

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Германия на пути к рецессии на фоне проблем периферии

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Ставки МБК слегка подросли в преддверии платежей по НДС и акцизам
- Рубль удержался от снижения

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды коррекция продолжается
- Локальный рынок еще немного подешевел

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

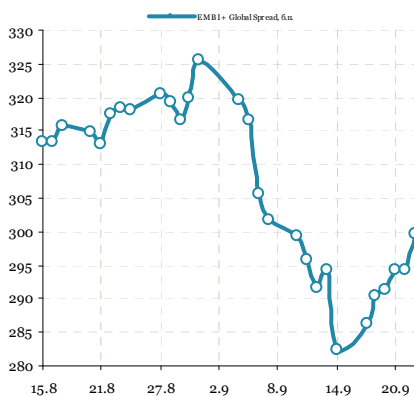
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.71	▼ -0.04	1.39	2.30
UST 10-2Y sprd	145	▼ -4	117	193
EMBI+ Glob.	300	▲ 5	282	441
EMBI+ Rus sprd	183	▲ 5	161	332
Russia 30 yield	3.04	▼ -0.02	2.85	4.45
Денежный рынок				
Libor-3m	0.37	▼ 0.00	0.37	0.47
Euribor-3m	0.23	▼ 0.00	0.23	0.83
MosPrime-1m	6.45	■ 0.00	5.78	6.89
Корсчета в ЦБ	824.5	▲ 11.6	446	1032
Депоз. в ЦБ	76.5	▲ 9.1	61	369
NDF RU 3m	6.2	▲ 0.0	5	7
Валютный рынок				
USD/RUB	31.157	▲ 0.137	28.98	33.67
EUR/RUB	40.248	▼ -0.086	38.48	41.81
EUR/USD	1.293	▼ -0.005	1.21	1.34
Корзина ЦБ	35.16	▲ 0.069	33.33	37.28
DXU Индекс	79.518	▲ 0.190	78.71	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1509.6	▲ 0.7%	1228	1723
Dow Jones	13558.9	▼ -0.15%	12101	13597
DAX	7411.0	▼ -0.03%	5969	7452
Nikkei 225	9069	▲ 0.25%	8296	10255
Shanghai Comp.	2033.2	▼ -0.19%	2025	2452
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	107.9	▼ -0.42%	88	123
Нефть Brent	109.8	▲ 0.64%	89	126
Золото	1764.5	▲ 0.20%	1540	1773
CRB Index	305.9	▼ -0.99%	267	321

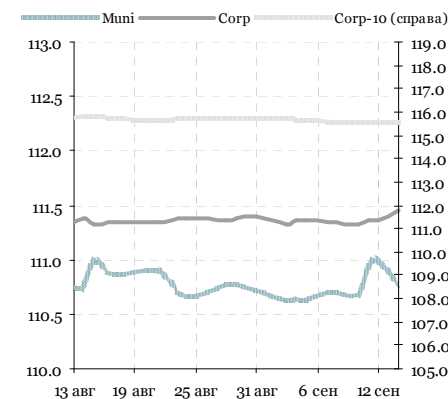
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETVI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETVI

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Price Return				
OFZ	117.2	▲ 0.18	107.5	117.2
Muni	110.8	▼ -0.20	110.5	112.8
Corp	111.5	▲ 0.11	110.7	112.1
Corp-10	115.6	▼ -0.01	115.5	117.8
Total Return				
OFZ	267.4	▲ 0.50	233.3	267.4
Muni	343.6	▼ -0.42	324.8	344.1
Corp	342.8	▲ 0.49	323.6	343.8
Corp-10	343.8	▲ 0.19	324.6	343.8
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	2 921	▲ 2 123	0	22 514
Muni	598	▼ -120	10	6 146
Corp	6 525	▲ 880	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ОАО «ФСК ЕЭС» планирует 26 сентября начать сбор заявок инвесторов на приобретение 15-летних облигаций 25-й серии объемом 15 млрд руб. Индикативная ставка купона находится в диапазоне 8,5-8,75% годовых, что соответствует доходности к 4-летней оферте на уровне 8,68-8,94% годовых. /Интерфакс/

ОАО «Меткомбанк» начал сбор заявок инвесторов на приобретение биржевых облигаций серии БО-05 объемом 1,5 млрд руб. /Интерфакс/

ООО «МегаФон Финанс» предварительно планирует открыть с 3 по 4 октября книгу заявок на покупку облигаций на 10 млрд руб. Ориентир купона 10-летних облигаций серии 05 составляет 8,20-8,45% годовых, что соответствует доходности к двухлетней оферте в диапазоне 8,37-8,63% годовых. /Bloomberg/

Evraz Group Plc рассматривает заявки компаний UCLH, Globaltrans Investment Plc, ЗАО «Нефтегазсервис» и ООО «Финансовый альянс» на покупку железнодорожного оператора «Евразтранс» по цене не менее 250 млн долл.

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 24.09.2012 – понедельник

- **Выплата купона:** Москва, 56 (7%, 705.8 млн руб.), Банк Зенит, БО-02 (7.75%, 195.3 млн руб.), Русский Международный Банк, 03 (10.5%, 57.9 млн руб.), Газпромбанк, 2015 (LPN) (6.5%, 32.5 млн долл.), Администрация города Томска, 34003 (10.13%, 14.1 млн руб.), Банк Санкт-Петербург, БО-02 (9%, 224.4 млн руб.), Сбербанк России ОАО, 2017 (LPN) (5.4%, 33.7 млн руб.), Вымпелком, 02 (8.85%, 441.3 млн руб.)
- **Размещение:** Магнит, БО-07 (5 млрд руб.)
- **Оферта:** Русфинанс Банк, 08 (2 млрд руб.)

Сегодня: 25.09.2012 – вторник

Статистика США: Consumer Confidence

- **Выплата купона:** ЮТэйр-Финанс, БО-01 (12.5%, 46.7 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-02 (12.5%, 46.7 млн руб.), Россельхозбанк, 2013, RUR (LPN) (7.5%, 1.1 млрд руб.), АЛРОСА, 20 (8.95%, 66.9 млн руб.), АЛРОСА, 22 (8.25%, 164.5 млн руб.), ФСК ЕЭС, 06 (7.15%, 356.5 млн руб.), ФСК ЕЭС, 08 (7.15%, 356.5 млн руб.), ФСК ЕЭС, 10 (7.75%, 386.4 млн руб.), Альфа-Банк, 2017-2 (LPN) (7.875%, 39.3 млн долл.), Краснодарский край, 34003 (8.3%, 165.5 млн руб.), ФГУП «Почта России», 01 (8.25%, 287.9 млн руб.), ИСО ГПБ-Ипотека Два, А (7.5%, 20.9 млн руб.), БНП Париба Банк, 01 (7.7%, 76.7 млн руб.), ОТП Банк, 02 (8.25%, 102.8 млн руб.), РЖД, 2031, GBP (LPN) (7.487%, 24.3 млн руб.), Банк Русский стандарт, БО-02 (9%, 224.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-С, RUB (RMBS, FRN) (12%, 2.7 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-С, RUB (RMBS, Step Up) (11.5%), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Да, RUB (RMBS) (12%, 3.5 млн долл.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (12%, 1.2 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-В, RUB (RMBS, FRN) (9%, 3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А1, RUB (RMBS, Step Up) (8.35%, 13.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-В, RUB (RMBS, Step Up) (8.75%, 2.3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А2 (RMBS, Step Up) (8.5%, 2.2 млн руб.), Национальный капитал, 01 (13%, 194.4 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-А (RMBS) (8.75%, 21.9 млн руб.)
- **Оферта:** Русфинанс Банк, 09 (2 млрд руб.), ТехноНИКОЛЬ-Финанс, БО-02 (2.5 млрд руб.), Транскапиталбанк, 02 (1.8 млрд руб.), Гражданские самолеты Сухого, 01 (5 млрд руб.)
- **Размещение:** Московский Кредитный банк, БО-02 (3 млрд руб.), Первый Объединенный Банк (Первобанк), БО-03 (2 млрд руб.), РЕСО Гарантия, 02 (5 млрд руб.), Тульская область, 34002 (5 млрд руб.)

Завтра: 26.09.2012 – среда

Статистика США: New Home Sales

- **Выплата купона:** Россия, 25065 (12%, 1.3 млрд руб.), НИА ВТБ 001, 1А (10.5%, 17.7 млн руб.), Газпром, 2014-4 (LPN) (10.5%, 21 млн долл.), Транснефть, 03 (10.15%, 6.6 млрд руб.), Россия, 35006(ГСО-ППС) (6.05%, 1.2 млрд руб.), Россия, 35007(ГСО-ППС) (6.9%, 688.2 млн руб.), ТехноНИКОЛЬ-Финанс, БО-03 (13%, 129.6 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-04 (9%, 33.6 млн руб.), АБСОЛЮТ БАНК, БО-02 (9%, 226.8 млн руб.), Казань, 34008 (8%, 39.9 млн руб.), Россия, 46012 (3.741%, 1.5 млрд руб.), Россия, 36006(ГСО-ФПС) (8.15%, 1.3 млрд руб.), Калужская область, 34004 (9.91%, 7.4 млн руб.)
- **Оферта:** Банк ЗЕНИТ, БО-02 (5 млрд руб.), Русский Международный Банк, 03 (1.1 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Германия на пути к рецессии на фоне проблем периферии

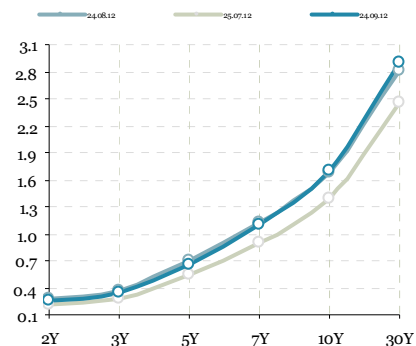
Настроения на глобальных площадках в начале новой недели определялись в большей степени отыгрыванием негатива из Европы, связанного как с продолжающей поступать негативной статистикой, так и с отсутствием прогресса в переговорах Греции и Испании с международными кредиторами. Утром был опубликован индекс деловой активности Германии за сентябрь, который неожиданно снизился с 102.3 п. до 101.4 п. (прогноз – 102.5 п.). Характерно, что все компоненты индекса снизились, при этом наиболее значительно потерял индекс деловых ожиданий (-1 п., до 93.2 п.). Текущее значение этого индекса в среднесрочной перспективе соответствует отрицательному темпу роста ВВП. Таким образом, сильнейшая европейская экономика может начать сокращения уже в 3-4 кварталах текущего года, усугубляя обстановку с расширением финансирования проблемных экономик. В частности, не исключено, что именно эти ожидания заставляют германских чиновников выступать категорически против любого увеличения объемов финансовой помощи для Греции, что в итоге заводит переговоры страны с международными кредиторами в тупик. Риски для Германии базируются также на том, что с началом нового раунда количественного смягчения со стороны ФРС США, единая европейская валюта продолжит восстанавливать позиции, оказывая дополнительное давление на ВВП ФРГ.

В отношении Испании процесс также идет крайне медленно. Премьер Рахой ведет переговоры с международными кредиторами, смещая акценты не на попытку усиления контроля за налогово-бюджетной политикой, считая это посягательством на суверенитет, на проведение структурных реформ. Этот факт затягивает переговоры, хотя и Испания явно не торопится с этим решением до «отладки» процесса выкупа бондов с вторичного рынка Европейским ЦБ (программа ОМТ), а также прохождения через региональные выборы в регионах Галисия и Страна Басков, которые намечены на 21 октября.

Текущий новостной поток по Европе вновь указывает инвесторам, насколько сложной выглядит ситуация в регионе. Экономический вектор явно направлен вниз, при этом рецессия распространяется внизу вверх, со слабых экономик на более сильные (в которых первые некогда являлись одними из ключевых внешних потребителей).

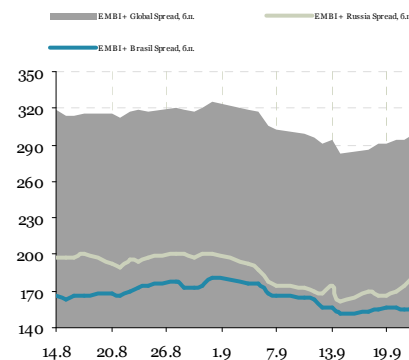
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



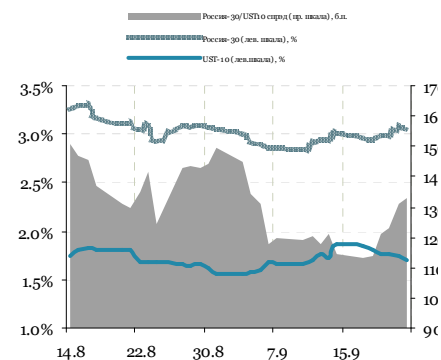
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



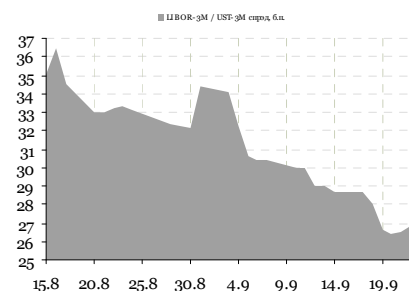
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Ставки МБК слегка подросли в преддверии платежей по НДС и акцизам

Условия локального денежно-кредитного рынка в понедельник немного ухудшились на фоне предстоящих налоговых платежей. На рынке МБК стоимость кредитов овернайт поднялась до 5.75-6.00% годовых, междилерское репо обходилось в среднем под 6.00% годовых (+20 бп). На аукционах репо с ЦБ РФ банки привлекли на 1 день 70 млрд руб. при спросе в 72 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 20.7 млрд руб., составив 901.0 млрд руб.

Сегодня предстоит провести платежи по налогу на добычу полезных ископаемых и акцизам, что в сумме потребует из системы порядка 200 млрд руб. Учитывая текущее состояние рынка, эти платежи могут заставить краткосрочные процентные ставки продолжить рост, особенно если аукционы прямого репо с ЦБ РФ оставят большой неудовлетворенный спрос.

Рубль удержался от снижения

Валютные торги понедельника завершились нейтрально для рубля, который закрылся без изменения по отношению к бивалютной корзине на отметке 35.24 руб. Предприняв попытку к ослаблению в начале дня и установив внутрисессионный минимум на уровне 35.43 руб., рубль к вечеру смог восстановить утраченные позиции. За этот же период котировки нефти снизились с уровня 111.5 до 110 долл. за барр. Сегодня настроения на внешних площадках выглядят не намного лучше вчерашнего дня, однако и поводов для снижения у рубля пока немного. Все это предполагает продолжение консолидации на текущих уровнях.

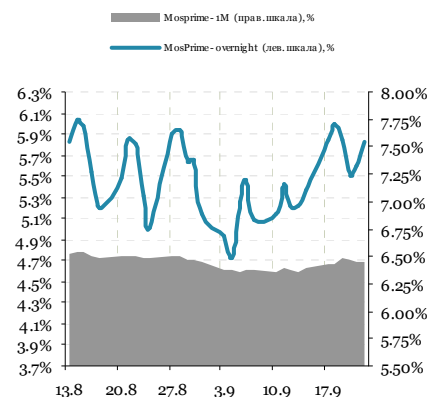
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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		70
Вторник	Уплата налогов	НДПИ и акцизы (около 200 млрд руб.)
	Аукцион Казначейства	91 день, 50 млрд руб., от 6.9% годовых
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 25080, 25 млрд руб.
	Выплата купонов ОФЗ	2.6 млрд руб.
	Возврат Фонду ЖКХ	0.6 млрд руб.
Четверг	Аукцион Казначейства	91 день, 50 млрд руб., от 6.9% годовых
Пятница	Уплата налогов	Налог на прибыль (около 160 млрд руб.)
	Возврат Казначейству	29.4 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

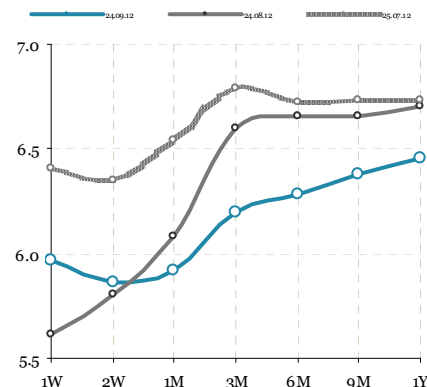
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды коррекция продолжается

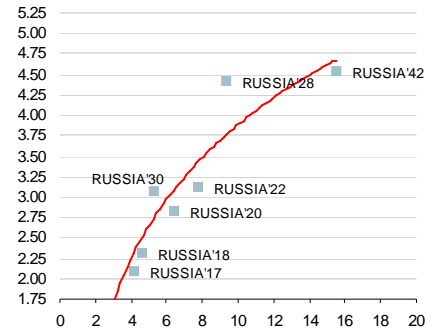
Российские евробонды в начале недели продолжили коррекцию на фоне слабой европейской статистики, питающей риски неопределенности относительно будущего монетарного союза. Цены суверенных бумаг завершили день на отрицательной территории и расширили спрэды к UST. Котировки вдоль суверенной кривой опустились на 25-50 бп, дальний выпуск Россия'42 завершил день немногим выше отметки 117.5%, потеряв порядка 75 бп. Корпоративный сектор завершил день фронтальным снижением цен, но выглядел достаточно ровно, потеряв в ценах в среднем по рынку в районе 50 бп.

Локальный рынок еще немного подешевел

Начало новой недели не принесло изменений на локальный долговой рынок. Котировки по-прежнему находятся под влиянием внешней неопределенности, волатильности на валютном рынке. Дополнительное давление на цены в ближайшие дни окажут налоговые выплаты, обуславливающие рост краткосрочных ставок на денежном рынке. В результате, котировки вдоль кривой ОФЗ в понедельник продолжили движение вниз достаточно умеренными темпами, а сделки в наиболее ликвидных дальних выпусках к концу дня проходили в среднем на 10 бп ниже пятничных отметок. Корпоративный сектор по сравнению с пятницей несколько оживился, а активность сместилась чуть дальше по кривой. В районе средней дюрации спрос наблюдался в бумагах Башнефти и Металлоинвеста, котировки которых однако лишь незначительно отклонились от пятничных уровней.

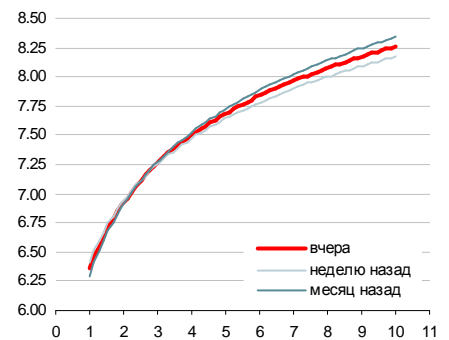
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



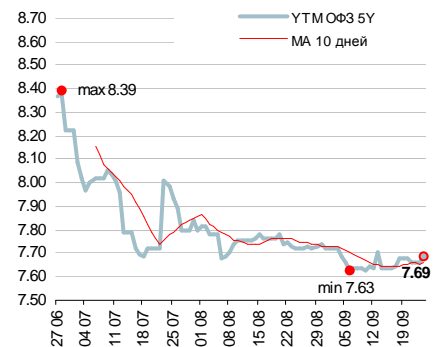
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



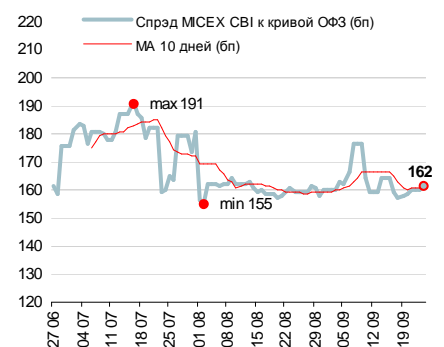
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



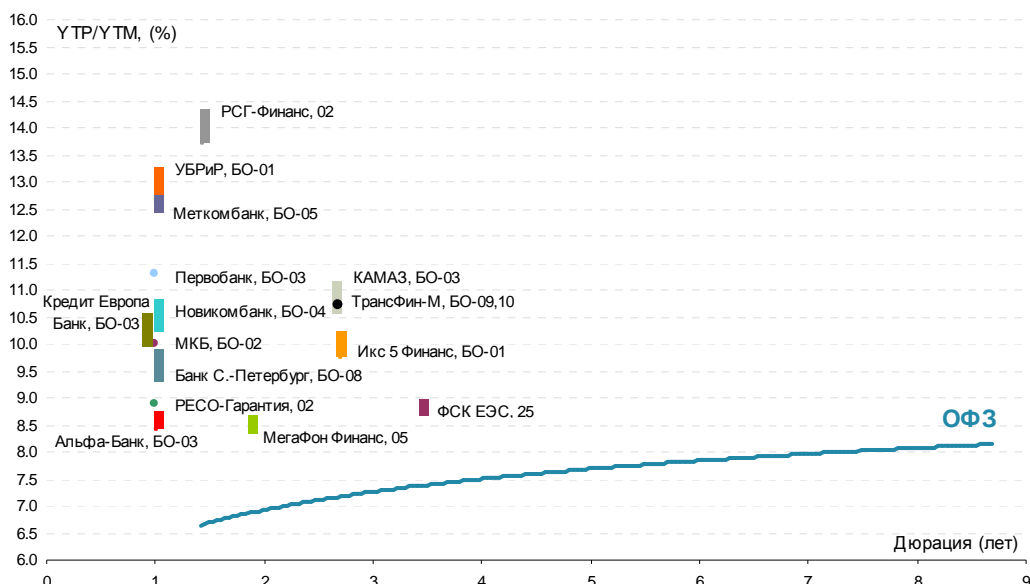
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Закрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
Трансфин-М, БО-09	NR	нет	2 000	10.78	н/д	24.09.2012	нет / 2.64 г.	нет / 3 г.
Трансфин-М, БО-10	NR	нет	2 000	10.78	н/д	24.09.2012	нет / 2.64 г.	нет / 3 г.
Первобанк, БО-03	- / B3 / -	да	2 000	11.30	20.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
РЕСО-Гарантия, 02	BB+ / - / -	да	5 000	8.89	21.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 10 лет
МКБ, БО-02	B+ / B1 / BB-	да	3 000	9.99	21.09.2012	25.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Альфа-Банк, БО-03	BB / Ba1 / BBB-	да	10 000	8.42-8.68	26.09.2012	28.09.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
УБРиР, БО-01	B / - / -	да	2 000	12.63-13.16	28.09.2012	02.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
ФСК ЭЭС, 25	BBB / Baa2 / -	да	15 000	8.68-8.94	28.09.2012	02.10.2012	нет / 3.46 г.	4 г. / 15 г.
КАМАЗ, БО-03	NR	нет	2 000	10.51-11.04	01.10.2012	04.10.2012	нет / 2.64 г.	нет / 3 г.
Банк Санкт-Петербург, БО-08	- / Ba3 / -	да	5 000	9.36-9.88	02.10.2012	08.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Новикомбанк, БО-04	- / B2 / -	да	2 000	10.25-10.78	02.10.2012	09.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Меткомбанк, БО-05	- / B2 / -	да	1 500	12.36-12.63	05.10.2012	09.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Кредит Европа Банк, БО-03	- / Ba3 / BB-	да	5 000	9.99-10.51	05.10.2012	09.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
МегаФон Финанс, 05	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.37-8.63	04.10.2012	11.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Икс 5 Финанс, БО-01	B+ / - / -	да	5 000	9.73-10.15	н/д	XX.10.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
РСГ-Финанс, 02	B- / - / -	да	2 500	13.69-14.22	н/д	н/д	нет / 1.41 г.	1.5 г. / 3 г.

Источник: Bloomberg, Cbonds, Finam

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Bid cover / Размещ объем	Ориентир УТР/УТМ	Фактическая УТР/УТМ	Дата размещения	Амортизация/Дюрация
Магнит, БО-07	BB- / - / -	да	5 000	2.5 / 100%	9.20-9.46	9.10	24.09.2012	нет / 2.68 г.
Трансфин-М, БО-09	NR	нет	2 000	н/д / 100%	10.78	10.78	24.09.2012	нет / 2.64 г.
Трансфин-М, БО-10	NR	нет	2 000	н/д / 100%	10.78	10.78	24.09.2012	нет / 2.64 г.
МОЭСК, БО-01	BB- / Baa2 / -	да	5 000	н/д / 100%	9.20-9.73	8.99	21.09.2012	нет / 2.68 г.
НЛМК, 07	BBB- / Baa3 / BBB-	да	5 000	1.6 / 100%	8.68-8.78	8.68	20.09.2012	нет / 2.30 г.
Группа ЛСР, 03	- / B2 / B	да	3 000	1.8 / 100%	12.11-12.64	11.83	14.09.2012	нет / 1.42 г.
Росбанк, БО-04	- / Baa3 / BBB+	да	10 000	1.4 / 100%	9.25-9.52	9.52	12.09.2012	нет / 1.86 г.
НЛМК, БО-04	BBB- / Baa3 / BBB-	да	5 000	2.7 / 100%	8.47-8.68	8.42	10.09.2012	нет / 1.88 г.
Промсвязьбанк, БО-07	- / Ba2 / BB-	да	5 000	1.4 / 100%	10.25-10.78	10.41	06.09.2012	нет / 1.86 г.
Элемент Лизинг, БО-01	B / - / -	да	1 000	н/д / 100%	13.65-14.75	14.20	06.09.2012	нет / 1.78 г.
ВТБ, БО-08	BBB / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.14-8.40	8.19	04.09.2012	нет / 1 г.
Пробизнесбанк, 07	- / B2 / B-	да	2 000	н/д / 100%	11.57-12.10	12.10	04.09.2012	нет / 1 г.



Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ОФЗ													
ОФЗ 25069		19/09/12							6.43	0.00			45 000
ОФЗ 25067		17/10/12	100.35	100.36	100.36	-0.06	8	30 183	5.64	0.06			45 000
ОФЗ 26198		02/11/12	100.00	100.02	100.00	-0.02	9	22 707	5.84	0.11			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.39	100.40	100.40	-0.03	8	136 277	5.98	0.33			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.24	100.30	100.30	-0.00	8	5 240	5.94	0.37			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.99	103.15	102.99	-0.16	1	1 851	6.07	0.48			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	99.85	100.07	100.07	-0.08	6	3 775	6.15	0.79			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.40	100.95					6.22	1.02			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.76	100.79	100.79	0.02	6	63 952	6.63	1.42	16		155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.45	109.80	109.50	-0.24	1	10 000	6.71	1.75		23	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.20	109.30	109.25	-0.15	3	6 293	6.87	2.01		39	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	99.10	103.00	102.95	0.41	3	8	6.72	1.99		24	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	99.87	99.97	99.97	0.06	12	2 498	7.13	2.45	3	62	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15		99.70	99.58		3	11 748	7.17	2.57	4	65	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	100.58	100.65	100.60	-0.01	4	13 012	7.27	2.98	1	72	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	96.42	97.40	97.20	-0.25	1	1	7.48	3.01	21	93	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	98.81	99.00	98.85		5	6 706	7.38	3.42	1	77	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	88.00	95.50					8.91	3.43	154	230	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.30	3.71	86	165	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	99.85	100.20	100.05	-0.07	11	113 362	7.52	3.84	5	85	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	99.90	100.17	100.05	0.04	10	3 018 001	7.52	4.00	2	83	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	100.30	100.49	100.30	-0.14	3	732	7.57	4.59		78	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	89.75	90.50	90.50	0.30	2	20 000	7.72	4.63	10	92	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	96.37	97.55	97.20		1	1	7.76	4.75	12	94	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	99.46	99.71	99.50	-0.25	2	50 001	7.74	5.19	2	85	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							8.16	5.65	37	121	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	94.00	94.40	94.40	-0.00	1	5	7.84	6.27		80	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	99.65	99.90	99.65	-0.30	19	66 871	7.80	6.24		77	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	98.70	99.20	99.38	0.38	9	20 433	7.84	7.00		70	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		89.53					8.39	7.54	36	118	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	100.96	101.05	101.05	-0.10	17	75 851	8.19	8.69	5	84	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	86.50	87.88	87.00	-1.00	1	1	8.34	10.91	1	74	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		93.33					7.86	10.55		30	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.50	99.70					7.36	0.83	116	94	15 000
НЛМК													
НЛМК ВО5		30/10/12	100.38	100.40	100.38	-0.08	7	12 442	6.79	0.10		83	10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	100.45	101.00	100.50	0.05	4	1 026	7.14	0.19		102	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.00	100.35	100.22	-0.03	2	10 001	7.35	0.44		106	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.01	100.83					7.73	0.71	166	134	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.70	100.75					7.73	0.71	166	134	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	86.00	100.15					8.40	1.84	154	192	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.00	101.70	101.60		3	10 002	8.27	1.93	137	179	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22							8.68	2.30	164	218	00000 000
ММК													
ММК ВО1		15/11/12	91.00	100.00					7.30	0.14		126	5 000
ММК ВО5		04/04/13	100.05	100.15	100.05	-0.05	3	41	7.69	0.51	190	137	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	94.00	100.15					8.10	0.87	186	167	5 000
ММК ВО4		27/02/14	87.01	99.50	99.08	-0.10	4	70	8.52	1.37	190	205	5 000
ММК ВО6		10/06/14							8.90	1.69	211	243	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.70	97.90	97.70	-0.20	3	19	8.82	1.72	202	235	5 000
Севсталь													
Севсталь ВО2		15/02/13	100.90	100.98	100.90	-0.15	1	6 860	7.49	0.39		122	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	86.07	101.03	100.95	-0.05	2	10 001	7.36	0.39		109	5 000
Алроса													
Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.41	100.60	100.48	-0.05	6	266	7.81	0.73	171	141	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15							7.94	0.73	185	154	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.20	101.50	101.20	-0.03	1	30	8.72	2.45	162	221	7 000
Алроса 20		23/06/15							8.73	2.41	165	222	3 000
Евраз													
Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.50	100.60	100.60		5	1 447	8.13	0.49		182	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.50	100.95	98.01	-2.64	2	2	14.04	0.49		773	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.95	108.00	107.98	-0.12	1	8 250	9.36	1.78	253	288	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.60	108.68	107.60	-0.50	1	1	9.57	1.78	274	309	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	99.95	100.48					10.27	2.63	311	375	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	99.75	100.25					10.07	2.63	291	355	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	91.00	94.70					10.55	3.16	324	398	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	94.15	94.60					10.44	3.15	314	387	15 000
Металлоинвест													
Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.65	99.80	99.76	0.05	2	76	9.32	2.27	229	282	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.60	99.80	99.79	0.04	5	55 002	9.30	2.27	227	280	10 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.60	99.80	99.79	0.04	5	55 002	9.30	2.27	227	280	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.60	99.80	99.80	0.30	2	350	9.30	2.28	226	280	10 000
Мечел													
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.33	100.00	100.70	0.79	5	1 083	10.76	0.79	460	435	5 000
Мечел 5	16/10/12	09/10/18	100.12	100.25	100.15	-0.05	3	4	10.22	0.06			5 000
Мечел ВО1	11/11/11	09/11/12	97.00	99.99	100.00	0.02	5	710	8.14	0.13		213	5 000
Мечел ВО2		12/03/13	98.75	99.35	99.35	0.15	6	1 607	11.53	0.46		523	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.85	99.35					11.88	0.56	601	554	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.60	96.96	96.96	0.46	6	2 870	12.28	0.70	623	589	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	92.21	93.00	93.00	0.05	2	8 025	14.38	1.34	778	791	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.66	93.00	93.00		2	1 001	14.38	1.34	778	791	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.57	97.10	96.50	-0.40	3	2 712	13.50	1.31	692	703	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.56	2.52	444	504	5 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.56	2.16	457	507	2 000
Мечел ВО7		07/04/15							11.56	2.52	444	504	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.56	2.52	444	504	3 000
Мечел ВО12		07/04/15							11.56	2.52	444	504	3 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	89.13	91.00	91.00		3	13	14.30	2.58	716	778	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	91.01	92.50					13.59	2.59	645	707	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	86.01	87.44	87.45	2.44	7	7	13.17	3.13	587	660	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	84.26	90.00	86.50	0.39	2	9 001	13.55	3.12	625	698	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	84.56	87.49	86.00	-0.25	2	2	13.74	3.14	644	717	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.06	100.10					9.03	1.01	266	257	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.60	100.79	100.75		4	102	8.48	0.76	236	207	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.50	98.49	98.10	-0.80	1	6 600	12.44	1.16	596	598	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	94.01	95.50					14.95	1.57	822	848	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.75	100.98	100.75	-0.10	1	1	8.55	0.19		243	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	95.62	99.00	95.84	0.13	6	92	11.81	1.55	509	534	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.85	92.95	92.95	-0.02	17	1 644	14.35	1.38	773	788	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.51	88.00	88.00		6	193	14.77	2.24	775	827	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 7		07/11/12	99.92	100.10					7.15	0.12		115	5 000
РЖД ВО1		05/12/12	100.52	100.82					6.72	0.20		60	15 000
РЖД 9	18/05/11	13/11/13	99.51	99.71	99.51	0.01	9	80 056	7.48	1.09	106	102	15 000
РЖД 10		06/03/14	110.51	110.70	110.70	0.20	4	12 323	7.20	1.35	60	73	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.41	102.45	102.45	-0.10	1	3 300	7.98	2.15	99	149	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.40	99.70					8.06	2.78	86	153	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.00	99.25	99.10		2	11 900	8.35	3.21	103	177	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.92	100.22					8.31	4.75	67	149	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20							7.47	0.95	115	102	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20							7.49	0.95	117	104	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.20	101.33	101.20		1	1 000	7.87	1.59	113	140	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	95.91	102.00					7.94	1.88	106	146	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20							8.06	2.63	90	154	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.20	98.70					8.12	2.73	93	159	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19		99.72	99.60	-0.11	2	2	8.40	3.07	112	184	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	96.80	97.50					8.89	4.13	136	218	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	96.80	97.50					8.89	4.13	136	218	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.20	97.00	96.05	0.05	2	76 454	9.02	4.67	139	222	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21		98.50	97.00	0.31	1	10 000	9.20	6.18	134	217	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.90	99.99					9.27	2.29	223	277	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.00					9.83	3.80	237	317	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	98.01	99.10	98.61	-0.13	6	132	10.58	1.07	417	412	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	97.00	99.00					8.99	2.92	175	245	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.70					9.11	3.08	182	255	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.11	3.08	182	255	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	85.00						9.41	3.71	197	276	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.65	3.71	221	300	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.43	3.71	199	278	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16							9.37	1.38	275	290	7 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
НЕФТЬ и ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14	100.01	100.06	100.02	-0.07	5	86 974	7.37	0.12		137	15 000
Газпром А9		12/02/14	99.10	100.30					7.03	1.33	44	56	5 000
Газпром А11		24/06/14	110.50	111.00	111.00	0.50	4	696	7.06	1.58	33	59	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12	100.37	100.66	100.70		2	200	5.95	0.22			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12	100.36						6.18	0.22		2	5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.00	100.30					6.61	1.15	14	15	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16		100.00					8.87	0.31		263	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13		100.02					7.33	0.52	151	101	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13		100.15					7.37	0.52	155	105	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.80	100.85	100.85	-0.05	4	140 000	8.00	2.17	100	151	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.80	110.10					8.39	2.96	114	184	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.70	103.00	100.75		1	1 368	8.41	2.98	115	186	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.30	104.43					8.77	4.34	120	202	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	97.01	98.96					8.68	4.40	110	192	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.00	100.18					7.62	0.73	152	122	10 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.25	100.00	99.50	0.23	1	500	7.94	0.97	161	149	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	101.11	101.29	101.25	-0.02	3	1 598	7.00	0.23		82	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	101.21	101.25	101.24	-0.09	1	38 406	7.05	0.23		87	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	101.21	101.25	101.22	-0.08	16	55 468	7.13	0.23		95	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.50	101.95	101.90	0.15	8	114 460	7.79	1.13	133	133	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.00	101.20	101.15	0.05	6	70 000	8.63	2.19	163	214	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.25	99.57	99.70		1	10 000	10.35	0.82	415	393	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	97.00	98.50	97.72	-0.13	10	1 106	11.38	1.30	481	491	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	94.01	96.00	96.25	2.00	10	52 852	10.33	3.15	303	376	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	94.01	96.32	96.35	2.10	7	6 187	10.30	3.15	299	373	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	98.76	99.25	99.00	-0.41	5	400	13.90	0.81	772	748	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	99.90					9.68	3.22	236	310	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.55	100.60	100.60	-0.10	9	27 486	7.99	0.76	186	158	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.28	100.31	100.28	-0.02	7	8 429	7.52	0.24		132	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.05	100.25	100.03	-0.02	5	5 750	8.08	0.33		184	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.85	100.06	99.90	-0.10	4	2 500	8.05	0.47		175	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.76	100.09	99.80	-0.10	3	620	8.28	0.47		198	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	100.09	100.00	-0.10	2	990	7.82	0.47		152	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.36	100.15	100.00	0.40	10	91 259	7.61	1.02	124	115	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.06						8.18	1.41	154	171	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.05	100.10					8.24	1.41	160	177	5 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	191	171	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.21	100.15	100.00		1	60 000	8.94	2.03	200	246	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.18					8.25	0.89	199	181	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					8.46	0.82	227	204	5 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	98.77	99.50	99.50		1	20 000	8.07	0.43		179	5 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.05	99.65	99.65		1	6 460	7.89	0.29		166	10 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45						8.90	1.16	242	244	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.91	1.28	235	244	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					7.85	0.58	195	151	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.80	100.40					8.41	0.79	225	200	8 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	94.00	99.60					7.32	1.03	94	86	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	99.75	100.25					8.67	2.27	164	217	15 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21							8.76	3.00	150	221	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.35	133	208	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	95.76	96.52					9.15	4.11	163	244	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.00	99.25	99.21	-0.08	4	70	8.21	1.44	155	174	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.25	100.86					8.51	1.89	163	203	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.70	101.00	100.90	0.03	2	36 380	8.49	1.90	161	201	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.25	100.65					8.94	2.09	198	245	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	98.50	99.30					8.62	3.01	135	207	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	98.20	99.00					9.31	3.01	204	276	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22							9.26	1.38	264	279	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.10	100.44					9.40	1.78	257	292	5 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РСХБ													
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.30		100.35	-0.03	1	450	8.05	0.91	178	161	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.35	100.45					8.01	0.91	174	157	10 000
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.20	100.52	100.52	0.06	1	1	6.81	0.16		74	5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.20	100.79	100.24	-0.11	7	62 000	8.60	0.16		253	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.40	101.90					7.42	0.37		116	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.40	100.84	100.55	0.15	2	1 550	7.57	0.37		131	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	101.00	99.60		2	55	7.55	0.70	150	116	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.10	100.60	100.43	-0.17	1	1	7.81	0.85	159	138	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.10	100.60					8.01	0.85	179	158	5 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	97.00	100.50	100.00	-0.35	1	1 000	8.36	1.04	197	190	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.70	101.10	100.80		2	526	8.13	1.05	173	167	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17		100.05					11.94	0.97	561	549	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	100.80	101.82					8.13	1.32	154	166	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	85.30	100.49					15.17	1.78	834	869	5 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.75	100.14	100.01	-0.02	3	48 998	8.72	2.26	169	222	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.35	98.20	97.35	-0.06	2	12 000	8.98	2.52	186	246	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.40	98.20					8.95	2.52	183	243	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.35	98.25					8.98	2.52	186	246	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							7.99	0.14		195	20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							5.93	0.16			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.25	100.29	100.22	-0.05	7	9 851	7.66	0.25		145	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.25	99.60					7.84	0.81	166	142	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.75	99.80	99.70		1	3 600	8.16	1.15	169	170	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.50	100.90	100.70		23	133 300	8.09	1.30	152	162	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.45	100.65	100.45	-0.30	5	200 053	8.75	1.68	197	228	10 000
АИЖК													
АИЖК А5		15/10/12	100.04	100.09	100.04	0.01	1	90	6.77	0.06			2 000
АИЖК А6		15/07/14	99.35	100.10					8.08	1.32	150	161	3 000
АИЖК А8		15/06/18	95.13	99.23					8.42	2.86	120	188	5 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	98.90					8.82	1.93	192	234	5 000
АИЖК А7		15/07/16	90.62	100.40					8.29	1.95	138	181	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.55		99.70	0.20	1	3 000	8.06	2.39	98	155	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	99.55	99.55	0.45	4	36	8.40	3.08	111	184	7 000
АИЖК А10		15/11/18	95.04						8.63	3.08	135	207	6 000
АИЖК А21		15/02/20	99.50	101.00					8.79	3.26	146	220	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	100.00					8.45	3.92	97	177	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.90	98.00	98.00	0.02	2	2 025	8.94	5.00	125	208	10 000
АИЖК А17		15/04/22	102.30	105.00					8.91	5.58	113	197	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	77	157	5 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.44	1.84	158	196	7 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13							8.99	1.14	252	253	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10						9.19	1.14	272	273	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.30					9.29	1.72	248	282	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.30					9.61	1.72	280	314	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.80	100.31	99.35	-0.82	1	14 967	10.21	0.40		394	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.45	100.10					8.04	0.86	181	161	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.45	99.70	99.70	0.05	2	119	8.23	1.09	180	177	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.01	99.80	99.70		1	1 500	8.63	1.45	197	216	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.51	100.00					8.11	3.36	75	151	15 000
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.20	100.50	100.50	0.20	2	2	7.40	0.72	132	101	10 000
МТС 1		17/10/13	99.15	99.89					7.73	1.01	136	127	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	98.69	99.70					8.21	1.56	149	174	15 000
МТС 2		20/10/15	97.71	98.40	98.40		1	1	8.52	2.70	134	199	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.01	99.14	98.50	-0.50	1	10 000	8.89	2.75	170	236	15 000
МТС 7		07/11/17	98.09	98.79	98.75	-0.26	7	43	9.21	4.10	169	250	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	101.10	101.30	101.25	0.10	2	2	7.76	0.79	160	135	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	96.98	99.08	99.08	0.58	8	72	8.11	1.68	132	164	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.05	99.49	99.20	0.15	1	1	9.43	2.29	239	293	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.15	99.35	99.31	0.21	16	21 090	9.38	2.27	235	288	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.11	99.32	99.32	-0.03	2	20 200	9.37	2.27	234	287	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.00	97.94					9.67	2.65	251	314	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	96.51	97.40	97.30	-0.10	2	71 044	9.55	2.65	239	302	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 13	21/10/11	17/10/12	99.61						13.54	0.17		746	2 000
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.00					8.40	0.72	232	201	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	84.00	100.00					11.15	0.88	490	472	2 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.	
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам		
СПБ Теле2														
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00							8.43	1.32	185	196	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.69						7.63	1.32	105	116	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	99.70	99.95	99.91	0.08	4	70	9.23	2.25	221	273	6 000	
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.27	97.00						9.93	3.20	261	335	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.26	96.99						9.93	3.20	261	335	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.26	97.00						10.05	3.20	273	347	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ														
ВБД														
ВБД ПП 3		27/02/13	99.80	99.90						7.82	0.43		154	5 000
МАГНИТ														
Магнит БО-1		09/09/13	86.00							8.30	0.94	200	185	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	95.00	100.10						8.42	0.94	212	197	1 000
Магнит БО-3		09/09/20								8.36	0.94	206	191	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	100.10	100.25						8.13	0.94	183	168	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	98.30							8.40	1.37	178	193	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	99.15	99.70	99.50		1	45 000	8.25	1.47	158	178	5 000	
Х5														
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.61	98.49						9.34	1.59	260	287	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00	99.94						9.27	1.65	250	280	9 000
Копейка														
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.05	99.00						22.05	0.80	1588	1 563	3 000
Копейка БО-2		01/10/13								9.14	0.96	282	269	3 000
ИНТУРИСТ														
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	98.92	99.22	99.25	0.03	1	8	11.48	0.63	551	512	2 000	
Черкизово														
Черкизово БО-3		08/11/13	98.98							9.23	1.07	282	277	3 000
Синергия														
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	99.00	100.17						7.10	0.03			3 000
Синергия БО-3		03/06/15								11.13	2.04	419	465	2 000
Русское Море														
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.71	100.00						12.82	0.72	674	643	1 000
Детский мир														
Детский мир 1		26/05/15	91.72	93.99						11.95	2.37	488	544	1 000
Мираторг														
Мираторг БО-1		29/07/14	95.25	95.50						11.84	1.72	504	537	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ														
АТОМЭНЕРГОПРОМ														
Атомэнергопром 6		15/08/14	85.00	98.99						8.19	1.82	134	171	10 000
Трансмашхолдинг														
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.60	94.85	94.65	-0.05	11	10 070	11.21	1.28	465	474	3 000	
КАМАЗ														
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13		100.00						8.86	0.23		268	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	93.10	98.70						9.90	1.30	333	343	3 000
УВЗ														
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	100.06	100.55						9.10	0.22		294	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.18	99.69						10.14	0.90	387	370	3 000
УОМЗ														
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.40	100.00						12.48	1.00	612	602	1 000
ИРКУТ														
Иркут БО-1		10/09/13								9.76	1.77	293	328	5 000
ГСС														
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	94.00							8.16	0.97	183	171	5 000
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	94.00							8.33	0.24		213	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	94.00	99.98						9.75	0.56	388	341	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.30	99.45	99.53	-0.02	10	77 538	9.29	0.56	342	295	3 000	
СОЛЛЕРС														
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.72	100.19	99.70		3	750	9.98	0.58	408	364	2 000	
Соллерс 2		17/07/13	102.33	102.50	102.40	0.19	5	154	9.53	0.78	338	312	3 000	
Гидромашсервис														
ГМС 02		13/02/15	100.45	100.70	100.66	-0.19	4	46	10.69	2.15	370	420	3 000	
ТРАНСПОРТ														
Аэрофлот														
Аэрофлот БО-1	08/04/13		100.05	100.15	100.15	-0.20	1	10 000	7.59	0.52	178	127	6 000	
Аэрофлот БО-2	08/04/13		99.68	100.23						7.47	0.52	166	115	6 000
Трансконтейнер														
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	101.10	100.60	-0.05	1	1	8.17	0.42		189	3 000	
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.60	100.90						8.45	1.78	162	197	3 000
Глобалтранс														
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.99	99.80	0.30	1	1	9.73	1.38	311	326	3 000	
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.11	100.35	100.35	0.10	1	1	10.07	2.21	306	358	5 000	
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.00	100.65	100.35	-0.26	3	3	10.07	2.21	306	358	5 000	
Трансаэро														
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.86	100.02	100.03	-0.02	4	102	12.83	0.99	648	637	3 000	

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.77	100.01	100.01	-0.04	14	2 115	12.86	0.91	658	642	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13							9.26	0.48		295	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13							11.40	0.48		509	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.15	99.65	99.60	0.35	1	24 995	11.13	0.58	523	479	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.15	99.65	99.50	-0.19	5	423	11.32	0.58	542	498	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15	85.58		100.50	0.30	2	200 000	8.20	0.67	217	182	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.50						10.38	1.13	392	392	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	87.01		102.30	0.31	2	81	7.70	1.18	121	124	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14							11.11	1.39	448	464	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14							10.48	1.39	385	401	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16			103.35	0.02	1	1	8.73	3.21	141	215	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	98.85	99.15	99.05	-0.05	2	230 000	8.48	3.08	120	192	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	99.05	99.20	99.05	0.05	2	109 999	8.48	3.08	120	192	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	84.00						6.38	0.41		10	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.55	100.70	100.60	-0.10	1	970	7.21	0.20		108	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.10					8.61	2.28	157	211	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.40	100.50	100.50	-0.05	8	1 617	7.90	0.71	183	151	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	95.80						8.22	1.65	145	175	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	100.00					10.25	1.63	349	378	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.22	91.99					13.56	3.00	630	701	5 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.51	99.97					10.09	1.81	325	361	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	85.53	99.05					8.43	1.41	179	196	4 000
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.67	0.25		146	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.70	99.19					8.42	0.75	230	201	5 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.00	98.40					10.32	0.86	409	389	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13		87.47	87.46	0.01	75	4 807	25.55	0.96	1923	1 910	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.55	98.95	98.95	-0.05	1	5	10.06	0.98	372	360	5 000
Иркутскэнерго													
Иркутэнерго-1		28/11/13							10.05	1.76	323	357	5 000
Иркутэнерго БО-1		08/04/14	96.00	100.00					8.91	1.43	226	244	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.40					8.35	0.92	206	191	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	242	256	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.20	99.00	99.00	0.55	1	1	9.66	0.91	338	322	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.00						9.09	2.46	199	258	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.58	2.76	238	305	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	97.08	103.49					9.11	0.97	278	266	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.15	102.30					9.00	1.09	258	254	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.40	100.30					10.57	1.60	382	410	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	93.81	100.30					13.12	1.70	633	665	4 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.26	98.35					10.20	1.42	355	373	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.50	100.95					9.84	0.73	375	344	2 000
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.40	100.60	100.55	0.05	3	12 205	8.30	0.35		205	5 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.20	100.44	100.40	-0.01	6	16 092	9.77	0.94	347	332	2 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14	97.75	97.95	97.75	-0.20	6	227	11.50	1.42	486	503	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	95.51	95.60	95.51		3	2 021	11.55	1.71	475	508	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.95	100.04	100.04	-0.06	5	11 525	11.00	0.24		481	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	101.26	101.67	101.26	-0.34	1	35	9.98	0.20		385	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07	102.90					8.30	0.42		202	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	97.61	98.99					9.58	4.20	204	286	8 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РОСНАНО 2		20/12/17	98.00	99.99	98.00	2.00	2	1 900	9.61	4.20	207	289	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	97.60	98.20					9.61	4.20	207	289	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	100.00	102.00	100.00	-0.20	2	2	8.52	1.77	169	204	20 000
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.04	101.05	101.05	-0.03	7	3 015	6.54	0.18		44	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.40	101.09	101.05	-0.05	2	4 050	7.45	0.45		116	6 000
АФК Система 4		15/03/16	98.00		98.66	0.39	4	184	8.52	2.00	159	204	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.16	99.60	99.56	-0.20	8	262	11.34	0.79	518	493	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.00	100.50	100.50	0.34	1	130	11.53	0.70	547	514	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	97.04	100.03	100.00		4	5 061	10.75	0.04			3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК БО-1	25/06/13	25/06/13		100.92					8.05	0.73	196	165	5 000
РОСБАНК БО-3	16/05/13	16/11/14	97.07	100.60					7.93	0.62	197	157	10 000
РОСБАНК БО-2		08/07/13							8.23	0.77	209	182	5 000
РОСБАНК АЗ	06/05/11	06/11/13	95.00	98.63	98.49	-0.13	5	77 160	8.50	1.07	209	204	5 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	95.07						9.73	1.94	283	325	5 000
АЛЬФА БАНК													
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.75	99.78	99.75	0.05	4	7 264	8.61	1.31	203	214	5 000
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16		101.15					7.66	0.68	162	128	5 000
Альфа-Банк БО7	28/02/14	31/08/15	99.95	100.05					8.58	1.37	196	211	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк БО-1		29/11/12	100.51	100.87					7.64	0.18		154	5 000
МДМ Банк БО-4	16/12/12	16/12/14		100.30	100.30	0.04	10	76 197	8.20	0.23		203	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	88.00	100.32					8.83	0.75	272	243	6 000
МДМ Банк БО-2		21/03/14	99.40	100.35	99.40	0.30	1	342	8.77	1.43	212	230	5 000
НОМОС Банк													
Номос БО-1	24/02/12	24/02/14	99.80	100.00					9.48	1.35	287	301	5 000
Номос 9	15/06/12	14/06/13	86.00	100.18					8.76	0.70	270	237	5 000
Номос БО-3	09/08/13	09/08/15	100.10	100.40					9.12	0.85	290	269	5 000
Номос 11	02/07/14	02/07/14	99.90	100.20					9.68	1.64	292	321	5 000
Номос БО-2	18/04/13	18/10/14	99.45	99.70					8.82	0.55	297	249	5 000
Номос 12	25/08/13	28/08/13	99.50	100.00	100.00	0.25	2	100	8.67	0.90	240	223	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк Зенит БО-2	22/09/12	22/09/13		100.01					7.64	0.98	131	119	5 000
Банк Зенит БО-3	15/11/12	15/11/14	100.08	100.15	100.15	0.03	5	2 910	7.70	0.14		166	3 000
Банк Зенит БО-6	26/11/12	26/05/14	99.83	99.94	99.83	-0.07	15	60 019	8.33	0.17		225	5 000
Банк Зенит БО-4	07/02/13	07/02/15	100.20	100.27					8.32	0.37		206	3 000
Банк Зенит БО-5	14/02/13	14/02/15	100.20	100.25	100.22	-0.04	6	27 380	8.45	0.39		218	3 000
Банк Зенит БО-1	07/04/12	07/04/13	86.00	99.90					7.63	0.52	182	131	5 000
Банк Зенит 5	05/06/12	04/06/13	100.40	100.55					8.46	0.67	243	208	5 000
Банк Зенит 6	02/07/13	01/07/14	100.45	100.55	100.45		1	280	8.73	0.75	262	233	3 000
Банк Зенит 8	28/08/13	23/08/17	100.09	100.12	100.08	-0.02	19	121 954	9.30	0.90	303	286	5 000
Банк Зенит БО-7	12/04/14	12/04/15	100.02	100.15	100.02	-0.15	1	100	9.39	1.42	275	292	5 000
ПРОМСВЯЗЬБАНК													
Промсвязьбанк БО-2	20/02/13	18/02/15	100.10	100.19	100.10	0.05	1	400	8.64	0.41		236	5 000
Промсвязьбанк БО-4	20/02/13	18/02/15	99.50	100.98	99.00	-1.10	2	2	11.60	0.41		532	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.55	99.88	99.55	-0.30	3	45	9.07	0.71	300	268	5 000
Промсвязьбанк БО-3		04/02/14	95.00	99.00	99.36	0.15	2	3	9.30	1.30	273	283	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18		101.75	100.00	-1.50	2	2	12.62	4.03	511	592	5 000
Банк СПБ													
Банк СПБ БО-2	26/03/12	23/09/13	99.80	99.90	99.80	-0.30	4	360	9.43	0.98	310	298	5 000
Банк СПБ БО-1	09/10/12	09/04/13	99.93		100.20	0.70	1	11	3.30	0.04			5 000
Банк СПБ БО-4	13/12/12	12/12/13			99.85	-0.15	2	2	9.30	0.22		314	3 000
МКБ													
МКБ 8	10/10/12	08/04/15	100.00	100.12					6.66	0.04			3 000
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.05	100.40					9.39	0.31		315	2 000
МКБ БО-4	15/10/12	15/04/14	99.97	100.01	100.01	0.01	29	199 015	7.83	0.06			5 000
МКБ БО-1	22/02/13	22/02/14	99.84	99.90	99.90	0.03	6	2 570	8.91	0.41		263	3 000
МКБ БО-3	27/04/13	27/04/15	99.73	99.99					9.62	0.57	373	328	4 000
МКБ БО-5		23/06/14	98.00	98.10	98.00		4	15 178	10.74	1.62	399	427	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	92.02	101.75					7.09	0.24		90	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	99.00	101.25					7.81	0.92	152	137	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.20	100.94					8.97	0.89	271	253	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.40	100.56					9.52	1.35	292	305	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.75	99.83	99.83	-0.01	6	2 280	9.13	0.95	282	268	5 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.17	100.23	100.23	0.06	3	101 100	9.40	0.58	350	306	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.10	100.20					9.68	0.78	354	327	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.75	98.85	98.80		9	3 576	10.31	0.84	410	388	3 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Уралсиб Лизинг БО-5	05/02/15		100.95	101.02	101.00	-0.01	9	8 000	11.04	1.14	457	458	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6	10/02/15		100.00	101.00					11.05	1.15	458	459	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7	22/04/15		100.25	100.50					11.09	1.21	458	463	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2	12/01/15		100.80	101.60	101.00	-0.60	1	10 000	11.46	2.01	453	498	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9	17/02/15		100.80	101.40					11.22	2.11	425	473	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.39	98.45	98.39	-0.31	8	2 293	12.24	0.84	603	582	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.41	100.55	100.55		2	84	12.54	0.84	633	611	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БО-3	21/08/12	18/02/14	100.20	100.30	100.20	-0.55	3	113	14.29	1.31	771	782	2 000
ТКС БО-4	18/04/13	16/04/15	100.01	100.20	100.20	0.25	3	299	13.24	0.53	740	691	2 000
ТКС БО-6	16/07/13	09/07/15	100.15	100.20	100.20	0.05	3	1 300	14.02	0.78	788	761	2 000
ТКС 2		28/07/13	105.16	105.25	105.15	0.15	13	480	13.67	0.80	750	725	1 000
ТКС БО-1		20/09/13	100.51	102.00	102.00	1.00	3	489	12.37	0.96	605	592	2 000
ТКС БО-2	29/11/11	26/11/13	102.38	102.39	102.39	-0.01	23	7 859	14.66	1.06	825	820	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.00	100.10	100.10	-0.04	24	30 950	14.56	0.84	835	814	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.06	100.28	100.20		1	3 400	9.02	0.13		300	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	99.90					7.73	1.04	134	127	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19		101.15					7.83	1.29	127	136	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18		99.60					8.00	1.33	141	153	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.50	100.50	0.15	2	30 350	8.53	2.21	152	204	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	100.95					8.25	0.14		222	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.00	100.15	100.20	0.15	2	3 401	8.43	0.91	215	199	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	99.95	100.05	99.95		5	131	8.73	0.93	244	229	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.00					9.10	0.92	281	266	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.63	1.15	216	217	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00	98.00					9.00	3.45	162	239	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.95	101.10					7.99	1.13	153	153	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.56	99.92	99.60	-0.10	3	27 001	8.00	1.12	155	154	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		227	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.30	100.37	100.35		2	198	8.15	0.13		214	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15							8.99	0.48		268	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	99.75	100.19	100.19	0.04	3	4 390	9.41	1.04	302	295	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-2	27/09/12	25/09/14							-17.16	0.01			2 000
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.58	0.48		127	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.60	100.70	100.60		4	11 300	10.68	0.85	445	425	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	99.90	99.90	0.20	1	1	10.34	0.99	399	388	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14		100.00					8.02	0.21		187	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.75	100.10	100.05		2	300	8.67	0.55	282	234	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	85.00						9.02	1.03	264	256	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.75	99.85	99.75	-0.26	3	35 000	10.23	2.27	320	373	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14							8.44	1.40	181	197	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.05	100.40	100.05	-0.15	2	3 000	9.40	0.96	308	295	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	86.00	100.50					9.18	0.96	286	273	2 000
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.50	99.00	98.50	-0.10	2	2	9.38	0.76	325	297	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00	99.75	0.50	2	20 000	9.22	0.93	293	278	4 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.10	99.50					9.32	1.08	290	286	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15							9.52	1.08	310	306	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.25	100.35					8.93	0.85	271	250	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	96.60	97.30	97.30	0.27	1	11	9.10	1.63	234	263	5 000
Дельта Кредит 8	05/11/14	02/11/16											5 000
ОТП Банк													
ОТП Банк БО-3	01/11/12	30/10/14	100.20	100.24	100.25		2	60 000	8.04	0.10		207	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	99.70	100.10	100.10	0.09	4	3 130	10.69	1.37	408	422	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14							10.68	1.38	406	421	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.60	95.96					10.71	1.73	390	424	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.20	100.80					4.55	0.20			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60						10.51	0.65	451	414	3 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.95	100.05					9.18	0.05			2 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	98.10	99.50					9.70	0.77	356	329	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	99.86						9.83	1.34	323	336	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.05	100.20	100.20	0.10	2	201	10.06	1.31	348	359	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.90	97.35	97.25	0.05	4	94	10.25	1.47	357	378	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.50	100.44					9.19	0.98	285	273	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.41	100.60					9.74	0.73	365	334	3 000
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.10					7.93	0.23		175	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.93	0.23		175	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.00	100.20					9.62	0.54	377	329	2 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						7.48	0.24		129	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22		101.00					7.52	0.56	165	118	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	263	321	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/12	19/04/14	99.80	99.99					10.82	0.07			2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.67	99.74	99.74	-0.31	4	1 736	11.93	0.44		564	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.75	99.99	99.99	-0.06	1	148	11.30	0.96	498	485	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	98.09	100.15	98.09	-1.91	2	2	14.76	0.36		850	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	100.00	100.50					10.91	0.53	509	459	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.06	100.20	100.09	-0.01	3	2 000	9.86	0.24		367	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	93.00	100.02					10.11	1.73	330	364	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.25	100.35	100.27	0.02	9	60 000	8.70	0.18		261	3 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.20	100.20	0.03	1	1	9.40	0.37		314	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	98.00						10.13	0.81	395	371	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	99.90	100.25	100.10	0.07	8	22 627	10.88	0.86	465	445	3 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.50	100.05					9.86	0.24		366	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.25	100.40	100.40	0.04	2	1 080	12.34	0.86	611	591	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	100.05	100.15					10.85	1.18	436	439	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.90	100.00					8.46	0.07			2 000
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.12	100.61					8.44	0.18		234	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	100.00	100.13	100.00		1	45	10.11	0.22		395	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.00	100.10	100.10	-0.05	4	3 500	11.27	0.41		499	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.37	99.00	-1.00	2	265	13.14	0.42		686	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.80	99.90					11.73	0.52	592	541	2 000

РЕГИОНАЛЬНЫЕ

МОСКВА

Москва 61	03/06/13		105.11	106.10					6.64	0.67	62	27	30 000
Москва 53	01/09/13		99.70	100.39					6.83	0.92	54	39	15 000
Москва 63	10/12/13		109.16	110.23					6.31	1.13			15 000
Москва 62	08/06/14		108.90	108.99	108.75	0.60	3	60 002	7.12	1.56	40	65	35 000
Москва 39	21/07/14		98.50						7.45	1.72	64	98	10 000
Москва 64	24/06/15		97.80	98.80					7.62	2.50	51	110	20 000
Москва 44	16/11/15		106.15		112.40	-1.30	4	640	8.01	2.60	86	149	40 000
Москва 56	22/09/16		96.30	97.90	97.00	0.70	2	2	8.05	3.55	65	142	20 000
Москва 49	14/06/17		95.75	97.10					8.19	4.01	69	150	25 000
Москва 48	11/06/22		88.95	90.10					8.23	6.94	27	110	30 000

МОС ОБЛ

Московская Обл 8	11/06/13		100.80	101.00	100.80	-0.70	4	356	7.95	0.69	190	157	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.55	99.65	99.55	0.15	4	286	8.48	1.45	182	201	16 000

НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ

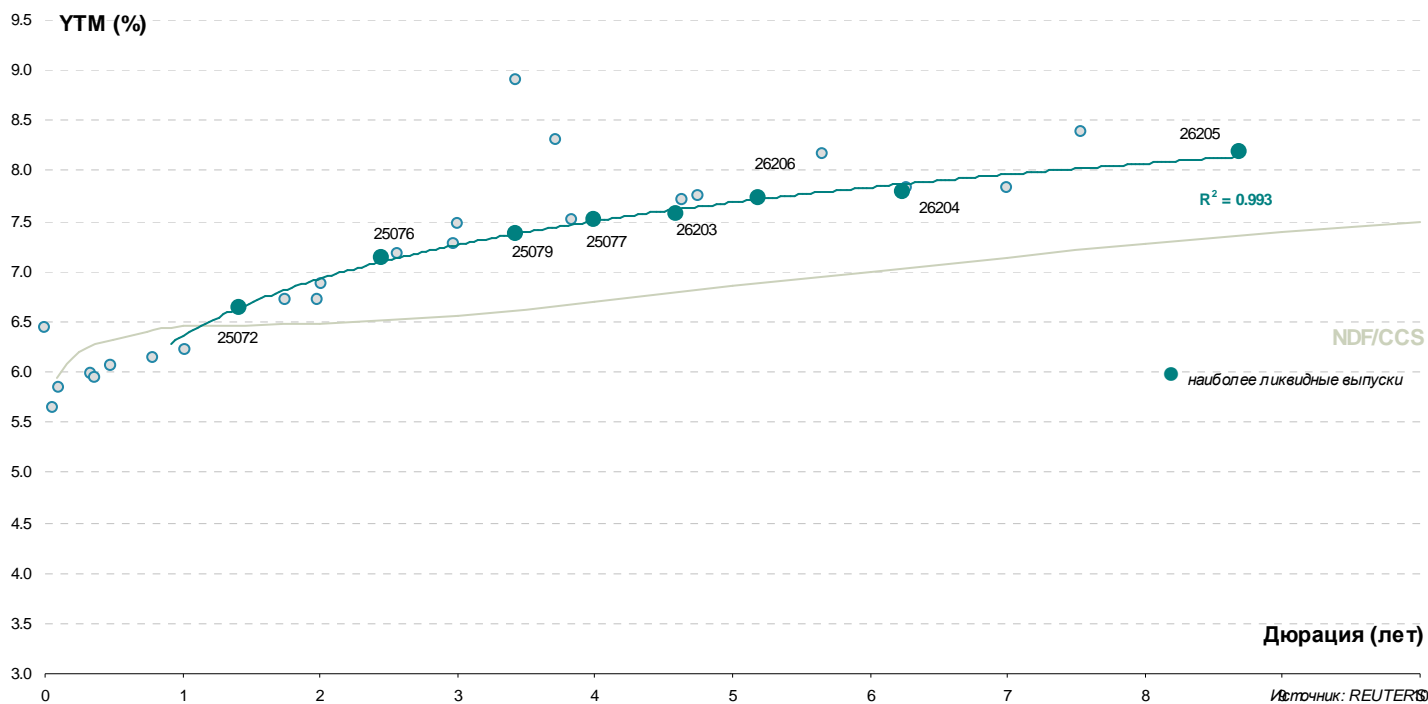
Нижегородская Обл 5	02/12/12		101.00	101.10	101.10		1	100	6.75	0.19		64	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12		98.50	102.05					7.44	0.15		140	3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.80	100.20	100.20		1	5	8.25	1.81	140	177	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.91	103.00					8.72	2.28	168	222	8 000

САМАРСКАЯ ОБЛ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Самарская Обл 5	19/12/13		101.39	102.20					8.13	1.18	164	167	8 000
Самарская Обл 6	10/05/13		104.00	104.70					7.51	0.60	158	116	2 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.65	97.75	97.75	0.25	1	1	8.84	2.16	185	235	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.76	100.37					7.26	0.29		103	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.20	101.60	101.40	0.20	1	4 000	8.00	0.72	192	161	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.51	100.53					8.12	1.20	161	166	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12		86.00	99.85						0.33			2 000
Краснодар 02	05/11/15		100.65	100.95					8.41	1.22	189	195	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14								8.17	1.38	155	170	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4	08/11/12		100.40	100.70					6.81	0.12		81	10 000
Красноярский край 5	29/11/16		101.80	102.20	102.10	0.25	5	100 004	7.92	1.57	119	145	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		98.20	100.70					6.90	0.64	92	54	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.00	100.00					9.17	1.45	251	270	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		93.00	95.00					8.62	2.37	155	211	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								9.01	2.41	193	250	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.50	104.30					8.65	2.55	152	213	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12		100.40	100.47	100.43	-0.04	8	24 377	7.37	0.24		118	3 000
Костромская область 6	17/11/16		99.11	102.97	102.45	1.25	6	54 265	8.48	1.93	158	200	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		97.40	103.40					9.53	2.38	246	302	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.00	103.30					9.20	1.78	237	272	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		100.45	100.57					7.13	0.63	116	77	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.00	99.55	99.55	0.30	1	1	8.19	1.22	167	173	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.50	101.00					9.12	2.27	209	262	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		99.00	100.00					8.78	1.18	229	232	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12		100.60	100.90					6.12	0.24			2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13		103.90	104.75					7.56	1.18	107	110	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16		101.70	102.10	102.10	0.50	1	3	8.26	1.89	138	178	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 5	26/12/13		100.00	107.90					8.54	1.17	206	208	4 000
Тверская Обл 6	12/06/14		103.69	103.70					8.34	0.87	210	191	3 000
Тверская Обл 7	15/12/15		98.35	98.40	98.40		1	5 000	9.46	2.57	233	294	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ

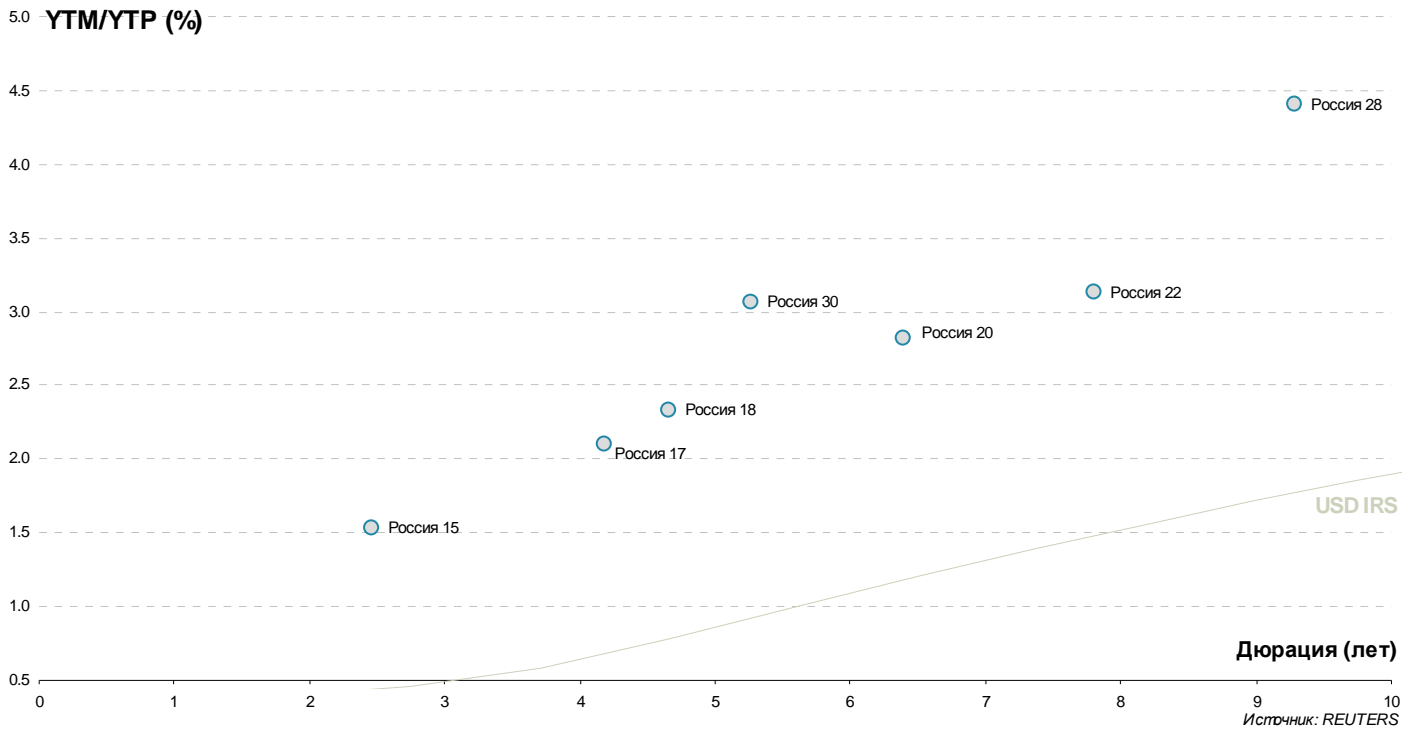


Результаты торгов евробондами

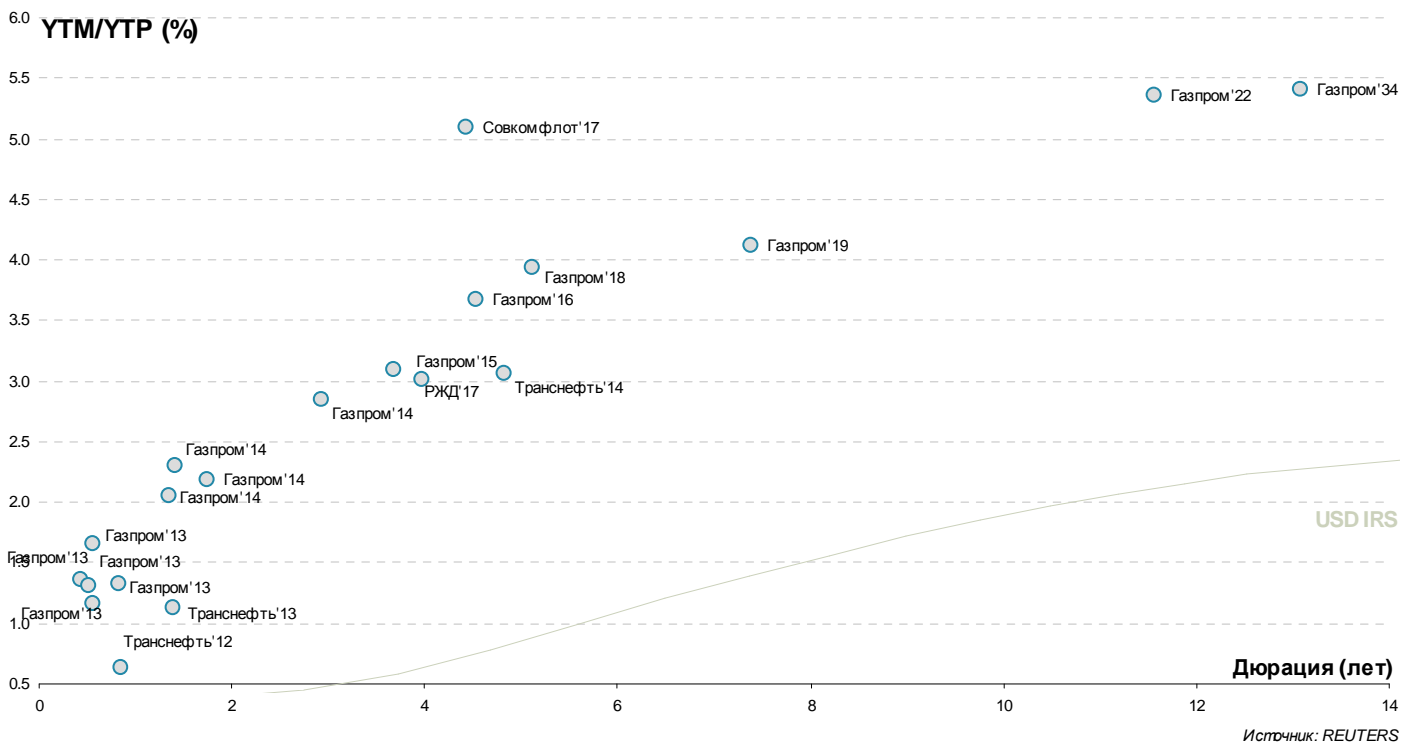
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд	
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			Дюрация
РОССИЯ										
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		105.125	105.500	1.60	1.45	2.46	-0.25	117
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		104.625	105.250	2.17	2.03	4.19	-0.38	150
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		146.450	147.550	2.41	2.25	4.66	0.06	151
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		124.712	124.958	3.08	3.04	5.27	-0.39	173
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		114.625	115.000	2.84	2.79	6.39	-0.38	158
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		111.000	111.375	3.15	3.11	7.80	-0.25	158
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		193.395	194.605	4.44	4.37	9.28	-0.20	248
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		117.063	118.438	4.57	4.49	15.50	-0.81	213
ГОСКOMPАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.546	101.671	1.76	1.54	0.57		142
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13		102.000	103.000	2.03	0.29	0.56	-0.63	169
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13		103.440	103.577	1.52	1.21	0.43	0.04	118
GAZPR'14 7.343%	USD	11/04/13		103.170	103.295	1.42	1.19	0.52	-0.02	108
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.901	105.401	1.61	1.04	0.83		127
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		111.630	112.380	2.54	2.07	1.41		220
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		111.630	112.380	2.31	1.81	1.36		196
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		110.522	110.767	2.25	2.13	1.74	0.02	189
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.510	107.002	2.93	2.77	2.93	-0.10	247
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.807	112.275	3.16	3.04	3.68	-0.27	257
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		121.788	122.778	3.75	3.58	4.54	-0.31	293
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.277	130.776	3.97	3.90	5.13	-0.34	297
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.006	119.019	4.18	4.06	7.39	-0.13	269
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		140.921	141.954	5.39	5.33	11.58	-1.02	321
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		125.383	125.874	5.42	5.39	13.08	-0.97	314
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		105.064	107.064	1.75	-0.48	0.84		140
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.967	106.967	1.46	0.79	1.40	0.16	110
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		129.868	130.243	3.09	3.03	4.83	-0.10	219
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.180	111.662	3.07	2.96	3.97	-0.40	242
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.745	101.745	5.21	4.98	4.42	-0.51	450
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		100.400	100.450	2.11	1.60	0.09		195
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.825	107.325	3.52	3.31	2.29	-0.14	314
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		106.365	106.740	4.96	4.88	4.66	-0.15	418
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		108.204	108.704	5.19	5.09	4.74	-0.42	436
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		106.027	106.527	5.61	5.53	6.26	-0.41	437
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.044	106.544	5.77	5.73	12.57	-0.17	353
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		103.000	103.750	2.48	1.31	0.61	-0.06	216
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.263	107.263	4.00	3.58	2.31	-0.24	362
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.144	100.144	7.08	6.63	2.30	0.03	679
ВЭБ										
VEB LEAS'16 5.125%	USD	27/05/16		104.176	105.176	3.89	3.60	3.34	0.19	339
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		108.424	108.924	3.64	3.54	4.51	-0.71	288
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		117.506	118.005	4.24	4.17	6.22	-1.11	300
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		117.448	117.948	4.98	4.93	9.08	-0.80	310
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		104.200	104.650	2.27	1.69	0.73	-0.05	194
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.128	106.475	3.36	3.20	2.08	-0.13	299
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.043	108.438	3.64	3.50	2.77	-0.25	321
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		103.235	103.453	2.03	1.69	0.62	0.11	170
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		106.100	106.350	2.32	2.13	1.25	0.08	197
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.910	111.035	2.43	2.36	1.59	-0.22	206
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.048	110.542	3.91	3.80	4.04	-0.48	325
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.408	118.906	4.08	3.99	4.69	-0.47	324
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		101.988	102.613	5.40	5.21	3.30	-0.25	493
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		103.045	103.381	1.62	1.11	0.62	-0.28	129
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.652	103.991	1.63	1.20	0.75	0.15	130
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.896	108.295	2.54	2.39	2.59	-0.01	211
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.637	108.132	3.55	3.43	4.07	-0.31	291
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.330	109.330	4.55	4.42	6.97	-0.27	316
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		103.500	104.000	2.69	1.85	0.55	-0.13	238
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.076	109.574	5.07	4.90	2.75	-0.16	466
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		112.350	112.850	6.80	6.70	4.37	-0.30	607
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.250	101.250	6.69	6.48	4.62	-0.72	593
Альянс Ойл										
ALLIANCE OIL'15 9.875%	USD	11/03/15		106.750	107.250	6.84	6.62	2.24	0.87	653
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.980	111.457	3.50	3.28	1.95	-0.13	313
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		112.392	113.391	5.81	5.66	6.13	-0.30	458
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		103.250	103.650	2.79	2.13	0.57	-0.15	247
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		105.090	105.090	4.83	4.83	3.04	-0.71	438
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.456	110.965	5.08	4.93	3.18	-0.53	462
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		114.644	115.147	6.00	5.90	4.44	-0.79	523
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		108.380	109.380	6.43	6.28	6.33	-0.37	518
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.551	108.848	2.20	2.06	1.96	-0.13	181
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.466	113.868	3.24	3.15	4.11	-0.37	256
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.357	120.867	3.94	3.86	5.69	-0.38	281
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		112.805	113.307	4.24	4.17	6.49	-0.38	294
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		119.882	120.642	4.14	4.06	7.41	-0.55	262
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		121.264	121.763	5.24	5.17	5.90	-0.88	407
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.750	107.250	3.18	3.03	3.10	-0.03	271
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		116.750	117.500	4.20	4.11	6.65	-0.63	287
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.750	107.000	1.61	1.33	0.82	0.22	127
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.625	110.250	2.90	2.51	1.44	0.25	255
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.764	107.263	5.17	5.06	4.30	-0.48	446
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		101.978	102.978	7.29	7.07	4.43	-0.54	662
ТНК										
TNK-BP'13 7.5%	USD	13/03/13		102.879	105.879	1.22	-4.94			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.110	109.049	2.66	2.27	2.21	0.10	227
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.496	115.997	3.15	3.02	3.38	-0.19	262
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.700	114.712	3.31	3.08	3.99	-0.19	267
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		120.808	121.837	3.64	3.45	4.63	-0.19	283
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.912	122.983	3.80	3.65	5.94	-0.18	263
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.800	105.100	2.66	2.27	0.72	-0.10	234
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		107.825	108.825	4.62	4.21	2.30	0.23	426
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		108.500	109.500	5.89	5.66	4.26	-0.12	523
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		101.500	102.500	2.40	-1.90		0.12	
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		102.077	102.577	4.48	4.00	1.02	-0.05	418
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		105.606	106.606	6.69	6.34	2.67	-0.09	635
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.945	105.195	4.38	4.07	0.78	-0.02	408
PSB FINANC'14 6.2%	USD	25/04/14		100.760	101.260	5.69	5.35	1.49	0.26	540
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		110.653	111.653	8.21	7.81	2.28	-0.20	795
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		106.696	108.696	9.11	8.50	3.14	-0.14	878
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.388	103.888	4.60	4.25	1.43	-0.12	428

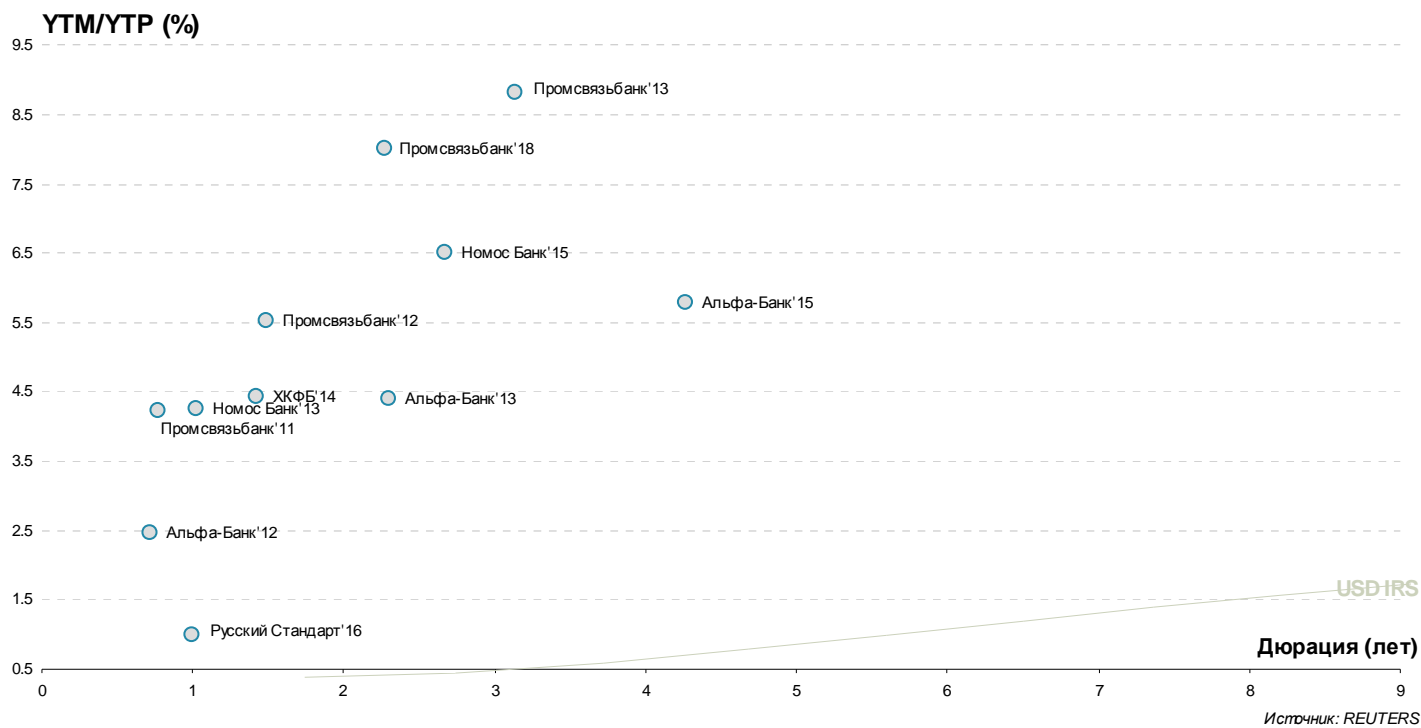
Россия



Госкомпании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@zenit.ru
a.pashkevich@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
[e.gashigullina@zenit.ru](mailto.e.gashigullina@zenit.ru)

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

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

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

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