

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Статистика из США вызвала непродолжительный рост рынков

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Платежи по НДС и акцизам вновь приподняли ставки МБК
- Рубль немного укрепился, но волатильность нарастает

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды нашли повод для восстановления цен
- Локальный рынок без активности

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

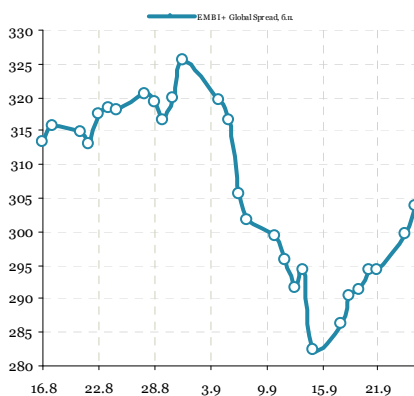
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.67	▼	-0.04	1.39	2.30
UST 10-2Y sprd	140	▼	-5	117	193
EMBI+Glob.	304	▲	4	282	441
EMBI+Rus sprd	183	▲	9	161	332
Russia 30 yield	3.14	▲	0.11	2.85	4.45
Денежный рынок					
Libor-3m	0.36	▼	0.00	0.36	0.47
Euribor-3m	0.22	▼	0.00	0.22	0.82
MosPrime-1m	6.48	▲	0.03	5.78	6.89
Корсчета в ЦБ	730.1	▼	-94.4	446	1032
Депоз. в ЦБ	68.0	▼	-8.5	61	369
NDF RU 3m	6.2	▼	0.0	5	7
Валютный рынок					
USD/RUB	31.054	▼	-0.102	29.04	33.67
EUR/RUB	40.23	▼	-0.018	38.48	41.81
EUR/USD	1.29	▼	-0.003	1.21	1.33
Корзина ЦБ	35.244	▼	-0.123	33.38	37.28
DXU Индекс	79.552	▲	0.034	78.71	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1511.0	▼	-1.9%	1228	1713
Dow Jones	13457.6	▼	-0.75%	12101	13597
DAX	7321.7	▼	-1.39%	5969	7452
Nikkei 225	9092	▼	-2.03%	8296	10255
Shanghai Comp.	2029.3	▼	-1.24%	2025	2452
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	108.0	▼	-0.24%	88	122
Нефть Brent	110.5	▼	-0.36%	89	126
Золото	1760.7	▲	0.11%	1540	1773
CRB Index	306.7	▲	0.25%	267	321

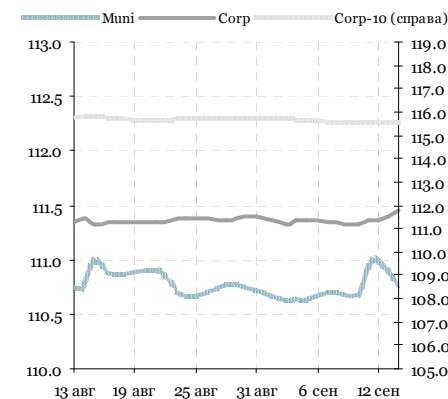
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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

Совет директоров ОАО «Газпромбанк» принял решение о размещении биржевых облигаций серий БО-06-БО-15 и классических облигаций 13-15 серий по 10 млрд руб. каждый. Срок обращения облигаций 13-й серии составляет 5 лет, 14-й серии - 7 лет, 15-й серии - 10 лет. /Интерфакс/

АФК «Система» планирует разместить три выпуска биржевых облигаций серий БО-01, БО-02 и БО-03 по 10 млрд руб. /Интерфакс/

Группа «Мечел», пересмотрев свою стратегию, выставила на продажу предприятия Восточно-Европейского металлургического дивизиона: Донецкий электрометаллургический завод (Украина), Invicta Merchant Bar Lmtд (Великобритания), «Мечел Нямунас» (Литва), «Мечел-Сервис Глобал» (международный металлотрейдер, за исключением «Мечел-Сервис»), часть ферросплавного бизнеса группы. Совет директоров группы также рекомендовал акционерам оценить возможность продажи стратегическому партнеру миноритарного пакета акций ОАО "Мечел-Майнинг" в размере не более 25%. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 25.09.2012 – вторник

Статистика Confidence	США: Consumer	<ul style="list-style-type: none"> • 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-Da, RUB (RMBS) (12%, 3.5 млн долл.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (12%, 1.2 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-B, RUB (RMBS, FRN) (9%, 3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-A1, RUB (RMBS, Step Up) (8.35%, 13.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-B, RUB (RMBS, Step Up) (8.75%, 2.3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-A2 (RMBS, Step Up) (8.5%, 2.2 млн руб.), Национальный капитал, 01 (13%, 194.4 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-A (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.)
--------------------------	---------------	--

Сегодня: 26.09.2012 – среда

- 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.)

Завтра: 27.09.2012 – четверг

Статистика Confidence	Еврозоны: Consumer	<ul style="list-style-type: none"> • Выплата купона: Восточный Экспресс Банк, БО-02 (10.5%, 104.7 млн руб.), Внешэкономбанк, 09 (7.9%, 590.8 млн руб.), МСП Банк, 01 (8.7%, 216.9 млн руб.), Ай-ТЕКО, 02 (12.5%, 19.6 млн руб.), МТС-Банк (МБРР), 02 (7%, 52.3 млн руб.), Наука-Связь (ООО), 01 (11.25%, 11.2 млн руб.) • Оферта: ЭГИДА, 01 (62 млн руб.) • Погашение: Ай-ТЕКО, 02 (630 млн руб.)
Статистика Goods Orders	США: GDP, Personal Consumption, PCE Core, Durable	

Внешний рынок долга

Статистика из США вызвала непродолжительный рост рынков

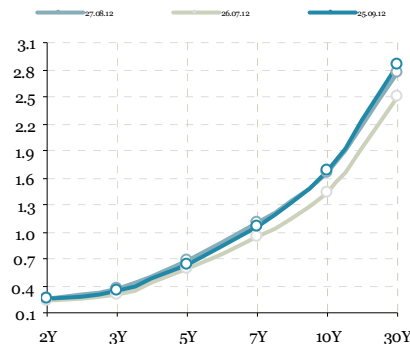
Настроения на глобальных рынках во вторник были переменчивы, что отражает сохранение неопределенности и отсутствие идей у инвесторов. Нейтральное поведение рискованных активов в первой половине дня сменилось кратковременным всплеском оптимизма после публикации неожиданно сильных данных по потребительскому доверию в США за сентябрь. Индекс подскочил с 61.3 п. до 70.1 п. при ожиданиях роста до 63 п. Сам индекс и его ключевая компонента ожиданий достигли 7-месячного максимума. Несмотря на довольно сильный рынок индекса, это движения, скорее всего, окажется непродолжительным. В сентябре на настроения потребителей позитивно повлияли два противоречивых фактора: рост цен на фондовых рынках при сохранении относительно невысоких цен на автомобильное топливо. В ближайшей перспективе настроения потребителей обречены на снижение ввиду сохранения слабого рынка труда и восстановления цен на нефть, за которыми последует и рост цен на топливо.

К вечеру весь позитив от хорошей статистики был сломлен заявлениями главы ФРБ Филадельфии о сомнительности эффект от нового раунда политики количественного смягчения. По мнению Чарльза Пlossера, который в текущем году не имеет права голоса в комитете по открытым рынкам ФРС США, новая программа выкупа ипотечных активов не сможет исправить ухудшающуюся ситуацию на рынке труда и в экономике в целом. Это в целом звучит на волне рыночной реакции после объявления QE3, после которого по рынкам прошла серьезная понижательная коррекция.

В перспективе ключевыми для рынков событиями должны стать важные данные в США (прежде всего, по заказам на товары длительного срока использования), а также ситуация вокруг финансовой помощи Испании и Греции. Учитывая небольшую вероятность разрешения этих вопросов в Европе, волатильность рискованных активов неизбежно возрастет.

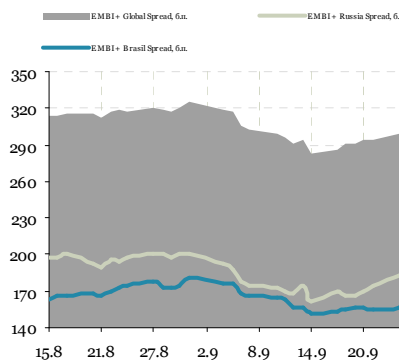
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



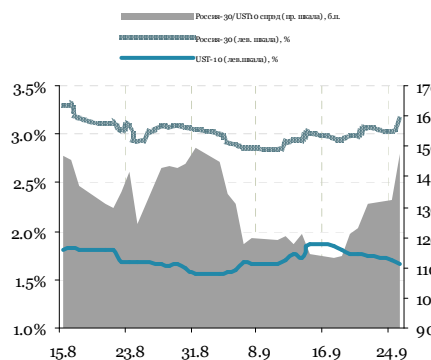
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



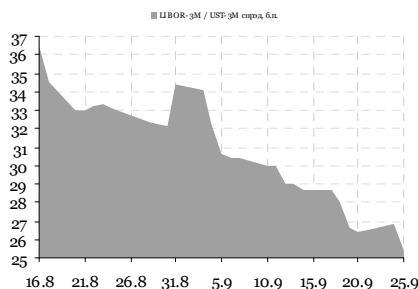
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Платежи по НДС и акцизам вновь приподняли ставки МБК

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка во вторник заметно ухудшилась на фоне завершения платежей по налогу на добычу полезных ископаемых и акцизов, которые потребовали из банковской системы порядка 200 млрд руб. На рынке МБК ставки по кредитам овернайт подняли в среднем на 30 бп до 6.1–6.25% годовых, междилерское репо на 1 день подорожало до 6.2% годовых (+20 бп). На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли весь требуемый объем ликвидности: на 1 день - 219 млрд руб. на 7 дней - 1 трлн руб. В результате совокупная задолженность банковского сектора по этим операциям подскочила до локального максимума 1,6 трлн руб. (+149 млрд руб.) Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ сократилась на 102.9 млрд руб., составив 798.1 млрд руб.

До конца недели банкам предстоит завершить платежи по налогу на прибыль, которые потребуют из системы еще порядка 160 млрд руб. Учитывая высокий объем задолженности перед ЦБ по операциям репо, эти платежи будут, вероятно, будут удерживать краткосрочные процентные ставки на повышенных уровнях по конца сентября.

Рубль немного укрепился, но волатильность нарастает

Торги на валютном рынке вчера завершились укреплением рубля по отношению к бивалютной корзине на 14 коп. до отметки 35.07 руб. На момент российской сессии настроения на внешних площадках были оптимистичными, котировки нефти Brent торговались с повышением на примерно 1% к уровням понедельника, на близко к отметке 111 долл. за барр. Рубль не успел захватить ухудшение ситуации на рынках, наблюдаемое вчера вечером, поэтому сегодня рубль должен вновь оказаться под давлением.

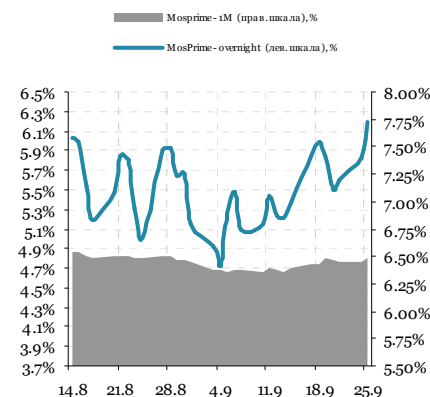
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	НДС и акцизы (около 200 млрд руб.)	219
	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

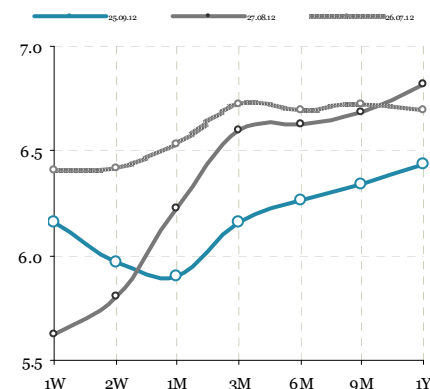
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды нашли повод для восстановления цен

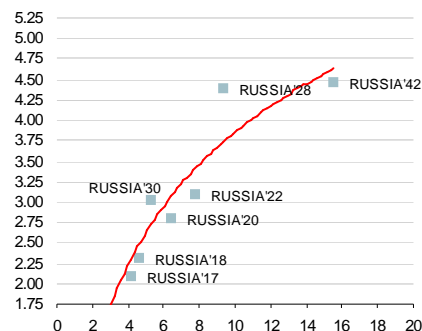
Во вторник настроения в российском сегменте несколько улучшились. Неплохие данные по состоянию потребительского доверия в США дали повод суверенным бумагам восстановить цены после трехдневного снижения. В результате бида вдоль суверенной кривой к концу дня порядка 25 бп, а дальний Россия'42 подорожал на фигуру и вернулся на отметку 118,5%, что соответствует уровням середины прошлой недели. Корпоративный сектор выглядел по-прежнему слабо, хотя и замедлил темпы снижения, которые во вторник в среднем по рынку составили менее 25 бп.

Локальный рынок без активности

Неопределенные настроения внешних площадок и нарастающий дефицит ликвидности во вторник существенно снизили активность на рынке рублевого долга. Основной оборот в сегменте ОФЗ сместился к ближнему участку кривой, где котировки двигались разнонаправлено в пределах 10 бп, дальняя дюрация осталась практически без сделок, хотя бида стояли на уровнях понедельника. В корпоративном секторе наблюдалась привычная картина: за пределами короткой дюрации точечный спрос был замечен в выпуске МТС 4 (УТМ 8.10%/D 1.56г. +137 бп к ОФЗ), подорожавшим по итогам для почти на 20 бп, что, видимо, можно связать с объявлением ориентиров по новому выпуску Мегафона. Выше по уровню кредитного риска также активно торговался выпуск ЛСР БО5 (+14 бп).

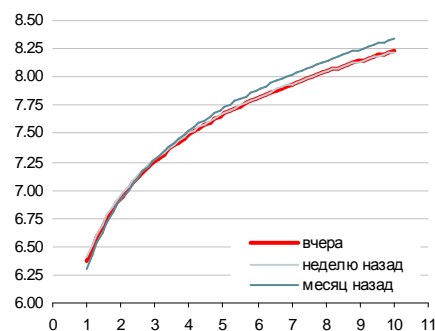
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



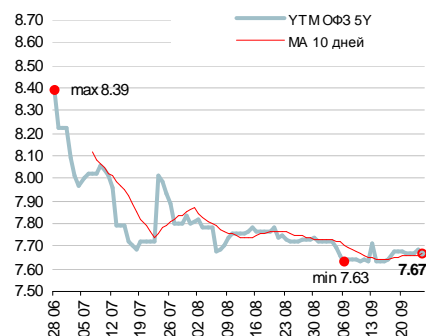
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



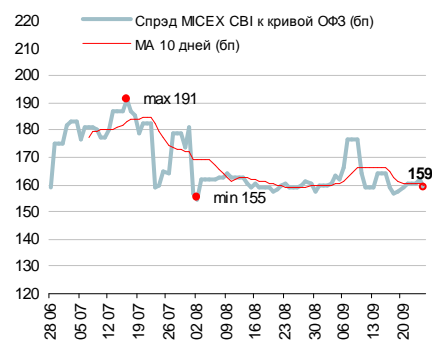
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спред индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



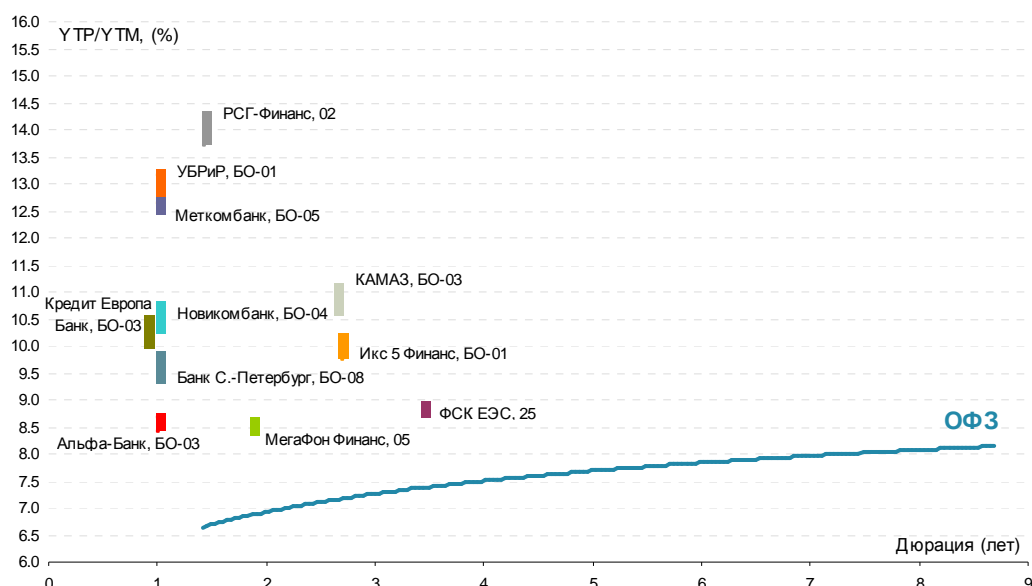
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
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 / Vaa2 / -	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	- / Va3 / -	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	- / Va3 / 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- / Vaa3 / -	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.

Источники: Interfax, Bloomberg, Cbonds

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
Трансфин-М, БО-09	NR	нет	2 000	н/д / 100%	10.78	10.78	25.09.2012	нет / 2.64 г.
Трансфин-М, БО-10	NR	нет	2 000	н/д / 100%	10.78	10.78	25.09.2012	нет / 2.64 г.
Первобанк, БО-03	- / B3 / -	да	2 000	н/д / 100%	11.04-11.57	11.30	25.09.2012	нет / 1 г.
РЕСО-Гарантия, 02	BB+ / - / -	да	5 000	н/д / 100%	8.89-9.20	8.89	25.09.2012	нет / 1 г.
МКБ, БО-02	B+ / B1 / BB-	да	3 000	1.5 / 100%	9.73-10.25	9.99	25.09.2012	нет / 1 г.
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- / Va2 / -	да	5 000	н/д / 100%	9.20-9.73	8.99	21.09.2012	нет / 2.68 г.
НЛМК, 07	BBB- / Vaa3 / 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	- / Vaa3 / BBB+	да	10 000	1.4 / 100%	9.25-9.52	9.52	12.09.2012	нет / 1.86 г.
НЛМК, БО-04	BBB- / Vaa3 / BBB-	да	5 000	2.7 / 100%	8.47-8.68	8.42	10.09.2012	нет / 1.88 г.
Промсвязьбанк, БО-07	- / Va2 / 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 / Vaa1 / 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 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
----------------	----------	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

НЕФТЬ И ГАЗ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ГАЗПРОМ													
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													
Сахатрнфг2		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
РСХБ													

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 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
СПБ Теле2													

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		
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			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	
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	

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Ю-Тэйр													
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
ЭНЕЛ ОГК-5													
ЭНЕЛ 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
ЭНЕЛ 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													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13							10.05	1.76	323	357	5 000
Ирку тЭнерго 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
РОСНАНО 2		20/12/17	98.00	99.99	98.00	2.00	2	1 900	9.61	4.20	207	289	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	
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 А3	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
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

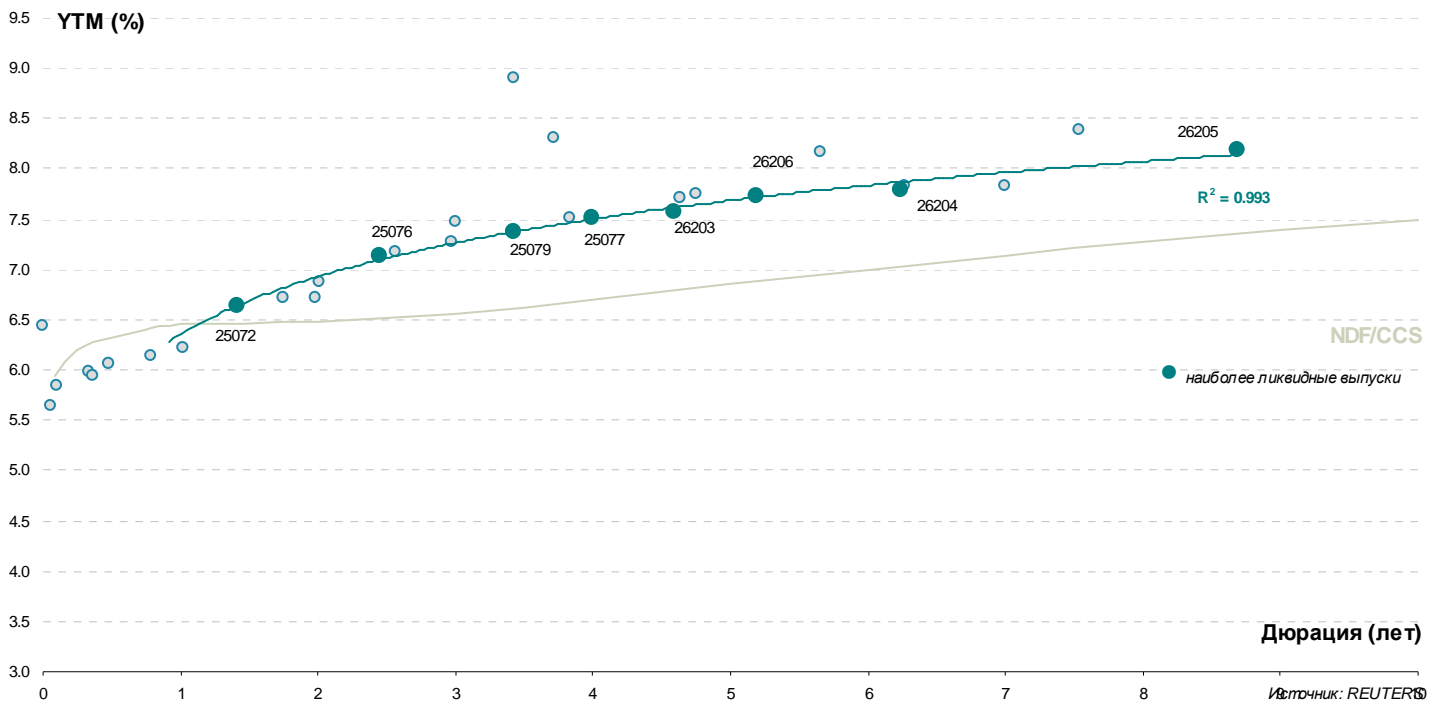
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					11.05	1.15	458	459	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.25	100.50					11.09	1.21	458	463	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
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	98.10	99.50					9.70	0.77	356	329	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	
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													
Самарская Обл 5		19/12/13	101.39	102.20					8.13	1.18	164	167	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	
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

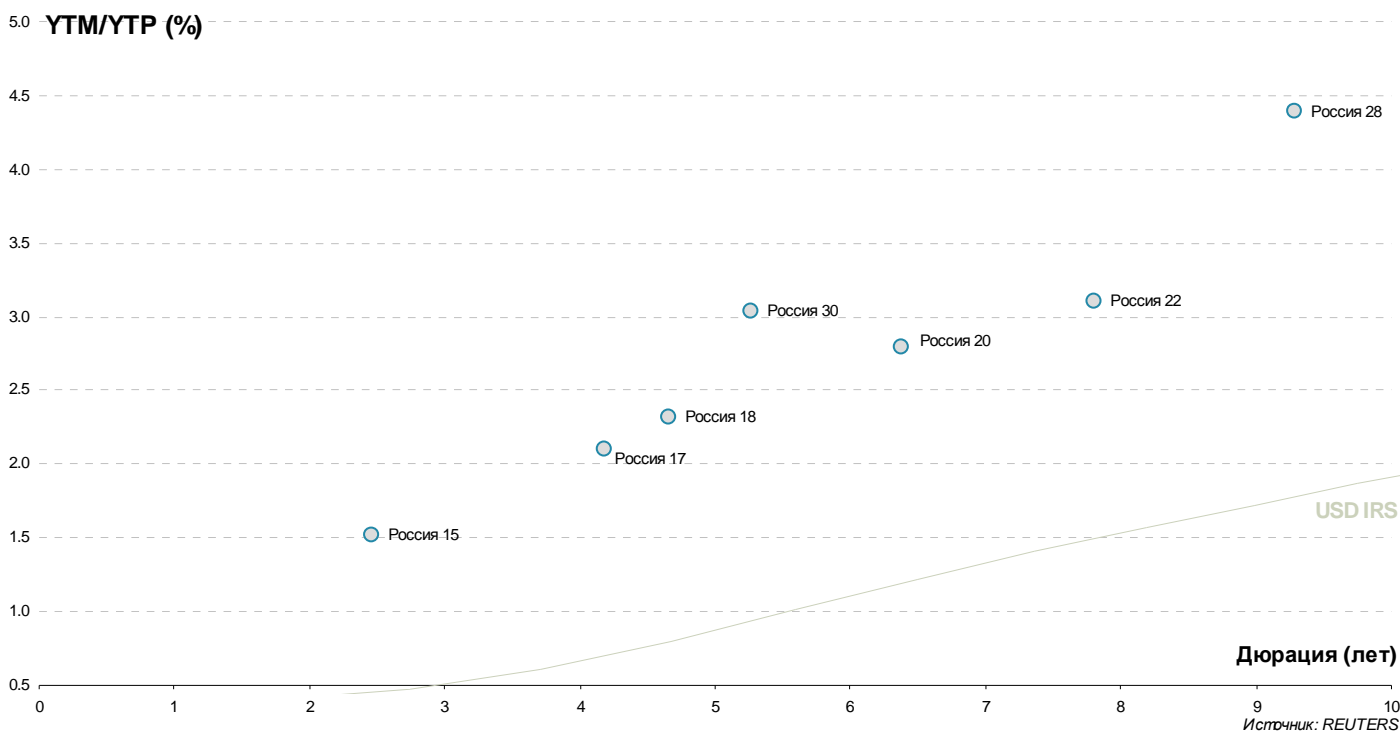
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа		
РОССИЯ									
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		105.125	105.500	1.59	1.45	2.46	116
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		104.625	105.250	2.17	2.03	4.18	148
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		146.400	147.600	2.41	2.23	4.66	-0.05
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		124.870	125.117	3.05	3.02	5.27	-0.01
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		114.625	115.375	2.84	2.74	6.39	
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		111.250	111.625	3.12	3.08	7.80	0.25
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		193.650	194.800	4.43	4.36	9.29	0.25
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		118.375	119.000	4.50	4.46	15.55	1.31
ГОСКOMPАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.541	101.666	1.75	1.54	0.56	141
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13		102.352	102.852	1.39	0.52	0.56	0.35
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13		103.750	103.800	0.77	0.65	0.43	0.31
GAZPR'14 7.343%	USD	11/04/13		103.149	103.274	1.42	1.20	0.52	-0.02
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.903	105.403	1.59	1.02	0.82	
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		111.630	112.380	2.53	2.05	1.41	
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		111.750	112.500	2.21	1.72	1.36	0.12
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		110.492	110.737	2.26	2.13	1.73	-0.03
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.450	106.941	2.94	2.79	2.93	-0.06
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.513	111.980	3.22	3.11	3.68	-0.30
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		121.676	122.665	3.77	3.59	4.53	-0.12
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		129.441	130.441	4.09	3.94	5.12	-0.87
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		116.635	117.633	4.34	4.23	7.37	-1.40
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		140.000	140.250	5.45	5.43	11.53	-0.96
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		124.552	125.038	5.47	5.44	13.04	-0.91
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		105.037	107.037	1.76	-0.47	0.84	-0.03
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.935	106.935	1.48	0.80	1.40	-0.03
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		129.888	130.263	3.08	3.02	4.83	0.02
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.079	111.560	3.09	2.98	3.97	-0.11
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.357	101.357	5.29	5.07	4.42	-0.39
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		101.313	101.500				0.91
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.528	107.026	3.64	3.43	2.29	-0.29
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.499	106.499	5.14	4.93	4.66	-0.87
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		107.859	108.357	5.25	5.15	4.73	-0.35
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.870	106.369	5.63	5.56	6.26	-0.18
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.013	106.513	5.77	5.73	12.57	-0.03
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.752	103.002	2.85	2.46	0.61	-0.25
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.082	107.082	4.07	3.65	2.30	-0.18
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.099	100.099	7.10	6.65	2.30	-0.04
ВЭБ									
VEB LEAS'16 5.125%	USD	27/05/16		104.120	105.120	3.91	3.62	3.34	-0.06
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		108.566	109.067	3.61	3.51	4.51	0.14
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		117.545	118.045	4.23	4.16	6.22	0.30
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		117.593	118.094	4.96	4.92	9.08	0.08
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		104.200	104.600	2.25	1.73	0.73	
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.188	106.535	3.33	3.17	2.07	0.06
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.070	108.470	3.62	3.49	2.77	0.03
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		103.221	103.438	2.03	1.69	0.62	-0.01
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.920	106.045	2.45	2.35	1.25	-0.18
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.988	111.388	2.37	2.15	1.59	0.08
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.039	110.534	3.91	3.80	4.04	0.54
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.304	118.801	4.10	4.01	4.69	-0.11
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		102.004	102.629	5.39	5.20	3.30	0.02
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		103.625	104.125	0.71	-0.06	0.62	0.58
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		104.000	104.500	1.17	0.53	0.75	0.35
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.835	108.234	2.56	2.41	2.59	-0.06
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.584	108.079	3.56	3.44	4.06	-0.06
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.053	109.053	4.59	4.45	6.96	-0.28

ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ

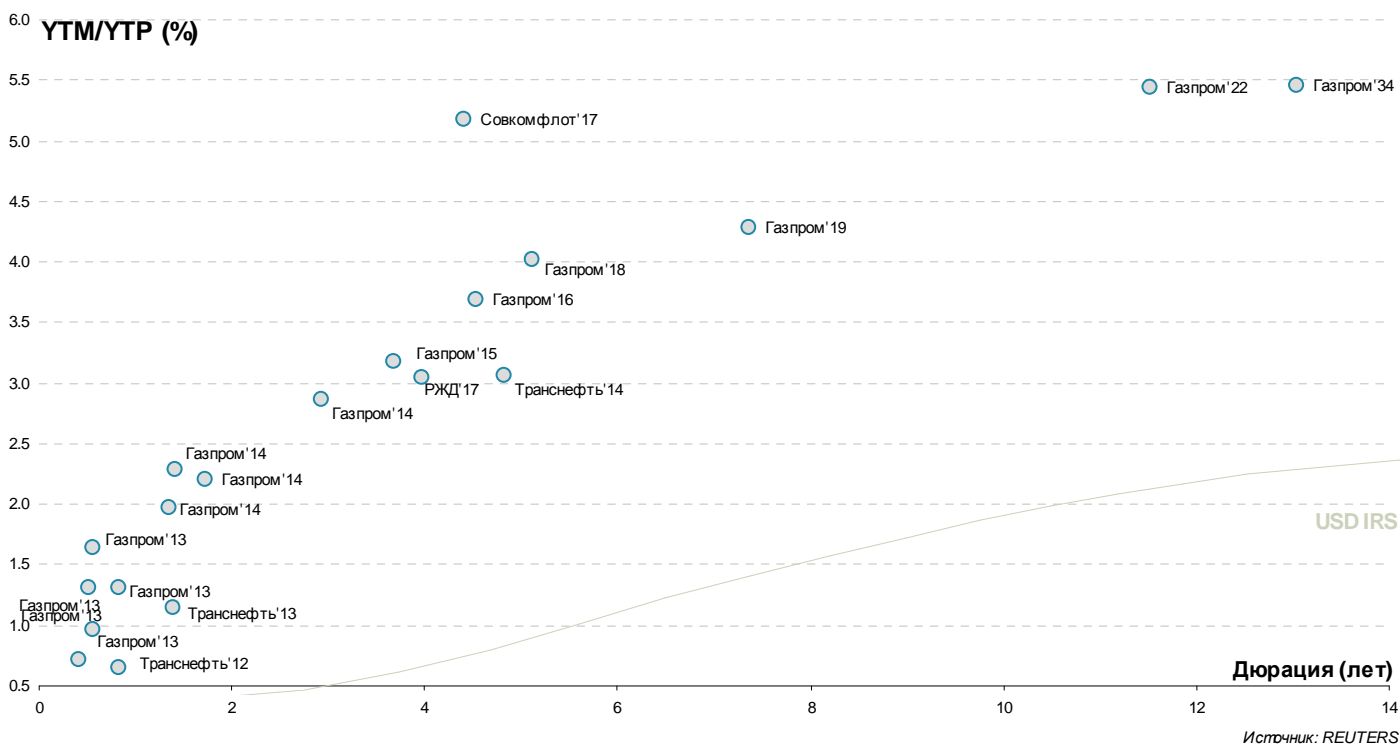
Евраз

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	103.850	2.67	2.07	0.55		234
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.018	109.515	5.08	4.92	2.75	-0.06	466
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		112.300	112.800	6.81	6.71	4.37	-0.24	605
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.176	101.176	6.71	6.49	4.62	-0.46	593
Альянс Ойл										
ALLIANCE OIL'15 9.875%	USD	11/03/15		106.750	107.250	6.84	6.62	2.24		651
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.928	111.404	3.52	3.30	1.95	-0.05	314
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		112.298	113.296	5.82	5.68	6.12	-0.12	458
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		103.250	103.650	2.77	2.10	0.57		244
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		105.130	105.130	4.81	4.81	3.04	-0.37	436
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.386	110.895	5.10	4.95	3.17	-0.07	461
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		114.447	114.948	6.04	5.94	4.44	-0.20	526
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		106.630	107.630	6.70	6.54	6.31	-1.75	546
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.503	108.799	2.21	2.08	1.96	-0.04	181
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.407	113.808	3.25	3.16	4.10	-0.06	256
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.326	120.836	3.94	3.87	5.69	-0.08	280
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		112.852	113.354	4.24	4.17	6.49	0.02	292
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		119.770	120.530	4.16	4.07	7.41	-0.14	262
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		121.158	121.656	5.26	5.19	5.89	-0.14	407
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.500	107.000	3.26	3.11	3.10	-0.25	276
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		116.500	117.000	4.24	4.17	6.65	-0.25	288
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.750	107.000	1.59	1.30	0.81	0.29	124
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.750	110.250	2.81	2.50	1.44	0.38	245
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.667	107.165	5.19	5.08	4.30	-0.10	447
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		101.772	102.772	7.34	7.11	4.42	-0.21	664
ТНК										
TNK-BP'13 7.5%	USD	13/03/13		102.749	105.749	1.46	-4.76		-0.13	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.053	108.990	2.68	2.29	2.21	-0.05	227
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.218	115.718	3.22	3.09	3.37	-0.28	267
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.377	114.384	3.38	3.16	3.98	-0.33	273
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		120.148	121.169	3.76	3.57	4.62	-0.67	293
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.098	122.160	3.92	3.77	5.93	-0.86	273
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.800	105.100	2.64	2.24	0.72		230
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		107.768	108.767	4.64	4.23	2.30	-0.05	426
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		108.208	109.208	5.95	5.73	4.26	-0.29	527
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		101.250	101.375	3.42	2.87	0.22	-0.25	314
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		102.082	102.582	4.47	3.99	1.02		417
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		105.745	106.745	6.64	6.29	2.67	0.14	628
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.882	105.132	4.43	4.12	0.77	-0.06	414
PSB FINANC'14 6.2%	USD	25/04/14		100.751	101.251	5.69	5.36	1.49	-0.01	540
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		111.488	112.488	7.87	7.48	2.28	0.84	759
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	09/07/16		106.829	108.829	9.07	8.46	3.14	0.13	871
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.506	104.006	4.51	4.17	1.42	0.12	419

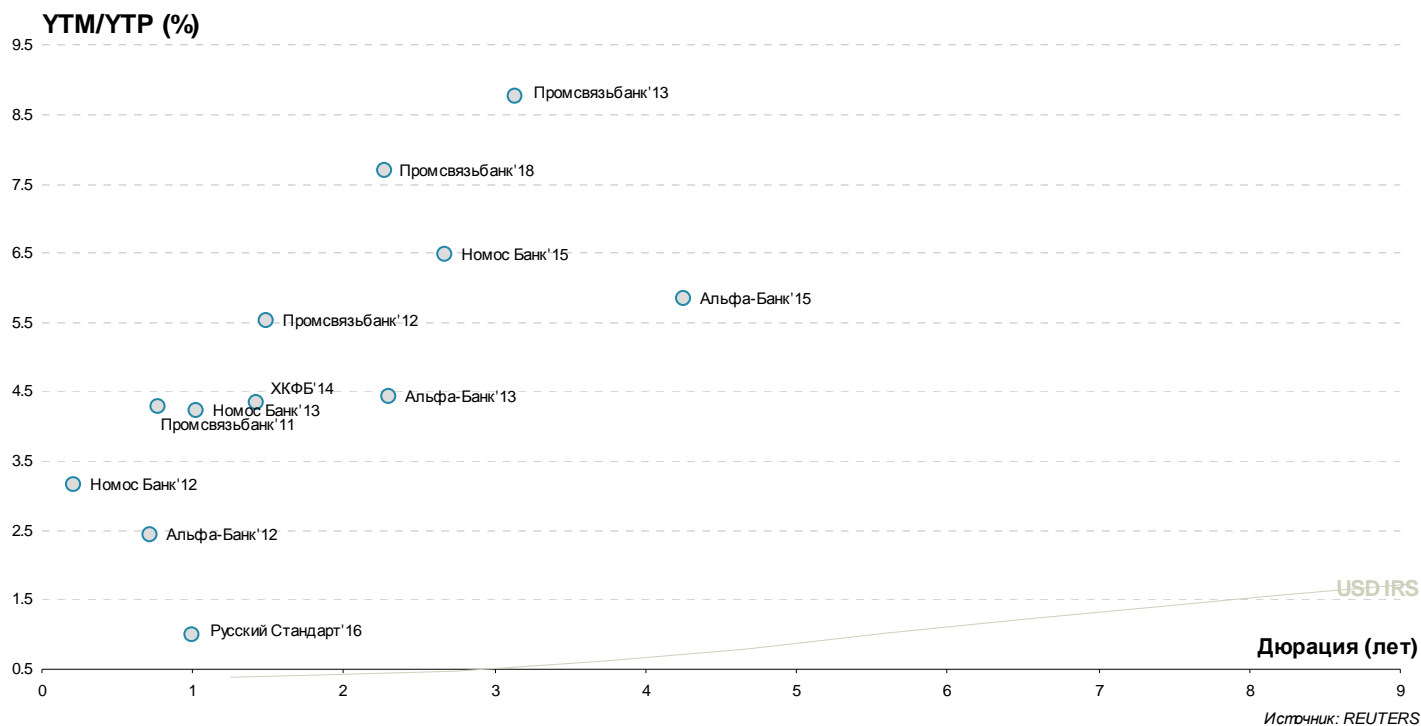
Россия



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

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.