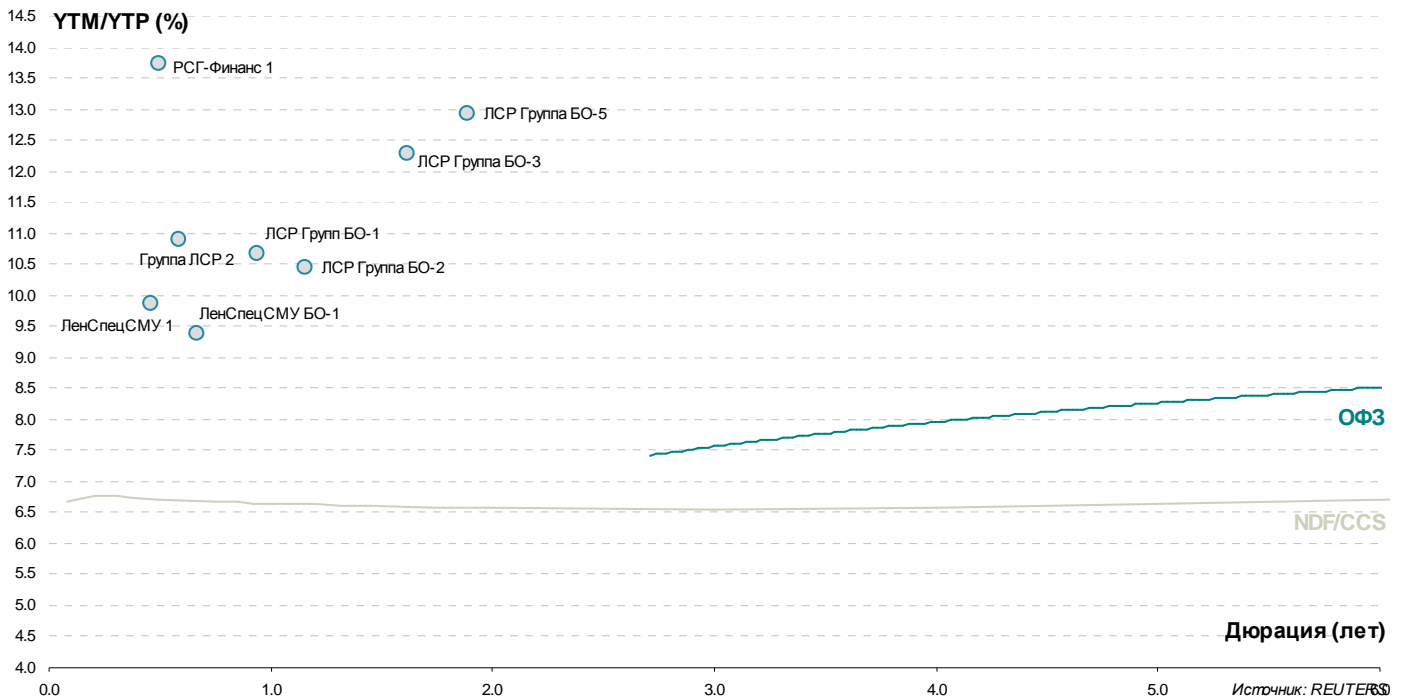
Машиностроение



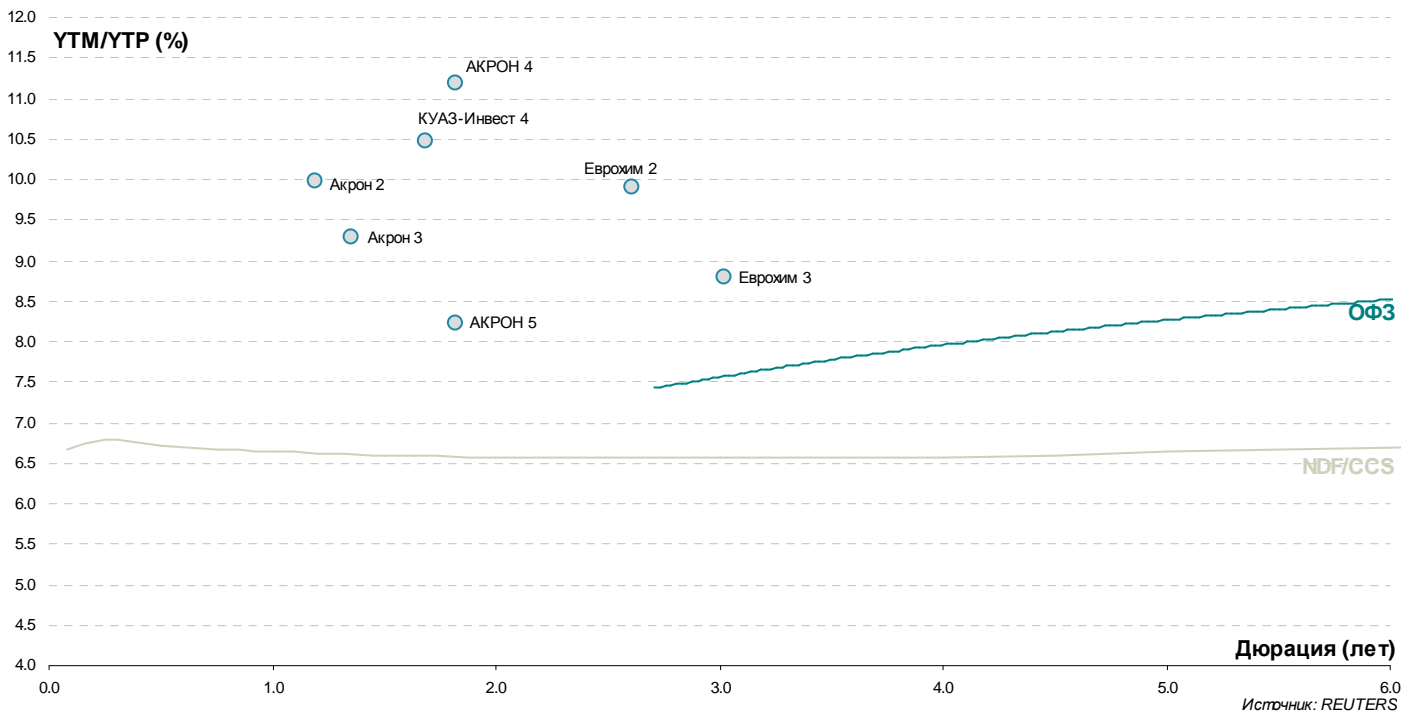
Транспорт



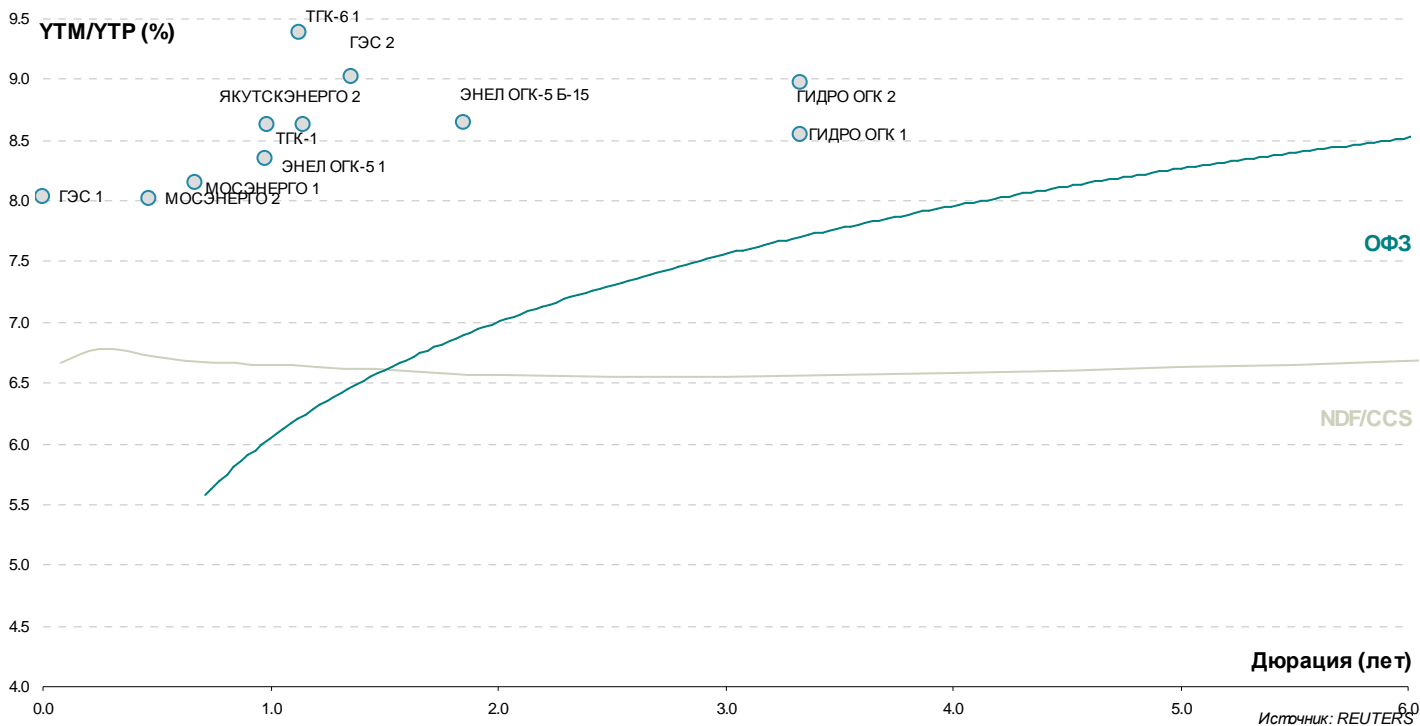
Строительство



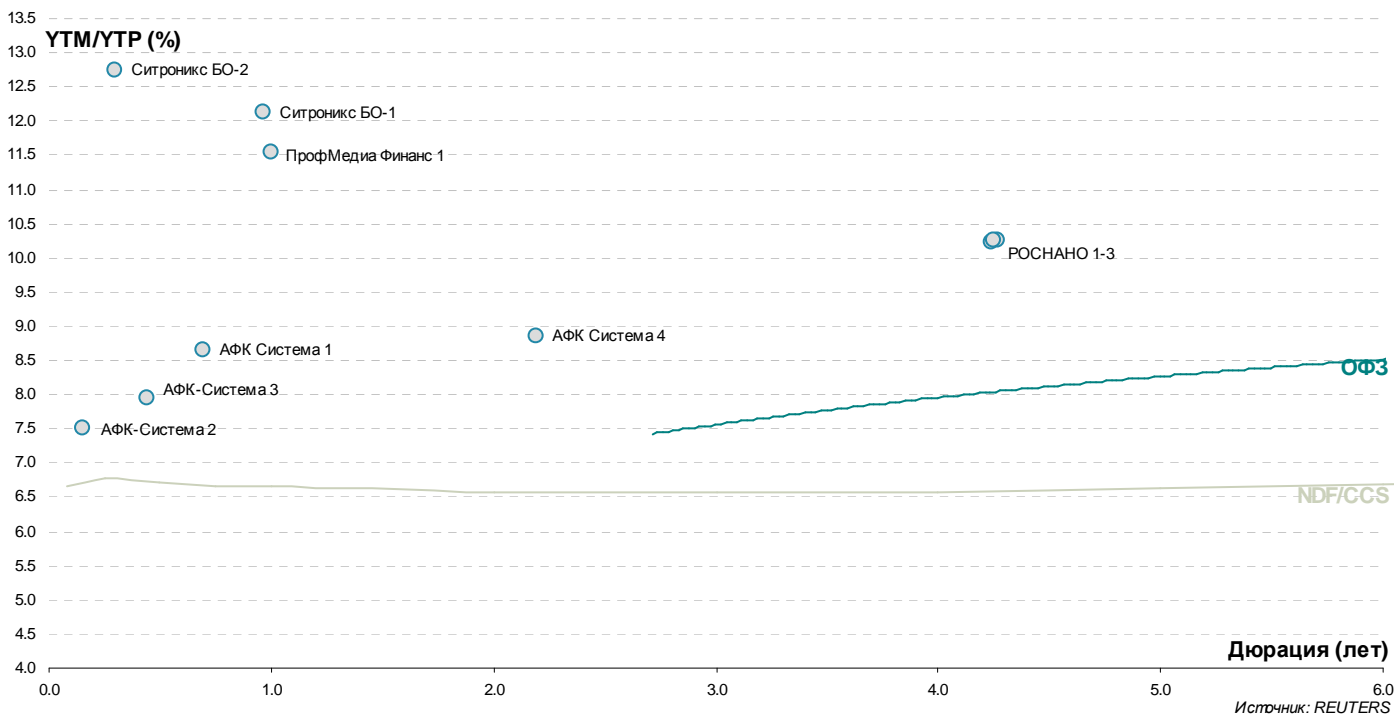
Химические



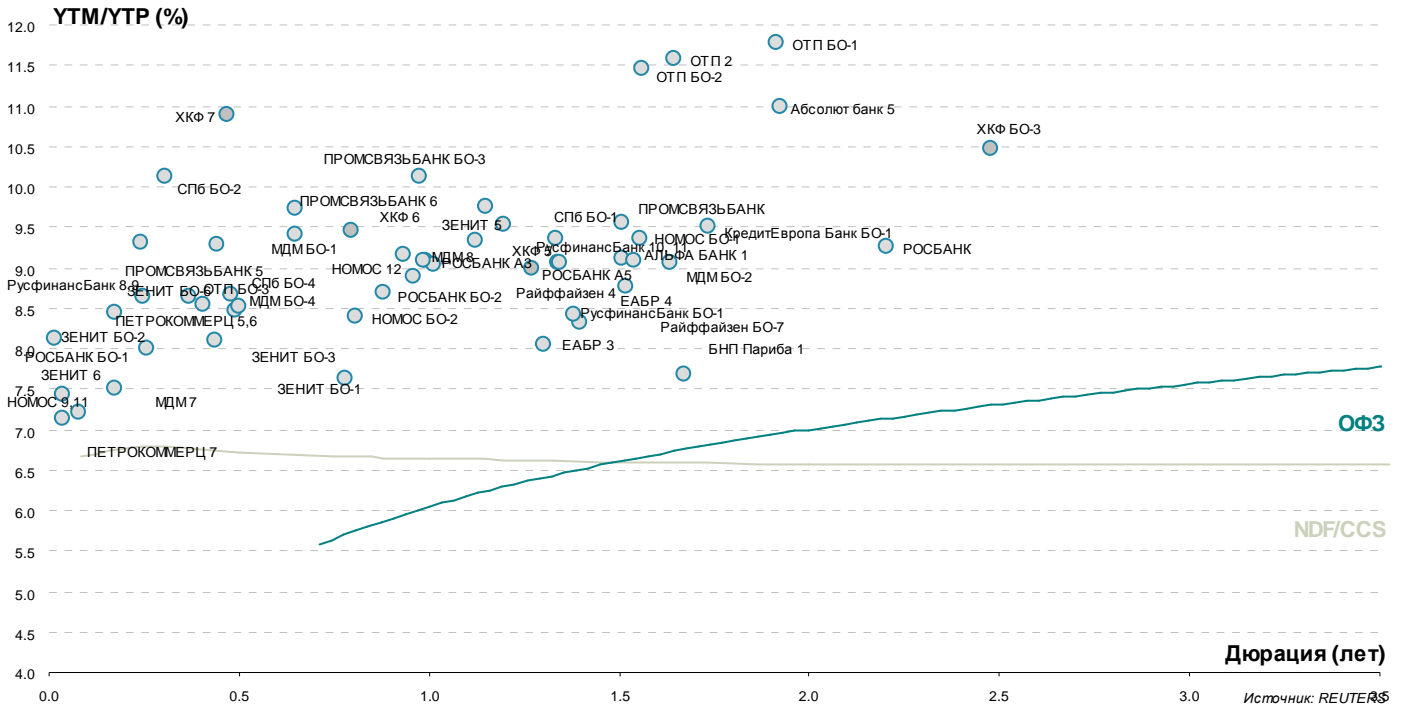
Энергетика и сети



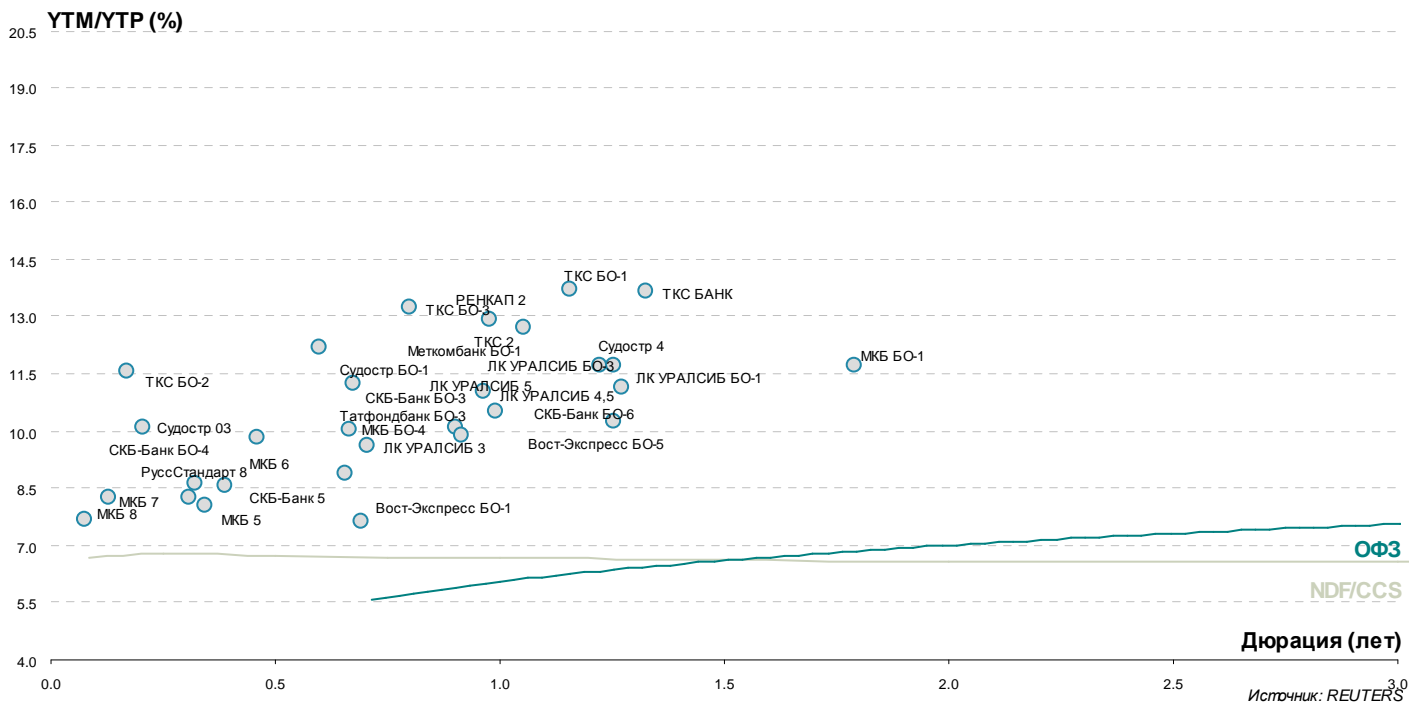
Технологии, Медиа, Интегрированные



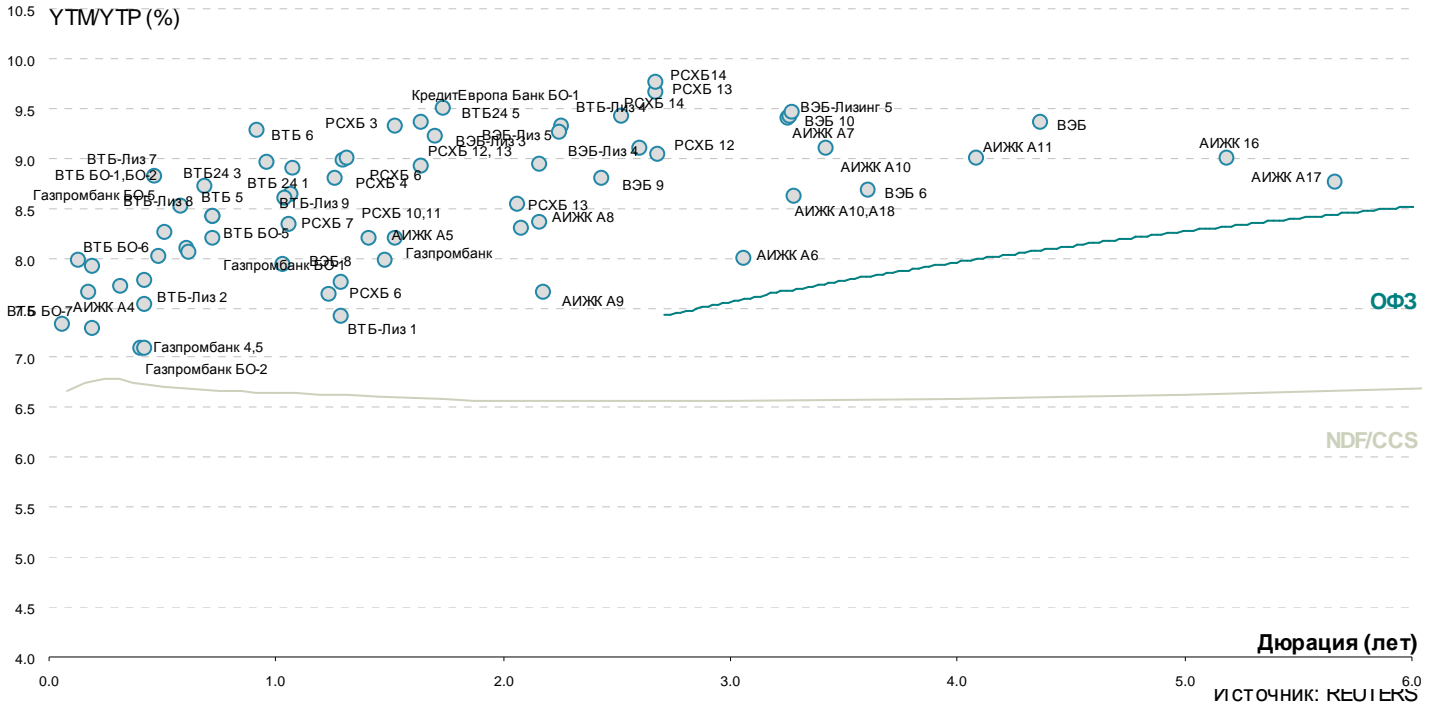
Частные банки с рейтингом не ниже «ВВ-»



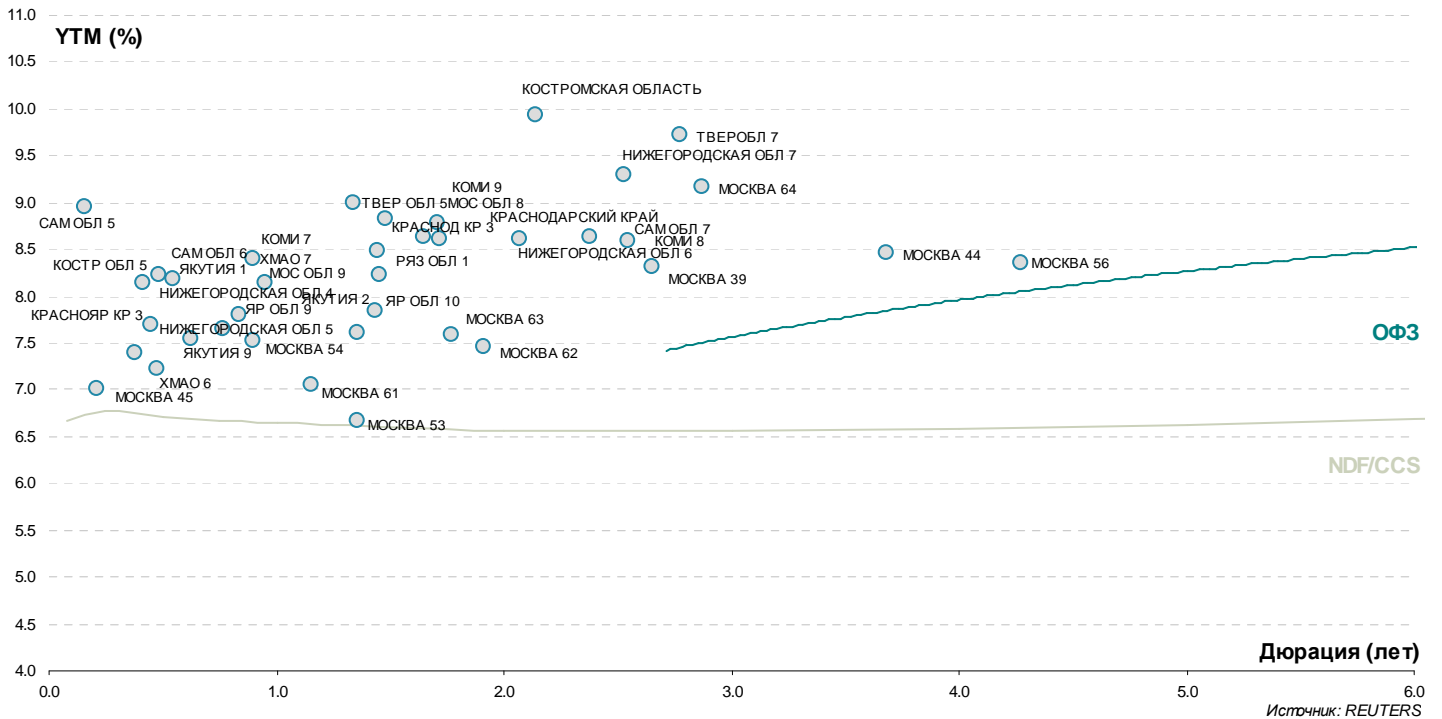
Частные банки с рейтингом не выше «В+»



Госбанки



Региональные

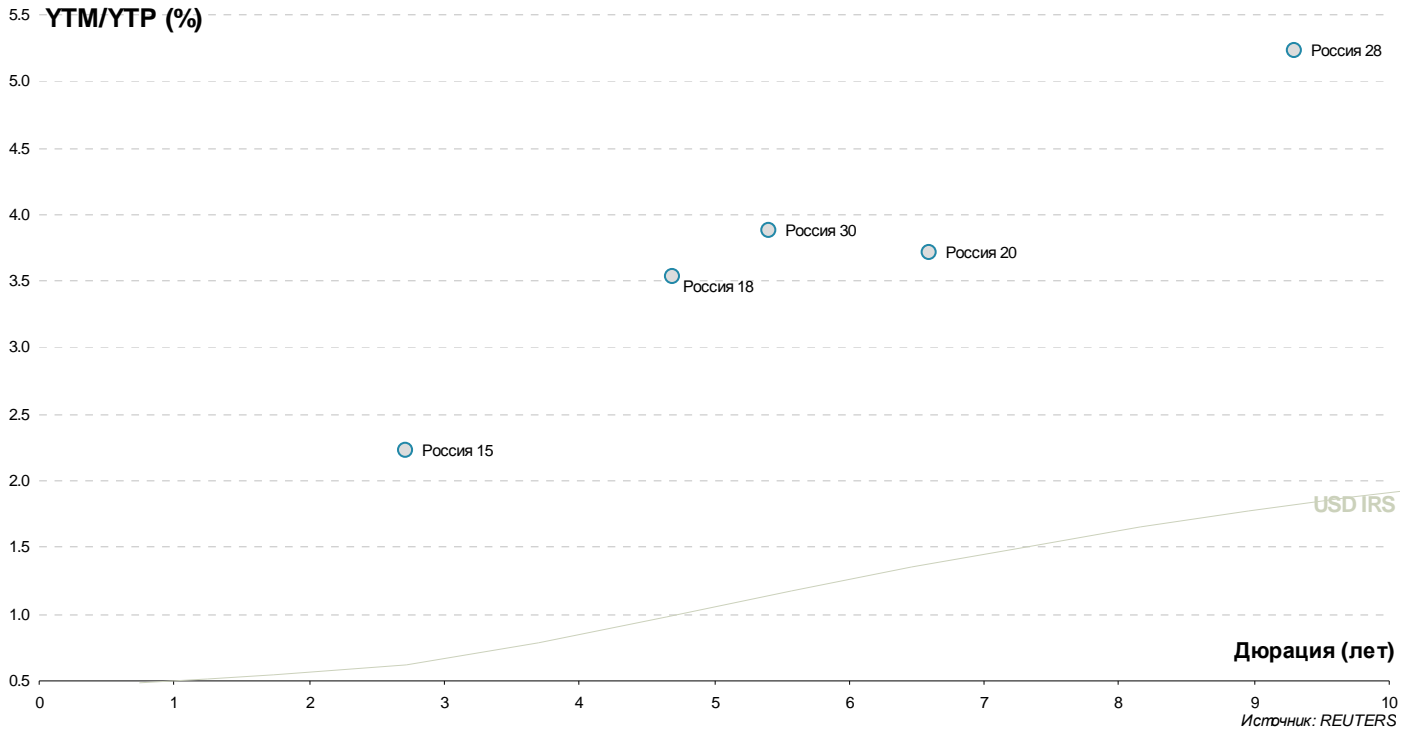


Результаты торгов евробондами

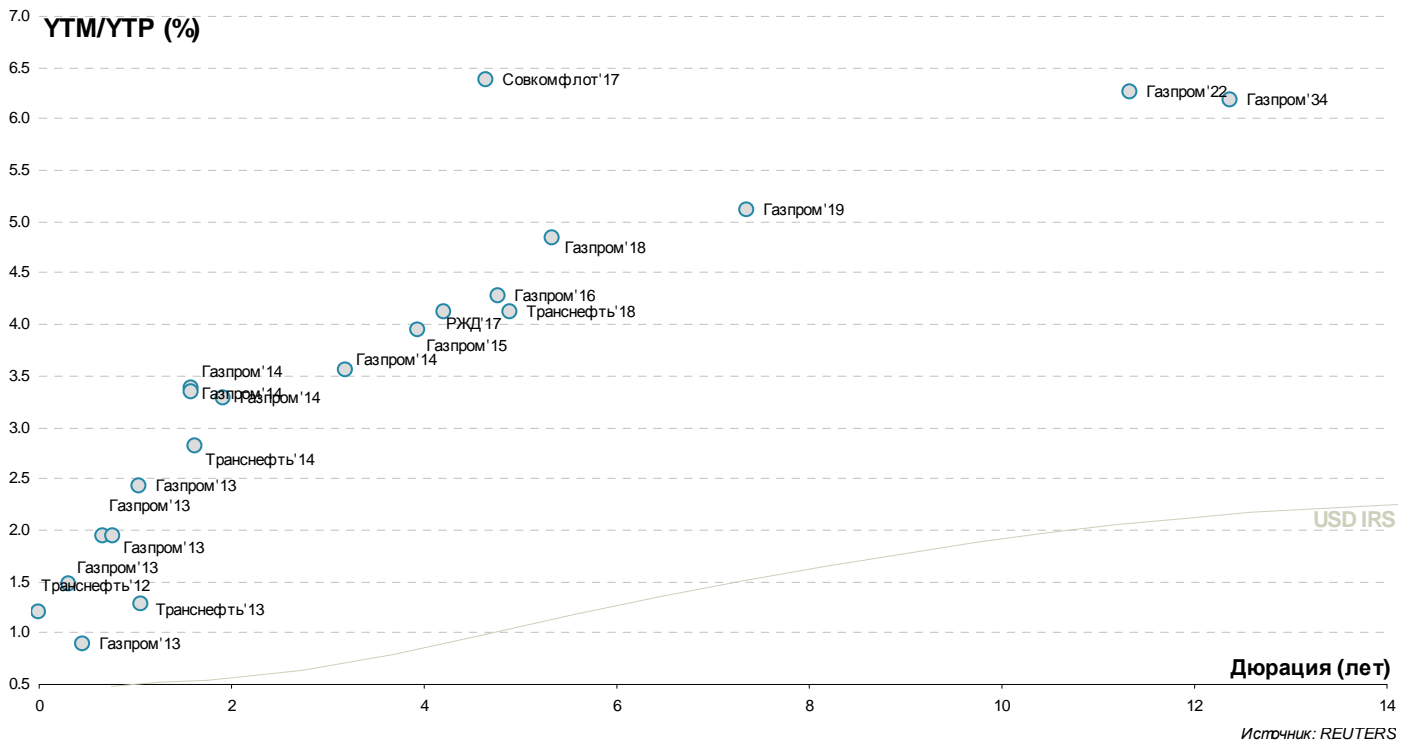
| Выпуск | Валюта | Дата Погашения | Цена | | Доходность | | Дюрация | Изм-е, % (по покупке) | Z-спрэд |
|-------------------------|--------|----------------|---------|---------|------------|---------|---------|--------------------------|---------|
| | | | Покупка | Продажа | Покупка | Продажа | | | |
| РОССИЯ | | | | | | | | | |
| RUSSIA'15 3.625% | USD | 29/04/15 | 103.625 | 104.000 | 2.30 | 2.17 | 2.72 | | 171 |
| RUSSIA'18 11% | USD | 24/07/18 | 139.200 | 141.800 | 3.73 | 3.35 | 4.70 | -0.08 | 266 |
| RUSSIA'30 7.5% | USD | 31/03/30 | 120.202 | 120.355 | 3.89 | 3.87 | 5.41 | 0.07 | 245 |
| RUSSIA'20 5% | USD | 29/04/20 | 108.500 | 108.850 | 3.74 | 3.69 | 6.60 | 0.13 | 230 |
| RUSSIA'28 12.75% | USD | 24/06/28 | 180.200 | 181.300 | 5.27 | 5.20 | 9.30 | -0.39 | 331 |
| ГОСКОМПАНИИ | | | | | | | | | |
| Газпром | | | | | | | | | |
| GAZPR'13 4.505% | USD | 22/07/13 | 100.906 | 101.031 | 1.66 | 1.27 | 0.32 | -0.02 | 122 |
| GAZST'13 5.625% | USD | 22/07/13 | 101.789 | 102.539 | 1.68 | 0.09 | 0.45 | 0.02 | 123 |
| GAZPR'13 9.625% | USD | 01/03/13 | 105.000 | 105.375 | 2.20 | 1.67 | 0.66 | 0.12 | 174 |
| GAZPR'13 7.343% | USD | 11/04/13 | 103.994 | 104.476 | 2.24 | 1.64 | 0.78 | 0.01 | 176 |
| GAZPR'13 7.51% | USD | 31/07/13 | 105.267 | 105.669 | 2.60 | 2.24 | 1.05 | -0.02 | 212 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 25/03/14 | 112.000 | 112.125 | 3.41 | 3.34 | 1.59 | | 293 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 08/03/14 | 111.750 | 111.875 | 3.37 | 3.30 | 1.58 | -0.25 | 289 |
| GAZPR'14 8.125% | USD | 31/07/14 | 109.502 | 109.900 | 3.39 | 3.20 | 1.92 | -0.05 | 287 |
| GAZPR'15 5.092% | USD | 29/11/15 | 104.656 | 105.132 | 3.63 | 3.49 | 3.19 | -0.05 | 298 |
| GAZPR'16 6.212% | USD | 22/11/16 | 108.866 | 109.344 | 4.00 | 3.88 | 3.93 | -0.08 | 319 |
| GAZPR'18 8.146% | USD | 11/04/18 | 119.449 | 119.953 | 4.31 | 4.23 | 4.77 | -0.14 | 327 |
| GAZPR'19 9.25% | USD | 23/04/19 | 125.184 | 125.601 | 4.87 | 4.81 | 5.34 | 0.19 | 368 |
| GAZPR'22 6.51% | USD | 07/03/22 | 110.317 | 110.806 | 5.14 | 5.08 | 7.35 | -0.10 | 354 |
| GAZPR'34 8.625% | USD | 28/04/34 | 127.629 | 128.124 | 6.28 | 6.25 | 11.33 | 0.57 | 424 |
| GAZPR'37 7.288% | USD | 16/08/37 | 113.757 | 114.251 | 6.20 | 6.17 | 12.38 | -0.11 | 411 |
| Транснефть | | | | | | | | | |
| TRANSN'12 6.103% | USD | 27/06/12 | 100.024 | 100.030 | 1.73 | 0.68 | 0.01 | 0.02 | 158 |
| TRANSN'13 7.7% | USD | 07/08/13 | 106.096 | 108.096 | 2.14 | 0.42 | 1.06 | | 166 |
| TRANSN'14 5.67% | USD | 05/03/14 | 104.208 | 105.191 | 3.10 | 2.52 | 1.62 | | 259 |
| TRANSN'18 8.7% | USD | 07/08/18 | 124.278 | 124.716 | 4.16 | 4.09 | 4.89 | 0.28 | 305 |
| РЖД | | | | | | | | | |
| RZD'17 5.739% | USD | 03/04/17 | 106.709 | 107.191 | 4.17 | 4.06 | 4.21 | 0.34 | 330 |
| Совкомфлот | | | | | | | | | |
| SOVKOM'17 5.375% | USD | 27/10/17 | 94.990 | 95.990 | 6.50 | 6.27 | 4.65 | -0.02 | 558 |
| ГОСБАНКИ | | | | | | | | | |
| ВТБ | | | | | | | | | |
| VTB'12 6.609% | USD | 31/10/12 | 101.553 | 101.711 | 2.07 | 1.62 | 0.35 | -0.03 | 160 |
| VTB'15 6.465% | USD | 04/03/15 | 104.913 | 105.613 | 4.50 | 4.23 | 2.47 | | 396 |
| VTB'18 6.315% | USD | 22/02/18 | 101.237 | 101.612 | 6.05 | 5.97 | 4.75 | -0.07 | 506 |
| VTB'18 6.875% | USD | 29/05/18 | 103.953 | 104.956 | 6.07 | 5.87 | 4.97 | -0.34 | 505 |
| VTB'20 6.551% | USD | 13/10/20 | 100.876 | 101.377 | 6.41 | 6.33 | 6.46 | 0.20 | 504 |
| VTB'35 6.25% | USD | 30/06/35 | 103.642 | 104.135 | 5.96 | 5.92 | 12.34 | -0.34 | 386 |
| Банк Москвы | | | | | | | | | |
| BANK OF MOS'13 7.335% | USD | 13/05/13 | 103.443 | 103.693 | 3.34 | 3.06 | 0.87 | 0.19 | 289 |
| BANK OF MOS'15 6.699% | USD | 11/03/15 | 104.153 | 105.104 | 5.04 | 4.67 | 2.49 | 0.90 | 450 |
| BOM CAPITAL'15 6.699% | USD | 11/03/15 | 97.309 | 98.309 | 7.81 | 7.39 | 2.48 | -0.01 | 737 |
| ВЭБ | | | | | | | | | |
| VEB LEAS'16 5.125% | USD | 27/05/16 | 98.735 | 99.735 | 5.49 | 5.20 | 3.59 | -0.01 | 480 |
| VEB'17 5.45% | USD | 22/11/17 | 104.325 | 104.811 | 4.54 | 4.44 | 4.75 | 0.39 | 355 |
| VEB'20 6.902% | USD | 09/07/20 | 109.704 | 110.212 | 5.40 | 5.32 | 6.22 | -0.62 | 403 |
| VEB'25 6.8% | USD | 22/11/25 | 107.171 | 107.684 | 6.01 | 5.96 | 9.12 | -0.43 | 417 |
| Газпромбанк | | | | | | | | | |
| GAZPROMB'13 7.933% | USD | 28/06/13 | 104.653 | 105.054 | 3.21 | 2.81 | 0.95 | 0.23 | 274 |
| GAZPROMB'14 6.25% | USD | 15/12/14 | 104.004 | 104.505 | 4.52 | 4.31 | 2.33 | 0.40 | 399 |
| GAZPROMB'15 6.5% | USD | 23/09/15 | 104.592 | 105.092 | 4.95 | 4.78 | 2.94 | -0.07 | 435 |
| РСХБ | | | | | | | | | |
| ROSSELKH'13 7.175% | USD | 16/05/13 | 104.142 | 104.437 | 2.45 | 2.12 | 0.88 | -0.02 | 198 |
| ROSSELKH'14 7.125% | USD | 14/01/14 | 105.606 | 106.008 | 3.39 | 3.13 | 1.46 | -0.01 | 289 |
| ROSSELKH'14 9% | USD | 11/06/14 | 110.208 | 110.632 | 3.56 | 3.35 | 1.84 | -0.22 | 305 |
| ROSSELKH'17 6.299% | USD | 15/05/17 | 105.952 | 106.451 | 4.91 | 4.80 | 4.28 | -0.08 | 404 |
| ROSSELKH'18 7.75% | USD | 29/05/18 | 113.547 | 114.037 | 5.07 | 4.99 | 4.92 | 0.11 | 403 |
| ROSSELKH'21 6% | USD | 03/06/21 | 98.491 | 99.116 | 6.44 | 6.26 | 3.55 | -0.02 | 578 |
| Сбербанк | | | | | | | | | |
| SBER'13 6.48% | USD | 15/05/13 | 103.703 | 104.034 | 2.25 | 1.88 | 0.87 | -0.02 | 177 |
| SBER'13 6.468% | USD | 02/07/13 | 104.067 | 104.414 | 2.41 | 2.07 | 0.97 | -0.02 | 193 |
| SBER'15 5.499% | USD | 07/07/15 | 104.719 | 105.198 | 3.84 | 3.67 | 2.77 | -0.36 | 324 |
| SBER'17 5.4% | USD | 24/03/17 | 103.712 | 104.194 | 4.52 | 4.41 | 4.21 | -0.10 | 366 |
| SBER'21 5.717% | USD | 16/06/21 | 102.280 | 102.905 | 5.39 | 5.31 | 7.16 | -0.23 | 387 |
| ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ | | | | | | | | | |
| Евраз | | | | | | | | | |
| EVRAZ'13 8.875% | USD | 24/04/13 | 104.071 | 104.703 | 3.84 | 3.09 | 0.81 | -0.03 | 339 |
| EVRAZ'15 8.25% | USD | 10/11/15 | 105.152 | 106.139 | 6.52 | 6.20 | 3.00 | -0.05 | 595 |

| Выпуск | Валюта | Дата Погашения | Цена | | Доходность | | Дюрация | Изм-е, % (по покупке) | Z-спрэд |
|------------------------|--------|-------------------|---------|---------|------------|---------|---------|--------------------------|---------|
| | | | Покупка | Продажа | Покупка | Продажа | | | |
| EVRAZ'18 9.5% | USD | 24/04/18 | 107.190 | 108.225 | 7.93 | 7.72 | 4.59 | 0.14 | 701 |
| EVRAZ'18 6.75% | USD | 27/04/18 | 96.250 | 97.000 | 7.55 | 7.39 | 4.85 | 0.25 | 659 |
| Альянс Ойл | | | | | | | | | |
| ALLIANCE OIL'15 9.875% | USD | 11/03/15 | 101.186 | 102.186 | 9.36 | 8.94 | 2.38 | 0.22 | 900 |
| Апроса | | | | | | | | | |
| ALROSA'14 8.875% | USD | 17/11/14 | 110.136 | 111.073 | 4.37 | 3.98 | 2.20 | -0.06 | 385 |
| ALROSA'20 7.75% | USD | 03/11/20 | 104.570 | 105.593 | 7.02 | 6.86 | 6.30 | -0.11 | 567 |
| Вымпелком | | | | | | | | | |
| VIMPELC'13 8.375% | USD | 30/04/13 | 103.483 | 103.810 | 4.14 | 3.75 | 0.83 | -0.06 | 369 |
| VIP FIN'16 6.493% | USD | 02/02/16 | 99.180 | 99.180 | 6.75 | 6.75 | 3.19 | 0.13 | 616 |
| VIMPELC'16 8.25% | USD | 23/05/16 | 104.539 | 105.043 | 6.90 | 6.76 | 3.41 | -0.06 | 627 |
| VIMPELC'18 9.125% | USD | 30/04/18 | 106.419 | 106.894 | 7.74 | 7.64 | 4.64 | 0.14 | 680 |
| VIP FIN'21 7.748% | USD | 02/02/21 | 97.000 | 98.000 | 8.24 | 8.07 | 6.21 | 1.12 | 690 |
| Лукойл | | | | | | | | | |
| LUKOIL'14 6.375% | USD | 05/11/14 | 107.120 | 107.580 | 3.22 | 3.02 | 2.22 | -0.05 | 267 |
| LUKOIL'17 6.356% | USD | 07/06/17 | 108.408 | 108.902 | 4.44 | 4.34 | 4.34 | -0.08 | 355 |
| LUKOIL'19 7.25% | USD | 05/11/19 | 112.744 | 113.270 | 5.15 | 5.07 | 5.89 | 0.73 | 386 |
| LUKOIL'20 6.125% | USD | 09/11/20 | 104.970 | 105.487 | 5.38 | 5.30 | 6.68 | -0.12 | 395 |
| LUKOIL'22 6.656% | USD | 07/06/22 | 109.438 | 110.412 | 5.42 | 5.30 | 7.54 | 0.29 | 380 |
| МТС | | | | | | | | | |
| MTS'20 8.625% | USD | 22/06/20 | 114.308 | 114.795 | 6.32 | 6.25 | 6.08 | -0.15 | 500 |
| НОВАТЭК | | | | | | | | | |
| NOVATEK'16 5.326% | USD | 03/02/16 | 102.780 | 103.080 | 4.48 | 4.39 | 3.27 | -0.82 | 382 |
| NOVATEK'21 6.604% | USD | 03/02/21 | 109.250 | 109.750 | 5.25 | 5.18 | 6.64 | 0.25 | 378 |
| Северсталь | | | | | | | | | |
| SEVERSTAL'13 9.75% | USD | 29/07/13 | 106.252 | 107.139 | 3.86 | 3.06 | 1.03 | -0.03 | 340 |
| SEVERSTAL'14 9.25% | USD | 19/04/14 | 108.875 | 109.625 | 4.12 | 3.72 | 1.70 | | 364 |
| SEVERSTAL'17 6.7% | USD | 25/10/17 | 100.368 | 101.372 | 6.61 | 6.39 | 4.53 | -0.09 | 571 |
| ТМК | | | | | | | | | |
| TMK'18 7.75% | USD | 27/01/18 | 94.516 | 95.516 | 9.02 | 8.78 | 4.46 | 0.51 | 817 |
| ТНК | | | | | | | | | |
| TNK-BP'13 7.5% | USD | 13/03/13 | 103.750 | 106.750 | 2.19 | -1.81 | | 0.06 | |
| TNK-BP'15 6.25% | USD | 02/02/15 | 105.543 | 106.443 | 3.99 | 3.63 | 2.39 | -0.05 | 343 |
| TNK-BP'16 7.5% | USD | 18/07/16 | 111.474 | 112.452 | 4.39 | 4.14 | 3.51 | -0.09 | 365 |
| TNK-BP'17 6.625% | USD | 20/03/17 | 108.281 | 109.238 | 4.65 | 4.44 | 4.11 | -0.08 | 380 |
| TNK-BP'18 7.875% | USD | 13/03/18 | 114.531 | 115.492 | 4.93 | 4.75 | 4.70 | -0.11 | 391 |
| TNK-BP'20 7.25% | USD | 02/02/20 | 112.833 | 113.339 | 5.19 | 5.11 | 5.94 | -0.29 | 387 |
| ЧАСТНЫЕ БАНКИ | | | | | | | | | |
| Альфа-Банк | | | | | | | | | |
| ALFA BANK'12 8.2% | USD | 25/06/12 | 100.320 | 100.970 | -28.94 | -103.05 | | 0.32 | |
| ALFA BANK'13 9.25% | USD | 24/06/13 | 104.226 | 105.227 | 4.86 | 3.86 | 0.98 | 0.33 | 442 |
| ALFA BANK'15 8% | USD | 18/03/15 | 104.479 | 105.479 | 6.19 | 5.80 | 2.47 | -0.80 | 568 |
| ALFA BANK'17 7.875% | USD | 25/09/17 | 100.757 | 101.757 | 7.69 | 7.46 | 4.33 | 0.38 | 685 |
| Номос Банк | | | | | | | | | |
| NOMOS BANK'12 9.25% | USD | 17/12/12 | 102.500 | 102.750 | 3.91 | 3.39 | 0.48 | | 347 |
| NOMOS BANK'13 6.5% | USD | 21/10/13 | 102.015 | 103.015 | 4.90 | 4.13 | 1.28 | 0.47 | 446 |
| NOMOS BANK'15 8.75% | USD | 21/10/15 | 102.740 | 103.740 | 7.79 | 7.45 | 2.92 | -0.26 | 728 |
| Промсвязьбанк | | | | | | | | | |
| PROMSVY AZB'13 10.75% | USD | 15/07/13 | 104.504 | 105.004 | 6.27 | 5.79 | 0.98 | -0.40 | 588 |
| PSB FINANC'14 6.2% | USD | 25/04/14 | 97.759 | 98.259 | 7.52 | 7.22 | 1.74 | 0.01 | 714 |
| PROMSVY AZB'15 12.75% | USD | 27/05/15 | 108.504 | 109.504 | 9.35 | 8.97 | 2.53 | -0.50 | 898 |
| PROMSVY AZB'16 11.25% | USD | 08/07/16 | 106.242 | 108.242 | 9.36 | 8.78 | 3.22 | 0.24 | 882 |
| ХКФБ | | | | | | | | | |
| HOME CREDIT'14 7% | USD | 18/03/14 | 102.757 | 103.257 | 5.31 | 5.01 | 1.63 | 0.76 | 486 |

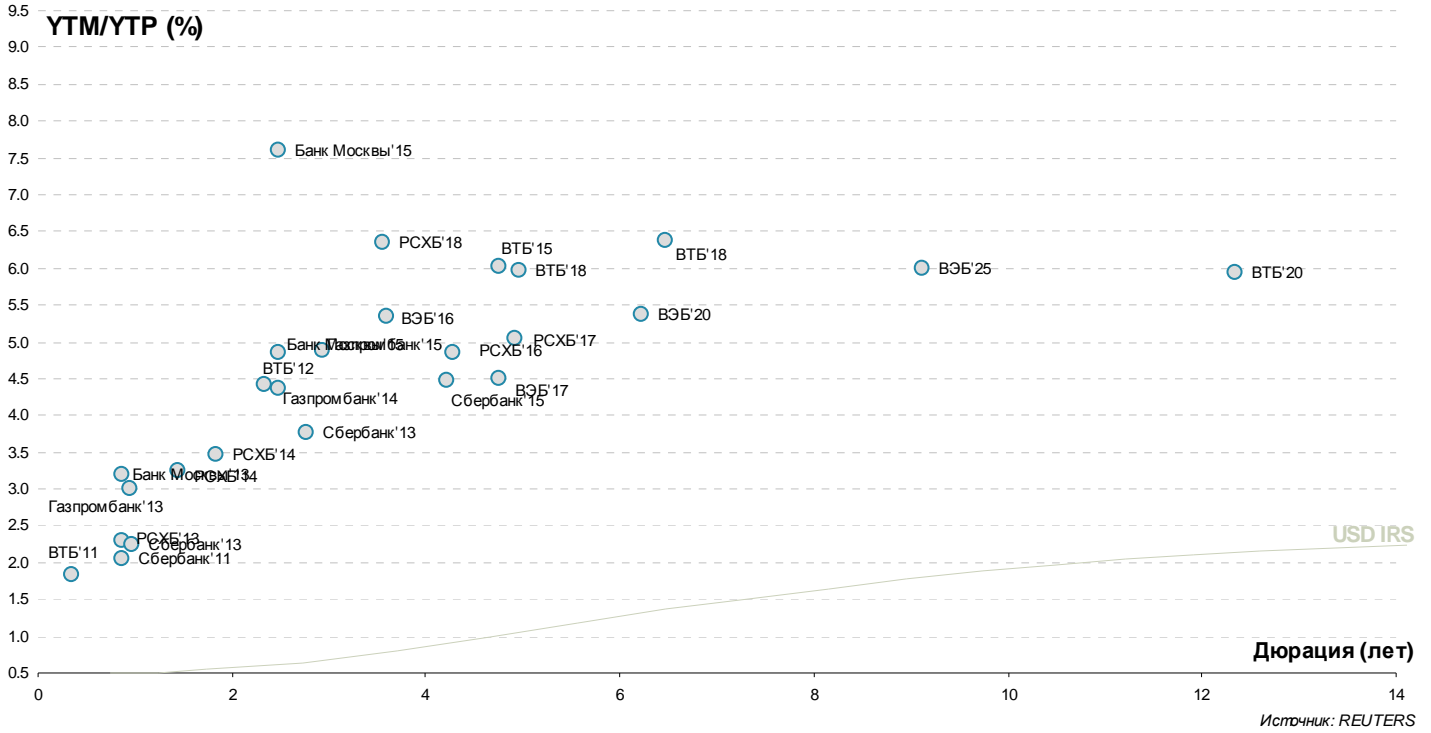
Россия



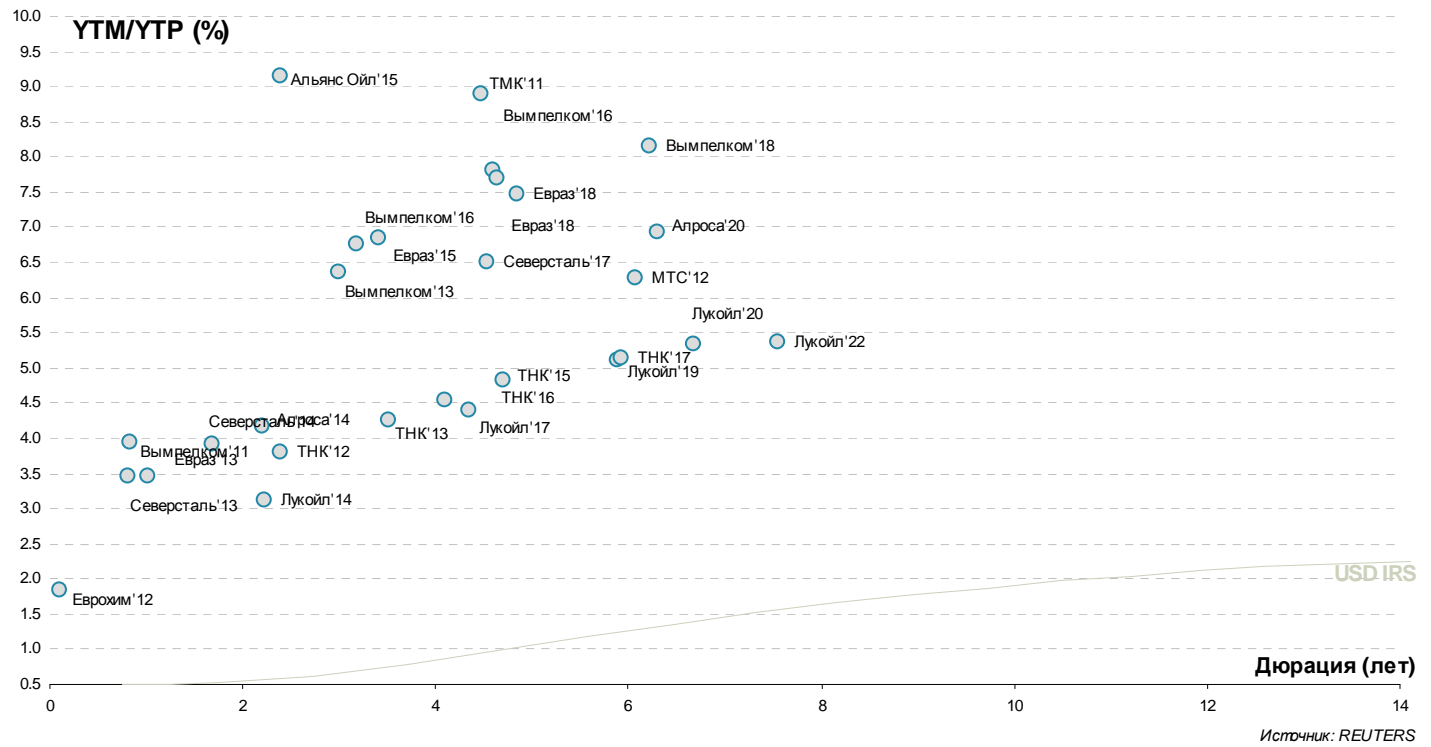
Госкомпании



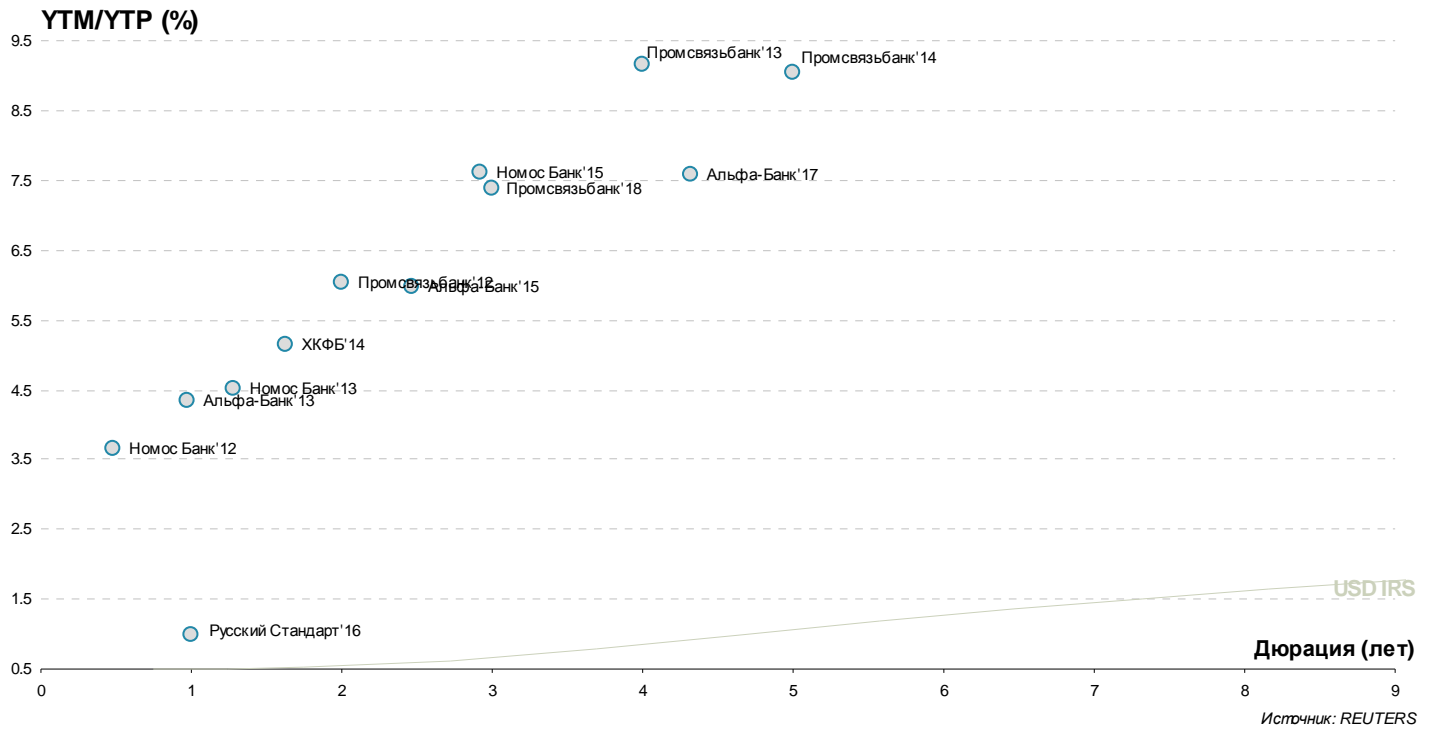
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Наталья Талейко
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
e.gashigullina@zenit.ru

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

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

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

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