

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Данные по рынку труда США неплохи, но выборы важнее

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Начало месяца для рынка выдалось нейтральным
- Рубль дешевеет на падающей нефти

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды в неопределенности
- Локальный рынок в режиме ожидания

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

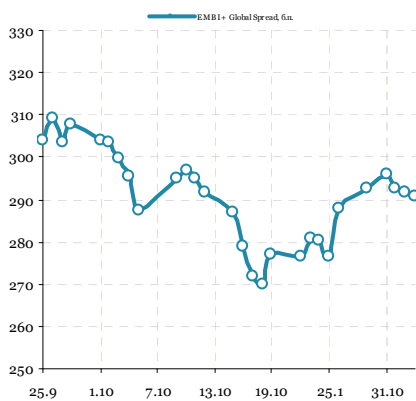
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 15/
- Результаты торгов евробондами /стр. 16/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 18/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.69	▼	-0.03	1.39	1.88
UST 10-2Y sprd	141	▼	-2	117	162
EMBI+Glob.	291	▼	-1	270	441
EMBI+Rus sprd	162	▼	-1	141	332
Russia 30 yield	2.84	▼	-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	0.70
MosPrime-1m	6.73	▼	-0.03	6.15	6.89
Корсчета в ЦБ	636.0	▼	-70.3	446	1032
Депоз. в ЦБ	101.6	▲	21.4	61	238
NDF RU 3m	6.4	▲	0.0	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	31.627	▲	0.154	30.00	33.67
EUR/RUB	40.451	▲	0.025	38.97	41.81
EUR/USD	1.28	▼	-0.004	1.21	1.31
Корзина ЦБ	35.476	▲	0.075	34.10	37.28
DXU Индекс	80.749	▲	0.156	78.85	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1441.2	▼	-0.1%	1228	1589
Dow Jones	13112.4	▲	0.15%	12101	13610
DAX	7326.5	▼	-0.51%	5969	7452
Nikkei 225	9007	▼	-0.36%	8296	9521
Shanghai Comp.	2114.0	▼	-0.38%	2004	2452
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	107.5	▲	1.69%	88	117
Нефть Brent	107.7	▲	0.06%	89	117
Золото	1685.0	▲	0.05%	1540	1790
CRB Index	292.3	▲	0.01%	267	321

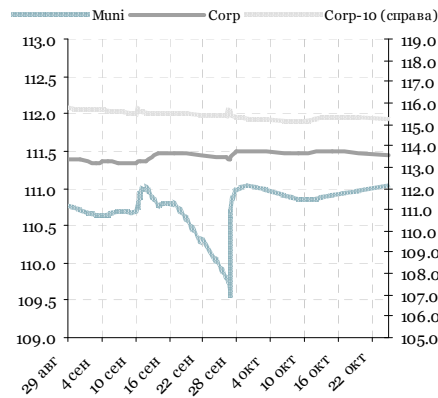
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETVI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETVI

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Price Return					
OFZ	119.3	▲	1.03	107.5	119.3
Muni	111.0	▲	0.13	109.6	112.8
Corp	111.4	▼	-0.04	110.7	112.1
Corp-10	115.3	▼	-0.03	115.1	117.8
Total Return					
OFZ	273.5	▲	0.86	233.3	273.5
Muni	347.7	▲	1.24	324.8	347.7
Corp	346.0	▲	0.65	323.6	347.2
Corp-10	347.2	▲	0.86	324.6	347.2
Объем торгов в сегменте (млн руб.)					
OFZ	462	▼	-231	0	22 514
Muni	981	▲	507	10	6 146
Corp	7 053	▲	2 082	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Совет директоров КБ «Кедр» принял решение о размещении биржевых облигаций серий БО-2 и БО-03 по 1,5 млрд руб., серии БО-04 – 2 млрд руб. Условиями выпусков предусмотрена возможность досрочного погашения по требованию владельцев и по усмотрению эмитента. /Интерфакс/

ОАО «Ростелеком» установило ставку первого купона облигаций 17-й серии на 10 млрд руб. в размере 8,55% годовых, что соответствует доходности к трехлетней оферте в размере 8,73% годовых. /Интерфакс/

ОК «Русал» продлил на год ковенантные каникулы по синдицированному кредиту на 4,75 млрд долл., договорившись с пулом кредиторов об отсрочке введения лимита долговой нагрузки. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке

02.11.2012 – пятница

Статистика США: Change in Nonfarm payrolls, Unemployment Rate, PMI Manufacturing

- Выплата купона: НС-финанс, БО-01 (10.5%, 104.7 млн руб.), Волгоградская область, 35002 (8.99%, 112 млн руб.), Россия, 26198 (6%, 2.5 млрд руб.), Газпром, 2017-2, EUR (LPN8) (5.44%, 27.2 млн руб.), Домашние Деньги, 01 (19%, 94.7 млн руб.), СИБУР Холдинг, 01 (10.47%, 78.3 млн руб.), Таттелеком, 04 (8.25%, 61.7 млн руб.)
- Оферта: БИНБАНК, 02 (1 млрд руб.), УБРиР, 02 (2 млрд руб.)
- Погашение: Россия, 26198 (42 млрд руб.), Национальный банк ТРАСТ, 2012 (Warehouse) (5.2 млрд руб.)
- Размещение: Русфинанс Банк, БО-03 (4 млрд руб.), АЛРОСА, БО-01 (5 млрд руб.), АЛРОСА, БО-02 (5 млрд руб.)

Сегодня: 06.11.2012 – вторник

Статистика США: ISM Non-Manufacturing

- Выплата купона: АЛРОСА, 2020 (7.75%, 38.7 млн руб.), Банк Русский стандарт, БО-06 (9.4%, 236.9 млн руб.), Газпромбанк, 2019 (LPN) (7.25%, 18 млн руб.), Интурист, ВАО, 2013 (CLN) (10.5%, 4.9 тыс долл.), Стратегия-лизинг, 02 (8%, 9.9 млн руб.), РОСБАНК, 8 (Аз) (6.9%, 172.9 млн руб.), РОСБАНК, 10 (А5) (7.4%, 185.5 млн руб.), Лукойл, 2014 (LPN) (6.375%, 28.6 млн долл.), Лукойл, 2019 (LPN) (7.25%, 21.7 млн руб.), Жилстрой (ранее ИК Стратегия), 02 (8%, 6.1 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 08 (8.25%, 79.1 млн руб.), РБК (ранее РБК-ТВ Москва), 2015 (LPN) (7%, 5 млн долл.), Россельхозбанк, 15 (8.75%, 436.3 млн руб.)
- Оферта: ОТП Банк, БО-03 (4 млрд руб.), Европлан, 03 (5 млрд руб.)

Завтра: 07.11.2012 – среда

Статистика Еврозоны: Retail sales

- Выплата купона: АЛРОСА, 2020 (7.75%, 38.7 млн руб.), Банк Русский стандарт, БО-06 (9.4%, 236.9 млн руб.), Газпромбанк, 2019 (LPN) (7.25%, 18 млн руб.), Интурист, ВАО, 2013 (CLN) (10.5%, 4.9 тыс долл.), Стратегия-лизинг, 02 (8%, 9.9 млн руб.), РОСБАНК, 8 (Аз) (6.9%, 172.9 млн руб.), РОСБАНК, 10 (А5) (7.4%, 185.5 млн руб.), Лукойл, 2014 (LPN) (6.375%, 28.6 млн долл.), Лукойл, 2019 (LPN) (7.25%, 21.7 млн руб.), Жилстрой (ранее ИК Стратегия), 02 (8%, 6.1 млн руб.), Волгоград, 34004 (17.5%, 31.5 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 09 (7%, 67.1 млн руб.), ДельтаКредит, 08-ИП (8.33%, 207.7 млн руб.), Группа Разгуляй, БО-16 (12%, 179.5 млн руб.), Волгоградская область, 34005 (7.75%, 115.9 млн руб.), Россия, 48001 (6.5%, 1.5 млрд руб.), Россия, 46017 (6.5%, 1.3 млрд руб.), РЖД, 07 (7.55%, 188.2 млн руб.)
- Погашение: Волгоград, 34004 (1.1 млрд руб.), РЖД, 07 (5 млрд руб.)
- Размещение: Ростелеком, 15 (5 млрд руб.)

Внешний рынок долга

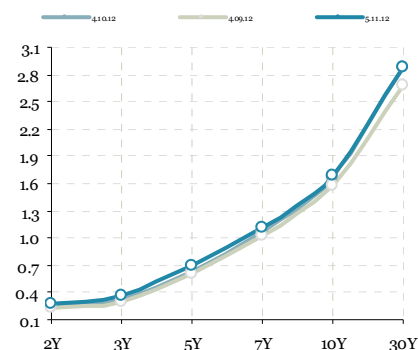
Данные по рынку труда США неплохи, но выборы важнее

Опубликованные в пятницу данные по рынку труда США за октябрь оказались заметно сильнее ожиданий. Занятость в несельскохозяйственных отраслях экономики увеличилась на 171 тыс. против ожиданий рынка в 125 тыс. Кроме того, данные за сентябрь и август были пересмотрены с повышением в сумме на 84 тыс. Тем не менее, показатель общей безработицы вырос с 7.8% до 7.9%, что произошло на фоне опережающего роста числа рабочей силы (578 тыс) над приростом общей занятости (410 тыс.). Снижение занятости в сентябре сразу на 0.3 пп базировалось на обратном процессе. Характерно, что поддержку рынку труда вновь начал оказывать производственный сектор: строительство добавило 17 тыс. рабочих мест, промышленность – 13 тыс. Госсектор сократил 13 тыс. человек, в сфере услуг драйвером является сезонный рост рабочих мест в розничной торговле. Качественные показатели рынка труда не выглядят оптимистичными: длительная безработица выросла на 158 тыс., длительность рабочей недели и средний заработок сократились. Стоит также отметить резкое падение числа временных рабочих мест (на 269 тыс.), которые в посткризисный период оказывали хорошую поддержку рынку труда.

Данные по рынку труда со всеми своими недостатками выглядят неплохо. Темп роста занятости пока недостаточен для снижения общего уровня безработицы, однако, эти цифры являются пока наилучшими во 2-ом полугодии. В то же время, для рынков сейчас гораздо важнее тема президентских выборов в США, результаты которых, судя по опросам, могут оказаться непредсказуемыми.

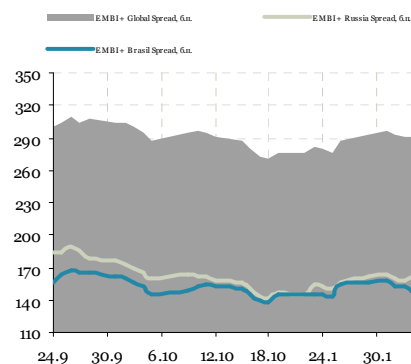
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



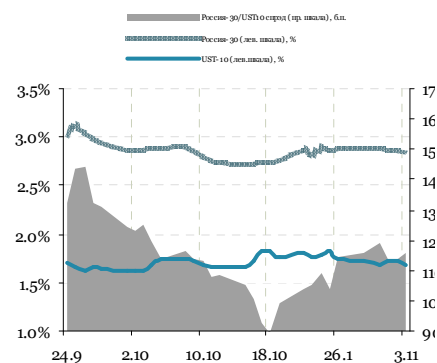
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВІ+ (Россия, Бразилия)



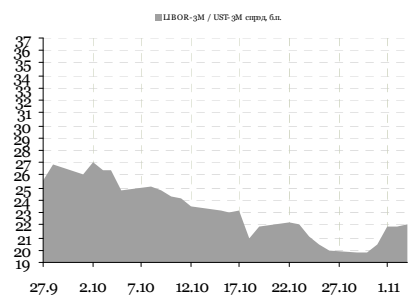
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Начало месяца для рынка выдалось нейтральным

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка остается невзрачной, несмотря на начало нового месяца. Уровень краткосрочных процентных ставок отступил от максимумов, однако по-прежнему выглядит завышенным. В пятницу на рынке МБК ставки по краткосрочным кредитам держались в пределах 6.25-6.5% годовых, междилерское репо на ММВБ обходилось в среднем под 6.30% годовых (-10 бп). На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банкам удалось привлечь весь заявленный объем в 263 млрд руб. против 330 млрд руб. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ сократилась на 31.2 млрд руб. до 737.6 млрд руб.

Российский денежно-кредитный рынок остается не в лучшей форме, традиционный приток бюджетных ресурсов в банковскую систему в начале месяца пока никак не сказывается на его условиях. На текущей неделе рынок должен продолжить медленное восстановление, ставки МБК по кредитам овернайт, вероятно, опустятся ниже 6.0% годовых.

Рубль дешевеет на падающей нефти

Торги на валютном рынке в пятницу завершились ослаблением рубля по отношению к бивалютной корзине на 6 коп. до отметки 35.49 руб. Спокойный внутренний фон заставляет инвесторов переключиться на настроения мировых площадок, где наблюдается снижение спроса на рискованные активы. В пятницу котировки нефти Brent на момент российских торгов подешевели на 1.5 долл. до 106.4 долл. за барр., а к окончанию суток и вовсе опустились ниже уровня 106 долл. за барр. Сегодня ситуация для рубля выглядит нейтральной, нефть торгуется чуть выше уровня в 107 долл. за барр., а инвесторы склонны занять выжидательную позицию до объявления итогов президентских выборов в США.

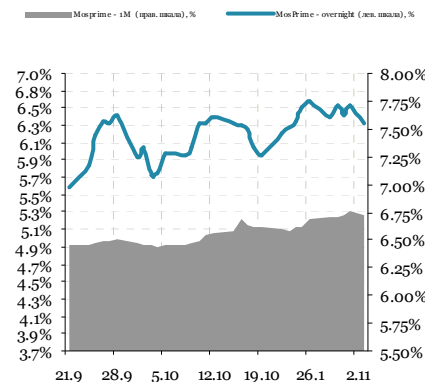
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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		
Вторник	Аукцион Казначейства	5 недель, 75 млрд руб., от 6.2% годовых
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26209 (10 лет), 35 млрд руб.
	Возврат Казначейству	75 млрд руб.
Четверг	Купоны ОФЗ	2.9 млрд руб.
	Аукцион Казначейства	5 недель, 50 млрд руб., от 6.2% годовых
Пятница	Возврат ВЭБу	10 млрд руб.
	Возврат Казначейству	47 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

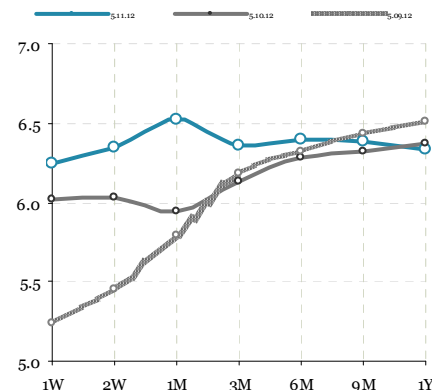
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды в неопределенности

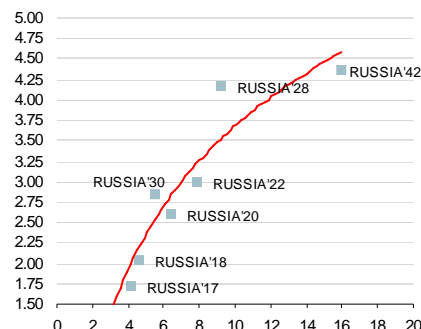
Российский сегмент провел последние торговые дни в узких ценовых диапазонах. Котировки суверенных бумаг слабо отреагировали на октябрьские данные по рынку труда США, находясь под давлением предвыборной неопределенности и возможных сложностей с получением очередного транша греческой помощи. Цены «тридцатки» остались на уровне 126.75%, дальний Россия'42 подошел ближе к отметке 121%. Корпоративный сектор в понедельник преимущественно дешевел, но потерял в ценах незначительно – в среднем по рынку немногим более 10 бп. Чуть слабее рынка выглядели дальние выпуски Северстали, Евраза и Вымпелкома, завершившие день снижением в среднем более чем на 25 бп.

Локальный рынок в режиме ожидания

Рынок рублевого долга провел последний день недели малоактивно: обилие событий на мировых рынках в первой половине предстоящей недели не располагали для наращивания позиций на длинные выходные. В результате активность на рынке ОФЗ в течение дня оставалась подавленной, а основной оборот был сосредоточен на ближнем участке кривой, на дальней дюрации цены менялись разнонаправлено и в среднем изменения не превышали 10 бп. В корпоративном секторе основная активность была сосредоточена в банковских бумагах: Промсвязьбанк БО7, Юникредит БО4, ВЭБ 09, Газпромбанк 06, РЕСО-Гарантия 02, выше по уровню кредитного риска сделки проходили в выпусках Крайинвест БО1 и ОТП Банк 02.

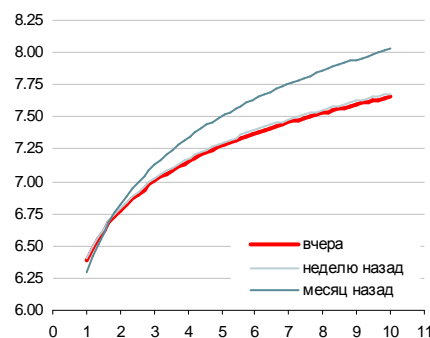
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



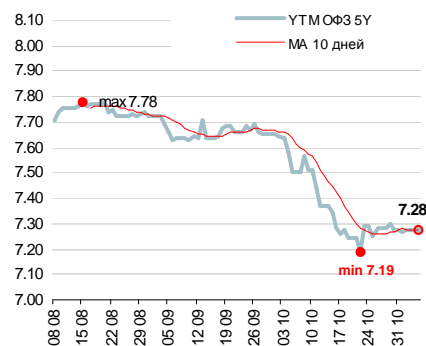
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



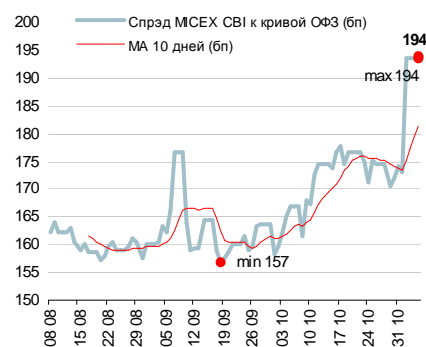
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



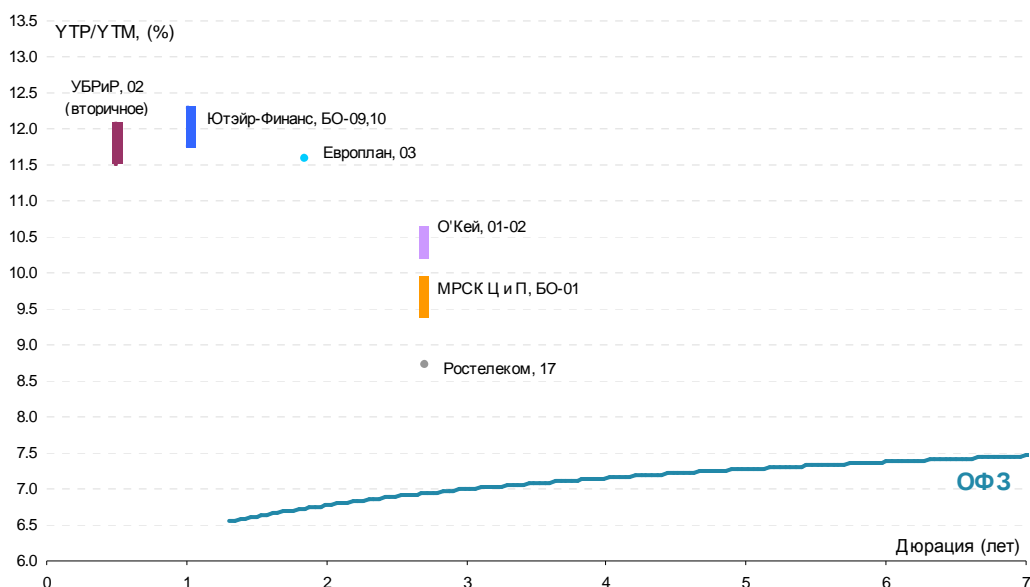
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
Европлан, 03	- / - / BB-	да	3 500	11.57	01.10.2012	06.11.2012	нет / 1.84 г.	2 г. / 5 лет
УБРИР, 02 (вторичное)	B / - / -	да	2 000	11.50-12.05	02.11.2012	07.11.2012	нет / 0.48 г.	0.5 г. / 1.5 г.
Ростелеком, 17	BB+ / - / BBB-	да	10 000	8.73	01.11.2012	08.11.2012	да / 2.70 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
Ютэйр-Финанс, БО-09	NR	нет	1 500	11.74-12.28	14.11.2012	16.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Ютэйр-Финанс, БО-10	NR	нет	1 500	11.74-12.28	14.11.2012	16.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Baa2 / -	да	4 000	9.41-9.94	XX.11.2012	XX.11.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Bid cover/Размещ. объем	Ориентир УТР/УТМ	Фактическая УТР/УТМ	Дата размещения	Амортизация/Дюрация
Русфинанс Банк, БО-03	- / Baa3 / BBB+	да	4 000	1.1 / 100%	9.73-10.25	10.25	02.11.2012	нет / 1.86 г.
АПРОСА, БО-01	BB- / Ba3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
АПРОСА, БО-02	BB- / Ba3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
Связь-Банк, БО-01	BB / - / BB	да	5 000	1.2 / 100%	9.20-9.46	9.20	01.11.2012	нет / 1 г.
ЮниКредит Банк, БО-05	BBB / - / BBB+	да	5 000	2.0 / 100%	9.31	9.31	30.10.2012	нет / 1.88 г.
Трансфин-М, БО-11	NR	нет	2 000	н/д / 100%	н/д	10.78	29.10.2012	нет / 2.64 г.
Роснефть, 04	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
Роснефть, 05	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
МОЭСК, БО-02	BB- / Baa2 / -	да	5 000	3.7 / 100%	8.99-9.20	8.99	29.10.2012	нет / 2.69 г.
Почта России, 02	- / - / BBB	да	3 000	1.1 / 100%	8.89-9.10	8.89	26.10.2012	нет / 2.7 г.
Почта России, 04	- / - / BBB	да	3 000	1.1 / 100%	8.89-9.10	8.89	26.10.2012	нет / 2.7 г.
ЮниКредит Банк, БО-04	BBB / - / BBB+	да	5 000	2.0 / 100%	9.41-9.73	9.31	26.10.2012	нет / 1.88 г.
Внешпромбанк, БО-02	B / B2 / -	да	3 000	н/д / 100%	12.10-12.63	12.36	26.10.2012	нет / 1 г.
Группа ЛСР, 04	- / B2 / B	да	5 000	н/д / 56%	11.83-12.10	11.57	26.10.2012	нет / 1.84 г.
Банк Ингеза, БО-01	- / Baa1 / -	да	3 000	1.8 / 100%	9.73-10.25	9.99	25.10.2012	нет / 1.43 г.
РСХБ, 18	- / Baa1 / BBB	да	5 000	н/д / 100%	8.52-8.58	8.52	25.10.2012	нет / 1.88 г.
Российский Капитал, 03	- / - / B+	да	3 000	1.1 / 100%	10.78-11.30	11.09	25.10.2012	нет / 1 г.
ФСК ЭЭС, БО-01	BBB / Baa2 / -	да	10 000	2.7 / 100%	8.37-8.58	8.26	24.10.2012	нет / 2.3 г.
ФСК ЭЭС, 21	BBB / Baa2 / -	да	10 000	2.3 / 100%	8.99-9.20	8.94	24.10.2012	нет / 3.8 г.



Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ОФЗ													
ОФЗ 26198		02/11/12	99.98	100.00	100.00	0.01	9	19 171	5.66	0.00			42 000
ОФЗ 25072		23/01/13	100.24	100.25	100.25	-0.06	39	365 555	6.06	0.23			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.16	100.17	100.17		14	12 810	6.09	0.27			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.35	102.43	102.43	-0.02	2	1 174	5.92	0.39			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.05	100.40					6.12	0.70			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	99.66	100.70	99.55	-1.00	1	10 000	7.23	0.93	88	91	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.67	100.71	100.71	-0.02	3	2 780	6.64	1.31	11	37	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.00	109.20					6.54	1.65		31	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.03	109.10	109.06	-0.04	11	130 350	6.76	1.91	2	57	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.85	103.40	103.05	0.18	4	250 582	6.60	1.88		41	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.40	100.55	100.52	-0.08	12	655 020	6.89	2.35	4	72	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.10	100.20	100.17	-0.03	4	2 006	6.92	2.46	4	75	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.37	101.45	101.45	0.12	10	650 146	6.95	2.87		80	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.25	98.58	98.58	-0.02	1	1	6.99	2.91	2	84	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.90	100.05	100.05	0.03	7	203 318	7.00	3.32		84	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18							8.68	3.32	164	252	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19			80.35	0.10	1	350	8.31	3.52	124	214	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.57	103.05	101.75	0.05	2	2	7.06	3.88		88	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.65	101.75	101.75	-0.03	9	111 046	7.07	3.90		89	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.40	102.65	102.60	0.40	3	3	7.03	4.51		82	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.80	92.00	91.80		2	50 020	7.41	4.53	20	120	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	97.00	99.87	99.87	0.36	6	16	7.15	4.66		94	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.11	102.20	102.05	-0.15	5	51 554	7.22	5.11		98	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		68.00					7.87	5.50	55	158	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.50	96.00	96.00	-0.20	9	11 980	7.53	6.19	15	115	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.05	102.15	102.10	-0.10	11	323 622	7.40	6.40		99	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	101.90		102.05	0.05	5	2 161	7.43	6.95		95	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		88.20	87.00	0.80	2	6	7.89	7.40	41	134	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	104.21	104.35	104.35	0.15	23	579 658	7.79	8.68	22	107	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	84.50	88.70					8.15	10.89	46	113	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		90.00					6.50	11.21			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.25	100.00	99.70		3	47 380	7.54	0.73	133	121	15 000
---------------	--	----------	-------	--------	-------	--	---	--------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО5		30/10/12							-3.74	0.00			10 000
НЛМК ВО1		04/12/12							6.91	0.09		53	5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.06	100.20					7.63	0.34		129	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.58	100.70	100.66	0.07	1	1	7.78	0.61	167	144	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.58	100.63	100.60	-0.04	1	1	7.88	0.61	177	154	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.80	101.05					8.35	1.74	166	214	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.13	101.25	101.25	0.10	9	190 502	8.44	1.82	173	224	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.01	100.09	100.01	-0.18	3	351	8.67	2.18	186	250	5 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12	99.02	100.01					7.73	0.04			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.75	99.95	99.95		2	6 000	7.90	0.42		156	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15		100.20					8.40	0.77	216	207	5 000
ММК ВО4		27/02/14	98.91	99.30					8.45	1.27	193	217	5 000
ММК ВО6		10/07/14		97.69	97.69		1	10 000	8.88	1.58	224	265	5 000
ММК ВО7		22/07/14	96.01	99.00					8.76	1.62	211	253	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.58	100.70	100.62	-0.06	8	38 999	7.62	0.29		128	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.57	100.62					7.55	0.29		121	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.20	100.30	100.22	-0.08	1	1	8.13	0.63	200	180	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.15	100.20	100.20	-0.10	10	90 602	8.17	0.64	203	184	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.77	100.95	100.95	0.18	1	5	8.82	2.35	197	265	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.77	101.05					8.79	2.36	193	262	3 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.41	100.60	100.41	-0.17	2	10 410	8.27	0.39		193	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.40	100.50	100.40	-0.10	1	500	8.30	0.39		196	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.90	108.10	108.10		1	1	9.09	1.78	239	288	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.81	108.09	108.10	-0.10	2	122	9.09	1.78	239	288	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.10	101.99					9.33	2.65	241	317	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.10	101.70	101.35	0.24	2	50 000	9.64	2.65	272	348	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	91.00	99.00					10.34	3.06	334	419	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	93.03	100.00	95.00		1	10	10.35	3.05	335	420	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.50	100.25	100.21	0.30	4	20 006	9.09	2.16	228	291	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.65	99.85	99.85		8	80 502	9.27	2.16	246	309	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.50	99.96	99.60	-0.36	5	7 391	9.39	2.17	258	322	10 000

Мечел



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 ВО1	11/11/11	09/11/12							9.08	0.02			5 000
Мечел ВО2		12/03/13	99.00	99.17	99.20	0.06	1	263	12.37	0.36	603		5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	99.10	100.50					-9.68	0.45			5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.60	98.80	98.60	0.20	6	309	13.27	0.48	693		5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.35	97.00	96.50		8	10 097	13.98	0.59	788	764	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	100.35					11.26	0.71	506	493	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.01	95.88	95.10	0.08	3	61	15.08	1.21	859	880	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	91.53	92.94					15.82	1.24	932	954	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.56	92.82					16.32	1.24	982	1 004	5 000
Мечел ВО5		07/04/15	99.50						11.81	2.22	499	564	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.81	2.22	499	564	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.81	2.22	499	564	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.81	2.22	499	564	3 000
Мечел ВО6		07/04/15	99.50						11.56	2.18	475	539	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	91.00	93.94	91.51	0.46	18	724	14.17	2.49	728	800	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	90.10	91.79	91.79	1.79	5	11	14.03	2.48	715	786	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	83.20	89.00					11.78	3.00	479	563	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.39	86.00	85.96	-0.04	1	1	13.91	3.02	692	776	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	83.65	84.49	83.65	-0.85	4	407	14.88	3.02	789	873	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13		99.95					9.39	0.95	303	308	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.40	100.60	100.56		7	322	8.62	0.65	247	229	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.02	97.30	97.30	-0.73	2	555	13.45	1.05	704	715	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.02	91.49	91.49	1.49	8	4 049	15.78	1.46	919	953	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.04	100.45	100.45	0.01	7	741	7.36	0.09		98	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.01	97.69	97.66	0.66	2	6	10.61	1.45	402	436	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.05	93.48	93.15	0.10	22	6 207	14.58	1.27	806	831	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.53	87.97	88.00	0.50	1	3	15.01	2.24	818	884	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 07		07/11/12							5.67	0.02			5 000
РЖД ВО01		05/12/12	100.00	100.25	100.25		1	200	6.64	0.09		26	15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.38	99.68	99.38	-0.22	1	60	7.67	0.98	129	136	15 000
РЖД 10		06/03/14	109.10	109.23	109.23	-0.06	14	209 698	7.76	1.25	125	148	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.09	102.30	102.30	0.05	1	159	8.01	2.04	123	183	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.29	99.59					8.22	2.68	130	206	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.27	99.40	99.30	-0.10	1	10	8.29	3.10	128	214	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	108	210	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.50	100.15					7.75	0.88	143	143	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.50	100.15	99.92	0.02	1	1	7.36	0.88	104	104	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	100.80	101.15	101.15	0.20	3	1 420	7.86	1.48	126	161	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.00	101.53					8.01	1.85	129	181	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	99.85	100.00	99.90	-0.13	1	5 000	8.31	2.28	147	214	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.75	99.40					8.18	2.63	127	202	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.00	98.70					8.16	2.73	123	200	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	97.01	100.00					8.26	3.09	126	211	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	99.95	100.10					8.76	3.38	171	260	15 000
ФСК ЕЭС 21		06/10/27							8.94	3.81	182	277	00000 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	96.75	97.45					8.83	4.19	166	264	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	96.75	97.45					8.83	4.19	166	264	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	96.00	96.50					9.05	4.58	183	284	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.70	97.45					9.12	6.08	175	276	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.90	100.10	99.96	0.01	1	1	9.22	2.28	238	305	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.00	102.00					9.66	3.22	263	350	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	94.03	101.90	99.31	-0.04	4	1 048	9.95	0.96	359	364	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	86.00	99.00					9.38	2.69	245	322	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.30	98.80		2	2	9.37	2.98	239	322	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20	99.30		2	2	9.19	2.98	221	304	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.61	222	314	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.46	3.61	237	329	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	86.00	100.20					9.35	3.61	226	318	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	100.20	100.85	100.20	-0.10	3	15 132	8.25	1.34	171	198	7 000

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	
НЕФТЬ и ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром Капитал-3	08/11/12	06/11/14							7.51	0.02			15 000
Газпром А9		12/02/14	99.50	99.85	99.80	-0.06	1	5	7.52	1.23	102	124	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.38	109.50	109.38	-0.12	2	280	7.70	1.47	110	145	5 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							6.17	0.12			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							6.17	0.12			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.05	100.15	100.05		1	500	7.48	1.04	107	118	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.55	101.00	98.55	-0.01	2	75	8.42	0.21		207	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13		100.50					7.88	0.44		154	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13		101.05					7.26	0.44		92	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	92.00	100.75					8.41	2.07	163	223	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.56	100.80					8.46	2.86	150	231	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.00	100.65					8.47	2.87	151	232	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.30	102.20					8.77	4.24	159	258	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	96.60	98.74	98.00		1	7	8.86	4.47	166	266	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	86.00	100.10					7.62	0.63	149	129	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	99.75	100.10	99.80	-0.35	2	10 000	8.60	2.66	168	244	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.15					8.48	2.66	156	232	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75	100.10					8.48	2.66	156	232	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.27	99.70	99.66	0.21	2	872	7.79	0.87	148	147	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.50	100.75	100.71	-0.05	2	794	6.83	0.13		46	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.50	100.70					7.70	0.13		133	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.50	100.80					7.70	0.13		133	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.20	101.72	101.26	-0.09	3	85 868	8.27	1.03	187	196	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	100.01	101.25					8.78	2.08	199	260	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	95.01	100.40					10.25	0.72	404	392	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	96.35	99.70	98.66	-0.04	6	800	10.66	1.19	418	438	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	92.00	95.59	94.51	0.01	1	1	11.01	3.04	402	486	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	92.00	97.99	94.51	0.01	1	1	11.01	3.05	402	486	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.00	99.20	99.00		6	2 025	14.07	0.70	788	774	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	97.00	97.50					9.52	3.11	251	337	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.20	100.59	100.59	-0.06	3	397	7.88	0.67	171	155	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.05	100.15	100.15	-0.01	14	239 500	7.56	0.14		119	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.90	100.15	100.15	-0.10	1	2 533	7.49	0.23		114	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.89	101.00					7.81	0.36		147	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.70	100.09	100.09	0.09	4	350	7.54	0.36		120	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.70	100.09					7.60	0.36		126	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.00	100.08					8.05	0.81	178	172	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.35	100.00	99.35	-0.60	1	50	8.36	0.93	201	204	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.05	100.20					8.24	1.30	171	197	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.15	100.17					8.28	1.30	175	201	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90						8.68	2.60	177	252	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.60	177	252	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90	100.15					8.20	0.55	214	186	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.21	101.00					8.93	1.93	219	274	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.08	100.15	100.10	-0.05	8	17 873	8.21	0.79	196	188	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.60	99.79	99.60	-0.15	2	2	8.89	0.19		253	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	98.77	99.75					7.96	0.32		162	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17							7.72	0.47		138	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14							8.42	0.68	224	209	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60	99.15		2	9 901	8.35	0.71	215	202	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17							7.68	1.06	126	138	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.50	100.50					8.94	1.18	246	265	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20		99.65	99.65	-0.15	3	80 002	7.41	0.96	105	110	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.00	100.30					8.57	2.16	176	239	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32							8.73	2.70	180	257	00000 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32							8.73	2.70	180	257	00000 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.50	98.10	98.10	-0.24	6	50 012	8.74	3.02	175	259	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.68	3.38	163	252	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.61	96.84	96.84	0.04	4	4	8.89	4.18	172	270	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21		99.50	99.30	0.25	2	2	8.18	1.39	162	192	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 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.40					8.41	1.87	168	221	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.80	101.00	100.80	-0.05	3	8 749	8.53	1.87	180	233	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.35	100.65					8.76	1.99	200	258	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.00	99.70					9.14	3.03	215	299	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21		99.80					9.14	3.03	215	299	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.71	100.55					8.41	1.34	187	214	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.40	100.65					9.04	1.68	237	282	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19	100.00	100.15	100.05	-0.15	3	1 592	9.21	0.06			5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19	100.00	100.40					6.52	0.06			5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.35	101.00	100.35	0.03	3	9 001	7.71	0.27		137	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.35	100.50	100.35		1	10 000	7.73	0.27		139	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.30	99.59	99.32	0.02	1	42 116	8.16	0.59	206	182	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.34					7.84	0.74	162	151	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.34					7.89	0.75	166	156	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13		100.29					8.05	0.80	179	172	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.25	100.29					8.06	0.80	180	173	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						6.75	0.90	42	43	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.00	100.36					7.97	0.97	160	166	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21							7.90	0.95	154	159	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.25	101.35	101.25	-0.05	1	15 000	8.35	1.22	186	207	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	84.50	100.50					8.48	1.68	181	226	5 000
РСХБ 18		13/10/22							9.00	1.88	227	280	
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22							8.53	1.88	180	233	00000 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.90	101.00					8.61	2.25	178	244	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.60	98.61	97.85	0.25	1	50	8.79	2.41	192	262	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.80	98.15					8.81	2.42	194	264	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.80	98.80	97.85	0.05	1	80	8.79	2.42	192	262	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12	99.60		99.85		1	700	11.00	0.04			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12	99.60		99.85		1	800	9.60	0.06			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.10	100.16					7.84	0.15		147	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.15	99.34	99.25	0.05	1	1	7.97	0.70	178	164	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13							7.49	1.05	108	119	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	86.00	100.83					7.92	1.20	143	164	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.68	100.77	100.75	0.07	1	5 000	8.53	1.58	190	229	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	175	252	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	175	252	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	175	252	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	175	252	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14		99.75					7.84	1.15	138	155	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.42	1.73	173	221	7 000
АИЖК А9		15/02/17							7.99	1.83	127	179	5 000
АИЖК А7		15/07/16	93.00	100.00					8.25	1.88	152	206	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.30	99.50	99.40	0.15	2	18 484	8.21	2.29	137	204	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	97.95	97.95	-0.55	1	3	8.65	2.75	171	249	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.15	99.30					8.60	2.98	162	245	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.10	99.20					8.51	3.04	152	236	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.75	3.15	174	260	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	99.09					8.73	3.80	161	256	10 000
АИЖК А16		15/09/21		100.00					9.35	4.92	209	312	10 000
АИЖК А17		15/04/22		101.50					8.97	5.53	165	268	8 000
АИЖК А20		15/12/27							8.88	8.37	133	220	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	100.30					8.98	1.04	257	267	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.18					8.98	1.04	257	267	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	98.00	100.00					9.58	1.62	293	335	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.00					9.51	1.62	286	328	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.90	100.10					7.67	0.29		133	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.08	100.01	0.01	1	1	8.02	0.76	179	169	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.60	99.85					8.07	0.99	169	176	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	99.91					8.42	1.40	185	216	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	99.90	100.20	100.03	-0.22	3	35 000	8.08	0.61	196	174	10 000
МТС 1		17/10/13	99.10	99.75					8.03	0.94	168	172	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14		99.07	99.00	-0.17	8	144 005	8.27	1.46	168	202	15 000
МТС 2		20/10/15	97.54	98.80	98.80	0.32	5	5	8.38	2.70	145	222	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.02	99.05	99.04	-0.10	6	21 502	8.70	2.64	178	254	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.61	99.90					9.06	3.26	203	290	15 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
МТС 7		07/11/17	98.63	99.00	98.75	-0.25	2	2	9.22	4.01	208	304	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.88	100.98					8.08	0.69	190	175	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.86	98.10	97.85	-0.45	1	10 000	8.98	1.58	235	275	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.28	99.60	99.55	0.04	5	51 005	9.26	2.19	245	309	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.26	99.60	99.60	-0.10	10	137 811	9.24	2.17	243	307	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.27	99.85	99.51	-0.19	8	50 910	9.28	2.17	247	311	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.51	98.00	97.50	-0.99	3	10 000	9.50	2.66	258	334	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.52	98.50	98.00	-0.50	4	19	9.29	2.66	237	313	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	99.85	100.10					8.24	1.82	153	204	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.49					7.74	0.59	164	140	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.35	99.60					7.93	0.51	191	159	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.50	100.80					8.55	1.21	206	227	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.50	101.69					7.61	1.21	112	133	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.00	100.13					9.14	2.24	231	297	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.00	106.50					8.91	3.11	190	276	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.00	97.00					9.96	3.10	296	381	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.05	107.00					9.95	3.10	295	380	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13		99.90					7.97	0.32		163	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	100.00	100.12	100.00	-0.12	1	5	8.40	0.84	211	208	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.50	100.12					8.25	0.84	196	193	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	100.05	101.10	100.05	-0.05	1	10 000	8.34	0.84	205	202	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	100.01	100.12					8.25	0.84	196	193	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.30	99.45	99.30	-0.14	1	10 000	8.74	1.27	222	246	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.00						8.53	1.42	195	227	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.15	100.20	100.20	-0.15	4	27 000	9.01	2.59	210	285	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.00	100.00					7.90	1.48	130	165	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00						9.06	1.55	243	282	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.15	100.25	100.18	-0.06	30	90 000	9.64	2.60	273	348	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.80	99.00					9.03	0.71	283	270	3 000
Копейка БО-2		01/10/13		100.00	99.96	-0.50	2	18	9.35	0.88	303	303	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.01	99.44	99.49	0.64	4	395	11.25	0.53	522	491	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13							9.35	0.96	299	304	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.07	101.00					9.71	0.90	338	339	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.93	438	494	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.61	100.00	99.61	-0.39	1	1	13.51	0.62	739	717	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.22	94.00					11.57	2.27	474	540	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	96.00	96.25					11.51	1.61	486	528	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	96.70	99.45	96.70	0.70	1	1	9.56	1.72	288	334	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.00	96.00					10.86	1.18	439	457	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.05	100.15	100.05	0.05	1	10 000	8.64	0.13		227	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.65	98.95	98.65	-0.25	2	10 455	9.98	1.20	350	370	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	86.00	101.60	100.10		1	60	10.73	2.57	383	457	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.29	100.08					9.29	0.12		292	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.45	99.64	99.40	-0.15	1	1	9.93	0.80	367	360	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.35	99.50					11.37	0.95	501	506	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.45	100.75					8.79	0.84	250	247	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	86.00		100.03	0.03	3	3	8.06	0.14		169	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14		100.05	100.00	0.25	1	5 000	9.19	0.47		285	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	98.00	99.90	99.72		4	60	9.06	0.47		272	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	100.00					8.14	0.86	184	182	5 000
СОЛЛЕРС													

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	
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.02	100.99	100.00		1	15	9.46	0.50		312	2 000
Соллерс 2		17/07/13	102.20	102.45					9.30	0.68	313	297	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.45	100.55	100.55	0.09	8	5 100	10.73	2.04	395	455	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	100.00	100.10					7.85	0.43		151	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.20	100.00	-0.05	4	6 000	7.88	0.43		154	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.40	100.68					7.32	0.32		98	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.55	1.67	188	233	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.50	99.60					9.96	1.42	338	370	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.00	100.89					10.01	2.11	322	383	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.00	100.40					10.05	2.11	326	387	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.63	99.93	99.90	-0.04	6	4 161	12.97	0.81	670	664	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.90	100.00	99.90	-0.04	24	6 508	13.00	0.95	665	669	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.55	101.00	101.00	-0.05	2	14 000	10.25	0.39		391	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.55	101.60					10.94	0.39		460	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.20						12.68	0.48		634	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.20	100.00					10.38	0.48		404	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.62	0.57	254	228	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.00						10.38	1.02	398	407	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							7.82	1.08	139	152	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.01	97.89					11.84	1.32	531	557	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	94.02	98.90					10.34	1.32	380	407	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.73	3.18	171	257	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру гидро 1	22/04/16	12/04/21	94.01	99.00					8.52	3.09	152	237	10 000
Ру гидро 2	22/04/16	12/04/21	94.54	98.99					8.63	3.09	163	248	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16							8.26	0.31		192	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.20	100.39	100.20	-0.05	2	7 660	8.16	0.10		178	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.00	100.25	100.00	-0.25	1	1	8.99	2.58	209	283	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60					8.58	2.27	175	241	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.22	100.49					7.79	0.61	168	145	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	95.81						8.52	1.55	190	228	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	100.00					12.55	1.52	593	631	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	82.50	89.99					15.99	3.02	900	984	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.75	100.00	99.87	0.82	3	10 202	9.20	2.65	228	304	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	94.03	99.47					8.90	1.70	222	268	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.64	0.15		127	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.00	98.70	-0.05	2	1 310	8.92	0.65	277	259	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70	100.00					8.56	1.30	203	229	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	97.20	99.50					9.23	0.76	300	290	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	82.54	83.70	83.70	2.03	24	924	34.14	0.85	2784	2 782	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17		98.80					10.42	0.92	408	410	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	105.86						9.85	0.97	348	354	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	86.00	99.10					7.51	1.38	95	125	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	100.01	100.07					8.27	0.82	199	195	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13							7.56	0.48		122	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.61	98.20					10.06	0.81	379	373	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	99.50	100.99					9.02	2.36	216	285	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.22	2.65	230	306	5 000
АКРОН													

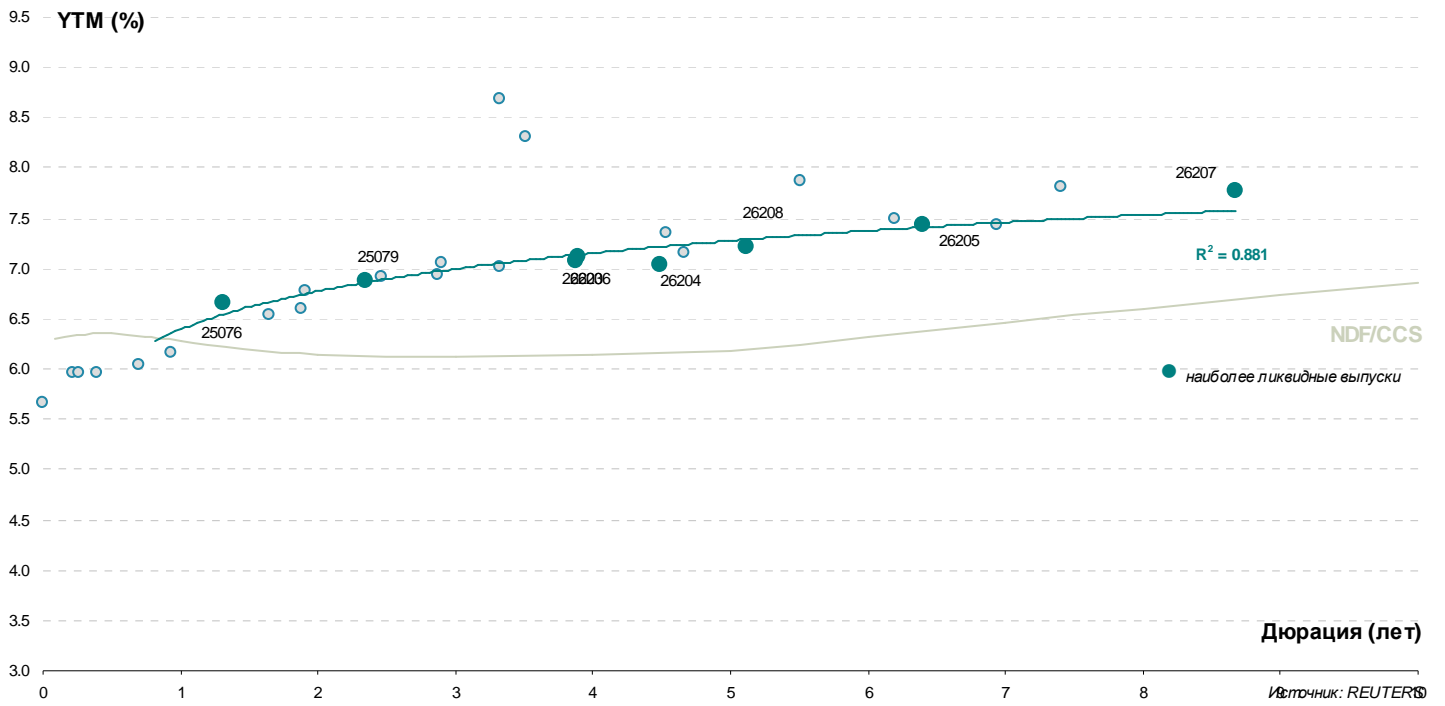
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	98.81	103.28	100.00		1	1	8.35	0.86	205	203	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	100.00	102.10	101.50	0.04	1	1	8.50	0.98	212	219	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	100.00	100.50	2.20	10	8 000	7.74	1.45	115	149	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	100.00					9.34	1.51	273	310	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.02	100.35	100.35	-0.10	2	5 001	9.84	2.62	293	368	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	97.97	98.70	98.48	-0.61	1	10 000	9.99	1.38	343	373	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Гру ппа 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.39					9.49	0.25		314	5 000
ЛСР Гру ппа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.13	0.62	401	379	2 000
ЛСР Гру ппа БО-2		10/09/13	100.15	100.35	100.40	-0.04	1	1 180	9.70	0.83	342	338	2 000
ЛСР Гру ппа 3	14/03/14	08/09/17	100.01	100.70	100.60	-0.05	4	2 740	11.29	1.28	477	502	3 000
ЛСР Гру ппа БО-3		20/03/14	98.15	98.45	98.41	0.11	10	5 968	11.04	1.31	451	477	2 000
ЛСР Гру ппа БО-5		24/07/14	95.80	96.00	96.00		2	203	11.37	1.61	473	514	2 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.95	100.00	100.00	0.02	3	11 190	11.12	0.13		475	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	100.50	100.99	100.55	0.44	7	6 977	13.75	1.36	720	749	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.50	100.90					7.94	0.10		156	2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.07	101.75					8.97	0.32		263	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.49					9.29	4.10	213	310	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.50					9.38	4.10	222	320	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.40	99.50					9.33	4.10	217	314	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.30	100.35	100.40		1	560	7.12	0.08			19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.61	100.71	100.71	0.11	1	590	7.71	0.35		137	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	100.00	100.10					8.48	1.66	182	226	20 000
АФК Система 4		15/03/16	92.38	99.30	98.56	0.19	6	624	8.61	1.90	187	242	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	97.24	97.97	97.95	0.55	2	100	14.02	0.68	784	769	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.10	100.30	100.30	0.25	3	521	11.77	0.60	566	543	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.00	100.15					12.21	0.90	588	589	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.00	100.70	100.40	0.10	1	1	8.33	0.52	231	199	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13							8.53	0.62	240	219	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	99.00	105.00	99.50	0.20	1	1	8.93	0.66	277	260	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13							8.77	0.96	241	246	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	99.71	100.10	100.05	0.45	8	163 045	9.47	1.73	278	326	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14							9.59	1.84	287	339	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	96.00						7.62	0.58	154	128	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.00	100.09	100.09	0.04	3	601	8.50	0.89	218	218	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	97.50	99.70					8.54	1.20	205	226	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.00	100.05	100.00	-0.05	3	200 000	8.77	1.27	226	249	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.35	100.40	100.40	-0.04	4	22 003	7.38	0.08			5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	98.62	100.17	100.06	-0.05	4	602	9.03	0.12		266	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.00	100.12	100.08	-0.13	2	490	9.10	0.67	293	277	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.12	1.33	258	285	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14		99.85	99.78	0.03	3	9 951	8.66	0.46		232	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	99.92	100.00					9.09	0.59	299	275	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.12	100.35	100.12	-0.03	7	70 640	9.15	0.75	292	282	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.45	99.90					9.04	0.79	278	271	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.75	100.18	100.00		1	1	9.29	1.25	278	301	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.95	100.08	100.00		1	1	9.71	1.53	309	347	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/12	15/11/14	100.02	100.05					8.22	0.04			3 000
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.95	99.98	99.95	0.05	10	18 528	8.03	0.07			5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.15	100.25	100.15	-0.01	2	5 500	8.41	0.27		207	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.15	100.25	100.22	0.07	1	1	8.20	0.29		186	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО1	07/04/12	07/04/13	86.00	100.50					8.88	0.43		254	5 000
Банк ЗЕНИТ 5	05/06/12	04/06/13	100.30	100.45					8.37	0.57	230	203	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.35	100.50					8.55	0.64	241	222	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.26	100.32	100.30	0.05	2	226	8.98	0.80	272	265	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.63	0.87	132	131	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.05	100.40	100.20	-0.13	2	1 135	9.25	1.38	269	299	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк ВО2	20/02/13	18/02/15	100.05	100.10	100.10	0.10	1	1	8.51	0.30		217	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 ВО4	20/02/13	18/02/15	86.01	100.10	100.02	-0.08	2	1 002	8.79	0.30		245	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.50	99.56	99.52	-0.13	4	8 503	9.23	0.61	312	289	5 000
Промсвязьбанк ВО3		04/02/14	98.00	99.44	99.01	0.01	2	192	9.65	1.20	317	337	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.00	100.15	100.15	-0.14	9	180 003	10.30	1.71	362	408	5 000
Промсвязьбанк 13		01/02/18	99.00	101.70	101.50	-0.20	2	2	12.20	3.93	507	602	5 000
Банк СПБ													
Банк СПБ ВО1	09/10/12	09/04/13							8.26	0.04			5 000
Банк СПБ ВО4	13/12/12	12/12/13		100.10					6.73	0.12		36	3 000
Банк СПБ ВО2	26/03/12	23/09/13	99.90	100.38					8.32	0.87	201	200	5 000
Банк СПБ ВО8	07/10/13	05/10/15	100.21	100.29					9.36	0.91	303	304	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.25	100.40	100.27	0.02	1	1	8.20	0.21		185	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.85	99.95					8.92	0.31		258	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.90	99.94					9.61	0.48		327	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.50	99.89					10.06	0.88	375	374	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	86.00	100.06					9.97	0.92	363	365	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.81	100.05					10.54	1.38	398	428	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.05	98.42					10.73	1.51	412	449	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.58	100.70					8.04	0.13		167	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	101.25					8.87	0.82	260	255	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	99.91	100.19	99.91	-1.09	2	2	9.50	0.79	325	317	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.05	100.50					9.42	1.24	292	314	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.60	99.90	99.81	-0.08	1	1	9.16	0.84	287	284	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.96	100.07	99.96	0.01	4	502	9.95	1.26	344	367	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.15	100.25					9.54	0.61	343	320	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.00	100.05					9.75	0.67	358	342	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.90	98.99					10.20	0.88	389	388	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.95	101.05					10.96	1.04	455	465	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00	100.50	-0.50	4	2 000	11.48	1.05	507	518	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.30	100.59					11.19	1.25	468	491	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.35	101.60					11.10	1.96	435	492	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	100.80	101.40	100.82	0.02	1	4 050	11.56	2.01	479	538	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.35	98.60	98.70	0.10	6	15 390	12.03	0.73	581	570	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.11	100.60	100.10	-0.35	7	35 001	13.09	0.74	687	676	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.25	100.30	100.26	-0.04	1	1	13.02	0.46		668	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	100.25	100.48	100.25	-0.15	3	1 041	13.88	0.67	771	755	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	103.71	104.27	104.27	-0.20	20	4 173	14.05	0.69	787	772	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	100.52	101.76					14.01	0.85	771	769	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.44	102.50	102.43	-0.02	11	1 609	14.42	0.96	806	811	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.05	100.35	100.06	0.01	6	11 830	14.38	1.20	789	810	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.85	99.87	99.85	0.03	17	1 166	14.89	0.73	867	856	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	12/11/12	02/11/17	100.00	100.04	100.00	-0.05	14	25 161	10.72	0.03			5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22							8.89	0.98	252	258	00000 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.20	100.40	100.20		2	10 000	9.48	1.70	280	326	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	99.80	99.92					7.75	0.97	138	144	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19							7.97	1.18	149	168	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.14	1.22	164	186	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.00	100.75					8.54	2.10	175	236	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/11/12	10/11/15	96.00	100.64	100.00	0.05	4	89 278	7.00	0.03			10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.04	100.15	100.04	-0.21	4	60 060	8.60	0.81	233	227	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.05	100.30	100.05	0.55	1	52 000	8.59	0.82	231	227	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.00	99.60	100.00	0.70	3	10 325	7.62	0.82	134	130	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	100.00	100.50					8.78	1.05	237	248	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16	84.00						9.01	3.39	196	285	5 000
Райффайзен													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.75	100.95	100.85	-0.02	1	10 000	8.06	1.03	166	175	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.60	99.75					7.94	1.02	154	163	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							6.29	0.02			5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.33	100.33	0.08	3	600	8.27	0.40		193	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	
РуссСтандарт БО-6 Вост-Экспресс	03/11/13	03/05/15	100.11	100.47	100.47		3	20 001	9.10	0.94	275	279	5 000
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.53	0.48		119	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.39	100.48	100.53	0.18	4	55 000	10.69	0.75	446	436	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	99.90	99.90	-0.10	5	4 001	10.36	0.93	401	404	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.31	100.50	100.45	-0.04	4	14 502	11.12	1.32	458	485	2 000
ЖФ Банк													
ЖФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	94.00	100.08					7.83	0.11		146	5 000
ЖФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.90	100.05	100.02	0.02	1	1	8.72	0.45		238	4 000
ЖФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							9.53	0.95	318	322	4 000
ЖФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.00	100.17	100.00	-0.24	2	2	10.11	2.22	329	394	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10					7.98	1.35	143	172	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.91	99.05	98.95	-0.10	1	1	8.96	0.65	281	263	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.65	99.89	99.75	-0.12	1	1	9.24	0.82	296	292	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		100.22	100.22	0.02	4	23 500	9.16	0.85	286	284	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.05	100.22					9.25	0.85	295	293	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	98.80						9.30	0.97	293	299	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	86.00	98.95					9.29	0.98	292	298	2 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.35	100.45	100.37	-0.18	2	2	8.90	0.74	268	257	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	84.00						9.07	1.52	245	283	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	100.00	100.10					9.39	1.87	266	319	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.25	100.29	100.27	-0.02	4	43 200	10.52	1.26	401	424	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.25	97.53	97.55	0.04	6	538	10.43	1.33	389	416	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.95	96.19					10.79	1.62	414	456	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.10	100.50					8.54	0.11		217	2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60	100.20					10.48	0.55	442	414	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	98.75	99.14					10.26	0.67	410	393	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	99.90	100.30					10.19	0.92	385	387	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.04	100.01	0.01	1	1	10.01	0.91	368	369	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	86.00	100.55					9.83	1.23	333	355	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.96	100.05	99.96	-0.07	5	13 536	10.26	1.21	377	398	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.05	97.75	97.71	0.39	2	262	10.03	1.43	345	378	5 000
Банк Интеза													
Интеза О3	11/10/13	13/04/15	99.66	99.85					9.43	0.92	309	311	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	98.50	100.05					9.98	1.41	341	372	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.20					8.11	0.13		174	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.20					6.98	0.13		61	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.20	100.35					9.09	0.46		275	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.50	100.55					9.70	0.62	358	336	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21	85.70						7.76	0.13		139	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	99.80	100.14	100.00		1	1	8.93	0.48		259	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22	98.00						9.72	2.44	285	355	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	99.00	100.00	100.00		4	87 500	10.77	0.94	442	446	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.70	100.39	100.25	0.25	3	25 003	10.39	0.33		405	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	98.58	99.98	98.56	-1.44	3	3	13.06	0.91	673	674	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	85.30	99.90	99.85	0.05	1	1 000	9.42	0.25		308	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	100.10	100.35					10.14	0.45		380	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	100.00	100.30	100.30		2	9 000	11.71	0.91	538	539	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.10	100.17	100.15		1	15 000	9.01	0.13		264	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	93.00	99.50					10.32	1.63	367	409	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.20	100.00		1	5 000	9.96	0.44		362	2 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	86.00	100.00					9.98	0.48	364	483	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.26	100.24					11.15	0.87	484	483	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.03	100.16	100.03	-0.12	1	100	9.83	0.07			3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.55	100.05	99.70	-0.30	2	10 300	12.46	0.81	619	613	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.24					9.05	0.27		271	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	100.00	100.11	100.06	0.01	1	1	10.22	0.70	403	389	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.34	100.44	100.35	-0.04	5	5	10.49	0.76	426	416	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.75	100.20	99.98	0.02	1	1	9.74	0.54	369	340	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.15	99.70	99.45	0.05	3	9 000	9.54	0.66	338	321	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.10	100.33					10.31	0.92	397	399	2 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.62	99.72	99.63	-0.22	4	2 344	9.63	0.93	328	331	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	100.00	100.08					9.53	0.94	318	321	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	99.90	100.00					11.82	0.49		548	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.03	100.20	100.20	0.02	6	2 051	12.61	0.88	629	629	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14		100.00					10.98	0.14		461	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.16	100.35					12.32	0.76	609	599	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03		28/10/15							11.00	0.98	463	469	
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.13	100.20	100.13	-0.06	3	1 950	10.51	0.08			2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.95						10.51	0.12		414	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.04	100.10	100.10	0.05	22	6 639	11.13	0.30		479	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.01	100.10	100.00		3	150	10.46	0.32		412	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.65	99.69					11.94	0.44		560	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.00	100.05					13.38	0.92	704	706	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.25	98.89	98.50	-0.45	17	243	12.56	1.07	614	626	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.90	100.10					12.65	1.37	609	639	2 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		104.22	105.40	104.30	-1.13	2	39 996	7.63	0.56	156	129	30 000
Москва 53	01/09/13			100.10	100.10	-0.22	2	50 000	6.98	0.82	71	66	15 000
Москва 63	10/12/13		109.15	109.93					6.15	1.02			15 000
Москва 62	08/06/14		108.15	108.35	108.35	0.20	9	74	7.01	1.45	42	76	35 000
Москва 39	21/07/14		91.09	100.00					7.24	1.62	59	101	10 000
Москва 64	24/06/15		98.20	99.03					7.52	2.40	66	135	20 000
Москва 44	16/11/15		103.66	113.77					7.37	2.51	48	121	40 000
Москва 56	22/09/16		96.61	98.00	96.72	-1.28	1	186	8.15	3.44	109	199	20 000
Москва 49	14/06/17		97.25	97.60	97.70	0.45	5	11 035	7.74	3.91	61	156	25 000
Москва 48	11/06/22		90.00	91.10	91.10		1	903	8.07	6.86	63	160	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.11	100.50	100.50		2	1 000	8.28	0.59	219	194	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.36	99.50	99.50	-0.10	7	3 100	8.54	1.40	197	228	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	02/12/12		100.35	100.39	100.50	0.05	1	179	6.66	0.08		28	3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12		99.99	100.05	100.03	-0.03	11	121 865	7.06	0.04			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.27	99.70	99.80	-0.01	5	2 576	8.46	1.78	176	225	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.76	102.90	102.84	0.09	1	1	8.70	2.17	189	253	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		99.80						7.90	0.50		156	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.50	101.70					8.13	1.08	170	183	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.70	98.30					8.22	2.05	144	204	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13			100.00					8.18	0.44		184	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.40	101.50	101.40		1	50	7.65	0.61	153	131	2 000
Якутия 7	17/04/14		98.01	99.90					8.05	1.31	152	178	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12		86.00	99.87						0.12			2 000
Краснодар 02	05/11/15		100.20	100.85					8.87	1.12	243	257	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.62	100.30					8.40	1.34	186	213	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 4	08/11/12								5.75	0.02			10 000
Красноярский край 5	29/11/16		101.00	101.55					8.09	1.47	150	184	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13			100.40					8.44	0.53	240	210	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.00	100.00					9.65	1.40	308	339	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		86.02	95.50					8.52	2.30	168	235	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								8.99	2.31	215	282	2 000

ОФЗ



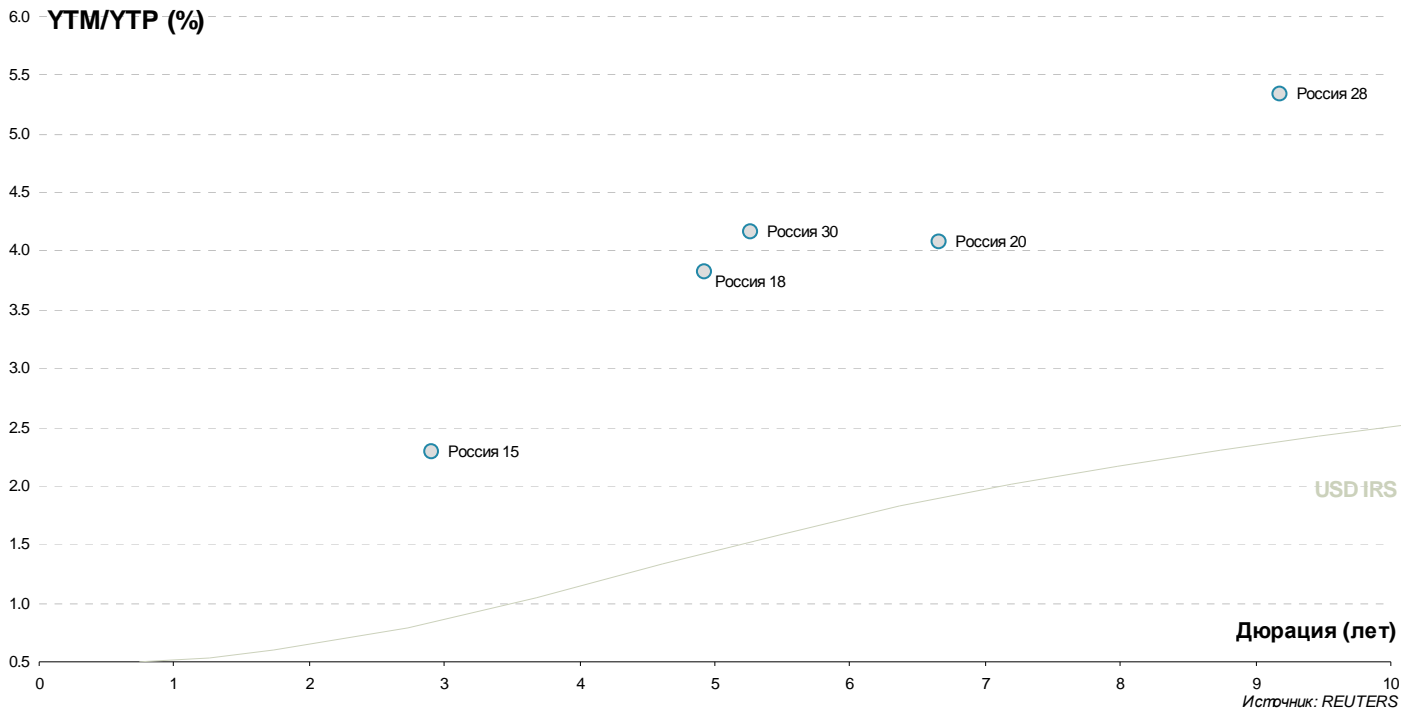
Результаты торгов евробондами

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	1.11	0.98		71
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.250	106.625	1.77	1.68		112
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		146.900	149.200	2.21	1.87	0.12	135
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.755	126.905	2.86	2.84		154
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.000	116.325	2.63	2.58		140
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.000	112.375	3.02	2.98		149
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.395	198.553	4.19	4.13	-0.05	226
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		120.500	121.250	4.38	4.34		198
ГОСКОМПАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.335	101.460	1.55	1.27	-0.01	126
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.880	102.880	1.40	-0.76	0.18	112
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.488	102.538	1.45	1.33	-0.02	117
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.203	104.703	1.66	1.00	-0.14	137
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.647	111.397	2.62	2.10		232
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		110.650	111.400	2.36	1.83		205
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.625	109.825	2.40	2.29	-0.01	207
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.267	107.746	2.60	2.45	-0.10	216
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.691	107.691	2.95	2.66	0.02	245
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.364	111.819	3.19	3.08	-0.15	263
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.516	123.508	3.55	3.37	-0.09	275
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.815	131.309	3.82	3.75	0.01	285
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.989	112.323	3.19	3.09	0.61	243
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.739	118.238	4.19	4.13	-0.02	274
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		105.980	106.730	4.19	4.10		262
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		141.931	142.973	5.32	5.26	-0.18	318
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		127.305	127.807	5.30	5.27	-0.59	306
Газпром нефть									
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		100.250	100.500	4.34	4.31	-0.86	274
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.451	106.451	1.68	-0.88	-0.02	138
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.410	105.865	1.53	1.19	-0.01	121
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		129.048	129.423	3.14	3.07	-0.13	228
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.907	111.377	3.07	2.96	-0.15	245
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		111.475	112.225	4.21	4.12	-0.19	273
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		101.020	102.020	5.14	4.91	-0.05	445
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.801	107.286	3.39	3.18	0.01	303
VTB'17 6%	USD	12/04/17		104.276	104.651	4.91	4.82	0.09	432
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.480	105.855	5.12	5.04	0.50	437
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		107.610	108.104	5.28	5.18	-0.37	449
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.604	106.100	5.66	5.59	0.02	446
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		103.520	104.270	6.46	6.36	0.14	502
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.452	106.950	5.74	5.70	-0.11	354
VTB' 9.5%	USD			100.835	101.835	9.37	9.22	-0.01	810
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.629	102.879	2.16	1.68	0.51	188
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.499	107.499	3.77	3.34	-0.06	342
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.000	104.000	4.89	4.55		448
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.500	101.500	5.89	5.64	-0.19	528
ВЭБ									
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.531	108.906	3.22	3.13		261
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.331	109.826	3.42	3.32	-0.14	268
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.382	118.881	4.09	4.02	-0.29	288
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		111.625	112.625	4.53	4.41		299
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.260	118.756	4.89	4.84	-0.03	306
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.497	103.622	2.38	2.19	-0.23	210
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		105.614	105.907	3.46	3.32	-0.06	311
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.423	107.820	3.75	3.61	-0.01	335
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		110.986	111.286	3.92	3.83	-0.01	341
GAZPROM '17 5.625%	USD	17/05/17		103.613	103.988	4.73	4.64	-0.03	411
GAZPROM '19 7.25%	USD	03/05/19		106.169	107.169	6.08	5.90	0.07	515
GPB EURO' 7.875%	USD			100.046	101.046	7.86	7.64	-0.40	719
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.792	103.839	1.78	-0.17	-0.01	150

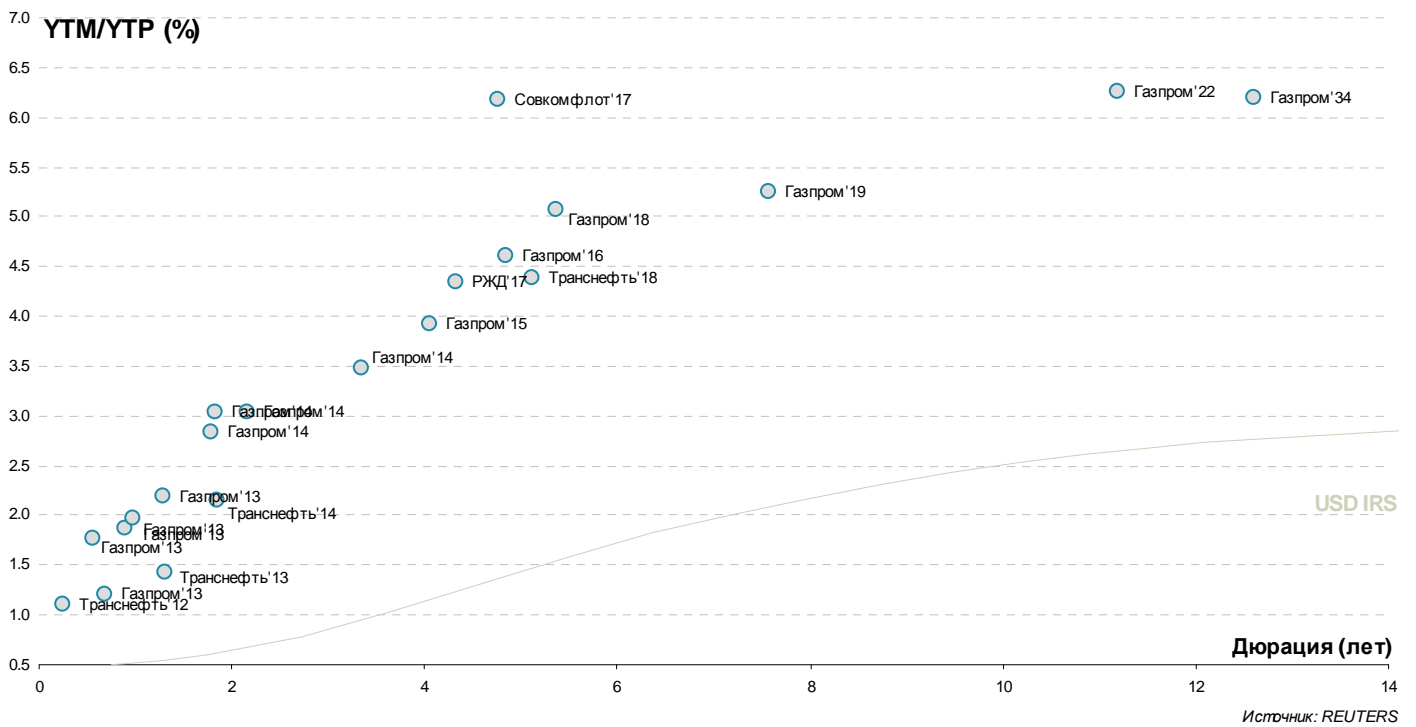
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.686	106.052	2.23	1.92	1.13	-0.01	192
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.508	110.882	2.24	2.02	1.48	-0.01	191
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		111.081	111.578	3.62	3.51	3.93	0.11	298
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		107.146	107.521	3.75	3.68	4.51	-0.06	300
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		119.719	120.215	3.78	3.69	4.59	0.14	297
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		105.514	106.139	4.32	4.13	3.20	1.00	384
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		102.464	102.753	1.69	1.15	0.50	-0.01	141
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.066	103.354	1.70	1.27	0.64	-0.01	141
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.468	107.717	2.58	2.49	2.48		218
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.662	108.161	3.50	3.38	3.95	-0.15	288
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		105.906	106.281	3.44	3.35	3.85	0.15	284
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		105.994	106.431	4.14	4.06	5.64	-0.10	310
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.762	109.387	4.48	4.39	6.86	-0.40	312
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		111.714	112.464	4.56	4.46	7.23	-0.18	312
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		99.991	100.741	5.13	5.03	7.93	-0.17	359
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.881	103.381	2.55	1.49	0.46	-0.09	228
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		108.659	109.139	5.11	4.94	2.64	0.02	472
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		103.754	104.754	6.42	6.16	3.88	0.15	587
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		112.621	113.604	6.70	6.50	4.44	-0.03	599
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.513	101.513	6.64	6.42	4.66	0.01	591
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		102.625	103.125	5.70	5.55	3.30		525
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		99.535	99.972	5.03	4.95	5.88	-0.55	397
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		106.647	107.647	6.75	6.30	2.13	-0.60	648
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.683	111.177	3.37	3.14	1.84		303
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.548	115.296	5.48	5.37	6.24	0.08	427
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.600	103.000	2.85	2.03	0.48	-0.14	258
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.778	102.333	4.51	2.91	1.59	-0.12	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.560	106.560	4.30	4.30	2.93		386
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.403	111.903	4.72	4.57	3.06	-0.31	426
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		104.610	105.610	5.05	4.80	3.82		446
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.060	117.567	5.48	5.38	4.52	-0.13	472
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.630	110.630	6.23	6.09	6.23		501
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		107.625	108.125	6.40	6.33	6.88	-0.13	504
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.561	108.752	1.97	1.88	1.91		161
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.908	114.304	3.08	2.99	3.99	-0.05	239
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.840	121.346	3.83	3.75	5.75	0.04	269
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.786	114.288	4.09	4.02	6.39	-0.13	282
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.649	121.409	4.04	3.95	7.31	-0.02	250
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		123.996	124.503	4.82	4.75	5.81	0.13	367
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.507	106.807	3.19	3.10	2.99	0.12	274
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.085	117.710	4.13	4.05	6.54	0.37	284
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		105.700	106.000	1.79	1.40	0.70	0.17	151
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.857	110.357	2.29	1.96	1.39	0.23	197
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		104.843	105.843	4.81	4.52	3.33	-0.20	433
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.817	107.315	5.13	5.02	4.32	-0.27	445
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		99.080	100.080	6.02	5.89	7.63	-0.12	454
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		103.114	104.114	7.02	6.80	4.32	-0.05	636
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		104.232	105.232	6.64	6.39	3.87	-0.03	610
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.249	105.249	0.99	-7.16			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.435	108.325	2.79	2.40	2.09	0.12	243
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		114.541	115.544	3.29	3.02	3.26	0.23	278
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.022	114.004	3.39	3.17	3.87	0.28	278
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		119.753	120.754	3.76	3.58	4.51	0.39	298
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.965	123.025	3.76	3.61	5.85		256
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.162	104.412	2.52	2.13	0.61	0.05	224
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.629	109.598	4.12	3.71	2.19	0.01	378
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.395	100.395	6.46	6.19	3.78	-0.03	594
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.522	110.522	5.62	5.39	4.15	-0.29	497

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	109.522	110.522	5.62	5.39	4.15	-0.29	497
ALFA BANK'21 7.75%	USD	28/04/21	108.849	109.849	6.38	6.24	6.46	-0.16	514
Номос Банк									
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12	100.450	100.575	4.90	3.78	0.11		486
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13	101.993	102.243	4.34	4.07	0.94	0.76	408
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15	104.761	105.761	6.94	6.57	2.66		662
NOMOS BANK'19 10%	USD	26/04/19	100.132	101.132	9.97	9.76	4.90	-0.13	924
Промсвязьбанк									
PROMSVYAZB'18 12.5%	USD	31/01/18	101.500	102.500	5.57	1.42	0.23		548
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13	104.883	105.133	3.47	3.12	0.66		321
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14	100.869	101.369	5.57	5.22	1.42		532
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15	110.740	111.740	8.01	7.60	2.17	-0.02	777
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	09/07/16	106.739	108.739	9.04	8.42	3.03	-0.04	873
PROMSVYAZB'19 8.5%	USD	25/04/19	100.513	101.513	8.36	8.09	3.80	0.09	789
ХКФБ									
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14	102.813	104.313	4.83	3.72	1.31	-0.04	457

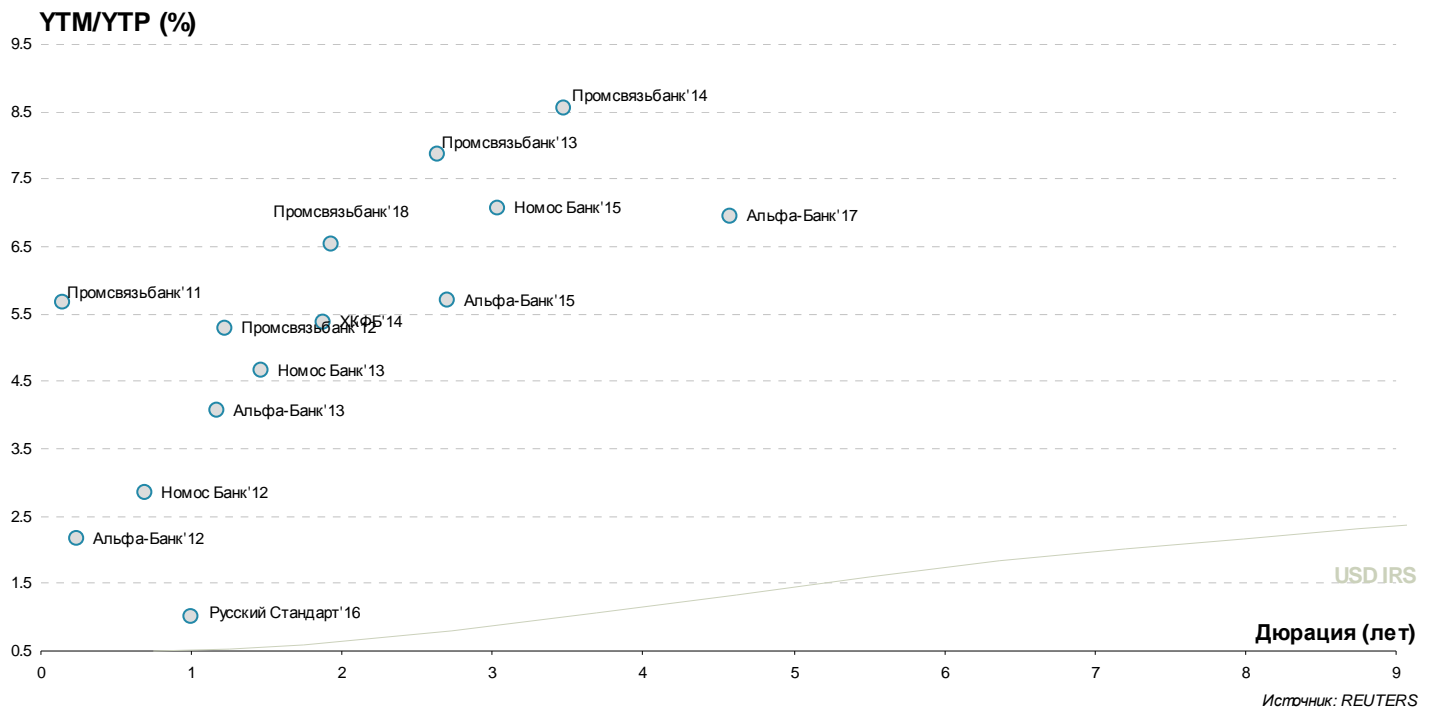
Россия



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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Наталья Талейко
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@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.