

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Коррекционные настроения нарастают

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Ставки МБК снижаются на фоне щедрости ЦБ РФ
- Рубль стабилен, внешние факторы противоречивы

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды продолжили движение вниз
- На локальном рынке началась фиксация прибыли

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

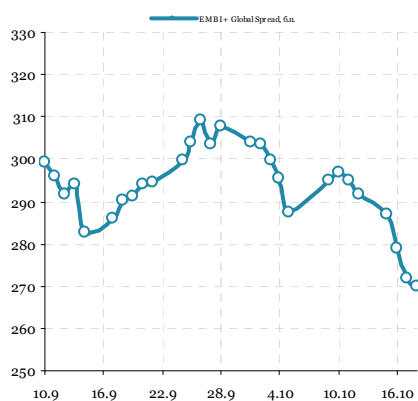
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.84 ▲	0.02	1.39	1.99
UST 10-2Y sprd	154 ▲	1	117	172
EMBI+ Glob.	270 ▼	-2	270	441
EMBI+ Rus sprd	141 ▼	-8	143	332
Russia 30 yield	2.74 ▼	-0.01	2.72	4.45
Денежный рынок				
Libor-3m	0.32 ▼	0.00	0.32	0.47
Euribor-3m	0.21 ▼	0.00	0.21	0.75
MosPrime-1m	6.61 ▼	-0.02	5.95	6.89
Корсчета в ЦБ	895.1 ▼	-39.4	446	1032
Депоз. в ЦБ	97.2 ▲	11.8	61	238
NDF RU 3m	6.3 ▼	0.0	6	7
Валютный рынок				
USD/RUB	30.746 ▼	-0.011	29.31	33.67
EUR/RUB	40.309 ▼	-0.048	38.72	41.81
EUR/USD	1.307 ▼	-0.005	1.21	1.33
Корзина ЦБ	35.041 ▲	0.000	33.54	37.28
ДХУ Индекс	79.367 ▲	0.351	78.71	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1512.0 ▼	-0.1%	1228	1620
Dow Jones	13548.9 ▼	-0.06%	12101	13610
DAX	7421.1 ▼	-0.22%	5969	7452
Nikkei 225	8983 ▲	0.22%	8296	9667
Shanghai Comp.	2131.7 ▼	-0.16%	2004	2452
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	111.6 ▲	0.27%	88	117
Нефть Brent	112.4 ▲	0.39%	89	120
Золото	1741.3 ▼	-0.29%	1540	1790
CRB Index	308.8 ▲	0.31%	267	321

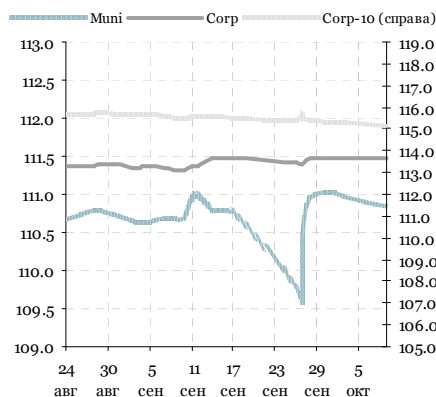
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETBI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETBI

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Price Return				
OFZ	117.5 ▲	0.52	107.5	117.5
Muni	110.8 ▼	-0.11	109.6	112.8
Corp	111.5 ▼	-0.02	110.7	112.1
Corp-10	115.1 ▼	-0.26	115.1	117.8
Total Return				
OFZ	270.6 ▲	2.87	233.3	270.6
Muni	345.7 ▲	0.26	324.8	345.7
Corp	344.8 ▲	0.66	323.6	345.2
Corp-10	345.2 ▲	0.51	324.6	345.2
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	411 ▼	-326	0	22 514
Muni	1 015 ▼	-332	10	6 146
Corp	7 234 ▲	998	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

ОАО «Группа ЛСР» планирует 26 октября разместить пятилетние облигации серии 04 объемом 5 млрд руб. Ориентир ставки 1-го купона находится в диапазоне 11,50 – 11,75%, что соответствует доходности к двухлетней оферте 11,83 – 12,10% годовых. /Финам/

ОАО «ХКФ Банк» закрыло книгу заявок по выпуску субординированных еврооблигаций объемом 500 млн долл. сроком 7,5 лет с возможностью полного досрочного погашения через 5,5 лет. Ставка купона составила 9,375% годовых. Спрос на еврооблигации в 5,7 раз превысил предложение. /Финам/

ОАО «РСХБ» начал сбор заявок на выпуск десятилетних облигации серии 18 объемом 5 млрд руб. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 18.10.2012 – четверг

Статистика России: Unemployment Rate, Retail sales

Статистика США: Initial jobless claims, Continuing claims

Статистика Китая: Industrial production, Real GDP

- **Выплата купона:** Мой Банк, 05 (12%, 299.2 млн руб.), СИБМЕТИНВЕСТ, 01 (13.5%, 673.2 млн руб.), ТрансКредитБанк, 06 (8.25%, 164.5 млн руб.), Восточный Экспресс Банк, БО-05 (10%, 99.7 млн руб.), ИФК РФА-Инвест, 02 (8.2%, 20.4 млн руб.), ТКС Банк, БО-04 (13.25%, 99.1 млн руб.), КИТ Финанс Капитал, 01 (11%, 16.5 млн руб.), Республика Коми, 34009 (7.5%, 78.9 млн руб.), КБ Центр-инвест, БО-02 (9.7%, 72.5 млн руб.), НОМОС-БАНК, БО-02 (8%, 200.5 млн руб.), Татфондбанк, БО-02 (8.75%, 87 млн руб.), Ростелеком, 14 (11.4%, 28.4 млн руб.), Связь-Банк, 05 (9.5%, 236.8 млн руб.), ИнтрастБанк, 01 (12.5%, 31.3 млн руб.), ВТБ, 05 (7.4%, 276.7 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 35002 (7.8%, 34 млн руб.), МТС, 01 (7%, 349 млн руб.), КБ МИА (ОАО), 05 (7.9%, 39.4 млн руб.)
- **Оферта:** Банк Национальная Факторинговая Компания (ЗАО), БО-01 (2 млрд руб.), КБ МИА (ОАО), 04 (2 млрд долл.)
- **Погашение:** Ростелеком, 14 (1 млрд руб.)
- **Размещение:** АК БАРС БАНК, БО-01 (500 млн руб.), Газпромбанк, 10 (10 млрд руб.), Газпромбанк, 11 (10 млрд руб.), Газпромбанк, 12 (10 млрд руб.), Внешэкономбанк, 19 (10 млрд руб.)

Сегодня: 19.10.2012 – пятница

- **Выплата купона:** Крайинвестбанк, БО-01 (9.25%, 69.6 млн руб.), ОПК "ОБОРОНПРОМ", 01 (8%, 841.3 млн руб.), СЗКК, 03 (6.73%, 167.8 млн руб.), СЗКК, 04 (6.73%, 167.8 млн руб.), Каркаде, 02 (13%, 48.6 млн руб.), Северсталь, 2014 (LPN) (9.25%, 17.3 млн долл.), КБ Нефтяной альянс, 01 (11%, 13.8 млн руб.), ДельтаКредит, 2035-A (RMBS, FRN) (1.269%, 39.7 тыс руб.)
- **Оферта:** Мечел, 05 (5 млрд руб.), Московский Кредитный банк, БО-04 (5 млрд руб.)

22.10.2012 – понедельник

- **Выплата купона:** Москва, 2016, EUR (LPN) (5.064%, 20.6 млн руб.), НОМОС-БАНК, 2015 (LPN) (8.75%, 15.3 млн руб.), НОМОС-БАНК, 2013 (LPN) (6.5%, 13 млн руб.), ТКС Банк, 2014 (LPN) (11.5%, 17.8 млн руб.), РусГидро, 01 (8%, 398.9 млн руб.), РусГидро, 02 (8%, 398.8 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2012-1, А1 (11%, 13.8 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2012-1, А2 (5.5%, 7.7 млн руб.)
- **Погашение:** АЛРОСА, 2012-2 (zero, ECP) (260 млн долл.)
- **Размещение:** Газпромбанк, 07 (10 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Коррекционные настроения нарастают

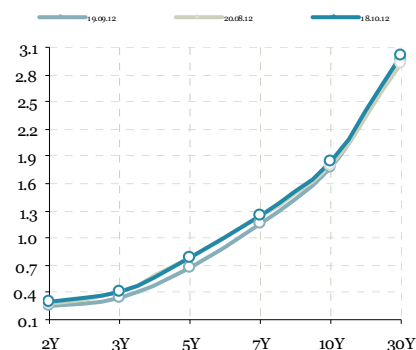
Внешние рынки вчера сбавили обороты оптимизма, несмотря на относительно неплохую статистику по ВВП Китая за минувший квартал (+7.4%) и более сильный, нежели ожидания, отчет банка Morgan Stanley. Инвесторы были склонны замечать скорее новости с негативным оттенком, пытаясь найти повод для коррекции 3-дневного роста котировок рискованных активов.

Таким поводом стали еженедельные данные по рынку труда в США. Число первичных обращений за пособием по безработице выросло за неделю на 46 тыс. при ожиданиях их роста лишь на 26 тыс. Несмотря на более сильные данные по индексу промышленной активности от ФРБ Филадельфии и опережающим экономическим индикаторам, спрос на риск к вечеру четверга заметно сократился.

Стартовавший вчера 2-дневный саммит ЕС пока не принес ничего нового с точки зрения антикризисной борьбы в Европе. Ключевыми темами, на которые должны обратить внимание чиновники должны стать развитие идеи создания единого банковского регулятора в регионе (и определение возможных сроков его создания), а также ситуации в Греции. Испании должно быть отведено меньше времени, поскольку основные чиновники страны ранее отвергали идею о скором обращении за помощью.

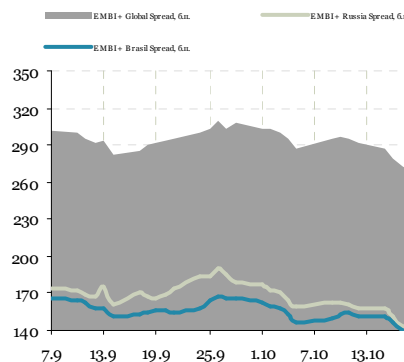
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



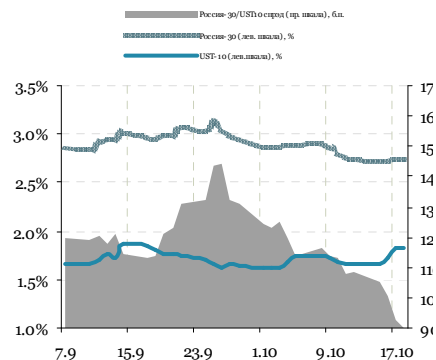
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



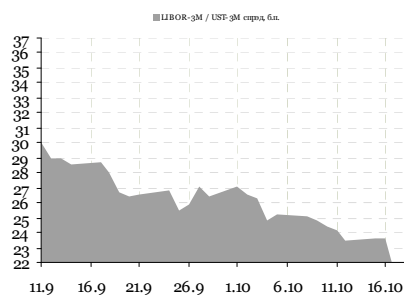
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Ставки МБК снижаются на фоне щедрости ЦБ РФ

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка вчера немного улучшилась на фоне отсутствия ограничений на аукционах прямого репо ЦБ РФ. Ставки по кредитам овернайт на рынке МБК держались на уровне 6.00% годовых (-25 бп), междилерское репо на 1 день обходилось в среднем под 6.10% годовых (-20 бп). На аукционах прямого репо с ЦБ РФ регулятор полностью удовлетворил заявки на 1-дневные операции на сумму 128 млрд руб. против 144 млрд руб. накануне. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ сократилась на 27.6 млрд руб., составив 992.3 млрд руб.

Следующий налоговый платеж должен завершиться в начале следующей недели, когда пройдет уплата НДС. На уплату этого налога потребуется не менее 180 млрд руб. из банковской системы и избежать дальнейшего роста ставок помогут лишь отсутствия ограничений на аукционах прямого репо с регулятором.

Рубль стабилен, внешние факторы противоречивы

Валютные торги четверга завершились нейтрально для рубля, по отношению к бивалютной корзине остался на уровне предыдущего дня (35.07 руб.). Внешний фон был довольно противоречивым, однако в целом предопределил спокойное поведение рынка. Котирувки нефти, отыгрывая утром неплохие данные из Китая, к вечеру опустились на 1.5 долл. до 112 долл. за барр. Brent. Усиление дефицита рублевой ликвидности на внутреннем рынке на фоне активной фазы налогового периода должно оказать рублю поддержку, однако определяющими для российской валюты пока остаются внешние условия.

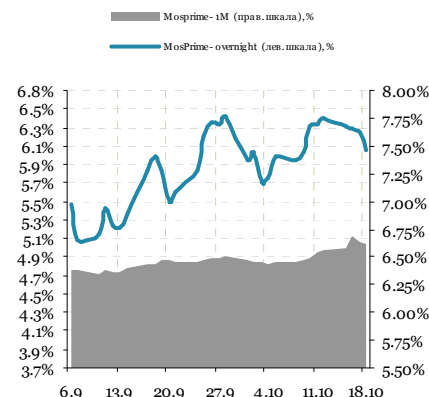
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	Уплата налогов	Страховые взносы в фонды (~230 млрд руб.)
Вторник	Аукцион Казначейства	37 млрд руб. на 3 месяца.
Среда	Аукционы ОФЗ	ОФЗ 26207 (15 лет) – 20 млрд руб. ОФЗ 26080 (5 лет) – 20 млрд руб.
	Погашение ОФЗ	ОФЗ 25067 (45 млрд руб.)
	Выплата купонов ОФЗ	3 млрд руб.
	Возврат Казначейству	5.7 млрд руб.
Четверг		128
Пятница	Возврат Казначейству	17.5 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

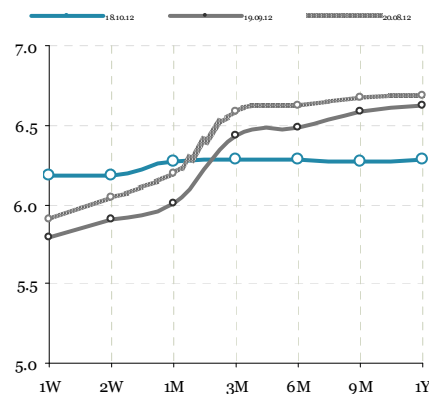
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды продолжили движение вниз

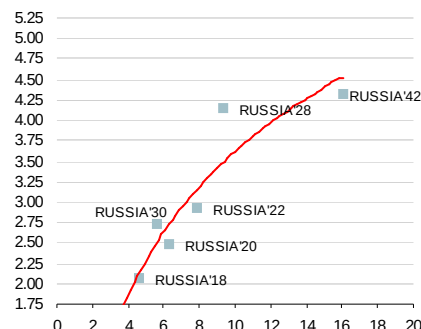
Цены в российском сегменте в четверг продолжили плавное движение вниз на фоне фиксации прибыли в рискованных активах и боковика в UST. Российские суверенные выпуски по итогам дня потеряли в ценах в среднем не более 10 бп, «тридцатка» и дальний Россия'42 опустились под отметки 127.75% и 121.75% соответственно. Корпоративный сектор также двигался преимущественно вниз по ценам, потеряв по итогам дня в среднем не более 25 бп. Чуть хуже рынка смотрелись выпуски металлургических компаний: цены в дальних выпусках Северстали и Евраза в среднем потеряли более 25 бп.

На локальном рынке началась фиксация прибыли

На локальном рынке инвесторы задумались о фиксации прибыли после полуторанедельного ралли, в ходе которого доходности на дальнем участке кривой ОФЗ опустились на 25-30 бп. Вчера же цены ликвидных бумаг на дальнем участке кривой потеряли в среднем в районе 15-20 бп, лучше рынка выглядел дальний выпуск 26207, подорожавший по итогам дня на 35 бп и все еще сохраняющий премию к кривой на уровне 20 бп. Корпоративный сектор провел день достаточно оживленно: на дальнем участке кривой покупали выпуск ФСК 25 (+20 бп), ближе по дюрации спрос был замечен в выпусках Вымпелком 01 и Вымпелком 04, а также бумагах Металлоинвеста, подорожавших в пределах 10 бп. Выше по уровню кредитного риска активность присутствовала в выпусках Группы ЛСР, биды в которых опустились в среднем на 20 бп.

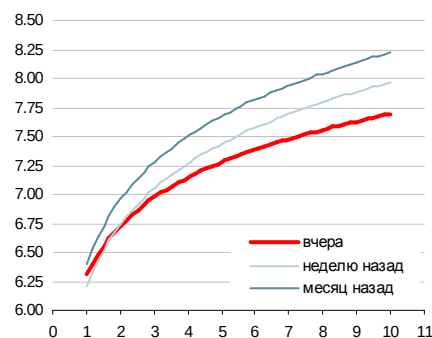
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



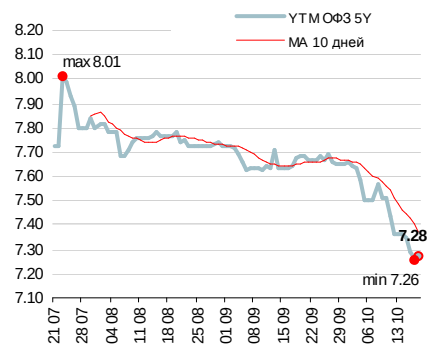
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



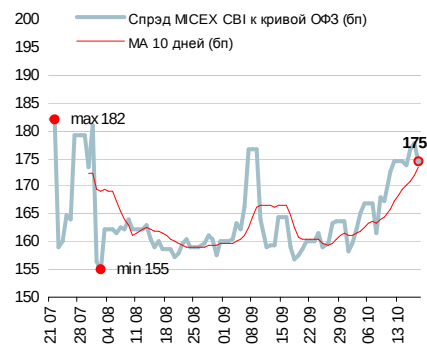
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ

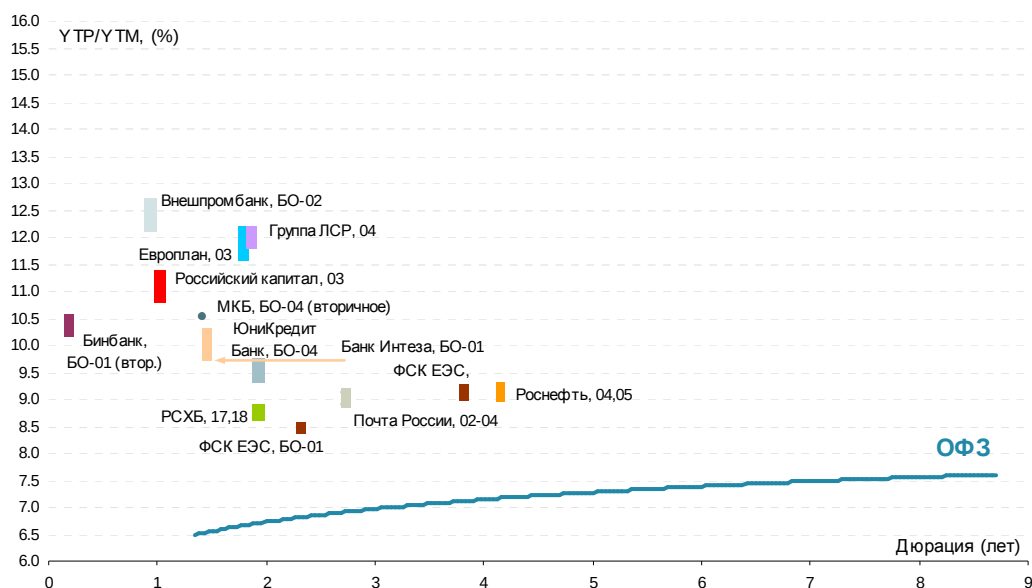


Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Заккрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
МКБ, БО-04 (вторичное)	B+ / B1 / BB-	да	5 000	10.51	18.10.2012	19.10.2012	нет / 1.42 г.	нет / 1.5 г.
Газпромбанк, 07	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	8.68	16.10.2012	22.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 4 г.
РСХБ, 17	- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.63-8.84	18.10.2012	23.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Крайинвестбанк, БО-01 (вторичное)	B+ / - / B+	да	1 500	10.77	22.10.2012	23.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 1.5 г.
ФСК ЕЭС, БО-01	BBB / Baa2 / -	да	10 000	8.37-8.48	19.10.2012	24.10.2012	нет / 2.3 г.	2.5 г. / 3 г.
ФСК ЕЭС, 21	BBB / Baa2 / -	да	10 000	8.99-9.20	19.10.2012	24.10.2012	нет / 3.8 г.	4.5 г. / 15 лет
Банк Интеза, БО-01	- / Ba1 / -	да	3 000	9.73-10.25	23.10.2012	25.10.2012	нет / 1.42 г.	1.5 г. / 3 г.
РСХБ, 18	- / Baa1 / BBB	да	5 000	8.52	19.10.2012	25.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Почта России, 02	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 03	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 04	- / - / BBB	да	3 000	8.89-9.10	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
ЮниКредит Банк, БО-04	BBB / - / BBB+	да	5 000	9.41-9.73	24.10.2012	26.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 3 г.
Внешпромбанк, БО-02	B / B2 / -	да	3 000	12.10-12.63	24.10.2012	26.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Группа ЛСР, 04	- / B2 / B	да	5 000	11.83-12.10	Конкурс	26.10.2012	нет / 1.84 г.	2 г. / 5 лет
Роснефть, 04	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.99-9.31	23.10.2012	29.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
Роснефть, 05	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	8.99-9.31	23.10.2012	29.10.2012	нет / 4.13 г.	5 лет / 10 лет
Бинбанк, БО-01 (вторичное)	B / B2 / B-	да	2 500	10.23-10.54	16.10.2012	XX.10.2012	нет / 0.17 г.	2 мес. / 2.17 г.
Российский Капитал, 03	- / - / B+	да	3 000	10.78-11.30	19.10.2012	XX.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Европлан, 03	- / - / BB-	да	3 000	11.57-12.10	30.10.2012	01.11.2012	нет / 1.84 г.	2 г. / 5 лет

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds



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							6.79	0.00			45 000
ОФЗ 26198		02/11/12	99.99	100.00	99.99	-0.02	19	244 015	6.21	0.04			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.31	100.31	100.31	-0.00	33	383 047	6.00	0.27			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.22	100.24	100.24	0.01	8	107 959	5.95	0.30			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.63	102.70					5.99	0.43			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.00	100.40	100.15	0.05	1	1 000	6.02	0.73			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.51	100.55					6.26	0.97			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.80	100.83	100.83	-0.00	5	9 420	6.57	1.35	8	29	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.30	109.34	109.35	0.05	12	425 001	6.62	1.68		35	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.30	109.35	109.30	0.05	5	124 750	6.72	1.95	1	47	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.89	103.10	102.89	0.04	2	2	6.71	1.92	1	46	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.37	100.57	100.45	-0.10	20	304 216	6.92	2.38	9	67	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	99.98	100.19					6.91	2.50	5	66	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.30	101.40	101.30	-0.10	11	182 226	7.01	2.91	6	76	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.00	98.45	98.00	-0.30	1	1	7.20	2.95	24	95	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	100.00	100.10	100.07	0.20	2	1 051	6.99	3.36		73	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	93.00	100.00	93.00	0.90	1	4 554	8.66	3.37	162	240	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19		85.00					8.02	3.57	95	175	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.75	101.85	101.75	-0.15	5	50 608	7.06	3.79		78	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.70	101.80	101.70	-0.30	20	249 323	7.08	3.94		79	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.59	102.70	102.60	-0.15	4	4 983	7.03	4.53		69	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.75	92.25	92.60	0.60	9	225 015	7.20	4.58		85	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	98.50	100.00	98.47	-0.73	2	10	7.47	4.69	23	111	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.05	102.24	102.10	-0.05	4	200 000	7.21	5.15		80	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		78.00					7.23	5.54		76	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.50	95.80	95.50	-0.20	8	560 005	7.63	6.23	22	107	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.30	102.50	102.35	-0.05	8	100 731	7.36	6.22		80	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	102.30	102.50	100.41	-1.99	12	119 296	7.68	6.99	20	101	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	74.00	87.20					8.02	7.42	51	129	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	103.45	103.70	103.75	0.35	34	1 031 437	7.86	8.70	25	95	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	86.50	88.95					8.20	10.92	45	97	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29	67.00	93.33	67.00	-10.78	1	1	9.40	10.59	167	222	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	97.95	100.00					7.67	0.76	152	136	15 000
---------------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО5		30/10/12	100.10	100.13	100.13	0.03	4	927	6.66	0.03			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	96.00		100.27		1	1	7.61	0.13		134	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.00	100.25					7.33	0.38		101	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.55	100.70					7.93	0.65	188	161	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.55	100.70					7.77	0.65	172	145	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.20	100.29	100.50	0.35	3	3	8.11	1.78	146	185	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.00	101.55	101.00	-0.50	1	5 000	8.58	1.86	190	232	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.20	100.41					8.54	2.21	175	229	5 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12		100.15					7.88	0.08			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.90	100.10					7.79	0.46		147	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.00	100.15					8.14	0.81	196	183	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.20	99.32					8.37	1.31	190	209	5 000
ММК ВО6		10/07/14	97.50	97.90					8.91	1.62	231	264	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.56	98.05	97.80	0.07	2	6 000	8.80	1.65	219	253	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.67	100.75	100.71	0.16	3	7 440	7.60	0.33		129	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13		100.80					7.51	0.33		120	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.30	100.56	100.40	0.10	1	2 000	7.86	0.67	179	154	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.49	100.50	100.49	0.02	1	995	7.73	0.68	166	141	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.40	101.54	101.30		2	2 695	8.67	2.39	184	242	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.25	101.55					8.56	2.40	172	231	3 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.05	100.60					8.41	0.42		209	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.46	100.50	100.45	-0.10	3	14 100	8.29	0.42		197	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	108.20	108.40	108.40	0.20	8	19 774	9.01	1.82	234	275	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	108.05	108.60	108.00	-0.25	3	3	9.23	1.82	256	297	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.20	101.92	101.40	0.30	3	5 501	9.63	2.57	275	338	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.20	101.70	101.40	0.30	2	501	9.63	2.57	275	338	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	93.00	102.99					10.14	3.10	315	389	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	95.50	101.99					10.15	3.09	316	390	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.90	100.20					9.22	2.20	244	297	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.70	99.95	99.95	0.05	11	76 204	9.22	2.20	244	297	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.65	100.00	99.95	0.10	9	105 000	9.22	2.21	243	297	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 BO1	11/11/11	09/11/12	99.95	99.97	99.97	0.03	7	18 491	8.63	0.06			5 000
Мечел BO2		12/03/13	98.86	99.19	99.00	-0.28	19	24 130	12.73	0.40		641	5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.60	100.00	100.00	0.02	3	211	11.73	0.49		541	5 000
Мечел BO3		24/04/13							14.38	0.49		806	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.25	96.65	96.50	-0.10	7	954	13.59	0.63	756	727	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	100.20					11.58	0.73	546	526	5 000
Мечел BO4	11/02/14	10/02/15	95.50	97.00	96.00	-0.99	3	3	14.10	1.24	766	781	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	90.61	92.77					15.42	1.28	896	913	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	90.84	92.96	92.50	0.23	5	5 000	15.13	1.28	867	884	5 000
Мечел BO5		07/04/15							11.82	2.22	503	557	5 000
Мечел BO7		07/04/15	87.00						11.82	2.22	503	557	2 000
Мечел BO11		07/04/15							11.82	2.22	503	557	3 000
Мечел BO12		07/04/15							11.82	2.22	503	557	3 000
Мечел BO6		07/04/15							11.56	2.22	477	531	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	91.05	92.39					14.35	2.52	749	810	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.52	91.97					14.13	2.52	727	788	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	83.10	83.50	83.70	-0.10	1	25	14.82	3.04	784	857	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.39	87.47					13.42	3.06	644	717	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	83.03	85.98	85.97	-0.01	1	125	13.83	3.07	685	758	5 000
ТМК													
ТМК BO1		22/10/13							9.04	0.95	276	274	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.57	100.65	100.63		6	100	8.56	0.69	247	224	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.00	99.00					12.34	1.09	598	604	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.81	92.50	92.00		1	2	15.21	1.50	866	893	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ BO1	05/06/12	04/12/12	100.30	100.40	100.40	-0.05	1	1 500	9.30	0.13		303	5 000
КОКС													
КОКС BO2		28/05/14	93.01	98.40	98.36	-0.10	4	22	10.06	1.48	351	378	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.81	93.25	93.21	0.14	14	4 983	14.37	1.31	790	809	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.71	88.35	88.35	0.35	4	18 786	14.72	2.28	792	847	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12	100.04	100.08	100.08	0.03	7	1 546	6.06	0.05			5 000
РЖД BO		05/12/12	100.17	100.35	100.35	0.08	1	20	6.68	0.13		41	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.60	99.65	99.60	-0.05	3	100 078	7.42	1.02	110	112	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.60	109.80	109.70	0.05	10	103 020	7.60	1.28	114	131	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.70	102.80	102.70		1	90	7.83	2.08	108	158	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.45	99.75	99.65		2	10 000	8.08	2.72	117	183	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.80	100.10	99.80	-0.07	2	7	8.12	3.15	112	186	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	108	195	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.80	100.25					7.37	0.92	111	107	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.80	100.25					7.41	0.92	115	111	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.10	101.19	101.10		2	4 003	7.91	1.52	135	164	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.60	102.00	101.65	-0.10	1	5 000	8.00	1.82	133	174	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.30	100.00					8.12	2.67	122	187	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.30	99.00	99.00	0.50	4	17	8.03	2.66	113	178	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	99.65	100.00					8.39	3.01	142	214	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.20	100.40	100.45	0.20	8	205 004	8.64	3.42	159	237	15 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70	97.40	0.35	1	1	8.83	4.06	168	253	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	97.15	97.70					8.91	4.06	176	261	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.10	97.00	96.70		1	300	8.88	4.61	165	253	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	97.50	101.00	97.69	0.44	3	6	9.08	6.12	168	253	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.20	100.40	100.35	0.05	2	1 311	9.04	2.23	225	279	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16							9.84	3.80	273	356	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.05	101.99	99.90	0.97	6	113 412	9.30	1.00	299	300	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.73	247	313	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	98.85					9.36	3.02	239	311	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.11	3.02	214	286	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.65	222	303	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.31	3.65	222	303	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.35	3.65	226	307	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	100.16	100.23	100.16	-0.24	2	5 600	8.29	1.38	179	201	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	100.00	100.04					7.52	0.06			15 000
Газпром А9		12/02/14	99.50	101.50					7.47	1.27	102	118	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.55	110.00	109.80	-0.20	6	13 667	7.56	1.51	100	129	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12			100.34		1	1	6.94	0.15		66	5 000
Лукойл БО-7		13/12/12			100.34		1	1	6.94	0.15		66	5 000
Лукойл 4		05/12/13	98.95	101.50	100.10	-0.01	1	100	7.43	1.08	107	113	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.40	100.90					7.49	0.24		118	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.93	99.97	99.96	0.01	2	20 000	7.36	0.47		104	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.93	100.00					7.38	0.47		106	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.75	100.85	100.75	-0.10	3	1 602	8.03	2.11	127	178	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.40	101.00	100.65	0.15	1	10 000	8.43	2.90	148	218	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	95.00	101.00	100.70		1	1 203	8.42	2.91	147	217	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.10	102.90	102.10	0.10	2	2	8.57	4.28	139	225	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	96.01	99.29					8.61	4.51	140	227	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	98.99	100.02	100.10	0.10	4	9 700	7.46	0.67	140	114	10 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40	99.53	99.45	-0.04	5	5 036	8.02	0.91	177	171	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.50	100.90					7.21	0.17		93	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	99.53	103.73	100.80	0.30	1	13 923	7.58	0.17		130	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.02	100.95					7.58	0.17		130	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	100.70	101.75	100.70	-0.95	11	151 802	8.86	1.07	251	256	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22		101.65					8.36	2.12	160	211	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.00	100.00					10.26	0.76	412	395	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	97.00	99.30	99.26	0.43	6	204	10.09	1.23	366	380	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	92.72	95.49					10.63	3.08	365	438	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	92.72	97.99					10.81	3.09	382	456	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	98.81	99.00	99.00		3	57	14.00	0.74	787	768	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50	97.10	0.10	1	9 500	9.56	3.15	256	330	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.50	100.75	100.50		1	445	8.07	0.71	197	175	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.18	100.26	100.18	-0.05	5	15 049	7.64	0.18		136	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15		100.19	100.13	-0.02	4	17 301	7.67	0.27		136	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.95	100.08	100.04	0.04	1	3 000	7.70	0.40		138	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	97.50	100.04	100.10		1	30	7.54	0.40		122	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.02	100.06	100.04	-0.03	4	13 100	7.70	0.40		138	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.07	100.31	100.10	-0.05	11	50 001	8.06	0.85	185	175	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.45	99.83	99.55	-0.30	2	10 068	8.11	0.97	182	181	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15		101.00	100.05	-0.05	1	1	8.20	1.34	171	192	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.08	100.15	100.05	-0.10	1	1	8.20	1.34	171	192	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.96						8.69	2.64	180	244	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15							8.69	2.64	180	244	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	192	183	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.21	100.15					8.93	1.96	222	268	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.20					8.09	0.82	190	178	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.05	99.74					8.04	0.22		174	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	98.77	99.67					7.93	0.36		162	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					8.25	0.51	234	193	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.40					8.41	0.72	230	209	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.05	99.05	-0.15	1	1	8.44	0.75	230	213	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45						7.67	1.10	130	137	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.93	1.22	250	264	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20							7.68	0.96	139	138	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.10	100.30	100.30	-0.05	4	30 002	8.42	2.20	164	217	15 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.00	98.45	98.20	-0.10	13	308	8.69	3.05	171	244	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.42	163	241	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20							8.87	4.05	172	257	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.00	99.98	99.05	-0.15	2	7 600	8.36	1.42	184	208	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.85	101.25	101.00		1	634	8.42	1.83	175	216	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.80	101.50	100.85		1	980	8.51	1.83	184	225	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.25	100.70	100.60	-0.10	2	16 505	8.87	2.02	214	262	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.00	99.30					9.02	3.07	204	277	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	99.35	100.50	99.85	0.65	1	2 763	8.84	3.07	186	259	5 000
МСП 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	
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.27	100.35	100.35	0.01	5	40 000	8.61	1.38	211	233	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.50	100.60	100.55	-0.10	11	97 128	9.05	1.72	242	279	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.10	100.32					6.88	0.10		63	5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.26	100.34	100.25	-0.01	1	2 500	7.42	0.10		117	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20		100.60					5.67	0.30			5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.00	100.60	100.50	0.50	1	15 000	7.39	0.31		108	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.70					7.45	0.63	142	113	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	99.30	100.55					7.53	0.78	137	122	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.30	100.50					7.87	0.79	171	156	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.40	100.60	100.40		3	18 500	7.94	0.84	173	163	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.35	100.65	100.55	0.11	1	1	7.75	0.84	154	144	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						8.04	0.94	177	174	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.30	100.50	100.52	0.07	2	5 001	7.81	0.97	152	151	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21		101.00	100.85	-0.12	1	5 451	8.04	0.99	174	174	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.70	101.70	0.70	5	227 230	8.01	1.26	156	172	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	85.04	100.00					8.47	1.72	184	221	5 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.08	100.55					8.61	2.29	180	236	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	98.20	98.05	-0.15	1	1	8.69	2.45	184	244	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.65	98.55					8.87	2.46	202	262	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.65	98.55					8.87	2.46	202	262	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							8.93	0.08			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							5.26	0.10			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.10	100.23					7.43	0.18		114	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.10	99.39					7.72	0.74	159	140	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.95	100.00					7.91	1.08	155	161	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	86.01	100.90	100.75	0.20	7	44 134	8.02	1.24	158	173	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.75	100.95	100.80	0.05	26	143 331	8.51	1.61	191	224	10 000
АИЖК													
АИЖК А5		15/10/12							6.37	0.01			2 000
АИЖК А6		15/07/14	99.50	99.70	99.70		8	40 000	7.88	1.19	147	159	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.77	177	216	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.95					8.10	1.87	141	184	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.25	99.75	99.39	0.09	1	10 130	8.25	1.92	155	200	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.25	99.75	99.50		2	40 000	8.15	2.33	133	190	6 000
АИЖК А8		15/06/18	97.95	99.79	98.50		2	4 001	8.43	2.79	150	218	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30					8.56	3.01	159	231	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.25	99.40					8.45	3.08	147	220	7 000
АИЖК А21		15/02/20		101.15	101.15	-0.35	1	1	8.71	3.19	170	245	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	100.00					8.71	3.84	159	243	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.11	97.99	97.20	-0.10	2	250	9.12	4.96	185	273	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					8.94	5.57	160	247	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	129	201	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	86.00						8.99	1.08	264	269	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.20					8.99	1.08	264	269	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.45	1.66	284	318	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00	100.00		1	50 000	9.45	1.66	284	318	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.95	100.20					8.09	0.33		178	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.80	100.10	99.80	-0.30	2	145	8.30	0.80	213	199	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.80	99.85	99.85	0.03	4	20 000	8.09	1.03	176	179	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.77	99.85	99.80	-0.15	1	2 500	8.57	1.44	204	229	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.20	100.70	100.52	0.02	2	11 360	7.30	0.65	125	98	10 000
МТС 1		17/10/13	99.80	100.19					7.24	0.98	94	94	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.30	99.65	99.30		4	4 611	8.04	1.50	149	176	15 000
МТС 2		20/10/15							8.58	2.63	169	233	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.30	99.25					8.65	2.68	175	240	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.51	100.00					8.97	3.30	194	271	15 000
МТС 7		07/11/17	99.00	99.75	99.00	-0.40	7	45 932	9.15	4.05	200	286	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.80	101.10	101.10	-0.05	3	25 843	7.83	0.73	171	151	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.20	99.24	98.37	-0.13	1	10 100	8.60	1.62	200	233	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.70	100.00	99.70	0.20	2	73 501	9.19	2.22	240	294	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.75	100.00	99.90		9	341 265	9.09	2.21	230	284	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.85	99.98	99.85	-0.13	7	308 580	9.11	2.21	232	286	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.75	98.50					9.25	2.70	234	300	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.04	98.50					9.14	2.70	223	289	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 13	21/10/11	17/10/12							350.17	0.17		34 389	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	
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	99.70					7.42	0.64	138	110	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.75					7.95	0.55	200	163	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00	101.50					8.74	1.25	230	245	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.70					8.40	1.25	196	211	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.10	100.20	100.10	-0.07	9	30 397	9.14	2.28	234	289	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.90	97.00	97.00		2	25 000	9.60	3.14	260	334	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.01	107.00					9.95	3.13	295	369	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.90	97.50	97.00	0.05	2	11 999	9.60	3.14	260	334	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.75	99.80	99.80	-0.10	2	706	8.14	0.36		183	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.50						8.34	0.87	211	203	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50		100.05	0.04	1	4 600	8.34	0.87	211	203	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.50	100.25					8.24	0.87	201	193	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	100.02	100.12	100.12	-0.01	3	17 500	8.26	0.87	203	195	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	98.70						9.31	1.31	284	303	5 000
Магнит БО-6		22/04/14							8.42	1.40	191	214	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.30	100.50	100.38	-0.02	1	1 000	8.94	2.63	205	269	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.50	99.25					9.25	1.52	269	298	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.00						9.00	1.59	241	273	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.27	100.40	100.35	0.20	6	8 276	9.58	2.64	269	333	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13							8.94	0.74	281	262	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.60	100.15	100.15	0.07	9	16 075	9.13	0.92	287	283	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.12	99.37					11.92	0.56	595	560	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.15						9.26	1.00	295	296	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.00	100.83					9.72	0.94	345	342	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.97	441	488	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.90	100.03					12.90	0.65	685	658	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.00	93.50	94.00	0.50	1	10 000	11.53	2.31	472	528	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	96.00	96.49					11.25	1.65	464	498	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14		100.50					9.97	1.76	332	371	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.60	96.99					10.87	1.22	444	458	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.00	100.10	100.00	-0.20	1	1	9.07	0.16		279	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.70	98.85	98.85		1	495	9.77	1.24	333	348	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.05	102.00	100.05	-1.45	3	2 320	10.75	2.61	387	450	2 000
УВЗ													
Уралвагонзавод 1	13/12/12	07/12/17	99.29	100.25					11.05	0.15		477	3 000
Уралвагонзавод 2	27/08/13	20/02/18	99.25	99.70					9.51	0.84	331	320	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.11	99.70					11.57	0.94	530	527	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13							9.76	1.77	311	350	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	86.00	100.00					8.31	0.18		203	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14							9.20	0.49		288	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14							9.65	0.49		333	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.15	0.90	190	184	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.30	100.50					8.63	0.51	272	231	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.20	102.61					9.47	0.72	336	315	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.31	100.70	100.70	-0.05	5	2 014	10.66	2.08	391	441	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.05	100.20	100.15	0.08	1	1 000	7.55	0.47		123	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	100.05	100.20	100.20	0.10	4	1 018	7.44	0.47		112	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	101.10					7.81	0.36		150	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.53	101.00					8.50	1.71	187	224	3 000
Глобалтранс													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Офтеры	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	98.50	99.99					9.76	1.46	322	348	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.60	100.90	100.60	-0.10	1	600	9.94	2.15	317	369	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.25	100.70	100.73	-0.13	2	2	9.87	2.15	310	362	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.95	100.00	100.00		3	222	12.85	0.85	664	654	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13							13.00	0.93	674	670	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.30	101.50					9.99	0.43		367	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.30	101.99					11.57	0.43		525	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.35	100.25	99.75		1	17 331	10.91	0.51	500	459	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.35	100.00					10.70	0.51	479	438	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15			100.10	-0.20	1	200 000	8.82	0.61	281	250	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.50		100.00		1	394	10.37	1.06	402	407	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13		101.99					7.01	1.12	64	72	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.02	98.49					11.78	1.35	529	550	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.02	99.80					10.32	1.36	383	404	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.74	3.15	174	248	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21							8.44	3.01	147	219	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21							8.46	3.01	149	221	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	94.00						7.43	0.35		112	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.30	100.40	100.35	-0.12	4	466 000	7.61	0.13		134	5 000
МОЗСК													
МОЗСК БО1		18/09/15	100.20	100.40	100.35	-0.05	1	500	8.85	2.62	196	260	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.20	100.60	100.20	-0.40	1	70 000	8.59	2.22	180	234	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.50	100.58	100.58	0.10	13	51 245	7.70	0.65	165	138	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	95.80	98.88	98.30	-0.05	1	40 000	8.36	1.58	177	209	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	97.25					10.63	1.56	405	436	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.01	91.34					13.90	2.93	695	765	5 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.00	96.99	96.15	0.35	2	5	10.70	1.74	406	444	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.65	0.19		136	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.20	99.00	98.85	-0.05	4	8 905	8.57	0.69	249	225	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70						16.48	1.34	1000	1 020	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	91.00	98.75					10.01	0.80	384	370	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	85.22	85.94	85.96	0.70	10	255	29.18	0.89	2294	2 287	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17		98.99					10.96	0.96	468	466	5 000
Иркутскэнерго													
Иркутэнерго-1		28/11/13	91.01	106.49	106.49	4.49	8	160	9.41	1.01	309	311	5 000
Иркутэнерго БО-1		08/04/14	86.01	100.30	100.30	2.10	2	25 010	7.52	1.42	100	124	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	99.90	100.25	100.00	-0.01	2	12 000	8.40	0.86	218	209	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	254	275	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.00	99.70					11.05	0.84	484	474	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	99.50	101.00					9.00	2.40	217	275	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	94.00	99.29					9.21	2.69	231	296	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	98.70	103.59					4.34	0.90			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.00	102.10					7.94	1.02	162	164	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.76	100.30					9.31	1.51	275	304	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	97.31	100.30					9.31	1.51	275	304	4 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.48	99.21					10.14	1.42	362	386	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.20	100.50					9.01	0.29		270	5 000
ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.24	0.66	418	392	2 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.15	100.39	100.36		2	2	9.78	0.87	355	347	2 000
ЛСР Групп 3	14/03/14	08/09/17	100.60	100.95	100.70	-0.10	5	156 270	11.23	1.32	475	495	3 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14	98.31	98.59	98.56		9	5 287	10.89	1.35	440	461	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	95.85	96.24	96.15		12	114 357	11.21	1.64	460	494	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	
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.91	99.95	99.95	0.01	6	3 320	11.47	0.17		519	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.90	101.18					6.86	0.14		59	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07						9.00	0.36		269	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.45					9.29	4.14	213	299	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.50	98.90	0.50	1	2 000	9.38	4.14	222	308	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	98.95	98.95	0.15	4	19 860	9.36	4.14	220	306	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.50	100.79					7.12	0.12		86	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.75	100.87					7.70	0.38		138	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	100.20	101.39					8.33	1.70	170	207	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.60	99.75	98.82		6	200	8.45	1.94	174	220	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.90	99.10	99.06		6	212	12.15	0.72	604	583	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.17	100.30	100.17	0.03	1	30	12.01	0.64	597	569	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.51	100.25	100.25	0.25	4	188	12.05	0.94	578	575	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	86.03	100.49	100.39	-0.06	1	1	8.39	0.55	244	207	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.20	100.45	100.45	-0.20	4	5 511	8.35	0.66	229	203	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	86.00	100.00					8.89	0.70	279	257	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	95.00		98.38	-0.14	4	176	8.72	1.00	241	242	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.49	100.79					9.21	1.77	256	295	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	95.30	105.00	96.79	-0.01	3	3	9.35	1.88	266	309	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	100.95	101.25	101.00	0.03	2	7 201	7.72	0.61	170	140	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.09	100.12					8.49	0.93	223	219	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.00	100.00	99.68	-0.27	3	60 000	8.68	1.24	224	239	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.00	100.10	100.10	-0.20	4	7 020	8.69	1.30	222	241	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.20	100.70					6.15	0.12			5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	97.23	100.23	100.21	0.03	2	92	8.20	0.16		192	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.04	100.15	100.15	-0.06	6	41 000	9.00	0.71	289	268	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.10	1.36	260	282	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.63	99.88					8.60	0.50		228	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	100.05	100.13					8.82	0.63	279	250	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.25	100.30	100.26	-0.03	2	80 000	8.97	0.79	281	266	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.60	100.00					8.72	0.83	252	241	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	100.00	100.20					9.16	1.29	270	287	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	100.00	100.37					9.54	1.57	296	327	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.04	100.07	100.05		1	1	8.09	0.08			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.90	99.93	99.93	0.03	8	9 280	7.96	0.11		170	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.17	100.23	100.23		1	1	8.22	0.31		191	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.15	100.23	100.23	0.04	1	40	8.27	0.33		196	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13	86.10	99.75					8.09	0.47		177	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.35	100.50					8.48	0.61	247	216	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.45	100.50	100.50		5	2 915	8.60	0.68	252	228	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.31	100.39	100.36	0.05	7	73 026	8.92	0.84	272	261	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.63	0.91	138	132	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.26	100.35	100.30		4	2 563	9.18	1.42	266	290	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк ВО2	20/02/13	18/02/15	100.05	100.53	100.08	0.04	1	20 200	8.63	0.34		232	5 000
Промсвязьбанк ВО4	20/02/13	18/02/15	100.05	100.50	100.08	-0.02	1	17 000	8.63	0.34		232	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.61	100.00					9.05	0.64	301	273	5 000
Промсвязьбанк ВО3		04/02/14	99.00	99.44	99.01	-0.44	1	5 453	9.63	1.24	319	334	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.31	100.70	100.60	0.11	2	50 001	10.02	1.75	338	376	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	99.00	101.70					12.41	3.97	527	612	5 000
Банк СПб													
Банк СПб ВО1	09/10/12	09/04/13	90.00						8.27	0.04			5 000
Банк СПб ВО4	13/12/12	12/12/13	86.00		100.00	-0.10	1	3 000	8.55	0.15		227	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13		100.50	100.40	0.35	4	1 329	8.72	0.91	247	241	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.30	100.69	100.11	-0.24	1	1	9.59	0.95	331	329	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.30	100.22	0.02	16	22 050	8.64	0.24		233	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.90	99.95	99.90	0.03	9	24 233	8.93	0.35		262	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.90	99.97	99.97	0.02	10	22 891	9.52	0.50	363	320	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.90	99.98					10.09	0.92	383	378	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15		100.10	100.00		1	180 000	9.98	0.95	370	368	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	
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.99	100.05	99.99	0.04	4	23 300	10.52	1.42	400	424	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.29	98.35	98.35	0.15	5	5 313	10.54	1.55	397	427	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.77	100.80					8.08	0.17		180	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	100.30					9.08	0.85	287	277	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.00	101.00					9.19	0.82	300	288	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.00	100.55					9.65	1.28	319	336	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.75	99.90	99.75	-0.07	2	5	9.23	0.88	300	292	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.05	100.12	100.08	0.07	5	91 003	9.85	1.30	339	356	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.20					9.48	0.51	358	316	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.05	100.20					9.65	0.71	355	333	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.87	99.10	98.87	-0.05	2	10 000	10.12	0.92	386	381	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	101.00	101.10	101.00	0.05	3	23 455	10.99	1.08	464	469	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					12.00	1.09	564	570	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.30	100.60					10.99	1.14	460	470	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.45	101.55					11.16	2.00	443	491	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.61	101.55					11.68	2.05	494	543	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.43	98.60	98.46	0.01	10	62 562	12.29	0.77	614	598	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.41	100.55					12.61	0.78	645	630	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.10	100.25	100.25	0.05	17	2 172	14.22	1.24	778	793	2 000
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.00	100.20	100.20	0.35	4	1 647	13.24	0.50		692	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	100.26	100.65					13.37	0.71	727	705	2 000
ТКС БАНК 2		28/07/13	104.62	104.75	104.70	-0.05	5	509	13.75	0.73	763	743	1 000
ТКС БАНК ВО1		20/09/13	100.27	103.00					12.19	0.89	595	588	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.60	102.78	102.65	-0.10	14	1 798	14.27	1.00	796	797	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.92	99.98	99.98	0.04	32	32 592	14.70	0.77	855	839	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.05	100.15	100.07	-0.11	5	4 960	9.52	0.07			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22							8.89	0.98	260	259	00000 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.80					9.36	1.74	272	310	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	99.90	100.00	100.00		1	310	7.64	0.98	134	134	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.90	101.05	100.90		1	1 495	7.99	1.22	156	170	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	86.00	99.50					8.00	1.26	155	171	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.52	2.14	175	227	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	99.95					9.37	0.07			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.00	100.21	100.22	0.02	2	2	8.38	0.85	217	207	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.00	100.30					8.47	0.86	225	216	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.20	100.00					8.38	0.86	216	207	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14			100.40	-0.20	3	3	8.79	1.08	243	249	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.01	3.39	197	274	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.95	101.04	101.04	0.04	1	5 000	7.90	1.07	155	160	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.80	99.65	-0.10	1	1 999	7.98	1.06	164	168	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		217	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.17	100.21	100.17	0.01	6	4 403	8.08	0.06			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.23	100.35					8.61	0.44		229	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.50	100.84	100.52	-0.03	2	20 001	9.06	0.98	276	276	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.55	0.48		123	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.37	100.55	100.50	-0.13	6	35 860	10.76	0.79	459	445	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00						10.36	0.97	407	406	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30	100.51	100.46	0.01	4	7 046	11.13	1.36	464	485	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	86.00	100.11					7.44	0.15		117	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.13	100.28					8.66	0.49		234	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							7.05	0.96	76	75	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15							10.10	2.21	331	385	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10	99.25	0.05	1	5 005	8.42	1.39	191	214	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90	99.20					8.84	0.69	275	252	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.95	100.30	100.00		1	18 000	8.92	0.86	270	261	4 000

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	
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.10	100.97					9.29	0.89	305	298	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.50					8.96	0.89	272	265	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.20	101.00					9.25	1.01	293	295	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00						9.24	1.01	292	294	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.45	101.20					8.68	0.78	252	237	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.45	97.75	97.45	-0.45	4	55 003	9.07	1.56	249	280	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	100.09	100.18	100.09	-0.09	9	26 303	8.08	0.04			4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.26	100.34	100.30	-0.05	3	9 500	10.51	1.30	404	423	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.11	97.59	97.55	0.04	6	180	10.38	1.37	388	410	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.91	96.19	96.19		1	4 250	10.60	1.66	399	433	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.20	100.50					9.20	0.13		293	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.75	100.05					9.69	0.59	370	337	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.00	99.17					10.55	0.70	445	423	2 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.90	100.10					-28.82	1.41			2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.04	100.09	100.09	0.03	3	4 685	9.93	0.95	365	363	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14		100.55					9.83	1.27	338	354	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.10	100.25	100.11	-0.04	1	1	10.13	1.24	369	384	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.35	97.90	97.96	0.40	2	98	9.80	1.41	329	352	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.81	100.00	100.00	0.49	3	21 500	9.20	0.96	292	290	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.03	100.07					8.14	0.17		186	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.20					7.32	0.17		104	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15		100.35					9.28	0.50		296	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.60	100.70	100.65	-0.05	2	8 000	9.58	0.66	352	326	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						5.55	0.17			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22							9.98	0.49		366	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.73	2.44	288	348	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14							10.80	0.93	453	450	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	90.00	100.10					11.23	0.37		492	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.51	99.97					13.06	0.95	678	676	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30						8.26	0.29		195	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	99.85	100.40					10.69	0.48		437	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.10	100.23					8.92	0.17		264	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.75	97.00					10.27	1.67	365	400	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14		100.10	100.00	-0.20	2	15 000	9.98	0.48		366	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13							10.00	0.49		368	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.01	100.10	100.10	0.10	4	3 440	11.16	0.91	491	485	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.15	100.40					8.67	0.11		241	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	100.40					12.06	0.85	585	575	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.24					9.25	0.31		294	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	99.98		100.06	0.01	1	1	10.22	0.74	409	390	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.35	100.75	100.35		7	8 502	10.52	0.79	435	421	3 000
УБРиР													
УБРР 2	29/10/12	01/05/14	100.00	100.10	100.00		3	2 800	9.50	0.03			2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.15	100.20	100.20	0.10	9	2 167	12.63	0.92	637	633	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.30	100.00					11.36	0.18		508	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.35	100.55	100.55	0.10	1	10	12.08	0.80	591	577	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.00	100.05	100.05	0.05	3	2 177	11.86	0.12		560	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	
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.01	100.00					10.08	0.16		380	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.98	100.00	100.00	0.03	5	38 650	11.51	0.34		520	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.65	100.08	99.65	-0.43	1	10	11.55	0.36		524	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.48	99.90					12.51	0.47		619	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.98	100.00	100.00	1.00	1	90	11.03	1.12	466	474	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.90	100.12	100.14	0.14	1	2	12.55	1.41	603	627	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61		03/06/13	104.74	105.99	105.50	0.76	1	13 500	6.09	0.60	9		30 000
Москва 53		01/09/13	100.10		100.07	-0.03	1	190	7.02	0.85	81	71	15 000
Москва 63		10/12/13	109.15	109.85					6.80	1.06	45	50	15 000
Москва 62		08/06/14	108.05	108.48	108.50		9	8 937	7.05	1.49	50	77	35 000
Москва 39		21/07/14	97.46	100.00					7.30	1.66	69	103	10 000
Москва 64		24/06/15	98.32	99.09	98.21	-0.83	6	50 000	7.90	2.44	106	165	20 000
Москва 44		16/11/15	105.01						7.43	2.55	56	118	40 000
Москва 56		22/09/16	97.50	97.92					7.74	3.48	68	147	20 000
Москва 49		14/06/17	97.35	97.80	97.70	0.50	11	229 217	7.74	3.95	61	145	25 000
Москва 48		11/06/22	91.21	91.53	91.50	1.00	5	313 614	8.00	6.90	53	134	30 000
МОС ОБЛ													
Московская Обл 8		11/06/13	100.80	101.10					7.66	0.62	163	134	19 000
Московская Обл 7		16/04/14	99.75	99.94	99.75	-0.05	10	23 040	8.35	1.44	182	207	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5		02/12/12	100.50	100.70					6.48	0.12		22	3 000
Нижегородская Обл 4		17/11/12	99.25	102.05					7.14	0.08			3 000
Нижегородская Обл 6		07/10/15	99.80	100.15					8.23	1.82	156	197	5 000
Нижегородская Обл 7		16/11/16	103.01	103.10					8.64	2.21	185	239	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6		10/05/13	103.50	103.90	103.90	-0.10	2	859	8.02	0.53	209	170	2 000
Самарская Обл 5		19/12/13	101.70	102.39					7.99	1.12	162	170	8 000
Самарская Обл 7		30/11/16		98.20	98.12	-0.18	1	50 000	8.67	2.09	192	242	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.76	100.49					7.62	0.47		130	3 000
Якутия 9		19/09/13	101.35	102.00					7.79	0.65	174	147	2 000
Якутия 7		17/04/14	100.00	100.40	100.00	0.10	7	11 176	8.03	1.35	154	175	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12	86.00	99.87						0.16			2 000
Краснодар 02		05/11/15	100.25	100.80					8.52	1.16	212	223	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	100.00	100.55					8.20	1.38	170	192	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4		08/11/12	100.10	100.20	100.20	0.05	2	427	6.98	0.06			10 000
Красноярский край 5		29/11/16	101.50	102.35	101.50	-0.35	3	55 002	8.27	1.50	172	200	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	98.30		100.00		1	139	8.14	0.57	217	182	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	100.00					9.60	1.44	307	332	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	86.02	95.00	95.00	0.30	1	252	8.50	2.31	169	225	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							8.99	2.35	217	274	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.50	104.90					9.00	2.48	214	275	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12	100.24	100.27	100.23	-0.07	2	3 664	7.85	0.17		157	3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.61	100.99	100.99	-0.11	7	60 001	9.27	1.86	259	301	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16	100.01	103.45					9.47	2.31	266	322	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.85	102.10	101.95	-0.05	3	5 552	8.90	1.71	227	264	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.32	100.35	100.32	-0.01	1	3 017	7.62	0.56	166	130	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.60	99.85					8.06	1.18	165	177	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	101.00	101.45	101.00		3	10 001	8.70	2.21	191	245	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	98.95	100.00					8.40	1.11	203	211	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	100.37	100.58	100.58	-0.15	1	9 500	6.96	0.17		68	2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	103.10	104.10					8.11	1.10	175	181	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	87.00	102.20					8.13	1.83	146	187	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	97.01	103.40					9.02	0.81	284	271	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13	100.01	107.49	107.50	0.50	2	25	8.62	1.10	225	233	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.31	98.55					9.43	2.50	257	318	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ

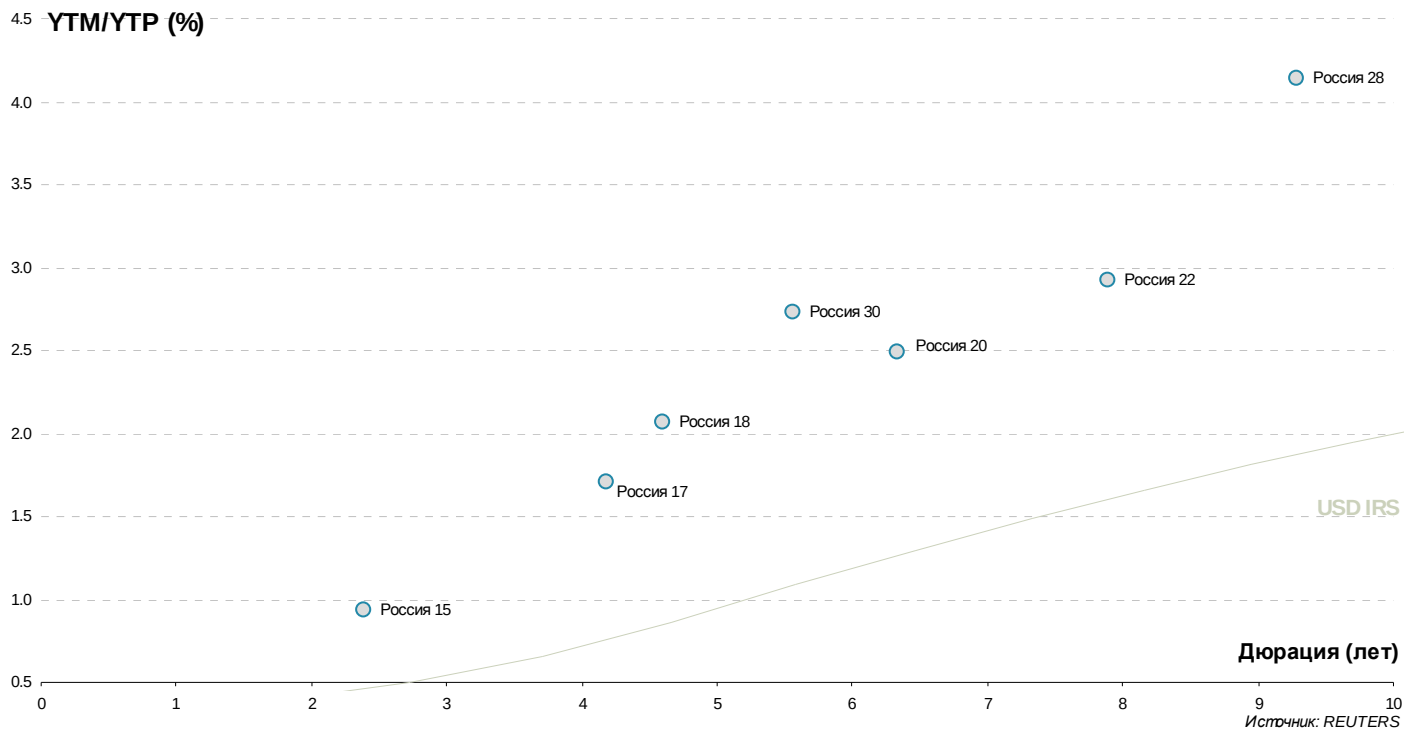


Результаты торгов евробондами

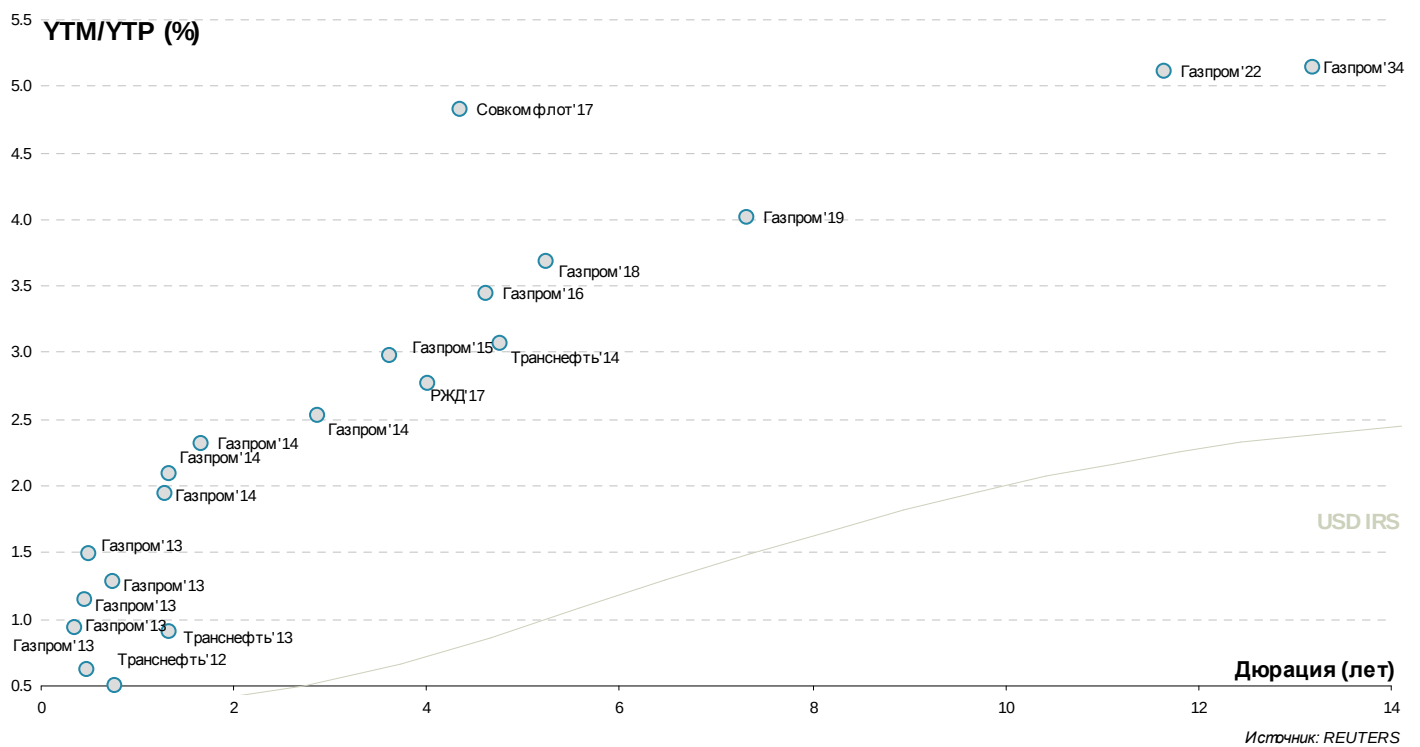
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
РОССИЯ										
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		106.500	106.830	1.00	0.88	2.39		57
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.361	106.769	1.76	1.66	4.18	0.01	102
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.639	148.806	2.15	1.98	4.60	-0.01	119
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.659	127.919	2.75	2.71	5.57	0.16	132
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.880	117.380	2.52	2.45	6.33		118
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.819	113.156	2.94	2.90	7.90	-0.01	126
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.900	199.100	4.17	4.11	9.29	-0.24	212
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		121.587	122.038	4.32	4.30	16.02	-0.39	178
ГОСКOMPАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.421	101.546	1.62	1.37	0.49		133
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13		102.300	102.600	0.91	0.32	0.49	0.42	62
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13		103.000	103.150	1.14	0.73	0.36	0.10	86
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.750	103.000	1.41	0.89	0.47	-0.01	113
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.650	104.850	1.40	1.15	0.76	0.05	111
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		111.380	112.130	2.34	1.84	1.34	0.32	203
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		111.200	111.950	2.21	1.69	1.29		190
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.875	110.100	2.39	2.26	1.67	0.07	203
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.374	107.859	2.60	2.44	2.86		211
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		112.112	112.575	3.03	2.92	3.61	0.03	240
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.724	123.724	3.54	3.36	4.62	0.39	265
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		131.712	132.213	3.71	3.64	5.24	-0.16	264
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		119.085	119.591	4.04	3.98	7.33	0.19	246
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		145.019	146.094	5.14	5.08	11.64	0.49	285
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		129.657	130.173	5.16	5.13	13.20	0.55	277
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		104.667	106.667	1.71	-0.71	0.77	-0.02	142
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.959	106.959	1.26	0.55	1.33	0.09	92
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		129.449	129.824	3.10	3.04	4.76	-0.14	214
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		112.093	112.573	2.82	2.72	4.01	0.07	212
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		101.942	102.942	4.93	4.71	4.36	0.03	414
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		99.900	99.925	9.98	8.88	0.02		1 054
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.042	107.536	3.34	3.13	2.22	-0.03	295
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		106.239	107.239	4.97	4.76	4.59	-0.27	412
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		109.174	109.674	4.98	4.88	4.67	-0.05	409
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		107.853	108.351	5.33	5.26	6.40	0.47	400
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		107.117	107.513	5.69	5.66	12.55	0.11	335
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.880	103.630	2.09	0.77	0.54	-0.02	181
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		107.300	107.800	3.48	3.27	2.23	0.10	308
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.006	100.006	7.16	6.69	2.23	-0.09	686
ВЭБ										
VEB'16 5.125%	USD	27/05/16		104.720	105.020	3.71	3.62	3.27	-0.22	316
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		110.310	110.814	3.23	3.13	4.45	0.21	240
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		119.936	120.437	3.88	3.82	6.17	0.94	256
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		120.549	121.048	4.68	4.64	9.07	0.67	271
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		104.000	104.250	1.98	1.62	0.66	0.10	170
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.096	106.396	3.28	3.14	2.00	0.10	291
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.040	108.439	3.57	3.43	2.70	-0.01	312
ПСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		103.000	103.375	1.80	1.15	0.55	0.01	152
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.875	106.125	2.23	2.03	1.18	-0.04	192
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		111.000	111.300	2.11	1.94	1.52	0.09	177
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		112.177	112.677	3.39	3.28	3.97	0.30	267
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		120.362	120.864	3.69	3.60	4.63	0.11	278
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		105.344	105.969	4.38	4.20	3.24	-0.13	384
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		102.850	103.075	1.36	0.97	0.55	0.17	108
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.200	103.575	1.79	1.26	0.68	-0.01	150
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.909	108.299	2.46	2.32	2.52	-0.11	202
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.499	108.999	3.32	3.20	4.00	0.28	262
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		109.569	110.569	4.38	4.24	6.91	0.01	288
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		103.400	103.600	2.04	1.66	0.48	0.05	177
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		110.043	110.536	4.67	4.51	2.68	-0.31	423
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		114.765	115.777	6.29	6.08	4.32	-0.16	547
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		102.748	103.748	6.15	5.94	4.56	-0.37	531
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		107.700	108.200	6.34	6.12	2.17	0.20	602
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		111.283	111.746	3.19	2.97	1.88	-0.12	282
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		115.567	116.075	5.34	5.27	6.09	0.14	401
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		103.100	103.300	2.33	1.96	0.50	0.20	205
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		107.160	107.160	4.13	4.13	2.98	-0.09	363
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.950	112.459	4.59	4.45	3.11	-0.17	408
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		118.622	119.141	5.20	5.10	4.40	-0.17	435
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		111.130	112.130	6.02	5.87	6.29	0.25	467
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.904	109.099	1.89	1.80	1.89	0.07	151
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		114.950	115.950	2.88	2.67	4.04	0.38	214
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		121.710	122.223	3.71	3.64	5.63	0.11	251
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		114.770	115.279	3.96	3.89	6.44		257
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		122.125	122.899	3.88	3.79	7.37	0.38	226
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		123.805	124.313	4.87	4.80	5.85	0.15	360
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		108.000	109.000	2.76	2.45	3.03		224
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		118.500	119.000	3.96	3.90	6.60	2.62	253
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		106.450	106.700	1.27	0.95	0.74	0.18	97
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		110.130	110.430	2.29	2.10	1.43	0.03	196
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		108.898	109.410	4.69	4.58	4.24	0.09	391
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		103.942	104.942	6.84	6.62	4.37	0.17	607
ТНК										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.521	105.521	0.99	-6.30			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.408	109.323	2.43	2.03	2.14	0.19	203
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		116.563	117.062	2.80	2.67	3.31	0.39	222
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		115.275	116.289	2.91	2.68	3.92	0.52	221
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		122.443	123.477	3.29	3.11	4.57	0.68	242
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		122.611	123.681	3.68	3.53	5.88	0.85	243
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.500	104.850	2.42	1.92	0.65		214
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.909	109.896	4.07	3.66	2.23	-0.03	369
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		110.380	110.750	5.44	5.36	4.20	-0.06	470
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		101.000	102.000	2.48	-3.88		0.10	
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		101.695	102.195	4.74	4.22	0.98		448
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		106.380	107.380	6.38	6.02	2.71	0.01	598
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.835	105.085	3.93	3.59	0.70	-0.03	367
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14		101.247	101.747	5.33	4.98	1.42	-0.01	507
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		112.745	113.745	7.26	6.87	2.21	0.01	696
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		108.465	110.465	8.53	7.93	3.07	0.50	812
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.506	104.006	4.39	4.03	1.35	0.01	410

Россия



Госкомпании



YTM/YTP (%)

Дюрация (лет)

Источник: REUTERS

Bank (Label)	Duration (лет)	YTM/YTP (%)
Сбербанк'11	0.8	1.1
Сбербанк'13	0.8	1.4
Сбербанк'13	1.0	1.5
Сбербанк'13	1.2	1.6
Сбербанк'13	1.5	1.8
Сбербанк'13	1.8	2.0
Сбербанк'13	2.2	2.4
Сбербанк'15	2.5	3.2
Сбербанк'15	2.8	3.4
Сбербанк'15	3.2	3.6
Сбербанк'15	3.5	3.8
Сбербанк'15	3.8	4.0
Сбербанк'15	4.2	4.2
Сбербанк'15	4.5	4.4
Сбербанк'15	4.8	4.6
Сбербанк'15	5.2	4.8
Сбербанк'15	5.5	5.0
Сбербанк'15	5.8	5.2
Сбербанк'15	6.2	5.4
Сбербанк'15	6.5	5.6
Сбербанк'15	6.8	5.8
Сбербанк'15	7.2	6.0
Сбербанк'15	7.5	6.2
Сбербанк'15	7.8	6.4
Сбербанк'15	8.2	6.6
Сбербанк'15	8.5	6.8
Сбербанк'15	8.8	7.0
Сбербанк'15	9.2	7.2
Сбербанк'15	9.5	7.4
Сбербанк'15	9.8	7.6
Сбербанк'15	10.2	7.8
Сбербанк'15	10.5	8.0
Сбербанк'15	10.8	8.2
Сбербанк'15	11.2	8.4
Сбербанк'15	11.5	8.6
Сбербанк'15	11.8	8.8
Сбербанк'15	12.2	9.0
Сбербанк'15	12.5	9.2
Сбербанк'15	12.8	9.4
Сбербанк'15	13.2	9.6
Сбербанк'15	13.5	9.8
Сбербанк'15	13.8	10.0
Сбербанк'15	14.2	10.2
Сбербанк'15	14.5	10.4
Сбербанк'15	14.8	10.6
Сбербанк'15	15.2	10.8
Сбербанк'15	15.5	11.0
Сбербанк'15	15.8	11.2
Сбербанк'15	16.2	11.4
Сбербанк'15	16.5	11.6
Сбербанк'15	16.8	11.8
Сбербанк'15	17.2	12.0
Сбербанк'15	17.5	12.2
Сбербанк'15	17.8	12.4
Сбербанк'15	18.2	12.6
Сбербанк'15	18.5	12.8
Сбербанк'15	18.8	13.0
Сбербанк'15	19.2	13.2
Сбербанк'15	19.5	13.4
Сбербанк'15	19.8	13.6
Сбербанк'15	20.2	13.8
Сбербанк'15	20.5	14.0
Сбербанк'15	20.8	14.2
Сбербанк'15	21.2	14.4
Сбербанк'15	21.5	14.6
Сбербанк'15	21.8	14.8
Сбербанк'15	22.2	15.0
Сбербанк'15	22.5	15.2
Сбербанк'15	22.8	15.4
Сбербанк'15	23.2	15.6
Сбербанк'15	23.5	15.8
Сбербанк'15	23.8	16.0
Сбербанк'15	24.2	16.2
Сбербанк'15	24.5	16.4
Сбербанк'15	24.8	16.6
Сбербанк'15	25.2	16.8
Сбербанк'15	25.5	17.0
Сбербанк'15	25.8	17.2
Сбербанк'15	26.2	17.4
Сбербанк'15	26.5	17.6
Сбербанк'15	26.8	17.8
Сбербанк'15	27.2	18.0
Сбербанк'15	27.5	18.2
Сбербанк'15	27.8	18.4
Сбербанк'15	28.2	18.6
Сбербанк'15	28.5	18.8
Сбербанк'15	28.8	19.0
Сбербанк'15	29.2	19.2
Сбербанк'15	29.5	19.4
Сбербанк'15	29.8	19.6
Сбербанк'15	30.2	19.8
Сбербанк'15	30.5	20.0
Сбербанк'15	30.8	20.2
Сбербанк'15	31.2	20.4
Сбербанк'15	31.5	20.6
Сбербанк'15	31.8	20.8
Сбербанк'15	32.2	21.0
Сбербанк'15	32.5	21.2
Сбербанк'15	32.8	21.4
Сбербанк'15	33.2	21.6
Сбербанк'15	33.5	21.8
Сбербанк'15	33.8	22.0

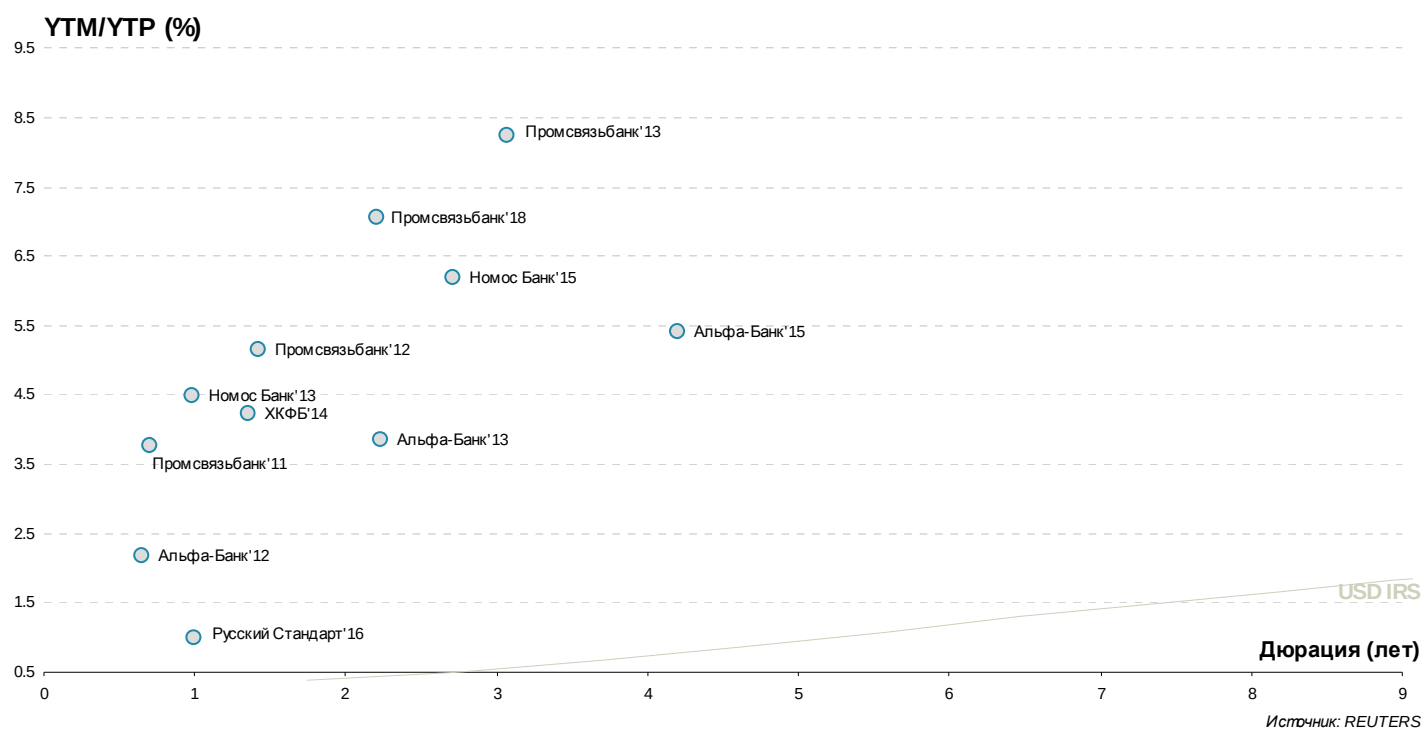
YTM/YTP (%)

Дюрация (лет)

USD IRS

Источник: REUTERS

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

ibcm@zenit.ru

Рублевые облигации

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

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

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

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

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

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