БАНК ЗЕНИТ
БАНКОВСКАЯ ГРУППА ЗЕНИТ

# ДОЛГОВОЙ РЫНОК

*Ежедневный обзор*


**Основные события /стр. 2/**

**Макроэкономика /стр. 3/**

- Промпроизводство в РФ в июле: темпы роста восстановились, но доверия к ним нет

**Внешний рынок долга /стр. 4/**

- Статистика из США продолжает радовать инвесторов

**Денежно-кредитный рынок /стр. 5/**

- Старт налогового периода августа прошел без проблем
- Рубль без движений

**Российский долговой рынок /стр. 6/**

- Евробонды ускорили снижение
- Локальный рынок «в минусе», Минфин безуспешен на первичке

**Первичный рынок /стр. 7/**

**Приложения**

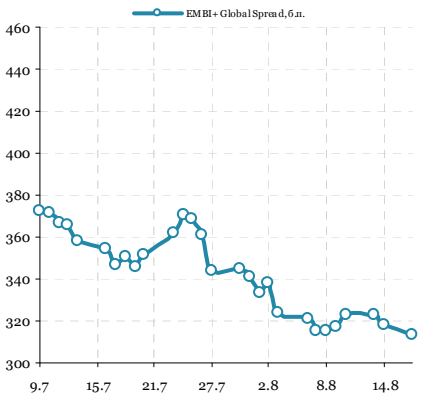
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 8/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 16/
- Результаты торгов евробондами /стр. 17/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 19/


## Динамика ключевых показателей

| | знач. | | Δ за день | за 6 месяцев: MIN. | MAX. |
|---|---|---|---|---|---|
| **Внешний рынок долга** | | | | | |
| UST-10 yield | 1.82 | ▲ | 0.08 | 1.39 | 2.38 |
| UST 10-2Y sprd | 153 | ▲ | 7 | 117 | 200 |
| EMBI+Glob. | 313 | ▼ | -5 | 313 | 441 |
| EMBI+Rus sprd | 197 | ▼ | -5 | 188 | 332 |
| Russia'30 yield | 3.28 | ▲ | 0.03 | 2.91 | 4.45 |
| **Денежный рынок** | | | | | |
| Libor-3m | 0.43 | ▼ | 0.00 | 0.43 | 0.52 |
| Euribor-3m | 0.34 | ▼ | 0.00 | 0.34 | 1.07 |
| MosPrime-1m | 6.54 | ■ | 0.00 | 5.67 | 6.89 |
| Корсчета в ЦБ | 799.1 | ▲ | 34.4 | 504 | 1032 |
| Депоз. в ЦБ | 90.2 | ▼ | -0.1 | 61 | 757 |
| NDF RU 3m | 6.7 | ▲ | 0.0 | 5 | 7 |
| **Валютный рынок** | | | | | |
| USD/RUB | 31.87 | ▲ | 0.015 | 28.97 | 33.67 |
| EUR/RUB | 39.171 | ▼ | -0.105 | 38.43 | 41.81 |
| EUR/USD | 1.229 | ▼ | -0.003 | 1.21 | 1.35 |
| Корзина ЦБ | 35.15 | ▼ | -0.030 | 33.33 | 37.28 |
| DXY Индекс | 82.645 | ▲ | 0.162 | 78.27 | 84.01 |
| **Фондовые индексы** | | | | | |
| RTS | 1427.7 | ▲ | 0.4% | 1228 | 1755 |
| Dow Jones | 13164.8 | ▼ | -0.06% | 12101 | 13279 |
| DAX | 6943.6 | ▼ | -0.05% | 5969 | 7158 |
| Nikkei 225 | 8925 | ▲ | 1.88% | 8296 | 10255 |
| Shanghai Comp. | 2118.9 | ▼ | -0.32% | 2104 | 2461 |
| **Сырьевые рынки** | | | | | |
| Нефть Urals | 116.5 | ▼ | -0.11% | 88 | 125 |
| Нефть Brent | 116.3 | ▼ | -0.30% | 89 | 126 |
| Золото | 1603.1 | ▼ | -0.07% | 1540 | 1784 |
| CRB Index | 301.7 | ▲ | 0.46% | 267 | 326 |

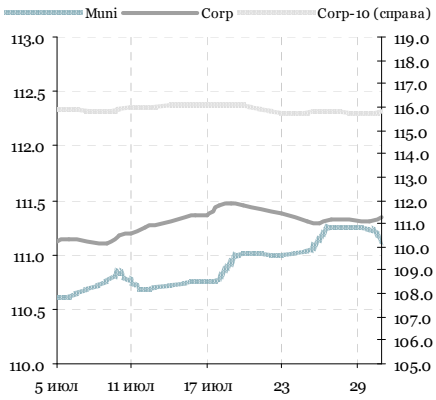
*Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ*

**EMBI+ Global Sovereign Spread**




*Источник: JPM*

**Ценовые индексы ZETBI**




*Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ*

## Динамика индексов ZETBI

| | знач. | | Δ за день | за 6 месяцев MIN. | MAX. |
|---|---|---|---|---|---|
| **Price Return** | | | | | |
| OFZ | 110.8 | ▲ | 0.01 | 107.5 | 112.0 |
| Muni | 111.1 | ▼ | -0.10 | 110.5 | 113.9 |
| Corp | 111.3 | ▲ | 0.03 | 110.7 | 113.2 |
| Corp-10 | 115.8 | ▲ | 0.04 | 115.5 | 120.6 |
| **Total Return** | | | | | |
| OFZ | 244.4 | ▲ | 0.08 | 230.8 | 244.7 |
| Muni | 339.9 | ▼ | -0.24 | 321.1 | 340.1 |
| Corp | 338.8 | ▲ | 0.17 | 318.6 | 340.3 |
| Corp-10 | 340.3 | ▲ | 0.22 | 321.0 | 340.3 |
| **Объем торгов в сегменте (млн руб.)** | | | | | |
| OFZ | 612 | ▲ | 206 | 0 | 22 514 |
| Muni | 97 | ▼ | -252 | 10 | 6 146 |
| Corp | 4 430 | ▲ | 1 206 | 19 | 44 858 |

*Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ*

# Главные новости

**Минфин РФ разместил ОФЗ-ПД серии 25080 с погашением 19 апреля 2017 года на общую сумму 6,5 млрд руб. по номиналу при спросе по верхней границе установленного диапазона доходности 6,5 мрд руб. и объеме предложения 15 млрд руб.** Средневзвешенная цена на составила 99,6645% от номинала, что соответствует доходности 7,62% годовых. /Интерфакс/

**ОАО «Запсибкомбанк» установило ставку 1-2 купонов биржевых облигаций серии БО-02 на 2 млрд руб. на уровне 12,5% годовых, что соответствует доходности к годовой оферте на уровне 12,89% годовых.** /Интерфакс/

**ОАО «Банк «Восточный экспресс» установило ставку первого купона биржевых облигаций БО-04 на 5 млрд рублей в размере 11,0% годовых, что соответствует доходности к годовой оферте в размере 11,46% годовых.** /Интерфакс/

# Основные события: вне рынка / на рынке

## Вчера: 15.08.2012 – среда

**Статистика США:** CPI, Empire Manufacturing, Net long-term TIC Flows, Industrial production, Capacity Utilization

- **Выплата купона: ОМПК, 01** (12%, 29.9 млн руб.), **АИЖК, 19** (7.7%, 116.4 млн руб.), **Атомэнергопром, 06** (7.5%, 752.1 млн руб.), **РейлТрансАвто (РТА), 02** (12%, 44.8 млн руб.), **НОТА-Банк , 01** (11%, 54.8 млн руб.), **Банк Держава, 01** (10.25%, 15.3 млн руб.), **АИЖК, 21** (8.8%, 332.7 млн руб.), **Москоммерцбанк, 2034-С (RMBS)** (7%, 27 тыс долл.), **Россия, 46020** (6.9%, 4.6 млрд руб.), **АИЖК, 09** (7.49%, 94.4 млн руб.), **Газпром, 09** (7.23%, 180.2 млн руб.), **Каскад Нижне-Черекских ГЭС, 2013 (LPN)** (10.5%, 3.1 млн долл.), **Россия, 46021** (6%, 3.2 млрд руб.), **Первый ипотечный агент АИЖК, 1А** (6.94%), **АИЖК, 10** (8.05%, 121.7 млн руб.), **МДМ Банк, 2052-А (RMBS)** (10%, 20.9 млн руб.), **Хортекс-Финанс, 01** (0.5%, 2.5 млн руб.)
- **Погашение: ОМПК, 01** (500 млн руб.)

## Сегодня: 16.08.2012 – четверг

**Статистика США:** Initial jobless claims, Continuing claims, Housing starts, Building permits

**Статистика Еврозоны:** CPI

**Статистика России:** Industrial production

- **Выплата купона: ГЛОБЭКСБАНК, БО-01** (8.3%, 206.9 млн руб.), **Каравай, 06** (10%, 5.6 млн руб.), **ОАО DOMO, 01** (14%, 69.8 млн руб.), **Ярославская область, 34009** (8%, 59.8 млн руб.), **ВТБ, 2013, CHF (LPN)** (4%, 16 млн швейцарских франков), **ММК, БО-08** (8.19%, 204.2 млн руб.), **Минфин Республики Саха (Якутия), 35004** (8.77%, 54.6 млн руб.), **Россельхозбанк, 03** (9.25%, 461.2 млн руб.), **Газпром, 2037 (LPN12)** (7.288%, 45.5 млн руб.), **Россия, 39003(ГСО-ФПС)** (6.6%, 1 млрд руб.)

## Завтра: 17.08.2012 – пятница

**Статистика США:** U. of Michigan Confidence

- **Выплата купона: Северсталь, БО-02** (9.75%, 486.2 млн руб.), **Северсталь, БО-04** (9.75%, 243.1 млн руб.), **Медведь-Финанс, БО-01** (12.5%, 31.1 млн руб.), **Россия, 36003(ГСО-ППС)** (7.5%, 570.3 млн руб.), **Башнефть, 04** (9%, 448.8 млн руб.), **ГИДРОМАШСЕРВИС, 02** (10.75%, 160.8 млн руб.), **Россельхозбанк, 2017, RUB (LPN)** (8.625%, 862.5 млн руб.), **Россельхозбанк, 06** (7.8%, 194.4 млн руб.), **Газпром, 2037 (LPN12)** (7.288%, 45.5 млн руб.), **Россия, 39003(ГСО-ФПС)** (6.6%, 1 млрд руб.)
- **Оферта: АФК Система, 02** (20 млн руб.)
- **Размещение: Восточный Экспресс Банк, БО-04** (3 млрд руб.), **Запсибкомбанк, БО-02** (2 млрд руб.)

# Макроэкономика

*Владимир Евстифеев*
*v.evstifeev@zenit.ru*

## Промпроизводство в РФ в июле: темпы роста восстановились, но доверия к ним нет

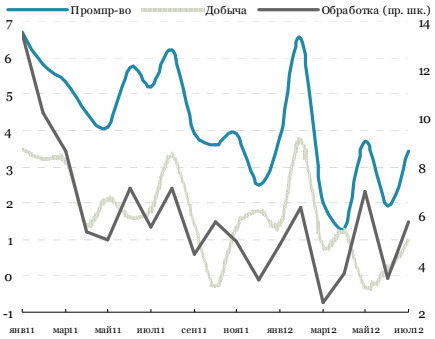
Росстат вчера отчитался о состоянии российской промышленности за июль. Цифры оказались сильнее наших ожиданий (2.0-2.5%), индекс промпроизводства вырос на 3.4% после роста на 1.9% в июне, при этом в месячном выражении сектор возобновил рост на 0.9% после июньской стагнации.

В добывающих отраслях картина остается без существенных изменений: растущие темпы добычи угля (8.2%) компенсируют снижение добычи газа (-7.9%). Нефтяная отрасль стабилизировала добычу на прежнем уровне и продолжает стагнацию. В результате эти процессы выливаются в относительно нейтральное состояние добычи.

Обрабатывающие сегменты получают поддержку по тем же направлениям, что и раньше, при этом в июле она была несколько сильнее обычного. Так, пищевая отрасль (прежде всего, мясная и мясоперерабатывающая промышленность), производство стройматериалов и автомобилестроители оказали наибольшую поддержку обрабатывающему сегменту. По направлениям химия и нефтехимия, вес которых в индексе обрабатывающих отраслей достигает 40%, в июле активизации замечено не было, средние темпы роста здесь пока остаются почти вдвое ниже, чем по всей обработке.

Хорошие данные по российской промышленности за июль выглядят не более чем положительным стечением временных обстоятельств. В июле было на 1 рабочий день больше, чем в июле 2011 г. Качественным рост промпроизодства не выглядит ни в добывающих, ни в обрабатывающих отраслях. Добыча стагнирует на фоне компенсации угольной промышленностью провала в добыче газа. Обработка же базирует свой рост на факторе сохранения высокого темпа наращивания потребительских расходов, который в перспективе ускорения инфляции выглядит всё менее надежным. Таким образом, мы сохраняем свой прогноз роста промышленности в августе и сентябре на уровне 2.0-2.5% в годовом выражении.

**Промпроизводство в РФ (г/г, %)**




*Источник: Росстат*

**Промышленность в РФ (%)**

| | Июль'12 | | Июнь'12 | | 7М2012 | 7М2011 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | к июлю'11 | к июню'12 | к июню'11 | к маю'12 | | |
| Промпроизводство, в т.ч. | 3.4 | 0.9* | 1.9 | 0.0* | 3.2 | 5.3 |
| -Добыча полезных ископаемых | 0.9 | 3.8 | 0.2 | -2.2 | 0.9 | 2.4 |
| -Обрабатывающие производства | 5.7 | 1.2 | 3.4 | 1.0 | 4.9 | 7.6 |
| -Пр-во и распр-е э/энергии, газа и воды | 0.8 | 1.1 | 2.1 | -11.2 | 1.7 | 0.4 |

* С исключением сезонного и календарного факторов

Источник: Росстат

# Внешний рынок долга

*Владимир Евстифеев*
*v.evstifeev@zenit.ru*

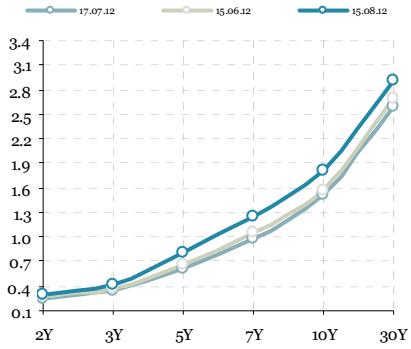
## Статистика из США продолжает радовать инвесторов

Негативное начало дня на глобальных рынках в среду сменилось нулевой динамикой благодаря обнадеживающей статистике из США, которая одновременно указала на расширение возможностей ФРС для внедрения нового раунда политики количественного смягчения и улучшение ситуации в производственном секторе. Так, индекс потребительских цен в США в июле замедлил годовой темп роста до 1.4% с 1.7% в июне. Причиной замедления инфляционных процессов стало резкое замедление роста цен на продовольствие и автомобильное топливо. Впрочем, учитывая рост рыночных цен на торгуемые виды продуктов питания, а также восстановление цен на нефть, инфляция может возобновить рост уже с августа.

Данные по промышленности США за июль также оказались сильными, относительно мировых тенденций. Сектор увеличил объем выпуска в прошлом месяце на 0.5% по сравнению с июнем, что связано как с увеличившимся потреблением на фоне июньского роста доходов населения, так и с главной компонентой этого роста – производством автомобилей. Учитывая волатильную ситуацию на рынках и перенос этой нервозности на на конечных потребителей, ожидать сохранения сильных значений промышленности в августе не стоит.

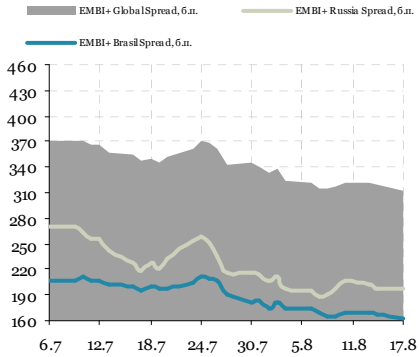
Резюмируя, стоит отметить, что статистика из США все больше склоняет инвесторов к мысли о неизбежности нового раунда политики количественного смягчения со стороны ФРС в среднесрочной перспективе. Экономика Штатов, если отбросить волатильность и временные факторы поддержки, уверенно замедляется с начала текущего года, тогда как у инфляции есть большой запас для роста, прежде, чем она начнет угрожать экономике и конечному потреблению.

### Кривая US Treasures



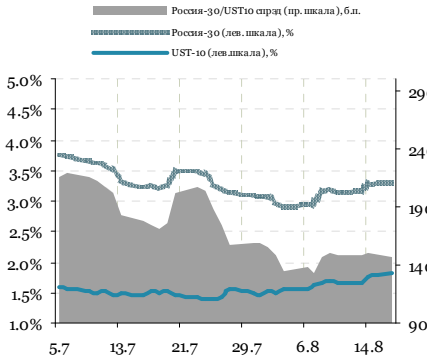

*Источник: Reuters*

### Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



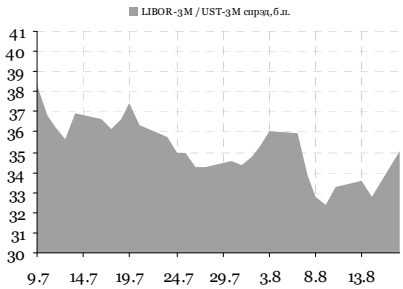

*Источник: Bloomberg*

### Спрэд Россия-30 / UST-10Y




*Источник: Reuters*

### Спрэд LIBOR-3M / UST-3M




*Источник: Reuters*

# Денежно-кредитный рынок

*Владимир Евстифеев*
*v.evstifeev@zenit.ru*

## Старт налогового периода августа прошел без проблем

Начало налогового периода и уплата страховых взносов в фонды, потребовавшая около 230 млрд руб., вчера не смогли оказать давление на конъюнктуру локального денежно кредитного рынка, даже несмотря на сохранение низких лимитов ЦБ РФ по операциям репо. Краткосрочные процентные ставки вчера даже немного снизились (на 10-15 бп): кредиты овернайт и междилерское репо обходились в среднем под 6.0% годовых. На аукционе прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли «стандартные» 10 млрд руб. при спросе 24 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 34.2 млрд руб., составив 889.3 млрд руб.

В перспективе полутора недель налоговый период не должен оказывать давление на ликвидность и ставки. В следующий понедельник завершатся платежи по НДС (около 160 млрд руб.). В то же время, поводов для существенного снижения процентных ставок в ближайшей перспективе также сложно найти.

## Рубль без движений

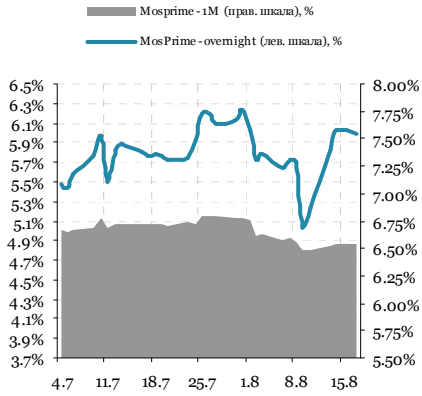
Валютные торги среды прошли также безыдейно, как и в предыдущие дни прошлой недели. Утренний негатив с внешних площадок к закрытию российской сессии растворился, котировки нефти, однако, были чуть ниже своих значений вторника. В итоге курс бывалютной корзины не изменился, оставшись на отметке 35.17 руб. Начало налогового периода в условии ограничения ликвидности со стороны Центробанка обещает оказать рублю более заметную поддержку, нежели в предыдущие несколько месяцев.

## 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 | | | 11 |
| Вторник | Аукцион Казначейства | 3 мес., 50 млрд руб., от 6.7% годовых | 8 |
| Среда | Уплата налогов | Страховые взносы в фонды (~230) млрд руб. | 10 |
| | Аукцион ОФЗ | ОФЗ 26208 (5 лет), 15 млрд руб. | |
| | Выплата купонов ОФЗ | 6.8 млрд руб. | |
| | Возврат Казначейству | 14 млрд руб. | |
| | Возврат Фонду ЖКХ | 1.1 млрд руб. | |
| Четверг | | | |
| Пятница | | | |

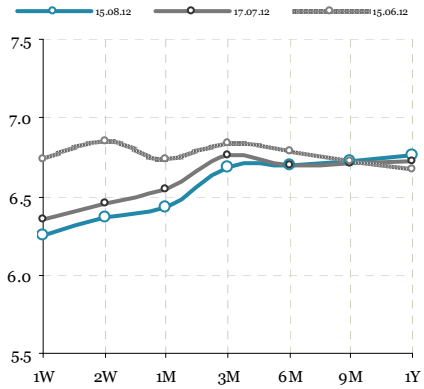
*Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ*

### Ставки МБК




*Источник: Reuters, ЦБ*

### Кривая NDF




*Источник: Reuters*

# Российский долговой рынок

*Кирилл Сычев*
*k.sychev@zenit.ru*

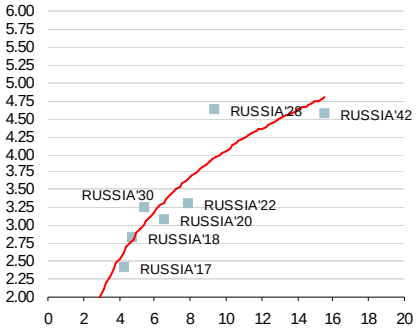
## Евробонды ускорили снижение

Российский сегмент в среду ускорил снижения, игнорируя в целом позитивную статистику из США и последовавшей за ней рост нефтяных цен. Котировки вдоль суверенной кривой опустились в среднем на 50 бп, котировки «тридцатки» и дальнего Россия'42 опустились под отметки 124% и 117%, потеряв в ценах, таким образом, 75 и 100 бп соответственно. Корпоративный сектор также фронтально дешевел, опустившись в ценах в среднем по рынку на 25 бп.

## Локальный рынок «в минусе», Минфин безуспешен на первичке

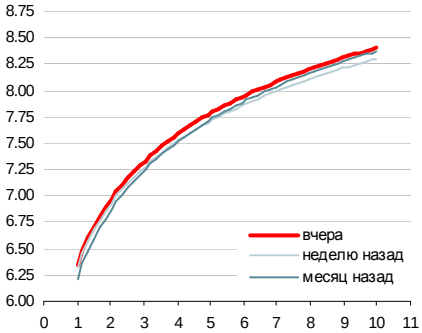
Рублевые облигации остаются не в лучшей форме как с точки зрения цен, так и активности, находясь под давлением обострившейся ситуации на денежном рынке. Вчера цены длинных ОФЗ двинулись вниз и по итогам дня потери составили порядка 20 бп. На этом фоне безуспешно выглядел аукцион Минфина в пятилетнем выпуске 25080, где спросом было покрыто менее половины предложенного 15-млрд. объема. Размещение прошло по верхней границе заявленного диапазона, а на вторичке к концу дня биды в бумаге опустились на 10 бп ниже цены аукциона. Корпоративный сектор заметно сократил активность, а основная часть сделок проходила на ближнем участке кривой, цены двигались разнонаправлено, не выходя за рамки диапазона 10 бп.

### Суверенные еврооблигации



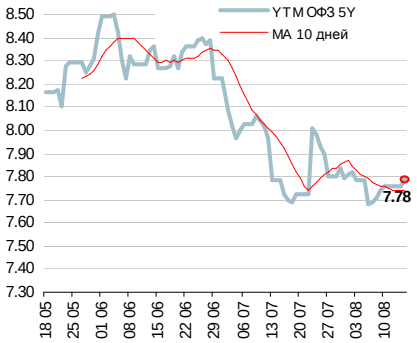

*Источник: Reuters*

### Кривая ОФЗ



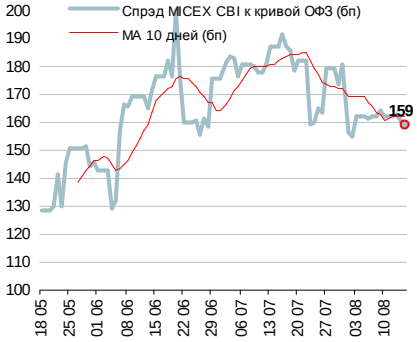

*Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ*

### Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет




*Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ*

### Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



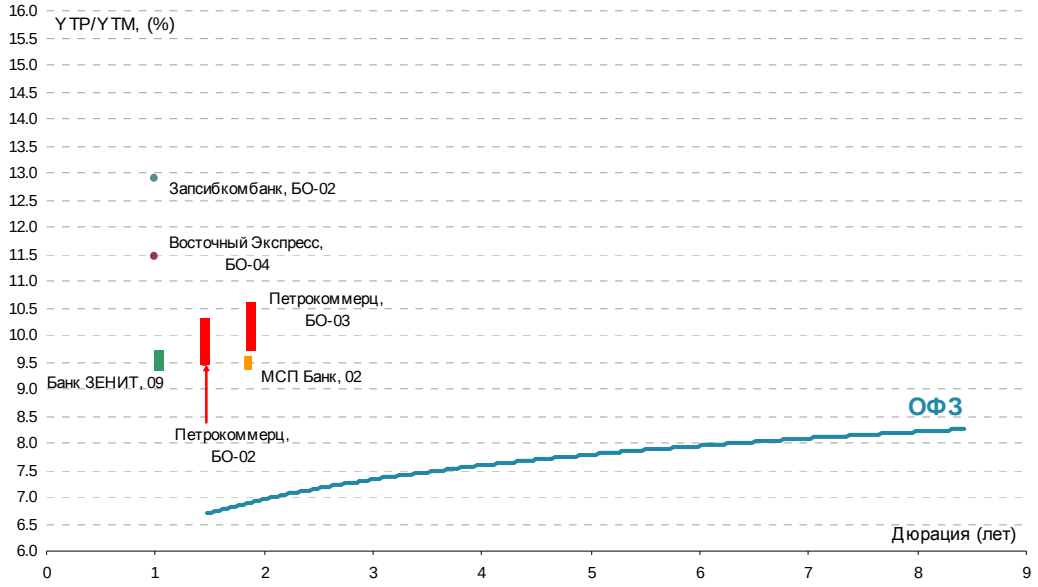

*Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ*

# Первичный рынок

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Ломбард ЦБ | Объем эмиссии, млн. руб. | Ориентир YTP/YTM | Закрытие книги | Дата размещения | Амортизация/ Дюрация | Оферта/ Погашение |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Банк Восточный Экспресс, БО-04 | - / B1 / - | да | 5 000 | 11.46 | 15.08.2012 | 17.08.2012 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| Запсибкомбанк, БО-02 | B+ / - / - | да | 2 000 | 12.89 | 15.08.2012 | 17.08.2012 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| МСП Банк, 02 | BBB / Baa2 / - | да | 5 000 | 9.41-9.52 | 16.08.2012 | 23.08.2012 | нет / 1.86 г. | 2 г. / 10 лет |
| Банк ЗЕНИТ, 09 | - / Ba3 / B+ | да | 5 000 | 9.41-9.62 | 24.08.2012 | 29.08.2012 | нет / 1 г. | 1 г. / 5 лет |
| Петрокоммерц, БО-02 | B+ / Ba3 / - | да | 3 000 | 9.46-10.25 | XX.08.2012 | XX.08.2012 | нет / 1.43 г. | 1.5 г. / 3 г. |
| Петрокоммерц, БО-03 | B+ / Ba3 / - | да | 5 000 | 9.73-10.51 | XX.08.2012 | XX.08.2012 | нет / 1.86 г. | 2 г. / 3 г. |

*Источник: Bloomberg, Cbonds, Finam*

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Ломбард ЦБ | Объем эмиссии, млн. руб. | Bid cover/ Размещ объем | Ориентир YTP/YTM | Фактическая YTP/YTM | Дата размещения | Амортизация/ Дюрация |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Локо-Банк, БО-03 | - / B2 / B+ | да | 3 000 | н/д / 100% | 10.51-11.04 | 11.04 | 14.08.2012 | нет / 1 г. |
| Связной Банк, 01 | - / B3 / - | да | 2 000 | н/д / 100% | 14.22-14.76 | 14.76 | 09.08.2012 | нет / 1 г. |
| Номос-Банк, БО-03 | - / Ba3 / BB | да | 5 000 | 1.5 / 100% | 8.99-9.46 | 9.36 | 09.08.2012 | нет / 1 г. |
| Ренессанс Капитал, БО-2 | B / B2 / B | да | 4 000 | 0.5 / 50% | 12.89-13.42 | 13.32 | 09.08.2012 | нет / 1 г. |
| Промсвязьбанк, 13 | - / Ba2 / BB- | да | 5 000 | н/д / 100% | 12.36-12.89 | 12.63 | 09.08.2012 | нет / 4.15 г. |
| ФСК ЕЭС, 22 | BBB / Baa2 / - | да | 10 000 | н/д / 100% | Купон: 9% | Купон: 9% | 08.08.2012 | нет / н/д |
| ДельтаКредит, БО-03 | - / Baa3 / - | да | 4 000 | н/д / 100% | 9.48-10.00 | 9.48 | 07.08.2012 | нет / 1 г. |
| Трансфин-М, БО-08 | NR | нет | 2 000 | н/д / 100% | 10.78 | 10.78 | 07.08.2012 | нет / 2.64 г. |
| РЖД, 32 | BBB / Baa1 / BBB | да | 10 000 | н/д / 100% | Купон: 8.95 | Купон: 8.95 | 20.07.2012 | нет / н/д |
| ТКС Банк, БО-6 | - / B2 / B | да | 2 000 | 1.7 / 100% | 14.22-14.76 | 14.39 | 17.07.2012 | нет / 1 г. |
| Газпромбанк, 06 | BB+ / Baa3 / - | да | 10 000 | н/д / 100% | 8.94-9.20 | 9.05 | 12.07.2012 | нет / 1.87 г. |
| СКБ-Банк, БО-03 (вторичное) | - / B1 / B | да | 1 500 | 0.7 / 70% | 10.27-10.72 | 10.53 | 11.07.2012 | нет / 0.85 г. |
| Управление отходами - НН, 01 | NR | нет | 1 000 | н/д / 100% | 10.72-11.19 | 10.72 | 27.06.2012 | нет / н/д |
| Русское море, БО-01 | NR | нет | 1 000 | н/д / 100% | 11.83-12.89 | 12.89 | 26.06.2012 | нет / 1 г. |
| 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+ / Ba3 / B+ | да | 5 000 | н/д / 100% | 9.47-10.00 | 9.62 | 03.05.2012 | нет / 1.44 г. |




16.08.2012

# Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ОФЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| ОФЗ 26199 | | 11/07/12 | | | | | | | 5.16 | 0.00 | | | 44 000 |
| ОФЗ 25073 | | 01/08/12 | | | | | | | 6.56 | 0.00 | | | 150 000 |
| ОФЗ 46002 | | 08/08/12 | | | | | | | -5.79 | 0.00 | | | 62 000 |
| ОФЗ 25069 | | 19/09/12 | 100.46 | 100.50 | 100.50 | -0.01 | 30 | 211 633 | 5.46 | 0.10 | | | 45 000 |
| ОФЗ 25067 | | 17/10/12 | 100.94 | 101.00 | 101.00 | -0.06 | 10 | 46 977 | 5.53 | 0.17 | | | 45 000 |
| ОФЗ 26198 | | 02/11/12 | 100.05 | 100.06 | 100.05 | -0.05 | 17 | 78 145 | 5.63 | 0.22 | | | 42 000 |
| ОФЗ 25072 | | 23/01/13 | 100.50 | 100.61 | 100.60 | 0.03 | 8 | 17 211 | 5.82 | 0.44 | | | 150 000 |
| ОФЗ 25078 | | 06/02/13 | 100.38 | 100.40 | 100.38 | -0.08 | 7 | 100 990 | 5.98 | 0.48 | | | 100 000 |
| ОФЗ 25065 | | 27/03/13 | | 104.50 | 103.75 | -0.05 | 2 | 5 551 | 5.85 | 0.59 | | | 46 000 |
| ОФЗ 26200 | | 17/07/13 | 100.06 | 100.25 | 100.15 | 0.10 | 2 | 5 100 | 6.06 | 0.90 | | | 50 000 |
| ОФЗ 26201 | | 16/10/13 | | 101.00 | 101.00 | 0.54 | 6 | 37 002 | 5.78 | 1.13 | | | 47 000 |
| ОФЗ 25076 | | 13/03/14 | 100.82 | 100.86 | 100.85 | | 7 | 106 964 | 6.62 | 1.48 | | | 155 000 |
| ОФЗ 25068 | | 20/08/14 | | 110.35 | 109.00 | -1.15 | 2 | 275 | 7.25 | 1.76 | 40 | 52 | 45 000 |
| ОФЗ 26202 | | 17/12/14 | 103.00 | 109.50 | 109.40 | -0.20 | 2 | 25 001 | 6.99 | 2.07 | | 27 | 40 000 |
| ОФЗ 25071 | | 26/11/14 | 102.40 | 103.49 | | | | | 6.72 | 2.10 | | | 80 000 |
| ОФЗ 25079 | | 03/06/15 | 99.65 | 99.75 | 99.65 | | 6 | 22 423 | 7.26 | 2.56 | 8 | 53 | 150 000 |
| ОФЗ 25075 | | 15/07/15 | 99.15 | 99.35 | 99.20 | -0.05 | 2 | 1 001 | 7.32 | 2.68 | 10 | 59 | 150 000 |
| ОФЗ 25077 | | 20/01/16 | 90.20 | 100.33 | 100.20 | -0.24 | 4 | 70 276 | 7.41 | 3.08 | 6 | 66 | 150 000 |
| ОФЗ 46017 | | 03/08/16 | 95.00 | 96.70 | | | | | 7.64 | 3.12 | 28 | 89 | 80 000 |
| ОФЗ 26203 | | 03/08/16 | 98.20 | 99.10 | 98.35 | -0.06 | 1 | 1 136 | 7.52 | 3.53 | 5 | 74 | 150 000 |
| ОФЗ 48001 | | 31/10/18 | | 98.20 | | | | | 8.85 | 3.54 | 138 | 207 | 24 000 |
| ОФЗ 46019 | | 20/03/19 | | | | | | | 4.85 | 3.99 | | | 26 000 |
| ОФЗ 25080 | | 19/04/17 | 99.57 | 99.67 | 99.67 | -0.13 | 13 | 188 350 | 7.62 | 3.95 | 5 | 80 | 150 000 |
| ОФЗ 26206 | | 14/06/17 | 99.50 | 99.80 | 99.60 | -0.10 | 9 | 53 047 | 7.64 | 4.10 | 3 | 81 | 150 000 |
| ОФЗ 26204 | | 15/03/18 | 99.60 | 99.80 | 99.70 | | 11 | 111 004 | 7.71 | 4.53 | 2 | 83 | 150 000 |
| ОФЗ 46021 | | 08/08/18 | 89.25 | 89.35 | | | | | 7.91 | 4.59 | 20 | 103 | 107 000 |
| ОФЗ 46014 | | 29/08/18 | 96.05 | 96.60 | | | | | 8.03 | 4.69 | 30 | 113 | 62 000 |
| ОФЗ 26208 | | 27/02/19 | 99.00 | 99.40 | 99.30 | -0.20 | 11 | 60 289 | 7.78 | 5.11 | | 84 | 150 000 |
| ОФЗ 46005 | | 09/01/19 | | | | | | | 8.44 | 5.84 | 52 | 140 | 27 000 |
| ОФЗ 46018 | | 24/11/21 | 93.20 | 93.58 | 93.20 | 0.20 | 1 | 20 122 | 8.07 | 6.24 | 9 | 98 | 133 000 |
| ОФЗ 26205 | | 14/04/21 | 99.25 | 99.45 | 99.21 | -0.34 | 17 | 33 239 | 7.87 | 6.35 | | 76 | 150 000 |
| ОФЗ 26209 | | 20/07/22 | 98.65 | 101.35 | | | | | 7.91 | 7.12 | | 71 | 150 000 |
| ОФЗ 46022 | | 19/07/23 | | | | | | | 7.53 | 7.64 | | 26 | 45 000 |
| ОФЗ 26207 | | 03/02/27 | 99.91 | 100.01 | 100.10 | -0.10 | 25 | 303 907 | 8.30 | 8.42 | 5 | 94 | 150 000 |
| ОФЗ 46012 | | 05/09/29 | | | | | | | 6.28 | 11.16 | | | 40 000 |
| ОФЗ 46020 | | 06/02/36 | 80.00 | 87.00 | 86.02 | -1.10 | 5 | 44 000 | 8.45 | 10.98 | | 81 | 135 000 |
| **МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| **НорНикель** | | | | | | | | | | | | | |
| НорНикель ВО3 | | 30/07/13 | 98.70 | 99.80 | 99.80 | | 4 | 1 600 | 7.34 | 0.94 | 106 | 60 | 15 000 |
| **НЛМК** | | | | | | | | | | | | | |
| НЛМК ВО5 | | 30/10/12 | 100.64 | 100.79 | 100.78 | -0.02 | 10 | 13 670 | 6.92 | 0.21 | | 31 | 10 000 |
| НЛМК ВО1 | | 04/12/12 | | 101.30 | 101.10 | 0.25 | 1 | 73 | 6.08 | 0.30 | | | 5 000 |
| НЛМК ВО6 | | 05/03/13 | 100.10 | 100.25 | | | | | 7.69 | 0.53 | 192 | 100 | 10 000 |
| НЛМК ВО2 | 19/06/13 | 17/12/14 | 100.65 | 101.17 | | | | | 8.08 | 0.82 | 192 | 135 | 5 000 |
| НЛМК ВО3 | 19/06/13 | 17/12/14 | 100.80 | 101.20 | | | | | 7.50 | 0.82 | 134 | 77 | 5 000 |
| НЛМК ВО7 | | 11/11/14 | 92.05 | 101.60 | 101.23 | -0.37 | 1 | 1 | 8.50 | 2.04 | 152 | 178 | 10 000 |
| **ММК** | | | | | | | | | | | | | |
| ММК ВО2 | 14/12/11 | 12/12/12 | | | | | | | -0.01 | 1.00 | | | 10 000 |
| ММК ВО1 | | 15/11/12 | | 99.97 | | | | | 7.80 | 0.25 | | 111 | 5 000 |
| ММК ВО5 | | 04/04/13 | 100.10 | 100.20 | 100.20 | 0.10 | 2 | 1 000 | 7.43 | 0.62 | 153 | 73 | 8 000 |
| ММК ВО8 | 15/08/13 | 12/02/15 | | | | | | | 8.16 | 0.95 | 187 | 142 | 5 000 |
| ММК ВО4 | | 27/02/14 | 99.00 | 99.35 | | | | | 8.53 | 1.43 | 187 | 179 | 5 000 |
| ММК ВО6 | | 10/06/14 | 97.25 | | | | | | 9.08 | 1.80 | 221 | 235 | 5 000 |
| ММК ВО7 | | 22/07/14 | 97.40 | 97.91 | 97.41 | -0.19 | 3 | 12 001 | 8.92 | 1.83 | 204 | 219 | 5 000 |
| **Севсталь** | | | | | | | | | | | | | |
| Севсталь ВО1 | 20/09/11 | 18/09/12 | 100.02 | 100.03 | 100.03 | | 13 | 79 597 | 7.19 | 0.09 | | 81 | 15 000 |
| Севсталь ВО2 | | 15/02/13 | | | | | | | 7.63 | 0.48 | | 95 | 10 000 |
| Севсталь ВО4 | | 15/02/13 | | | | | | | 7.63 | 0.48 | | 95 | 5 000 |
| **Алроса** | | | | | | | | | | | | | |
| Алроса 21 | 25/06/13 | 18/06/15 | 100.40 | 100.56 | | | | | 7.99 | 0.83 | 182 | 126 | 8 000 |
| Алроса 22 | 28/06/13 | 23/06/15 | 100.40 | 100.45 | 100.35 | -0.05 | 2 | 1 000 | 8.06 | 0.84 | 188 | 133 | 8 000 |
| Алроса 23 | | 18/06/15 | 101.22 | 101.39 | 101.22 | -0.04 | 3 | 29 999 | 8.73 | 2.51 | 157 | 200 | 7 000 |
| Алроса 20 | | 23/06/15 | 101.18 | 101.48 | 101.18 | -0.17 | 2 | 10 021 | 8.75 | 2.52 | 158 | 202 | 3 000 |
| **Евраз** | | | | | | | | | | | | | |
| Евраз 1 | 22/03/13 | 13/03/20 | 100.54 | 100.65 | 100.65 | 0.20 | 9 | 1 025 | 8.26 | 0.58 | 241 | 157 | 10 000 |
| Евраз 3 | 22/03/13 | 13/03/20 | 100.55 | 100.60 | 100.60 | 0.05 | 3 | 15 372 | 8.34 | 0.58 | 249 | 165 | 5 000 |
| Сибметинвест 1 | 16/10/14 | 10/10/19 | 107.20 | 107.55 | 107.46 | 0.01 | 4 | 1 239 | 9.82 | 1.89 | 291 | 310 | 10 000 |
| Сибметинвест 2 | 16/10/14 | 10/10/19 | 107.11 | 107.73 | | | | | 9.80 | 1.89 | 289 | 308 | 10 000 |
| Евраз 2 | 26/10/15 | 19/10/20 | 99.31 | 99.99 | 99.50 | | 3 | 4 170 | 10.38 | 2.74 | 314 | 365 | 10 000 |
| Евраз 4 | 26/10/15 | 19/10/20 | 89.25 | 100.25 | | | | | 10.28 | 2.74 | 304 | 355 | 5 000 |
| Евраз 5 | 06/06/16 | 27/05/21 | 89.00 | 93.99 | | | | | 10.39 | 3.27 | 299 | 363 | 5 000 |
| Евраз 7 | 02/06/16 | 25/05/21 | 94.02 | 96.00 | | | | | 10.61 | 3.27 | 321 | 385 | 15 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Металлоинвест** | | | | | | | | | | | | | |
| Металлоинвест 1 | 16/03/15 | 07/03/22 | 99.10 | 99.70 | 99.71 | 0.71 | 4 | 110 | 9.33 | 2.28 | 225 | 260 | 5 000 |
| Металлоинвест 5 | 16/03/15 | 07/03/22 | 99.10 | 99.40 | 99.40 | -0.08 | 3 | 1 586 | 9.48 | 2.28 | 240 | 275 | 10 000 |
| Металлоинвест 6 | 19/03/15 | 10/03/22 | 99.41 | 99.57 | 99.50 | | 4 | 50 000 | 9.43 | 2.29 | 235 | 270 | 10 000 |
| **Мечел** | | | | | | | | | | | | | |
| Мечел 4 | 25/07/13 | 21/07/16 | 99.51 | 100.28 | | | | | 11.36 | 0.90 | 512 | 462 | 5 000 |
| Мечел 5 | 16/10/12 | 09/10/18 | 100.35 | 100.70 | 100.60 | -0.19 | 2 | 300 | 9.16 | 0.17 | | 263 | 5 000 |
| Мечел ВО1 | 11/11/11 | 09/11/12 | 99.80 | 99.90 | | | | | 8.18 | 0.24 | | 152 | 5 000 |
| Мечел ВО2 | | 12/03/13 | 99.46 | 100.00 | 99.50 | -0.01 | 8 | 492 | 10.93 | 0.55 | 513 | 424 | 5 000 |
| Мечел ВО3 | | 24/04/13 | 98.60 | 99.15 | 98.69 | 0.14 | 5 | 9 900 | 12.08 | 0.67 | 611 | 537 | 5 000 |
| Мечел 2 | 15/06/11 | 12/06/13 | 96.01 | 96.99 | 96.01 | 0.01 | 6 | 101 | 13.01 | 0.81 | 687 | 628 | 5 000 |
| Мечел 15 | 18/02/14 | 09/02/21 | | | | | | | 12.35 | 1.39 | 571 | 561 | 5 000 |
| Мечел 16 | 18/02/14 | 09/02/21 | | | | | | | 12.39 | 1.39 | 575 | 565 | 5 000 |
| Мечел ВО4 | 11/02/14 | 10/02/15 | 93.85 | 96.96 | 96.96 | -0.14 | 4 | 104 | 12.94 | 1.42 | 629 | 620 | 5 000 |
| Мечел ВО5 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 438 | 482 | 5 000 |
| Мечел ВО6 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | | | | | 2 000 |
| Мечел ВО7 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 438 | 482 | 2 000 |
| Мечел ВО11 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 438 | 482 | 3 000 |
| Мечел ВО12 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 2.52 | 438 | 482 | 3 000 |
| Мечел 13 | 01/09/15 | 25/08/20 | 90.00 | 93.00 | | | | | 13.26 | 2.57 | 607 | 653 | 5 000 |
| Мечел 14 | 01/09/15 | 25/08/20 | 91.02 | 92.60 | 92.60 | 0.10 | 2 | 10 | 13.44 | 2.57 | 625 | 671 | 5 000 |
| Мечел 17 | 02/06/16 | 27/05/21 | 85.03 | 85.85 | 85.85 | -0.15 | 5 | 25 | 13.69 | 3.23 | 630 | 693 | 5 000 |
| Мечел 18 | 02/06/16 | 27/05/21 | 85.02 | 88.00 | | | | | 14.34 | 3.24 | 695 | 758 | 5 000 |
| Мечел 19 | 07/06/16 | 01/06/21 | 84.08 | 94.00 | | | | | 7.93 | 3.27 | 53 | 117 | 5 000 |
| **ТМК** | | | | | | | | | | | | | |
| ТМК ВО1 | | 22/10/13 | 99.00 | 99.80 | 99.80 | 0.15 | 1 | 5 000 | 9.21 | 1.12 | 277 | 246 | 5 000 |
| **СУЭК** | | | | | | | | | | | | | |
| СУЭК 1 | 05/07/13 | 26/06/20 | 100.73 | 100.85 | 100.73 | -0.13 | 8 | 20 152 | 8.64 | 0.87 | 243 | 191 | 10 000 |
| **РМК** | | | | | | | | | | | | | |
| РМК 3 | 17/12/13 | 15/12/15 | 98.03 | 99.00 | | | | | 11.95 | 1.27 | 540 | 521 | 3 000 |
| РМК 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 94.00 | 95.99 | | | | | 11.83 | 1.68 | 503 | 510 | 5 000 |
| **ЧТПЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| ЧТПЗ ВО1 | 05/06/12 | 04/12/12 | 100.50 | 100.98 | | | | | 12.69 | 0.30 | | 600 | 5 000 |
| **КОКС** | | | | | | | | | | | | | |
| КОКС ВО2 | | 28/05/14 | 95.75 | 98.48 | 95.97 | 0.37 | 4 | 90 | 11.55 | 1.66 | 476 | 482 | 5 000 |
| **Русал** | | | | | | | | | | | | | |
| Русал 7 | 03/03/14 | 22/02/18 | 92.42 | 92.50 | 92.50 | -0.20 | 11 | 685 | 14.32 | 1.42 | 766 | 758 | 15 000 |
| Русал 8 | 15/04/15 | 05/04/21 | 87.80 | 88.49 | 87.74 | -0.65 | 13 | 558 | 14.67 | 2.35 | 756 | 794 | 15 000 |
| **ИНФРАСТРУКТУРА** | | | | | | | | | | | | | |
| **РЖД** | | | | | | | | | | | | | |
| РЖД 7 | | 07/11/12 | 100.21 | 100.51 | | | | | 6.25 | 0.23 | | | 5 000 |
| РЖД ВО1 | | 05/12/12 | 100.89 | 100.90 | 100.89 | 0.09 | 1 | 1 500 | 6.47 | 0.31 | | | 15 000 |
| РЖД 9 | 18/05/11 | 13/11/13 | 99.20 | 99.45 | | | | | 7.67 | 1.20 | 117 | 93 | 15 000 |
| РЖД 10 | | 06/03/14 | 110.90 | 111.15 | 111.14 | 0.14 | 1 | 50 000 | 7.42 | 1.37 | 80 | 68 | 15 000 |
| РЖД 23 | 29/01/15 | 16/01/25 | 102.51 | 102.72 | | | | | 8.01 | 2.25 | 94 | 128 | 15 000 |
| РЖД 11 | | 18/11/15 | 98.90 | 99.19 | 99.00 | -0.04 | 1 | 10 000 | 8.31 | 2.89 | 102 | 157 | 15 000 |
| РЖД 16 | 06/06/16 | 05/06/17 | 98.63 | 98.80 | 98.65 | -0.15 | 4 | 28 000 | 8.49 | 3.32 | 107 | 172 | 15 000 |
| РЖД 19 | 16/07/18 | 08/07/24 | 99.92 | 100.22 | | | | | 8.31 | 4.79 | 56 | 140 | 10 000 |
| **ФСК ЕЭС** | | | | | | | | | | | | | |
| ФСК ЕЭС 6 | 26/09/13 | 15/09/20 | 99.50 | 99.95 | 99.77 | -0.05 | 2 | 10 001 | 7.49 | 1.06 | 110 | 74 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 8 | 26/09/13 | 15/09/20 | 99.50 | 100.00 | | | | | 7.61 | 1.06 | 122 | 86 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 18 | 09/06/14 | 27/11/23 | 101.15 | 101.25 | 101.25 | 0.03 | 7 | 15 500 | 7.89 | 1.70 | 108 | 116 | 15 000 |
| ФСК ЕЭС 15 | 23/10/14 | 12/10/23 | 101.75 | 102.15 | 101.75 | -0.05 | 3 | 13 656 | 8.01 | 1.99 | 105 | 129 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 10 | 24/09/15 | 15/09/20 | 98.30 | 99.00 | | | | | 8.28 | 2.74 | 104 | 155 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 7 | 27/10/15 | 16/10/20 | 98.05 | 98.15 | 98.00 | -0.10 | 1 | 5 000 | 8.39 | 2.84 | 111 | 165 | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 12 | 22/04/16 | 19/04/19 | 98.00 | 99.25 | 99.15 | -0.15 | 1 | 1 000 | 8.54 | 3.18 | 116 | 179 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 9 | 24/10/17 | 16/10/20 | 96.75 | 97.45 | | | | | 8.91 | 4.23 | 128 | 206 | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 11 | 24/10/17 | 16/10/20 | 96.75 | 97.25 | | | | | 8.97 | 4.23 | 134 | 212 | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 19 | 18/07/18 | 06/07/23 | | 95.70 | 95.70 | -0.35 | 1 | 1 | 9.10 | 4.78 | 136 | 219 | 20 000 |
| ФСК ЕЭС 13 | | 22/06/21 | 95.55 | 96.24 | 95.95 | 0.40 | 2 | 1 024 | 9.39 | 6.28 | 140 | 229 | 10 000 |
| **НМТП** | | | | | | | | | | | | | |
| НМТП БО-2 | | 29/04/15 | 99.00 | 99.20 | 99.20 | -0.30 | 2 | 40 | 9.55 | 2.40 | 243 | 282 | 4 000 |
| **Росавтодор** | | | | | | | | | | | | | |
| Росавтодор 1 | | 29/11/16 | | | | | | | 9.82 | 3.80 | 228 | 302 | 3 000 |
| **Росводоканал** | | | | | | | | | | | | | |
| Росводоканал 3 | 11/11/13 | 09/11/15 | 98.00 | 99.20 | 99.16 | 0.10 | 10 | 7 692 | 9.95 | 1.18 | 346 | 321 | 3 000 |
| **Водоканал** | | | | | | | | | | | | | |
| Водоканал 1 | | 09/12/15 | | 99.45 | | | | | 8.99 | 2.92 | 169 | 225 | 2 000 |
| **Западный СД** | | | | | | | | | | | | | |
| Западный СД 1 | 29/04/16 | 13/05/31 | 98.50 | 99.30 | | | | | 9.28 | 3.19 | 190 | 252 | 5 000 |
| Западный СД 2 | 29/04/16 | 13/05/31 | 98.50 | 99.30 | | | | | 9.28 | 3.19 | 190 | 252 | 5 000 |
| Западный СД 3 | 24/02/17 | 06/02/32 | 85.00 | | | | | | 9.41 | 3.66 | 191 | 262 | 5 000 |
| Западный СД 4 | 24/02/17 | 06/02/32 | | 99.25 | | | | | 9.41 | 3.66 | 191 | 262 | 5 000 |
| Западный СД 5 | 24/02/17 | 06/02/32 | | 100.00 | | | | | 9.41 | 3.65 | 191 | 262 | 5 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Почта России** | | | | | | | | | | | | | |
| Почта России 1 | 25/03/14 | 22/03/16 | 98.50 | 99.00 | 98.75 | 0.20 | 2 | 2 | 9.30 | 1.49 | 260 | 256 | 7 000 |
| **НЕФТЬ и ГАЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| **ГАЗПРОМ** | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром Капитал-3 | 08/11/12 | 06/11/14 | 100.05 | 100.15 | 100.05 | -0.07 | 2 | 2 175 | 7.34 | 0.23 | | 68 | 15 000 |
| Газпром А9 | | 12/02/14 | 98.00 | 100.00 | | | | | 7.55 | 1.44 | 88 | 81 | 5 000 |
| Газпром А11 | | 24/06/14 | 110.90 | 111.29 | | | | | 7.49 | 1.68 | 68 | 76 | 5 000 |
| **Лукойл** | | | | | | | | | | | | | |
| Лукойл БО-6 | | 13/12/12 | | 100.90 | 100.90 | | 2 | 16 015 | 6.44 | 0.33 | | | 5 000 |
| Лукойл БО-7 | | 13/12/12 | 100.60 | 100.90 | 100.90 | -0.02 | 2 | 2 | 6.44 | 0.33 | | | 5 000 |
| Лукойл 4 | | 05/12/13 | | 100.50 | | | | | 7.25 | 1.25 | 71 | 51 | 6 000 |
| **Газпром нефть** | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром нефть 3 | 15/01/13 | 12/07/16 | 97.10 | 97.98 | | | | | 8.61 | 0.42 | | 193 | 8 000 |
| Газпром нефть БО-5 | | 09/04/13 | 99.85 | 100.00 | | | | | 7.50 | 0.63 | 157 | 80 | 10 000 |
| Газпром нефть БО-6 | | 09/04/13 | 99.85 | 100.00 | 99.85 | -0.05 | 1 | 701 | 7.50 | 0.63 | 157 | 80 | 10 000 |
| Газпром нефть 11 | 03/02/15 | 25/01/22 | 100.45 | 100.75 | 100.75 | -0.03 | 5 | 82 865 | 8.07 | 2.28 | 99 | 134 | 10 000 |
| Газпром нефть 8 | | 02/02/16 | 99.00 | | | | | | 8.54 | 3.07 | 119 | 179 | 10 000 |
| Газпром нефть 9 | 08/02/16 | 26/01/21 | 100.00 | 100.60 | 100.00 | -0.30 | 1 | 1 | 8.68 | 3.08 | 133 | 193 | 10 000 |
| Газпром нефть 10 | 05/02/18 | 26/01/21 | | | 99.90 | -0.10 | 1 | 15 000 | 9.12 | 4.44 | 144 | 225 | 10 000 |
| Газпром нефть 4 | 10/04/18 | 09/04/14 | 96.51 | 98.35 | | | | | 8.96 | 4.50 | 127 | 209 | 10 000 |
| **НОВАТЭК** | | | | | | | | | | | | | |
| НОВАТЭК БО-1 | | 25/06/13 | 99.80 | 100.25 | 100.25 | -0.05 | 1 | 1 000 | 7.31 | 0.84 | 113 | 58 | 10 000 |
| **ТАТНЕФТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Татнефть БО-1 | | 20/09/13 | 99.00 | | 99.43 | | 2 | 178 | 7.94 | 1.05 | 156 | 119 | 5 000 |
| **Башнефть** | | | | | | | | | | | | | |
| Башнефть 1 | 18/12/12 | 13/12/16 | 101.50 | 101.77 | 101.73 | -0.02 | 4 | 530 | 7.36 | 0.34 | | 67 | 15 000 |
| Башнефть 2 | 18/12/12 | 13/12/16 | 101.69 | 101.85 | 101.81 | -0.04 | 3 | 114 | 7.11 | 0.34 | | 42 | 15 000 |
| Башнефть 3 | 18/12/12 | 13/12/16 | 101.51 | 101.85 | | | | | 7.17 | 0.34 | | 48 | 20 000 |
| Башнефть БО1 | 05/12/13 | 02/12/14 | 101.55 | 101.75 | 101.60 | -0.08 | 5 | 31 270 | 8.18 | 1.24 | 165 | 144 | 10 000 |
| Башнефть 4 | 13/02/15 | 04/02/22 | | | | | | | 8.68 | 2.20 | 163 | 196 | 10 000 |
| **НК Альянс** | | | | | | | | | | | | | |
| НК Альянс 3 | 30/07/13 | 21/07/20 | 98.00 | 98.99 | | | | | 13.60 | 0.93 | 733 | 686 | 5 000 |
| НК Альянс БО-1 | | 04/02/14 | 96.74 | 99.75 | 97.29 | -0.06 | 8 | 360 | 11.61 | 1.41 | 496 | 487 | 5 000 |
| НК Альянс 4 | 07/06/16 | 01/06/21 | 90.01 | 98.00 | | | | | 12.19 | 3.24 | 480 | 543 | 5 000 |
| НК Альянс 6 | 10/06/16 | 04/06/21 | 91.01 | 94.99 | 91.00 | -2.00 | 2 | 149 | 12.19 | 3.25 | 479 | 543 | 7 000 |
| **Сахатранснефтегаз** | | | | | | | | | | | | | |
| Сахатрнфг2 | | 26/07/13 | 98.81 | 99.80 | | | | | 13.17 | 0.92 | 691 | 643 | 3 000 |
| **БК Евразия** | | | | | | | | | | | | | |
| БК Евразия 1 | 22/06/16 | 20/06/18 | 83.00 | 96.89 | | | | | 9.59 | 3.33 | 217 | 282 | 5 000 |
| **ГОСБАНКИ** | | | | | | | | | | | | | |
| **ВТБ** | | | | | | | | | | | | | |
| ВТБ 6 | 10/07/13 | 06/07/16 | 100.68 | 100.70 | 100.70 | 0.01 | 10 | 3 189 | 7.96 | 0.87 | 175 | 123 | 15 000 |
| ВТБ БО-6 | 21/12/12 | 19/12/14 | 100.38 | 100.53 | 100.47 | 0.05 | 1 | 34 300 | 7.31 | 0.35 | | 62 | 10 000 |
| ВТБ БО-7 | 25/01/13 | 23/01/15 | 100.11 | 100.34 | | | | | 7.60 | 0.44 | | 92 | 10 000 |
| ВТБ БО-1 | | 15/03/13 | 99.90 | 100.09 | 100.00 | | 2 | 5 800 | 7.81 | 0.57 | 198 | 112 | 5 000 |
| ВТБ БО-2 | | 15/03/13 | 99.60 | 100.45 | | | | | 7.68 | 0.57 | 185 | 99 | 5 000 |
| ВТБ БО-5 | | 15/03/13 | 99.85 | 100.10 | | | | | 7.72 | 0.57 | 189 | 103 | 10 000 |
| ВТБ 5 | | 17/10/13 | 99.45 | 99.60 | 99.05 | -0.15 | 1 | 1 | 8.51 | 1.13 | 206 | 176 | 15 000 |
| ВТБ БО-03 | 18/03/14 | 17/03/15 | 99.05 | 100.10 | | | | | 8.24 | 1.49 | 154 | 150 | 5 000 |
| ВТБ БО-04 | 18/03/14 | 17/03/15 | 99.80 | 100.05 | | | | | 8.24 | 1.49 | 154 | 150 | 5 000 |
| ВТБ 24 3 | 30/05/12 | 29/05/13 | | | | | | | 8.14 | 0.86 | 194 | 141 | 6 000 |
| ВТБ 24 1-ИП | 14/12/11 | 10/12/14 | 99.20 | 101.00 | | | | | 8.93 | 2.14 | 191 | 221 | 15 000 |
| ВТБ 24 5 | 23/08/12 | 20/02/14 | | | | | | | 4.60 | 0.02 | | | 8 000 |
| ВТБ-Лизинг 3 | 10/09/13 | 07/06/16 | 98.60 | 99.50 | | | | | 8.49 | 0.91 | 224 | 175 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 4 | 12/03/13 | 07/06/16 | 99.16 | 99.44 | 99.44 | 0.24 | 1 | 2 440 | 7.93 | 0.53 | 216 | 124 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 2 | 08/01/13 | 07/07/15 | 99.35 | 99.85 | | | | | 8.22 | 0.40 | | 154 | 10 000 |
| ВТБ-Лизинг 9 | 05/02/14 | 02/08/17 | 98.15 | 99.50 | | | | | 8.72 | 1.27 | 217 | 198 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 7 | 04/06/14 | 30/11/16 | 99.50 | 100.50 | | | | | 8.87 | 1.37 | 225 | 213 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 8 | 07/05/13 | 01/08/17 | 100.12 | 100.23 | 100.10 | -0.10 | 2 | 2 | 8.35 | 0.69 | 235 | 164 | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 1 | 07/11/13 | 06/11/14 | 99.55 | 100.15 | | | | | 8.35 | 0.90 | 211 | 161 | 8 000 |
| **ВЭБ** | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ 8 | 22/10/13 | 13/10/20 | 98.10 | 99.55 | | | | | 7.38 | 1.14 | 93 | 63 | 15 000 |
| ВЭБ 21 | 10/03/15 | 17/02/32 | 99.75 | 100.10 | | | | | 8.80 | 2.28 | 172 | 207 | 15 000 |
| ВЭБ 9 | 24/03/16 | 18/03/21 | 97.50 | 98.00 | | | | | 8.87 | 3.11 | 151 | 212 | 15 000 |
| ВЭБ 10 | 27/09/16 | 21/09/21 | 86.00 | | | | | | 8.68 | 3.45 | 123 | 190 | 15 000 |
| ВЭБ 6 | 17/10/17 | 13/10/20 | 95.00 | 95.60 | | | | | 9.34 | 4.22 | 171 | 250 | 10 000 |
| **ВЭБ-Лизинг** | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ-Лизинг 3 | 11/04/14 | 02/04/21 | 96.01 | 99.50 | 98.90 | 0.40 | 5 | 46 141 | 8.38 | 1.55 | 165 | 165 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 8 | 28/10/14 | 19/10/21 | 100.01 | 100.52 | 100.52 | 0.02 | 5 | 4 136 | 8.71 | 2.00 | 175 | 199 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 9 | 29/10/14 | 20/10/21 | 100.25 | 100.70 | | | | | 8.80 | 2.01 | 184 | 208 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 6 | | 31/01/17 | 100.25 | 100.65 | | | | | 9.05 | 2.20 | 200 | 233 | 10 000 |
| ВЭБ-Лизинг 4 | 08/04/16 | 02/04/21 | | 101.50 | | | | | 9.12 | 3.12 | 176 | 237 | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 5 | 08/04/16 | 02/04/21 | | 100.00 | | | | | 9.08 | 3.12 | 172 | 233 | 5 000 |
| **МСП Банк** | | | | | | | | | | | | | |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| МСП Банк 01 | 27/03/14 | 17/03/22 | | 100.00 | | | | | 9.23 | 1.50 | 253 | 249 | 5 000 |
| **РСХБ** | | | | | | | | | | | | | |
| РСХБ БО-1 | 29/08/12 | 28/08/13 | 100.15 | 101.12 | 100.14 | 0.09 | 4 | 2 903 | 3.48 | 0.04 | | | 5 000 |
| РСХБ БО-5 | 29/08/12 | 28/08/13 | 100.15 | 100.30 | 100.12 | 0.07 | 3 | 64 201 | 4.01 | 0.04 | | | 10 000 |
| РСХБ 8 | 22/11/12 | 14/11/19 | 100.83 | 101.50 | 100.85 | 0.02 | 7 | 56 015 | 6.92 | 0.27 | | 23 | 5 000 |
| РСХБ 9 | 22/11/12 | 14/11/19 | 100.65 | 101.47 | 100.95 | 0.12 | 8 | 55 001 | 6.54 | 0.27 | | | 5 000 |
| РСХБ 10 | 06/02/13 | 29/01/20 | 100.40 | 101.90 | | | | | 7.40 | 0.48 | | 72 | 5 000 |
| РСХБ 11 | 07/02/13 | 29/01/20 | 100.40 | 101.00 | 100.50 | -0.50 | 1 | 5 | 8.07 | 0.48 | | 139 | 5 000 |
| РСХБ 7 | 11/06/13 | 05/06/18 | 99.15 | 99.48 | | | | | 7.88 | 0.81 | 174 | 115 | 5 000 |
| РСХБ БО-2 | 06/08/13 | 03/02/15 | | 101.15 | | | | | 8.08 | 0.96 | 178 | 133 | 5 000 |
| РСХБ БО-3 | 08/08/13 | 05/02/15 | 100.05 | 100.22 | | | | | 8.09 | 0.96 | 178 | 134 | 5 000 |
| РСХБ БО-6 | 01/05/12 | 29/10/13 | 100.15 | 100.35 | | | | | 8.17 | 1.15 | 171 | 142 | 10 000 |
| РСХБ 15 | 05/11/13 | 26/10/21 | 100.50 | 100.89 | | | | | 8.15 | 1.17 | 167 | 141 | 10 000 |
| РСХБ 4 | 02/10/13 | 27/09/17 | 86.00 | 100.00 | | | | | 7.63 | 1.08 | 122 | 88 | 10 000 |
| РСХБ 3 | 13/02/14 | 09/02/17 | | | | | | | 8.22 | 1.37 | 160 | 148 | 10 000 |
| РСХБ 6 | 15/08/14 | 09/02/18 | | | | | | | 7.67 | 1.82 | 80 | 94 | 5 000 |
| РСХБ 16 | 13/04/15 | 04/04/22 | 99.75 | 99.99 | | | | | 8.78 | 2.37 | 167 | 205 | 10 000 |
| РСХБ 14 | 07/07/15 | 29/06/21 | 96.99 | 97.95 | | | | | 8.69 | 2.63 | 148 | 196 | 10 000 |
| РСХБ 12 | 09/07/15 | 01/07/21 | | 98.00 | | | | | 8.81 | 2.63 | 160 | 208 | 5 000 |
| РСХБ 13 | 10/07/15 | 02/07/21 | 85.00 | | | | | | 8.79 | 2.64 | 158 | 206 | 5 000 |
| **Газпромбанк** | | | | | | | | | | | | | |
| Газпромбанк 4 | | 15/11/12 | | | | | | | 7.54 | 0.25 | | 85 | 20 000 |
| Газпромбанк 5 | | 22/11/12 | | | | | | | 7.50 | 0.27 | | 81 | 20 000 |
| Газпромбанк БО-4 | 24/12/12 | 20/12/14 | 99.95 | 100.40 | | | | | 4.58 | 0.36 | | | 10 000 |
| Газпромбанк БО-2 | 22/07/13 | 11/07/14 | 99.00 | | | | | | 7.99 | 0.92 | 173 | 125 | 10 000 |
| Газпромбанк БО-1 | | 08/12/13 | 99.50 | 99.95 | | | | | 8.01 | 1.26 | 146 | 127 | 10 000 |
| Газпромбанк БО-3 | 05/02/14 | 01/02/15 | 100.55 | 100.60 | 100.60 | | 5 | 35 | 8.22 | 1.41 | 157 | 148 | 10 000 |
| **АИЖК** | | | | | | | | | | | | | |
| АИЖК А5 | | 15/10/12 | 99.90 | 100.20 | | | | | 7.66 | 0.17 | | 113 | 2 000 |
| АИЖК А6 | | 15/07/14 | 99.51 | 99.70 | | | | | 7.84 | 1.43 | 118 | 110 | 3 000 |
| АИЖК А8 | | 15/06/18 | 96.51 | 98.80 | | | | | 8.29 | 2.92 | 99 | 155 | 5 000 |
| АИЖК А9 | | 15/02/17 | 97.80 | 99.00 | | | | | 8.50 | 2.05 | 152 | 178 | 5 000 |
| АИЖК А7 | | 15/07/16 | | 99.50 | 91.70 | -5.80 | 2 | 2 | 12.56 | 2.04 | 558 | 584 | 4 000 |
| АИЖК А19 | 15/05/15 | 15/11/24 | 97.00 | 99.00 | | | | | 8.36 | 2.45 | 121 | 163 | 6 000 |
| АИЖК А18 | 15/04/16 | 15/07/23 | 97.00 | 99.00 | 98.30 | | 1 | 3 000 | 8.82 | 3.19 | 144 | 206 | 7 000 |
| АИЖК А10 | | 15/11/18 | | | | | | | 8.64 | 3.19 | 126 | 189 | 6 000 |
| АИЖК А21 | | 15/02/20 | | 100.20 | 100.15 | 0.10 | 8 | 161 002 | 9.05 | 3.35 | 162 | 228 | 15 000 |
| АИЖК А11 | | 15/09/20 | 97.00 | | | | | | 9.36 | 3.93 | 179 | 255 | 10 000 |
| АИЖК А16 | | 15/09/21 | 96.00 | 97.40 | | | | | 9.20 | 5.02 | 141 | 227 | 10 000 |
| АИЖК А17 | | 15/04/22 | 102.30 | 103.00 | | | | | 8.80 | 5.64 | 91 | 179 | 8 000 |
| АИЖК А20 | | 15/12/27 | 99.80 | 102.50 | | | | | 8.88 | 8.37 | 63 | 153 | 5 000 |
| АИЖК-11 А1 | 15/09/14 | 15/09/43 | 100.15 | 100.35 | | | | | 8.56 | 1.92 | 164 | 184 | 7 000 |
| АИЖК-11 А2 | 15/03/19 | 15/09/43 | | | | | | | | | | | 7 000 |
| **ГЛОБЭКС** | | | | | | | | | | | | | |
| ГЛОБЭКС БО-3 | 08/06/12 | 08/12/13 | 100.00 | 100.20 | 100.21 | 0.01 | 2 | 9 800 | 9.00 | 1.25 | 246 | 226 | 3 000 |
| ГЛОБЭКС БО-5 | 08/06/12 | 08/12/13 | 100.00 | 100.20 | 99.99 | 9.99 | 1 | 32 | 9.19 | 1.25 | 265 | 245 | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-4 | 01/08/12 | 01/08/14 | 99.50 | | | | | | 9.46 | 1.84 | 258 | 274 | 3 000 |
| ГЛОБЭКС БО-6 | 01/08/12 | 01/08/14 | 86.00 | | | | | | 9.46 | 1.84 | 258 | 274 | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-1 | 16/02/11 | 16/02/13 | | | | | | | 8.36 | 0.49 | | 168 | 5 000 |
| **Транскредитбанк** | | | | | | | | | | | | | |
| Транскредитбанк 5 | | 12/08/13 | 99.10 | 100.40 | 99.40 | -0.20 | 2 | 1 000 | 8.72 | 0.97 | 241 | 197 | 3 000 |
| Транскредитбанк БО-1 | | 17/11/13 | 99.64 | 100.00 | | | | | 8.19 | 1.20 | 169 | 145 | 5 000 |
| Транскредитбанк 6 | | 17/04/14 | 98.03 | 100.00 | | | | | 8.61 | 1.56 | 187 | 188 | 4 000 |
| **ТЕЛЕКОМЫ** | | | | | | | | | | | | | |
| **МТС** | | | | | | | | | | | | | |
| МТС 5 | 26/07/12 | 19/07/16 | 98.31 | 99.70 | | | | | 9.28 | 3.47 | 182 | 250 | 15 000 |
| МТС 3 | 20/06/13 | 12/06/18 | | 100.46 | 100.46 | -0.49 | 4 | 89 882 | 7.55 | 0.83 | 138 | 82 | 10 000 |
| МТС 1 | | 17/10/13 | 99.60 | 100.19 | 99.60 | 0.35 | 1 | 999 | 7.48 | 1.12 | 104 | 73 | 10 000 |
| МТС 4 | 19/05/11 | 13/05/14 | 98.85 | 99.92 | 98.85 | -0.15 | 3 | 94 | 8.30 | 1.67 | 150 | 157 | 15 000 |
| МТС 2 | | 20/10/15 | 97.16 | 99.30 | 99.33 | -0.06 | 1 | 1 | 8.15 | 2.81 | 88 | 141 | 10 000 |
| МТС 8 | 12/11/15 | 03/11/20 | 98.10 | 98.24 | 98.10 | -0.10 | 4 | 1 238 | 9.02 | 2.85 | 174 | 228 | 15 000 |
| МТС 7 | | 07/11/17 | 97.77 | 98.25 | 97.77 | -0.23 | 1 | 5 | 9.45 | 4.21 | 182 | 261 | 10 000 |
| **Вымпелком** | | | | | | | | | | | | | |
| Вымпелком Инв 1 | | 19/07/13 | 101.15 | 101.40 | 101.30 | 0.10 | 2 | 1 862 | 7.91 | 0.90 | 166 | 117 | 10 000 |
| Вымпелком 3 | 12/07/11 | 08/07/14 | 97.56 | 97.70 | 97.55 | -0.14 | 16 | 52 123 | 9.02 | 1.79 | 216 | 229 | 10 000 |
| Вымпелком 2 | 23/03/15 | 14/03/22 | 98.20 | 98.42 | 98.42 | 0.05 | 9 | 48 408 | 9.77 | 2.30 | 268 | 304 | 10 000 |
| Вымпелком 1 | 17/03/15 | 08/03/22 | 98.30 | 98.42 | 98.42 | -0.02 | 8 | 25 252 | 9.78 | 2.28 | 270 | 305 | 10 000 |
| Вымпелком 4 | 17/03/15 | 08/03/22 | 98.31 | 98.44 | 98.43 | 0.11 | 4 | 51 682 | 9.77 | 2.28 | 269 | 304 | 15 000 |
| Вымпелком 6 | | 13/10/15 | | 96.49 | | | | | 9.83 | 2.76 | 258 | 309 | 10 000 |
| Вымпелком 7 | | 13/10/15 | 95.80 | 97.50 | 95.90 | 0.10 | 1 | 1 | 10.07 | 2.76 | 282 | 333 | 10 000 |
| **Ростелеком** | | | | | | | | | | | | | |
| Ростелеком 13 | 21/10/11 | 17/10/12 | 99.60 | | 99.60 | -0.25 | 1 | 93 | 9.14 | 0.17 | | 260 | 2 000 |
| Ростелеком 8 | | 03/09/13 | 98.90 | 100.49 | | | | | 8.81 | 0.72 | 277 | 209 | |
| Ростелеком 1 | 18/08/11 | 08/08/13 | 97.50 | 116.00 | | | | | 10.49 | 0.88 | 426 | 375 | 2 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **СПБ Теле2** | | | | | | | | | | | | | |
| ТЕЛЕ2 4 | 10/02/14 | 31/01/22 | | 101.00 | 100.80 | 1.00 | 3 | 28 100 | 8.49 | 1.43 | 183 | 175 | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 5 | 10/02/14 | 31/01/22 | | 101.70 | 100.80 | 1.00 | 3 | 25 300 | 8.49 | 1.43 | 183 | 175 | 4 000 |
| ТЕЛЕ2 7 | 14/04/15 | 05/04/22 | 98.20 | 99.99 | | | | | 9.46 | 2.36 | 235 | 273 | 6 000 |
| ТЕЛЕ2 1 | 17/06/16 | 11/06/21 | 90.00 | 97.98 | 95.30 | 0.15 | 1 | 30 000 | 10.14 | 3.31 | 273 | 338 | 5 000 |
| ТЕЛЕ2 3 | 17/06/16 | 11/06/21 | 95.20 | 108.00 | | | | | 10.07 | 3.31 | 266 | 331 | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 2 | 17/06/16 | 11/06/21 | 92.32 | 96.98 | 95.30 | 0.30 | 1 | 35 000 | 10.14 | 3.31 | 273 | 338 | 5 000 |
| **ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ** | | | | | | | | | | | | | |
| **ВБД** | | | | | | | | | | | | | |
| ВБД ПП 3 | | 27/02/13 | 99.65 | 100.00 | | | | | 8.08 | 0.52 | 233 | 140 | 5 000 |
| **МАГНИТ** | | | | | | | | | | | | | |
| Магнит БО-1 | | 09/09/13 | 99.90 | | | | | | 8.36 | 1.01 | 201 | 161 | 1 000 |
| Магнит БО-2 | | 09/09/13 | 100.05 | 101.10 | | | | | 8.20 | 1.01 | 185 | 145 | 1 000 |
| Магнит БО-3 | | 09/09/20 | 99.91 | 100.20 | 100.19 | 0.03 | 8 | 1 201 | 8.21 | 1.01 | 186 | 146 | 2 000 |
| Магнит БО-4 | | 09/09/20 | 100.00 | 100.20 | 100.00 | -0.16 | 2 | 93 | 8.41 | 1.01 | 206 | 166 | 2 000 |
| Магнит БО-5 | | 28/02/14 | 99.30 | 99.85 | | | | | 8.63 | 1.43 | 197 | 189 | 5 000 |
| Магнит БО-6 | | 22/04/14 | 99.10 | | 99.10 | 0.40 | 1 | 5 000 | 8.49 | 1.58 | 174 | 176 | 5 000 |
| **X5** | | | | | | | | | | | | | |
| X5 Финанс 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 96.01 | 97.75 | | | | | 9.88 | 1.70 | 307 | 315 | 8 000 |
| X5 Финанс 1 | | 01/07/14 | 97.01 | 98.25 | 97.40 | 0.25 | 1 | 1 | 9.71 | 1.76 | 286 | 298 | 9 000 |
| **Копейка** | | | | | | | | | | | | | |
| Копейка БО-1 | 24/07/12 | 23/07/13 | 98.01 | 100.00 | | | | | 8.37 | 0.91 | 211 | 163 | 3 000 |
| Копейка БО-2 | | 01/10/13 | 99.70 | 100.00 | 99.50 | -0.46 | 8 | 162 | 9.81 | 1.07 | 341 | 306 | 3 000 |
| **ИНТУРИСТ** | | | | | | | | | | | | | |
| Интурист 2 | 22/05/12 | 21/05/13 | 99.00 | 99.20 | 99.00 | 0.40 | 3 | 8 | 11.68 | 0.74 | 561 | 496 | 2 000 |
| **Черкизово** | | | | | | | | | | | | | |
| Черкизово БО-3 | | 08/11/13 | 98.70 | | | | | | 9.59 | 1.18 | 311 | 285 | 3 000 |
| **Синергия** | | | | | | | | | | | | | |
| Синергия БО-1 | 04/10/12 | 03/10/13 | 99.16 | 100.22 | | | | | 8.51 | 0.14 | | 204 | 3 000 |
| Синергия БО-3 | | 03/06/15 | | | | | | | | | | | 2 000 |
| **Русское Море** | | | | | | | | | | | | | |
| Русское Море 01 | 25/06/13 | 23/06/15 | 100.21 | 100.58 | | | | | 12.31 | 0.83 | 614 | 558 | 1 000 |
| **Детский мир** | | | | | | | | | | | | | |
| Детский мир 1 | | 26/05/15 | 92.51 | 93.70 | | | | | 12.01 | 2.48 | 486 | 528 | 1 000 |
| **Мираторг** | | | | | | | | | | | | | |
| Мираторг БО-1 | | 29/07/14 | 94.77 | 95.24 | 94.76 | | 1 | 3 | 12.18 | 1.83 | 530 | 545 | 3 000 |
| **МАШИНОСТРОЕНИЕ** | | | | | | | | | | | | | |
| **АТОМЭНЕРГОПРОМ** | | | | | | | | | | | | | |
| Атомэнергопром 6 | | 15/08/14 | | 101.00 | | | | | 8.49 | 1.93 | 156 | 177 | 10 000 |
| **Трансмашхолдинг** | | | | | | | | | | | | | |
| Трансмашхолдинг БО-1 | | 23/01/14 | 94.55 | 94.85 | 94.55 | -0.10 | 3 | 600 | 10.96 | 1.39 | 432 | 422 | 3 000 |
| **КАМАЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| Камаз БО-1 | 17/12/12 | 16/12/13 | | 100.60 | | | | | 7.57 | 0.34 | | 88 | 2 000 |
| Камаз БО-2 | | 04/02/14 | 93.01 | 100.90 | | | | | 9.17 | 1.42 | 252 | 243 | 3 000 |
| **УВЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| Уралвагонзавод 1 | 13/12/12 | 07/12/17 | 99.95 | 100.00 | | | | | 9.39 | 0.33 | | 270 | 3 000 |
| Уралвагонзавод 2 | 27/08/13 | 20/02/18 | 98.26 | 99.25 | | | | | 10.23 | 0.97 | 392 | 348 | 3 000 |
| **УОМЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| УОМЗ 04 | 22/10/13 | 21/04/15 | 97.50 | 98.00 | | | | | 12.71 | 1.12 | 627 | 596 | 1 000 |
| **ИРКУТ** | | | | | | | | | | | | | |
| Иркут БО-1 | | 10/09/13 | | | | | | | 9.76 | 1.77 | 291 | 303 | 5 000 |
| **ГСС** | | | | | | | | | | | | | |
| ГСС 01 | 20/09/12 | 26/03/17 | 86.04 | 100.00 | | | | | 8.08 | 0.10 | | 169 | 5 000 |
| Сухого ГС БО-1 | 21/12/12 | 20/12/13 | | | | | | | 8.37 | 0.35 | | 168 | 3 000 |
| Сухого ГС БО-2 | 23/04/13 | 22/04/14 | | | | | | | 9.60 | 0.67 | 362 | 289 | 3 000 |
| Сухого ГС БО-3 | 23/04/13 | 22/04/14 | 90.11 | | 99.51 | 0.01 | 2 | 12 | 9.17 | 0.67 | 319 | 246 | 3 000 |
| **СОЛЛЕРС** | | | | | | | | | | | | | |
| Соллерс БО-2 | 02/05/12 | 01/05/13 | 99.76 | 100.40 | | | | | 9.63 | 0.69 | 363 | 292 | 2 000 |
| Соллерс 2 | | 17/07/13 | 102.43 | 102.88 | 102.89 | -0.05 | 4 | 2 338 | 9.34 | 0.89 | 311 | 260 | 3 000 |
| **Гидромашсервис** | | | | | | | | | | | | | |
| ГМС 02 | | 13/02/15 | | | | | | | 10.74 | 2.15 | 371 | 402 | 3 000 |
| **ТРАНСПОРТ** | | | | | | | | | | | | | |
| **Аэрофлот** | | | | | | | | | | | | | |
| Аэрофлот БО-1 | | 08/04/13 | 100.05 | 100.34 | 100.00 | -0.35 | 3 | 50 001 | 7.87 | 0.63 | 195 | 117 | 6 000 |
| Аэрофлот БО-2 | | 08/04/13 | 95.00 | 100.20 | 99.00 | | 1 | 3 | 9.57 | 0.63 | 365 | 287 | 6 000 |
| **Трансконтейнер** | | | | | | | | | | | | | |
| Трансконтейнер 1 | | 26/02/13 | 100.75 | 101.25 | | | | | 7.89 | 0.51 | 215 | 121 | 3 000 |
| Трансконтейнер 2 | | 04/06/15 | 100.20 | 100.70 | | | | | 8.59 | 1.88 | 168 | 187 | 3 000 |
| **Глобалтранс** | | | | | | | | | | | | | |
| НовПеревозКом 1 | | 10/07/15 | 98.50 | 99.60 | | | | | 9.86 | 1.49 | 316 | 312 | 3 000 |
| НовПеревозКом БО-01 | | 03/03/15 | 99.40 | 99.73 | | | | | 10.37 | 2.22 | 332 | 365 | 5 000 |
| НовПеревозКом БО-02 | | 03/03/15 | | 99.74 | 99.65 | -0.10 | 2 | 4 | 10.41 | 2.21 | 336 | 369 | 5 000 |
| **Трансаэро** | | | | | | | | | | | | | |
| ТРАНСАЭРО 1 | 25/04/12 | 23/10/13 | 99.90 | 99.99 | 99.99 | 0.01 | 5 | 152 | 12.86 | 1.10 | 643 | 611 | 3 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ТРАНСАЭРО БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 99.60 | 99.70 | 99.70 | -0.10 | 18 | 5 671 | 13.20 | 0.97 | 689 | 645 | 3 000 |
| **Ю-Тэйр** | | | | | | | | | | | | | |
| Ю-Тэйр БО-1 | | 26/03/13 | 100.00 | 101.89 | | | | | 9.40 | 0.59 | 354 | 271 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-2 | | 26/03/13 | 100.01 | 101.90 | | | | | 9.58 | 0.59 | 372 | 289 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-6 | 30/04/13 | 22/04/15 | 99.40 | 100.20 | | | | | 10.37 | 0.69 | 436 | 366 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-7 | 30/04/13 | 22/04/15 | 99.40 | 100.10 | | | | | 10.37 | 0.69 | 436 | 366 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-16 | 03/06/13 | 26/05/15 | | | | | | | 8.58 | 0.77 | 248 | 186 | 1 000 |
| Ю-Тэйр БО-8 | 02/12/13 | 26/05/15 | | | | | | | 10.38 | 1.21 | 387 | 364 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-3 | | 19/12/13 | 87.10 | 102.00 | | | | | 10.65 | 1.26 | 410 | 391 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-4 | | 26/03/14 | 94.35 | 97.65 | 97.65 | | 3 | 14 | 11.03 | 1.50 | 433 | 429 | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-5 | | 26/03/14 | 91.01 | 98.74 | | | | | 9.23 | 1.50 | 253 | 250 | 2 000 |
| Ю-Тэйр 5 | | 21/07/16 | | | | | | | 8.78 | 3.32 | 136 | 201 | 2 000 |
| **ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ** | | | | | | | | | | | | | |
| **РУСГИДРО** | | | | | | | | | | | | | |
| Русгидро 1 | 22/04/16 | 12/04/21 | 98.45 | 98.75 | 98.70 | 0.18 | 3 | 101 061 | 8.59 | 3.18 | 121 | 184 | 10 000 |
| Русгидро 2 | 22/04/16 | 12/04/21 | 94.06 | 99.09 | 99.00 | 0.45 | 1 | 1 | 8.49 | 3.19 | 111 | 174 | 5 000 |
| **МОСЭНЕРГО** | | | | | | | | | | | | | |
| Мосэнерго 2 | 21/02/13 | 18/02/16 | 82.00 | | | | | | 10.34 | 0.52 | 459 | 366 | 5 000 |
| Мосэнерго 3 | 06/12/12 | 28/11/14 | | | 100.84 | -0.10 | 1 | 20 000 | 7.53 | 0.31 | | 84 | 5 000 |
| **ЛЕНЭНЕРГО** | | | | | | | | | | | | | |
| Ленэнерго 4 | 21/04/15 | 18/04/17 | 86.00 | 100.10 | | | | | 8.65 | 2.40 | 153 | 192 | 3 000 |
| **ЭНЕЛ ОГК-5** | | | | | | | | | | | | | |
| ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15 | 19/06/12 | 18/06/13 | 100.56 | 100.65 | 100.65 | 0.03 | 2 | 4 435 | 7.81 | 0.82 | 165 | 108 | 4 000 |
| ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18 | | 25/06/14 | 98.00 | 98.50 | | | | | 8.47 | 1.76 | 162 | 174 | 5 000 |
| **КузбасЭнерго** | | | | | | | | | | | | | |
| КузбасЭнерго-Фин 1 | 23/06/14 | 14/06/21 | 86.01 | | | | | | 9.45 | 1.87 | 255 | 273 | 10 000 |
| КузбасЭнерго-Фин 2 | 21/04/16 | 15/04/21 | 87.36 | 90.90 | | | | | 12.70 | 3.12 | 534 | 595 | 5 000 |
| **МРСК ЮГА** | | | | | | | | | | | | | |
| МРСК Юга 2 | 30/08/11 | 26/08/14 | 94.01 | 95.00 | | | | | 11.82 | 1.84 | 494 | 510 | 6 000 |
| **ТГК-1** | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-1 01 | 13/03/12 | 11/03/14 | 85.00 | 108.60 | | | | | 8.46 | 1.46 | 178 | 172 | 4 000 |
| ТГК-1 03 | 25/12/12 | 14/12/21 | | | | | | | 7.71 | 0.38 | | 103 | 2 000 |
| ТГК-1 02 | 02/07/13 | 01/07/14 | 98.15 | 98.85 | 98.85 | 0.46 | 4 | 10 000 | 8.23 | 0.86 | 202 | 150 | 5 000 |
| **ТГК-9** | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-9 1 | 12/08/13 | 07/08/17 | 97.40 | 98.00 | 97.51 | -0.14 | 3 | 102 | 11.11 | 0.97 | 480 | 436 | 7 000 |
| **ТГК-2** | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-2 БО-1 | | 17/09/13 | 87.30 | 87.63 | 87.06 | -0.64 | 23 | 4 794 | 24.38 | 1.02 | 1802 | 1 763 | 5 000 |
| **ТГК-5** | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-5 1 | 11/10/13 | 06/10/17 | 97.85 | 98.75 | 98.74 | 0.83 | 2 | 3 000 | 10.15 | 1.09 | 373 | 340 | 5 000 |
| **Иркутскэнерго** | | | | | | | | | | | | | |
| ИркутЭнерго-1 | | 28/11/13 | | | | | | | 10.51 | 1.76 | 366 | 378 | 5 000 |
| ИркутЭнерго БО-1 | | 08/04/14 | 85.00 | 98.50 | | | | | 9.08 | 1.54 | 235 | 235 | 3 000 |
| **ЯКУТСКЭНЕРГО** | | | | | | | | | | | | | |
| Якутскэнерго БО-1 | | 03/09/13 | 100.00 | 100.50 | | | | | 7.89 | 0.99 | 156 | 114 | 3 000 |
| **ГЭС** | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром-газэнергосеть 2 | | 23/04/13 | | | | | | | 9.03 | 1.36 | 242 | 229 | 2 000 |
| **ТГК-6** | | | | | | | | | | | | | |
| ТГК-6 1 | 29/08/13 | 24/08/17 | 97.92 | 98.60 | | | | | 10.75 | 0.98 | 443 | 400 | 5 000 |
| **ХИМИЧЕСКИЕ** | | | | | | | | | | | | | |
| **ЕВРОХИМ** | | | | | | | | | | | | | |
| Еврохим 2 | 30/06/15 | 26/06/18 | 91.00 | | | | | | 9.09 | 2.57 | 190 | 236 | 5 000 |
| Еврохим 3 | 18/11/15 | 14/11/18 | 90.00 | 100.00 | | | | | 9.55 | 2.87 | 226 | 281 | 5 000 |
| **АКРОН** | | | | | | | | | | | | | |
| Акрон 2 | 22/09/11 | 19/09/13 | 94.60 | 104.00 | | | | | 9.38 | 1.04 | 301 | 263 | 4 000 |
| Акрон 3 | 23/05/12 | 20/11/13 | 95.00 | 102.30 | | | | | 8.04 | 1.20 | 154 | 130 | 4 000 |
| Акрон 4 | 27/05/14 | 18/05/21 | 94.10 | 99.00 | | | | | 12.11 | 1.71 | 529 | 538 | 4 000 |
| Акрон 5 | 27/05/14 | 18/05/21 | 94.00 | 100.30 | | | | | 12.81 | 1.70 | 599 | 608 | 4 000 |
| **КУАЗ** | | | | | | | | | | | | | |
| КУАЗ-Инвест 4 | 10/04/14 | 07/04/16 | 97.61 | 98.28 | | | | | 10.46 | 1.53 | 374 | 373 | 2 000 |
| **СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ** | | | | | | | | | | | | | |
| **ЛСР** | | | | | | | | | | | | | |
| ЛСР Групп БО-1 | 26/06/12 | 25/06/13 | 100.00 | 100.30 | | | | | 10.35 | 0.84 | 417 | 362 | 2 000 |
| Группа ЛСР 2 | 31/01/13 | 01/08/13 | 100.00 | 100.49 | 100.05 | -0.42 | 4 | 1 800 | 9.91 | 0.46 | | 323 | 5 000 |
| ЛСР Группа БО-2 | | 10/09/13 | 99.50 | 100.17 | 100.13 | -0.02 | 4 | 40 | 10.10 | 1.00 | 376 | 335 | 2 000 |
| ЛСР Группа БО-3 | | 20/03/14 | 96.95 | 97.30 | 96.95 | -0.31 | 13 | 21 815 | 11.97 | 1.46 | 529 | 523 | 2 000 |
| ЛСР Группа БО-5 | | 24/07/14 | 94.03 | 94.50 | 94.70 | 0.30 | 1 | 1 000 | 11.93 | 1.82 | 505 | 520 | 2 000 |
| **РеноваСтройГрупп** | | | | | | | | | | | | | |
| РСГ-Финанс-1 | 19/12/12 | 18/06/14 | 99.71 | 99.85 | 99.83 | 0.03 | 2 | 4 927 | 11.72 | 0.34 | | 503 | 3 000 |
| **ЛенСпецСМУ** | | | | | | | | | | | | | |
| ЛенСпецСМУ 1 | | 07/12/12 | 102.40 | 102.73 | 102.40 | | 3 | 602 | 8.36 | 0.30 | | 167 | 2 000 |
| ЛенСпецСМУ БО-2 | | 23/05/13 | | | | | | | 9.15 | 0.52 | 341 | 247 | 2 000 |
| **ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ** | | | | | | | | | | | | | |
| **РОСНАНО** | | | | | | | | | | | | | |
| РОСНАНО 1 | | 20/12/17 | 87.13 | 99.00 | 98.90 | 3.63 | 2 | 3 380 | 9.37 | 4.32 | 172 | 252 | 8 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| РОСНАНО 2 | | 20/12/17 | 83.00 | | | | | | 9.99 | 4.30 | 234 | 314 | 10 000 |
| РОСНАНО 3 | | 20/12/17 | 94.00 | 97.89 | | | | | 10.34 | 4.29 | 269 | 349 | 15 000 |
| **СИСТЕМА** | | | | | | | | | | | | | |
| АФК Система 2 | 14/08/12 | 12/08/14 | 99.88 | 100.00 | 99.90 | -0.10 | 4 | 477 | 8.58 | 1.87 | 168 | 186 | 20 000 |
| АФК Система 3 | 29/11/12 | 24/11/16 | 101.50 | 101.75 | | | | | 6.52 | 0.29 | | | 19 000 |
| АФК Система 1 | | 07/03/13 | 100.90 | 101.15 | | | | | 7.55 | 0.54 | 177 | 86 | 6 000 |
| АФК Система 4 | | 15/03/16 | 97.80 | 99.96 | 98.15 | 0.17 | 6 | 250 | 8.75 | 2.04 | 177 | 203 | 20 000 |
| **ПРОФМЕДИА** | | | | | | | | | | | | | |
| ПрофМедиа Финанс 1 | 18/07/13 | 16/07/15 | 99.10 | 99.69 | 99.66 | -0.19 | 8 | 248 | 11.17 | 0.90 | 493 | 443 | 3 000 |
| **СИТРОНИКС** | | | | | | | | | | | | | |
| Ситроникс БО-1 | 19/06/12 | 18/06/13 | 100.22 | 100.25 | 100.25 | | 3 | 137 | 11.97 | 0.81 | 582 | 524 | 2 000 |
| Ситроникс БО-2 | 08/10/12 | 07/10/13 | 99.82 | 99.90 | 99.90 | -0.08 | 5 | 1 918 | 11.55 | 0.15 | | 506 | 3 000 |
| **ЧАСТНЫЕ БАНКИ** | | | | | | | | | | | | | |
| **РОСБАНК** | | | | | | | | | | | | | |
| РОСБАНК БО-1 | 25/06/13 | 25/06/13 | 86.00 | 100.70 | | | | | 8.18 | 0.84 | 200 | 145 | 5 000 |
| РОСБАНК БО-3 | 16/05/13 | 16/11/14 | | 100.77 | 100.76 | -0.01 | 4 | 57 802 | 8.01 | 0.73 | 196 | 129 | 10 000 |
| РОСБАНК БО-2 | | 08/07/13 | 86.10 | | | | | | 8.02 | 0.88 | 180 | 128 | 5 000 |
| РОСБАНК А3 | 06/05/11 | 06/11/13 | 98.01 | 98.20 | 97.93 | -0.23 | 8 | 588 | 8.89 | 1.18 | 240 | 215 | 5 000 |
| РОСБАНК А5 | 06/05/11 | 07/11/14 | 82.00 | | | | | | 9.63 | 2.05 | 265 | 291 | 5 000 |
| **АЛЬФА БАНК** | | | | | | | | | | | | | |
| Альфа-Банк 1 | 04/02/14 | 02/02/16 | 99.94 | 99.95 | 98.94 | -1.06 | 2 | 2 | 9.24 | 1.42 | 259 | 250 | 5 000 |
| Альфа-Банк 2 | 07/06/13 | 02/12/16 | 101.05 | 101.20 | 101.05 | | 3 | 1 551 | 8.02 | 0.79 | 189 | 130 | 5 000 |
| **МДМ Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| МДМ Банк БО-1 | | 29/11/12 | 101.07 | 101.24 | 101.24 | 0.04 | 3 | 1 001 | 8.40 | 0.29 | | 171 | 5 000 |
| МДМ Банк БО-4 | 16/12/12 | 16/12/14 | 100.26 | 100.44 | 100.32 | 0.12 | 5 | 20 488 | 8.63 | 0.34 | | 194 | 5 000 |
| МДМ Банк 8 | 09/07/13 | 09/04/15 | 100.00 | 100.05 | 100.05 | 0.05 | 5 | 25 001 | 9.14 | 0.86 | 294 | 241 | 6 000 |
| МДМ Банк БО-2 | | 21/03/14 | 96.03 | 99.00 | 96.00 | -3.93 | 1 | 11 | 11.23 | 1.48 | 454 | 449 | 5 000 |
| **НОМОС Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| Номос БО-1 | 24/02/12 | 24/02/14 | 99.75 | 100.08 | 99.75 | -0.35 | 3 | 3 | 9.49 | 1.40 | 285 | 275 | 5 000 |
| Номос 9 | 15/06/12 | 14/06/13 | 100.00 | 100.20 | | | | | 8.85 | 0.81 | 270 | 212 | 5 000 |
| Номос 11 | 02/07/14 | 02/07/14 | 99.95 | 100.15 | 100.15 | 0.25 | 5 | 13 500 | 9.62 | 1.75 | 278 | 289 | 5 000 |
| Номос БО-2 | 18/04/13 | 18/10/14 | 99.46 | 99.65 | 99.46 | -0.54 | 6 | 150 | 9.01 | 0.65 | 305 | 231 | 5 000 |
| Номос 12 | 25/08/13 | 28/08/13 | 99.30 | 99.70 | 100.00 | 0.35 | 1 | 1 | 8.68 | 0.97 | 237 | 193 | 5 000 |
| **Банк ЗЕНИТ** | | | | | | | | | | | | | |
| Банк Зенит 6 | 02/07/13 | 01/07/14 | 100.44 | 100.60 | 100.60 | 0.13 | 1 | 150 | 8.64 | 0.86 | 244 | 191 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-2 | 22/09/12 | 22/09/13 | 100.06 | 100.10 | 100.06 | 0.01 | 14 | 32 431 | 7.18 | 0.10 | | 77 | 5 000 |
| Банк Зенит БО-3 | 15/11/12 | 15/11/14 | 100.12 | 100.25 | | | | | 8.13 | 0.25 | | 144 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-6 | 26/11/12 | 26/05/14 | 99.76 | 99.78 | 99.76 | -0.02 | 8 | 18 784 | 8.22 | 0.28 | | 153 | 5 000 |
| Банк Зенит БО-4 | 07/02/13 | 07/02/15 | 100.23 | 100.31 | | | | | 8.31 | 0.48 | | 163 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-5 | 14/02/13 | 14/02/15 | 100.23 | 100.32 | | | | | 8.60 | 0.50 | 288 | 192 | 3 000 |
| Банк Зенит БО-1 | 07/04/12 | 07/04/13 | 86.00 | 100.40 | | | | | 7.62 | 0.62 | 170 | 92 | 5 000 |
| Банк Зенит 5 | 05/06/12 | 04/06/13 | 100.30 | 100.50 | | | | | 8.42 | 0.78 | 230 | 170 | 5 000 |
| Банк Зенит БО-7 | 12/04/14 | 12/04/15 | 99.50 | 99.85 | 99.83 | -0.02 | 2 | 3 016 | 9.51 | 1.53 | 279 | 278 | 5 000 |
| **ПРОМСВЯЗЬБАНК** | | | | | | | | | | | | | |
| Промсвязьбанк БО-2 | 20/02/13 | 18/02/15 | | | | | | | 8.73 | 0.50 | | 205 | 5 000 |
| Промсвязьбанк БО-4 | 20/02/13 | 18/02/15 | | | | | | | 9.14 | 0.50 | | 246 | 5 000 |
| Промсвязьбанк 6 | | 17/06/13 | 99.33 | 99.73 | 99.73 | -0.07 | 3 | 336 | 8.75 | 0.82 | 259 | 202 | 5 000 |
| Промсвязьбанк БО-3 | | 04/02/14 | 98.50 | 99.00 | 98.50 | -0.50 | 3 | 7 | 9.95 | 1.41 | 330 | 321 | 5 000 |
| **Банк СПб** | | | | | | | | | | | | | |
| Банк СПБ БО-2 | 26/03/12 | 23/09/13 | 99.00 | 99.95 | 99.95 | -0.01 | 4 | 4 730 | 9.24 | 1.04 | 286 | 249 | 5 000 |
| Банк СПБ БО-1 | 09/10/12 | 09/04/13 | 100.00 | | | | | | 11.86 | 0.15 | | 536 | 5 000 |
| Банк СПБ БО-4 | 13/12/12 | 12/12/13 | 86.00 | | | | | | 8.55 | 0.33 | | 186 | 3 000 |
| **МКБ** | | | | | | | | | | | | | |
| МКБ 8 | 10/10/12 | 08/04/15 | 100.12 | 100.30 | 100.12 | 0.07 | 3 | 21 002 | 8.24 | 0.15 | | 174 | 3 000 |
| МКБ 7 | 15/01/13 | 14/07/15 | | | | | | | 9.17 | 0.42 | | 249 | 2 000 |
| МКБ БО-4 | 15/10/12 | 15/04/14 | 99.94 | 99.97 | 99.97 | | 8 | 3 309 | 8.24 | 0.17 | | 171 | 5 000 |
| МКБ БО-1 | 22/02/13 | 22/02/14 | | | | | | | 9.50 | 0.50 | 378 | 282 | 3 000 |
| МКБ БО-3 | 27/04/13 | 27/04/15 | 89.66 | 99.75 | 99.50 | -0.16 | 4 | 7 251 | 10.22 | 0.68 | 423 | 351 | 4 000 |
| МКБ БО-5 | | 23/06/14 | 97.50 | 97.80 | 97.50 | -0.49 | 8 | 1 323 | 10.99 | 1.73 | 416 | 426 | 5 000 |
| **ПЕТРОКОММЕРЦ** | | | | | | | | | | | | | |
| Петрокоммерц 7 | 20/02/11 | 22/08/12 | | | | | | | 5.97 | 0.02 | | | 3 000 |
| Петрокоммерц 6 | | 22/08/12 | | | | | | | 5.10 | 0.02 | | | 3 000 |
| Петрокоммерц 5 | 19/12/12 | 21/12/14 | | 102.00 | | | | | 7.43 | 0.35 | | 74 | 5 000 |
| Петрокоммерц БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 100.30 | | | | | | 8.77 | 0.99 | 244 | 202 | 3 000 |
| **Банк УРАЛСИБ** | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб 04 | 13/09/13 | 10/03/17 | 99.75 | 100.05 | 100.05 | 0.05 | 3 | 77 | 8.88 | 1.02 | 252 | 213 | 5 000 |
| **ЛК УРАЛСИБ** | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб Лизинг БО-3 | | 29/10/13 | 100.00 | 100.40 | | | | | 9.20 | 0.68 | 320 | 249 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-1 | | 28/02/14 | 100.00 | 100.18 | | | | | 9.69 | 0.75 | 361 | 297 | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-4 | | 03/07/14 | 98.20 | 98.90 | 98.90 | | 1 | 1 | 10.02 | 0.95 | 372 | 328 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-5 | | 05/02/15 | 101.00 | 101.15 | 101.00 | -0.10 | 71 | 4 000 | 11.12 | 1.25 | 458 | 438 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-6 | | 10/02/15 | 100.02 | 101.00 | | | | | 12.00 | 1.26 | 545 | 526 | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-7 | | 22/04/15 | 99.70 | 100.15 | | | | | 11.58 | 1.32 | 500 | 484 | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-2 | | 12/01/15 | 100.65 | 101.60 | | | | | 11.38 | 2.13 | 436 | 466 | 2 000 |

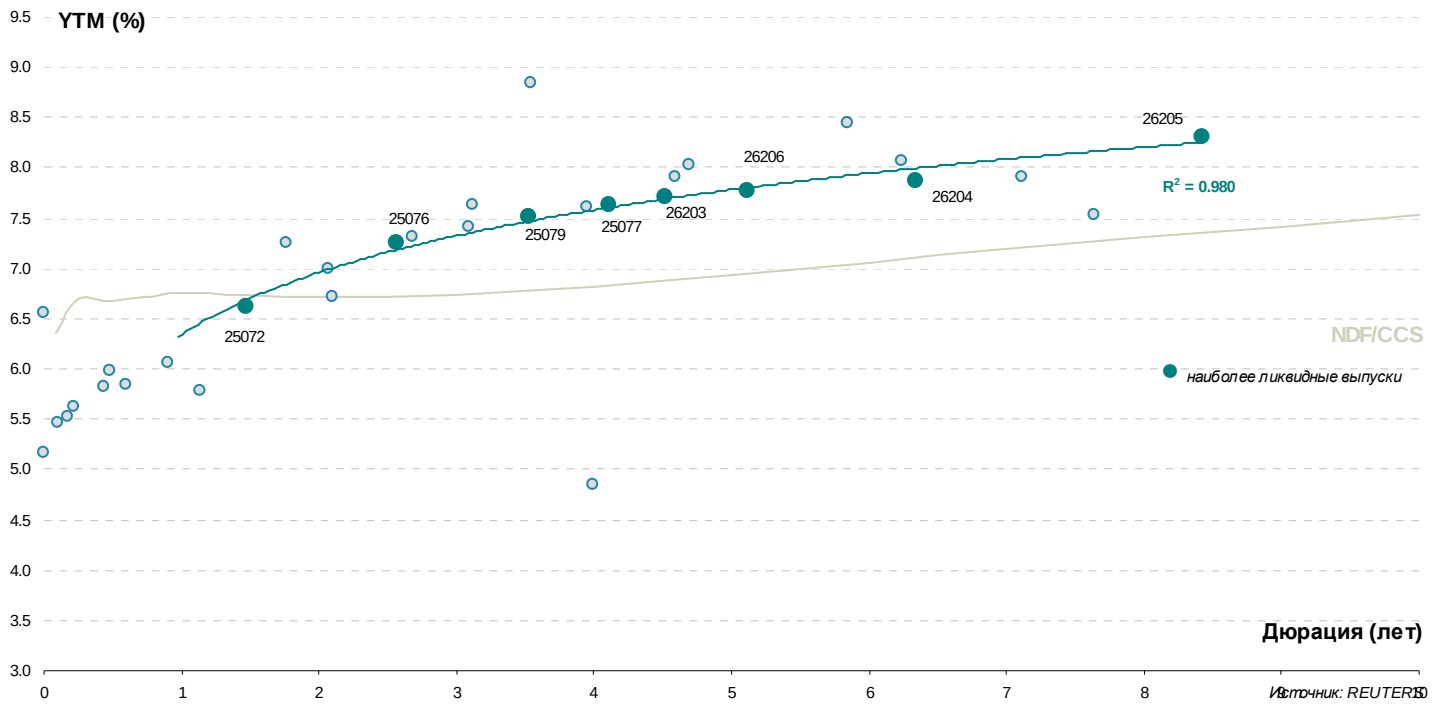
| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Уралсиб Лизинг БО-9 | | 17/02/15 | 100.60 | 101.75 | | | | | 11.25 | 2.16 | 422 | 453 | 2 000 |
| **КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ** | | | | | | | | | | | | | |
| РенКап БО-3 | 05/08/13 | 05/08/14 | 97.70 | 97.75 | 97.75 | | 7 | 770 | 12.80 | 0.95 | 651 | 606 | 3 000 |
| **ТКС БАНК** | | | | | | | | | | | | | |
| ТКС БО-3 | 21/08/12 | 18/02/14 | 100.01 | 100.05 | 100.01 | -0.01 | 13 | 2 987 | 13.34 | 0.02 | | | 2 000 |
| ТКС БО-4 | 18/04/13 | 16/04/15 | 100.01 | 100.20 | 100.00 | -0.25 | 4 | 1 926 | 13.61 | 0.64 | 767 | 691 | 2 000 |
| ТКС 2 | | 28/07/13 | 105.50 | 105.55 | 105.55 | -0.01 | 4 | 62 | 14.00 | 0.91 | 775 | 726 | 1 000 |
| ТКС БО-1 | | 20/09/13 | 99.81 | 101.88 | | | | | 14.00 | 1.00 | 766 | 725 | 2 000 |
| ТКС БО-2 | 29/11/11 | 26/11/13 | 102.77 | 102.88 | 102.88 | -0.01 | 14 | 11 475 | 14.40 | 1.17 | 792 | 766 | 2 000 |
| **РОСГОССТРАХ** | | | | | | | | | | | | | |
| Росгосстрах 2 | 12/11/12 | 02/11/17 | 100.20 | 100.24 | 100.24 | -0.05 | 3 | 109 | 9.59 | 0.24 | | 291 | 5 000 |
| **ЕАБР** | | | | | | | | | | | | | |
| ЕАБР 3 | 29/10/13 | 25/10/16 | | 99.90 | | | | | 8.18 | 1.15 | 171 | 143 | 5 000 |
| ЕАБР 1 | 03/02/14 | 28/01/19 | 100.85 | 101.27 | 100.85 | -0.42 | 2 | 58 | 8.12 | 1.40 | 148 | 138 | 5 000 |
| ЕАБР 4 | 11/02/14 | 06/02/18 | | | | | | | 9.06 | 1.44 | 240 | 232 | 5 000 |
| ЕАБР 2 | 26/02/15 | 21/02/19 | 93.00 | 110.00 | | | | | 8.86 | 2.27 | 179 | 213 | 5 000 |
| **Юникредит Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| Юникредит Банк 4 | 13/11/12 | 10/11/15 | 96.00 | 100.00 | | | | | 8.13 | 0.25 | | 145 | 10 000 |
| Юникредит Банк БО02 | 30/08/13 | 27/02/15 | 99.70 | 100.00 | 99.80 | -0.20 | 4 | 50 001 | 8.89 | 0.98 | 257 | 214 | 5 000 |
| Юникредит Банк БО03 | 04/09/13 | 04/03/15 | | 99.95 | 99.80 | -0.08 | 1 | 135 | 8.88 | 0.99 | 255 | 213 | 5 000 |
| Юникредит Банк 5 | 03/09/13 | 01/09/15 | 90.10 | 98.90 | | | | | 8.85 | 1.00 | 251 | 210 | 5 000 |
| Юникредит Банк БО01 | 11/12/13 | 10/12/14 | | | | | | | 8.68 | 1.26 | 213 | 194 | 5 000 |
| Юникредит Банк 1 | | 07/09/16 | 84.00 | 98.00 | | | | | 9.14 | 3.61 | 165 | 235 | 5 000 |
| **Райффайзен** | | | | | | | | | | | | | |
| Райффайзен 4 | 06/12/11 | 03/12/13 | 101.05 | 101.13 | 101.05 | | 1 | 110 | 8.02 | 1.24 | 149 | 128 | 10 000 |
| Райффайзен БО-7 | | 27/11/13 | 99.53 | 99.59 | | | | | 8.02 | 1.23 | 150 | 128 | 5 000 |
| **ИНГ Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| ИНГ Банк 2 | 12/11/12 | 18/11/14 | | | | | | | 8.48 | 0.25 | | 179 | 5 000 |
| **РуссСтандарт** | | | | | | | | | | | | | |
| РуссСтандарт БО-1 | 09/11/12 | 07/11/14 | 100.42 | 100.65 | 100.55 | -0.12 | 18 | 29 264 | 8.65 | 0.24 | | 199 | 5 000 |
| РуссСтандарт БО-2 | 26/03/13 | 24/03/15 | 99.96 | 100.18 | 100.10 | 0.28 | 12 | 31 106 | 8.99 | 0.59 | 313 | 230 | 5 000 |
| РуссСтандарт БО-6 | 03/11/13 | 03/05/15 | 99.65 | 99.90 | | | | | 9.69 | 1.16 | 322 | 294 | 5 000 |
| **Вост-Экспресс** | | | | | | | | | | | | | |
| Вост-Экспр Банк БО-5 | 19/04/12 | 17/10/13 | 99.80 | 99.99 | | | | | 10.42 | 1.10 | 400 | 367 | 2 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-1 | 10/03/11 | 07/03/13 | | | | | | | 7.63 | 0.58 | 178 | 94 | 1 000 |
| **ХКФ Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| ХКФ Банк 6 | 11/12/12 | 10/06/14 | 99.80 | 100.00 | | | | | 7.96 | 0.32 | | 127 | 5 000 |
| ХКФ Банк 5 | 19/10/11 | 17/04/13 | 99.50 | 100.00 | | | | | 9.60 | 0.65 | 364 | 290 | 4 000 |
| ХКФ Банк БО-3 | 22/10/13 | 22/04/14 | | | | | | | 9.28 | 1.14 | 282 | 253 | 4 000 |
| ХКФ Банк 7 | 26/04/12 | 23/04/15 | 99.35 | 99.70 | 99.35 | -0.05 | 9 | 10 000 | 10.41 | 2.38 | 329 | 368 | 5 000 |
| **БНП Париба** | | | | | | | | | | | | | |
| БНП Париба 1 | | 29/03/14 | | | | | | | 9.97 | 1.51 | 326 | 324 | 2 000 |
| **РусфинансБанк** | | | | | | | | | | | | | |
| РусфинансБанк 8 | 17/09/12 | 14/09/15 | | 100.03 | | | | | 8.19 | 0.09 | | 181 | 2 000 |
| РусфинансБанк 9 | 18/09/12 | 15/09/15 | 99.75 | 100.05 | | | | | 8.28 | 0.09 | | 190 | 2 000 |
| РусфинансБанк БО-01 | 04/07/13 | 04/07/14 | 98.01 | 99.75 | 99.25 | 0.80 | 2 | 992 | 8.19 | 0.87 | 198 | 146 | 4 000 |
| РусфинансБанк БО-02 | 06/09/13 | 06/03/15 | 86.00 | | | | | | 9.46 | 1.00 | 312 | 271 | 4 000 |
| РусфинансБанк 10 | 12/11/13 | 10/11/15 | 86.00 | 101.00 | | | | | 9.17 | 1.19 | 268 | 243 | 2 000 |
| РусфинансБанк 11 | 13/11/13 | 11/11/15 | | 98.50 | | | | | 10.13 | 1.19 | 364 | 339 | 2 000 |
| **ОТП Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| ОТП Банк БО-3 | 01/11/12 | 30/10/14 | 100.45 | 100.50 | 100.40 | | 1 | 780 | 8.62 | 0.21 | | 200 | 4 000 |
| ОТП Банк БО-2 | 04/03/14 | 03/03/15 | 99.25 | 99.45 | | | | | 11.52 | 1.41 | 487 | 478 | 6 000 |
| ОТП Банк 2 | | 25/03/14 | 95.90 | 96.20 | 96.16 | | 10 | 746 | 11.20 | 1.49 | 450 | 446 | 3 000 |
| ОТП Банк БО-1 | | 29/07/14 | | 94.80 | 94.30 | -0.15 | 4 | 6 048 | 11.60 | 1.84 | 471 | 488 | 5 000 |
| **СКБ-Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| СКБ-Банк БО-4 | 05/12/12 | 05/06/13 | 100.60 | 101.25 | | | | | 8.82 | 0.31 | | 213 | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-3 | 28/05/13 | 26/11/13 | 99.50 | 99.90 | 99.50 | -0.15 | 2 | 3 246 | 10.40 | 0.76 | 431 | 368 | 3 000 |
| СКБ-Банк БО-5 | 11/10/12 | 10/04/14 | 99.95 | 100.05 | | | | | 8.63 | 0.16 | | 212 | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-6 | 09/07/13 | 08/06/14 | 98.10 | 98.61 | | | | | 10.53 | 0.88 | 430 | 379 | 2 000 |
| **КредитЕвропа Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| КредЕврБанк 6 | 21/08/12 | 18/02/14 | | | | | | | 8.34 | 0.02 | | | 4 000 |
| КредЕврБанк БО-2 | 10/02/14 | 10/02/15 | 99.40 | 99.80 | 99.70 | 0.20 | 3 | 77 | 10.48 | 1.42 | 383 | 374 | 5 000 |
| КредЕврБанк БО-1 | | 27/04/14 | 93.00 | 98.00 | | | | | 10.30 | 1.59 | 355 | 357 | 5 000 |
| **Банк Интеза** | | | | | | | | | | | | | |
| Интеза 03 | 11/10/13 | 13/04/15 | 99.10 | 99.70 | | | | | 9.48 | 1.10 | 306 | 273 | 5 000 |
| **Центр-Инвест** | | | | | | | | | | | | | |
| ЦентрИнвест 2 | 25/06/13 | 24/06/14 | 100.40 | 100.60 | | | | | 9.99 | 0.84 | 381 | 326 | 3 000 |
| ЦентрИнвест БО-1 | 18/12/12 | 17/06/14 | 99.60 | 99.90 | | | | | 9.30 | 0.35 | | 261 | 2 000 |
| ЦентрИнвест БО-5 | 18/12/12 | 17/06/14 | 99.55 | 99.95 | | | | | 9.30 | 0.35 | | 261 | 1 000 |
| ЦентрИнвест БО-2 | 18/04/13 | 16/04/15 | 99.75 | 99.90 | | | | | 9.89 | 0.65 | 393 | 319 | 2 000 |
| **Связь-Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| СвязьБанк 03 | 20/12/12 | 09/12/21 | 86.00 | | | | | | 7.56 | 0.35 | | 87 | 5 000 |

| Выпуск | Дата Оферты | Дата Погашения | Котировки Покупка | Котировки Продажа | Цена Посл | Цена Изм. пп | Кол-во сделок | Оборот, шт | YTM/YTP | Дюрация | Спрэд к (бп) ОФЗ | Спрэд к (бп) свопам | Объем млн руб. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| СвязьБанк 04 | 24/04/13 | 13/04/22 | 100.00 | 100.20 | 100.00 | -0.09 | 1 | 10 000 | 8.91 | 0.67 | 293 | 220 | 5 000 |
| СвязьБанк 05 | 16/04/15 | 07/04/22 | | 100.00 | | | | | 9.71 | 2.44 | 257 | 298 | 5 000 |
| **Крайинвестбанк** | | | | | | | | | | | | | |
| Крайинвестбанк БО-1 | 19/10/12 | 19/04/14 | 99.73 | 99.80 | | | | | 9.92 | 0.18 | | 337 | 2 000 |
| **Судостроительный банк** | | | | | | | | | | | | | |
| Судостр 03 | 05/09/11 | 03/09/12 | 99.04 | | | | | | 10.01 | 0.05 | | | 2 000 |
| Судостр БО01 | 03/03/13 | 03/03/14 | 90.00 | 100.00 | | | | | 12.40 | 0.52 | 664 | 572 | 2 000 |
| Судостр 04 | 10/04/12 | 08/10/13 | 98.01 | 100.00 | | | | | 11.78 | 1.07 | 538 | 503 | 2 000 |
| **Меткомбанк** | | | | | | | | | | | | | |
| Меткомбанк БО-1 | 02/02/13 | 02/08/14 | 92.13 | 100.15 | 98.90 | 1.10 | 10 | 50 009 | 11.47 | 0.47 | | 479 | 2 000 |
| Меткомбанк 01 | 13/04/13 | 15/04/15 | 95.02 | 100.50 | 100.21 | -0.26 | 1 | 20 000 | 10.63 | 0.64 | 470 | 393 | 2 000 |
| **Абсолют банк** | | | | | | | | | | | | | |
| Абсолют банк 5 | 30/07/14 | 27/07/16 | 83.00 | | | | | | 10.29 | 1.84 | 340 | 357 | 2 000 |
| **СМП Банк** | | | | | | | | | | | | | |
| СМП Банк 01 | 27/11/12 | 23/05/17 | 100.00 | 100.14 | 100.00 | -0.10 | 3 | 20 000 | 10.40 | 0.28 | | 371 | 3 000 |
| **Татфондбанк** | | | | | | | | | | | | | |
| Татфондбанк БО-1 | 28/06/12 | 26/12/13 | 98.50 | 99.90 | 99.30 | -0.67 | 1 | 15 | 11.64 | 1.29 | 507 | 490 | 2 000 |
| Татфондбанк БО-2 | 18/10/12 | 17/04/14 | 99.75 | 100.00 | | | | | 11.54 | 0.18 | | 499 | 2 000 |
| Татфондбанк БО-3 | 29/11/12 | 27/11/14 | 100.50 | 100.85 | | | | | 7.54 | 0.29 | | 85 | 2 000 |
| Татфондбанк 7 | 16/12/11 | 14/12/12 | 99.85 | 100.20 | 99.85 | -0.40 | 1 | 1 | 10.66 | 0.33 | | 397 | 1 000 |
| Татфондбанк БО-4 | 19/02/13 | 17/02/15 | | | | | | | 11.70 | 0.49 | | 502 | 3 000 |
| Татфондбанк 6 | 28/02/12 | 26/02/13 | 99.00 | | 100.00 | 0.70 | 1 | 1 | 10.52 | 0.51 | 479 | 384 | 2 000 |
| Татфондбанк БО-5 | 09/04/13 | 07/04/15 | 99.45 | 100.00 | 100.00 | 0.45 | 1 | 85 | 11.28 | 0.62 | 536 | 458 | 2 000 |
| **РЕГИОНАЛЬНЫЕ** | | | | | | | | | | | | | |
| **МОСКВА** | | | | | | | | | | | | | |
| Москва 54 | | 05/09/12 | 100.04 | 100.07 | 100.04 | -0.06 | 2 | 2 | 6.30 | 0.06 | | | 15 000 |
| Москва 61 | | 03/06/13 | 107.00 | 107.50 | | | | | 5.91 | 0.75 | | | 30 000 |
| Москва 53 | | 02/09/13 | | 100.75 | | | | | 7.01 | 1.00 | 67 | 26 | 15 000 |
| Москва 63 | | 10/12/13 | 110.25 | 110.75 | | | | | 6.79 | 1.20 | 29 | 5 | 15 000 |
| Москва 62 | | 09/06/14 | 108.95 | 109.20 | 109.20 | 0.10 | 2 | 22 | 7.20 | 1.62 | 43 | 47 | 35 000 |
| Москва 39 | | 21/07/14 | 91.00 | 99.50 | | | | | 7.59 | 1.83 | 71 | 86 | 10 000 |
| Москва 64 | | 24/06/15 | 97.37 | 98.40 | 98.40 | 1.08 | 1 | 150 | 7.77 | 2.61 | 57 | 104 | 20 000 |
| Москва 44 | | 16/11/15 | 112.20 | 113.29 | 113.29 | 0.89 | 1 | 150 | 7.86 | 2.72 | 62 | 113 | 40 000 |
| Москва 56 | | 22/09/16 | 96.25 | 96.95 | 96.95 | 0.70 | 2 | 367 | 8.04 | 3.53 | 57 | 126 | 20 000 |
| Москва 49 | | 14/06/17 | 96.02 | 97.00 | | | | | 8.04 | 4.12 | 43 | 121 | 25 000 |
| Москва 48 | | 11/06/22 | 88.61 | 89.24 | | | | | 8.41 | 7.03 | 32 | 122 | 30 000 |
| **МОС ОБЛ** | | | | | | | | | | | | | |
| Московская Обл 8 | | 11/06/13 | 97.01 | 101.30 | 101.40 | | 2 | 6 | 7.32 | 0.80 | 118 | 59 | 19 000 |
| Московская Обл 7 | | 16/04/14 | 95.01 | 99.50 | 99.30 | -0.25 | 7 | 6 495 | 8.63 | 1.56 | 189 | 190 | 16 000 |
| **НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ** | | | | | | | | | | | | | |
| Нижегородская Обл 5 | | 03/12/12 | 101.55 | 101.75 | | | | | 6.40 | 0.30 | | | 3 000 |
| Нижегородская Обл 4 | | 17/11/12 | 99.99 | 100.20 | 100.10 | -0.10 | 3 | 4 033 | 7.42 | 0.26 | | 73 | 3 000 |
| Нижегородская Обл 6 | | 07/10/15 | 99.55 | 100.00 | | | | | 8.43 | 1.92 | 151 | 171 | 5 000 |
| Нижегородская Обл 7 | | 16/11/16 | 103.00 | 103.25 | 103.00 | | 4 | 5 004 | 8.73 | 2.39 | 161 | 200 | 8 000 |
| **САМАРСКАЯ ОБЛ** | | | | | | | | | | | | | |
| Самарская Обл 5 | | 19/12/13 | 101.50 | 101.99 | | | | | 7.95 | 1.26 | 140 | 121 | 8 000 |
| Самарская Обл 6 | | 10/05/13 | 105.00 | 105.60 | 105.60 | | 1 | 1 | 7.30 | 0.71 | 127 | 59 | 2 000 |
| Самарская Обл 7 | | 30/11/16 | | 98.80 | 97.50 | -0.50 | 4 | 12 906 | 8.91 | 2.22 | 185 | 219 | 12 000 |
| **ЯКУТИЯ** | | | | | | | | | | | | | |
| Якутия 1 | | 11/04/13 | 100.00 | 100.30 | 100.10 | -0.20 | 1 | 800 | 7.91 | 0.40 | | 123 | 3 000 |
| Якутия 9 | | 19/09/13 | 101.10 | 101.50 | 101.60 | 0.27 | 1 | 120 | 7.41 | 0.64 | 148 | 71 | 2 000 |
| Якутия 7 | | 17/04/14 | | 100.20 | | | | | 7.82 | 1.31 | 124 | 108 | 3 000 |
| **КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ** | | | | | | | | | | | | | |
| Краснодарский край 2 | | 14/12/12 | 99.50 | 99.74 | | | | | | 0.33 | | | 2 000 |
| Краснодар 02 | | 05/11/15 | 100.30 | 102.00 | | | | | 8.86 | 1.33 | 226 | 212 | 1 000 |
| Краснодарский край 3 | | 27/09/14 | 100.00 | 100.30 | | | | | 8.12 | 1.49 | 142 | 138 | 4 000 |
| **КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ** | | | | | | | | | | | | | |
| Красноярский край 4 | | 01/11/12 | 100.70 | 100.76 | 100.75 | -0.05 | 5 | 60 731 | 7.30 | 0.23 | | 64 | 10 000 |
| Красноярский край 5 | | 29/11/16 | 101.50 | 102.20 | 101.90 | -0.05 | 9 | 64 361 | 8.15 | 1.68 | 135 | 142 | 9 000 |
| **КОМИ** | | | | | | | | | | | | | |
| Коми Респ 7 | | 22/11/13 | 99.70 | 100.60 | | | | | 7.07 | 0.75 | 100 | 35 | 1 000 |
| Коми Респ 9 | | 18/10/14 | 97.25 | 100.00 | | | | | 9.07 | 1.56 | 233 | 234 | 2 000 |
| Коми Респ 8 | | 03/12/15 | 94.65 | 95.40 | 94.65 | 0.15 | 2 | 68 966 | 8.60 | 2.39 | 148 | 187 | 1 000 |
| Коми Респ 10 | | 15/12/16 | | | | | | | 9.04 | 2.53 | 187 | 231 | 2 000 |
| **УДМУРТИЯ** | | | | | | | | | | | | | |
| Удмуртия 05 | | 24/11/16 | | | | | | | 8.67 | 2.66 | 145 | 194 | 2 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во | Оборот, | | | Спрэд к (бп) | | Объем |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | сделок | шт | YTM/YTP | Дюрация | ОФЗ | свопам | млн руб. |
| **КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Костромская область 5 | | 20/12/12 | | 100.65 | 100.65 | -0.08 | 6 | 151 127 | 7.28 | 0.34 | | 59 | 3 000 |
| Костромская область 6 | | 17/11/16 | | | | | | | 9.26 | 1.99 | 230 | 254 | 4 000 |
| **ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ** | | | | | | | | | | | | | |
| Вологодская обл. 02 | | 14/12/16 | 100.07 | 103.65 | | | | | 9.66 | 2.43 | 252 | 293 | 3 000 |
| **РЕСП КАРЕЛИЯ** | | | | | | | | | | | | | |
| Карелия 14 | | 30/11/16 | 101.31 | 101.85 | 101.85 | -0.15 | 7 | 7 997 | 9.05 | 1.88 | 214 | 233 | 1 000 |
| **ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Ярославская Обл 9 | | 16/05/13 | | | | | | | 7.46 | 0.47 | | 78 | 3 000 |
| Ярославская Обл 10 | | 15/04/14 | 99.00 | 99.70 | | | | | 8.30 | 1.33 | 170 | 156 | 3 000 |
| **РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Рязанская Обл 1 | | 27/11/14 | | | | | | | 8.61 | 1.29 | 204 | 187 | 2 000 |
| **ХМАО** | | | | | | | | | | | | | |
| ХМАО-Югра 7 | | 20/12/12 | 100.81 | 101.25 | | | | | 6.62 | 0.35 | | | 2 000 |
| ХМАО-Югра 8 | | 19/12/13 | 104.00 | 104.87 | | | | | 7.46 | 1.28 | 90 | 72 | 2 000 |
| **СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Свердловская обл. 01 | | 11/12/16 | | 102.80 | | | | | 8.32 | 1.96 | 138 | 160 | 3 000 |
| **ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ** | | | | | | | | | | | | | |
| Тверская Обл 5 | | 26/12/13 | 107.00 | 108.08 | | | | | 8.78 | 1.24 | 225 | 204 | 4 000 |
| Тверская Обл 6 | | 12/06/14 | 100.05 | 104.10 | | | | | 8.38 | 0.95 | 208 | 164 | 3 000 |
| Тверская Обл 7 | | 15/12/15 | 97.23 | 98.15 | | | | | 9.54 | 2.62 | 234 | 281 | 3 000 |

*Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ*

## ОФЗ

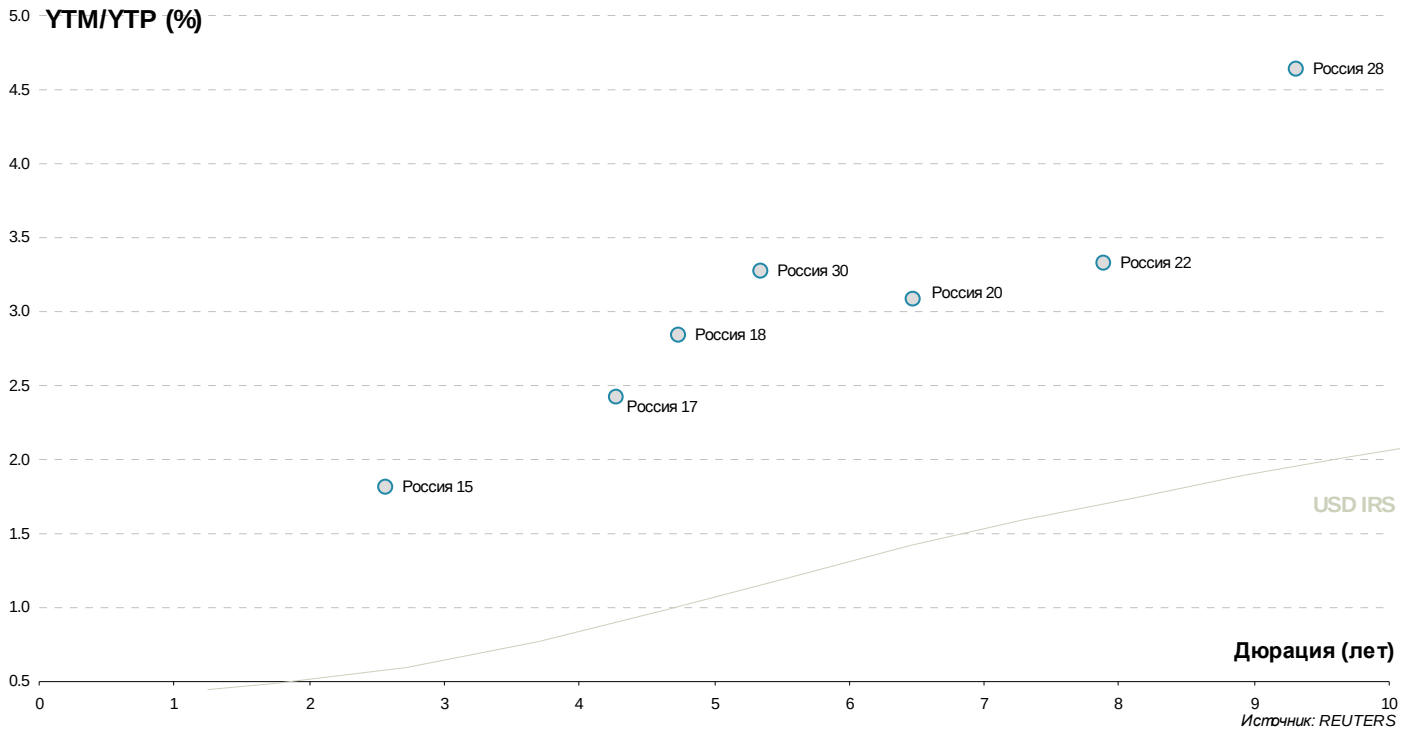

YTM (%)
9.5
9.0
8.5
8.0
7.5
7.0
6.5
6.0
5.5
5.0
4.5
4.0
3.5
3.0
0
1
2
3
4
5
6
7
8
9
10
Дюрация (лет)
25072
25076
25079
25077
26203
26206
26204
26205
R² = 0.980
NDF/CCS
наиболее ликвидные выпуски
Источник: REUTERS

# Результаты торгов евробондами

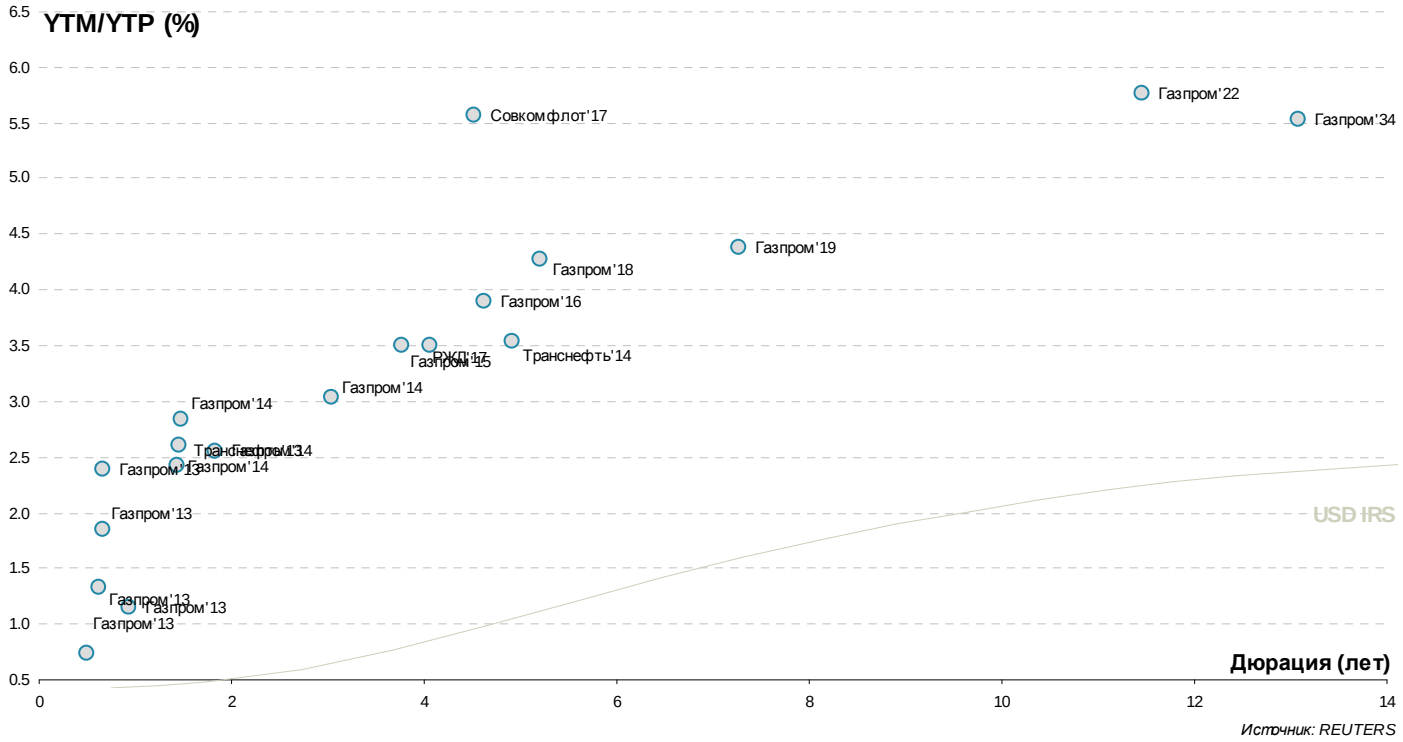
| Выпуск | Валюта | Дата Погашения | Цена Покупка | Цена Продажа | Доходность Покупка | Доходность Продажа | Дюрация | Изм-е, % (по покупке) | Z-спрэд |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **РОССИЯ** | | | | | | | | | |
| RUSSIA'15 3.625% | USD | 29/04/15 | 104.500 | 105.000 | 1.90 | 1.72 | 2.57 | -0.05 | 136 |
| RUSSIA'17 3.25% | USD | 04/04/17 | 103.450 | 103.825 | 2.46 | 2.37 | 4.29 | -0.05 | 158 |
| RUSSIA'18 11% | USD | 24/07/18 | 143.650 | 144.900 | 2.93 | 2.74 | 4.75 | -0.05 | 186 |
| RUSSIA'30 7.5% | USD | 31/03/30 | 123.703 | 123.861 | 3.28 | 3.26 | 5.34 | -0.62 | 176 |
| RUSSIA'20 5% | USD | 29/04/20 | 112.875 | 113.250 | 3.11 | 3.05 | 6.48 | -0.63 | 163 |
| RUSSIA'22 4.5% | USD | 04/04/22 | 109.375 | 109.875 | 3.35 | 3.29 | 7.89 | -0.63 | 159 |
| RUSSIA'28 12.75% | USD | 24/06/28 | 189.650 | 190.850 | 4.68 | 4.61 | 9.32 | -0.25 | 265 |
| RUSSIA'42 5.625% | USD | 04/04/42 | 116.750 | 117.250 | 4.59 | 4.56 | 15.55 | -1.25 | 210 |
| **ГОСКОМПАНИИ** | | | | | | | | | |
| **Газпром** | | | | | | | | | |
| GAZPR'13 4.505% | USD | 22/07/13 | 101.708 | 101.833 | 1.93 | 1.75 | 0.67 | -0.02 | 155 |
| GAZST'13 5.625% | USD | 22/07/13 | 101.875 | 102.375 | 2.76 | 2.01 | 0.66 | 0.07 | 238 |
| RBS D'13 9.625% | USD | 01/03/13 | 104.500 | 104.900 | 1.09 | 0.37 | 0.51 | | 70 |
| GAZPR'13 7.343% | USD | 11/04/13 | 103.625 | 104.025 | 1.64 | 1.03 | 0.62 | -0.03 | 125 |
| GAZPR'13 7.51% | USD | 31/07/13 | 105.700 | 106.200 | 1.41 | 0.90 | 0.93 | 0.08 | 101 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 25/03/14 | 111.850 | 111.975 | 2.88 | 2.81 | 1.48 | -0.05 | 247 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 08/03/14 | 111.750 | 112.750 | 2.73 | 2.12 | 1.43 | -0.05 | 231 |
| GAZPR'14 8.125% | USD | 31/07/14 | 110.250 | 110.750 | 2.67 | 2.43 | 1.84 | | 222 |
| GAZPR'15 5.092% | USD | 29/11/15 | 106.125 | 106.625 | 3.11 | 2.95 | 3.03 | -0.38 | 251 |
| GAZPR'16 6.212% | USD | 22/11/16 | 110.375 | 110.875 | 3.56 | 3.44 | 3.78 | -0.13 | 279 |
| GAZPR'18 8.146% | USD | 11/04/18 | 121.000 | 121.750 | 3.96 | 3.82 | 4.63 | -0.50 | 291 |
| GAZPR'19 9.25% | USD | 23/04/19 | 128.250 | 129.000 | 4.33 | 4.22 | 5.21 | -0.75 | 311 |
| GAZPR'22 6.51% | USD | 07/03/22 | 116.250 | 116.750 | 4.41 | 4.35 | 7.27 | 0.20 | 271 |
| GAZPR'34 8.625% | USD | 28/04/34 | 134.768 | 135.741 | 5.79 | 5.73 | 11.46 | -0.39 | 354 |
| GAZPR'37 7.288% | USD | 16/08/37 | 123.250 | 124.250 | 5.56 | 5.49 | 13.09 | 0.44 | 323 |
| **Транснефть** | | | | | | | | | |
| TRANSN'13 7.7% | USD | 07/08/13 | 105.955 | 107.955 | 1.46 | -0.52 | 0.95 | | 105 |
| TRANSN'14 5.67% | USD | 05/03/14 | 104.156 | 105.053 | 2.89 | 2.31 | 1.46 | -0.04 | 247 |
| TRANSN'18 8.7% | USD | 07/08/18 | 127.000 | 128.000 | 3.63 | 3.46 | 4.92 | -0.25 | 253 |
| **РЖД** | | | | | | | | | |
| RZD'17 5.739% | USD | 03/04/17 | 109.250 | 109.750 | 3.55 | 3.44 | 4.07 | -0.50 | 270 |
| **Совкомфлот** | | | | | | | | | |
| SOVKOM'17 5.375% | USD | 27/10/17 | 98.657 | 99.657 | 5.68 | 5.45 | 4.52 | -0.32 | 477 |
| **ГОСБАНКИ** | | | | | | | | | |
| **ВТБ** | | | | | | | | | |
| VTB'12 6.609% | USD | 31/10/12 | 100.900 | 101.150 | 1.90 | 0.66 | 0.20 | | 159 |
| VTB'15 6.465% | USD | 04/03/15 | 106.375 | 107.000 | 3.81 | 3.56 | 2.32 | -0.13 | 331 |
| VTB'18 6.315% | USD | 22/02/18 | 103.173 | 103.548 | 5.64 | 5.56 | 4.61 | -0.70 | 466 |
| VTB'18 6.875% | USD | 29/05/18 | 106.375 | 106.750 | 5.57 | 5.49 | 4.83 | -0.63 | 453 |
| VTB'20 6.551% | USD | 13/10/20 | 104.375 | 104.875 | 5.87 | 5.79 | 6.35 | 0.30 | 441 |
| VTB'35 6.25% | USD | 30/06/35 | 105.250 | 105.750 | 5.83 | 5.79 | 12.64 | -0.23 | 352 |
| **Банк Москвы** | | | | | | | | | |
| BANK OF MOS'13 7.335% | USD | 13/05/13 | 103.000 | 104.000 | 3.14 | 1.79 | 0.71 | 0.11 | 276 |
| BANK OF MOS'15 6.699% | USD | 11/03/15 | 104.875 | 105.625 | 4.65 | 4.35 | 2.33 | 0.76 | 418 |
| BOM CAPITAL'15 6.699% | USD | 11/03/15 | 98.937 | 99.937 | 7.16 | 6.72 | 2.33 | -0.04 | 675 |
| **ВЭБ** | | | | | | | | | |
| VEB LEAS'16 5.125% | USD | 27/05/16 | 102.083 | 102.383 | 4.52 | 4.43 | 3.44 | -0.03 | 386 |
| VEB'17 5.45% | USD | 22/11/17 | 107.125 | 107.625 | 3.94 | 3.83 | 4.61 | -0.13 | 295 |
| VEB'20 6.902% | USD | 09/07/20 | 115.236 | 115.735 | 4.58 | 4.51 | 6.31 | -0.11 | 313 |
| VEB'25 6.8% | USD | 22/11/25 | 114.375 | 114.875 | 5.28 | 5.23 | 9.12 | -0.25 | 326 |
| **Газпромбанк** | | | | | | | | | |
| GAZPROMB'13 7.933% | USD | 28/06/13 | 104.375 | 104.775 | 2.72 | 2.26 | 0.84 | -0.03 | 233 |
| GAZPROMB'14 6.25% | USD | 15/12/14 | 104.375 | 104.875 | 4.25 | 4.02 | 2.18 | -0.13 | 379 |
| GAZPROMB'15 6.5% | USD | 23/09/15 | 105.625 | 106.125 | 4.53 | 4.36 | 2.79 | 0.13 | 398 |
| **РСХБ** | | | | | | | | | |
| ROSSELKH'13 7.175% | USD | 16/05/13 | 103.750 | 104.100 | 2.03 | 1.57 | 0.72 | | 164 |
| ROSSELKH'14 7.125% | USD | 14/01/14 | 105.750 | 106.125 | 2.90 | 2.64 | 1.35 | -0.13 | 249 |
| ROSSELKH'14 9% | USD | 11/06/14 | 110.750 | 111.250 | 2.85 | 2.59 | 1.69 | | 241 |
| ROSSELKH'17 6.299% | USD | 15/05/17 | 109.125 | 109.625 | 4.16 | 4.04 | 4.14 | -0.22 | 330 |
| ROSSELKH'18 7.75% | USD | 29/05/18 | 117.625 | 118.500 | 4.27 | 4.12 | 4.79 | -0.25 | 321 |
| ROSSELKH'21 6% | USD | 03/06/21 | 100.833 | 101.458 | 5.75 | 5.57 | 3.40 | -0.17 | 513 |
| **Сбербанк** | | | | | | | | | |
| SBER'13 6.48% | USD | 15/05/13 | 103.625 | 103.875 | 1.51 | 1.17 | 0.72 | | 111 |
| SBER'13 6.468% | USD | 02/07/13 | 103.850 | 104.350 | 1.96 | 1.40 | 0.85 | -0.03 | 157 |
| SBER'15 5.499% | USD | 07/07/15 | 106.750 | 107.250 | 3.03 | 2.86 | 2.70 | -0.10 | 249 |
| SBER'17 5.4% | USD | 24/03/17 | 105.500 | 106.000 | 4.07 | 3.96 | 4.06 | -0.38 | 324 |
| SBER'21 5.717% | USD | 16/06/21 | 105.417 | 106.042 | 4.95 | 4.87 | 7.04 | -0.79 | 337 |
| **ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ** | | | | | | | | | |
| **Евраз** | | | | | | | | | |

| Выпуск | Валюта | Дата Погашения | Цена Покупка | Цена Продажа | Доходность Покупка | Доходность Продажа | Дюрация | Изм-е, % (по покупке) | Z-спрэд |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| EVRAZ'13 8.875% | USD | 24/04/13 | 103.900 | 104.100 | 3.01 | 2.72 | 0.66 | -0.10 | 263 |
| EVRAZ'15 8.25% | USD | 10/11/15 | 107.125 | 107.625 | 5.79 | 5.63 | 2.85 | -0.13 | 526 |
| EVRAZ'18 9.5% | USD | 24/04/18 | 108.375 | 109.375 | 7.65 | 7.44 | 4.45 | -0.13 | 673 |
| EVRAZ'18 6.75% | USD | 27/04/18 | 97.125 | 97.500 | 7.38 | 7.29 | 4.70 | -0.13 | 642 |
| **Альянс Ойл** | | | | | | | | | |
| ALLIANCE OIL'15 9.875% | USD | 11/03/15 | 105.250 | 105.750 | 7.58 | 7.36 | 2.24 | | 719 |
| **Апроса** | | | | | | | | | |
| ALROSA'14 8.875% | USD | 17/11/14 | 110.775 | 111.271 | 3.81 | 3.59 | 2.05 | -0.07 | 335 |
| ALROSA'20 7.75% | USD | 03/11/20 | 110.375 | 110.750 | 6.12 | 6.07 | 6.21 | 0.28 | 469 |
| **Вымпелком** | | | | | | | | | |
| VIMPELC'13 8.375% | USD | 30/04/13 | 103.875 | 104.250 | 2.70 | 2.17 | 0.68 | -0.13 | 231 |
| VIP FIN'16 6.493% | USD | 02/02/16 | 102.250 | 102.250 | 5.76 | 5.76 | 3.14 | 0.12 | 520 |
| VIMPELC'16 8.25% | USD | 23/05/16 | 107.775 | 108.281 | 5.91 | 5.76 | 3.27 | 0.04 | 529 |
| VIMPELC'18 9.125% | USD | 30/04/18 | 108.875 | 109.625 | 7.19 | 7.04 | 4.51 | -0.13 | 625 |
| VIP FIN'21 7.748% | USD | 02/02/21 | 99.000 | 100.000 | 7.91 | 7.75 | 6.33 | 0.50 | 653 |
| **Лукойл** | | | | | | | | | |
| LUKOIL'14 6.375% | USD | 05/11/14 | 108.500 | 109.100 | 2.40 | 2.13 | 2.07 | -0.13 | 192 |
| LUKOIL'17 6.356% | USD | 07/06/17 | 111.000 | 111.750 | 3.82 | 3.66 | 4.20 | -0.63 | 294 |
| LUKOIL'19 7.25% | USD | 05/11/19 | 116.125 | 116.875 | 4.60 | 4.48 | 5.76 | -0.25 | 326 |
| LUKOIL'20 6.125% | USD | 09/11/20 | 110.125 | 110.875 | 4.63 | 4.53 | 6.57 | -0.60 | 312 |
| LUKOIL'22 6.656% | USD | 07/06/22 | 115.000 | 115.750 | 4.73 | 4.64 | 7.46 | -0.50 | 301 |
| **МТС** | | | | | | | | | |
| MTS'20 8.625% | USD | 22/06/20 | 117.625 | 118.375 | 5.79 | 5.69 | 5.97 | -0.33 | 442 |
| **НОВАТЭК** | | | | | | | | | |
| NOVATEK'16 5.326% | USD | 03/02/16 | 106.250 | 107.000 | 3.39 | 3.17 | 3.20 | 1.49 | 277 |
| NOVATEK'21 6.604% | USD | 03/02/21 | 114.875 | 115.500 | 4.47 | 4.39 | 6.74 | -0.38 | 293 |
| **Северсталь** | | | | | | | | | |
| SEVERSTAL'13 9.75% | USD | 29/07/13 | 106.750 | 107.100 | 2.45 | 2.09 | 0.92 | | 206 |
| SEVERSTAL'14 9.25% | USD | 19/04/14 | 109.250 | 109.750 | 3.48 | 3.18 | 1.54 | -0.10 | 306 |
| SEVERSTAL'17 6.7% | USD | 25/10/17 | 102.750 | 103.250 | 6.07 | 5.96 | 4.39 | -0.13 | 517 |
| **ТМК** | | | | | | | | | |
| TMK'18 7.75% | USD | 27/01/18 | 98.167 | 99.167 | 8.17 | 7.94 | 4.51 | -0.32 | 732 |
| **ТНК** | | | | | | | | | |
| TNK-BP'13 7.5% | USD | 13/03/13 | 103.440 | 106.440 | 1.35 | -3.69 | | | |
| TNK-BP'15 6.25% | USD | 02/02/15 | 106.875 | 107.475 | 3.31 | 3.06 | 2.31 | -0.13 | 281 |
| TNK-BP'16 7.5% | USD | 18/07/16 | 113.125 | 113.625 | 3.85 | 3.72 | 3.47 | -0.13 | 316 |
| TNK-BP'17 6.625% | USD | 20/03/17 | 111.374 | 112.380 | 3.89 | 3.67 | 3.97 | | 306 |
| TNK-BP'18 7.875% | USD | 13/03/18 | 118.260 | 119.277 | 4.16 | 3.98 | 4.57 | -0.03 | 314 |
| TNK-BP'20 7.25% | USD | 02/02/20 | 117.054 | 118.083 | 4.53 | 4.38 | 6.01 | -0.10 | 315 |
| **ЧАСТНЫЕ БАНКИ** | | | | | | | | | |
| **Альфа-Банк** | | | | | | | | | |
| ALFA BANK'13 9.25% | USD | 24/06/13 | 104.133 | 104.990 | 4.21 | 3.20 | 0.82 | -0.05 | 385 |
| ALFA BANK'15 8% | USD | 18/03/15 | 105.478 | 106.439 | 5.68 | 5.29 | 2.31 | -0.05 | 523 |
| ALFA BANK'17 7.875% | USD | 25/09/17 | 105.452 | 106.452 | 6.60 | 6.37 | 4.20 | -0.01 | 575 |
| **Номос Банк** | | | | | | | | | |
| NOMOS BANK'12 9.25% | USD | 17/12/12 | 102.000 | 102.250 | 2.99 | 2.24 | 0.33 | | 264 |
| NOMOS BANK'13 6.5% | USD | 21/10/13 | 102.309 | 102.809 | 4.45 | 4.01 | 1.12 | 0.31 | 408 |
| NOMOS BANK'15 8.75% | USD | 21/10/15 | 104.600 | 105.100 | 7.10 | 6.92 | 2.77 | -0.25 | 662 |
| **Промсвязьбанк** | | | | | | | | | |
| PROMSVYAZB'13 10.75% | USD | 15/07/13 | 104.877 | 105.127 | 5.14 | 4.87 | 0.88 | -0.25 | 480 |
| PSB FINANC'14 6.2% | USD | 25/04/14 | 98.873 | 99.373 | 6.91 | 6.59 | 1.59 | -0.38 | 659 |
| PROMSVYAZB'15 12.75% | USD | 27/05/15 | 109.744 | 110.744 | 8.70 | 8.31 | 2.38 | -0.49 | 835 |
| PROMSVYAZB'16 11.25% | USD | 08/07/16 | 106.355 | 108.355 | 9.26 | 8.66 | 3.24 | -0.01 | 877 |
| **ХКФБ** | | | | | | | | | |
| HOME CREDIT'14 7% | USD | 18/03/14 | 103.002 | 103.502 | 4.99 | 4.67 | 1.48 | 0.01 | 461 |

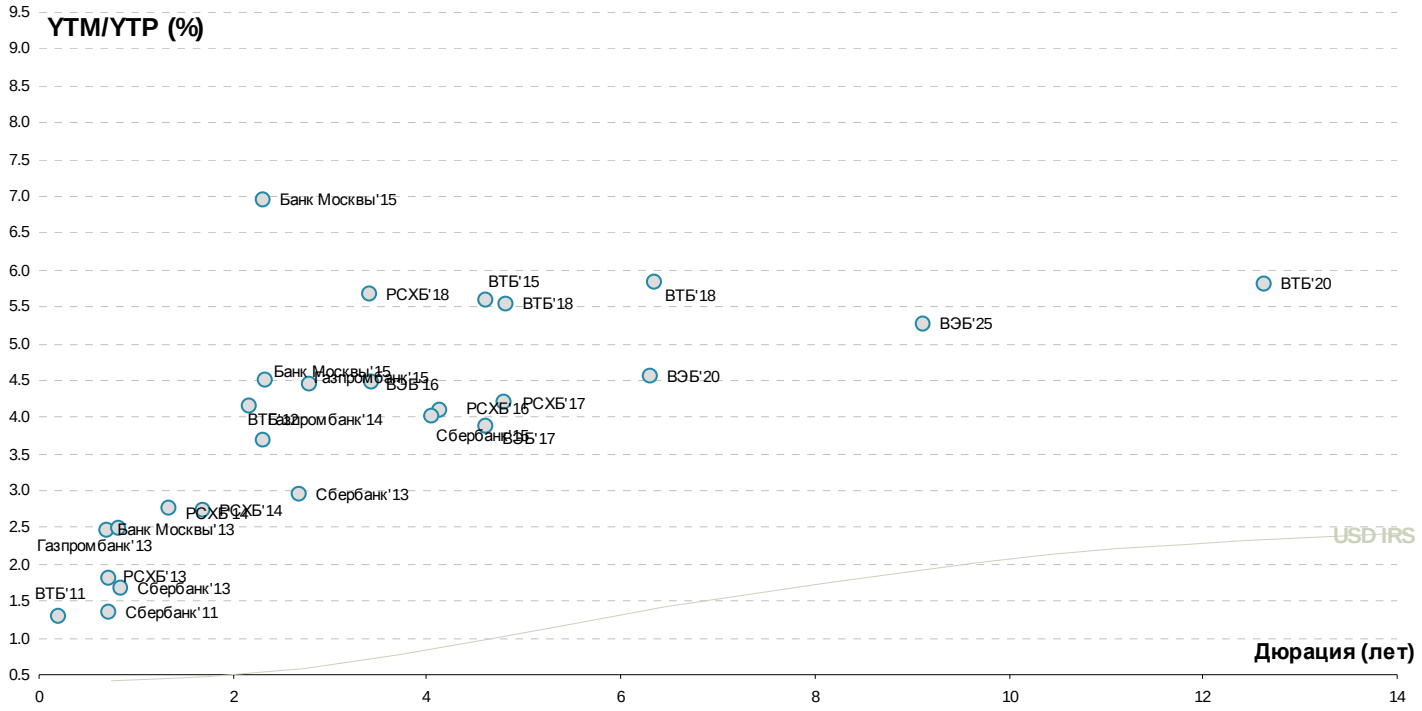
## Россия




## Госкомпании

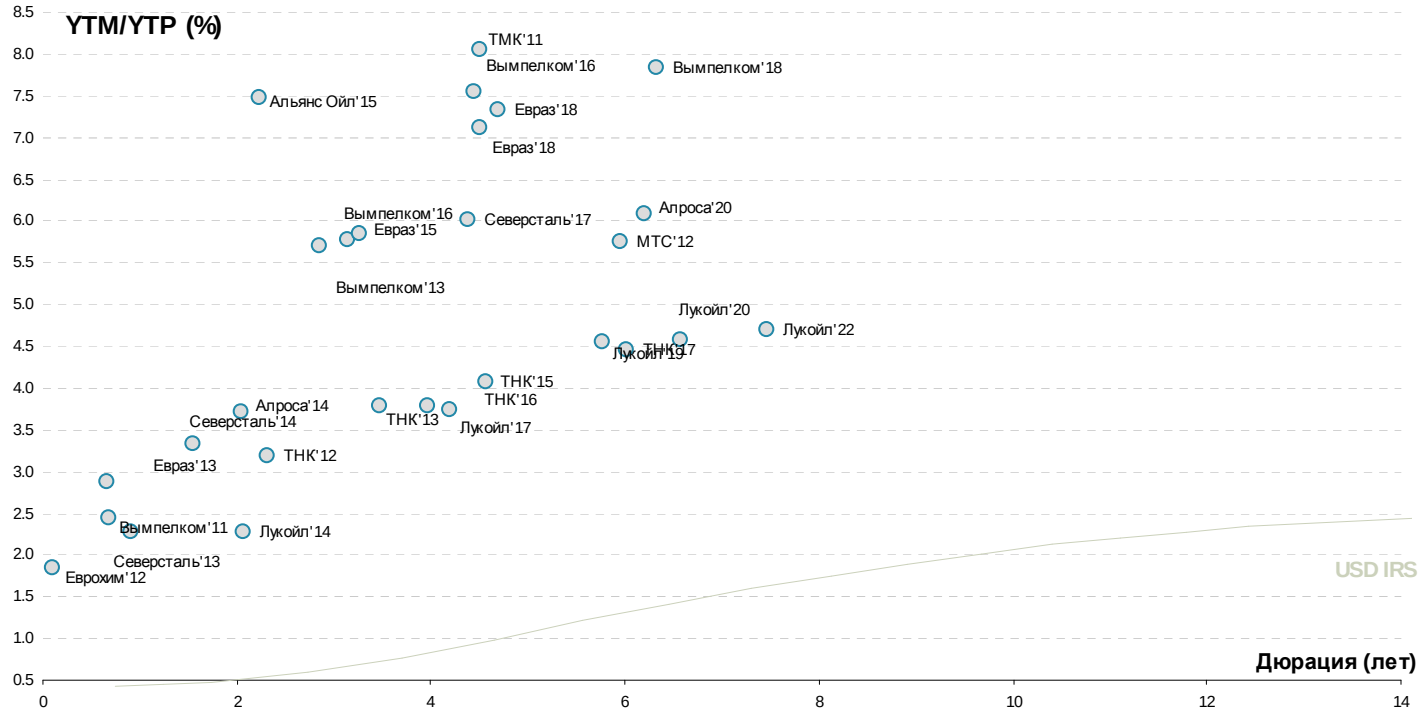


## Госбанки



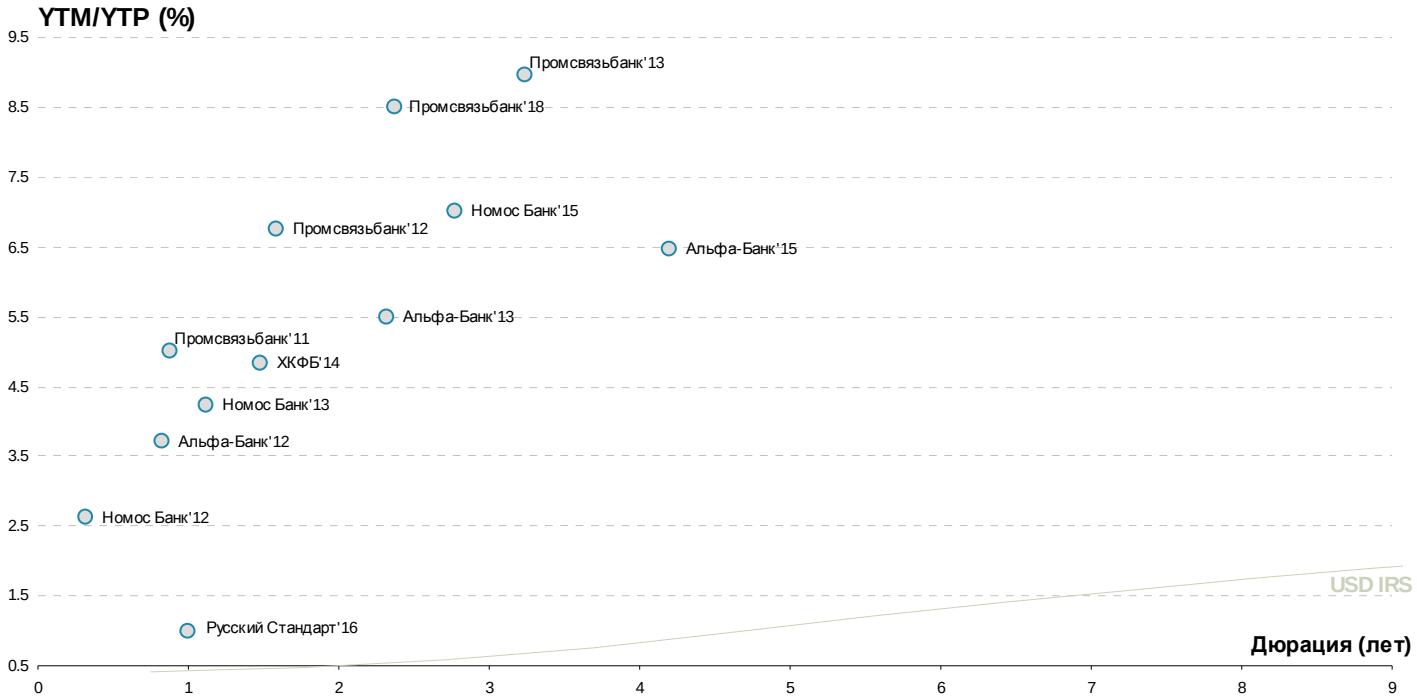

*Источник: REUTERS*

## Частные компании




*Источник: REUTERS*

## Частные банки




*Источник: REUTERS*

# 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** | Кирилл Копелович | kopelovich@zenit.ru |
| **Зам.начальника Департамента** | Константин Поспелов | konstantin.pospelov@zenit.ru |

**Управление продаж**

| | | |
|---|---|---|
| Валютные и рублевые облигации | Юлия Шабанова | j.shabanova@zenit.ru |
| Валютные и рублевые облигации | Максим Симагин | m.simagin@zenit.ru |
| Валютные и рублевые облигации | Александр Валканов | a.valkanov@zenit.ru |
| Валютные и рублевые облигации | Юлия Паршина | y.parshina@zenit.ru |

| | | |
|---|---|---|
| **Аналитическое управление** | Акции | research@zenit.ru |
| | Облигации | firesearch@zenit.ru |
| Макроэкономика | Владимир Евстифеев | v.evstifeev@zenit.ru |
| Макроэкономика/кредитный анализ | Кирилл Сычев | k.sychev@zenit.ru |
| Кредитный анализ | Евгений Чердаков | e.cherdakov@zenit.ru |
| Кредитный анализ | Наталья Талейко | n.taleyko@zenit.ru |
| Количественный анализ | Дмитрий Чепрагин | d.chepragin@zenit.ru |
| Акции | Евгения Лобачева | eugenia.lobacheva@zenit.ru |

| | | |
|---|---|---|
| **Управление рынков долгового капитала** | | ibcm@zenit.ru |
| Рублевые облигации | Денис Ручкин | d.ruchkin@zenit.ru |
| | Андрей Пашкевич | a.pashkevich@zenit.ru |
| | Фарида Ахметова | f.akhmetova@zenit.ru |
| | Марина Никишова | m.nikishova@zenit.ru |
| | Вера Панова | vera.panova@zenit.ru |
| | Алексей Басов | a.basov@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.

БАНК ЗЕНИТ
БАНКОВСКАЯ ГРУППА ЗЕНИТ

16.08.2012