

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Заказы товаров длительного пользования США разочаровали

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Уплата НДС подняла ставки к локальным максимумам
- Рубль не смог удержать внутрисдневное преимущество

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды сохраняют слабую динамику
- Локальный рынок отыгрывает потери

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

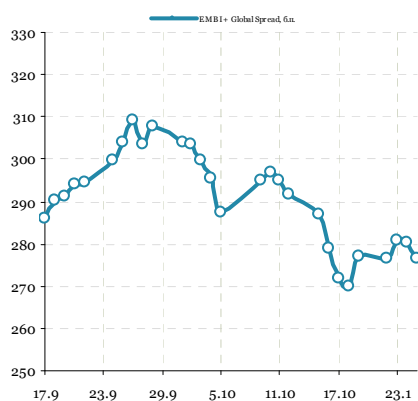
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.82 ▲	0.03	1.39	1.94
UST 10-2Y sprd	151 ▲	1	117	168
EMBI+ Glob.	277 ▼	-4	270	441
EMBI+ Rus sprd	151 ▼	-2	141	332
Russia 30 yield	2.89 ▲	0.01	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 ■	0.00	6.01	6.89
Корсчета в ЦБ	657.1 ▼	-159.8	446	1032
Депоз. в ЦБ	100.6 ▲	12.4	61	238
NDF RU 3m	6.4 ▲	0.0	6	7
Валютный рынок				
USD/RUB	31.335 ▼	-0.098	29.31	33.67
EUR/RUB	40.64 ▼	-0.050	38.72	41.81
EUR/USD	1.293 ▼	-0.004	1.21	1.33
Корзина ЦБ	35.557 ▼	-0.088	33.57	37.28
DXU Индекс	80.044 ▲	0.130	78.71	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1456.9 ▼	-1.3%	1228	1620
Dow Jones	13103.7 ▲	0.20%	12101	13610
DAX	7176.5 ▼	-0.33%	5969	7452
Nikkei 225	9055 ▼	-1.35%	8296	9667
Shanghai Comp.	2101.6 ▼	-1.68%	2004	2452
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	106.8 ▼	-0.60%	88	117
Нефть Brent	108.5 ▼	-0.49%	89	120
Золото	1712.1 ▼	-0.49%	1540	1790
CRB Index	297.7 ▲	0.02%	267	321

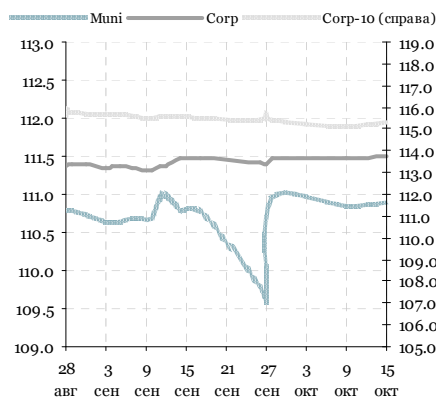
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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

ОАО «МОЭСК» установило ставку первого купона биржевых облигаций серии БО-02 на 5 млрд руб. в размере 8,8% годовых. /Интерфакс/

ОАО АКБ «Связь-банк» откроет с 29 по 30 октября книгу заявок на покупку биржевых облигаций серии БО-01 с однолетней офертой на выкуп объемом 5 млрд руб. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 25.10.2012 – четверг

Статистика США: Durable Goods Orders, Initial jobless claims, Continuing claims

- **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 ЕЭС, 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.)

Сегодня: 26.10.2012 – пятница

Статистика США: Personal consumption, GDP, U. of Michigan Confidence

- **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 ЕЭС, 07 (7.5%, 187 млн руб.), ФСК ЕЭС, 09 (7.99%, 199.2 млн руб.), ФСК ЕЭС, 11 (7.99%, 398.4 млн руб.), ФСК ЕЭС, 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.)

29.10.2012 – понедельник

Статистика США: Personal income, Personal spending, PCE Core

- **Выплата купона:** Московский Кредитный банк, БО-03 (9.25%, 185.5 млн руб.), Совкомфлот, 2017 (5.375%, 21.5 млн долл.), ЕБРР, 08 (0.01%, 0.7 млн руб.), КРЕДИТ ЕВРОПА БАНК, БО-01 (8.1%, 203 млн руб.), Евраз Груп, 2018-2 (6.75%, 28.6 млн руб.), КБ Кольцо Урала, 01 (11.5%, 57.6 млн руб.), Азиатско-Тихоокеанский Банк, 01 (10.25%, 77 млн руб.), Распадская, 2017 (LPN) (7.75%, 15.5 млн руб.), БИНБАНК, 02 (8.85%, 44.3 млн руб.), РусГидро, 2015, RUR (7.875%, 787.5 млн руб.), Альфа-Банк, 2021 (LPN) (7.75%, 38.7 млн долл.), Газпром, 2034 (LPN2) (8.625%, 51.7 млн долл.), ЕвразХолдинг Финанс, 02 (9.95%, 496.1 млн руб.), ЕвразХолдинг Финанс, 04 (9.95%, 248 млн руб.), Россия, 2015 (3.625%, 36.2 млн руб.), Россия, 2020 (5%, 87.5 млн руб.), УБРИР, 02 (9.5%, 95.2 млн руб.)
- **Оферта:** ТрансФин-М, БО-11 (3 млрд руб.)
- **Размещение:** ТрансФин-М, БО-11 (2 млрд руб.), Московская объединенная электросетевая компания (МОЭСК), БО-02 (5 млрд руб.), Роснефть, 04 (10 млрд руб.), Роснефть, 05 (10 млрд руб.)

Внешний рынок долга

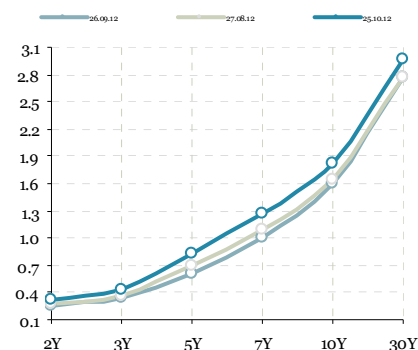
Заказы товаров длительного пользования США разочаровали

Одними из ключевых индикаторов текущей недели до публикации предварительной оценки ВВП США за III квартал являются данные по заказам на товары длительного срока использования за сентябрь, которые были опубликованы вчера. В широком определении заказы выросли на 9.9% после снижения на 13.1% в августе (прогноз – 7.5%). Несмотря на то, что цифра оказалась заметно сильнее прогноза, доверия к ней нет: ее во многом обеспечил традиционная волатильная компонента – заказы в гражданской авиации. В частности Boeing в сентябре получил заказы на 143 самолета против 1 в августе и 260 в июле. Без учета транспортных средств заказы выросли лишь на 2.0%, что во многом было обусловлено ухудшением августовской оценки с -1.6% до -2.1%. Негативным моментом является отсутствие роста заказов в группе капитальных товаров, при том, что в августе они подросли на 0.2%. Это все больше коррелирует с отчетами компаний за III квартал, большинство из которых снизили прогнозы продаж и спроса на текущий и следующий годы. Как итог, привлекательность осуществления капитальных инвестиций резко снижается.

С точки зрения ВВП это означает, что в III квартале экономика США в части инвестиций получила поддержку лишь со стороны жилищного сектора, тогда как вклад инвестиций реальных секторов экономики в темп роста ВВП снижается. Еще один тревожный сигнал – замедление темпов роста запасов товаров длительного пользования. В сентябре они прибавили лишь 0.3% после роста на 0.6% в августе и 0.9% в июле. Поскольку для оценки вклада запасов в прирост ВВП берется чистое их изменение за квартал, в июле-сентябре это фактор скорее сыграл в сторону замедления экономики. Таким образом, этот отчет бросает тень на сегодняшнюю оценку ВВП за минувший квартал, предполагающую ускорение темпов роста с 1.3% до 1.8%. Учитывая слабость капитальных инвестиций и запасов, реальная цифра по ВВП может оказаться ниже, особенно при последующих оценках.

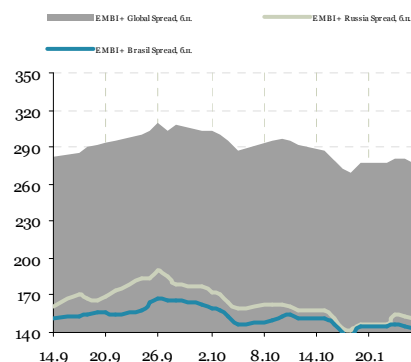
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



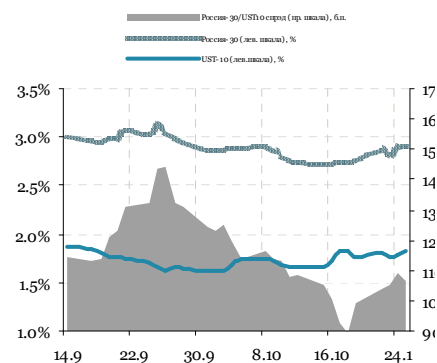
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВІ+ (Россия, Бразилия)



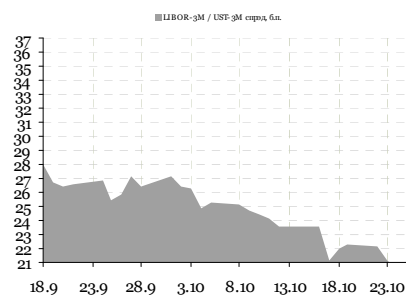
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Уплата НДС подняла ставки к локальным максимумам

Условия локального денежно-кредитного рынка вчера заметно ухудшились на фоне проведения платежей по НДС, которые потребовали из банковской системы порядка 220 млрд руб. Как итог, на рынке МБК ставки по кредитам overnight поднялись до 6.75% годовых (+50 бп), междилерское репо на ММБВ обходилось в среднем под 6.30% годовых, однако объем сделок здесь был заметно меньше обычного. На аукционах 1-дневного прямого репо с ЦБ РФ регулятор полностью удовлетворил спрос со стороны банков в размере 387 млрд руб. Сегодня утром сумма средств банков на корсчетах и депозитах в ЦБ РФ снизилась на 38.6 млрд руб., составив 719.1 млрд руб.

В начале следующей недели рынку предстоит выдержать испытание уплатной налога на прибыль, который потребует не менее 170 млрд руб. Учитывая сложную конъюнктуру рынка и 2-месячный максимум по задолженности банков по операциям репо перед Центробанком (более 1.6 трлн руб.), повышенный уровень краткосрочных процентных ставок сохранится в ближайшие дни.

Рубль не смог удержать внутридневное преимущество

Торги на валютном рынке вчера прошли нейтрально для рубля. Российская валюта в точности скопировала поведение нефтяных котировок: баррель Brent утром стоил чуть ниже 108 долл., за тем подорожал до 109 долл. и к вечеру опустился на уровни открытия. Рубль в этот период предпринял попытку укрепления к бивалютной корзине до отметки 35.41 руб., однако затем вернулся к уровню закрытия среды (35.54 руб.). Обострение ситуации на локальном денежно-кредитном рынке должно оказать рублю поддержку, однако ухудшение внешних условий заставит российскую валюту ослабевать.

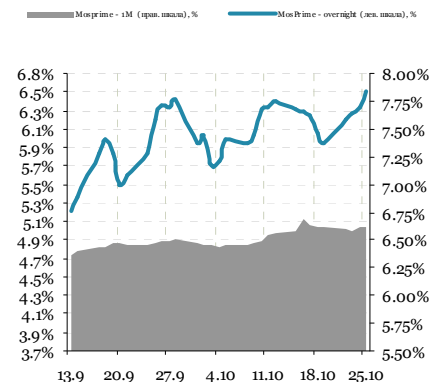
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	387
	Уплата налогов	НДПИ за сентябрь	
Пятница			

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

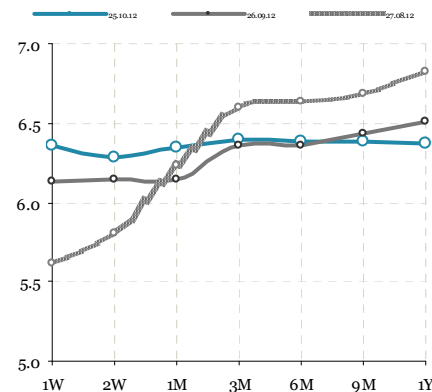
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды сохраняют слабую динамику

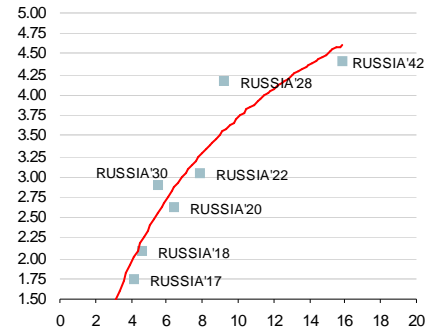
Российский сегмент в четверг дешевел в преддверии квартальных данных по ВВП США и слабого спроса на риск. Цены вдоль суверенной кривой потеряли по итогам дня порядка 40 бп, Россия'30 и Россия'42 опустились под отметки соответственно 127% и 120%, спрэды выпусков к кривой UST расширились на фоне повышенной волатильности американских бумаг. Корпоративный сектор торговался разнонаправлено, колебание котировок в обе стороны не превышало 25 бп; лучше рынка выглядел дальний суборд SBER'22, завершивший день ростом цен на 50 бп.

Локальный рынок отыгрывает потери

Локальный рынок вчера продолжил отыгрывать потери вторника. Котировки на кривой ОФЗ завершили день ростом, составившим в среднем по ликвидным выпускам более 25 бп. Доходности на дальнем участке кривой опустились в среднем на 5 бп и, таким образом, вернулись на отметки недельной давности. В корпоративном секторе активность находилась на невысоком уровне: за пределами короткой дюрации спрос был замечен в выпуске Магнит БО7 (+10 бп; УТМ 8.97%/D 2.6г. +207 бп к ОФЗ), более скромную динамику показали выпуски МРСК Центра БО1 (-15 бп; УТМ 9.23%/D 2.7г. +231 бп к ОФЗ) и дальний МТС 7 (-20 бп; УТМ 9.15%/D 4.0г. +201 бп к ОФЗ).

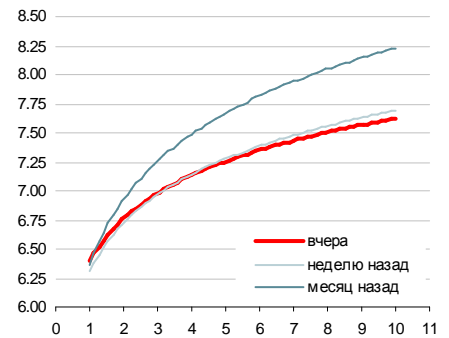
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



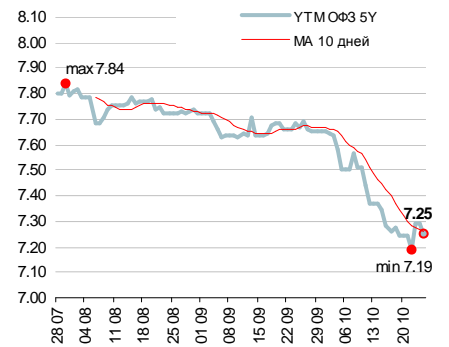
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



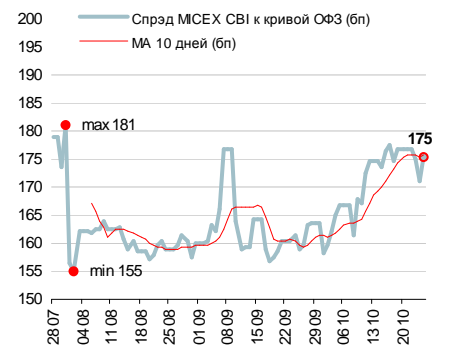
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ

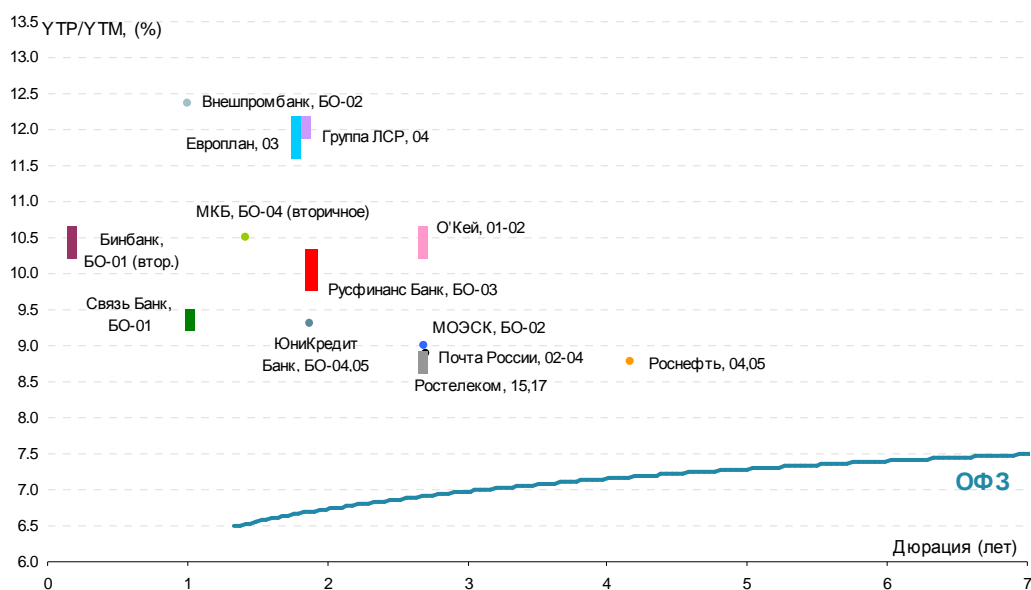


Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
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	B / B2 / -	да	3 000	12.36	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- / 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	25.10.2012	29.10.2012	нет / 2.69 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)	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.
МКБ, БО-04 (вторичное)	B+ / B1 / 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	- / - / B+	да	2 000	10.25-10.62	08.11.2012	13.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
О'Кей, 02	- / - / B+	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	100.00	-0.02	7	48 613	6.08	0.02			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.29	100.33	100.29	-0.01	40	489 189	5.98	0.25			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.18	100.23	100.18	-0.05	22	525 800	6.10	0.28			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.44	103.00	102.55	0.05	9	48 680	5.92	0.41			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.05	100.40					6.09	0.72			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13		100.55					6.10	0.95			47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.75	100.79	100.75	-0.00	4	50 192	6.62	1.33	7	27	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.00	109.20	109.10		3	4	6.71	1.67	4	40	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.22	109.30	109.23	-0.01	4	34 474	6.71	1.93		42	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.84	103.05	102.92	0.07	3	32 136	6.68	1.90		39	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.35	100.46	100.40	0.08	12	235 057	6.94	2.36	9	66	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.06	100.25	100.10	-0.05	6	25 005	6.95	2.48	7	67	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.27	101.40	101.40	0.05	8	96 469	6.97	2.89	1	70	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.40	98.45	98.40	0.25	2	381	7.05	2.93	8	78	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.95	100.00	99.98	0.08	10	82 004	7.02	3.34		74	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	80.10	100.00					8.67	3.34	163	239	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19		85.00					8.04	3.55	97	175	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.60	101.75	101.70	-0.05	4	60 002	7.07	3.90		77	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.65	101.80	101.75	0.30	7	135 008	7.07	3.92		77	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.50	102.69	102.69	0.14	1	1	7.01	4.52		67	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.85	92.60	92.15	0.35	5	159 535	7.31	4.55	11	97	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	99.30	99.50					7.47	4.68	25	112	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.00	102.15	102.00	-0.10	11	135 120	7.23	5.13		84	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19	66.00	68.00					7.84	5.50	54	141	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.85	95.95	95.95	0.20	17	203 487	7.55	6.21	18	103	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.14	102.75	102.75	0.85	14	57 247	7.29	6.42		74	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	102.08	102.25	102.20	0.40	7	112 061	7.41	6.96		78	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		88.20					8.02	7.40	56	133	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	104.20	104.40	104.20	0.21	20	247 196	7.81	8.70	26	94	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	87.05	88.30	87.00	-1.25	2	2	8.34	10.82	67	116	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29	68.00	96.00					7.63	10.98		42	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.41		99.50		6	151 150	7.81	0.75	157	145	15 000
---------------	--	----------	-------	--	-------	--	---	---------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО5		30/10/12							7.70	0.01			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12	96.00						6.95	0.11		64	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.00	100.10					7.86	0.36		151	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.56	100.70	100.70	0.20	2	5 400	7.74	0.63	160	138	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.60	100.70					7.74	0.63	160	138	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.90	100.30	100.94	1.84	1	14 000	7.84	1.76	115	154	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.20						8.41	1.84	169	211	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.00	100.25					8.58	2.19	177	230	5 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12		100.05	101.00	1.08	1	1	-9.61	0.06			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.90	100.00					7.78	0.44		143	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	99.75	100.05	100.00	-0.05	6	25 500	8.33	0.79	207	197	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.21	99.21	-0.08	2	5 100	8.44	1.29	191	209	5 000
ММК ВО6		10/06/14	97.20		97.70	0.05	1	5 000	8.85	1.60	221	253	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.15	97.90	102.00	4.10	2	2	6.10	1.64			5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.60	100.67	100.60	-0.10	4	7 885	7.83	0.31		149	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.60	100.65	100.65	-0.10	1	301	7.66	0.31		132	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.25	100.39	100.32		1	10 850	7.98	0.65	182	162	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.20	100.40	100.32		1	800	7.98	0.66	181	162	8 000
Алроса 23		18/06/15	101.31	101.45	101.45		1	48	8.59	2.37	174	231	7 000
Алроса 20		23/06/15	101.15	101.42					8.57	2.38	171	229	3 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.40	100.60	100.40		1	30	8.36	0.41		201	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.40	100.50					8.09	0.41		174	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	108.10	108.33	108.20	-0.14	8	5 170	9.08	1.80	237	278	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	108.10	108.33					9.05	1.80	234	275	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20							9.71	2.55	282	344	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20							9.71	2.55	282	344	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	95.00	98.00	95.24	0.24	1	203	10.24	3.08	325	397	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	95.25	97.50	95.39	-0.11	2	10 001	10.19	3.07	320	392	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.60	99.90	99.90		1	2 400	9.25	2.18	244	297	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.51	99.90	99.50	-0.05	2	2	9.44	2.18	263	316	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.51	99.95					9.23	2.19	242	295	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	99.97	99.98	99.98		4	11 949	8.62	0.04			5 000
Мечел ВО2		12/03/13	99.06	99.20	99.20	0.05	8	1 342	12.26	0.38	591		5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.95	100.50	100.00		3	72	11.73	0.47	538		5 000
Мечел ВО3		24/04/13	97.95	98.00	98.00	-0.10	21	1 443	14.56	0.50	821		5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.03	97.19	96.60	0.20	4	275	13.59	0.61	746	723	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	100.10	100.20	100.10	-0.10	10	665	11.58	0.73	536	522	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.10	95.99	95.15	-0.35	7	10 107	14.96	1.22	846	860	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	90.57	92.94	92.68	0.48	2	107	15.05	1.26	853	870	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.43	92.87	92.92	1.16	1	5	14.82	1.26	830	847	5 000
Мечел ВО5		07/04/15	99.50						11.82	2.22	500	554	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.82	2.22	500	554	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	500	554	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	500	554	3 000
Мечел ВО6		07/04/15	99.50						11.56	2.20	475	528	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	91.00	91.09					14.38	2.50	750	811	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.52	91.89					14.64	2.50	776	837	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	82.75	84.99	83.50	1.00	2	202	14.94	3.02	796	867	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.39	87.47					13.45	3.04	646	718	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	84.52	85.49	84.52	0.02	5	687	14.47	3.05	748	820	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	98.00	99.99					9.06	0.97	268	268	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.55	100.65					8.66	0.67	248	230	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.30	98.40					12.36	1.07	593	599	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.22	92.00					15.49	1.48	889	916	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.08	100.40					7.33	0.11		102	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	95.00		97.75	-0.11	1	25	10.52	1.47	392	419	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.91	93.29	92.90	-0.06	24	24 572	14.74	1.29	821	839	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.11	88.18					14.80	2.26	797	852	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12	99.91	100.04	99.96	-0.09	3	2 531	8.73	0.04			5 000
РЖД ВО01		05/12/12	100.09	100.29	100.31	0.13	10	10	6.57	0.11		26	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.38	99.68	99.60	0.20	2	16 005	7.43	1.00	104	105	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.00	109.19	109.00	-0.18	8	21 335	8.03	1.27	151	168	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.23	102.54	102.54	0.02	1	274	7.90	2.06	112	162	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.25	99.55	99.55		5	35 048	8.12	2.70	120	185	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.25	99.55	99.55	0.05	3	3	8.20	3.12	120	193	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	110	196	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.80	100.25					7.41	0.90	107	104	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.80	100.00					7.41	0.90	107	104	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	100.95	101.10	101.00	-0.05	5	22 504	7.97	1.50	136	164	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.40	101.55	101.40	-0.25	6	34 107	8.14	1.87	141	185	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.85	99.55					8.18	2.65	127	191	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20							8.04	2.64	113	177	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19							8.39	2.99	141	212	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	99.95	100.25	99.75	-0.45	1	1	8.86	3.40	181	258	15 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20							8.83	4.04	169	253	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20							8.83	4.04	169	253	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.00	96.50					8.88	4.59	167	254	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.70	97.99	97.50		1	1	9.12	6.10	176	262	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.80	100.15	100.15	0.35	1	50	9.13	2.21	231	285	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.00	102.00					9.65	3.22	263	337	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.04	101.99					10.04	0.98	366	366	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.71	245	311	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.30					9.65	3.00	267	338	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.00	99.80					9.12	3.00	214	285	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.63	223	302	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.46	3.63	238	317	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.35	3.63	227	306	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	100.26	100.49	100.26	0.01	2	20 001	8.21	1.36	165	187	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	100.04	100.05	100.04	0.09	33	816 110	6.44	0.04			15 000
Газпром А9		12/02/14	89.85	99.90					7.77	1.25	126	141	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.45	109.50	109.50	-0.01	6	43 866	7.69	1.49	108	136	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							6.61	0.13		30	5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							6.61	0.13		30	5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.00	100.18	100.00	-0.15	1	1 500	7.53	1.06	111	116	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16		101.00					8.06	0.22		173	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13		100.50	99.95	-0.03	1	1	7.38	0.45		103	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.50	100.00	100.00		3	15 001	7.27	0.45		92	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.00	101.00					7.90	2.09	111	162	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.60	101.00	100.60	-0.02	1	100	8.45	2.88	149	218	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.68	102.77					8.12	2.89	116	185	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.60	109.99					8.60	4.26	143	228	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	96.60	99.50					8.37	4.49	117	204	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.00	100.17					7.37	0.65	121	101	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	99.85	100.30	100.25		1	296	8.42	2.68	150	215	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.35					8.42	2.68	150	215	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.85	100.25					8.42	2.68	150	215	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.25	99.60					7.90	0.89	157	153	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.55	100.80					6.53	0.15		21	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.50	100.80					6.94	0.15		62	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.50	100.70	100.68	0.13	1	699	7.77	0.15		145	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.00	101.59	101.50		1	1 000	8.06	1.05	164	168	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	100.35	101.40	100.35	-1.05	2	25 000	9.01	2.10	222	273	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.80	100.40					10.27	0.74	404	391	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	96.36	99.70	99.00	0.09	8	4 975	10.33	1.21	383	397	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	92.00	95.59					11.00	3.06	401	473	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	92.00	97.99					11.00	3.07	401	473	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.01	99.19	99.01	-0.19	7	159	14.02	0.72	780	766	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50					9.51	3.13	251	324	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.55	100.62	100.55		16	14 130	7.97	0.69	178	161	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.15	100.19	100.15	-0.03	9	13 801	7.71	0.16		139	10 000
ВТБ БО-7		23/01/15							7.63	0.25		129	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	97.50	100.02					6.67	0.38		32	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	97.50	100.07					7.64	0.38		129	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.97	100.03	99.98	-0.02	7	34 010	7.86	0.38		151	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.07	100.11					8.05	0.83	176	168	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.45	99.93					7.66	0.95	129	128	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15		100.05					8.24	1.32	170	189	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.06	100.15					8.20	1.32	166	185	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15							8.70	2.62	179	243	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15							8.70	2.62	179	243	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90	100.15	99.97	0.07	1	50 000	8.19	0.57	210	183	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	101.00					8.93	1.95	218	264	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.30	100.20	0.05	2	10 800	8.08	0.81	180	172	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.63	99.74	99.74	0.04	1	533	7.95	0.21		162	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	98.77	99.67					8.21	0.34		186	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	100.49	100.50	100.35	0.05	2	332	7.75	0.49		140	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.40					8.42	0.70	221	206	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					8.17	0.73	194	181	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.50					7.67	1.08	124	130	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.94	1.20	245	258	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20		99.77					7.69	0.98	131	131	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	99.75	100.30					8.42	2.18	161	214	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32							8.73	2.70	181	246	00000 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32							8.73	2.70	181	246	00000 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.00	98.40	98.00	0.50	2	15 000	8.77	3.04	178	250	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.40	163	240	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.55	97.00	97.00		2	2	8.84	4.20	168	253	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21		99.55					7.99	1.41	141	165	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21							8.31	1.81	160	201	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	101.00	101.25	101.00	0.05	3	22 126	8.42	1.81	171	212	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17		100.70					8.92	2.01	216	264	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.23	100.00	99.20	-0.05	3	30 350	9.07	3.05	208	280	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	99.55	100.00					8.61	3.05	162	234	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.33	100.75	100.40		1	90	8.56	1.36	200	222	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.40	100.65					9.02	1.70	235	271	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.04	100.24					6.22	0.08			5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.19	100.23	100.19	-0.01	2	4 356	7.55	0.08			5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.00	101.00					8.00	0.28		166	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.00	100.45	100.34	-0.16	1	25 280	7.86	0.29		152	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.60					7.98	0.61	185	162	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.68					7.23	0.76	98	87	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.75	100.32	0.16	1	1	7.90	0.77	165	154	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.20	100.40					7.79	0.82	150	142	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.20	100.40					7.93	0.82	164	156	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						7.63	0.92	128	126	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13							7.93	0.95	156	155	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	101.00	100.75	-0.20	3	80 990	8.13	0.97	175	175	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.40	102.20	101.47	-0.06	2	3 000	8.18	1.24	167	182	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18		100.00					8.48	1.70	181	217	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22							8.53	1.88	180	224	00000 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.76	100.35					8.61	2.27	178	233	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	98.10					8.81	2.43	194	253	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.80	98.55					8.87	2.44	200	259	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.80	98.55					8.56	2.44	169	228	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							9.60	0.06			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							8.93	0.08			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.15	100.20					7.61	0.16		129	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.19	99.33					7.94	0.72	172	158	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13							7.99	1.07	156	162	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.65	100.80	100.67	0.02	9	30 000	8.08	1.22	158	172	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.72	100.84	100.70	-0.05	1	10 000	8.57	1.59	193	225	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	176	241	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	175	241	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	175	241	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	175	241	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14		99.75					7.84	1.17	136	148	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.75	173	212	7 000
АИЖК А9		15/02/17	99.00	99.95					8.10	1.85	138	181	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.34	99.60					8.24	1.90	150	195	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.50	99.60	99.52	0.02	4	22 305	8.15	2.31	131	187	6 000
АИЖК А8		15/06/18	97.95						8.43	2.77	149	216	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30					8.55	2.99	157	228	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.25	99.45					8.44	3.06	145	217	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.76	3.17	175	248	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.01	99.01	99.01	0.51	2	2	8.73	3.82	162	244	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	97.99					9.13	4.95	188	276	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	102.50	102.00	0.50	1	1	8.97	5.55	166	253	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	135	206	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	261	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.20					8.98	1.06	256	261	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.61	1.64	295	329	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.00					9.78	1.64	312	346	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.80	100.20					8.06	0.31		172	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.70	100.40					8.44	0.78	218	208	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.60	99.88	99.88	0.01	6	30 562	8.07	1.01	167	169	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.60					8.42	1.42	184	208	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18		100.20	100.20	0.20	1	2 010	7.80	0.63	165	144	10 000
МТС 1		17/10/13	99.25	99.50	99.50	-0.15	6	4 992	7.68	0.96	131	130	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14		99.20	99.25	0.01	7	42 376	8.08	1.48	148	175	15 000
МТС 2		20/10/15	97.81	98.00	98.68	0.49	6	12	8.43	2.72	150	216	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.00	99.20	98.80	-0.20	2	2	8.79	2.66	187	252	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.56	101.45	99.00	-0.99	1	150	9.06	3.28	203	278	15 000
МТС 7		07/11/17	99.00	99.15	99.00	-0.20	7	103 200	9.15	4.02	201	285	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	100.85	100.90	100.90	-0.08	4	4 500	8.08	0.71	187	172	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.68	98.25	98.29	-0.10	14	15 171	8.67	1.60	203	235	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.50	100.00					8.97	2.21	215	269	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.50	99.85	99.70	-0.05	8	26 844	9.19	2.19	238	291	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.65	99.92	99.65		3	9 440	9.21	2.19	240	293	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.50	98.20	98.20	0.15	6	5 607	9.21	2.68	229	294	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.00	98.20	98.00	0.25	1	1	9.29	2.68	237	302	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	99.80	100.00	100.27	0.57	2	12 232	8.05	1.84	133	175	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	99.65	99.50	-0.15	1	2 152	7.71	0.59	160	135	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.75					7.89	0.53	184	153	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	96.00	100.80					7.79	1.23	129	143	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.69					7.63	1.23	113	127	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.00	100.13	100.12		1	500	9.13	2.26	230	285	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.90	97.20					9.10	3.12	260	333	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.02	97.00	97.00		1	21	9.60	3.12	260	333	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.90	107.00					9.64	3.12	264	337	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.75	99.88	99.87	-0.02	2	18 491	7.95	0.34		160	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.50	100.12					8.34	0.85	203	197	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50	100.12					8.34	0.85	203	197	1 000
Магнит БО-3		09/09/20	100.00	100.20					8.24	0.85	193	187	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	100.00	100.12	100.00	-0.05	1	500	8.40	0.85	209	203	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	98.70	100.00					8.15	1.29	162	180	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.00	99.20					8.43	1.44	184	209	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.20	100.40	100.30	0.10	6	207 400	8.97	2.61	207	270	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.00	98.30					8.63	1.50	202	230	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.25	98.50					9.05	1.57	242	273	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.15	100.25	100.25	0.05	1	1	9.62	2.62	271	335	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	98.55	99.00					8.99	0.73	277	263	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.64	100.15					9.17	0.90	283	280	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	98.84	99.50					11.19	0.55	512	483	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.00						9.33	0.98	295	295	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.10	101.00					9.71	0.92	336	334	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	101.00						11.13	1.95	438	485	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.61	100.07					12.82	0.64	667	646	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	92.50	94.14	93.80	0.30	3	8 383	11.65	2.29	482	537	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	96.00	96.49					11.62	1.63	497	530	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	82.00	100.50					9.99	1.74	330	368	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	91.00	99.96					6.63	1.20	14	27	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	99.98	100.17	100.00	-0.05	1	2	9.06	0.15		275	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.80	98.85	98.85	-0.05	4	30 000	9.78	1.22	328	342	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.05	101.60	100.06	0.01	1	65	10.75	2.59	385	448	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.60	100.05	99.90	-0.13	5	59 000	10.09	0.13		378	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.35	99.60					9.72	0.82	344	335	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.11	99.70					11.58	0.97	521	520	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.45	102.00	100.50	0.05	1	8 000	8.81	0.85	250	244	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	86.00	99.90					8.30	0.16		198	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.60	99.95					9.20	0.49		285	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	96.00						10.02	0.49		367	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.15	0.88	182	178	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.80	100.45	100.00		6	5 350	9.46	0.49		311	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.50	102.40	102.25	-0.28	3	17	9.39	0.70	319	303	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	100.30	100.79					11.01	2.06	423	473	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.03	100.19					7.41	0.45		106	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.19					7.77	0.45		142	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.70	100.75	100.75	0.12	2	5 631	7.30	0.34		95	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.55	1.69	188	224	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.90					9.76	1.44	317	342	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.41	100.70	100.70	-0.05	2	7 744	9.88	2.13	308	360	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.40	100.70	100.70	0.05	1	3 616	9.88	2.13	308	360	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.91	99.99	99.99	0.09	7	947	12.85	0.83	656	648	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.01	100.05	100.05	0.02	26	2 559	12.83	0.96	646	645	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.56	101.49					9.85	0.41		350	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.56	101.99					11.50	0.41		515	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.35		100.00	0.25	1	1	10.38	0.50	435	402	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.35	100.00	100.00		1	1	10.38	0.50	435	402	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.39	0.59	228	203	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.00						9.63	1.04	321	325	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13		102.00					6.97	1.10	53	60	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.01	97.38					11.81	1.33	526	546	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.01	99.49					10.33	1.34	378	398	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.73	3.20	172	245	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру сгидро 1	22/04/16	12/04/21	99.00	99.20	99.00	-0.30	1	1	8.51	3.11	151	224	10 000
Ру сгидро 2	22/04/16	12/04/21	99.00	99.39					8.37	3.11	137	210	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16							7.82	0.33		148	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.26	100.35					7.61	0.12		130	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.15	100.30	100.25	0.05	2	9 499	8.88	2.60	198	261	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60					8.59	2.29	175	231	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.40	100.55	100.50	-0.10	9	40 067	7.81	0.63	167	145	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	98.00	98.34	98.00	-2.00	3	2 500	8.58	1.56	195	226	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	94.00	100.00	91.00	-5.50	1	20 000	14.82	1.54	820	849	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.25	91.34	82.50	-1.50	7	66 657	15.95	3.04	896	968	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.80	100.09	99.80	-0.15	9	70 001	9.23	2.67	231	296	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.00	96.99					10.72	1.72	404	441	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.65	0.17		133	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.15	99.22					8.78	0.67	260	242	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.68	99.00					8.55	1.32	201	220	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	97.61	98.65	98.75	0.05	1	29	9.97	0.78	371	361	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	82.30	82.80	82.80	-1.80	63	8 260	35.23	0.87	2891	2 886	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	96.01	98.75	98.75	0.35	3	380	10.40	0.94	404	402	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	105.86						9.94	0.99	355	356	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	86.00						7.51	1.40	94	117	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	100.00	100.15					8.34	0.84	204	197	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							8.04	1.36	148	170	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.20	99.45					10.84	0.82	455	447	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	99.50	100.99					9.02	2.38	216	274	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	98.00	100.00					9.21	2.67	229	294	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.00	99.99	97.08	-6.40	1	1	12.03	0.88	570	566	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.55	101.77	101.55	-0.20	6	14 504	8.47	1.00	208	209	4 000

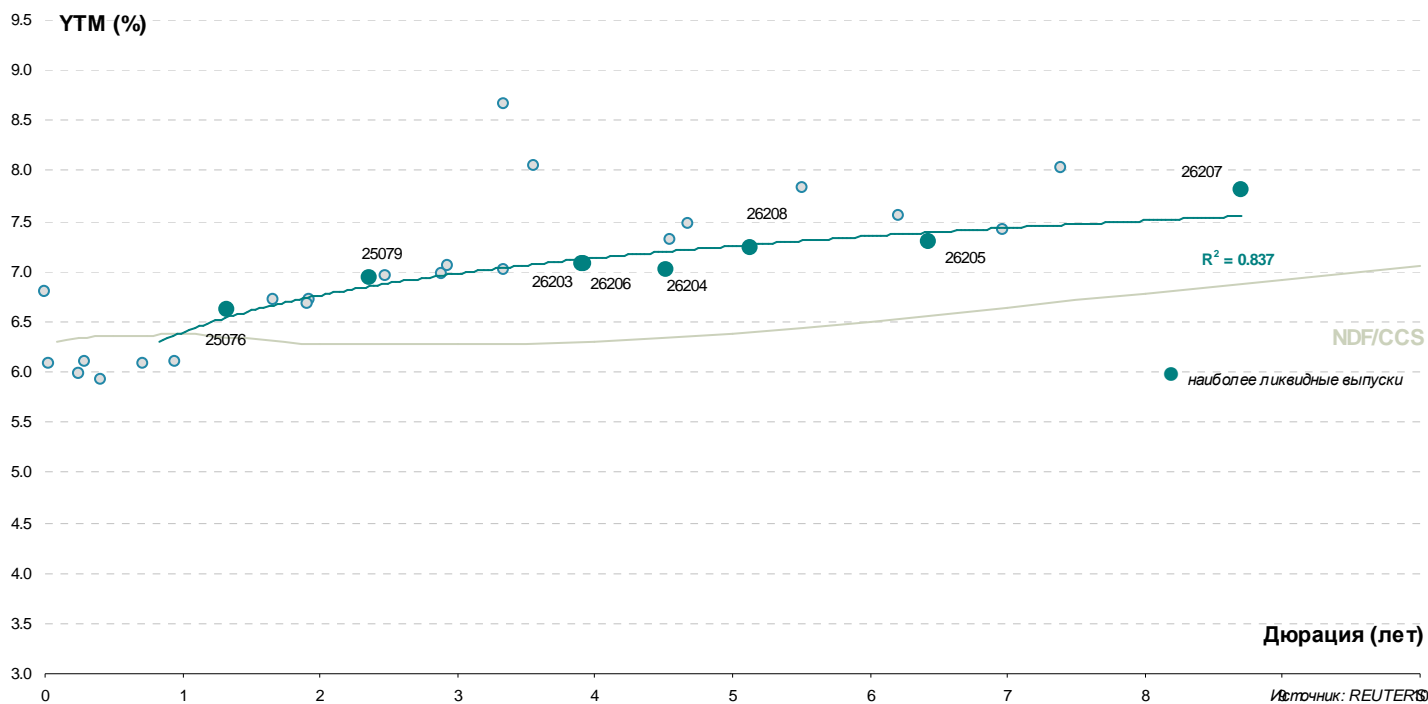
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.91	100.30					9.32	1.51	271	299	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	100.30					9.32	1.51	271	299	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.35	100.40	100.35	0.29	7	19 232	9.84	2.64	293	357	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.48	99.21					10.15	1.40	358	381	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Гру ппа 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.40					8.34	0.27		200	5 000
ЛСР Гру ппа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.50	100.90					9.98	0.64	383	362	2 000
ЛСР Гру ппа БО-2		10/09/13	100.20	100.35					9.82	0.85	351	345	2 000
ЛСР Гру ппа 3	14/03/14	08/09/17	100.00	100.90	100.73	0.23	5	17 720	11.19	1.30	466	484	3 000
ЛСР Гру ппа БО-3		20/03/14	98.10	98.20	98.20	-0.06	6	2 390	11.20	1.33	465	485	2 000
ЛСР Гру ппа БО-5		24/07/14	95.95	96.10	95.95	0.15	1	755	11.37	1.62	472	505	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.90	100.00	99.95	-0.04	4	37 000	11.50	0.15		518	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	99.95	100.05	100.00	-0.10	6	15 972	14.21	1.38	765	787	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.75	100.99					8.15	0.12		184	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	101.80		101.85		2	100 000	9.29	0.34		294	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.25					9.29	4.12	214	298	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.25					9.38	4.12	223	307	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	99.50					9.33	4.12	218	302	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.40	100.59					7.66	0.10		136	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.70	100.76	100.70	-0.04	1	3 600	7.86	0.36		151	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.90	100.05	100.05	-0.25	4	2 406	8.48	1.68	181	217	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.60	99.65					8.45	1.92	171	216	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	97.62	98.99	97.60	-1.46	3	2 105	14.51	0.70	830	815	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.10	100.20	100.10		4	20	12.13	0.62	599	577	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.99	100.14	100.01	-0.27	6	25 100	12.33	0.92	598	596	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.25	100.39	100.38	-0.02	4	32 171	8.39	0.53	233	203	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.30	100.48					8.28	0.64	212	192	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	86.00	104.00					8.13	0.68	194	177	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.00	98.60					8.74	0.98	236	236	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.30	100.40	100.12	-0.23	2	54 000	9.43	1.75	274	313	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	96.00	98.00	96.45	0.40	2	2	9.57	1.86	285	328	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	86.01	101.05	101.00		5	14 035	7.67	0.59	156	131	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.05	100.09	100.10	0.05	2	500	8.50	0.91	216	213	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.50	99.85	99.85	0.17	1	101	8.53	1.22	203	217	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.00	100.05	100.01	0.06	1	25 000	8.76	1.28	223	241	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.40	100.57	100.57	0.16	1	5	6.63	0.10		33	5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.15	100.18	100.15	-0.02	1	2 000	8.44	0.14		213	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.01	100.35					8.90	0.69	270	254	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.11	1.35	256	276	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.80		99.84	0.07	5	13 467	8.52	0.48		217	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	99.90	100.15					8.82	0.61	269	246	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.05	100.30	100.15	0.03	1	1	9.12	0.77	287	276	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/13	99.50	99.80					8.92	0.81	264	255	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.85	101.00					9.22	1.27	270	287	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	100.00	101.00					9.71	1.55	308	339	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.04		100.04	-0.03	1	7 800	8.03	0.06			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.94	99.96	99.94	0.03	33	224 104	7.99	0.09		169	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.15	100.20					8.45	0.29		211	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.15	100.25					8.15	0.31		181	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13							8.83	0.45		248	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.30	100.45	100.45	-0.05	1	10	8.37	0.59	226	201	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.35	100.50	100.40	-0.02	1	1 000	8.73	0.66	256	237	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.27	100.36	100.29	-0.04	3	3 000	9.00	0.82	271	263	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.63	0.89	130	126	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.15	100.29	100.29	0.04	1	17	9.18	1.40	261	284	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк ВО2	20/02/13	18/02/15	99.96	100.15	99.95	-0.05	17	17 150	9.04	0.32		270	5 000
Промсвязьбанк ВО4	20/02/13	18/02/15	99.95	100.23					8.61	0.32		227	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.55	100.20	99.75	0.11	6	41 626	8.82	0.62	268	246	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	99.49					9.67	1.22	317	331	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	99.01	100.79	100.25	-0.05	2	2	10.23	1.73	355	392	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	99.76	101.74					12.68	3.95	555	638	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		100.20	100.08	0.01	5	36 351	7.92	0.13		161	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	100.00	100.35	100.10	0.11	2	16 790	9.07	0.89	274	270	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.00	100.34	100.34	0.34	5	3 455	9.32	0.93	297	295	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.25	100.25	-0.03	2	18 315	8.42	0.22		209	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.90	100.00	99.90		3	15 000	8.94	0.33		260	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15							9.53	0.48		318	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.70	99.95					10.19	0.90	386	382	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	86.00	100.10					9.98	0.93	362	361	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.90	100.00	100.00		1	2 600	10.51	1.40	394	417	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.02	98.24	98.25	0.10	6	7 618	10.63	1.53	401	430	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.55	100.70	100.70	-0.04	14	104 943	7.96	0.15		164	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	101.25					8.88	0.84	258	251	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	99.70	100.20					8.06	0.81	178	170	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	86.00	100.55	100.25	0.20	1	1	9.70	1.26	318	335	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.70	99.95	99.70	-0.23	4	123 002	9.30	0.86	299	293	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.96	100.09					9.87	1.28	335	352	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13							9.47	0.49		312	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.05	100.20					9.65	0.69	346	329	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.91	98.98	99.05	0.20	2	35	9.93	0.90	360	356	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	101.01	101.05	101.05	0.10	7	26 251	10.92	1.06	450	455	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					12.00	1.07	557	563	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.30	100.55					11.02	1.27	450	467	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.35	101.55	101.55	0.03	1	650	11.14	1.98	438	486	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.80	101.38					11.68	2.03	491	540	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.40	98.48	98.48	-0.02	10	1 359	12.31	0.75	607	595	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	99.90	100.50					12.81	0.76	656	645	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.10	100.29	100.29	0.05	7	207	14.18	1.22	768	782	2 000
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.25	100.29	100.29	0.05	4	1 114	12.99	0.48		664	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	09/07/15	100.05	100.47	100.35	-0.10	1	500	13.74	0.69	755	738	2 000
ТКС БАНК 2		28/07/13	104.27	104.44	104.35	-0.39	7	110	14.09	0.71	788	773	1 000
ТКС БАНК ВО1		20/09/13	99.92	103.99					14.68	0.87	836	831	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.43	102.52	102.43	-0.02	15	2 279	14.46	0.98	808	808	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.80	99.90	99.90	-0.05	20	4 412	14.82	0.75	858	846	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.05	100.14	100.05		4	4 371	9.56	0.05			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22							8.89	0.98	251	251	00000 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.19	100.37	100.23	-0.17	2	6 000	9.46	1.72	278	315	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16							7.64	0.96	127	126	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	86.00	101.15					8.02	1.20	153	166	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	99.65	99.70					8.09	1.24	158	173	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.52	2.12	173	224	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	100.64					8.00	0.05			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.07	100.27	100.12	-0.15	1	1	8.50	0.83	221	213	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.00	100.22					9.30	0.84	300	293	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.20	99.60	99.20	-0.40	1	25	8.65	0.84	235	228	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	85.44		100.02	-0.38	1	10 000	9.17	1.07	274	280	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.01	3.39	197	273	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.80	101.01	100.92	-0.03	1	30 000	8.01	1.05	159	163	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.75					7.93	1.04	152	155	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/11/12	18/11/14							8.48	0.25		214	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	09/11/12	07/11/14	100.12	100.14	100.13	0.01	1	10 000	7.72	0.04			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.14	100.25	100.25	0.05	1	7 406	8.52	0.42		217	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.47	100.59	100.59	0.14	1	3	8.97	0.96	260	259	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							7.54	0.48		119	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.32	100.54	100.53	-0.03	5	17 640	10.70	0.77	445	434	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.94	100.00	100.00		2	2 347	10.24	0.95	387	386	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30		100.30	-0.10	3	2 775	11.25	1.34	470	490	2 000
ЖКФ Банк													
ЖКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	100.00	100.04	100.00	-0.04	20	382 200	7.94	0.13		163	5 000
ЖКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13		100.20					8.20	0.47		185	4 000
ЖКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14		101.00					7.03	0.96	66	65	4 000
ЖКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.96	100.04	99.95	-0.08	2	40 000	10.14	2.24	332	386	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.05					7.98	1.37	142	164	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90	99.20					8.88	0.67	270	252	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.62	99.87	99.87	-0.08	1	10 000	9.08	0.84	278	271	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.15						9.28	0.87	296	291	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.15	100.50					9.22	0.87	290	285	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	85.20						9.27	0.99	288	289	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00						9.27	0.99	288	289	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.38	100.50					8.74	0.76	249	238	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.30	97.90	97.55	0.25	1	3	9.01	1.54	239	268	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	100.01	100.07	100.04	-0.02	9	8 905	8.36	0.02			4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.22	100.28	100.28	0.03	11	36 350	10.52	1.28	399	417	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.30	97.40	97.40	0.04	2	750	10.53	1.35	398	419	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.96	96.14	96.19	0.04	3	2 260	10.63	1.64	397	431	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.10	100.50					8.93	0.11		262	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.00	100.19	100.00	-0.05	1	1 020	9.70	0.57	361	334	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	98.75	99.17					10.60	0.68	441	424	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	99.90	100.29					10.19	0.93	383	382	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.04	100.08	100.08	0.04	3	2 725	9.93	0.93	358	356	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.83	1.25	332	348	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.00	100.15	100.15	0.05	6	35 145	10.09	1.22	359	373	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14							9.82	1.39	325	348	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.81	99.90					9.19	0.94	283	281	5 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.04	100.08					8.09	0.15		177	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.25					7.17	0.15		85	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.23	100.47					9.13	0.48		278	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.55	100.65	100.55	-0.15	5	25 015	9.71	0.64	356	335	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						6.85	0.15		53	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	100.00	100.29					10.02	0.50		367	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	285	344	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	97.00	100.60					10.77	0.96	440	439	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.50	100.00					11.21	0.35		486	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.56	100.00					12.99	0.93	664	662	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30	99.90					10.01	0.27		367	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	96.10						10.07	0.47		372	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	100.41	100.60					11.53	0.93	518	516	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.13	100.22	100.22	0.04	6	1 505	8.68	0.15		236	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.21	99.50					10.30	1.65	364	398	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00		100.25	0.06	1	13	9.38	0.46		303	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	86.02	100.10	100.00		3	3 500	9.99	0.50		364	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.00	100.10	100.02	-0.03	2	2	11.25	0.89	492	488	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	100.19	100.15	-0.05	1	1 798	8.55	0.09	225		3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	100.48					12.05	0.85	574	568	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.16	100.23					9.30	0.29		296	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	98.00	100.18					10.32	0.72	410	396	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.35	100.49	100.34	-0.01	4	11 760	10.52	0.78	426	416	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.77	0.56	369	341	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.10	99.50					9.59	0.68	340	323	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15		100.20	100.15	0.10	2	12 000	10.33	0.94	397	396	2 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.55	99.66	99.67	0.17	2	108	9.58	0.95	321	320	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	100.00	100.15	100.00	-0.20	3	10 000	9.88	0.96	351	350	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	100.16	100.25	100.25	0.10	5	4 800	12.56	0.90	622	619	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.60	100.00					11.54	0.16		522	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.15	100.34	100.15	-0.27	3	38 500	12.62	0.78	636	626	2 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.07	100.22	100.11		2	9 609	11.09	0.10		479	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.95						10.45	0.14		414	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.80	100.00	100.00		5	15 701	11.50	0.32		516	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.70	100.09	100.09	0.02	4	89	10.18	0.34		383	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.72	99.75	99.75		4	1 082	11.92	0.45		557	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.01	100.15	100.15	0.10	4	12 111	13.27	0.94	691	689	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.00	100.10					12.03	1.10	559	566	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	97.00	100.29					12.66	1.39	609	632	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		102.08	105.47					5.88	0.58			30 000
Москва 53	01/09/13			100.33					7.87	0.84	157	150	15 000
Москва 63	10/12/13		109.25	109.95					6.66	1.04	24	28	15 000
Москва 62	08/06/14		108.02	108.66	108.66	0.66	3	4	6.87	1.47	27	54	35 000
Москва 39	21/07/14		91.09	100.00					7.31	1.64	65	99	10 000
Москва 64	24/06/15		98.40	99.10	98.41	-0.60	5	38 000	7.81	2.42	95	153	20 000
Москва 44	16/11/15		105.23						7.40	2.53	51	113	40 000
Москва 56	22/09/16		96.61	99.44	98.00	1.43	5	14	7.74	3.46	68	146	20 000
Москва 49	14/06/17		97.05	97.35					7.82	3.93	70	152	25 000
Москва 48	11/06/22		90.85	91.12					8.13	6.88	71	152	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		97.02	101.00					7.88	0.61	176	152	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.50	99.60	99.50	-0.25	9	44 969	8.54	1.42	196	220	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	03/12/12		100.46	100.65	100.46	-0.04	4	4 000	8.16	0.10		186	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12		99.52	102.05	100.10	0.15	3	158	6.15	0.06			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.80	100.00	100.00	-0.20	2	715	8.35	1.80	164	205	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.95	103.00	103.00		1	380	8.63	2.19	182	235	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		100.00	104.10					8.16	0.52	212	180	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.39	101.69	101.70		1	1 000	7.96	1.10	152	159	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		93.00	98.00	97.90	-0.35	1	8 516	8.79	2.07	201	251	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.01						8.17	0.45		182	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.31	101.70					7.64	0.63	149	128	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.90	100.40	99.35	-0.65	3	250	8.56	1.33	201	221	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12			99.87						0.14			2 000
Краснодар 02	05/11/15		99.00	100.80					8.51	1.14	205	214	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		100.00	100.60					7.77	1.36	121	143	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4	01/11/12		100.09	100.12	100.12	0.02	5	6 502	7.32	0.04			10 000
Красноярский край 5	29/11/16		101.60	101.70					8.11	1.48	151	178	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13			100.60					8.14	0.55	207	178	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.00	101.00					9.62	1.42	304	328	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		86.02	96.00					8.51	2.30	167	223	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								8.99	2.33	215	271	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.50						8.99	2.46	212	271	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12			100.20	100.15	-0.05	20	95 913	8.23	0.15		191	3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.80	100.90	100.80		1	1	9.37	1.84	265	307	4 000

ОФЗ



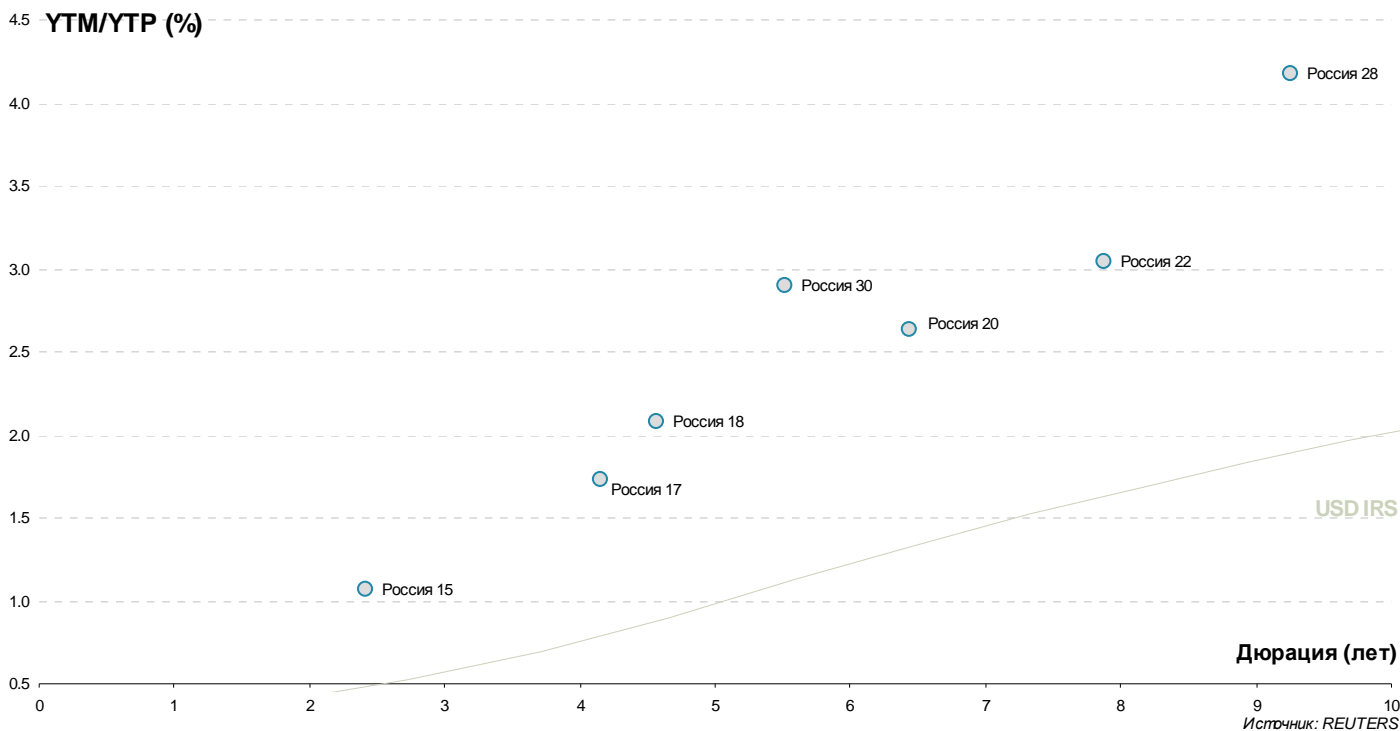
Результаты торгов евробондами

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		106.125	106.450	1.13	1.00	2.41	68
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.250	106.625	1.78	1.69	4.16	101
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		146.778	149.222	2.26	1.90	4.58	-0.51
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.380	126.750	2.93	2.87	5.53	-0.60
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		115.875	116.125	2.65	2.62	6.44	-0.25
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		111.750	112.000	3.06	3.03	7.87	-0.50
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.083	198.361	4.21	4.14	9.26	-0.57
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		119.500	120.125	4.43	4.40	15.89	-0.13
ГОСКOMPАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.385	101.510	1.58	1.32	0.47	129
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.777	102.074	1.81	1.19	0.47	-0.01
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.625	102.875	1.43	0.89	0.45	-0.01
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.601	105.101	1.32	0.68	0.73	101
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.944	111.694	2.53	2.02	1.32	-0.01
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		111.000	111.750	2.24	1.71	1.27	193
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.627	110.627	2.47	1.92	1.64	-0.03
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.256	107.738	2.62	2.47	2.84	-0.06
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.594	107.594	2.99	2.70	3.26	-0.03
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		110.923	111.377	3.31	3.20	3.59	-1.01
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.312	123.305	3.60	3.42	4.60	-0.20
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.273	130.766	3.92	3.84	5.22	-0.60
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.952	112.288	3.23	3.13	2.97	-0.15
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.098	117.594	4.27	4.21	7.29	-0.19
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		105.790	106.540	4.22	4.13	7.80	0.29
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		143.150	144.206	5.25	5.19	11.91	-0.40
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.251	128.759	5.24	5.21	13.12	-0.47
Газпром нефть									
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		100.603	101.353	4.30	4.21	8.10	-0.12
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.553	106.553	1.71	-0.77	0.75	140
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.498	105.961	1.53	1.20	1.31	0.06
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		128.743	129.118	3.20	3.14	4.74	0.10
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.908	112.386	2.86	2.75	3.99	0.08
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		111.705	112.455	4.19	4.09	7.53	0.20
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.850	101.850	5.18	4.95	4.45	0.08
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'12 6.609%	USD	31/10/12		99.900	99.925	34.88	26.16	0.00	4 264
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.520	107.007	3.54	3.33	2.20	0.05
VTB'17 6%	USD	12/04/17		104.962	105.337	4.75	4.66	3.97	0.31
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.962	106.337	5.02	4.94	4.57	0.71
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		108.171	108.670	5.17	5.07	4.65	0.18
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.614	106.111	5.66	5.59	6.36	0.18
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		103.422	104.172	6.48	6.38	7.39	0.70
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.494	106.988	5.73	5.70	12.50	0.21
VTB' 9.5%	USD			101.179	102.179	9.32	9.16	6.60	0.07
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.830	103.080	2.00	1.54	0.52	0.20
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.644	107.644	3.73	3.31	2.21	-0.30
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.000	103.500	4.90	4.73	2.79	
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.440	101.440	5.91	5.66	3.92	-0.62
ВЭБ									
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		109.066	109.441	3.10	3.01	3.87	0.03
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.768	110.268	3.34	3.23	4.43	0.17
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.590	119.082	4.06	4.00	6.14	0.05
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		112.000	113.000	4.48	4.36	7.49	
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.872	119.362	4.83	4.79	9.02	0.10
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.900	104.300	1.96	1.37	0.64	167
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.039	106.336	3.28	3.14	1.98	0.14
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.358	107.751	3.79	3.65	2.68	-0.04
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		110.680	110.980	4.03	3.94	3.15	344
GAZPROM '17 5.625%	USD	18/05/17		103.716	104.091	4.71	4.62	3.99	0.20
GAZPROM '19 7.25%	USD	03/05/19		106.009	107.009	6.12	5.94	5.17	0.01
GPB EURO' 7.875%	USD								506
ПСХБ									

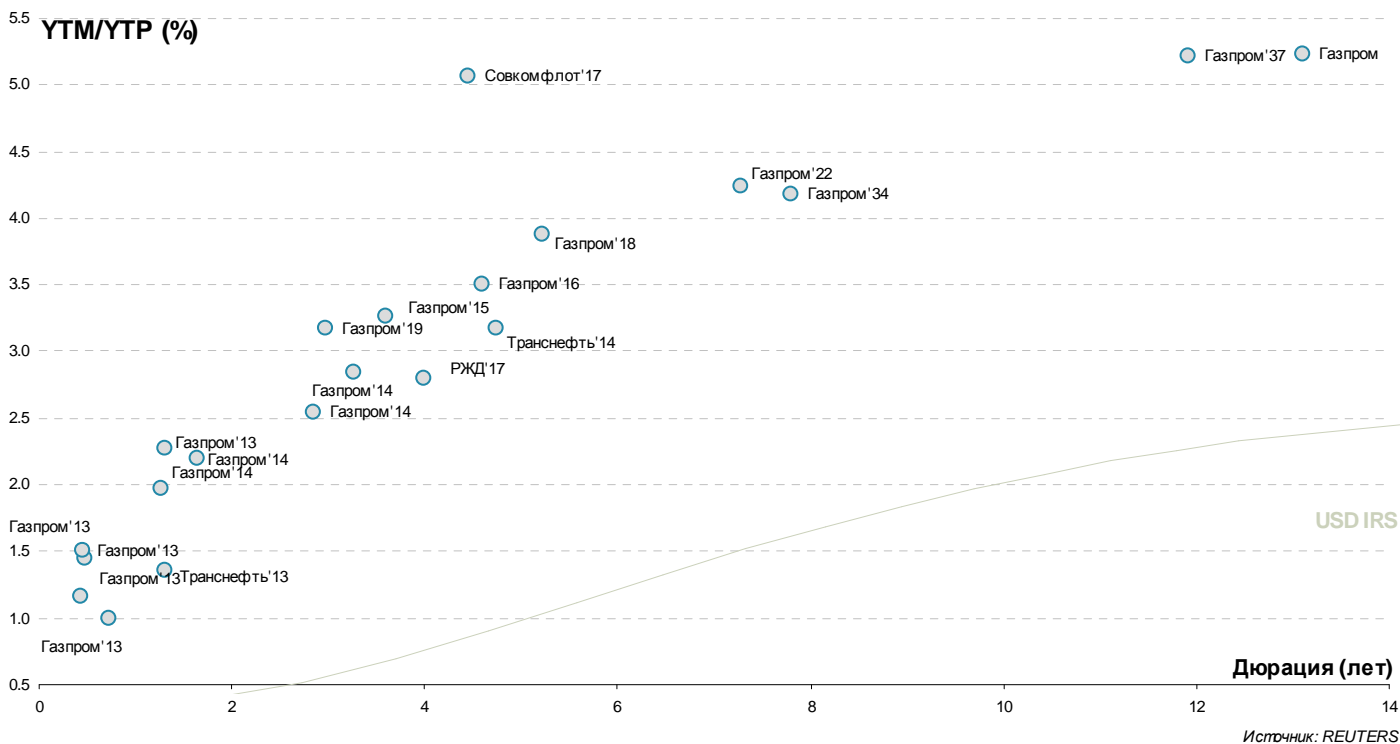
Выпуск	Валюта	Дата Погашения	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13	102.975	103.350	1.66	0.99	0.53	0.16	137
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14	105.772	105.897	2.24	2.14	1.16	0.02	191
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14	110.853	110.978	2.12	2.05	1.50	0.85	177
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17	110.877	111.375	3.68	3.56	3.95	-0.25	293
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17	107.358	107.733	3.72	3.64	4.53	0.11	285
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18	119.554	120.051	3.83	3.74	4.61	0.05	288
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21	105.021	105.646	4.47	4.29	3.22	0.50	392
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13	102.700	102.925	1.46	1.05	0.53	0.11	117
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13	103.100	103.475	1.80	1.26	0.66		151
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15	107.538	107.924	2.58	2.43	2.50	-0.06	212
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17	107.778	108.272	3.48	3.36	3.98	0.09	275
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17	105.248	106.048	3.61	3.41	3.87	-0.63	292
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19	106.409	106.846	4.07	4.00	5.66	1.37	290
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21	109.169	109.794	4.43	4.34	6.89	0.40	294
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22	111.612	112.362	4.57	4.48	7.25	-0.01	300
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22							
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ									
Евраз									
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13	103.200	103.500	2.18	1.58	0.48	0.33	190
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15	108.976	109.461	5.02	4.85	2.66	0.07	456
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17	103.704	104.704	6.44	6.18	3.91	0.15	579
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18	113.435	114.430	6.54	6.34	4.47	0.06	570
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18	100.625	101.125	6.61	6.50	4.68	-0.13	576
Металлоинвест									
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16	103.125	103.625	5.56	5.41	3.32	0.13	501
НЛМК									
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19	100.023	100.460	4.95	4.87	5.91	-0.34	375
Альянс Ойл									
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15	107.400	107.750	6.44	6.29	2.15	0.30	611
Алроса									
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14	110.822	111.322	3.36	3.12	1.86	-0.08	297
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20	114.299	115.047	5.52	5.41	6.06	-0.24	417
Вымпелком									
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13	102.650	103.100	3.00	2.11	0.50		271
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14	99.684	102.316	4.57	2.94	1.61		
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16	106.550	106.550	4.31	4.31	2.95	-0.14	380
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16	111.621	112.125	4.67	4.53	3.09	0.09	413
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17	104.610	105.610	5.06	4.80	3.84	0.02	437
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18	117.250	117.750	5.45	5.36	4.54	-0.21	458
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21	109.380	110.380	6.27	6.13	6.25	0.13	488
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22	107.550	107.925	6.42	6.36	6.90	0.42	491
Лукойл									
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14	108.676	108.870	1.96	1.87	1.87	-0.06	156
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17	113.935	114.332	3.08	3.00	4.02	-0.14	231
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19	120.614	121.121	3.87	3.79	5.60	-0.27	264
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20	113.367	113.867	4.15	4.08	6.41	-0.32	274
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22	120.157	120.914	4.10	4.01	7.33	-0.62	246
МТС									
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20	123.175	123.679	4.95	4.88	5.82	0.13	366
НОВАТЭК									
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16	107.400	107.900	2.93	2.77	3.01		240
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21	117.000	118.000	4.15	4.02	6.57	-0.25	272
Северсталь									
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13	105.750	106.250	1.95	1.31	0.73	-0.20	165
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14	109.600	110.100	2.55	2.22	1.41	-0.03	221
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16	105.050	106.050	4.76	4.47	3.35	-0.34	419
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17	106.671	107.169	5.17	5.06	4.34	0.05	437
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22	100.087	101.087	5.89	5.76	7.67	0.57	426
ТМК									
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18	103.068	104.068	7.04	6.81	4.34	0.30	626
Распадская									
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17	104.223	105.223	6.65	6.39	3.89	0.07	600
ТНК-ВР									
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13	102.441	105.441	0.86	-6.79		-0.02	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15	108.181	109.087	2.50	2.10	2.12	0.02	208
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16	114.500	115.500	3.32	3.06	3.29	-1.62	272
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17	114.252	115.251	3.12	2.90	3.90	-0.05	241
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18	119.279	119.654	3.86	3.79	4.53	-0.83	297
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20	121.697	122.755	3.80	3.65	5.85	-0.19	254
ЧАСТНЫЕ БАНКИ									
Альфа-Банк									
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13	104.349	104.599	2.46	2.08	0.63		217
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15	108.671	109.648	4.14	3.73	2.21	-0.05	374
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17	99.605	100.605	6.40	6.14	3.80	0.03	578

Выпуск	Валюта	Дата Погашения	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17	109.570	110.570	5.61	5.39	4.17	-0.20	486
ALFA BANK'21 7.75%	USD	28/04/21	109.153	110.153	6.34	6.20	6.48	0.16	497
Номос Банк									
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12	100.500	101.500	5.22	-2.13		-0.25	
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13	101.720	101.970	4.67	4.41	0.96	-0.07	441
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15	105.511	106.511	6.68	6.31	2.69	0.01	628
NOMOS BANK'19 10%	USD	26/04/19	100.127	101.127	9.97	9.76	4.93	0.01	911
Промсвязьбанк									
PROMSVYAZB'18 12.5%	USD	31/01/18	101.750	102.750	5.24	1.42	0.25		502
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13	104.881	105.131	3.69	3.34	0.68	0.05	341
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14	100.977	101.477	5.51	5.15	1.44	0.01	522
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15	111.507	112.507	7.73	7.33	2.19	0.02	742
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	09/07/16	107.297	109.297	8.88	8.27	3.05	-0.47	847
PROMSVYAZB'19 8.5%	USD	25/04/19	100.418	101.418	8.39	8.12	3.82	0.25	781
ХКФБ									
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14	103.252	103.752	4.54	4.18	1.33	0.38	424

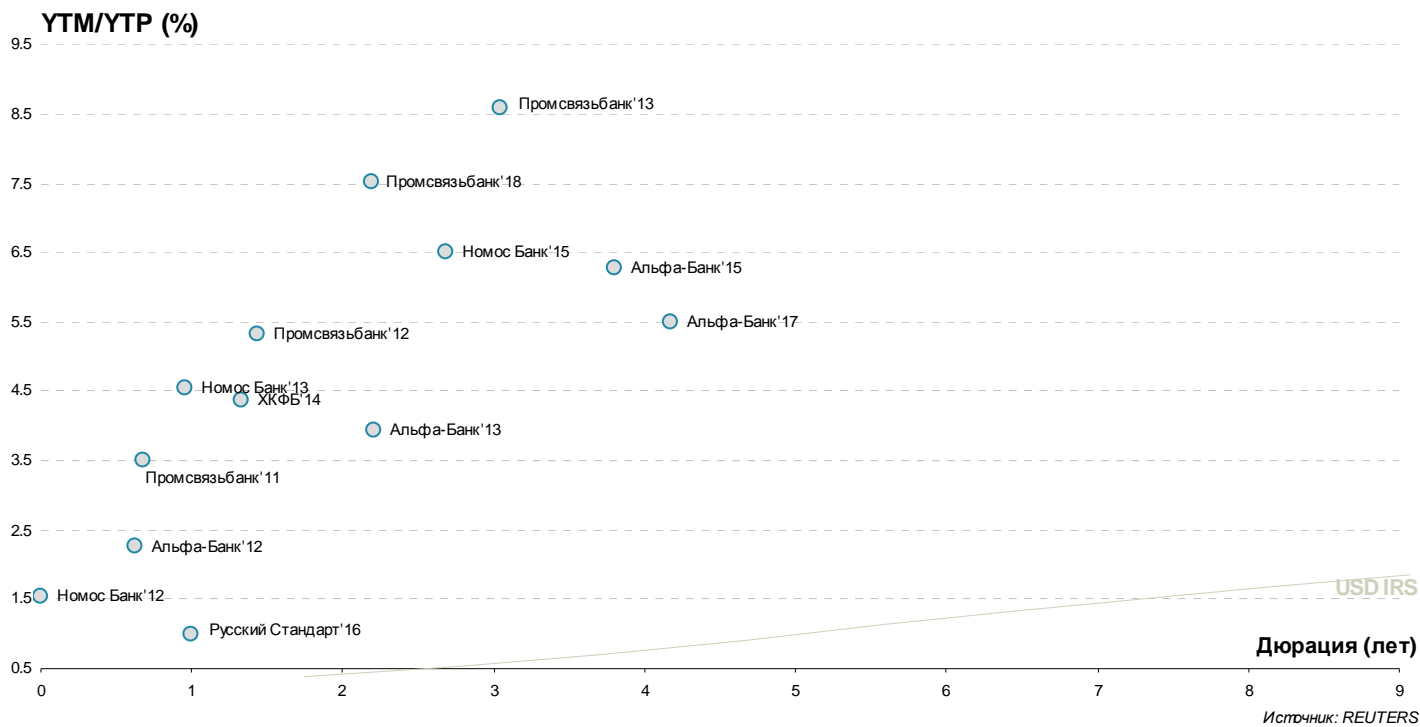
Россия



Госкомпании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@zenit.ru
a.pashkevich@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
e.gashigullina@zenit.ru

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

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

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

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