

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынок труда США: так ли хороша сентябрьская статистика?

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Условия рынка не спешат восстанавливаться
- Заседание ЦБ прошло без сюрпризов
- Рубль немного укрепился

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды: рост ограничен со стороны UST
- Локальный рынок растет на внешнем позитиве

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

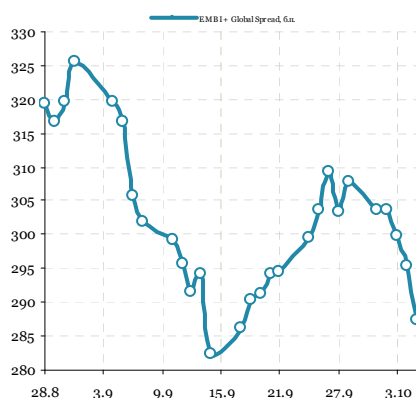
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.74	▲	0.07	1.39	2.06
UST 10-2Y sprd	148	▲	5	117	176
EMBI+ Glob.	287	▼	-8	282	441
EMBI+ Rus sprd	159	▼	-5	161	332
Russia '30 yield	2.89	▲	0.02	2.85	4.45
Денежный рынок					
Libor-3m	0.35	▼	0.00	0.35	0.47
Euribor-3m	0.22	▼	0.00	0.22	0.77
MosPrime-1m	6.46	▲	0.03	5.78	6.89
Корсчета в ЦБ	618.8	▲	28.6	446	1032
Депоз. в ЦБ	70.4	▲	0.6	61	369
NDF RU 3m	6.1	▼	-0.1	5	7
Валютный рынок					
USD/RUB	30.994	▲	0.072	29.31	33.67
EUR/RUB	40.395	▲	0.104	38.69	41.81
EUR/USD	1.305	▲	0.003	1.21	1.33
Корзина ЦБ	35.24	▲	0.065	33.54	37.28
ДXY Индекс	79.337	▼	-0.016	78.71	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1508.7	▼	-1.5%	1228	1682
Dow Jones	13610.2	▲	0.26%	12101	13610
DAX	7317.7	▼	-1.08%	5969	7452
Nikkei 225	8825	▲	0.44%	8296	10115
Shanghai Comp.	2086.2	▼	-0.56%	2004	2452
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	109.6	▼	-0.67%	88	122
Нефть Brent	112.0	▼	-1.27%	89	123
Золото	1780.6	▼	-0.67%	1540	1790
CRB Index	307.6	▼	-0.91%	267	321

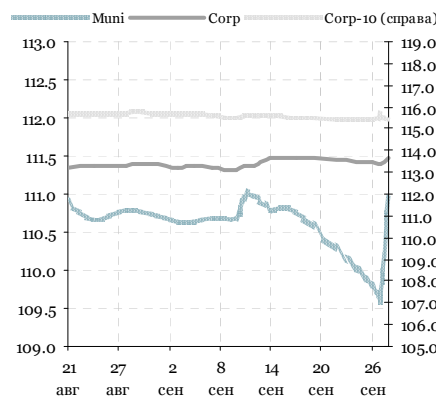
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	117.0	▲	0.40	107.5	117.2
Muni	111.0	▲	1.36	109.6	112.8
Corp	111.5	▲	0.10	110.7	112.1
Corp-10	115.4	▼	-0.18	115.4	117.8
Total Return					
OFZ	267.7	▲	0.32	233.3	267.7
Muni	345.4	▲	3.50	324.8	345.4
Corp	344.1	▲	0.77	323.6	344.8
Corp-10	344.7	▼	-0.11	324.6	344.8
Объем торгов в сегменте (млн руб.)					
OFZ	738	▼	-2 496	0	22 514
Muni	1 347	▲	957	10	6 146
Corp	6 236	▲	2 790	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ОАО «НОВАТЭК» открыло книгу заявок инвесторов на покупку биржевых облигаций серий БО-02 объемом 10 млрд руб., серий БО-03 и БО-04 по 5 млрд руб. /Интерфакс/

ЗАО «Кредит Европа Банк» установило купон биржевых облигаций серии БО-03 на 5 млрд руб. в размере 9,80% годовых, что соответствует доходности к годовой оферте на уровне 10,04% годовых. /Bloomberg/

ОАО Банк «Ак Барс» открыл книгу заявок на биржевые облигации серии БО-01 объемом 5 млрд руб. /Интерфакс/

Основные события: вне рынка / на рынке

05.10.2012 – пятница

Статистика США: Занятость в несельскохозяйственном секторе за сентябрь

Статистика США: данные по безработице за сентябрь

• **Выплата купона:** Фармпрепарат, 01 (12%, 23 млн руб.), Платежные системы, 01 (8%, 350 млн руб.), Россия, 26170 (2%, 704.2 млн руб.), Россия, 26197 (6%, 1 266.9 млн руб.), РЖД, 2022 (5.7%, 28.5 млн долл.)

• **Погашение:** Россия, 26170 (21 058.7 млн руб.)

• **Размещение:** ФК ОТКРЫТИЕ, 03 (7 млрд руб.)

Сегодня: 08.10.2012 – понедельник

• **Выплата купона:** Микро Капитал, 2014-3, CHF (9%, 101.25 тыс фр.), Банк ЗЕНИТ, БО-01 (7.5%, 188 млн руб.), Инвестторгбанк, 04 (9%, 67.68 млн руб.), Аэрофлот, БО-01 (7.75%, 231.84 млн руб.), Аэрофлот, БО-02 (7.75%, 231.84 млн руб.), СИТРОНИКС, БО-02 (10.75%, 160.8 млн руб.)

• **Оферта:** Синергия, БО-01 (3 млрд руб.)

• **Погашение:** Инвестторгбанк, 04 (1.5 млрд руб.)

• **Размещение:** Банк Санкт-Петербург, БО-08 (5 млрд руб.)

Завтра: 09.10.2012 – вторник

Статистика США: Wholesale inventories

• **Выплата купона:** РЖД, 14 (7.85%, 587.1 млн руб.), Мечел, БО-05 (11.25%, 280.5 млн руб.), Мечел, БО-06 (11.25%, 112.2 млн руб.), Мечел, БО-07 (11.25%, 112.2 млн руб.), Мечел, БО-11 (11.25%, 168.3 млн руб.), Мечел, БО-12 (11.25%, 168.3 млн руб.), Транснефть, 02 (9.75%, 3.4 млрд руб.), Банк Санкт-Петербург, БО-01 (8.25%, 205.7 млн руб.), Газпром нефть, БО-05 (7.15%, 356.5 млн руб.), Газпром нефть, БО-06 (7.15%, 356.5 млн руб.), СБ Банк, 04 (11%, 82.3 млн руб.), Иркутскэнерго, БО-01 (7.6%, 113.7 млн руб.), Татфондбанк, БО-05 (11%, 109.4 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 02 (6.45%, 74.2 млн руб.), Галс-Девелопмент (бывш. Система-Галс), 01 (8.5%, 127.1 млн руб.)

• **Погашение:** Северная экспедиция, 2012, CNV (100 млн руб.)

• **Размещение:** КРЕДИТ ЕВРОПА БАНК, БО-03 (5 млрд руб.), Меткомбанк, БО-05 (1.5 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Рынок труда США: так ли хороша сентябрьская статистика?

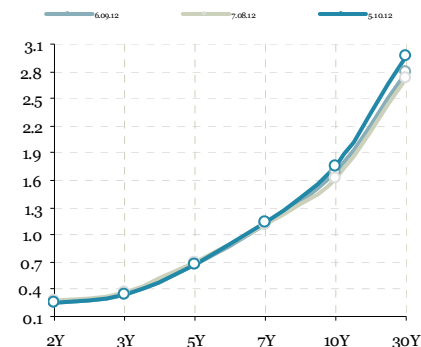
Ключевые экономические данные всей прошлой недели – цифры Минтруда США за сентябрь – оказались позитивными для динамики котировок рискованных активов. Число рабочих мест вне сельскохозяйственных отраслей увеличилось на 114 тыс. (прогноз – 115 тыс.), а уровень безработицы снизился с 8.1% до 7.8%. Эти цифры, на первый взгляд, говорят о неплохом состоянии рынка труда, более того, с точки зрения предвыборной гонки, они дают некоторые предпочтения нынешнему президенту США, сумевшему за свой срок нахождения у власти опустить уровень безработицы ниже психологических 8%.

Тем не менее, как это часто происходит, цифры с рынка труда при более детальном рассмотрении не вызывают эйфории. Снижение уровня безработицы вызвано лишь ростом волатильного показателя занятости (+873 тыс.), который составляется методом опроса домохозяйств, при меньшем приросте числа рабочей силы (+418 тыс.). Таким образом, прирост занятости на 100-200 тыс. рабочих мест в месяц не способно привести к качественному улучшению на рынке труда. Впрочем, стоит отметить и явные признаки улучшения. Прежде всего, это опустившийся ниже отметки в 5 млн чел. показатель длительной безработицы, что во многом было обусловлено скачком на 582 тыс. во временных рабочих местах (из-за невозможности найти постоянную работу).

В условиях повсеместного ухудшения экономических условий не стоит ожидать каких-либо чудес от рынка труда, который особенно в развитых экономиках является прямым отражением экономических процессов. В то же время, нельзя сказать что рынок труда США находится в депрессивном состоянии: качественные его показатели выглядят неплохо: средняя продолжительность рабочей недели и почасовой заработок в сентябре продемонстрировали рост.

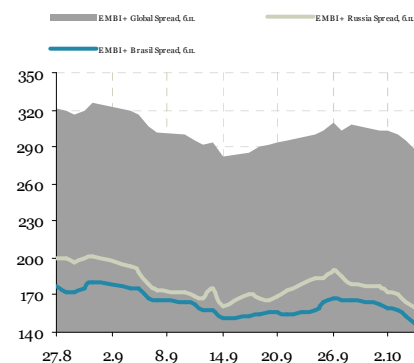
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



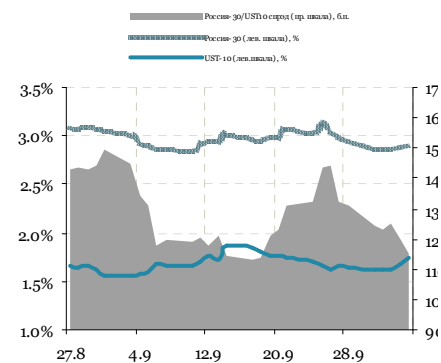
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



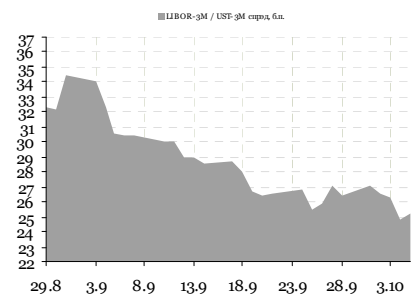
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Условия рынка не спешат восстанавливаться

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка в пятницу немного ухудшилась без особых на то причин. На рынке МБК стоимость краткосрочных кредитов поднялась на 25 бп до 6.00% годовых, междилерское репо через выходные стоило в среднем 5.90% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банкам удалось привлечь весь заявленный объем в 118 млрд руб. против 116 млрд руб. в четверг. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ увеличилась на 29.2 млрд руб., составив 689.2 млрд руб.

На текущей неделе отсутствие существенных отвлечений ликвидности должно помочь рынку продолжить восстановление. Банки уже привели к адекватному уровню задолженность по операциям репо с ЦБ РФ, снизив ее за прошлую неделю на 263 млрд руб. до 1.2 трлн руб. Мы ожидаем снижения краткосрочных процентных ставок на текущей неделе на 25-50 бп.

Заседание ЦБ прошло без сюрпризов

Прошедшее в пятницу заседание Совета директоров ЦБ РФ не принесло сюрпризов: регулятор оставил без изменения основные процентные ставки. Характерно, что минувшее заседание заметно отличалось от сентябрьского: продолжив ужесточать антиинфляционную риторику, представители Центробанка отметили также и ухудшающиеся условия для продолжения экономического роста. Однако тревожным сигналам августа-сентября было отведено не центральное место в сообщении ЦБ РФ по итогам заседания. Регулятор убежден, что дальнейшее ужесточение процентной политики не окажет весомого давления на экономическую активность и кредитный рынок. Учитывая эти заявления, мы ожидаем повышения линейки ключевых ставок ЦБ РФ на 25 бп на ноябрьском заседании.

Рубль немного укрепился

Валютные торги завершились в пятницу укреплением рубля по отношению к бивалютной корзине на 9 коп. до отметки 35.10 руб. Позитивный внешний фон, вызванный публикацией неплохих данных по рынку труда США за сентябрь, оказал рублю поддержку, однако к закрытию рубль растерял часть преимуществ. Учитывая относительно невысокую важность локальных факторов для рубля, на текущей неделе внешний фон останется определяющим для российской валюты. Таким образом, мы ожидаем сохранения волатильности рубля в диапазоне 35.00-35.50 руб. за корзину.

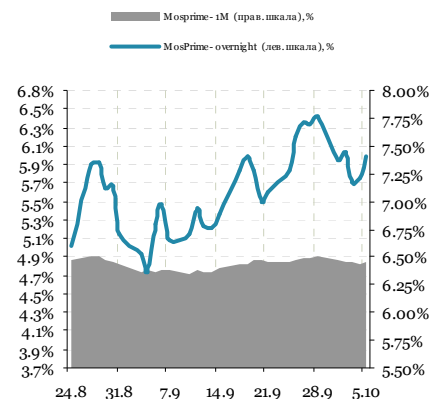
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	Аукцион репо ЦБ РФ	1 год
Вторник	Аукцион Казначейства	3 мес, 38 млрд руб. от 7.1% годовых
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26209 (10 лет), 35 млрд руб.
	Возврат ВЭБу	30 млрд руб.
	Возврат Казначейству	20 млрд руб.
Четверг	Аукцион Казначейства	3 мес, 38 млрд руб. от 7.1% годовых
Пятница		

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

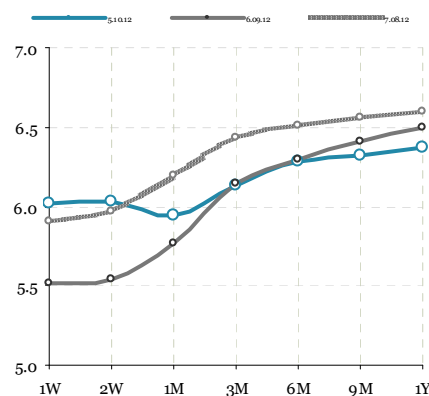
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды: рост ограничен со стороны UST

Российский сегмент показал в пятницу скорее нейтральную динамику цен, несмотря на всплеск оптимизма и растущий спрос на риск, обусловленные выходом неплохих цифр по рынку труда США. Давление на котировки суверенных бумаг оказывали растущие доходности вдоль кривой UST, на этом фоне цены вдоль суверенной кривой опустились в среднем в пределах 25 бп; «тридцатка» в течение дня торговалась на уровне 127%, котировки дальнего Россия'42 опустились ближе к отметке 121.5%. Корпоративный сегмент показал разнонаправленное движение цен, которое по-прежнему укладывалось в диапазон колебаний 25 бп.

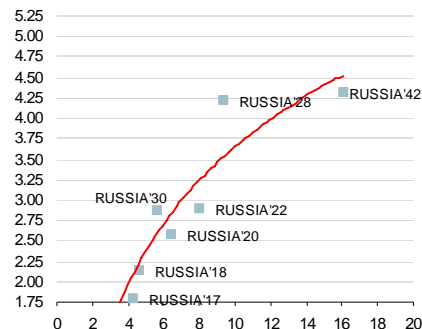
Локальный рынок растет на внешнем позитиве

Рублевые облигации завершили неделю на мажорной ноте. Неплохие данные по рынку труда США, растущая нефть и укрепляющийся рубль подогрели спрос на локальном рынке, дальние госбумаги прибавили в ценах в среднем порядка 40 бп, отдельные выпуски обновили годовые минимумы доходности. Корпоративный сектор также торговался преимущественно вверх по ценам. На среднем участке кривой неплохой результат показали выпуски Вымпелком 1 и Вымпелком 2, прибавившие в ценах в районе 40 бп, схожий результат показал выпуск РСХБ 14, более умеренным ростом завершили день выпуски НЛМК 7 и Сибметинвест 1, подорожавшие в среднем на 20 бп.

Кирилл Сычев

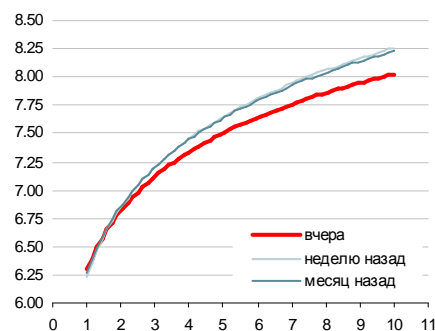
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



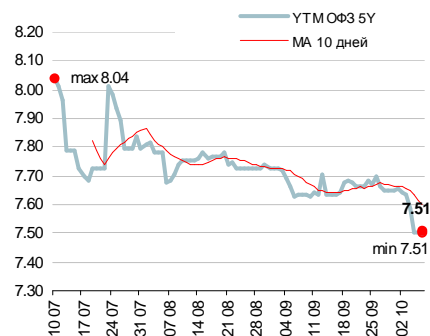
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



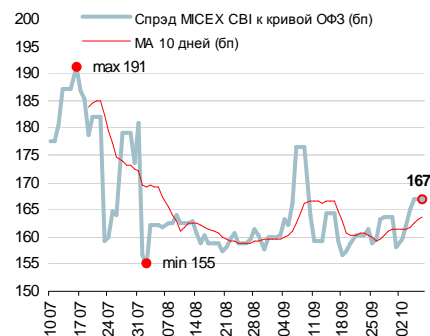
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



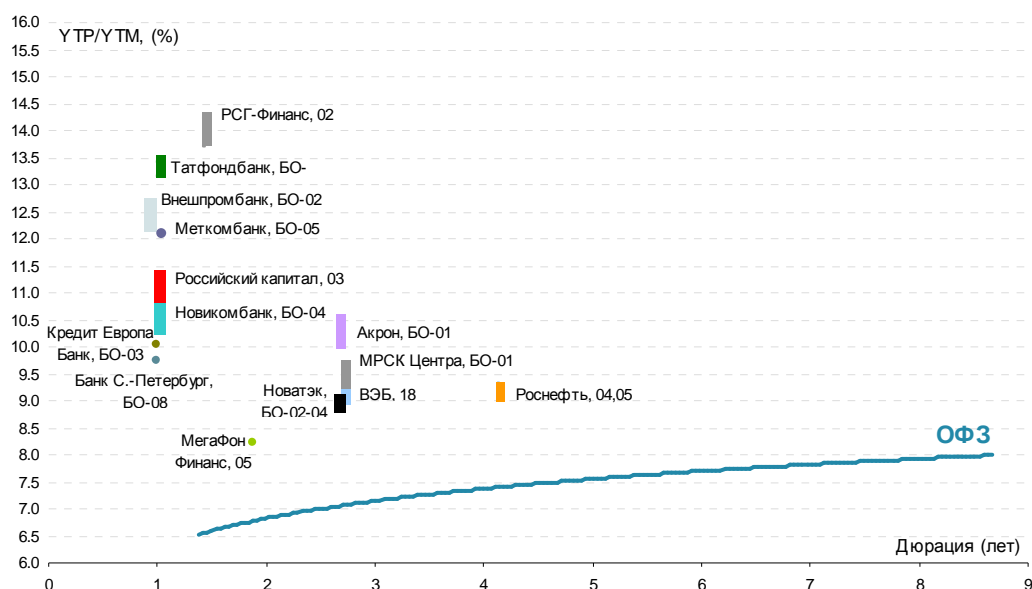
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
Банк Санкт-Петербург, БО-08	- / Ва3 / -	да	5 000	9.73	02.10.2012	08.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Меткомбанк, БО-05	- / В2 / -	да	1 500	12.10	05.10.2012	09.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Кредит Европа Банк, БО-03	- / Ва3 / ВВ-	да	5 000	10.04	05.10.2012	09.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
МегаФон Финанс, 05	ВВВ- / - / -	да	10 000	8.21	04.10.2012	11.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Новикомбанк, БО-04	- / В2 / -	да	2 000	10.25-10.78	09.10.2012	11.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
ВЭБ, 18	ВВВ / Ваа1 / ВВВ	да	10 000	8.94-9.15	10.10.2012	12.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 20 лет
Новатэк, БО-02	ВВВ- / Ваа3 / ВВВ-	да	10 000	8.78-9.05	09.10.2012	15.10.2012	нет / 2.7 г.	нет / 3 г.
Новатэк, БО-03	ВВВ- / Ваа3 / ВВВ-	да	5 000	8.78-9.05	09.10.2012	15.10.2012	нет / 2.7 г.	нет / 3 г.
Новатэк, БО-04	ВВВ- / Ваа3 / ВВВ-	да	5 000	8.78-9.05	09.10.2012	15.10.2012	нет / 2.7 г.	нет / 3 г.
Татфондбанк, БО-06	- / В3 / -	да	2 000	13.16-13.42	11.10.2012	16.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
РСГ-Финанс, 02	В- / - / -	да	2 500	13.69-14.22	12.10.2012	16.10.2012	нет / 1.41 г.	1.5 г. / 3 г.
Акрон, БО-01	- / В1 / В+	да	5 000	9.99-10.51	12.10.2012	16.10.2012	нет / 2.66 г.	нет / 3 г.
Роснефть, 04	ВВВ- / Ваа1 / ВВВ	да	10 000	8.99-9.31	12.10.2012	16.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
Роснефть, 05	ВВВ- / Ваа1 / ВВВ	да	10 000	8.99-9.31	12.10.2012	16.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
МРСК Центра, БО-01	ВВ- / - / -	да	4 000	9.20-9.73	15.10.2012	17.10.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
Ак Барс, БО-01	- / В1 / ВВ-	да	5 000	н/д	16.10.2012	18.10.2012	н/д	н/д / 3 г.
Российский Капитал, 03	- / - / В+	да	3 000	10.78-11.30	19.10.2012	XX.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Внешпромбанк, БО-02	В / В2 / -	да	3 000	12.10-12.63	XX.10.2012	XX.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.

Источник: 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
ФК Открытие, 03	NR	нет	7 000	н/д / 100%	10.65-11.19	10.65	05.10.2012	нет / 1 г.
КАМАЗ, БО-03	NR	нет	2 000	1.4 / 100%	10.51-11.04	10.78	04.10.2012	нет / 2.64 г.
Икс 5 Финанс, БО-01	В+ / - / -	да	5 000	1.2 / 100%	9.73-10.15	9.73	04.10.2012	нет / 2.68 г.
ВТБ, БО-19	ВВВ / Ваа1 / ВВВ	да	15 000	н/д / 100%	8.68	8.68	04.10.2012	нет / 2.68 г.
ВТБ, БО-20	ВВВ / Ваа1 / ВВВ	да	15 000	н/д / 100%	8.68	8.68	04.10.2012	нет / 2.68 г.
УБРИР, БО-01	В / - / -	да	2 000	1.3 / 100%	12.63-13.16	12.89	02.10.2012	нет / 1 г.
ФСК ЕЭС, 25	ВВВ / Ваа2 / -	да	15 000	1.5 / 100%	8.68-8.94	8.79	02.10.2012	нет / 3.46 г.
Альфа-Банк, БО-03	ВВ / Ва1 / ВВВ-	да	10 000	н/д / 100%	8.42-8.68	8.63	28.09.2012	нет / 1 г.
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.



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 25067		17/10/12	100.17	100.18	100.18	-0.00	13	20 043	5.82	0.03			45 000
ОФЗ 26198		02/11/12	99.98	100.00	99.99	-0.00	9	76 388	5.99	0.08			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.33	100.36	100.35	0.03	17	214 752	6.01	0.30			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.24	100.25	100.25	0.02	9	132 031	6.00	0.34			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.75	103.00					5.91	0.47			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.00	100.10	100.17	0.07	1	1	6.01	0.76			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13		100.95					6.24	0.99			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.80	100.81	100.81	0.02	17	246 338	6.60	1.39	6	25	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.40	109.70	109.70	0.30	3	37 001	6.52	1.72		18	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.30	109.45	109.35	-0.05	1	944	6.76	1.98		42	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	99.10	103.47	102.90	-0.29	2	4 001	6.73	1.96		39	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.32	100.35	100.18	-0.02	14	57 563	7.04	2.42	8	69	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	99.80	100.08	99.80	-0.16	5	40 010	7.08	2.54	9	73	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	100.80	101.15	101.15	0.15	9	69 735	7.07	2.95		71	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	97.50	97.75					7.39	2.98	27	103	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.40	99.48	99.32	-0.08	7	105 583	7.23	3.39	2	83	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18		97.00					8.93	3.40	171	253	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.34	3.71	106	192	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	100.85	101.05	100.95	0.30	15	254 837	7.28	3.82		85	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	100.65	101.00	101.00	0.30	19	3 248 025	7.27	3.97		82	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	101.40	101.55	101.50	0.60	21	534 070	7.29	4.56		76	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	90.75	91.00	90.90	0.65	2	325 000	7.62	4.60	18	108	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	97.60	97.90	97.90	0.05	1	3 000	7.60	4.72	14	104	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	100.45	100.75	101.26	1.11	14	290 119	7.38	5.17		75	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		68.00					8.26	5.57	67	157	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	94.59	94.60	94.60		6	8 956	7.80	6.23	13	102	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	100.20	100.65	100.60	0.45	14	45 907	7.64	6.22		86	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	99.61	99.85	99.85	0.25	14	106 036	7.77	6.98	1	87	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	74.60	87.20					8.74	7.45	93	177	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	101.20	101.59	101.30	0.15	38	906 805	8.15	8.67	23	100	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	85.15	88.20	87.00	1.00	2	31	8.34	10.88	25	86	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		80.00					7.87	10.55		44	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель													
НорНикель ВО3		30/07/13	95.01	100.00					7.18	0.80	105	88	15 000
НЛМК													
НЛМК ВО5		30/10/12	100.17	100.28	100.20	-0.06	1	1 000	7.73	0.07			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	100.36	100.43	100.43	0.08	1	5	7.08	0.16		107	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.20	100.31					7.49	0.41		130	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.65	100.85	100.70		2	30 000	7.83	0.68	182	155	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.65	100.70	100.70		3	31 000	7.83	0.68	182	155	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.05	100.25					7.94	1.81	120	160	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.00	101.70					8.26	1.90	148	192	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	85.05	100.25	100.15	0.10	7	222 001	8.60	2.25	170	226	5 000
ММК													
ММК ВО1		15/11/12	90.00	99.98	99.94	0.03	1	20 000	7.49	0.11		153	5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.95	100.03	99.93	-0.02	1	262	7.95	0.50		172	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	86.00	100.20					8.09	0.84	192	178	5 000
ММК ВО4		27/02/14	86.01	99.70	99.26	0.27	2	2	8.38	1.34	186	203	5 000
ММК ВО6		10/07/14	83.00						8.92	1.66	225	258	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.80	99.00	97.50	-0.08	3	3	8.97	1.69	228	263	5 000
Севсталь													
Севсталь ВО2		15/02/13	100.80	100.95	100.75	0.05	8	7 007	7.72	0.36		155	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.76	100.95					7.23	0.36		106	5 000
Алроса													
Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.25	100.45	100.30	0.02	3	800	8.05	0.70	202	177	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.21	100.48					8.13	0.71	209	185	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.20	101.50	101.40		3	13 025	8.63	2.42	167	228	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.20	101.50	101.45	0.05	1	19	8.61	2.44	165	226	3 000
Евраз													
Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.02	100.75					8.04	0.46		182	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20		100.95					7.53	0.46		131	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	108.16	108.45	108.16	0.21	5	57 169	9.21	1.75	249	287	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	108.15	108.45	108.25	0.23	2	50 000	9.16	1.75	244	282	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	100.60	101.00	100.60	0.15	2	12 342	9.95	2.60	294	360	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	100.25	101.24	100.50	0.15	3	46 001	9.99	2.60	298	364	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	93.00	99.90	95.03	-0.57	2	388	10.30	3.13	315	393	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	94.01	99.90	95.00	-0.60	1	1	10.31	3.12	316	394	15 000
Металлоинвест													
Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.75	99.95	99.91	0.10	2	168	9.24	2.24	234	290	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.70	99.95	99.85	0.05	1	1	9.27	2.24	237	293	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.70	99.90	99.85	0.12	2	1 501	9.27	2.25	237	293	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	
Мечел													
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	100.28	100.33	100.33	0.03	14	6 925	11.25	0.76	516	496	5 000
Мечел 5	16/10/12	09/10/18	99.80	100.00	100.00	-0.06	9	77 926	12.89	0.03			5 000
Мечел ВО1	11/11/11	09/11/12	95.01	99.97	99.97	-0.01	7	8 951	8.46	0.10		252	5 000
Мечел ВО2		12/03/13	99.15	99.29	99.20		3	208	12.00	0.43		580	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.00	99.20					11.58	0.53	577	534	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.00	96.25	96.50	0.35	8	12 076	13.27	0.67	728	700	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	92.31	92.89	92.60		4	631	14.88	1.31	838	853	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	92.30	93.23	92.60		5	602	14.88	1.31	838	853	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	96.00	96.49	95.75		4	228	14.25	1.28	777	790	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.57	2.52	458	522	5 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.57	2.14	470	523	2 000
Мечел ВО7		07/04/15							11.57	2.52	458	522	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.57	2.52	458	522	3 000
Мечел ВО12		07/04/15							11.57	2.52	458	522	3 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	88.10	90.98					14.35	2.55	735	800	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.54	91.80					13.90	2.56	690	755	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	84.00	85.49	83.00	-4.44	7	2 416	15.07	3.08	793	870	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	84.05	87.46					14.91	3.09	777	854	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	84.05	86.49	86.49	0.69	32	2 492	13.57	3.10	642	720	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.50	100.05					9.79	0.98	351	344	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.63	100.69	100.67	0.17	10	1 408	8.55	0.73	250	227	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.80	98.00	98.00	1.00	11	3 119	12.58	1.13	620	623	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	93.50	93.99	93.50	1.50	14	2 976	13.92	1.53	730	758	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.40	100.80					6.26	0.16		25	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	95.01	97.00	96.96	-0.27	3	333	11.04	1.52	443	470	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.35	93.75	93.35	-0.15	18	11 864	14.10	1.35	758	775	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	88.20	88.48	88.20	0.20	5	1 265	14.73	2.21	784	839	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12	99.95	100.10					6.43	0.09		50	5 000
РЖД ВО		05/12/12	100.45	100.50	100.45	-0.07	1	5 000	6.65	0.17		63	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.50	99.75	99.75	0.15	2	34	7.26	1.06	92	91	15 000
РЖД 10		06/03/14	110.15	110.26	110.27	0.22	5	650	7.36	1.32	86	101	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.60	102.63	102.55	-0.13	12	23 394	7.92	2.12	106	158	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.45	99.64	99.45	-0.10	1	6 500	8.16	2.75	110	180	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.25	99.47	99.40	0.15	4	35 014	8.25	3.18	109	187	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.00	100.30					8.31	4.65	86	176	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.60	100.30					7.42	0.96	116	108	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.60	100.30					7.50	0.96	124	116	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.10	101.39	101.15	0.03	1	4 000	7.89	1.56	126	155	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	96.50	102.15					7.74	1.85	98	140	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.30	100.00					8.08	2.70	104	173	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.30	98.75	98.50	-0.50	1	5 000	8.22	2.70	118	187	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	99.00						8.38	3.05	125	202	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	97.00	97.50					8.89	4.10	153	243	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70	97.00	-0.15	1	1	8.93	4.09	158	247	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.10	97.00					8.96	4.65	151	241	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.90	99.99					9.11	6.15	145	234	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.50	100.30	99.50	-0.40	18	64 532	9.43	2.26	252	308	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.00					9.83	3.80	253	340	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.01	101.00	99.20	0.03	8	14 164	10.01	1.04	369	366	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15		98.99					9.37	2.76	231	301	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.70					9.36	3.05	223	300	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.11	3.05	198	275	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	85.00						9.41	3.68	213	299	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32			99.03	-0.92	2	1 020	9.64	3.68	237	322	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.43	3.68	215	301	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16		100.19	100.20	0.12	1	100	8.26	1.41	171	191	7 000

НЕФТЬ и ГАЗ

ГАЗПРОМ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14	100.02	100.07	99.80	-0.21	1	99	9.79	0.09	385	15 000	
Газпром А9		12/02/14	99.51						7.64	1.30	115	5 000	
Газпром А11		24/06/14	110.00	110.85	110.20	-0.64	1	300	7.44	1.55	82	5 000	
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12		100.58					5.96	0.19		5 000	
Лукойл БО-7		13/12/12							6.89	0.19	85	5 000	
Лукойл 4		05/12/13	100.22	100.25	100.22	-0.03	2	2 971	7.32	1.12	94	6 000	
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.12	98.48	98.12	0.06	1	1	8.09	0.28	197	8 000	
Газпром нефть БО-5		09/04/13							7.27	0.49	104	10 000	
Газпром нефть БО-6		09/04/13							7.32	0.49	109	10 000	
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	92.00	101.00					7.99	2.15	112	10 000	
Газпром нефть 8		02/02/16	100.50	101.50	100.50	-0.50	2	1 000	8.49	2.93	139	10 000	
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.80	103.00					8.31	2.95	120	10 000	
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	95.00	102.50	101.55	0.45	4	26 497	8.71	4.32	132	10 000	
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	98.01	99.50	99.50	1.00	1	1	8.49	4.37	109	10 000	
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	95.00	100.20					7.39	0.70	136	10 000	
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.50	99.53	99.50	-0.10	1	181	7.95	0.94	170	5 000	
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.52	101.15	101.11	0.05	3	231	6.88	0.20	82	15 000	
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.50	101.13					6.88	0.20	82	15 000	
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	101.05	101.13	101.05	0.06	3	1 068	7.19	0.20	113	20 000	
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.65	101.75	101.60	-0.10	1	35	8.03	1.10	166	10 000	
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.00						8.62	2.16	175	10 000	
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.56	100.50					10.78	0.79	466	5 000	
НК Альянс БО-1		04/02/14	97.04	99.00	98.76	-0.25	9	1 559	10.51	1.27	404	5 000	
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	93.00	95.60					10.62	3.12	347	5 000	
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	93.00	97.99					10.79	3.12	364	7 000	
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.18	99.37	99.37	0.57	6	370	13.41	0.78	731	3 000	
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.69	3.19	252	5 000	
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16							7.81	0.73	175	15 000	
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.17	100.28	100.20	-0.06	1	1 000	7.74	0.21	167	10 000	
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.11						7.72	0.30	158	10 000	
ВТБ БО-1		15/03/13	99.70	101.00	101.00	0.92	1	5	5.39	0.44		5 000	
ВТБ БО-2		15/03/13	99.70	100.10					7.69	0.44	149	5 000	
ВТБ БО-5		15/03/13	99.85	100.08					7.69	0.44	149	10 000	
ВТБ 5		17/10/13	99.23	99.80	99.23	-0.72	1	130	8.44	0.99	215	15 000	
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.05						8.24	1.38	170	5 000	
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.05	100.19					8.09	1.38	155	5 000	
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	196	6 000	
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.21	100.15					8.65	2.00	183	15 000	
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.15	100.10	-0.05	3	20 001	8.23	0.86	205	8 000	
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					8.45	0.79	234	5 000	
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.45		99.65	0.11	1	1	7.75	0.40	157	5 000	
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15							7.92	0.26	181	10 000	
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.50					7.65	1.13	126	5 000	
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.92	1.25	246	5 000	
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	100.20	100.50	100.30	0.13	2	4 501	7.91	0.55	207	5 000	
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.40					8.41	0.76	232	8 000	
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20							7.65	1.00	136	15 000	
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.10	100.35	100.25	0.25	3	50 001	8.45	2.24	155	15 000	
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.70	98.45	98.45	0.01	3	3	8.60	3.09	146	15 000	
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.46	145	15 000	
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	95.76	96.54	96.54	0.54	8	7 120	8.95	4.08	160	10 000	
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.00	99.30	99.26	0.15	2	2	8.19	1.41	164	5 000	
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.00	101.00	0.20	1	12 000	8.43	1.86	167	5 000	
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.80	101.15	101.15	0.40	2	6 004	8.35	1.87	159	5 000	
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.50	100.90	100.60	0.20	1	10 000	8.88	2.06	204	10 000	
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		100.20	99.15	0.15	5	14 246	9.08	2.98	196	5 000	
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21		100.50	99.15	-0.10	4	113 124	9.08	2.98	196	5 000	
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.10	100.15	100.10	0.30	7	96 448	8.81	1.41	226	5 000	
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.45	100.65	100.49	0.29	3	1 169	9.10	1.75	238	5 000	
РСХБ													
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	98.50		100.40	0.05	3	10 000	7.97	0.88	178	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 БО-5	29/08/12	28/08/13	100.38	100.44	100.40		2	20 000	7.97	0.88	178	165	10 000
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.29	100.42	100.25	-0.20	3	1 002	8.16	0.13		218	5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.00	100.99					7.22	0.13		124	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.00	100.80					7.35	0.34		120	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.00	101.00	100.00	-1.00	1	1	9.14	0.34		298	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.55	99.50	0.10	3	20 019	7.74	0.67	175	147	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.52					7.57	0.82	143	126	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.52					7.59	0.82	144	128	5 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.30	100.60	100.40	0.10	4	9 153	7.95	1.01	165	160	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.85	101.00	100.85	0.05	5	200 139	8.06	1.02	175	171	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	101.50		99.80	-0.20	10	1 000	7.86	0.97	159	152	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.50	102.00					7.89	1.30	140	154	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	85.04	100.00					8.87	1.75	215	253	5 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.01	100.25	100.10	0.05	13	42 001	8.68	2.23	178	234	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.00	98.55	98.12	0.42	9	159 072	8.65	2.49	167	230	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.00	98.55	98.00	0.12	2	2	8.70	2.49	172	235	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.00	98.55	98.00	0.12	3	15 002	8.70	2.50	172	235	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							8.28	0.11		232	20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							5.70	0.13			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.22	100.29	100.22	-0.05	3	20 285	7.53	0.22		145	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.18	99.40					7.73	0.78	163	143	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.80	100.00					8.07	1.12	169	172	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.00	100.78					8.04	1.28	156	169	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.65	100.85	100.70	-0.15	4	16 328	8.58	1.65	191	224	10 000
АИЖК													
АИЖК А5		15/10/12							7.12	0.03			2 000
АИЖК А6		15/07/14							7.92	1.20	149	157	3 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	99.79					8.42	2.83	134	206	5 000
АИЖК А9		15/02/17	98.50		98.99		3	1 804	8.27	1.90	149	193	5 000
АИЖК А7		15/07/16							8.29	1.92	150	195	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.50	100.75					8.06	2.36	112	171	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23							8.40	3.05	127	204	7 000
АИЖК А10		15/11/18	95.04						8.65	3.05	152	229	6 000
АИЖК А21		15/02/20	101.00	101.30					8.76	3.23	158	238	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	100.00					8.98	3.87	167	254	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	98.00					8.94	5.00	144	234	10 000
АИЖК А17		15/04/22							8.90	5.48	132	223	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	99	177	5 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.81	168	208	7 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	99.60	100.20	100.20		2	4 000	8.99	1.11	262	264	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.21	100.20					9.19	1.11	282	284	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.75	100.00	100.00	0.25	1	75 419	9.45	1.69	276	311	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14	99.75	100.00	100.00	0.25	2	6 000	9.45	1.69	276	311	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	100.00	100.23	100.00		2	3 000	8.42	0.37		225	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.10					8.29	0.83	213	198	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.10	99.80	99.60	-0.10	2	30 001	8.33	1.06	199	198	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	99.95	99.95	0.15	2	22 300	8.45	1.42	189	210	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.10	99.60	99.25	-0.75	2	23 791	8.97	3.33	177	258	15 000
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.35	100.75	100.20	-0.44	1	1	7.83	0.69	182	155	10 000
МТС 1		17/10/13	99.40	99.89					8.02	0.98	174	167	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.00	99.25	99.10	0.20	3	78 359	8.17	1.53	156	183	15 000
МТС 2		20/10/15	97.71	98.20	98.36	-0.12	10	85 004	8.54	2.67	151	219	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.45	99.14	98.65	-0.15	3	202 100	8.84	2.72	179	249	15 000
МТС 7		07/11/17	98.45	99.15	99.11	0.76	3	7	9.12	4.08	177	266	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	101.19	101.20	101.20	0.10	6	12 003	7.77	0.76	168	148	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.02	99.07	98.36	-0.14	2	2	8.59	1.65	192	225	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.70	99.80	99.80	0.44	10	76 178	9.14	2.26	223	279	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.60	99.90	99.90	0.35	14	59 602	9.09	2.24	219	275	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.60	99.89	99.85	0.15	11	27 874	9.12	2.24	222	278	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.55		98.25	0.60	7	6 782	9.17	2.63	215	282	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.55		98.25	0.65	4	11 352	9.17	2.63	215	282	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 13	21/10/11	17/10/12	99.60						20.24	0.17		1 422	2 000
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.49					8.47	0.72	242	219	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	98.00	100.00					6.87	0.58	98	62	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00	101.10	100.40	-0.40	1	2	8.75	1.29	227	240	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	
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	97.01	101.10	100.02	-1.67	1	20 000	9.07	1.29	259	272	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.10	100.30	100.26	0.05	7	25 002	9.07	2.22	218	273	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.01	97.00					9.94	3.17	278	356	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.25	97.00	96.04	0.71	2	768	9.93	3.17	277	355	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.00	96.95					10.12	3.17	296	374	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.81	99.90	99.90		2	3	7.83	0.40		165	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.50						8.23	0.91	201	190	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	100.20		100.30	0.30	1	1	8.06	0.91	184	173	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.50						8.23	0.91	201	190	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.50	100.25					8.23	0.91	201	190	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	98.60						9.28	1.34	276	293	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.51	99.50	99.50	0.35	1	48	8.26	1.44	169	191	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.75	98.80					9.26	1.56	263	292	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.75	100.18	97.75	1.65	1	1	9.59	1.62	293	325	9 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	98.00	98.79					8.86	0.77	276	256	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	100.05	100.20	100.19	-0.01	11	13 653	9.09	0.96	283	275	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	98.83	99.45					11.46	0.60	555	520	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.15	99.90	99.90	0.73	1	1	8.51	1.04	219	216	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	96.20	100.17					6.10	0.97			3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	2.01	431	479	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.92	100.00	100.00		1	500	12.82	0.69	681	654	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	94.70	95.00	93.90	0.80	2	6 000	11.54	2.34	461	519	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.75	96.00	96.00	0.25	5	12 890	11.55	1.69	486	521	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	86.01	115.20					9.93	1.79	320	359	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.85	95.20	94.85	0.20	2	8 907	11.13	1.25	467	478	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.01	100.20	100.20	-0.05	2	2	8.02	0.20		197	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	94.05	98.95	98.60	0.60	3	9 002	9.96	1.27	348	361	3 000
УВЗ													
Ураль агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.25	100.10					7.93	0.19		189	3 000
Ураль агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.30	99.60	99.60	-0.07	1	4 886	9.63	0.87	344	331	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.60	100.00	98.54	-0.94	18	904	12.37	0.97	610	603	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13							9.76	1.77	304	342	5 000
ГСС													
ГСС 01	19/09/13	26/03/17							8.15	0.94	191	182	5 000
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							8.32	0.21		225	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	94.12	99.60	99.60		2	15 000	9.99	0.53	418	375	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	94.00		99.43	0.01	4	66	9.54	0.53	373	330	3 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.61	100.49					8.50	0.55	266	225	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.20	102.55	102.20	0.08	10	934	9.69	0.75	361	340	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.21	100.69	100.95	0.29	10	2 252	10.54	2.12	368	420	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13							7.51	0.49		128	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13							7.45	0.49		122	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	101.10					6.71	0.39		53	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.40	100.90					8.56	1.75	185	222	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.99					9.77	1.35	325	342	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.25	100.66					10.12	2.19	324	378	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.25	100.90	100.86	0.65	6	2 760	9.81	2.18	293	347	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.91	100.07	100.08	0.01	8	247	12.78	0.96	651	644	3 000
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.95	100.00	100.00	0.15	9	5 637	12.86	0.88	666	654	3 000
Ю-Тэйр													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УПМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.58	102.00					12.12	0.46		590	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.97	101.99	100.97	0.22	1	6	10.76	0.46		454	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.30	100.00					10.37	0.55	453	412	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.30	100.00					10.37	0.55	453	412	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15	94.00		100.30	0.05	1	150	8.49	0.64	253	222	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.50						10.37	1.10	400	402	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	87.10						7.65	1.15	125	130	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.40	97.99					12.05	1.39	551	570	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.02	100.00					10.30	1.39	376	395	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.73	3.18	156	235	2 000

ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ

РУСГИДРО

Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	94.50	99.40					8.46	3.05	133	210	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	94.58	99.40					8.46	3.05	133	210	5 000

МОСЭНЕРГО

Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	84.00						6.81	0.38		63	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.43	100.50	100.50		1	9 000	7.27	0.17		125	5 000

ЛЕНЭНЕРГО

Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.60					8.58	2.26	167	223	3 000
-------------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ЭНЕЛ ОГК-5

ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.48	100.58	100.58	0.03	3	10 500	7.75	0.68	174	147	4 000
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	95.80	100.00					8.23	1.62	157	189	5 000

КузбасЭнерго

КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	87.55	100.00					10.58	1.60	393	424	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.01	91.99	87.06	-0.72	3	317	13.85	2.96	674	749	5 000

МРСК ЮГА

МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	95.00	97.99	95.00	-0.16	1	3	11.40	1.77	468	506	6 000
------------	----------	----------	-------	-------	-------	-------	---	---	-------	------	-----	-----	-------

ТГК-1

ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	85.52						8.53	1.38	200	218	4 000
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.67	0.22		159	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.51					8.63	0.72	258	235	5 000

ТГК-9

ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.00	98.40	98.36	0.26	2	12	10.39	0.83	423	408	7 000
---------	----------	----------	-------	-------	-------	------	---	----	-------	------	-----	-----	-------

ТГК-2

ТГК-2 БО-1		17/09/13	87.10	87.40	87.40	0.68	9	1 155	26.16	0.93	1992	1 983	5 000
------------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	-------	-------	------	------	-------	-------

ТГК-5

ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17							10.10	0.95	384	376	5 000
---------	----------	----------	--	--	--	--	--	--	-------	------	-----	-----	-------

Иркутскэнерго

Ирку тЭнерго-1		28/11/13							9.91	1.76	319	357	5 000
----------------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Ирку тЭнерго БО-1

Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14							9.03	1.40	248	268	3 000
-------------------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ЯКУТСКЭНЕРГО

Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.15					8.35	0.89	214	203	3 000
--------------------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ГЭС

Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	251	268	2 000
-------------------------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ТГК-6

ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.05	98.55					10.70	0.88	450	438	5 000
---------	----------	----------	-------	-------	--	--	--	--	-------	------	-----	-----	-------

ХИМИЧЕСКИЕ

ЕВРОХИМ

Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.03	103.00					9.13	2.43	217	278	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.59	2.76	253	323	5 000

АКРОН

Акрон 2	22/09/11	19/09/13	97.08	102.00					4.49	0.94			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.31	102.00	101.50	0.01	7	5 752	8.59	1.06	225	224	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	100.30					10.61	1.60	396	427	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	100.30					9.49	1.55	287	315	4 000

КУАЗ

КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16							9.56	1.39	302	321	2 000
---------------	----------	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ

ЛСР

ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.38	100.95					9.81	0.70	379	353	2 000
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.30	100.60					8.63	0.32		248	5 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.17	100.44	100.40		2	18	9.75	0.91	353	342	2 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14	98.30	98.50	98.46	0.30	13	2 099	10.95	1.39	441	460	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	95.75	95.90	95.90	0.30	12	19 204	11.33	1.68	465	499	2 000

РеноваСтройГрупп

РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.88	99.99	99.88	0.08	2	1 219	11.81	0.21		575	3 000
--------------	----------	----------	-------	-------	-------	------	---	-------	-------	------	--	-----	-------

ЛенСпецСМУ

ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	101.20	101.37	101.37	0.36	1	40	8.11	0.17		209	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07	102.30					8.99	0.39		281	2 000

ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ

РОСНАНО

РОСНАНО 1		20/12/17	98.40	99.25	98.80	1.18	3	2 600	9.40	4.18	203	292	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	98.80					9.61	4.17	224	313	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	98.80	98.80	1.20	7	27 002	9.40	4.18	203	292	15 000

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	
СИСТЕМА													
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	97.00						8.33	1.74	162	199	20 000
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.50	100.88	100.71	0.04	4	283	7.65	0.15		165	19 000
АФК Система 1		07/03/13	101.00	101.05	100.70	-0.15	1	1	8.15	0.42		196	6 000
АФК Система 4		15/03/16	94.46	99.50	98.03	-0.19	8	340	8.88	1.97	208	254	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.01	99.70	99.65	-0.01	12	8 458	11.23	0.76	514	494	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.16	100.39					11.97	0.67	597	570	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13							12.29	0.93	605	596	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК БО-1	25/06/13	25/06/13	86.00						8.38	0.70	236	210	5 000
РОСБАНК БО-3	16/05/13	16/11/14		100.70					8.38	0.59	248	212	10 000
РОСБАНК БО-2		08/07/13	86.00	99.90					8.23	0.74	217	194	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.40		98.65	0.12	11	21 114	8.38	1.04	206	203	5 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	95.30						9.78	1.91	300	344	5 000
АЛЬФА БАНК													
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	97.51	100.40					8.66	1.28	218	231	5 000
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16		101.25	101.08	0.08	1	1	7.68	0.65	171	141	5 000
Альфа-Банк БО7	28/02/14	31/08/15	99.10	100.00	100.00		4	14 000	8.77	1.34	226	242	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк БО-1		29/11/12	100.77	100.82	100.82	0.09	8	11 685	7.16	0.15		116	5 000
МДМ Банк БО-4	16/12/12	16/12/14	86.01	100.20	100.15	-0.01	6	5 150	8.78	0.20		273	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15							8.83	0.72	279	255	6 000
МДМ Банк БО-2		21/03/14	86.00	100.35					9.09	1.40	254	274	5 000
НОМОС Банк													
Номос БО-1	24/02/12	24/02/14	99.90	100.50					9.37	1.32	287	302	5 000
Номос 9	15/06/12	14/06/13	99.90	100.50	99.68	-0.52	1	1	9.42	0.67	343	315	5 000
Номос БО-3	09/08/13	09/08/15	100.10	100.30	100.35	0.05	2	20	8.87	0.82	272	256	5 000
Номос 11	02/07/14	02/07/14	99.95	100.15					9.71	1.61	306	337	5 000
Номос БО-2	18/04/13	18/10/14							8.56	0.52	277	232	5 000
Номос 12	25/08/13	28/08/17	99.70	100.00	100.00	0.15	1	500	8.66	0.87	247	234	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк Зенит БО-2	22/09/12	22/09/13							7.64	0.95	139	130	5 000
Банк Зенит БО-3	15/11/12	15/11/14	100.06	100.12	100.08		1	1	8.04	0.11		208	3 000
Банк Зенит БО-6	26/11/12	26/05/14	99.89	99.93	99.89	0.03	5	6 138	8.09	0.14		210	5 000
Банк Зенит БО-4	07/02/13	07/02/15	100.23	100.26	100.23	-0.07	1	470	8.31	0.34		215	3 000
Банк Зенит БО-5	14/02/13	14/02/15	100.23	100.26	100.23	-0.03	4	9	8.36	0.36		219	3 000
Банк Зенит БО-1	07/04/12	07/04/13							8.72	0.48		249	5 000
Банк Зенит 5	05/06/12	04/06/13	100.40	100.54					8.27	0.64	231	200	5 000
Банк Зенит 6	02/07/13	01/07/14	100.30	100.50	100.30	-0.25	6	61 270	8.93	0.72	289	265	3 000
Банк Зенит 8	28/08/13	23/08/17	100.25	100.27	100.25		7	7 810	9.08	0.87	289	276	5 000
Банк Зенит БО-7	12/04/14	12/04/15							9.30	1.39	276	295	5 000
ПРОМСВЯЗЬБАНК													
Промсвязьбанк БО-2	20/02/13	18/02/15	100.00	100.15	100.00	-0.15	2	16	8.89	0.38		272	5 000
Промсвязьбанк БО-4	20/02/13	18/02/15	100.00	100.32	100.15	-0.05	1	1	8.47	0.38		230	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.48	99.59	99.59	0.03	7	5 443	9.03	0.68	303	276	5 000
Промсвязьбанк БО-3		04/02/14	95.00	99.50	99.42	0.25	2	302	9.26	1.27	278	291	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	100.70						12.20	4.01	486	575	5 000
Банк СПБ													
Банк СПБ БО-2	26/03/12	23/09/13	99.40	100.30					9.20	0.95	295	286	5 000
Банк СПБ БО-1	09/10/12	09/04/13							13.16	0.04			5 000
Банк СПБ БО-4	13/12/12	12/12/13	86.00	100.00					8.84	0.19		280	3 000
МКБ													
МКБ 8	09/10/13	08/04/15							9.98	0.95	373	364	3 000
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.05	100.40					8.63	0.28		251	2 000
МКБ БО-4	15/10/12	15/04/14							10.46	1.40	391	411	5 000
МКБ БО-1	22/02/13	22/02/14	99.70	99.90	99.86	0.01	2	2	9.03	0.38		285	3 000
МКБ БО-3	27/04/13	27/04/15	99.80	100.00	99.90		2	1 054	9.64	0.54	381	340	4 000
МКБ БО-5		23/06/14	98.05	98.10	98.10	0.10	16	42 624	10.69	1.59	405	435	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.50	100.90	100.90	-0.21	2	37	8.25	0.21		219	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	101.25	101.00	0.90	1	1	7.88	0.89	167	156	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.00	100.28					9.08	0.86	290	276	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.00	100.50					9.92	1.32	342	357	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.80	99.84	99.80	0.10	3	6 101	9.17	0.92	294	284	5 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.00	100.20	100.20	0.35	1	20	9.44	0.55	360	320	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.00	100.20					9.83	0.75	376	354	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	98.90	98.90	0.10	4	1 500	10.04	0.95	378	370	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.90	101.05					11.11	1.12	473	476	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					11.03	1.13	465	468	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-7		22/04/15	100.20	100.55					11.18	1.18	476	483	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.00	101.05					11.46	1.99	465	512	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.60	101.55					11.68	2.08	483	534	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.43	98.58	98.58	0.28	9	748	12.04	0.81	591	574	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15		100.60					12.58	0.82	644	627	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БО-3	21/08/12	18/02/14	100.20	100.35	100.35		14	297	14.15	1.28	767	780	2 000
ТКС БО-4	18/04/13	16/04/15	100.00	100.10	100.10		5	842	13.45	0.50	767	721	2 000
ТКС БО-6	16/07/13	14/07/15	100.31	100.45	100.31	0.01	7	4 343	13.84	0.75	777	755	2 000
ТКС 2		28/07/13	104.87	104.95	104.87	-0.05	13	64 625	13.81	0.77	772	752	1 000
ТКС БО-1		20/09/13	100.81	101.03					13.49	0.93	725	716	2 000
ТКС БО-2	29/11/11	26/11/13	102.52	102.68	102.68	0.08	21	7 013	14.31	1.03	799	796	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.92	100.00	100.00		30	5 231	14.69	0.81	856	839	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.01	100.18	100.13	-0.02	1	170	9.27	0.10		332	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.00					7.74	1.01	144	139	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	86.00	101.15					7.81	1.26	134	146	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	86.00						8.00	1.30	151	165	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.30	100.75					8.52	2.18	164	218	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	100.64					8.60	0.11		265	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.20	100.40					8.42	0.88	222	210	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.20	101.22	100.24	0.14	12	21 002	8.38	0.90	217	205	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	98.39	99.40	99.40	0.10	4	34 002	8.35	0.89	214	203	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.62	1.12	224	227	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00	98.00					9.01	3.45	178	261	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.90	101.13					7.90	1.10	153	155	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.55	99.62					8.01	1.09	165	166	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		237	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.30	100.32	100.30		3	78	7.78	0.10		184	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.25	100.36	100.25	0.11	1	1	8.62	0.47		240	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.20		100.40	0.20	15	8 000	9.19	1.01	289	284	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.25	100.50	100.40	0.20	1	1	11.19	1.40	464	484	2 000
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.57	0.48		134	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.45	100.64	100.25	-0.32	1	2 950	11.12	0.82	497	481	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00						10.35	0.96	409	401	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	86.00	100.12					7.84	0.18		180	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.00	100.24	100.25	0.25	3	3	8.25	0.52	246	201	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	95.00	99.50	99.49	-1.51	2	2	8.68	1.00	239	233	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.80	100.00	99.90		1	5 000	10.16	2.24	326	382	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.05					8.45	1.42	189	210	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		100.42					8.96	0.93	272	263	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15		100.50					8.87	0.93	263	254	2 000
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.80	99.00	98.80	0.05	5	3 504	9.02	0.73	296	273	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.80	100.25	100.00	0.10	1	1	8.93	0.90	272	260	4 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.10						9.31	1.05	298	296	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00						9.25	1.05	292	290	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.47	100.55	100.47	0.12	5	42 001	8.82	0.82	268	251	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.25	97.90					9.06	1.60	241	272	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	100.15	100.30					7.72	0.07			4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.15	100.24	100.20		2	15 000	10.60	1.34	409	425	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	96.91	97.10	97.06	-0.04	13	2 732	10.73	1.41	418	438	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.81	95.99					10.68	1.70	399	434	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.20	100.80	100.20	-1.00	1	50	9.56	0.17		354	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60	100.05					9.65	0.62	371	339	3 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.95	100.20	100.12		1	100	0.94	0.02			2 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	98.75	99.15	99.15	-0.05	1	20	9.89	0.74	382	360	2 000
КредитЕвропа Банк													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	86.00	100.55	99.86		1	1 344	9.83	1.31	333	348	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.00	100.10	100.10	-0.05	4	1 431	10.14	1.28	366	379	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	96.51	98.20	96.70	-0.28	4	5 036	10.71	1.44	414	436	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.70	100.19	100.00	-0.05	1	100	9.20	0.95	294	286	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.50	100.75					9.47	0.70	345	319	3 000
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.53	0.20		147	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.53	0.20		147	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.15	100.45					9.31	0.52	352	307	2 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70	100.21					7.33	0.21		126	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22		100.34					8.92	0.53	310	268	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	275	337	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/12	19/04/14	99.99	100.00	100.00	0.05	5	1 550	9.26	0.04			2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	98.53	100.00	100.00		4	268	11.25	0.41		506	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13							11.30	0.93	506	497	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30						8.33	0.33		218	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15							11.03	0.50		480	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.13	100.30	100.18		5	1 000	9.32	0.21		326	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.70	97.00	97.00		1	4 000	10.07	1.70	338	373	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.25	100.33					7.83	0.15		183	3 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.20	100.20		4	1 040	9.33	0.34		317	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00	100.08					10.18	0.78	408	388	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.16	100.35	100.35	0.05	5	2 001	10.54	0.83	439	423	3 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.80	100.00	100.00	0.50	1	500	9.85	0.21		378	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.30	100.35	100.35	0.20	3	1 601	12.38	0.83	622	607	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.82	100.00					11.03	1.15	463	468	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.85	100.02	99.98	-0.04	4	2 792	12.58	1.39	604	623	2 000
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	99.01	100.43					11.52	0.15		552	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.90						10.09	0.19		404	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.05	100.08	100.08		5	1 751	11.30	0.38		513	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.10	100.10		4	3 950	10.22	0.39		404	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15							11.24	0.49		501	2 000

РЕГИОНАЛЬНЫЕ

МОСКВА

Москва 61	03/06/13		105.20	105.60	105.60	0.10	1	581	6.42	0.64	47	16	30 000
Москва 53	01/09/13		100.00	100.25					6.99	0.89	78	67	15 000
Москва 63	10/12/13		109.21	109.90					6.74	1.10	38	39	15 000
Москва 62	08/06/14		108.02	108.80					6.85	1.53	24	51	35 000
Москва 39	21/07/14		97.46						7.18	1.69	49	84	10 000
Москва 64	24/06/15		97.80	99.05					7.55	2.47	57	120	20 000
Москва 44	16/11/15		105.60						7.49	2.59	48	114	40 000
Москва 56	22/09/16		96.30	98.15					7.90	3.52	66	149	20 000
Москва 49	14/06/17		96.90	97.10	97.00	-0.11	1	50 000	7.92	3.98	59	147	25 000
Москва 48	11/06/22		89.80	90.29					8.32	6.90	57	143	30 000

МОС ОБЛ

Московская Обл 8	11/06/13		100.85	101.10					7.58	0.66	160	131	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.70	99.80	99.80	0.13	10	4 882	8.30	1.42	174	195	16 000

НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ

Нижегородская Обл 5	02/12/12		100.90	100.95					6.92	0.16		91	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12		100.00	100.06	100.10	0.04	5	12 211	6.90	0.12		94	3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.80	100.20					8.48	1.86	172	214	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.90	103.20	103.20		6	108 800	8.57	2.25	167	223	8 000

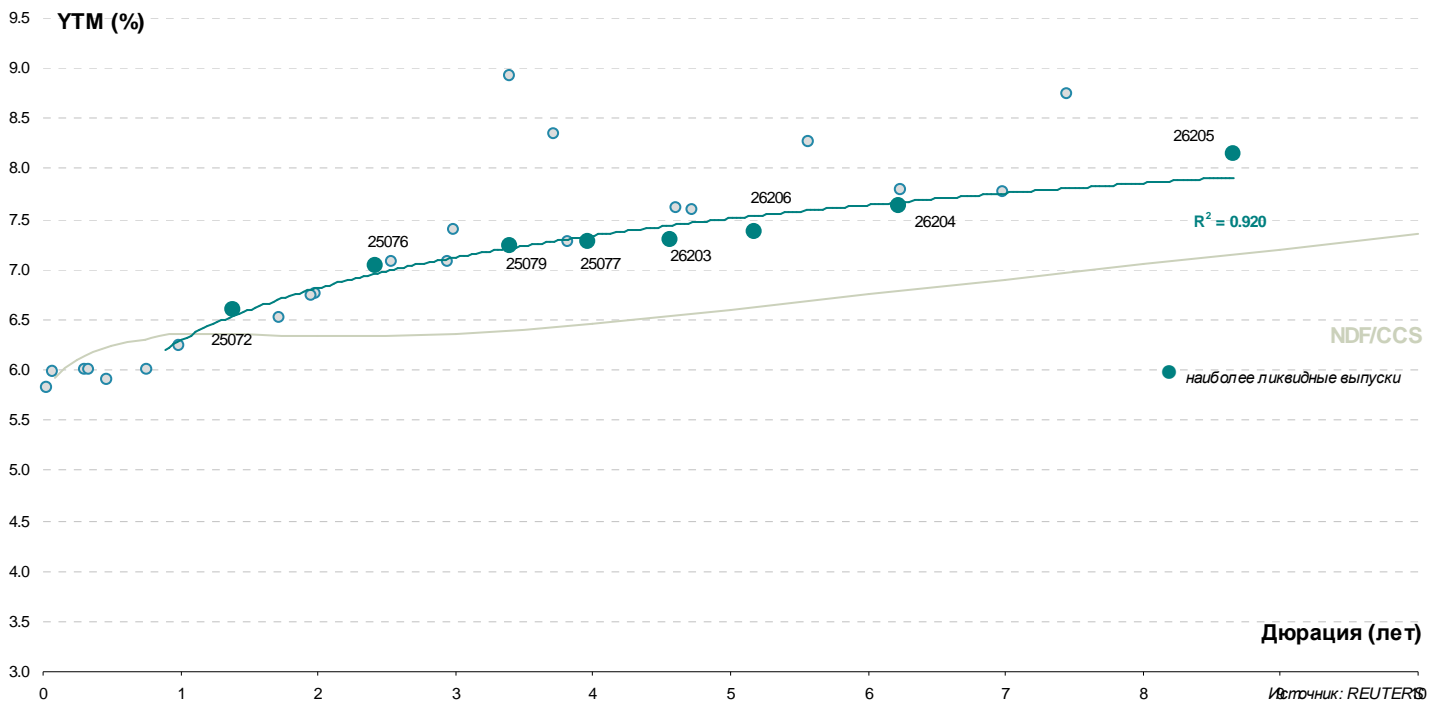
САМАРСКАЯ ОБЛ

Самарская Обл 5	19/12/13		101.90	102.20					8.09	1.15	169	174	8 000
Самарская Обл 6	10/05/13		103.50	104.50					7.38	0.57	151	113	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	
Самарская Обл 7	30/11/16		93.00	98.80	98.80	1.05	1	1	8.31	2.13	145	197	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13								7.15	0.26		103	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.40	101.75					7.91	0.69	190	163	2 000
Якутия 7	17/04/14		98.51	100.40					8.12	1.17	171	177	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12		86.00	99.85	99.85	0.10	1	14		0.19			2 000
Краснодар 02	05/11/15			100.80	100.80	0.16	4	25 282	8.49	1.19	206	214	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		100.00	100.60	100.60	0.45	1	1	7.75	1.41	120	140	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4	08/11/12		100.15	100.29	100.15	-0.19	14	260 101	8.97	0.09		303	10 000
Красноярский край 5	29/11/16		101.75	102.40	102.40	0.59	7	69 002	7.69	1.54	107	135	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		98.30						7.44	0.61	152	118	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		98.50	100.00	98.50	1.05	2	2 250	8.41	1.42	185	206	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		86.02	96.00					8.63	2.34	170	228	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								9.00	2.39	205	265	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.50	103.60					9.01	2.52	202	266	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12		95.00	101.81	100.40		4	87	7.23	0.21		117	3 000
Костромская область 6	17/11/16		101.00	101.50	101.00		1	300	9.27	1.90	249	293	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		103.07	103.30	103.30		2	8	9.56	2.35	262	321	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.70	103.50	102.02	0.12	3	11 400	8.87	1.75	216	253	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		100.30	100.50	100.33	-0.32	3	47 758	7.64	0.60	173	138	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.70	99.75	99.70	-0.05	2	1 897	8.06	1.19	163	171	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.82	100.90	100.85	0.05	10	100 001	8.78	2.24	188	244	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		99.00	100.00	100.00	0.40	1	50	8.41	1.15	201	206	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12		100.37	101.35					6.82	0.21		76	2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13		103.10	104.10					7.47	1.13	108	112	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16		101.95	102.20					8.44	1.86	168	210	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 5	26/12/13		107.00	107.30	107.00	-0.70	2	417	9.27	1.14	288	292	4 000
Тверская Обл 6	12/06/14		103.00	103.57	103.00	-0.70	1	1	9.18	0.84	302	287	3 000
Тверская Обл 7	15/12/15		98.35	98.50					9.42	2.54	243	307	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



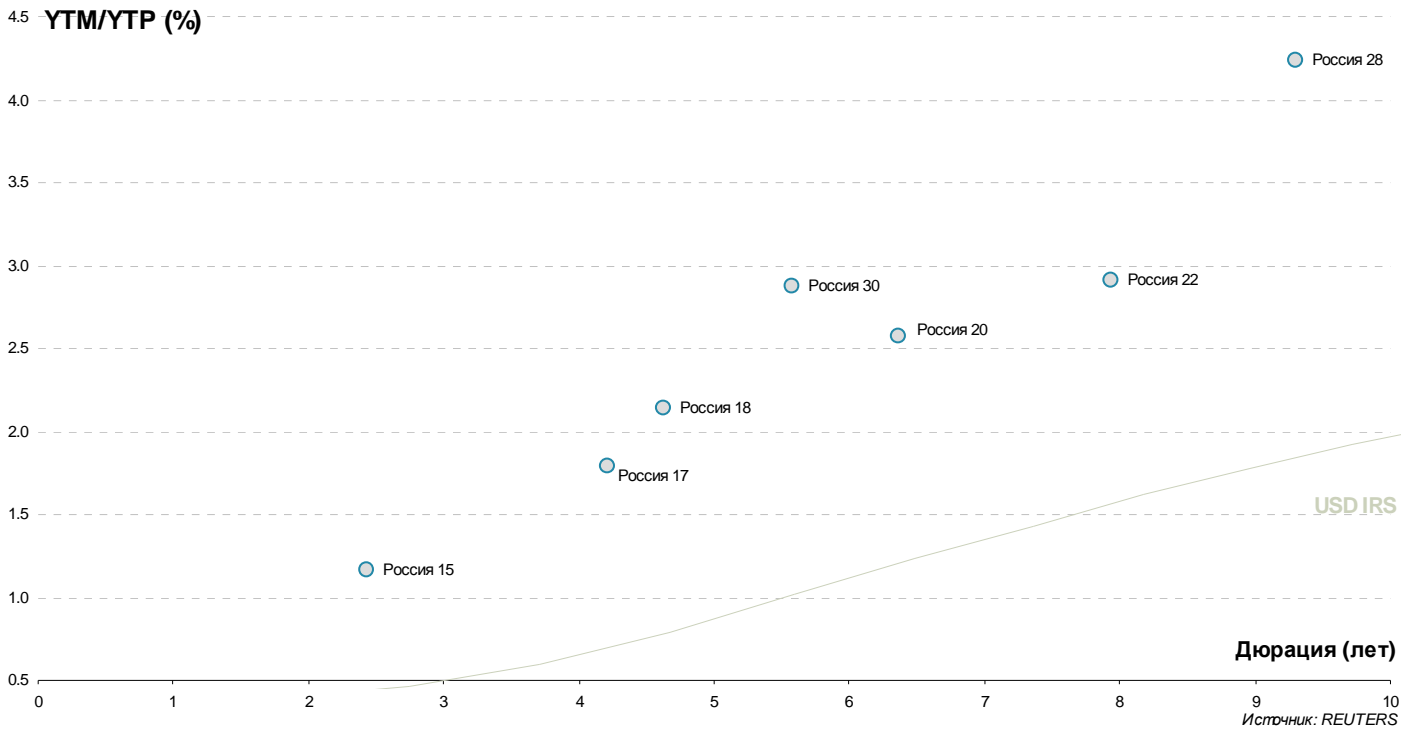
Результаты торгов евробондами

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		106.000	106.380	1.23	1.08	2.43	0.08	80
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.083	106.417	1.83	1.76	4.22	0.10	118
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.447	148.553	2.22	2.06	4.63	0.06	136
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.811	127.070	2.89	2.86	5.59	-0.03	151
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.380	116.750	2.60	2.55	6.36		132
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.975	113.263	2.92	2.89	7.94	0.26	134
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		196.342	197.605	4.27	4.20	9.30	0.20	225
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		121.461	121.789	4.33	4.31	16.05	-0.49	183
ГОСКOMPАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.481	101.606	1.70	1.47	0.53	-0.01	138
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13		102.250	102.545	1.32	0.77	0.52	0.37	100
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13		103.300	103.400	1.15	0.90	0.39	0.05	83
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.800	103.300	1.73	0.76	0.49	-0.16	142
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.900	105.200	1.36	1.01	0.79	0.15	104
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		111.400	112.150	2.51	2.02	1.37	-0.09	218
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		111.350	112.100	2.30	1.80	1.33		197
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		110.007	111.007	2.42	1.89	1.70	0.01	206
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.446	106.931	2.93	2.77	2.90	-0.08	247
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.184	111.645	3.28	3.17	3.65	-0.09	270
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.169	123.157	3.66	3.49	4.50	-0.15	284
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.711	131.210	3.88	3.81	5.09	-0.09	287
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.820	118.828	4.20	4.08	7.35	-0.12	267
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		141.411	142.446	5.36	5.30	11.56	-0.34	309
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		126.864	127.362	5.33	5.30	13.11	-0.53	295
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.844	106.844	1.76	-0.56	0.81	-0.02	143
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		106.060	107.060	1.30	0.61	1.36		95
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		129.984	130.359	3.04	2.98	4.80	-0.05	214
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.384	111.864	3.00	2.90	4.04	-0.10	236
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		101.663	102.663	5.00	4.77	4.39	-0.03	428
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		100.250	100.500	2.04	-2.31		0.15	
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.966	107.466	3.42	3.21	2.25	0.07	304
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.317	106.317	5.17	4.96	4.62	0.04	439
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		108.656	109.156	5.09	4.99	4.70	0.37	426
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.773	106.269	5.65	5.57	6.22	0.60	438
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.809	107.208	5.71	5.68	12.57	0.30	338
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.970	103.220	2.25	1.83	0.57	0.09	194
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.584	107.584	3.82	3.41	2.27	-0.17	344
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.146	100.146	7.09	6.63	2.26	-0.04	679
ВЭБ										
VEB LEAS'16 5.125%	USD	27/05/16		103.694	104.694	4.02	3.73	3.31		352
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.334	109.836	3.44	3.34	4.48	0.14	268
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		119.367	119.874	3.97	3.90	6.20	0.53	271
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.977	119.484	4.83	4.78	9.08	0.63	289
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		104.000	104.350	2.27	1.79	0.70		195
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.001	106.341	3.37	3.21	2.04		300
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.746	108.140	3.71	3.57	2.74	-0.16	329
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		103.125	103.500	1.91	1.30	0.58	0.06	159
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.975	106.100	2.29	2.19	1.21	-0.02	195
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		111.000	111.300	2.25	2.08	1.55		189
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		111.031	111.527	3.67	3.56	4.01	0.35	301
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		119.230	119.729	3.91	3.82	4.66	0.24	307
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		102.999	103.624	5.09	4.90	3.27		461
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		103.375	103.875	0.80	-0.01	0.58	0.55	48
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.500	103.875	1.61	1.10	0.71	0.09	128
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.908	108.302	2.50	2.35	2.56	0.06	208
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.434	108.937	3.35	3.23	4.03	0.43	271
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.999	109.999	4.46	4.32	6.94	-0.06	303

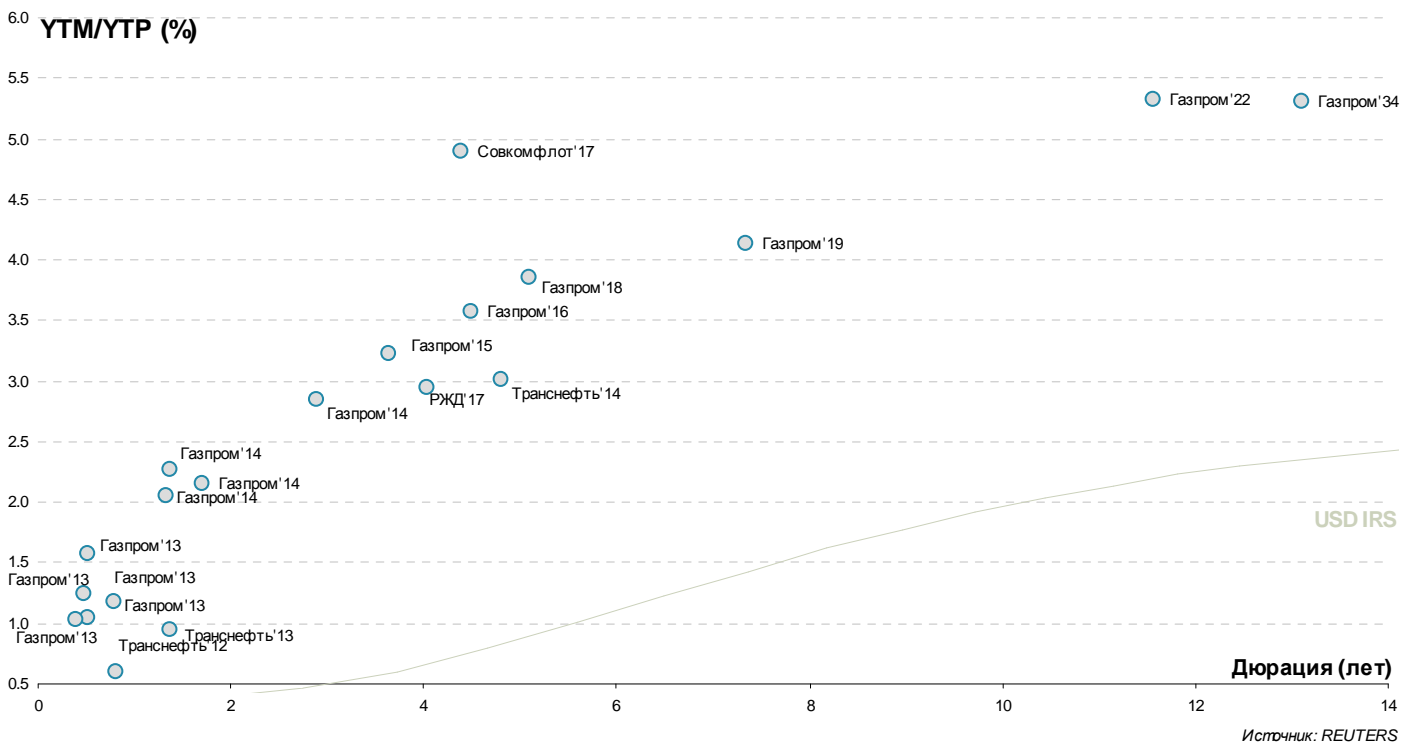
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ**Евраз**

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		103.550	103.850	2.21	1.67	0.52	0.05	190
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.719	110.215	4.82	4.65	2.72	0.12	441
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		113.250	114.000	6.60	6.45	4.34		586
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		101.388	102.138	6.45	6.29	4.59	0.25	568
Альянс Ойл										
ALLIANCE OIL'15 9.875%	USD	11/03/15		107.250	107.750	6.58	6.36	2.20		628
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		111.018	111.487	3.40	3.18	1.91	0.02	304
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.248	114.750	5.54	5.46	6.11	0.44	427
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		103.250	103.550	2.45	1.92	0.54		213
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		105.700	105.700	4.61	4.61	3.01	0.14	417
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.786	111.293	4.96	4.81	3.14	0.09	449
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		116.066	116.574	5.71	5.61	4.42	0.07	493
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		108.130	109.130	6.47	6.32	6.29		522
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.725	108.923	2.05	1.95	1.93	0.02	167
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		114.156	114.558	3.07	2.98	4.07	0.05	239
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		121.315	121.828	3.79	3.71	5.66	0.11	264
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.818	114.323	4.10	4.03	6.47	0.24	277
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.823	121.588	4.03	3.95	7.39	0.34	246
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		122.464	122.967	5.06	4.99	5.87	0.11	386
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		107.600	107.900	2.90	2.81	3.07	0.20	242
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.600	118.100	4.09	4.02	6.63	-0.15	272
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.750	107.100	1.27	0.85	0.78	0.22	94
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.950	110.250	2.56	2.37	1.41		221
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		108.073	108.576	4.87	4.77	4.27	0.13	416
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.829	103.829	7.10	6.87	4.40	-0.05	641
ТНК										
TNK-BP'13 7.5%	USD	13/03/13		102.691	105.691	1.13	-5.54		-0.01	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.326	109.252	2.52	2.13	2.17	0.06	213
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.720	116.219	3.05	2.93	3.34	0.08	253
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.262	115.272	3.16	2.93	3.95	0.13	252
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.766	122.799	3.44	3.26	4.60	0.15	263
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.681	122.745	3.82	3.67	5.90	0.10	264
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.500	104.900	2.76	2.20	0.68		245
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		107.837	108.824	4.57	4.16	2.26	-0.05	421
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		108.167	108.917	5.95	5.78	4.22	0.11	528
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		101.100	101.225	3.21	2.56	0.19	-0.15	296
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		102.059	102.559	4.43	3.94	0.99		414
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		106.238	107.238	6.45	6.10	2.64	0.43	609
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.878	105.128	4.18	3.86	0.74	-0.12	389
PSB FINANC'14 6.2%	USD	25/04/14		100.874	101.374	5.60	5.26	1.45	-0.01	532
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		112.004	113.004	7.62	7.22	2.25	0.01	734
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	09/07/16		107.124	109.124	8.96	8.35	3.10	0.02	862
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.303	103.803	4.60	4.25	1.39	0.05	429

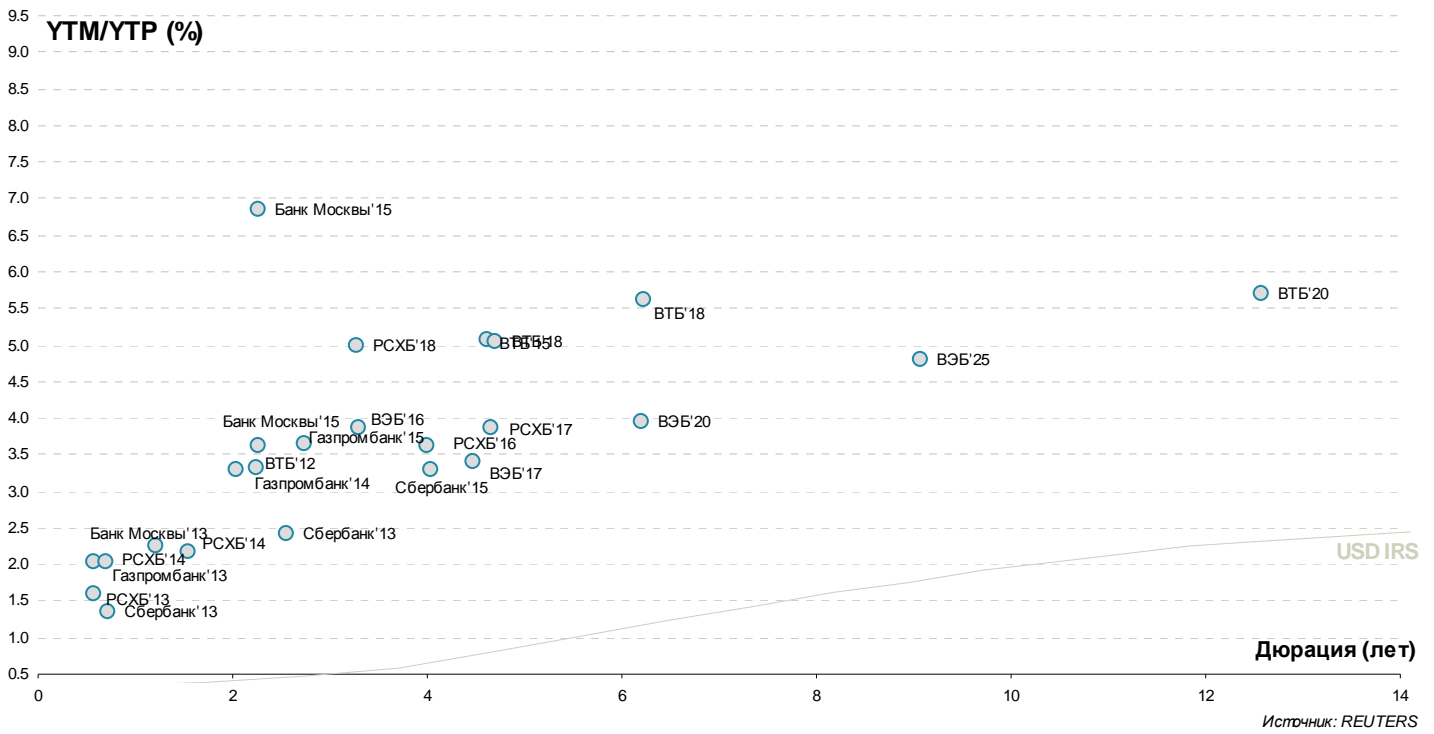
Россия



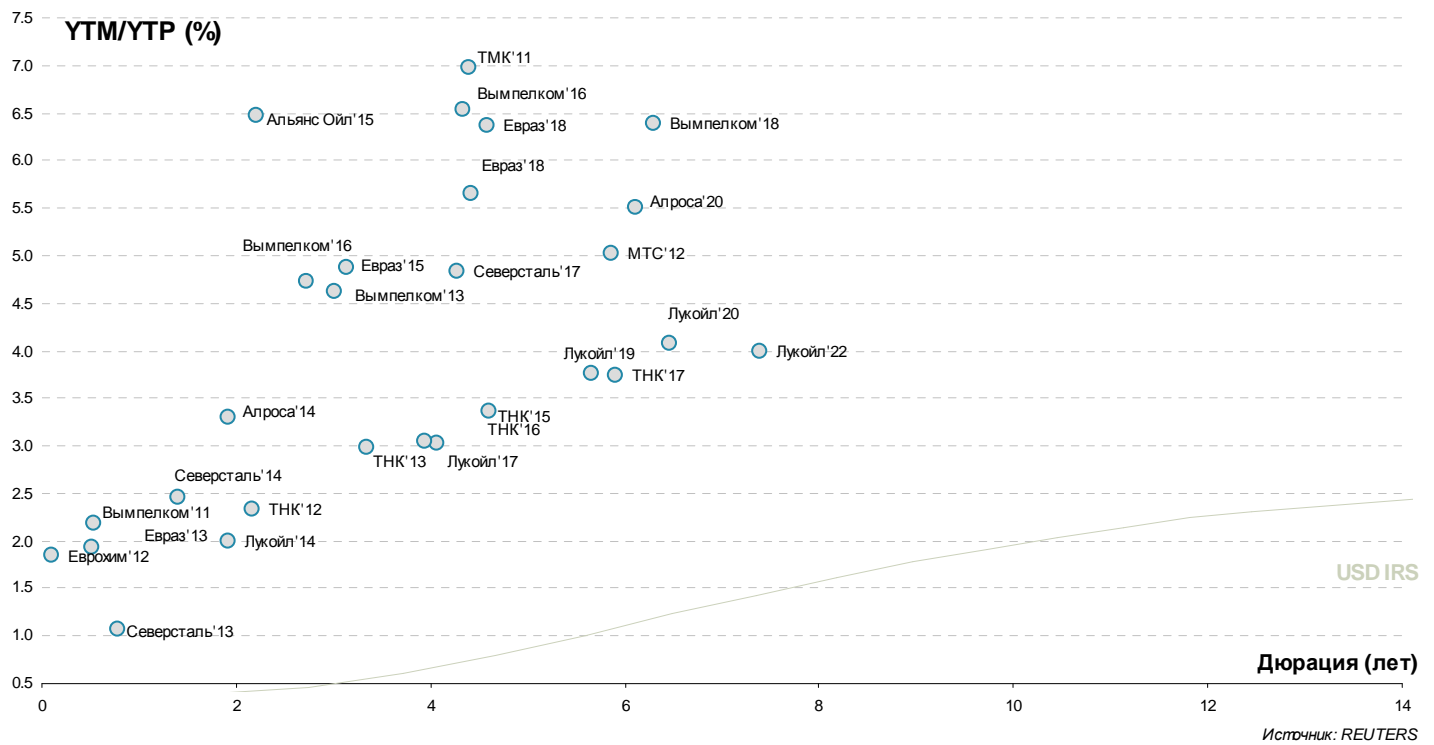
Госкомпании



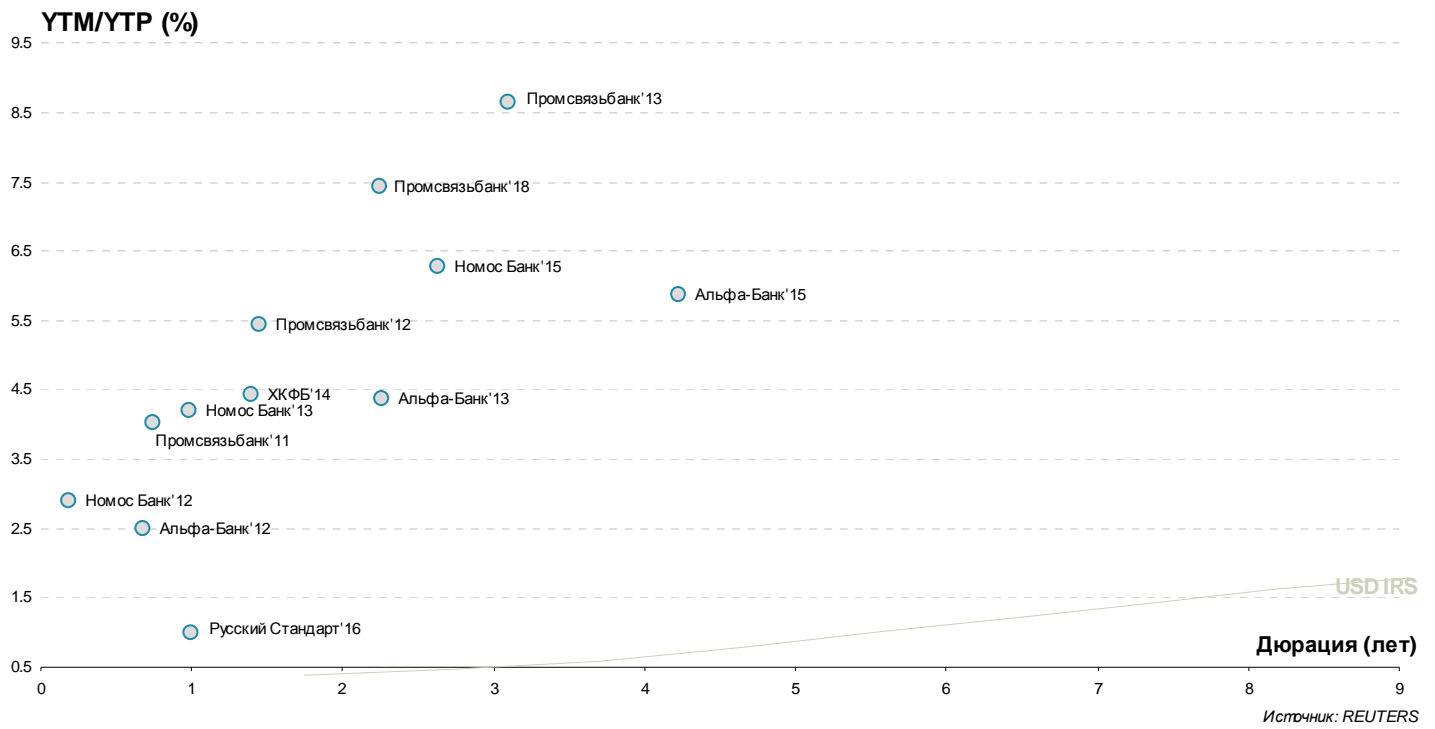
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

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.