

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки корректируются вверх на заявлениях Драги и Греции
- Заседание ФРС прошло ожидаемо неинтересно

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Уплата НДС грозит рынку ухудшением условий
- Рубль отыграл часть потерь, но выглядит слабым

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды опустились вниз по ценам
- Локальный рынок консолидируется

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

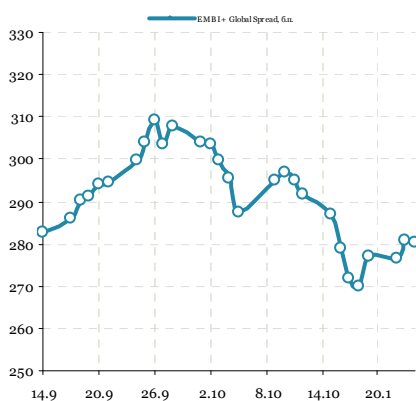
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.76	▼	-0.06	1.39	1.99
UST 10-2Y sprd	147	▼	-4	117	172
EMBI+ Glob.	280	▼	-1	270	441
EMBI+ Rus sprd	153	▲	9	141	332
Russia 30 yield	2.85	▼	0.00	2.72	4.45
Денежный рынок					
Libor-3m	0.31	▼	0.00	0.31	0.47
Euribor-3m	0.20	▼	0.00	0.20	0.73
MosPrime-1m	6.61	▲	0.03	6.01	6.89
Корсчета в ЦБ	770.2	▼	-80.5	446	1032
Депоз. в ЦБ	87.5	▲	1.2	61	238
NDF RU 3m	6.4	■	0.0	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	31.425	▲	0.313	29.31	33.67
EUR/RUB	40.776	▲	0.126	38.72	41.81
EUR/USD	1.299	▼	-0.007	1.21	1.33
Корзина ЦБ	35.52	▲	0.202	33.54	37.28
DXY Индекс	79.976	▲	0.324	78.71	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1456.7	▲	0.1%	1228	1620
Dow Jones	13102.5	▼	-1.82%	12101	13610
DAX	7169.7	▼	-0.06%	5969	7452
Nikkei 225	9014	▼	-0.67%	8296	9667
Shanghai Comp.	2114.4	▲	0.07%	2004	2452
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	108.1	▲	0.98%	88	117
Нефть Brent	108.3	▲	0.51%	89	120
Золото	1707.7	▲	0.01%	1540	1790
CRB Index	299.9	▼	-1.20%	267	321

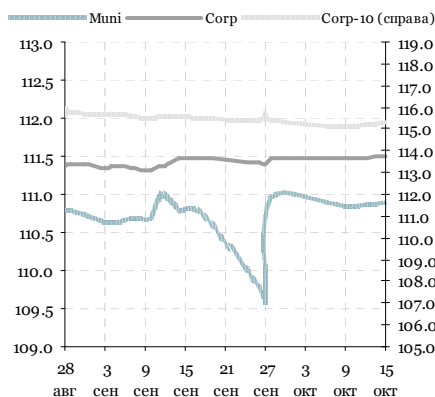
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	118.3	▲	0.76	107.5	118.3
Muni	110.9	▲	0.07	109.6	112.8
Corp	111.5	▲	0.02	110.7	112.1
Corp-10	115.3	▲	0.20	115.1	117.8
Total Return					
OFZ	272.7	▲	2.07	233.3	272.7
Muni	346.4	▲	0.78	324.8	346.4
Corp	345.4	▲	0.57	323.6	346.4
Corp-10	346.4	▲	1.16	324.6	346.4
Объем торгов в сегменте (млн руб.)					
OFZ	693	▲	281	0	22 514
Muni	473	▼	-542	10	6 146
Corp	4 972	▼	-2 262	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Fitch Ratings поместило рейтинги TNK-BP International Ltd, включая долгосрочный рейтинг дефолта эмитента в иностранной и национальной валютах «BBB-», под наблюдение в список Rating Watch «негативный». /Интерфакс/

ОАО «НК «Роснефть» установило ставку 1-го купона облигаций 4-й и 5-й серий объемом по 10 млрд руб. каждая в размере 8,6% годовых. /Интерфакс/

ОАО «Внешпромбанк» установило ставку первого купона биржевых облигаций серии БО-02 объемом 3 млрд руб. в размере 12% годовых. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке**Вчера: 24.10.2012 – среда**

- | | |
|---|---|
| <p>Статистика Еврозоны: PMI Manufacturing</p> <p>Статистика США: New home sales, FOMC Rate Decision</p> | <ul style="list-style-type: none"> • Выплата купона: Мечел, БО-03 (9.75%, 243.1 млн руб.), ТРАНСАЭРО, 01 (12.5%, 186.9 млн руб.), Первый Объединенный Банк (Первобанк), БО-01 (9.75%, 72.9 млн руб.), Россия, 26205 (7.6%, 5.8 млрд руб.), Связь-Банк, 04 (8.75%, 218.1 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-06 (10%, 37.4 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, БО-07 (10%, 37.4 млн руб.), Лизинговая компания УРАЛСИБ, БО-07 (11%, 50.3 млн руб.), Евраз Груп, 2017 (LPN) (7.4%, 22.2 млн руб.), Россия, 25080 (7.4%, 5.5 млрд руб.), Евраз Груп, 2018 (LPN) (9.5%, 33.2 млн долл.), Евраз Груп, 2013 (LPN) (8.875%, 57.7 млн долл.) • Оферта: Татфондбанк, БО-02 (2 млрд руб.) • Размещение: ФСК ЭЭС, БО-01 (10 млрд руб.), ФСК ЭЭС, 21 (10 млрд долл.) |
|---|---|

Сегодня: 25.10.2012 – четверг

- | | |
|---|--|
| <p>Статистика США: Durable Goods Orders, Initial jobless claims, Continuing claims</p> | <ul style="list-style-type: none"> • Выплата купона: Россия, 39004(ГСО-ФПС) (9.5%, 378.9 млн руб.), Мечел, 04 (11.25%, 140.2 млн руб.), КРЕДИТ ЕВРОПА БАНК, 2012 (LPN) (9%, 6.7 млн руб.), ХКФ Банк, 07 (9.75%, 121.5 млн руб.), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 01 (7%), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 02 (7%), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 03 (7%), Северсталь, 2017 (LPN) (6.7%, 33.5 млн долл.), ИСО ГПБ-Ипотека Два, А (7.5%, 19.7 млн руб.), Кузбассэнерго-Финанс, 02 (8.7%, 216.9 млн руб.), Промсвязьбанк, 2014 (LPN) (6.2%, 15.5 млн руб.), ФСК ЭЭС, 15 (8.75%, 436.3 млн руб.), ЮТэйр-Финанс, 05 (9.5%, 35.5 млн руб.), Завод Ремпутъмаш, 01 (8.5%, 97.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-С, RUB (RMBS, FRN) (12%, 2.6 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-С, RUB (RMBS, Step Up) (11.5%), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Да, RUB (RMBS) (12%, 3.2 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (12%, 1.1 млн руб.), Банк Москвы, 2013 (CLN) (8%, 0.7 млн руб.), Промсвязьбанк, 2017 (LPN) (8.5%, 17 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-В, RUB (RMBS, FRN) (9%, 2.9 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А1, RUB (RMBS, Step Up) (8.35%, 12.9 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-В, RUB (RMBS, Step Up) (8.75%, 2.2 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А2 (RMBS, Step Up) (8.5%, 2.1 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-А (RMBS) (8.75%, 21.2 млн руб.), Московская объединенная энергетическая компания (МОЭК), 01 (6.35%, 94.9 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-В (RMBS) (9%, 4.4 млн руб.) • Погашение: КРЕДИТ ЕВРОПА БАНК, 2012 (LPN) (2 млрд руб.) • Размещение: Банк Интеза, БО-01 (3 млрд руб.), Россельхозбанк, 18 (5 млрд руб.), Банк Российский Капитал, 03 (3 млрд руб.), Красноярский край, 34006 (16.9 млрд руб.) |
|---|--|

Завтра: 25.10.2012 – пятница

- | | |
|---|--|
| <p>Статистика США: Durable Goods Orders, Initial jobless claims, Continuing claims</p> | <ul style="list-style-type: none"> • Выплата купона: НИА ВТБ 001, 1А (10.5%, 15.8 млн руб.), Технологии Лизинга Инвест, 01 (8.5%, 74.1 млн руб.), ВТБ, БО-07 (7.95%, 198.2 млн руб.), ФСК ЭЭС, 07 (7.5%, 187 млн руб.), ФСК ЭЭС, 09 (7.99%, 199.2 млн руб.), ФСК ЭЭС, 11 (7.99%, 398.4 млн руб.), ФСК ЭЭС, 12 (8.1%, 403.9 млн руб.), НОМОС-БАНК, 2019 (LPN) (10%, 25 млн руб.), ХКФ Банк, БО-01 (7.5%, 19.7 млн руб.) • Оферта: ХКФ Банк, БО-01 (3 млрд руб.) • Размещение: ЮниКредит Банк, БО-04 (5 млрд руб.), Группа ЛСР (ОАО), 04 (5 млрд руб.), Внешпромбанк, БО-02 (3 млрд руб.), ФГУП «Почта России», 02 (3 млрд руб.), ФГУП «Почта России», 03 (3 млрд руб.), ФГУП «Почта России», 04 (3 млрд руб.) |
|---|--|

Внешний рынок долга

Рынки корректируются вверх на заявлениях Драги и Греции

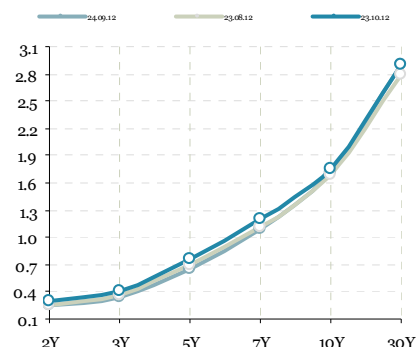
Негативный старт начала недели вчера сменился нарастанием коррекционных настроений и покупкой подешевевших рискованных активов. Поводом для роста аппетита к риску, помимо технических факторов, послужили неплохие корпоративные отчеты, а также улучшение новостного фона по Европе. В частности, глава ЕЦБ Марио Драги, выступая перед членами германского парламента, заявил о том, что выкуп облигаций проблемных экономик не навредит ценовой стабильности в регионе. Помимо этого, министр финансов Греции сообщил о договоренности с «тройкой» кредиторов относительно параметров экономической программы, которая будет включать новые меры бюджетной экономии. Это говорит о том, что в самое ближайшее время будет сформирован отчет миссии «тройки» в Афинах, после которого получение очередного транша на 31 млрд евро будет лишь техническим вопросом.

Заседание ФРС прошло ожидаемо неинтересно

Заседание ФРС вчера завершилось ожидаемо нейтрально для рынков. Федрезерв сохранил программу выкупа ипотечных активов на уровне 40 млрд евро в месяц. Глава ФРС в целом подтвердил свою скромную оценку экономики, ожидания первого повышения базовой процентной ставки в середине 2015 г. сохранились. В отношении краткосрочных оценок экономики ФРС была чуть более уверенной, было отмечено продолжающееся улучшение на рынке жилья. Инфляция, несмотря на заметное ускорение в сентябре, не тревожит ФРС, поскольку вызвано волатильность цен на энергоносители. Глава ФРС в целом подтвердил свою скромную оценку экономики, ожидания первого повышения базовой процентной ставки в середине 2015 г. сохранились.

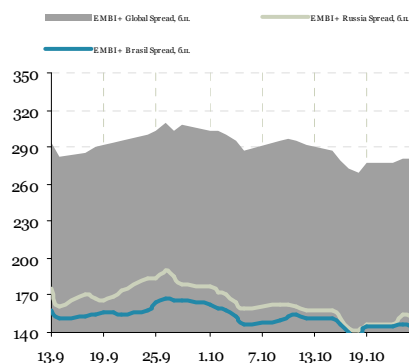
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



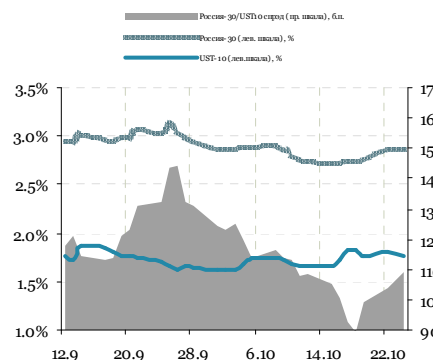
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВІ+ (Россия, Бразилия)



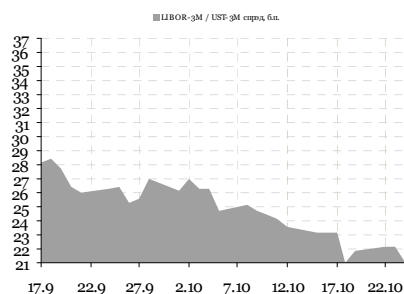
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Уплата НДС грозит рынку ухудшением условий

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка вчера оставалась неизменной, банки аккумулируют ликвидность для осуществления налоговых платежей. На рынке МБК ставки по кредитам overnight держались на уровне 6.25% годовых, междилерское репо на ММБВ обходилось в среднем под 6.30% годовых. На аукционах 1-дневного прямого репо с ЦБ РФ регулятор вновь ограничил объем размещения на уровне 190 млрд руб. при спросе со стороны банков на уровне 211 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ снизилась на 147.3 млрд руб., составив 757.7 млрд руб.

Сегодня рынку предстоит пережить еще один крупный налоговый платеж - НДС который потребует из банковской системы порядка 220 млрд руб., что при текущем состоянии рынка выглядит значительным. Если Центробанк сегодня ограничит спрос банков на краткосрочное рефинансирование, ставки денежного рынка могут подняться на 25-50 бп.

Рубль отыграл часть потерь, но выглядит слабым

Торги на валютном рынке вчера завершились укреплением рубля по отношению к бивалютной корзине на 11 коп. до отметки 35.52 руб. Общее улучшение настроений на рынках позволило рублю отыграть часть снижения в предыдущие 2 торговых дня (+55 коп. к корзине). Тем не менее, позиции рубля выглядят слабыми, поскольку котировки нефти вчера снижались до локальных минимумов на уровне 107 долл. за барр. Brent. Уплата НДС традиционно оказывает рублю поддержку, поэтому сегодня давление внешних факторов может оказаться менее ощутимым для российской валюты.

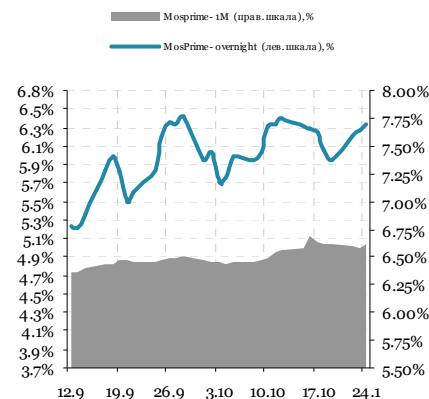
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	НДС, 1/3 за III квартал, (~180 млрд руб.)	156
Вторник	Аукцион Казначейства	84 дня, 16 млрд руб., от 7% годовых	146
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 25208 (7 лет), 30 млрд руб.	190
	Выплата купонов ОФЗ	4.5 млрд руб. (ОФЗ 26205)	
Четверг	Аукцион Казначейства	84 дня, 15 млрд руб., от 7% годовых	
	Уплата налогов	НДС за сентябрь	
Пятница			

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

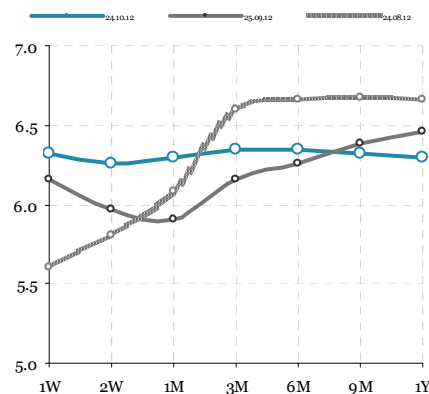
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды опустились вниз по ценам

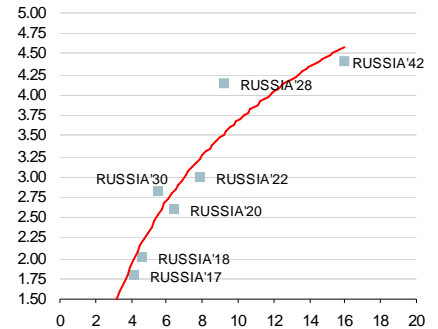
Цены в российском сегменте в среду по-прежнему выглядели слабо на фоне продолжающегося сворачивания рисков стратегий и снижения нефтяных цен. Биды вдоль суверенной кривой опустились в среднем на 20 бп, чуть лучше рынка выглядела «тридцатка», прибавившая в районе 25 бп до отметки 127.2%. Корпоративный сектор продолжил фронтальное движение вниз по ценам, потеряв в среднем по рынку еще в районе 25 бп. Слабую динамику показали дальние выпуски ТНК-ВР, потерявшие в ценах 75-100 бп, снижением на 50 бп завершили день выпуски EVRAZ'18, в финансовом секторе хуже рынка выглядел выпуск NOMOS'15, подешевевший на 50 бп, тогда как субординированный NOMOS'19 снизился на 70 бп.

Локальный рынок консолидируется

Локальный рынок вчера консолидировался после вторичных распродаж на фоне боковой динамики рубля и нейтрального новостного потока с глобальных рынков. Котировки на дальнем участке кривой ОФЗ менялись в диапазоне 25 бп, лучше рынка выглядел дальний выпуск 26207, подорожавший на 40 бп и восстановивший часть вторичных потерь. Доходности оставались на 5-10 бп выше ориентиров, намеченных Минфином для аукциона в семилетнем выпуске 26208, что заставило его отказаться от размещения бумаги. В корпоративном секторе активность сместилась ближе к началу кривой, на средней дюрации активность была заметна в торговавшихся в районе бидов выпусках Металлоинвеста. Заметные объемы без ценовых сдвигов проходили в коротких выпусках ВЭБ-Лизинг 03 и Газпромбанк БО4, выше по уровню кредитного риска достаточно активно торговались не самые ликвидные выпуски Банк СПБ БО4 и МКБ БО1.

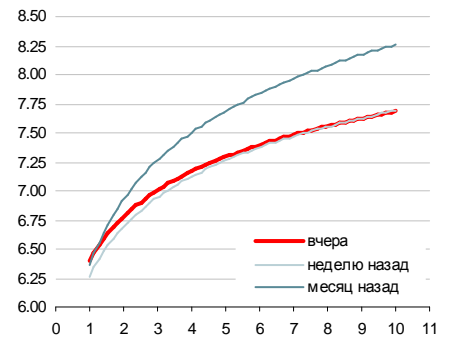
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



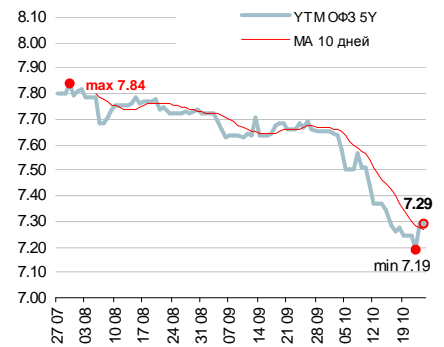
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



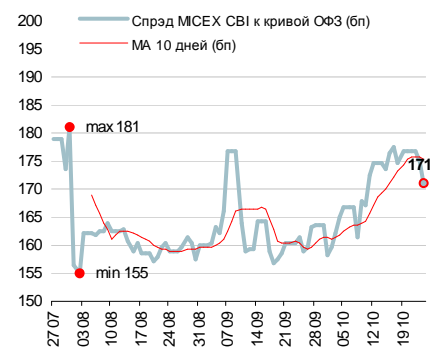
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ

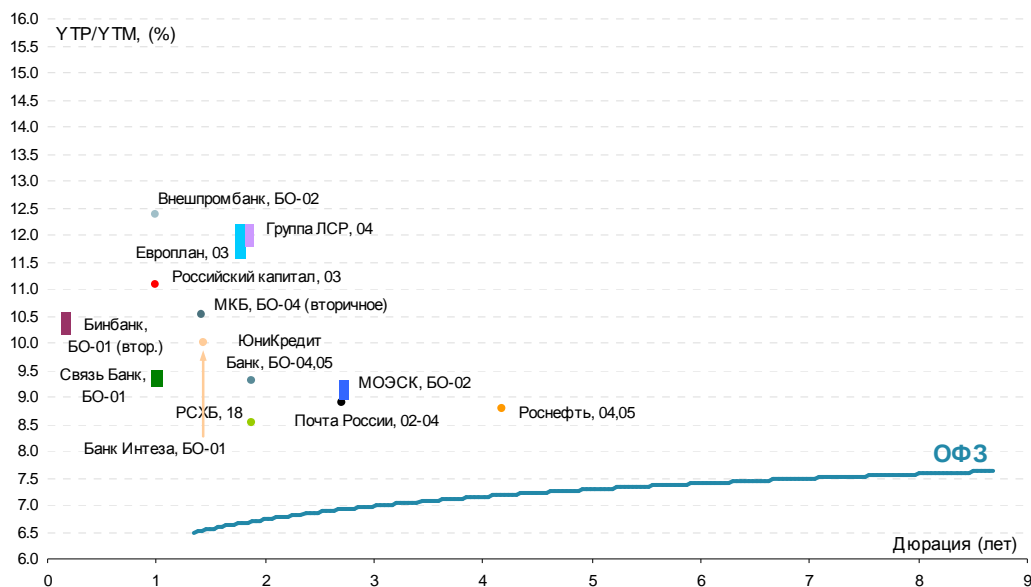


Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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 Интеза, БО-01	- / Ва1 / -	да	3 000	9.99	23.10.2012	25.10.2012	нет / 1.43 г.	1.5 г. / 3 г.
РСХБ, 18	- / Ваа1 / BBB	да	5 000	8.52	19.10.2012	25.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 10 лет
Российский Капитал, 03	- / - / В+	да	3 000	11.09	19.10.2012	25.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Почта России, 02	- / - / BBB	да	3 000	8.89	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 03	- / - / BBB	да	3 000	8.89	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
Почта России, 04	- / - / BBB	да	3 000	8.89	23.10.2012	26.10.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 7 лет
ЮниКредит Банк, БО-04	BBB / - / BBB+	да	5 000	9.31	24.10.2012	26.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 3 г.
Внешпромбанк, БО-02	В / В2 / -	да	3 000	12.36	24.10.2012	26.10.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Группа ЛСР, 04	- / В2 / В	да	5 000	11.83-12.10	Конкурс	26.10.2012	нет / 1.84 г.	2 г. / 5 лет
Роснефть, 04	BBB- / Ваа1 / BBB	да	10 000	8.78	23.10.2012	29.10.2012	нет / 4.17 г.	5 лет / 10 лет
Роснефть, 05	BBB- / Ваа1 / BBB	да	10 000	8.78	23.10.2012	29.10.2012	нет / 4.17 г.	5 лет / 10 лет
МОЭСК, БО-02	BB- / Ва2 / -	да	5 000	8.99-9.20	25.10.2012	29.10.2012	нет / 2.7 г.	нет / 3 г.
Трансфин-М, БО-11	NR	нет	2 000	н/д	Конкурс	29.10.2012	н/д	н/д / 3 г.
ЮниКредит Банк, БО-05	BBB / - / BBB+	да	5 000	9.31	24.10.2012	30.10.2012	нет / 1.88 г.	2 г. / 3 г.
Бинбанк, БО-01 (вторичное)	В / В2 / В-	да	2 500	10.23-10.54	16.10.2012	XX.10.2012	нет / 0.17 г.	2 мес. / 2.17 г.
МКБ, БО-04 (вторичное)	В+ / В1 / BB-	да	5 000	10.51	18.10.2012	XX.10.2012	нет / 1.42 г.	нет / 1.5 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
Связь-Банк, БО-01	BB / - / BB	да	5 000	9.20-9.46	30.10.2012	01.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Русфинанс Банк, БО-03	- / Ваа3 / BBB+	да	4 000	9.73-10.25	30.10.2012	02.11.2012	нет / 1.86 г.	2 г. / 3 г.
Ростелеком, 15	BB+ / - / BBB-	да	5 000	8.63-8.89	01.11.2012	07.11.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 5 лет
Ростелеком, 17	BB+ / - / BBB-	да	10 000	8.63-8.89	01.11.2012	07.11.2012	нет / 2.7 г.	3 г. / 5 лет
О'Кей, 01	- / - / В+	да	2 000	10.25-10.62	08.11.2012	13.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
О'Кей, 02	- / - / В+	да	3 000	10.25-10.62	08.11.2012	13.11.2012	нет / 2.66 г.	3 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	100.00	100.01	100.01	0.01	21	271 651	5.43	0.02			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.29	100.30	100.30	-0.05	36	100 247	5.96	0.25			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.20	100.23	100.23	0.03	2	4 321	5.92	0.29			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.46	102.60	102.50	-0.14	4	19 200	6.08	0.41			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.08	100.20	100.10	-0.05	3	24 601	6.09	0.72			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.28	100.55					6.10	0.95			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.75	100.83	100.75	-0.06	8	248 733	6.62	1.33	7	30	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.10	109.22	109.10	-0.05	2	50 000	6.71	1.67	3	42	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.00	109.20	109.24	-0.03	3	11 475	6.71	1.93		45	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.90	103.05	102.86	-0.05	8	12 391	6.72	1.91		46	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.30	100.32	100.32	-0.18	19	291 620	6.98	2.37	11	73	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.05	100.24	100.15	-0.05	7	20 602	6.93	2.48	3	68	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.26	101.35	101.35		2	3 335	6.99	2.90	0	75	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.15	98.40	98.15	-0.44	1	200	7.15	2.93	16	91	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.85	99.95	99.90		3	13 811	7.05	3.34		80	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	100.00					8.67	3.35	160	242	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19		85.00					8.04	3.55	94	178	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.45	101.65	101.75	0.10	8	25 033	7.06	3.90		79	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.55	101.65	101.45	-0.25	14	102 993	7.15	3.92		88	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.45	102.60	102.55	0.05	8	105 990	7.04	4.52		73	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.80	92.60	91.80	-0.60	5	301 220	7.40	4.56	16	109	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	99.30	99.49					7.47	4.68	21	115	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	101.90	102.10	102.10	0.05	10	173 978	7.21	5.13		85	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		68.00					7.84	5.50	49	144	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.56	95.90	95.75	-0.51	6	30 028	7.58	6.21	17	109	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	101.80	102.00	101.90	-0.40	44	582 667	7.43	6.42		91	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	101.80	101.95	101.80	-0.25	20	86 855	7.47	6.97		87	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		88.20					8.02	7.40	51	136	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	103.99	104.14	103.99	0.44	60	1 051 431	7.83	8.68	23	99	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	87.10	89.60					8.20	10.92	47	103	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29	68.00	96.00					7.63	10.98		45	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.45	99.50	99.50	-0.09	7	36 567	7.81	0.75	158	144	15 000
НЛМК													
НЛМК ВО5		30/10/12	90.00		100.04	-0.02	2	2	8.17	0.02			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	96.00						7.02	0.11		70	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.00	100.09					7.86	0.36		148	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.55	100.73					8.08	0.63	195	171	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.60	100.73	100.70	0.05	1	1	7.75	0.63	162	138	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.10	100.40	99.10	-0.90	2	14 001	8.97	1.76	226	269	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.20	101.70					8.41	1.85	167	214	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.00	100.30					8.58	2.20	175	233	5 000
ММК													
ММК ВО1		15/11/12	99.92	100.04	99.92	0.02	1	704	8.30	0.06			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.90	100.00	100.00		4	7 751	7.78	0.44		140	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	99.75	100.05					8.27	0.79	201	190	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.10	99.21					8.38	1.29	185	205	5 000
ММК ВО6		10/07/14	97.50	97.70					8.89	1.61	223	260	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.15	97.90	97.90	0.30	1	5	8.74	1.64	207	245	5 000
Севсталь													
Севсталь ВО2		15/02/13	100.62	100.75	100.70	0.15	3	26	7.51	0.31		113	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.60	100.77	100.75	0.08	1	18 000	7.35	0.31		97	5 000
Алроса													
Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.32	100.35					7.98	0.65	183	161	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.21	100.37					7.98	0.66	182	161	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.31	101.40	101.45	0.05	2	19	8.59	2.37	171	234	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.15	101.45					8.58	2.39	170	233	3 000
Евраз													
Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.40	100.55					8.37	0.41		199	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.40	100.55					8.11	0.41		173	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	108.16	108.34	108.34	0.01	1	7	9.01	1.81	229	274	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	108.16	108.35					9.06	1.81	234	279	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20							9.71	2.55	279	347	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20							9.71	2.55	279	347	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	95.00	95.40					10.33	3.08	331	409	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	94.01	99.99	95.50		2	32	10.15	3.07	313	391	15 000
Металлоинвест													
Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.55	99.94	99.90	-0.06	3	20 170	9.25	2.19	242	300	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.50	99.94	99.55	-0.40	10	154 387	9.42	2.19	259	317	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.50	99.94	99.94	0.14	14	145 733	9.23	2.19	240	298	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 ВО1	11/11/11	09/11/12	99.94	99.98	99.98	0.03	2	4 460	8.59	0.04			5 000
Мечел ВО2		12/03/13	99.01	99.19	99.15	-0.14	1	20 000	12.39	0.38		601	5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.98	100.50					11.73	0.47		535	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.10	98.99	98.10	0.10	3	138 099	14.30	0.50		792	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.26	97.00	96.40	-0.10	1	90 000	13.94	0.61	782	756	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16							11.43	0.71	523	506	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.02	96.75					14.62	1.23	811	829	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	90.53	92.64					15.51	1.26	899	918	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.27	92.90					15.94	1.26	942	961	5 000
Мечел ВО5		07/04/15	99.50						11.82	2.22	498	557	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.82	2.22	498	557	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	498	557	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	498	557	3 000
Мечел ВО6		07/04/15	99.50						11.56	2.20	473	531	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	87.00	92.44					14.37	2.50	746	813	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.54	91.96					14.64	2.50	773	840	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	82.51	83.49	82.50	0.50	6	10	15.38	3.03	837	914	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.39	87.47					13.44	3.04	643	720	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	84.50	85.54	84.50	1.00	5	664	14.48	3.05	746	824	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.25	99.99	99.99	-0.01	1	1	9.06	0.97	268	270	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.55	100.60	100.55	-0.05	3	161	8.66	0.67	249	229	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.55	98.00					12.36	1.07	593	601	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.40	91.99					15.48	1.48	887	917	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.10	100.40					7.45	0.11		113	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	93.00	97.90	97.86	-0.30	2	12	10.44	1.47	383	413	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.76	93.00	92.96	0.35	18	9 398	14.67	1.29	813	834	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.34	88.28	88.29	0.29	5	1 153	14.79	2.26	794	854	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12	99.98	100.05	100.05	0.02	3	1 127	6.22	0.04			5 000
РЖД ВО01		05/12/12	100.15	100.19					7.81	0.12		149	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.30	99.60	99.40	-0.05	12	51 057	7.64	1.01	125	128	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.00	109.19	109.18	-0.02	10	43 355	7.91	1.27	139	158	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.38	102.69	102.52	-0.18	2	10 000	7.91	2.06	111	166	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.30	99.55	99.55	-0.09	1	30	8.12	2.70	117	188	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.25	99.50	99.50	-0.11	4	10 031	8.22	3.13	119	198	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	106	199	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.80	100.20	99.88	-0.03	1	1	7.41	0.91	107	105	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.80	100.20					7.41	0.91	107	105	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	101.00	101.19					7.94	1.51	132	164	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23							8.00	1.80	128	173	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.90	99.50	99.30	0.10	1	21	8.18	2.65	124	194	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20							8.04	2.65	110	180	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19							8.39	2.99	138	215	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.00	100.35	100.20	0.20	3	3	8.72	3.40	164	247	15 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20							8.83	4.04	166	256	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20							8.83	4.04	166	256	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.10	96.70					8.88	4.59	163	257	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.90	97.95	97.50	0.21	1	1	9.12	6.11	171	265	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.80	100.11	99.80	-0.40	6	23 990	9.30	2.21	246	305	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.00	102.00					9.65	3.22	260	340	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.05	101.99	99.21	0.02	4	300	10.04	0.99	366	368	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.71	243	314	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.30					9.65	3.00	264	341	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.12	3.00	211	288	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.63	220	305	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32			99.65	-0.50	1	122	9.46	3.63	235	320	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.35	3.63	224	309	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	86.00	100.28	100.25		2	3 001	8.22	1.36	166	190	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	99.97	100.00	99.95	-0.05	4	10 003	8.78	0.04			15 000
Газпром А9		12/02/14	99.00	99.90					7.77	1.25	125	144	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.51	109.80	109.51	-0.29	4	35 338	7.69	1.49	107	138	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							6.66	0.14		33	5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							6.66	0.14		33	5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.11	100.15	100.15		1	10 000	7.38	1.06	95	103	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.50	100.00					7.97	0.23		160	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.94	100.40	99.98	-0.02	3	50 001	7.31	0.46		93	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.90	100.17					7.27	0.46		89	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50	101.00					7.91	2.09	111	166	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.62	101.50	100.62	-0.03	2	132	8.44	2.88	146	220	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.68	101.00	101.50	0.85	1	4	8.13	2.90	114	189	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	95.03	102.50					8.60	4.26	140	231	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	96.51	99.50					8.37	4.50	114	207	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	90.00	100.15					7.37	0.65	122	100	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	99.90	100.25	100.25	-0.10	1	11 000	8.42	2.68	148	218	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.90	100.30					8.42	2.68	148	218	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15		100.25					8.42	2.68	148	218	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.36	99.60	99.56	0.11	4	5 364	7.90	0.89	157	154	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.60	100.90	100.86	0.06	3	353	6.64	0.15		30	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.50	100.93					7.04	0.15		70	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.50	100.79					8.75	0.15		241	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14		101.65	101.50		1	500	8.06	1.05	164	171	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22		101.75					8.48	2.10	167	223	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.00	100.35					10.27	0.74	405	390	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	96.39	99.70	98.91	-0.13	6	732	10.41	1.22	391	407	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	92.00	95.59					11.00	3.06	398	476	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	92.00	97.99					11.00	3.07	398	476	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.06	99.20	99.20	0.20	14	1 431	13.72	0.73	751	735	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50					9.51	3.13	248	327	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.56	100.63	100.55	-0.10	7	3 984	7.97	0.69	178	160	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.16	100.22	100.18	-0.01	9	16 955	7.53	0.16		119	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15							7.64	0.25		126	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.71	100.00	100.41	0.31	3	6 002	6.68	0.38		30	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.70	100.07					7.64	0.38		126	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.95	100.00	100.00	-0.05	7	25 532	7.81	0.38		143	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.07	100.15	100.10	0.34	1	5 000	8.06	0.83	177	169	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.60	99.97					7.66	0.95	130	130	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15		100.20					8.24	1.33	169	192	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.06	100.19					8.20	1.33	165	188	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15							8.70	2.62	177	246	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15							8.70	2.62	177	246	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.14	0.86	183	177	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.00	100.49					8.93	1.95	216	267	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.05	100.15					8.15	0.81	188	178	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.10	99.74					8.15	0.21		179	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	92.00						8.20	0.35		182	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.25	100.75					7.86	0.50		148	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14							8.42	0.71	222	205	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	90.00	99.10					8.17	0.73	195	180	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.00	99.50					7.67	1.08	123	132	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16							8.94	1.20	244	260	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20		99.79					7.69	0.98	131	133	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	99.75	100.30					8.42	2.18	159	217	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32							8.73	2.70	178	249	00000 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32							8.73	2.70	178	249	00000 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.00	98.45	97.50	-0.80	1	300	8.95	3.04	194	271	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.41	160	243	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.55	96.90	97.00	0.45	5	50 551	8.84	4.20	164	256	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.35	99.50	99.54	0.04	8	209 164	7.99	1.41	141	168	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.50					8.31	1.81	159	204	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	
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.50	101.50					8.45	1.81	172	218	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.40	100.50	100.50	-0.07	1	20	8.92	2.01	214	267	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.00	99.25					9.05	3.05	203	281	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	99.55	100.50					8.61	3.05	159	237	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.33	100.40					8.56	1.36	200	224	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.40	100.60	100.60	-0.15	1	1	9.02	1.70	233	274	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.03	100.23					6.34	0.08			5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.20	100.30	100.20		1	277	7.50	0.08			5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.00	101.00	100.30	-0.70	1	2 300	8.00	0.29		162	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.00	100.50	100.50		8	10 201	7.29	0.29		91	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.35	99.55	99.40	-0.10	5	28 499	7.98	0.61	186	160	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.80					7.24	0.76	100	87	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.45					8.12	0.77	187	175	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13							7.79	0.82	151	142	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.25	100.40	100.40	-0.15	1	11 200	7.93	0.82	165	156	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						7.63	0.92	128	127	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.00	100.40	100.40	0.40	1	2	7.93	0.96	156	157	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.20	101.00	100.95	0.20	1	13 000	7.92	0.97	154	156	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	100.75	101.64					8.14	1.24	163	181	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	89.50	100.50					8.48	1.70	179	220	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22							8.53	1.88	179	227	00000 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.75	101.00					8.61	2.27	176	236	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	97.80	97.80	0.15	1	21	8.81	2.44	192	256	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.80	98.55					8.87	2.44	198	262	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.80	98.55					8.56	2.44	167	231	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							9.48	0.06			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							8.86	0.08			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.15	100.20	100.15		11	206 000	7.63	0.17		128	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.20	99.34	99.25	-0.03	4	10 202	7.94	0.73	173	157	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.90	99.95	99.90	-0.05	2	1 250	7.99	1.07	156	164	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	86.00	100.85					8.10	1.22	159	176	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.50	100.79	100.75	0.05	2	5 000	8.54	1.60	189	225	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	173	244	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	173	244	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	173	244	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	173	244	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14							7.84	1.17	136	150	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.76	171	214	7 000
АИЖК А9		15/02/17	99.00	99.87					8.10	1.85	136	183	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.25	99.85					8.24	1.91	149	198	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.50	99.60	99.50		1	3 000	8.16	2.31	130	191	6 000
АИЖК А8		15/06/18	97.95	99.23					8.43	2.78	147	219	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30	99.30	0.15	10	505	8.55	3.00	154	231	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.25	99.40	99.45		1	14	8.44	3.06	142	220	7 000
АИЖК А21		15/02/20			101.00		1	1	8.76	3.17	172	251	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	99.00	98.50	-0.60	1	1	8.88	3.82	174	262	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.15	97.99					9.12	4.95	183	278	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.00					9.07	5.56	172	266	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	130	209	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						8.98	1.06	256	263	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.20					8.98	1.06	256	263	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.61	1.64	294	332	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		99.99					9.77	1.64	310	348	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.80	100.20	100.10	0.10	2	4	8.06	0.32		168	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13		100.53	99.70	-0.40	1	860	8.44	0.78	219	207	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.60	99.85					8.08	1.01	168	172	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14		100.00					8.42	1.42	183	211	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.20	100.30	100.00	-0.48	1	1	8.13	0.64	199	176	10 000
МТС 1		17/10/13	99.50	100.19					7.51	0.96	114	115	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.00	99.26	99.24	-0.07	11	6 169	8.09	1.48	148	178	15 000
МТС 2		20/10/15	97.81	98.16	98.19	0.03	1	1	8.63	2.72	168	239	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.01	99.00	99.00	-0.15	5	17 741	8.71	2.67	177	247	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.55	99.00					8.73	3.28	167	248	15 000
МТС 7		07/11/17	98.61	99.20	99.20	-0.10	4	30	9.10	4.03	193	283	10 000
Вымпелком													

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	
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.90	100.97					7.97	0.71	177	160	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.68	98.39					8.60	1.60	195	231	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.60	100.15	100.15	0.34	1	1	8.97	2.21	213	272	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.65	99.75	99.75	-0.20	7	6 263	9.16	2.19	233	291	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.50	99.92	99.65	-0.10	1	2 065	9.21	2.19	238	296	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.75	97.99					9.27	2.68	233	303	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.92	98.35	97.75	-0.40	2	5 001	9.39	2.68	245	315	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	99.80	100.00	99.70	-0.05	2	19 991	8.39	1.85	165	212	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	99.50					7.44	0.64	130	107	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.75					7.88	0.53	184	150	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00	100.80					7.80	1.24	129	147	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.69	101.69	0.81	1	20 000	7.64	1.24	113	131	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.00	100.12	100.12	0.04	2	501	9.13	2.27	228	288	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.90	97.20					9.60	3.12	257	336	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.02	97.00					9.60	3.12	257	336	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.90	97.25	96.90	-0.10	1	10	9.64	3.12	261	340	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.75	99.90					7.88	0.35		150	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.50	100.12					8.34	0.86	203	197	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50	100.12					8.34	0.86	203	197	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.50	100.20					8.24	0.86	193	187	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	100.05	100.10	100.05	-0.07	1	50	8.34	0.86	203	197	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.20	100.00					8.15	1.29	162	182	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.00						8.43	1.44	183	212	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.25	100.45					9.01	2.61	208	277	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.10	98.40	98.95	0.95	1	100	8.63	1.50	201	233	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.00	98.60	98.60	-0.05	1	1	9.05	1.57	240	275	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.10	100.25	100.20	-0.05	1	5 000	9.64	2.62	271	340	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	98.53	99.00					8.98	0.73	276	261	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.54	100.15	100.11		2	20	9.17	0.90	283	281	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.00	99.50	99.50		2	15	11.19	0.55	514	481	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.17		99.15	-0.05	5	3 002	9.33	0.98	295	297	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.10	101.00					9.71	0.92	336	335	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	100.01						11.13	1.95	436	487	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.61	100.00					12.82	0.64	668	645	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.50	94.14					11.80	2.29	494	555	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	96.00	96.49					11.62	1.64	495	533	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	82.00	100.50					9.99	1.74	329	371	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.81	95.99	99.96	4.76	1	100	6.63	1.20	13	29	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.05	100.15	100.05	0.05	1	39	8.70	0.15		236	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	97.00	98.90	98.90	0.10	1	6 183	9.74	1.22	324	340	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.05	101.60					10.75	2.61	382	451	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.29	100.20	100.03		3	4 380	9.07	0.14		274	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.25	99.74					9.72	0.82	344	335	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.11	99.20					11.58	0.97	521	522	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13							9.76	1.77	305	348	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	86.00	100.00					8.30	0.16		196	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14		100.20					9.20	0.50		282	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	98.01	103.00	99.28	-0.03	5	86 104	10.01	0.50		363	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.15	0.88	183	179	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.81	100.45					9.45	0.50		307	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.21	102.49	102.53	0.03	3	9	8.99	0.70	280	262	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	
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.21	100.70					11.01	2.07	421	476	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.05	100.20					7.41	0.45		103	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.20					7.77	0.45		139	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.60	100.75	100.63	-0.17	2	11 000	7.69	0.34		131	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.55	1.69	186	227	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.90					9.76	1.44	316	345	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.27	100.80					9.86	2.13	304	361	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.25	100.90					9.91	2.13	309	366	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.90	100.00	99.90	0.01	4	1 010	12.98	0.83	669	661	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.95	100.02	100.03	0.13	19	4 939	12.86	0.97	649	650	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.56	101.48					9.87	0.41		349	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.56	101.60					11.51	0.41		513	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15							10.93	0.51	492	455	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	98.02	100.00	100.00	0.15	1	1	10.38	0.51	437	400	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.40	0.59	230	202	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							9.63	1.05	321	328	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13		102.00					6.98	1.10	54	63	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	94.65	98.94					11.80	1.34	525	548	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	94.00	99.49					10.33	1.34	377	401	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.73	3.13	170	249	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	99.00	99.20					8.40	3.12	137	216	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	99.00	99.39	99.39	0.24	1	1	8.37	3.12	134	213	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	97.50						7.76	0.33		138	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.26	100.35	100.30	-0.05	1	10 000	7.67	0.12		135	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.05	100.35					8.91	2.61	198	267	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60					8.59	2.30	173	234	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.40	100.60	100.60	0.15	2	2	7.65	0.63	152	128	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	96.00	98.45	100.00	1.50	1	2 000	7.22	1.57	58	92	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	99.75					10.65	1.55	401	435	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21							15.26	2.91	827	902	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.80	99.95	99.95		1	15 000	9.17	2.67	223	293	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.00	96.99					10.72	1.72	402	444	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.65	0.17		130	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.10	99.39					8.77	0.67	260	240	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	90.00	99.00					8.55	1.32	200	223	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	97.61	98.64					10.04	0.78	379	367	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	84.16	84.59	84.60	0.09	16	195	31.90	0.87	2558	2 553	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.30	98.80	98.40	0.04	2	270	10.81	0.94	445	445	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	105.86						9.95	0.99	356	359	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	86.00						7.51	1.40	93	119	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.15					8.34	0.84	205	197	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							9.03	1.36	247	271	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.61	99.45					10.83	0.83	454	446	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	99.50	100.99					9.02	2.38	214	277	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	98.00	100.00					9.21	2.68	227	297	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	98.82	103.69					4.27	0.88			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.55	101.90					8.27	1.01	188	191	4 000

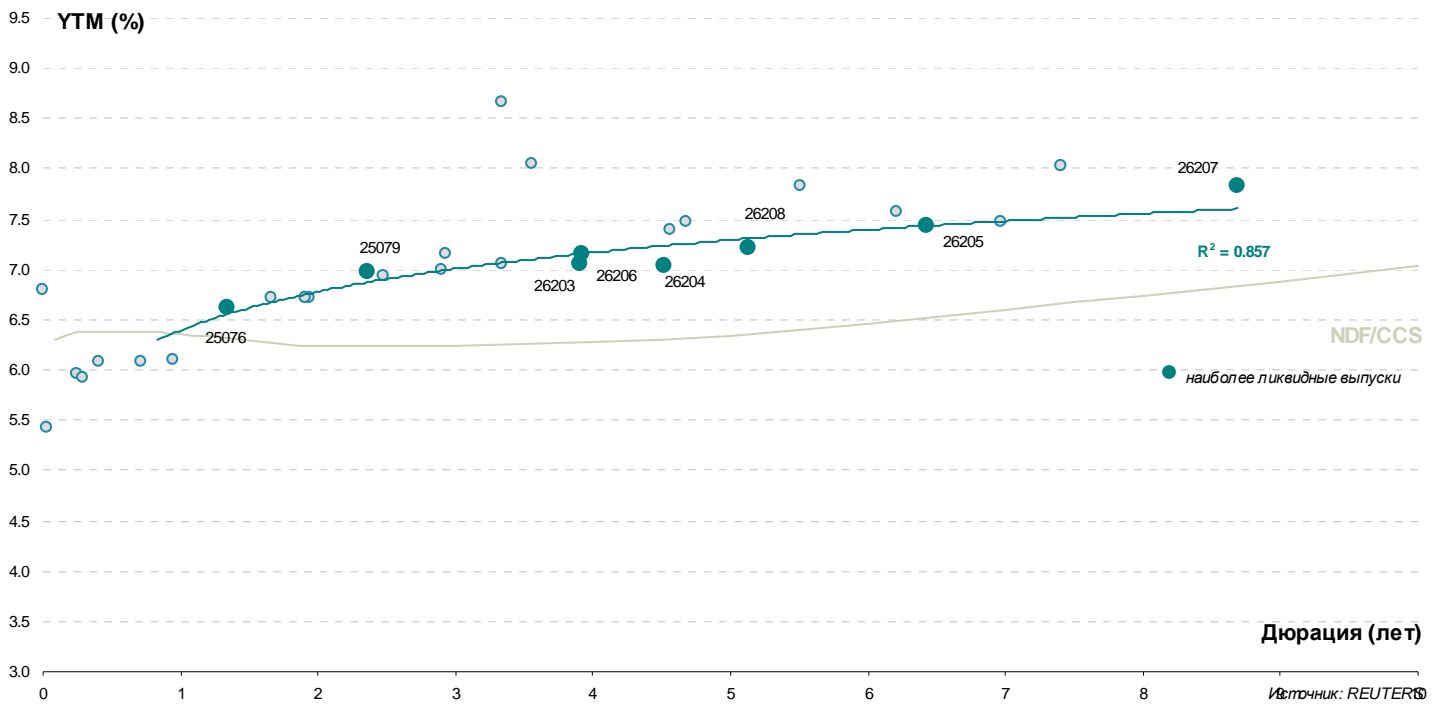
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.81	100.30					9.32	1.51	270	302	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	100.30					9.32	1.51	270	302	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.06	100.45	100.06	-0.44	6	203	9.96	2.64	302	372	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.48	99.21					10.15	1.40	357	383	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
Группа ЛСР 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.40					8.36	0.27		198	5 000
ЛСР Групп БО-1	26/06/12	25/06/13	100.40	100.95	100.45	0.15	9	16 000	9.98	0.64	384	361	2 000
ЛСР Групп БО-2		10/09/13	100.15	100.30					9.82	0.85	352	345	2 000
ЛСР Групп 3	14/03/14	08/09/17	100.00	100.90					11.39	1.31	485	506	3 000
ЛСР Групп БО-3		20/03/14	98.10	98.30	98.26	-0.39	14	26 817	11.15	1.33	460	483	2 000
ЛСР Групп БО-5		24/07/14	95.70	96.05					11.47	1.63	481	518	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.86	99.99	99.99	0.11	2	1 000	11.20	0.15		486	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	99.90	100.15	100.10	0.15	3	10 866	14.13	1.38	756	781	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.75	100.99					8.35	0.12		203	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07		101.85	-0.15	1	50 000	9.34	0.34		296	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.50					9.29	4.12	210	301	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.25					9.38	4.12	220	310	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	99.50					9.33	4.12	214	305	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.40	100.50	100.45	-0.05	1	486	7.79	0.10		148	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.70	100.74	100.74	-0.01	10	16 772	7.77	0.37		139	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	103.00						8.32	1.68	164	204	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.60	99.65	98.82	-0.04	6	652	8.45	1.92	169	219	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.78	99.10	99.06	0.29	6	740	12.18	0.71	598	581	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.10	100.30	100.10	-0.05	2	11	12.13	0.62	600	575	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.99	100.25					12.01	0.93	566	565	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	90.00	100.39					8.35	0.54	231	197	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.35	100.48					8.28	0.65	213	191	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	86.00	100.10					8.13	0.68	195	176	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	95.00	98.47	98.39	-0.12	5	575	8.73	0.99	235	237	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.30	100.35	100.35	-0.15	1	10 000	9.29	1.76	258	301	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	96.25	98.00	96.05	-0.66	2	120 000	9.80	1.86	306	353	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	100.90	101.00	101.00		2	5 001	7.68	0.60	158	130	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.05	100.09	100.05	-0.05	1	301	8.56	0.91	222	220	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.50	99.80					8.68	1.22	217	234	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.95	100.00	99.95		3	15 681	8.81	1.29	228	248	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.46	100.50	100.41	-0.02	1	15	8.45	0.10		214	5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.10	100.20	100.17	0.01	5	539	8.32	0.15		199	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.05	100.25	100.21	0.11	5	5 154	8.90	0.70	271	253	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.11	1.35	255	279	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.70	99.80	99.77	-0.10	5	38 200	8.67	0.48		229	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	100.00	100.05	100.05	0.05	1	2 500	8.82	0.62	270	244	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.25	100.12	-0.18	5	105 100	9.16	0.77	291	279	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.40	99.80	99.80	-0.15	1	500	8.92	0.82	264	255	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.95	101.00	100.08	0.03	1	20 000	9.22	1.27	269	289	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	100.00	100.05	100.00	-0.25	1	2 000	9.71	1.56	307	341	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.04	100.10					7.55	0.06			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.90	99.97	99.91	-0.05	10	5 904	8.32	0.09		201	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.15	100.25	100.15	-0.10	2	44 847	8.46	0.29		208	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.15	100.22	100.25		5	80 000	8.16	0.31		178	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13	99.50	99.75					8.82	0.45		244	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.30	100.50					8.28	0.59	218	190	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.39	100.46	100.42	-0.08	8	55 000	8.71	0.67	255	234	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.26	100.36	100.33	0.04	4	8 284	8.95	0.82	267	258	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.63	0.89	130	127	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.10	100.28	100.25	-0.05	2	40 000	9.21	1.40	263	289	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк ВО2	20/02/13	18/02/15	100.00	100.09	100.00	-0.05	23	69 951	8.87	0.33		249	5 000
Промсвязьбанк ВО4	20/02/13	18/02/15	99.90	100.25					8.61	0.33		223	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.60	99.64	99.64	-0.11	3	2 900	9.00	0.63	287	263	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	
Промсвязьбанк ВО3		04/02/14	95.00	99.44	98.98	-0.42	2	306	9.67	1.22	317	333	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	99.01	100.50					10.20	1.73	350	392	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	99.76	101.65	99.75	-0.26	2	2	12.68	3.95	552	641	5 000
Банк СПб													
Банк СПб ВО1	09/10/12	09/04/13	85.00						8.26	0.04			5 000
Банк СПб ВО4	13/12/12	12/12/13	100.07	100.10	100.07	0.07	12	276 801	8.01	0.14		168	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.75	100.40	99.99	-0.01	1	1	9.20	0.89	287	284	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.28	100.42	100.00	-0.34	2	3	9.72	0.93	337	336	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.40					8.29	0.23		192	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.90	99.99	99.90	0.02	20	162 775	8.94	0.33		256	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15							9.52	0.48		314	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.70	99.94	99.82	-0.13	3	10 050	10.19	0.90	386	383	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	86.00	100.10					9.98	0.94	362	362	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.81	100.00	100.00	-0.06	6	30 141	10.51	1.40	393	419	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.15	98.25	98.15	-0.10	1	1	10.69	1.53	406	439	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.70	100.73	100.74	-0.03	7	60 200	7.78	0.15		144	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	101.25					8.88	0.84	259	251	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15		101.00					8.06	0.81	179	169	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	86.00	100.56	100.05	-0.25	1	1	9.87	1.27	335	354	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.75	100.05					9.01	0.87	270	264	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.95	100.10					9.87	1.28	334	354	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.17					9.47	0.49		309	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.07	100.20					9.65	0.69	346	328	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	98.98	98.85		1	95	10.17	0.90	384	381	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.95	101.00					11.03	1.06	461	468	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					12.00	1.07	557	565	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.31	100.60					11.03	1.27	451	470	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.50	101.55	101.52		1	14 500	11.16	1.99	438	491	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.82	101.30					11.68	2.03	489	543	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.21	98.46	98.50	0.19	1	15	12.27	0.76	603	590	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.30	100.48	100.30	-0.15	3	2 459	12.81	0.76	657	644	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.15	100.28	100.24	-0.06	9	1 145	14.22	1.22	771	788	2 000
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.24	100.25	100.24	-0.01	5	11 255	13.11	0.48		673	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	100.30	100.45	100.45	0.38	4	695	13.58	0.69	739	721	2 000
ТКС БАНК 2		28/07/13	104.37	104.70	104.74	0.15	5	2 747	13.55	0.72	735	718	1 000
ТКС БАНК ВО1		20/09/13	99.91	103.99					14.68	0.87	836	831	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.27	102.39	102.45	0.14	9	3 280	14.45	0.98	807	809	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.90	99.95	99.95	0.19	18	3 059	14.74	0.76	850	837	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.04	100.13	100.05		1	500	9.61	0.05			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22							8.89	0.98	251	253	00000 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.23	100.40	100.40	0.17	1	5	9.36	1.73	266	308	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16							7.64	0.96	127	128	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.80	100.89					8.02	1.21	152	168	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	99.51	101.50	99.70	0.20	10	54 401	8.09	1.25	157	176	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.52	2.12	171	227	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	99.99	99.95	0.11	3	5 000	7.95	0.05			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.11	100.26	100.27	-0.62	1	1	8.31	0.83	202	194	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	94.10	100.25	99.50	-0.80	2	2	9.30	0.84	300	293	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.20	99.60	99.60	0.20	1	20 000	8.13	0.84	184	176	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14			100.40		2	2	8.79	1.07	236	244	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.01	3.39	193	276	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.95	100.96	100.95	0.15	1	2 000	7.98	1.05	156	163	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.60	99.80					7.93	1.04	152	157	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		210	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.12	100.15	100.12		5	13 363	8.16	0.04			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.15	100.35	100.20	-0.15	8	10 160	8.65	0.42		227	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.45	100.53					9.13	0.96	276	277	5 000
Вост-Экспресс													

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	
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.55	0.48		117	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.32	100.55	100.56	-0.02	1	1	10.66	0.77	441	429	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	100.00					10.25	0.96	388	389	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.40	100.45	100.40	0.19	2	1 200	11.17	1.35	461	485	2 000
ЖКФ Банк													
ЖКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	100.00	100.05	100.04	0.04	2	20 000	7.61	0.13		128	5 000
ЖКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13		100.20					8.20	0.47		182	4 000
ЖКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							7.03	0.97	66	67	4 000
ЖКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15							10.10	2.19	327	385	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.05	99.82	0.27	1	1	7.98	1.37	141	166	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90	99.20					8.87	0.68	270	250	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00					8.98	0.85	268	261	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.10	101.00					9.28	0.87	296	291	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.50					9.22	0.88	290	286	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.20	101.00					9.27	0.99	288	291	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00		98.85		1	1	9.26	1.00	287	290	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.40	100.49					8.74	0.76	250	237	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.20	97.90	97.30		2	20 000	9.19	1.55	255	289	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	100.06	100.08	100.06		3	7 001	7.70	0.02			4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.15	100.37	100.25	0.05	4	7 700	10.54	1.28	401	421	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.20	97.40	97.36		6	512	10.56	1.36	400	424	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.96	96.10	96.15	0.18	1	516	10.65	1.65	398	436	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.10	100.50					8.98	0.12		266	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60	100.10					9.60	0.57	352	322	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	98.75	99.17					10.59	0.69	441	422	2 000
СКБ-Банк БО-5	11/10/12	10/04/14	99.90	100.29	100.04	-0.06	1	1	-28.82	1.39			2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.00	100.08					9.98	0.93	363	362	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	99.86						9.83	1.25	331	350	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.00	100.15					10.14	1.23	363	381	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14							9.81	1.39	323	349	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.80	99.90					9.19	0.94	283	283	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					8.10	0.15		176	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.15					7.19	0.15		85	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15		100.38					9.14	0.48		276	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.55	100.65					9.47	0.64	333	310	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						6.88	0.16		54	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	100.00	100.34					10.02	0.50		364	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	283	347	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	91.00	100.40					10.77	0.96	440	441	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	90.00	100.00	100.00	-0.20	1	1	11.22	0.36		484	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.56	100.00	98.60	0.08	4	5	12.98	0.93	663	662	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30						10.00	0.28		362	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	99.80	100.35					10.08	0.47		370	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	100.40	100.49					11.53	0.93	518	517	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.13	100.22					8.98	0.15		264	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.21	99.50					10.29	1.65	362	400	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.20	100.19	0.19	1	5	9.52	0.46		314	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	86.01	100.00	100.00	0.01	4	8 117	9.99	0.50		361	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.52	100.06	100.05	0.01	3	1 902	11.22	0.89	489	486	2 000
СМП 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	
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.15	100.20	100.20	0.05	1	3	8.05	0.09		174	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	100.00	100.50					12.05	0.85	575	568	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.18	100.25	100.17	-0.03	1	1	9.31	0.29		293	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	100.00	100.14					10.32	0.73	411	395	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.35	100.44	100.35	-0.05	4	3 058	10.51	0.78	426	414	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.77	0.56	370	339	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.40	99.70	99.40	-0.15	1	4 179	9.59	0.68	341	322	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.10		100.05	-0.15	1	1	10.44	0.94	408	408	2 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.50	99.69	99.50	-0.20	3	2 503	9.77	0.95	341	341	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.95	100.20	100.20	0.20	4	210 001	9.65	0.96	328	329	5 000
УБРиР													
УБРР 2	29/10/12	01/05/14							9.49	0.01			2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.15	100.20	100.15	-0.09	5	1 235	12.68	0.91	634	632	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.62	99.95					11.51	0.16		517	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.25	100.36					12.24	0.78	599	587	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.09	100.11	100.11	-0.02	5	12 870	11.12	0.10		481	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.90		99.95		2	5 000	10.45	0.14		412	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.01	100.00	100.00	0.02	14	72 715	11.50	0.32		512	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.70	100.08	100.07	0.07	1	1	10.25	0.34		387	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.71	99.75	99.75	-0.05	5	21 470	11.92	0.46		554	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.03	100.14	100.05	-0.15	4	12 602	13.39	0.95	703	703	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.50	99.00	99.00		5	1 015	12.02	1.10	558	567	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	97.00	99.96					12.66	1.39	608	634	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		104.00	105.47	105.46	-0.04	2	61 926	5.92	0.58			30 000
Москва 53	01/09/13			100.35	99.40	-0.90	3	3	7.87	0.84	158	150	15 000
Москва 63	10/12/13		109.25	110.00					6.68	1.05	26	33	15 000
Москва 62	08/06/14		108.00	108.65	108.00	-0.65	3	30	7.32	1.48	71	101	35 000
Москва 39	21/07/14		97.46	100.00					7.31	1.64	64	102	10 000
Москва 64	24/06/15		98.20	99.10	99.01	0.77	7	50 000	7.55	2.42	66	130	20 000
Москва 44	16/11/15		110.00						7.40	2.53	49	116	40 000
Москва 56	22/09/16		96.70	97.90					8.20	3.47	111	195	20 000
Москва 49	14/06/17		96.91	97.35	97.39	0.09	2	5 013	7.82	3.93	66	155	25 000
Москва 48	11/06/22		91.00	91.12	90.70	-0.50	11	114	8.13	6.88	66	155	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		99.01	101.10					7.88	0.61	177	150	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.35	99.75	99.75	-0.03	5	6 107	8.35	1.42	176	204	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	02/12/12		100.40	100.54	100.50	-0.12	1	255	7.89	0.11		157	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12		99.52	102.05	99.95	-0.10	1	158	8.57	0.07			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.83	100.18	100.20		2	13	8.23	1.81	151	196	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.96	103.08	103.00		1	10 000	8.63	2.19	180	238	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		103.65	104.15					8.19	0.52	217	181	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.70	102.00					7.98	1.10	154	163	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.90	98.25	98.25	0.12	6	16 984	8.61	2.07	181	236	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.76	100.35					8.17	0.46		179	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.35	101.66	101.45	-0.25	1	1	7.65	0.64	151	128	2 000
Якутия 7	17/04/14		100.00	100.40					8.03	1.33	148	171	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12		86.00	99.87						0.14			2 000
Краснодар 02	05/11/15		100.30	100.85					8.51	1.14	205	217	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		100.00	100.50					7.77	1.36	121	145	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4	08/11/12		100.08	100.13	100.10	-0.06	12	100 165	8.09	0.04			10 000
Красноярский край 5	29/11/16		101.49	101.70	101.70	-0.10	2	11 250	8.11	1.49	150	180	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		85.01	100.55					8.14	0.55	208	176	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.00	100.00					9.62	1.42	303	331	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		86.02	96.00					8.51	2.30	165	226	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								8.99	2.33	212	274	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.50						8.99	2.47	209	274	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12		100.15	100.20	100.20	-0.05	2	7 721	7.90	0.16		156	3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.80	101.00	100.80	-0.10	3	1 016	9.37	1.84	264	310	4 000

ОФЗ



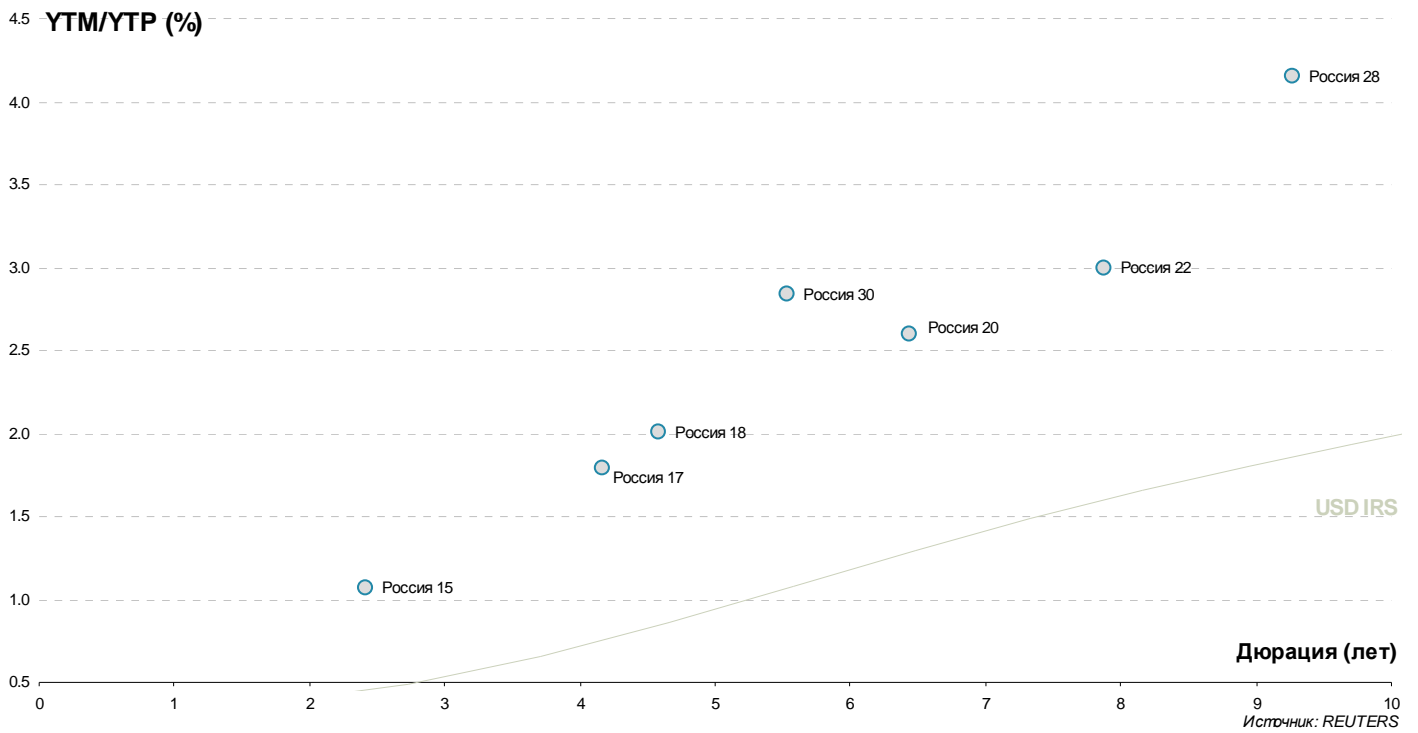
Результаты торгов евробондами

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа		
РОССИЯ									
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		106.130	106.450	1.13	1.01	2.42	71
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.958	106.417	1.84	1.74	4.16	0.81
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.289	149.711	2.18	1.83	4.58	-0.01
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.890	127.148	2.85	2.82	5.54	0.09
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.130	116.400	2.62	2.58	6.45	
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.112	112.400	3.02	2.98	7.88	0.86
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.650	198.850	4.18	4.12	9.27	-0.20
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		119.700	120.300	4.42	4.39	15.90	1.08
ГОСКOMPАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.389	101.514	1.58	1.33	0.48	-0.02
GAZPR'13 5.625%	USD	22/07/13		101.790	102.085	1.81	1.20	0.47	-0.28
GAZPR'13 9.625%	USD	01/03/13		102.742	102.852	1.47	1.16	0.34	-0.06
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.638	102.781	1.44	1.13	0.45	-0.05
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.601	105.101	1.34	0.70	0.74	
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.955	111.705	2.54	2.03	1.32	-0.14
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		111.000	111.750	2.25	1.73	1.27	-0.15
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.659	110.659	2.45	1.91	1.65	-0.03
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.331	107.814	2.60	2.45	2.85	0.02
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.950	112.410	3.06	2.95	3.60	0.02
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.497	123.492	3.57	3.39	4.60	-0.03
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.877	131.373	3.83	3.75	5.22	-0.06
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.313	117.810	4.25	4.19	7.29	-0.50
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		143.747	144.808	5.22	5.15	11.93	-1.03
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.849	129.360	5.20	5.17	13.14	-0.67
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.556	106.556	1.73	-0.75	0.75	-0.05
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.433	105.896	1.59	1.25	1.31	-0.37
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		128.642	129.017	3.22	3.16	4.74	-0.58
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.828	112.305	2.87	2.77	3.99	0.33
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.768	101.768	5.20	4.97	4.45	-0.52
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		99.900	99.925	20.65	16.28	0.01	2 331
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.470	106.958	3.56	3.36	2.20	-0.23
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.256	106.256	5.17	4.96	4.57	-0.24
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		107.978	108.476	5.21	5.11	4.65	-0.11
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.436	105.932	5.69	5.62	6.36	-0.07
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.294	106.788	5.75	5.71	12.50	-0.25
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.628	102.878	2.40	1.94	0.52	211
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.948	107.948	3.61	3.18	2.22	323
BOM CAPITAL'15 6.699%	USD	11/03/15		99.014	100.014	7.15	6.69	2.21	687
ВЭБ									
VEB'16 5.125%	USD	27/05/16		104.369	105.369	3.81	3.51	3.26	327
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.579	110.078	3.38	3.27	4.43	-0.06
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.546	119.039	4.07	4.00	6.14	-0.20
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.844	119.334	4.84	4.79	9.02	-0.03
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.900	104.300	1.98	1.40	0.65	170
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		105.803	106.100	3.40	3.26	1.99	-0.10
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.413	107.807	3.78	3.64	2.68	-0.34
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.810	102.996	1.98	1.65	0.53	-0.12
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.751	105.876	2.27	2.17	1.16	-0.04
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.856	110.981	2.13	2.06	1.50	0.16
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.939	111.437	3.66	3.55	3.95	-0.19
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		119.456	119.952	3.84	3.76	4.61	-0.04
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		104.524	105.149	4.62	4.43	3.22	0.01
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		102.587	102.875	1.68	1.17	0.53	-0.11
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.097	103.395	1.83	1.39	0.66	-0.04
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.612	107.998	2.55	2.41	2.50	0.01
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.688	108.182	3.50	3.38	3.98	-0.16
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.769	109.394	4.48	4.40	6.88	-0.20

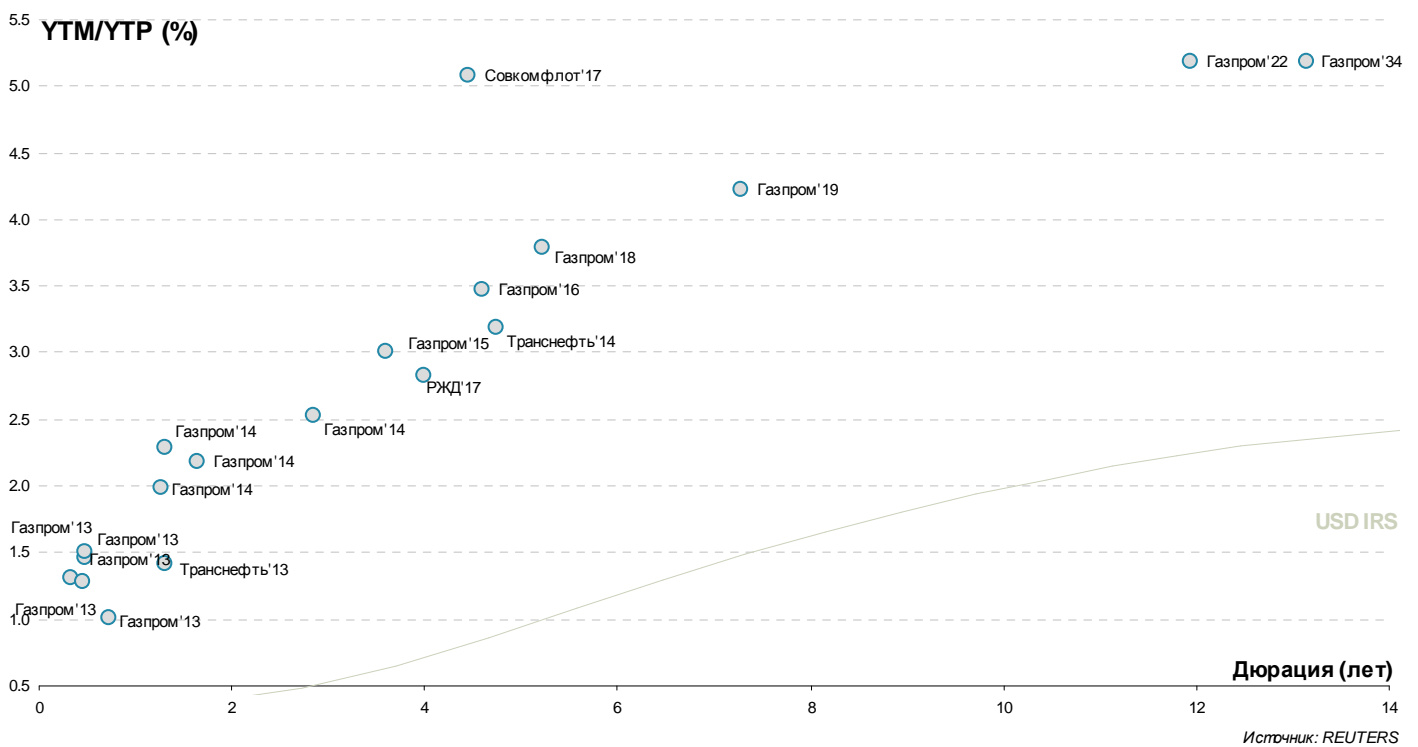
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ**Евраз**

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		103.350	103.650	1.92	1.32	0.49	0.45	164
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		108.918	109.402	5.04	4.87	2.66	0.02	461
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		113.365	114.359	6.56	6.36	4.47	-0.26	576
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.666	101.666	6.60	6.39	4.69	-1.01	578
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		107.100	107.500	6.58	6.40	2.15	-0.40	628
Алроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.775	111.275	3.39	3.15	1.86	0.03	303
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.539	115.288	5.48	5.38	6.06	-0.08	417
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.650	103.100	3.02	2.14	0.48		274
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.250	106.250	4.41	4.41	2.96	-0.43	391
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.555	112.060	4.69	4.55	3.09	0.36	418
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.447	117.958	5.42	5.32	4.37	0.45	457
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.250	110.250	6.29	6.14	6.25	-0.63	496
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.737	108.931	1.94	1.84	1.88	-0.02	156
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		114.068	114.466	3.06	2.97	4.02	-0.24	233
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.890	121.398	3.83	3.75	5.61	-0.42	264
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.685	114.186	4.11	4.04	6.41	0.20	273
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.824	121.587	4.02	3.94	7.34		242
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		123.041	123.544	4.97	4.90	5.83	0.04	371
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		107.400	107.900	2.93	2.77	3.01	-0.10	242
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		118.669	119.294	3.93	3.85	6.58	0.82	252
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		105.697	106.317	2.05	1.26	0.73	-0.36	176
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.600	110.100	2.56	2.24	1.41	-0.15	224
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.602	107.100	5.18	5.07	4.35	-0.45	442
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.763	103.763	7.11	6.88	4.34	-0.04	636
ТНК										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.461	105.461	0.86	-6.74		-0.04	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		108.162	109.068	2.51	2.12	2.12		212
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		114.688	115.688	3.27	3.01	3.29	-0.25	270
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.309	115.309	3.11	2.89	3.90		243
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		120.105	120.480	3.71	3.64	4.54	-1.71	285
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.891	122.951	3.77	3.62	5.85	-0.08	254
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.350	104.600	2.48	2.11	0.63	-0.15	220
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.729	109.708	4.12	3.71	2.21	-0.01	375
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.769	110.769	5.57	5.35	4.18	0.24	483
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		100.750	100.875	3.48	2.58	0.13	-0.15	326
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		101.786	102.036	4.61	4.35	0.96	0.09	435
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		105.505	106.505	6.68	6.32	2.69	-0.25	631
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.830	105.080	3.78	3.44	0.69	0.03	352
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14		100.964	101.464	5.52	5.17	1.44		525
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		111.488	112.488	7.74	7.34	2.19	-0.01	745
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	09/07/16		107.763	109.763	8.74	8.13	3.05		834
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.147	103.647	4.63	4.26	1.34	0.21	434

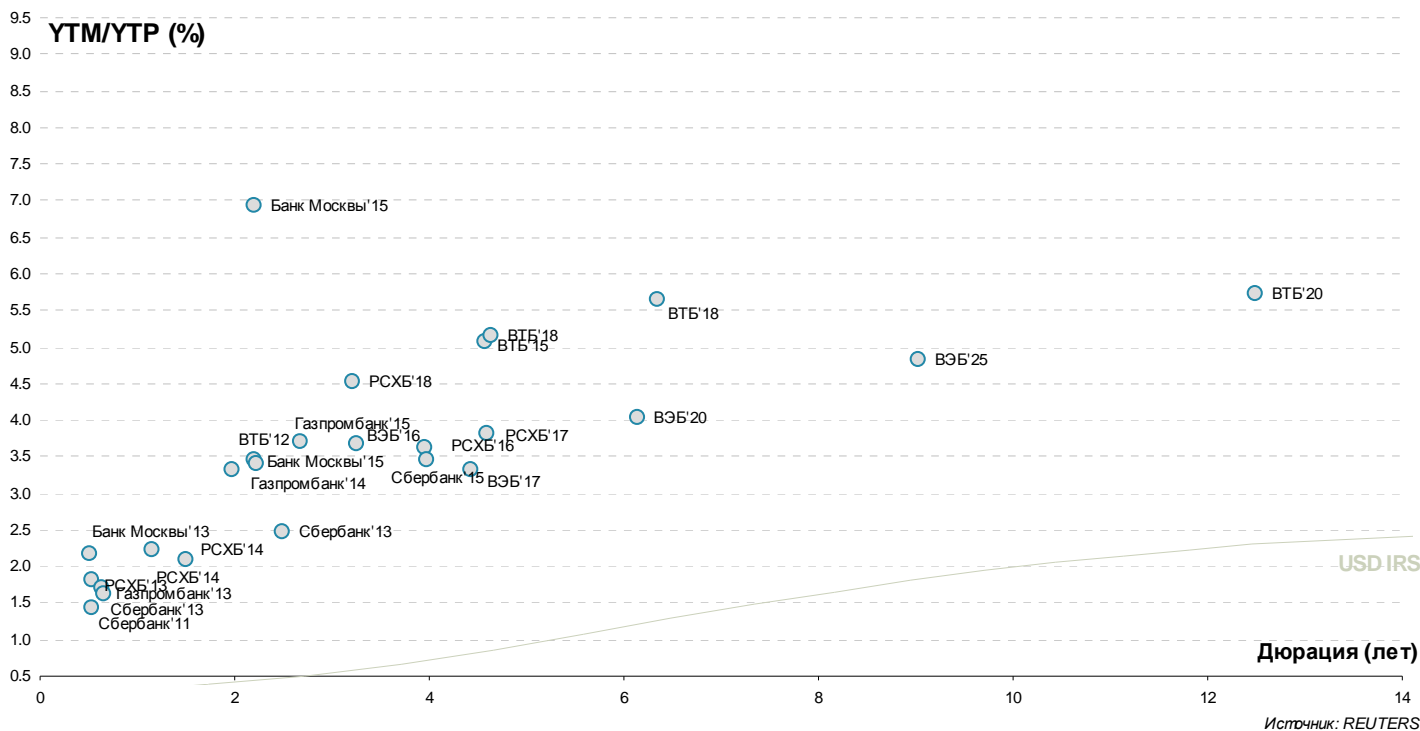
Россия



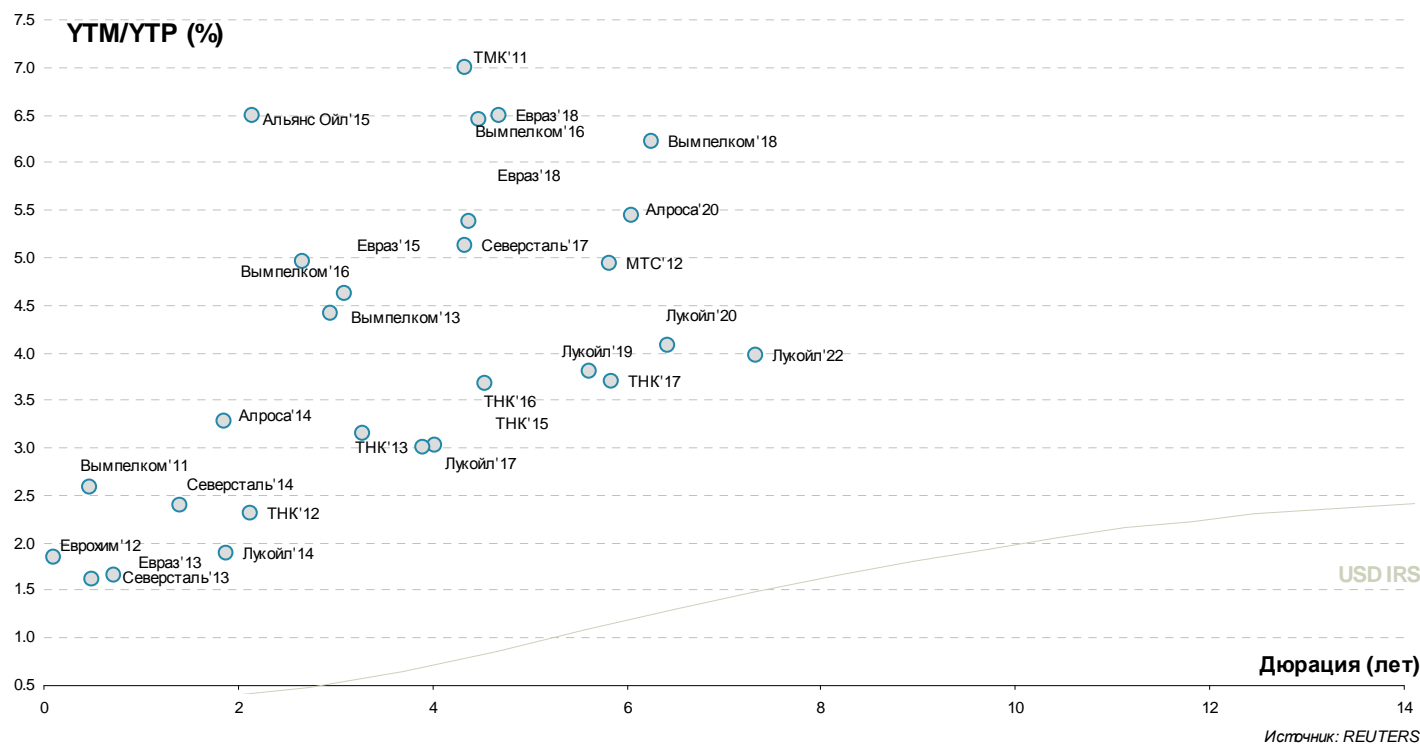
Госкомпании



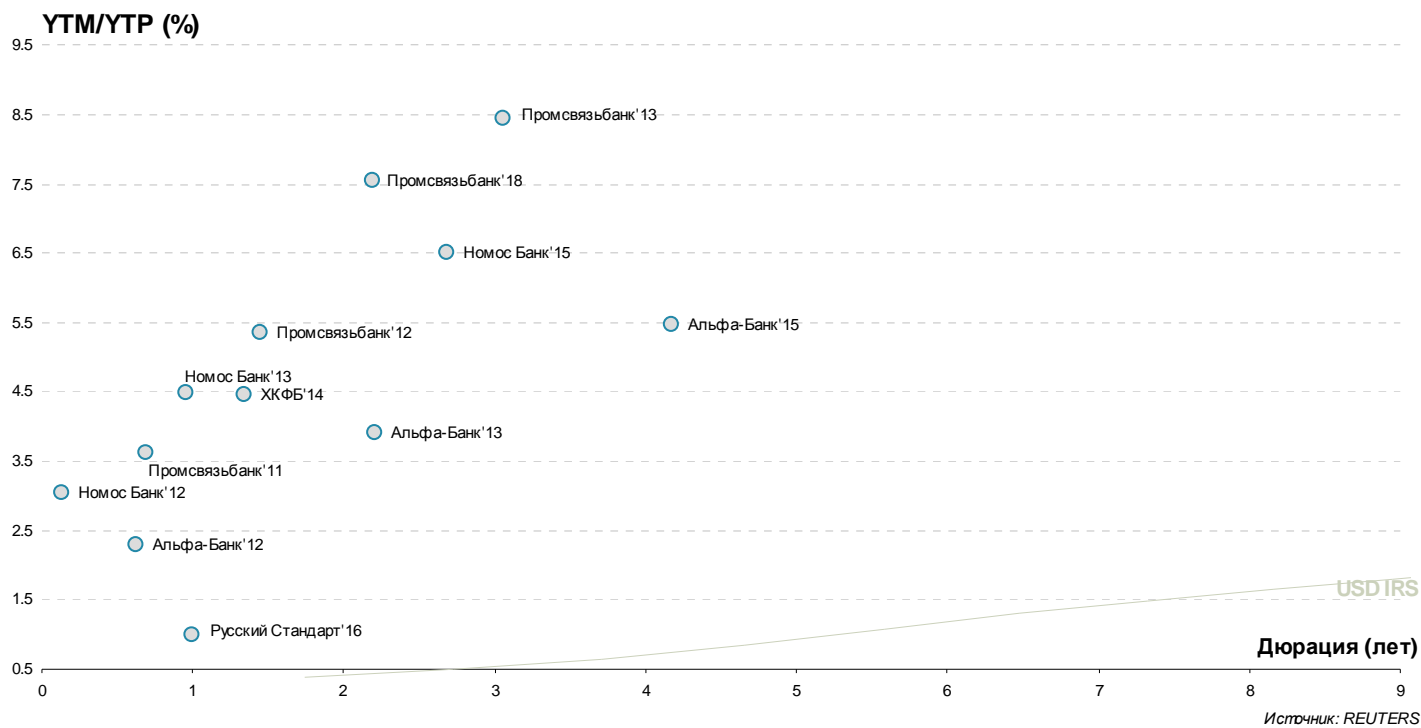
Госбанки



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](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.