

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки остаются в политических тисках

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Условия рынка стабильны, завтра стартует налоговый период
- Рубль подешевел к корзине, внешнее давление нарастает

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды остаются под давлением продавцов
- Локальный рынок устойчив к негативу

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

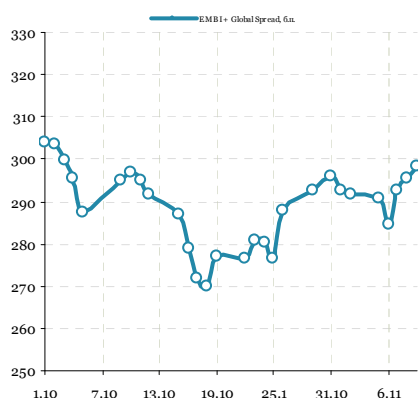
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.61	■	0.00	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	135	■	0	117	162
EMBI+ Glob.	298	▲	3	270	441
EMBI+ Rus sprd	168	▲	4	141	332
Russia 30 yield	2.87	▲	0.01	2.72	4.45
Денежный рынок					
Libor-3m	0.31	■	0.00	0.31	0.47
Euribor-3m	0.19	▼	0.00	0.19	0.69
MosPrime-1m	6.62	■	0.00	6.21	6.89
Корсчета в ЦБ	718.8	▲	44.0	446	1032
Депоз. в ЦБ	105.5	▼	-5.1	65	238
NDF RU 3m	6.2	▲	0.0	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	31.634	▲	0.059	30.38	33.67
EUR/RUB	40.201	▲	0.050	38.97	41.81
EUR/USD	1.271	▼	0.000	1.21	1.31
Корзина ЦБ	35.55	▲	0.054	34.27	37.28
DXU Индекс	80.793	▲	0.034	78.85	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1404.3	▼	-1.3%	1228	1589
Dow Jones	12815.1	▼	0.00%	12101	13610
DAX	7168.8	▲	0.07%	5969	7452
Nikkei 225	8837	▼	-0.90%	8296	9232
Shanghai Comp.	2071.5	▼	-0.12%	2004	2452
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	105.8	▲	0.05%	88	117
Нефть Brent	107.3	▲	0.04%	89	117
Золото	1731.5	▲	0.04%	1540	1790
CRB Index	291.9	▲	0.13%	267	321

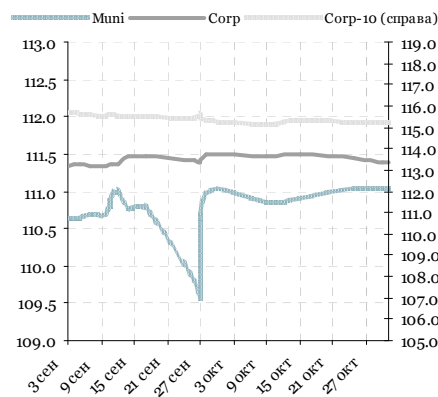
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	119.3	▲	0.19	107.5	119.3
Muni	111.0	▼	0.00	109.6	112.8
Corp	111.4	▼	0.00	110.7	112.1
Corp-10	115.3	▼	-0.01	115.1	117.8
Total Return					
OFZ	273.9	▲	0.49	233.3	273.9
Muni	348.3	▲	0.12	324.8	348.3
Corp	346.3	▲	0.08	323.6	347.7
Corp-10	347.7	▲	0.08	324.6	347.7
Объем торгов в сегменте (млн руб.)					
OFZ	736	▲	412	0	22 514
Muni	1 422	▲	998	10	6 146
Corp	9 103	▲	3 401	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Минфин РФ сегодня проведет аукцион по продаже пятнадцатилетних ОФЗ-ПД серии 26207 на сумму 25 млрд руб. Ориентир доходности предполагается осуществить в интервале 7,67-7,72% годовых. /Интерфакс/

ОАО «АИКБ «Татфондбанк» установило ставку 3-4 купона по трехлетним облигациям серии БО-03 на уровне 12,25% годовых. Облигации были размещены в декабре 2011 года под ставку 12,25% годовых. /Интерфакс/

ОАО «Главная дорога» перенесла дату начала размещения облигаций серии 07 объемом 1,4 млрд руб. с 15 на 20 ноября 2102 г. Выпуск погашается 2029 году. /Cbonds/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 13.11.2012 – вторник

Статистика США: Monthly Budget Statement

• **Выплата купона:** Новолипецкий металлургический комбинат, БО-07 (8.95%, 446.3 млн руб.), МТС, 07 (8.7%, 433.8 млн руб.), МТС, 08 (8.15%, 609.6 млн руб.), ЮниКредит Банк, 04 (7%, 349 млн руб.), Русфинанс Банк, 10 (7.9%, 78.8 млн руб.), Алеф-Банк, 01 (10%, 24.9 млн руб.), Лизинговая компания УРАЛСИБ, БО-06 (11.5%, 71.7 млн руб.), Белгородская область, 34006 (8%, 99.7 млн руб.), Банк Москвы, 2013 (LPN) (7.335%, 18.3 млн долл.), Белгородская область, 24003 (7.98%, 60 млн руб.)

Сегодня: 14.11.2012 – среда

Статистика Еврозоны: Industrial production

• **Выплата купона:** Внешпромбанк, 01 (10.5%, 78.5 млн руб.), Русфинанс Банк, 11 (7.9%, 78.8 млн руб.), Интурист, ВАО, 2012 (CLN) (9.75%, 0.1 млн долл.), РейлТрансАвто (РТА), 02 (12%, 44.9 млн руб.), ДИГ-Банк, 04 (11%, 0.6 млн руб.), РЖД, 09 (6.9%, 516.1 млн руб.)

Статистика США: PPI, Advance Retail Sales, Minutes of FOMC Meeting

• **Оферта:** Группа Разгуляй, БО-16 (3 млрд руб.), ТД Спартак-Казань, 03 (1 млрд руб.)
• **Погашение:** Внешпромбанк, 01 (1.5 млрд руб.)

Завтра: 15.11.2012 – четверг

Статистика Еврозоны: CPI, GDP

Статистика США: CPI, Empire Manufacturing, Initial Jobless Claims, Continuing claims

• **Выплата купона:** АИЖК, 14 (10.5%, 370.5 млн руб.), ММК, БО-01 (6.9%, 172 млн руб.), Банк Зенит, БО-03 (8.75%, 132.3 млн руб.), ОАО ДОМО, 01 (14%, 69.8 млн руб.), Ярославская область, 34009 (8%, 38.8 млн руб.), АИЖК, 19 (7.7%, 116.4 млн руб.), АИЖК, 21 (8.8%, 332.7 млн руб.), Нижегородская область, 34007 (9.95%, 396.8 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2011-1, А1/11 (9%, 43 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2011-1, А2/11 (3%, 7.1 млн руб.), Москоммерцбанк, 2034-С (RMBS) (7%, 27 тыс долл.), Минфин Республики Саха (Якутия), 35004 (8.77%, 54.6 млн руб.), Сбербанк России ОАО, 2013 (LPN) (6.48%, 16.2 млн долл.), Gallery Media, 2013 (10.125%, 8.8 млн руб.), АИЖК, 09 (7.49%, 94.4 млн руб.), Первый ипотечный агент АИЖК, 1А (6.94%, 5.7 млн руб.), Первый ипотечный агент АИЖК, 2Б (9.5%, 6.3 млн руб.), Россельхозбанк, 2017 (LPN2) (6.299%, 39.3 млн руб.), Москоммерцбанк, 2034-А (RMBS, FRN) (1.964%, 58.6 тыс долл.), Москоммерцбанк, 2034-В (RMBS, FRN) (5.464%, 76.2 тыс долл.), Газпром, 2012, JPY (LPN15) (2.89%, 433.5 млн японских йен.), Газпромбанк, 04 (6.85%, 683.2 млн руб.), АИЖК, 10 (8.05%, 121.7 млн руб.), МДМ Банк, 2052-А (RMBS) (10%, 20.9 млн руб.)

• **Оферта:** Газпром Капитал, 03 (15 млрд руб.)

• **Погашение:** ММК, БО-01 (5 млрд руб.), Газпром, 2012, JPY (LPN15) (30 млрд руб.), Газпромбанк, 04 (20 млрд руб.)

• **Размещение:** Краснодарский край, 34004 (12 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Рынки остаются в политических тисках

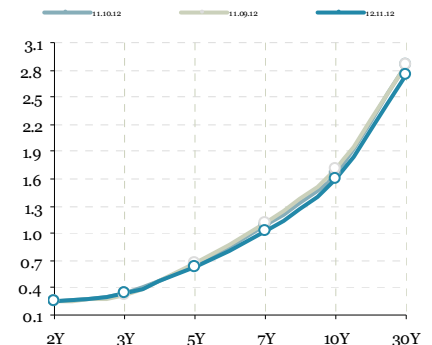
Негативные настроения на внешних площадках остаются в силе, а технические отскоки котировок рискованных активов вверх остаются кратковременными. Инвесторы ждут путей решения двух принципиальных вопросов – попыток американских властей решить проблему бюджетного «тупика» и итоги переговоров внутри «тройки» международных кредиторов в отношении Греции.

Пока еврогруппа и МВФ спорят о том, до 2020 г. или 2022 г. Греции будет необходимо привести показатель долг/ВВП к уровню 120%, Афины пытаются аккумулировать деньги для погашений своих долгов в пятницу на общую сумму 5 млрд евро. Вчера Греция смогла неплохо разместить краткосрочных веселей на 4.1 млрд евро, в ближайшие дни попытается занять еще 1 млрд евро. Таким образом, вопрос успешного прохождения страной через дату 16 ноября можно считать решенным вопросом. В то же время, разногласия между министрами финансов и МВФ в отношении Греции не кажутся слишком значительными, но они напоминают о том, что каждый последующий транш финансовой помощи Афинам требует более долгих и напряженных согласований даже внутри «тройки».

В отношении США инвесторам не остается ничего другого как ждать. Обама начнет переговоры с Конгрессом о компенсации для экономики ущерба от бюджетного «тупика» только с пятницы и пока неясно, какой характер будет у этих попыток. Теоретически, с завершением президентской гонки, политический накал снизился, что позволит республиканцам быть сговорчивей, чем ранее. Да и среди консерваторов доминирует мнение о том, что экономике в начале 2013 г. потребуется поддержка со стороны властей, чтобы вновь не скатиться в рецессию.

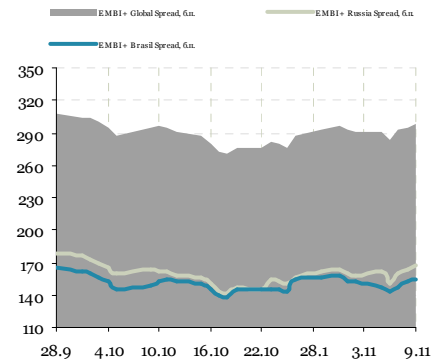
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



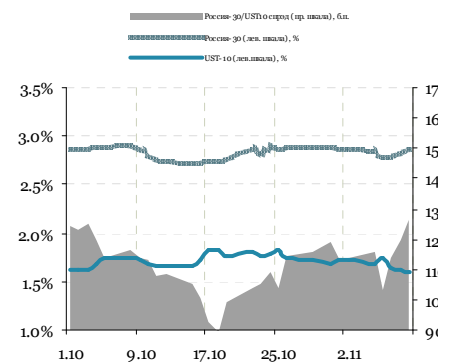
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



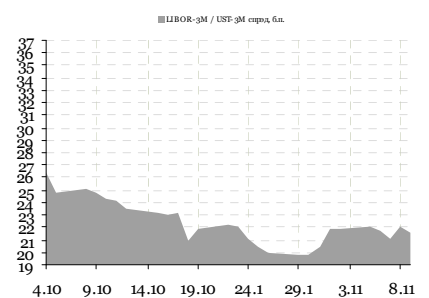
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Условия рынка стабильны, завтра стартует налоговый период

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка вчера существенно не изменилась. На рынке МБК стоимость кредитов overnight держалась в среднем уровне 6.00% годовых, междилерское 1-дневное репо с облигациями обходилось в среднем под 6.15% годовых. Аукционы прямого репо вновь принесли банкам меньше заявленного: на 1 день им вчера удалось привлечь 120 млрд руб. при спросе в 183 млрд руб. На 7 дней объем сделок составил 1.06 трлн руб., совпав по объему с поданными заявками. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 14.4 млрд руб. до 838.7 млрд руб.

На текущей неделе стартует налоговый период ноября, до завтра предстоит провести платежи по страховым взносам в фонды (около 230 млрд руб.). Стоит отметить, что рынок еще не в полной мере восстановился, о чем свидетельствуют относительно высокий уровень краткосрочных процентных ставок, а также задолженность по репо перед ЦБ РФ (почти 1.3 трлн руб.). Таким образом, новый налоговый период неизбежно вызовет очередной всплеск процентных ставок до локальных максимумов.

Рубль подешевел к корзине, внешнее давление нарастает

Торги на валютном рынке во вторник завершились ослаблением рубля по отношению к бивалютной корзине на 14 коп. до отметки 35.62 руб. После продолжительно затишья рубль начал реагировать на заметное ухудшение внешних условий. Между тем, котировки нефти оставались в рамках среднесрочного диапазона волатильности. Баррель Brent в период российской сессии терял порядка 1.5 долл. и торговался на отметке 107.50 долл. Приближение налогового периода, как фактор внутренней поддержки рубля, вряд ли сможет пока компенсировать внешнее давление на риск.

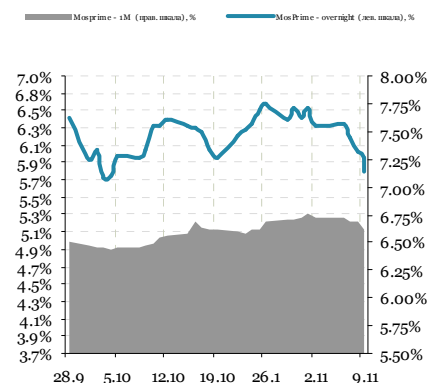
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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		120
Вторник	Аукцион Казначейства 35 дней, 50 млрд руб., от 6.3% годовых	120
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26207 (15 лет), 25 млрд руб.
	Возврат Казначейству	50 млрд руб.
Четверг	Купоны ОФЗ	2.9 млрд руб.
	Аукцион Казначейства	35 дней, 50 млрд руб., от 6.3% годовых
Пятница	Уплата налогов	Страховые взносы в фонды (~230 млрд руб.)
	Возврат Казначейству	50 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

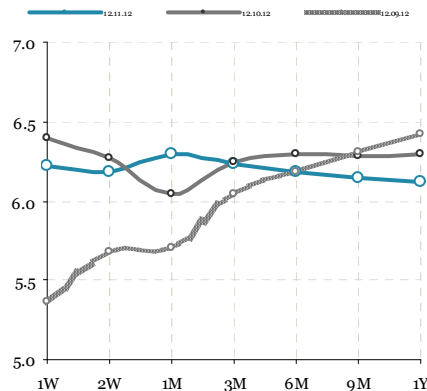
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды остаются под давлением продавцов

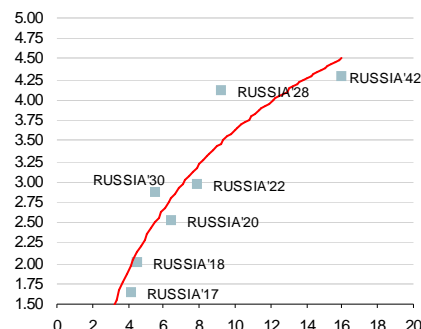
В суверенном сегменте торги во вторник завершили без существенных ценовых изменений. Спрэды госбумаг незначительно расширились со стороны кривой UST, где сохраняется напряженность в преддверии стартующих в пятницу переговоров Белого дома и Конгресса по способам решения близящихся бюджетных проблем. Заметно лучше рынка торговался дальний выпуск Россия'42, прибавивший в ценах порядка 50 бп и завершавший день выше отметки 122%. Корпоративный сектор выглядел заметно слабее и продолжил фронтальное движение вниз по ценам, темпы которого в среднем по рынку по итогам дня превысили 20 бп. В секторе частных компаний слабый результат показали выпуски ALFA'17, Северсталь'22, Vimpelcom'21 и EVRAZ'17, снижение цен которых приближалось к 50 бп. В секторе госкомпаний продавали банки: цены выпусков VTB'20, VEB'25, Россельхоз'18, SBER'21 и SBER'22 в среднем потеряли более 50 бп.

Локальный рынок устойчив к негативу

Локальный рынок по-прежнему устойчив к негативным настроениям, проявляющимся на курсе рубля и фондовых индикаторах. Вчера активность на кривой ОФЗ несколько снизилась, а цены на дальнем участке кривой опустились в среднем на 10 бп относительно отметок понедельника. Корпоративный сектор заметно оживился: спрос наблюдался в выпусках НМТП БО2 (YTM 9.13%/D 2.25г. +228 бп к ОФЗ), НОВАТЭК БО2 (YTM 8.51%/D 2.63г. +158 бп к ОФЗ), а также на среднем участке кривой Вымпелкома.

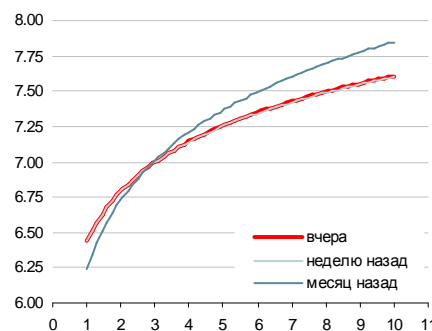
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



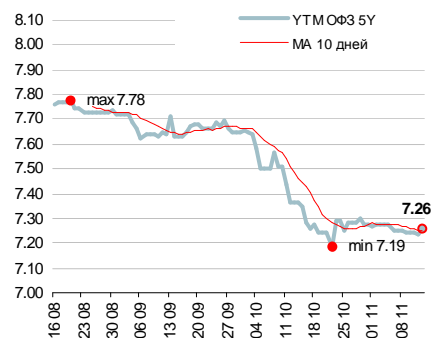
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



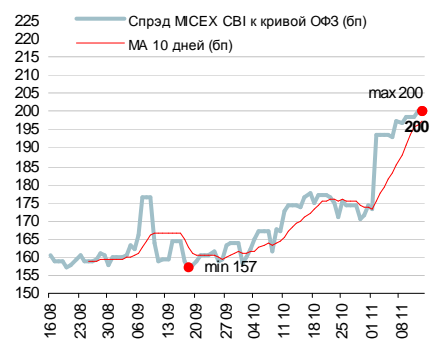
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



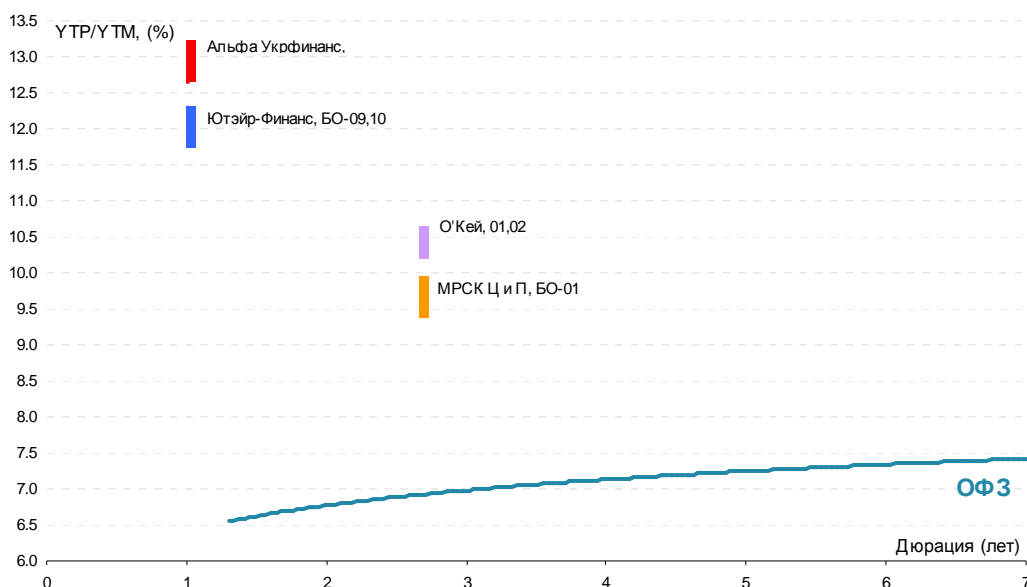
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
Нижне-Ленское-Инвест, 04	NR	нет	1 200	н/д	Конкурс	16.11.2012	н/д	1.5 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.
Альфа Укрфинанс, 01	NR	нет	3 000	12.63-13.16	16.11.2012	20.11.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
О'Кей, 01	- / - / В+	да	2 000	10.25-10.62	XX.11.2012	XX.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
О'Кей, 02	- / - / В+	да	3 000	10.25-10.62	XX.11.2012	XX.11.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Ва2 / -	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
Ростелеком, 17	BB+ / - / BBB-	да	10 000	н/д / 100%	8.63-8.89	8.73	08.11.2012	да / 2.70 г.
Европлан, 03	- / - / BB-	да	3 500	1.5 / 100%	11.57-12.10	11.57	06.11.2012	нет / 1.84 г.
Русфинанс Банк, БО-03	- / Ваа3 / BBB+	да	4 000	1.1 / 100%	9.73-10.25	10.25	02.11.2012	нет / 1.86 г.
АПРОСА, БО-01	BB- / Ва3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
АПРОСА, БО-02	BB- / Ва3 / 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- / Ваа1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
Роснефть, 05	BBB- / Ваа1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
МОЭСК, БО-02	BB- / Ва2 / -	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, 03	- / - / 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	- / Ва1 / -	да	3 000	1.8 / 100%	9.73-10.25	9.99	25.10.2012	нет / 1.43 г.
РСХБ, 18	- / Ваа1 / BBB	да	5 000	н/д / 100%	8.52-8.58	8.52	25.10.2012	нет / 1.88 г.
Российский Капитал, 03	- / - / В+	да	3 000	1.1 / 100%	10.78-11.30	11.09	25.10.2012	нет / 1 г.
ФСК ЕЭС, БО-01	BBB / Ваа2 / -	да	10 000	2.7 / 100%	8.37-8.58	8.26	24.10.2012	нет / 2.3 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 25072		23/01/13	100.22	100.24	100.24	-0.00	22	63 240	5.91	0.19			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.15	100.20	100.20	0.03	26	364 200	5.88	0.23			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.17	102.24	102.24	-0.01	2	2 000	5.90	0.36			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	99.95	100.15	100.09	-0.03	5	5 908	6.10	0.66			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.30	100.42	100.42	-0.02	8	23 750	6.22	0.90		6	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.72	100.90	100.75	0.05	25	78 975	6.60	1.28	4	48	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.80	109.25	108.80	-0.20	1	5 000	6.74	1.61	6	66	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.00	109.27					6.75	1.88		70	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	100.74	103.40	102.95	0.05	1	10	6.63	1.85		57	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.30	100.60	100.30	-0.29	7	44 520	6.98	2.31	12	95	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.01	100.25	100.25	0.05	2	600	6.89	2.43	0	86	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.36	101.55	101.35	-0.18	5	59 902	6.98	2.84	1	96	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	97.00	98.48	98.47	-0.03	4	195	7.03	2.92	5	101	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	99.90	100.00	99.90	-0.05	6	49 660	7.05	3.29	1	102	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18		99.80					8.17	3.55	109	214	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.35	3.49	128	232	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	101.65	101.72	101.65	-0.10	2	41 150	7.08	3.85		104	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	101.60	101.68	101.68	-0.07	15	215 077	7.09	3.87		105	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	102.40	102.85	102.65	0.11	4	3 002	7.01	4.46		94	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.85	92.60					7.35	4.50	15	128	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18		99.76	99.00	-0.50	2	2	7.35	4.62	13	127	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	102.10	102.45	102.10	-0.10	4	35 012	7.20	5.08		109	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19	66.00	79.20					7.92	5.50	62	176	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	95.80	96.00					7.49	6.16	13	126	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	102.20	102.35	102.25	-0.05	4	20 002	7.37	6.37		111	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	102.10	102.20	102.20	0.00	5	250 002	7.41	6.92		108	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		89.10					7.87	7.34	42	148	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	104.90	104.95	104.90	-0.20	23	103 735	7.72	8.66	18	115	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	83.55	89.50					8.15	10.88	50	129	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		105.00					6.52	11.21			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	95.01	99.70					7.63	0.69	138	145	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО1		04/12/12	100.12	100.16	100.12	-0.03	6	5 340	7.60	0.06			5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.05	100.18	100.15		4	8 960	7.32	0.31		106	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.56	100.65	100.56	-0.01	1	1	7.90	0.58	174	168	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.56	100.60					7.81	0.58	165	159	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.60	99.70	99.67	-0.23	6	120 003	8.62	1.70	191	255	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14							8.53	1.87	177	248	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.01	100.09					8.63	2.14	180	259	5 000

ММК

ММК ВО1		15/11/12							10.78	0.01			5 000
ММК ВО5		04/04/13	99.89	100.00	100.00	0.14	5	7 331	7.77	0.39		152	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	99.70	100.20					8.33	0.73	205	216	5 000
ММК ВО4		27/02/14							8.80	1.24	225	268	5 000
ММК ВО6		10/07/14	97.00	99.00	97.72	0.07	1	1	8.89	1.55	223	280	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.00						8.92	1.58	225	283	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.46	100.80	100.80	0.25	6	36 134	6.60	0.26		33	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.46	100.70					8.05	0.26		178	5 000

Апроса

Апроса 21	25/06/13	18/06/15	100.09	100.29	100.15	0.05	1	211	8.23	0.60	205	202	8 000
Апроса 22	28/06/13	23/06/15	100.20	100.30	100.15		1	155	8.24	0.61	206	203	8 000
Апроса 23		18/06/15	100.70	101.00	101.00		3	10 161	8.79	2.32	193	276	7 000
Апроса 20		23/06/15	100.70	101.00					8.74	2.33	187	271	3 000
Апроса ВО1		30/10/15	99.99	100.00	100.00		2	3 015	9.15	2.63	222	312	5 000
Апроса ВО2		30/10/15	99.00	100.10	100.00	-0.05	1	3 000	9.15	2.63	222	312	5 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.35	100.45					8.40	0.35		214	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.30	100.43					8.07	0.35		181	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.70	107.89	107.80		1	473	9.19	1.75	247	312	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.51	107.96					9.02	1.75	230	295	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.25	102.30	100.32	-0.78	2	370	10.06	2.62	313	403	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	100.00	102.10					9.74	2.62	281	371	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	95.00	100.00					10.36	3.03	336	434	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	95.00	100.00	95.00		2	2	10.36	3.02	336	434	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.50	99.85	99.82	0.18	5	1 696	9.28	2.13	246	324	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.50	99.85	99.84	-0.01	2	21 900	9.27	2.13	245	323	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.75	99.85					9.37	2.14	255	333	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							15.88	0.00			5 000
Мечел ВО2		12/03/13	98.99	99.10	99.00	-0.05	6	1 625	13.29	0.33	703		5 000
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	89.20	105.00					-11.13	0.42			5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.50	99.15					12.47	0.44	623		5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.37	96.50	96.50		22	51 762	14.36	0.56	822	814	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	100.40	100.00		1	1	11.72	0.68	548	553	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	94.11	95.99	95.01	-0.43	2	5	15.28	1.17	876	915	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	90.05	91.99	91.70	0.30	1	2	16.32	1.21	979	1 019	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	90.91	91.62	91.55	0.15	4	5 004	16.47	1.20	994	1 034	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.81	2.22	497	577	5 000
Мечел ВО7		07/04/15							11.81	2.22	497	577	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.81	2.22	497	577	3 000
Мечел ВО12		07/04/15							11.81	2.22	497	577	3 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.56	2.15	473	552	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	90.01	91.50	90.50	-0.50	1	5	14.72	2.45	783	869	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	89.12	90.95					15.42	2.44	853	939	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	82.00	84.50					15.70	2.97	871	968	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.38	87.47					13.95	2.98	696	793	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	83.21	85.00	84.99	0.99	1	79	14.35	2.99	736	833	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.75	99.77	99.77	-0.03	10	22 281	9.31	0.92	292	315	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.35	100.41	100.39	0.02	15	7 247	8.87	0.62	268	267	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.02	98.40					13.87	1.02	742	772	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.50	91.77	90.25	-1.54	5	409	16.99	1.42	1037	1 089	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.03	100.20	100.03	-0.07	3	30	11.97	0.06			5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.00	97.39	95.16	-2.30	4	24	12.62	1.41	601	652	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.80	92.95	92.95	-0.10	11	484	14.93	1.24	838	881	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.61	88.43	88.25	-0.15	6	597	14.94	2.21	810	890	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД ВО01		05/12/12	100.12	100.14	100.12	-0.06	5	325	7.34	0.06			15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13							7.70	0.95	129	155	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.95	109.00	109.00	0.01	6	2 978	7.77	1.21	123	164	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.15	102.25	102.15	0.01	2	4 574	8.07	2.01	128	203	15 000
РЖД 11		18/11/15							8.15	2.64	122	212	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.29	99.30	99.20	0.10	2	400	8.33	3.07	132	231	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.05	100.35					8.31	4.65	109	223	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.50	99.90	99.75	-0.25	2	4 861	7.58	0.85	122	142	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.50	99.90					7.58	0.85	122	142	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	100.85	100.86	100.83	-0.03	1	40 000	8.08	1.45	145	198	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.10	101.20	101.17	-0.21	5	31 900	8.25	1.82	151	219	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	99.85	99.95	99.85	-0.05	2	2	8.33	2.25	148	230	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.65	99.25					8.20	2.60	128	217	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	97.80	98.20					8.16	2.69	122	213	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	97.01	100.00					8.26	3.06	125	224	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	99.85	100.05	100.04		3	5 002	8.77	3.35	172	274	15 000
ФСК ЕЭС 21		06/10/27							8.94	3.81	182	290	00000 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	96.75	97.20					8.82	4.15	166	277	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	96.75	97.20					8.82	4.15	166	277	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	95.60	96.50					8.81	4.54	160	274	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	96.70	97.50	97.50	0.02	1	1	9.12	6.05	177	290	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.85	100.30	100.15	0.15	5	413 751	9.13	2.25	228	310	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.00	102.00					9.66	3.22	263	364	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.01	99.50	99.39	-0.18	6	262	9.89	0.97	347	374	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15		98.98					9.39	2.66	246	336	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.10					9.37	2.94	238	335	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30						9.19	2.95	220	317	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.58	222	328	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32			99.03	-0.47	2	244	9.64	3.57	256	361	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32		100.20					9.35	3.58	226	332	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	99.90	100.15	99.90	-0.30	1	114	8.49	1.30	192	237	7 000
Почта России 2	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	195	286	00000 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	
Почта России 3	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	195	286	00000 000
Почта России 4	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	195	286	00000 000
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	99.40	100.50					7.39	1.20	86	126	5 000
Газпром А11		24/06/14	108.07	109.70	109.70	0.30	3	2 505	7.38	1.44	76	128	5 000
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22							8.78	4.16	162	273	00000 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22							8.78	4.16	162	273	00000 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12	100.12	100.23					6.70	0.08			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							7.96	0.08			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.02	100.15					7.17	1.01	73	102	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16		101.00					8.61	0.17		231	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	100.00	100.30	100.03	0.01	7	50 649	7.17	0.40		92	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	100.00	101.03	100.00	-0.03	4	876	7.25	0.40		100	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50	100.70	100.69	0.13	2	125 199	8.05	2.04	125	201	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.48	101.50					8.30	2.82	133	228	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.20	100.45					8.49	2.84	152	247	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.60	101.90					8.75	4.21	158	270	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	97.15	98.60	97.15		3	3	9.07	4.43	188	300	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	86.00	100.00	100.00	-0.20	5	1 300	7.62	0.59	145	141	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	99.75	100.10	100.02	0.02	6	211 533	8.51	2.63	158	248	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.10					8.38	2.63	145	235	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75	100.10					8.50	2.63	157	247	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.29		99.50	-0.45	4	422	8.00	0.84	165	184	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.45	100.60	100.56	0.22	4	45 718	6.49	0.10		17	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.45	100.64	100.45	-0.16	4	30 330	7.66	0.10		134	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.20	100.50					7.02	0.10		70	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.21	101.39	101.30	-0.05	1	31	8.20	0.99	177	205	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22							8.67	2.05	187	263	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.80	100.00	100.00	0.03	4	8 700	9.95	0.69	370	376	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	96.01	98.90	98.75	-0.11	8	524	10.60	1.16	409	447	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	91.00	95.59					10.79	3.01	379	477	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	91.00	95.59					10.10	3.02	310	408	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	98.61	99.00	98.70		9	775	14.64	0.67	841	845	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.60	3.08	259	358	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.51	100.55					8.02	0.64	181	182	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.09	100.10	100.07	-0.03	9	21 008	8.00	0.10		168	10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.02	100.14	100.14	0.02	1	38 000	7.42	0.20		113	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.91	100.09	99.98	0.03	1	907	7.87	0.33		161	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.90	100.05	100.00	0.05	4	3 325	7.81	0.33		155	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	100.03	100.00	0.01	2	340	7.81	0.33		155	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.04	100.05	100.00	-0.05	1	1	8.18	0.78	187	201	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.45	99.90	99.70	-0.24	5	676	7.96	0.90	158	180	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.05	99.90					8.29	1.27	173	217	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.05	100.20	100.00	0.01	11	6 442	8.24	1.27	168	212	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90		100.00	0.10	10	1 000	8.68	2.57	176	265	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90		100.00		10	1 000	8.68	2.57	176	265	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90		99.90		1	1 400	8.35	0.52	224	212	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.20					8.82	1.89	206	277	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.06	100.20	100.05		2	60	8.27	0.75	198	210	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.75	100.25					7.70	0.15		140	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.00						8.27	0.29		201	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50	99.90	-0.35	1	1 180	8.75	0.45		251	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.41	0.84	206	225	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					7.70	0.68	146	151	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.75	98.45		1	1 000	8.80	1.04	234	265	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.96	1.15	245	283	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20		99.50					7.42	0.92	102	126	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	99.75	100.20					8.45	2.13	163	241	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.10	100.14	100.10	-0.45	3	200 000	8.69	2.61	176	266	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.05	100.14	100.10	0.05	1	100 000	8.69	2.63	176	266	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.75	98.21	97.50		2	2	8.96	2.98	197	294	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	
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21			100.00		10	820	8.68	3.35	163	265	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.85	97.29	96.85	-0.65	5	11 522	8.89	4.15	173	284	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21		99.50					8.06	1.35	147	195	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.25					8.42	1.84	167	236	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.65	101.25	100.51	-0.24	1	1	8.69	1.84	194	263	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17		100.65					8.95	1.95	217	290	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		99.46					9.14	3.00	214	312	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21		100.00					9.14	3.00	214	312	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.00	100.43					8.46	1.31	189	234	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.31	101.00	100.43	-0.17	2	802	9.11	1.64	242	303	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/11/12	14/11/19		100.10					6.34	0.02			5 000
РСХБ 9	22/11/12	14/11/19		101.11	100.07		4	5 800	7.16	0.02			5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.35	100.40	100.30	0.30	3	7 420	7.73	0.23		145	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.25	100.60	100.30		2	3 500	7.75	0.24		148	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.25	99.60	99.28	-0.18	2	4 000	8.31	0.56	217	209	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.25					7.88	0.71	162	170	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.25					7.89	0.72	162	171	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13		100.25	100.15	-0.01	6	14 780	8.24	0.77	194	207	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.19	100.20	100.15	-0.11	1	5 000	8.24	0.77	194	207	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17		99.50					7.32	0.87	96	116	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.20	100.25	100.00	-0.13	1	150	8.36	0.94	195	221	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.42	100.60	100.60	0.07	2	23 000	8.26	0.96	185	211	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.10	101.45	101.39	0.10	6	22 705	8.20	1.19	168	207	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18		100.50					8.52	1.64	183	244	5 000
РСХБ 18		13/10/22							9.00	1.88	224	295	
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22							8.53	1.88	177	248	00000 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	99.75	100.18					8.78	2.22	194	274	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	97.75	97.95	97.75	0.15	3	2 992	8.85	2.38	197	282	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	97.75	98.20					8.46	2.38	158	243	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	97.75	98.15					8.80	2.39	192	277	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 4		15/11/12							39.39	0.01			20 000
Газпромбанк 5		22/11/12							13.35	0.02			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.00	100.14	100.14		1	1	7.26	0.11		94	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.05	99.35					8.34	0.67	210	215	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13		99.94					7.89	1.01	145	174	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.00	100.75					7.99	1.17	147	186	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.25	100.65	100.61	-0.09	4	6 602	8.62	1.54	196	253	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	174	265	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	174	265	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	174	265	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	174	265	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14		99.35					7.85	1.12	136	171	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43		100.15					8.42	1.70	171	235	7 000
АИЖК А9		15/02/17							8.26	1.80	152	220	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.10	99.40					8.34	1.85	159	228	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24							8.25	2.25	140	222	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	98.50					8.66	2.72	171	263	5 000
АИЖК А10		15/11/18							8.60	2.94	161	258	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	98.45	99.50	99.50	0.10	2	10 001	8.42	3.01	142	240	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.77	3.12	175	275	15 000
АИЖК А11		15/09/20	91.00	99.50					8.96	3.76	185	292	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	97.99					9.36	4.89	212	327	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	102.00					8.97	5.50	167	281	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	136	235	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13							8.98	1.01	254	283	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.18	100.18					9.00	1.01	256	285	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.55	100.00					10.19	1.59	352	410	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.00					9.51	1.59	284	342	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	100.05	100.10	100.10	0.05	4	726	7.98	0.26		171	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.55	100.30					8.29	0.73	201	211	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13							8.22	0.96	181	207	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.09					8.42	1.37	182	231	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17							8.73	2.70	179	270	00000 000
МТС													

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 3	20/06/13	12/06/18	100.02	100.25	100.25	0.25	1	318	7.69	0.58	153	148	10 000
МТС 1		17/10/13	99.10	99.75					7.41	0.91	102	125	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	98.85	99.10	98.90		6	19 665	8.36	1.42	174	226	15 000
МТС 2		20/10/15	97.54	98.88	98.88	0.01	4	4	8.35	2.67	141	232	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	98.01	99.00	98.50	-0.20	1	3	8.92	2.72	197	289	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.09	99.10	98.50	-0.59	2	10	9.22	3.22	219	320	15 000
МТС 7		07/11/17	98.60	99.20	98.85	-0.15	9	4 616	9.19	4.15	203	314	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.75	100.80	100.80	0.05	8	53 617	8.14	0.66	192	195	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.99	98.00	98.00	0.04	5	28 000	8.91	1.55	225	282	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.50	99.64	99.60	0.10	5	50 002	9.24	2.15	241	320	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.50	99.55	99.50		6	274 860	9.29	2.14	247	325	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.50	99.55	99.50	-0.01	11	29 156	9.29	2.14	247	325	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.50	98.45	98.45	0.95	12	514	9.11	2.63	218	308	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.50	98.50					9.30	2.63	237	327	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	99.80	100.30					8.03	1.79	130	197	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.90	100.49					8.39	0.56	225	217	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.00	99.33					8.17	0.48		193	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.75	100.90	100.50	-0.25	1	40	8.63	1.18	211	250	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.49	101.50	100.50	-1.19	1	1	8.63	1.18	211	250	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	99.95	100.10	99.95	-0.01	4	117 001	9.20	2.21	236	316	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.01	97.19	96.75	-0.25	2	25 000	9.71	3.07	270	369	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.75	97.10	96.75	-0.25	3	24 934	9.71	3.07	270	369	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.75	97.25	96.75	0.70	3	15 046	9.71	3.07	270	369	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13		99.89					7.93	0.29		167	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90	100.12					8.40	0.80	207	223	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.85	100.12					8.24	0.80	191	207	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.95						8.33	0.80	200	216	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	100.04	100.05	99.95	-0.05	3	5 010	8.46	0.80	213	229	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.20	99.40					8.85	1.24	230	273	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.60	99.35					8.99	1.38	239	288	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	99.00	100.30					8.99	2.55	208	296	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.95	99.50					9.32	1.45	269	322	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	85.00	99.50					9.08	1.52	243	299	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	99.85	99.95	99.95	-0.67	6	11 767	9.74	2.56	282	371	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.80	99.00					9.12	0.68	288	293	3 000
Копейка БО-2		01/10/13		100.10	99.84	-0.09	4	60	9.51	0.85	316	335	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.50	99.65	99.55	0.05	4	751	11.20	0.49		496	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	98.01						9.38	0.97	296	323	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.03	100.20					9.70	0.87	334	354	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.90	437	508	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.25	100.00					12.83	0.58	667	662	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.50	94.19	94.00	1.93	3	660	11.61	2.24	476	557	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.26	95.74	95.75	0.25	1	54	11.88	1.58	521	579	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	90.00	99.95	97.00	-1.50	1	1	9.39	1.68	269	332	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.90	96.00	95.90		1	12	10.48	1.15	397	435	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	100.04	100.17					8.59	0.09		227	2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.65	99.40					9.82	1.17	330	369	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.00	101.60					10.44	2.53	353	441	2 000
УВЗ													
Уралвагонзавод 1	13/12/12	07/12/17	99.90	100.05					8.64	0.08			3 000
Уралвагонзавод 2	27/08/13	20/02/18	99.40	99.65					9.61	0.76	331	344	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.50	99.50					11.37	0.92	498	521	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.50	100.75	100.40		1	10	8.90	0.80	257	273	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	
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13			100.00	-0.10	1	50 000	8.28	0.10		196	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14		100.05					9.06	0.44		282	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.00	99.60	99.56	-0.40	5	63	9.48	0.44		324	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17		99.00					8.14	0.83	180	198	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.76	100.88	100.00	-0.80	3	1 598	9.45	0.46		321	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.85	102.35	101.85	-0.07	4	1 865	9.78	0.64	357	358	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.50	100.69	100.60	0.08	13	50 140	10.70	2.01	391	466	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.90	100.12	100.05	0.04	6	5 047	7.74	0.40		149	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.20	100.05	-0.15	1	48	7.74	0.40		149	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.40	100.45	100.45	0.01	5	2 000	7.96	0.29		170	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.54	1.64	185	246	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	98.55	99.99					10.00	1.39	340	389	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.05	100.30	100.20		5	8 457	10.13	2.08	332	409	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.20	100.65	100.61	-0.05	4	4	9.92	2.08	311	388	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.68	99.96	99.70	-0.30	7	161	13.26	0.78	695	709	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.93	99.98	99.93	-0.06	14	717	12.96	0.91	657	680	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.70	100.94	100.95	0.25	3	10 525	10.15	0.36		389	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.51	101.40					10.91	0.36		465	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.40	100.00	99.40	0.40	1	97	11.84	0.45		560	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.65	100.00	99.85	0.85	2	1 000	10.74	0.45		450	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.46	0.54	234	223	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	98.30						10.38	0.99	395	423	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13		102.50	102.35		2	77 500	7.40	1.04	94	125	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.02	97.00					11.90	1.28	534	578	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	95.01	98.00					10.37	1.28	380	425	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.68	3.15	166	266	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	94.50	99.40	98.65	-0.45	4	26 891	8.64	3.06	163	262	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	94.00	98.90	99.00	0.10	3	20 150	8.51	3.06	150	249	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16		99.00					12.85	0.27		658	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.10	100.25					7.87	0.06			5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	99.70	100.30					8.86	2.55	195	283	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	99.70	99.95					9.01	2.65	208	298	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.60					8.39	2.24	154	235	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.31	100.50	100.50		5	9 517	7.75	0.58	159	153	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	98.00		98.00	-0.10	13	105 000	8.62	1.51	197	253	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.01	97.95					12.64	1.49	600	654	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	81.05	86.00	81.04	-1.46	5	788	16.73	2.99	974	1 071	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.80	100.05					9.17	2.62	224	314	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.10	96.99	96.10		8	376	10.82	1.67	412	474	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.63	0.12		132	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.15	99.00					9.03	0.62	284	283	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70	99.00					8.58	1.27	202	246	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	97.98	98.31	97.98	-0.53	8	28 510	11.26	0.73	498	508	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	80.00	80.39	80.39	0.37	82	11 827	41.85	0.82	3551	3 569	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	97.00	98.60	98.58	1.28	2	3 000	10.68	0.89	430	452	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13							9.68	0.94	327	353	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14		100.50	99.75	-0.55	2	2 700	7.94	1.35	135	183	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.96	100.05					8.46	0.79	214	229	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	95.00	102.00					7.21	0.48		97	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	
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.84	98.00	97.84	0.02	4	31 500	11.50	0.77	519	533	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.00	100.96					9.14	2.33	227	311	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.02	2.62	209	299	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.00	102.99					8.35	0.83	201	219	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.50	101.90					8.45	0.95	204	230	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	100.00					7.74	1.42	112	164	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	94.50	100.00					9.60	1.44	298	350	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.03	100.25	100.15	-0.05	5	27 001	9.92	2.59	300	389	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.26	98.69					9.84	1.35	325	373	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.20	100.38	100.20	-0.10	1	530	8.92	0.22		264	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95	100.95	0.60	1	15	9.04	0.59	287	283	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.10	100.40	100.10	-0.20	5	304	10.08	0.80	376	391	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.50	100.70	100.55	-0.05	2	3 190	11.32	1.25	477	520	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.10	98.45	98.41	0.05	14	6 020	11.07	1.28	451	495	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	95.80	95.95	95.81	-0.18	1	10 235	11.55	1.57	488	546	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.70	100.25	99.95	-0.05	1	19 786	11.59	1.79	486	553	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.91	99.98	99.98	0.04	7	7 770	11.32	0.10		500	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	100.71	101.75	101.75	0.32	4	10 079	12.73	1.33	615	662	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.26	100.80					3.73	0.07			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	101.20	101.80					11.06	0.29		480	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.41	99.00					9.29	4.07	214	325	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.40	99.00					9.51	4.06	236	347	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.45	99.00	98.40	-0.75	2	500	9.51	4.07	236	347	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	100.00	100.20	100.20	-0.05	3	8 237	7.77	0.04			19 000
АФК Система 1		07/03/13		100.60	100.52	-0.08	3	21	8.12	0.31		186	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	97.00	99.95	99.75	-0.40	5	953	8.68	1.63	199	260	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.01	99.90	98.72	-0.24	8	378	8.53	1.87	178	248	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	97.26	97.48	97.48	-0.02	7	375	15.00	0.65	878	880	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.10	100.25					12.12	0.57	597	590	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.11	100.25	100.15	0.05	12	9 338	12.14	0.87	577	598	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14							8.29	0.48		205	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.15	100.40					8.50	0.59	233	229	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	86.00	100.00					8.64	0.63	244	244	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.07	98.30	98.06	-0.11	10	55 275	9.21	0.96	279	306	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.05	100.10	100.05	-0.10	3	5 050	9.47	1.70	276	340	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	96.00	96.59					9.59	1.88	283	354	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	86.00	101.30					7.53	0.54	140	131	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.00	100.10	100.04	-0.06	1	6 520	8.56	0.85	220	240	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	97.50	99.70					8.77	1.17	225	264	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.00	102.00	100.00	0.05	1	1	8.77	1.23	223	265	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12	100.18	100.25					6.86	0.04			5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.05	100.13	100.10	-0.06	4	306	8.37	0.09		205	5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.00	100.12	100.08		6	476	9.08	0.64	287	288	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	99.40					9.14	1.29	257	302	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.60	99.75	99.60		1	1	9.15	0.43		290	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	100.00	100.27	100.00	-0.27	1	54	8.92	0.56	278	270	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	99.95	100.00	100.00	-0.05	19	20 260	9.32	0.72	305	314	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.31	99.80	99.70	0.10	1	2 000	9.07	0.76	277	290	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	86.00	100.15					9.26	1.22	272	313	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.50	100.00					9.77	1.50	313	368	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/11/12	26/05/14	99.95	99.98	99.95		12	30 075	8.71	0.04			5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15		100.10	100.05	-0.01	1	20 000	8.76	0.24		249	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.10	100.10	-0.02	1	2 000	8.58	0.25		231	3 000
Банк ЗЕНИТ 1	07/04/12	07/04/13	99.45	99.80					8.97	0.40		272	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	
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.31	100.40					8.60	0.53	248	237	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.35	100.40	100.35		5	11 170	8.77	0.61	258	256	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.26	100.31	100.26	-0.03	3	1 168	9.01	0.77	271	284	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.84	127	146	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14							9.29	0.94	288	314	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.20	100.27	100.20	0.06	1	11 709	9.24	1.35	265	313	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	99.95	100.08	100.05	-0.08	1	1	8.65	0.27		238	5 000
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15	99.91	100.10					8.73	0.27		246	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	98.55	99.56	99.56	-0.13	19	21 377	9.21	0.57	306	299	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	98.70	99.30	98.70	-0.37	3	3 004	9.96	1.17	344	383	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.00	100.10	100.10	-0.05	3	322	10.32	1.67	362	424	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	99.00	101.70					12.58	3.89	545	654	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							8.01	0.08			3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.40	100.20	100.15	-0.05	3	12 001	8.99	0.84	264	283	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.00	100.25					9.40	0.88	303	324	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.20	100.40					8.35	0.17		205	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.70	99.93	99.90		3	15 000	8.98	0.28		271	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.86	99.93	99.89	-0.01	10	77 101	9.71	0.45		347	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.72	99.82					10.09	0.84	374	393	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15							9.97	0.88	360	381	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.95	100.00	100.00	0.02	2	7 005	10.50	1.35	391	439	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.05	98.38	98.38	0.08	10	40 008	10.57	1.48	393	447	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.30	100.55					7.71	0.10		139	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.11	102.00	99.95	0.35	3	11 026	9.14	0.78	283	297	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	86.00	100.29					9.32	0.75	303	315	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.00	100.28	100.27		4	13 650	9.67	1.21	313	354	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.70	99.80	99.80		3	4 500	9.18	0.81	285	301	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.95	100.07	100.05	0.05	1	5 780	9.87	1.22	333	374	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3	29/10/13		100.20	100.25					9.36	0.57	321	314	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1	28/02/14		100.00	100.10					9.84	0.64	363	364	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4	03/07/14		98.90	99.15					9.86	0.84	351	370	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5	05/02/15		100.75	100.90	100.75	-0.20	8	11 840	11.28	1.15	477	515	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6	10/02/15		100.00	101.00					11.53	1.16	502	540	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7	22/04/15		99.90	100.34					11.45	1.21	491	532	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2	12/01/15		101.50	101.60	101.60		2	1 365	11.09	1.93	432	504	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9	17/02/15		101.50	101.70	101.60	0.20	1	1 000	11.13	1.98	435	509	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.10	98.29	98.10	-0.38	6	53 848	13.07	0.70	681	689	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.10	100.57	100.65	0.55	6	2 002	12.24	0.71	598	606	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.40	100.45	100.40	0.15	9	2 417	12.58	0.43		633	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	100.20	100.60	100.21	-0.05	14	7 471	13.94	0.64	773	774	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	104.01	104.22	104.22	-0.78	7	5 967	13.85	0.66	762	766	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	100.16	100.99					14.51	0.82	817	835	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	102.57	102.68	102.68	0.04	27	2 295	14.08	0.93	768	792	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	100.37	100.43	100.37	0.17	9	602	14.09	1.17	757	796	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.81	99.85	99.85		24	5 773	14.90	0.70	864	872	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.05	100.10	100.05	-0.25	3	185	10.72	0.96	430	457	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.50	100.07	100.07	0.22	1	2	8.78	0.84	243	262	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.15	100.40	100.20		3	10 000	9.48	1.67	278	340	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	99.90					7.69	0.94	128	154	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	86.00	100.84					8.18	1.18	166	205	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18		100.05	100.05	0.05	1	5	7.79	1.19	126	166	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.25	100.40					8.57	2.07	176	253	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	100.05					8.94	1.43	232	284	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	99.99	100.05	100.06	0.02	1	1	8.57	0.78	226	240	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	99.90	100.07	100.07	0.07	6	50 003	8.56	0.79	224	239	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.50	99.25	0.10	1	1	8.64	0.79	232	247	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.78	1.01	234	263	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.20	100.25	100.25	0.10	10	39 391	9.15	1.82	241	309	5 000

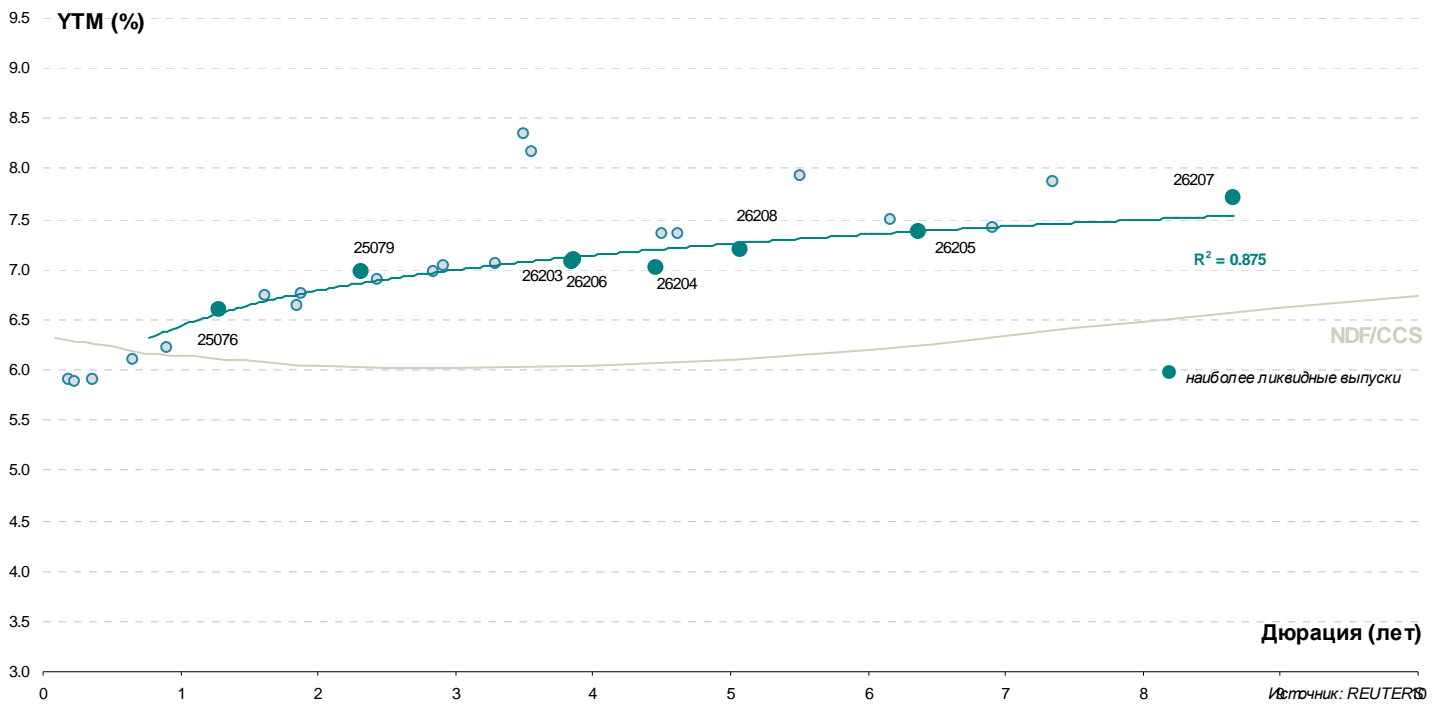
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.20	100.30	100.40	0.25	3	5 002	9.07	1.83	233	301	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.02	3.39	196	299	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.80	100.94	100.94	0.14	1	25	7.95	0.99	152	180	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.60	99.80	99.80	0.05	1	580	7.85	0.99	142	170	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		221	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.02	100.07	100.02	-0.06	5	729	9.60	0.96	318	345	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.21	100.19	-0.01	1	900	8.59	0.36		234	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15		100.35					9.27	0.95	286	312	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13							7.52	0.48		128	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15							10.71	0.72	444	453	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	99.90					11.46	0.90	508	530	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14							11.02	1.29	445	490	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	99.99	100.09	99.99	0.06	2	56 000	8.06	0.08			5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.00	100.05	100.05	0.02	1	1 646	8.63	0.42		238	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14			99.25	1.25	6	80 000	9.03	0.91	264	287	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	99.85	100.00	100.03	-0.02	8	14 073	10.10	2.19	326	406	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.00					7.98	1.32	140	186	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.70	99.05					9.17	0.62	297	297	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00					9.18	0.79	286	301	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	100.45	100.05	0.13	1	5 000	9.37	0.82	303	321	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.00	100.50					9.30	0.82	296	314	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15		99.00					9.34	0.98	291	319	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15							9.45	0.94	304	330	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.23	100.35	100.35		1	270	10.04	1.83	329	398	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.35	100.55	100.35	0.02	1	1	8.90	0.71	264	272	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.20	97.45	97.45	0.05	1	200	9.14	1.49	250	304	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							9.41	1.84	266	335	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.21	100.29	100.28	-0.01	6	100 000	10.50	1.23	396	438	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.30	97.60	97.56		9	4 344	10.46	1.30	389	434	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	95.76	95.95	95.76	-0.24	3	5 100	11.00	1.59	433	492	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.10	100.50					9.04	0.07			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	99.60	100.20					9.91	0.52	381	368	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.00	99.14	99.15	-0.03	5	9 000	10.08	0.63	387	388	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	99.90	100.30					10.07	0.88	370	391	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.90	100.00					10.08	0.88	371	392	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	86.00	100.55					9.83	1.20	330	370	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.96	99.97	99.95	-0.01	2	2 276	10.27	1.17	375	414	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.50	97.92	97.25	-0.13	3	5 152	10.44	1.39	383	433	5 000
Банк Интеза													
Интеза О3	11/10/13	13/04/15	99.83	99.84	99.80		1	80	9.43	0.89	305	327	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	99.90	100.00					9.98	1.38	338	387	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнв ест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.15					7.99	0.10		167	2 000
ЦентрИнв ест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.04					6.48	0.10		16	1 000
ЦентрИнв ест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.27	100.35	100.35	0.02	4	10 003	9.01	0.43		276	2 000
ЦентрИнв ест 2	25/06/13	24/06/14	100.55	100.70	100.68	0.03	3	10 450	9.41	0.59	324	320	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк О3	20/12/12	09/12/21		100.45					11.15	0.10		483	5 000
СвязьБанк О4	24/04/13	13/04/22		101.00	100.00	-0.80	1	1 000	8.92	0.44		268	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15		100.00					9.20	0.98	277	305	5 000
СвязьБанк О5	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	283	369	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинв естбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	99.70	99.85	99.70		2	4 000	11.12	0.91	473	496	2 000
Судостроительный 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	
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	98.50	100.03	100.03	0.04	1	10	11.07	0.30		481	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	99.20	100.19	100.19	0.19	1	2	11.04	0.88	467	488	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14							9.50	0.22		322	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	99.90	100.20					10.85	0.41		460	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	91.00	101.00	100.30	0.02	2	39 998	11.68	0.87	531	552	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.08	100.10					7.44	0.10		112	2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	92.00	96.50					10.19	1.59	352	411	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14		100.25	100.25		2	4	9.28	0.41		303	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	86.01	100.02	100.25	0.22	3	20 001	9.35	0.44		311	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.26	100.25					11.17	0.84	482	501	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	27/11/12	23/05/17	100.00	100.15					8.90	0.04			3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	98.00	99.92					12.11	0.79	579	594	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.15					9.32	0.24		305	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	99.90	100.07	100.07	0.01	2	51 000	10.20	0.67	396	401	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.40	100.42	100.40	-0.04	5	30 000	10.39	0.72	412	421	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13		100.20					9.71	0.51	361	348	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14							9.75	0.63	355	355	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.15	100.25					10.43	0.88	405	427	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	95.10	100.10	100.00		10	4 003	12.34	0.92	594	618	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.40	99.75	99.60	-0.20	5	319	9.67	0.90	329	351	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15		100.09	100.09	-0.26	3	135 000	9.76	0.90	337	360	5 000
УБРИР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	99.91	100.50	100.30	0.15	4	6 602	11.08	0.46		484	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.12	100.29	100.17	0.07	9	7 110	12.63	0.85	627	647	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14		100.27	99.90		3	753	10.81	0.10		449	2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.21	100.33	100.30	0.08	6	21 100	12.37	0.73	609	619	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03		28/10/15							11.00	0.98	457	485	
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14	100.10	100.14	100.10	0.05	12	12 482	9.88	0.04			2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.96		100.10		1	24	8.80	0.08		248	1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.00	100.10	100.10		17	50 349	11.07	0.27		480	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.01	100.20					9.70	0.29		344	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.50	99.69					12.11	0.40		586	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	99.99	100.00	99.95	-0.10	18	29 502	13.50	0.89	712	734	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.27	99.00	99.00		4	135	12.08	1.04	562	593	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	100.00	100.05	100.05	-0.05	1	4 000	12.60	1.34	601	649	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	481	550	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		104.60	105.24					5.97	0.53			30 000
Москва 53	01/09/13		98.10	100.21	100.21	0.11	1	1 300	6.82	0.78	51	65	15 000
Москва 63	10/12/13		95.00	109.40	108.60	-0.55	1	1 000	6.80	0.99	37	65	15 000
Москва 62	08/06/14		107.83	107.95	107.83	-0.82	12	6 076	7.24	1.42	62	114	35 000
Москва 39	21/07/14		92.50	99.99					7.32	1.59	65	123	10 000
Москва 64	24/06/15		98.40	99.45	99.11	0.11	3	26 500	7.51	2.37	63	148	20 000
Москва 44	16/11/15								7.32	2.48	42	129	40 000
Москва 56	22/09/16		96.61	97.90	97.80	-0.12	3	20 023	7.81	3.41	75	178	20 000
Москва 49	14/06/17		97.00	97.90					7.69	3.88	56	165	25 000
Москва 48	11/06/22		89.98	91.09					8.14	6.82	73	182	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		99.12	101.00					8.97	0.55	283	275	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		98.52	99.30	99.01	-0.29	8	10 890	8.94	1.36	234	283	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	02/12/12		100.23	100.33	100.33	-0.02	1	53	6.23	0.05			3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12								-81.90	0.01			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.27	100.20					8.39	1.75	167	232	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16								8.72	2.14	190	268	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		103.31	103.60					7.56	0.48		132	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.39	101.75					8.09	1.04	163	194	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		93.00						9.01	2.02	222	297	12 000

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	
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.81	100.35					8.70	0.40		245	3 000
Якутия 9		19/09/13	100.71	102.00	101.20	-0.20	1	1	7.89	0.58	173	168	2 000
Якутия 7		17/04/14	99.62	99.77	99.77	-0.15	6	53 965	8.22	1.28	166	210	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12	99.80	99.92	99.92	0.14	2	862		0.08			2 000
Краснодар 02		05/11/15	99.50	100.05	99.80	-0.59	2	69 995	9.30	2.27	245	327	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	99.50	99.98					8.65	1.30	208	253	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 5		29/11/16	101.00	101.35					8.17	1.43	155	207	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	99.66	100.10					8.85	0.50		261	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	100.00	98.28	1.28	2	10 000	8.65	1.36	205	254	2 000
Коми Респ 8		03/12/15		95.99					8.53	2.23	168	249	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							8.98	2.28	212	295	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.25	103.55	103.25	-0.25	1	2 400	8.99	2.41	211	296	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12	100.12	100.19	100.06	-0.18	10	34 250	8.61	0.10		229	3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.11	100.31	100.30	0.05	9	73 054	9.66	1.79	293	360	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16	100.07	103.23	103.23		5	25	9.53	2.24	268	349	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.45	101.70	101.80	-0.10	2	8	8.95	1.64	226	287	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13							7.48	0.49		124	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.00	99.70	99.70	0.10	1	1	8.06	1.11	157	192	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.55	100.85	100.55	-0.35	3	2 001	8.90	2.14	208	286	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	99.40	100.00					8.99	1.04	253	284	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	100.05	100.32					6.65	0.10		33	2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	102.80	103.80					7.94	1.02	149	179	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16		101.90					8.17	1.75	145	210	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	99.80	103.35					9.17	0.74	289	300	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13	106.45	107.40	107.40		1	30	8.32	1.03	187	217	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.01	98.30	98.30		5	1 094	9.53	2.43	264	350	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



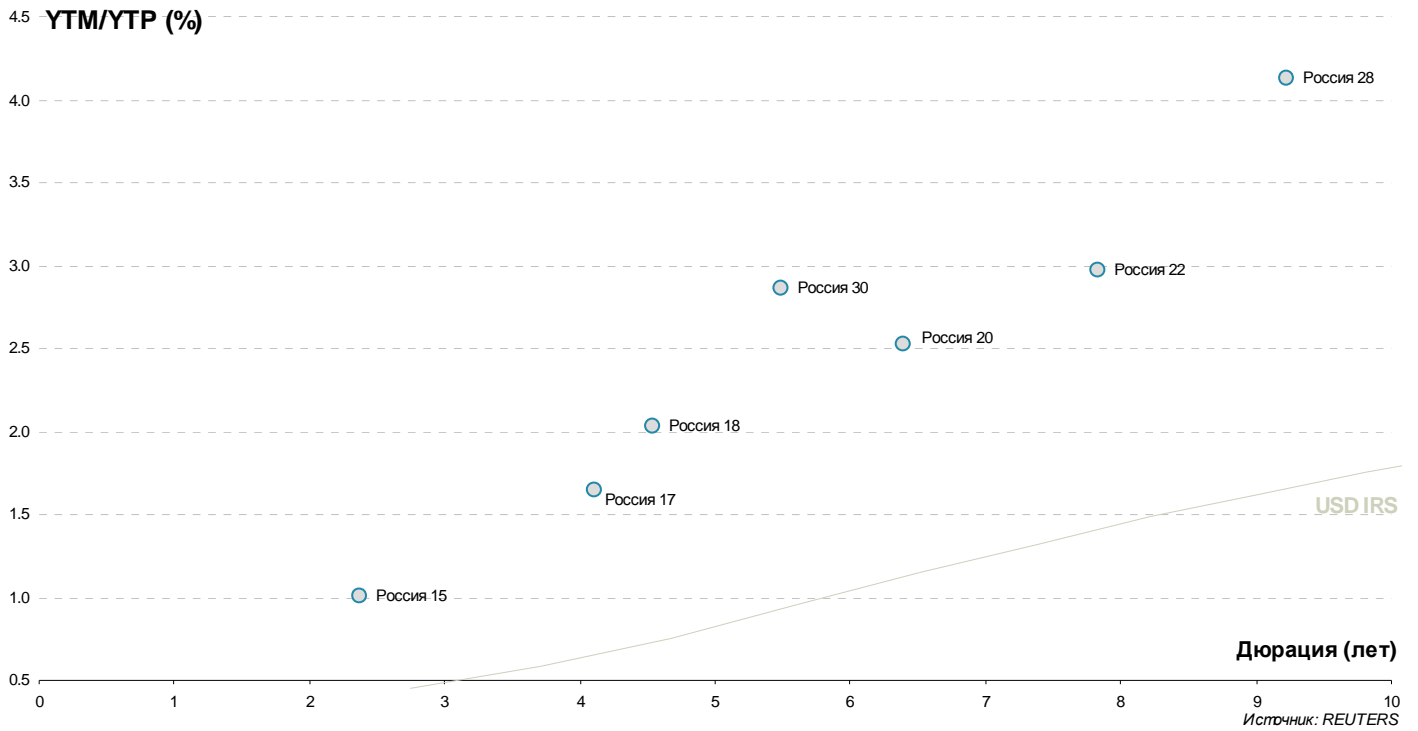
Результаты торгов евробондами

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд	
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			Дюрация
РОССИЯ										
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		106.150	106.480	1.08	0.95	2.37	0.13	68
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.500	107.000	1.70	1.59	4.12	0.88	107
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		146.789	149.211	2.20	1.85	4.53	-0.01	139
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.532	126.681	2.88	2.86	5.49	-0.11	161
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.500	117.000	2.55	2.49	6.40	0.38	138
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.250	112.750	2.99	2.94	7.83		153
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.833	199.167	4.16	4.09	9.23	-0.06	233
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		121.900	122.650	4.30	4.27	15.98	0.90	202
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.285	101.410	1.51	1.23	0.43	-0.01	123
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.598	101.895	1.84	1.16	0.42	-0.01	156
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.250	102.500	1.71	1.10	0.40	-0.02	143
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		104.100	104.300	1.63	1.36	0.69	-0.02	133
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.363	111.113	2.70	2.17	1.27	-0.05	240
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		110.150	110.900	2.60	2.05	1.23	-0.10	229
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.481	109.706	2.41	2.28	1.60	-0.02	208
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.075	107.550	2.65	2.49	2.80	0.13	222
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.599	107.599	2.96	2.67	3.21	-0.33	248
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.614	112.068	3.11	3.00	3.55	-0.27	257
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.071	123.056	3.61	3.43	4.55	-0.76	285
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.607	131.099	3.84	3.76	5.17	0.11	291
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.203	111.531	3.41	3.31	2.92	0.03	268
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.197	117.692	4.25	4.19	7.24	0.10	286
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		105.600	106.000	4.24	4.19	7.75	-0.82	277
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		140.711	141.742	5.40	5.33	11.79	-1.51	336
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		127.382	127.885	5.29	5.26	13.03	-0.90	316
Газпром нефть										
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		101.442	102.192	4.19	4.10	8.07	1.19	269
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.323	106.323	1.67	-0.97	0.71	-0.01	137
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.350	105.750	1.51	1.21	1.26	-0.05	118
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		128.750	129.750	3.17	3.00	4.70		234
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.643	111.110	3.12	3.01	3.94	0.21	251
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		111.270	112.020	4.23	4.14	7.48	-0.09	282
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		99.999	100.999	5.37	5.14	4.40	-0.19	472
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.902	107.301	3.32	3.15	2.16	-0.22	296
VTB'17 6%	USD	12/04/17		104.408	104.783	4.88	4.78	3.93	-0.35	430
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.324	106.324	5.15	4.94	4.52	-0.60	443
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		107.757	108.250	5.24	5.14	4.60	-0.24	448
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		106.145	106.644	5.58	5.50	6.32	-0.64	443
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		103.520	104.270	6.46	6.36	7.35	-0.03	508
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.490	106.887	5.73	5.70	12.46	-0.25	364
VTB' 9.5%	USD			101.374	102.374	9.29	9.13	6.56	0.08	807
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.498	102.748	2.20	1.70	0.49	-0.13	191
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.410	107.410	3.78	3.35	2.17	-0.09	342
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.350	103.700	4.76	4.64	2.74	0.15	437
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.480	101.480	5.90	5.64	4.00	0.11	535
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.349	108.724	3.25	3.16	3.82	0.09	266
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.214	109.706	3.44	3.33	4.38	-0.04	272
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.174	118.671	4.11	4.04	6.09	-0.08	296
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		111.999	112.999	4.48	4.36	7.45	-0.25	305
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.818	119.318	4.84	4.79	8.98	0.57	308
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.650	103.750	1.94	1.79	0.60		166
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		105.870	106.170	3.31	3.16	1.94	0.27	296
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.425	107.819	3.73	3.59	2.64	-0.23	334
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		110.794	111.094	3.96	3.87	3.11	-0.17	347
GAZPROM '17 5.625%	USD	17/05/17		103.514	103.889	4.75	4.66	3.94	-0.28	415
GAZPROM '19 7.25%	USD	03/05/19		105.496	106.496	6.20	6.02	5.30	-0.24	532
GPB EURO' 7.875%	USD			100.043	101.043	7.86	7.64	4.51	0.08	722
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.550	102.925	2.02	1.29	0.50	-0.02	174

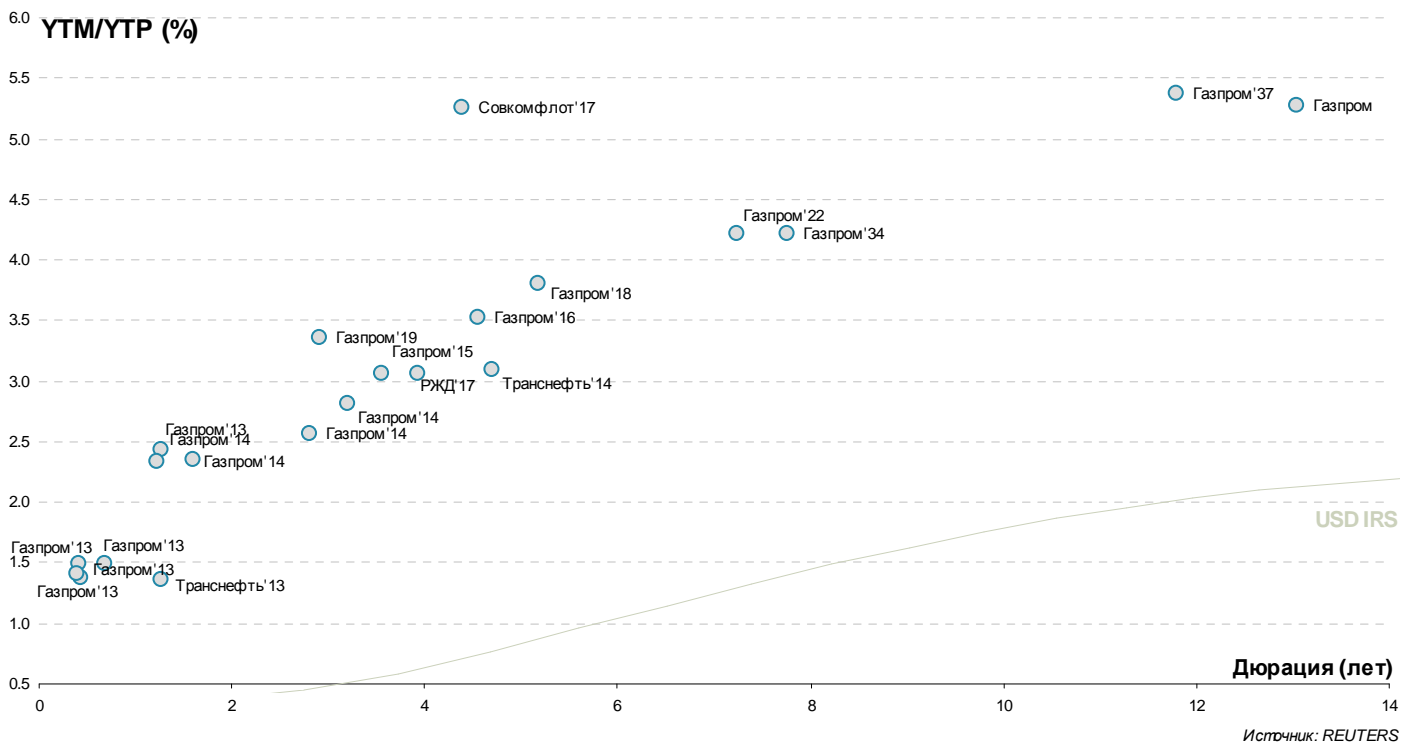
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.996	106.121	1.88	1.77	1.11		156
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.600	110.900	2.10	1.92	1.45	-0.05	176
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.162	110.652	3.82	3.71	4.01	-0.34	321
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		107.045	107.420	3.77	3.69	4.49	0.06	305
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.905	119.395	3.92	3.83	4.56	-0.56	313
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		104.874	105.499	4.50	4.31	3.18	-0.46	404
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		102.550	102.700	1.32	1.02	0.50	-0.08	103
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		103.050	103.425	1.56	0.98	0.61		127
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.184	107.681	2.66	2.48	2.46	-0.09	227
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		107.962	108.460	3.42	3.30	3.93	-0.16	282
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		105.695	106.495	3.49	3.29	3.83	-0.17	291
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		105.698	106.135	4.18	4.11	5.61	-0.04	320
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.285	108.910	4.54	4.46	6.83	-0.39	325
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		111.205	112.205	4.62	4.49	7.20	-0.70	324
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		100.039	100.789	5.12	5.02	7.91	0.08	365
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.500	103.000	3.09	1.97	0.44	-0.08	283
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		108.205	108.679	5.24	5.08	2.71	0.34	487
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		102.375	103.025	6.77	6.60	3.86	-0.49	626
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		111.442	112.409	6.94	6.74	4.42	0.07	627
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		99.327	100.327	6.90	6.68	4.63	-0.27	621
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		102.025	102.525	5.88	5.73	3.27	-0.10	544
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		99.801	100.238	4.98	4.91	5.86	0.03	396
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		106.750	107.500	6.68	6.34	2.10		641
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.467	110.954	3.42	3.19	1.81	-0.03	309
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		113.309	113.804	5.65	5.58	6.21	-0.53	451
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.625	102.875	2.54	2.00	0.46		226
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.667	102.222	4.58	2.96	1.56	-0.13	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		105.750	105.750	4.55	4.55	2.91	-0.20	413
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.724	111.219	4.90	4.75	3.04	-0.28	446
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		103.160	104.160	5.42	5.16	3.79	-0.96	489
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		116.560	117.054	5.56	5.47	4.49	0.31	484
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.110	110.110	6.31	6.16	6.20		514
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		107.250	107.750	6.45	6.38	6.86	-0.38	516
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.364	108.553	2.02	1.93	1.88	0.34	167
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.157	113.547	3.23	3.14	3.97	-0.08	260
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		119.902	120.403	3.95	3.88	5.72	-0.18	292
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		112.785	113.280	4.22	4.15	6.53	-0.05	301
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		119.663	120.414	4.14	4.06	7.28	-0.55	272
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		124.199	124.706	4.79	4.72	5.79	-0.43	369
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.000	106.750	3.34	3.10	2.96	-0.25	289
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		116.000	117.000	4.27	4.14	6.52	-0.60	304
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		105.450	105.700	1.90	1.56	0.68	0.21	161
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.500	109.750	2.43	2.26	1.36	0.25	210
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		104.360	105.360	4.94	4.65	3.31	-0.21	448
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.176	106.667	5.26	5.15	4.30	-0.15	461
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		98.429	99.429	6.11	5.98	7.60	-0.35	470
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		101.842	102.842	7.31	7.08	4.29	0.15	669
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		104.050	105.050	6.68	6.43	3.85	0.02	616
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		102.001	105.001	1.30	-7.42		-0.25	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.257	108.137	2.84	2.45	2.07	-0.49	247
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.292	116.298	3.06	2.80	3.24	0.29	257
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.520	114.503	3.26	3.04	3.85	0.52	267
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		120.660	121.667	3.58	3.39	4.50	0.66	283
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		120.756	121.799	3.92	3.77	5.80	0.01	284
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		104.000	104.350	2.54	1.98	0.58	-0.16	226
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.044	108.544	4.34	4.13	2.16	0.14	400
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		98.542	99.542	6.70	6.42	3.75	-0.02	620
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		108.628	109.628	5.81	5.58	4.13	-0.55	519

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.364	100.364	6.47	6.20	3.77	-0.02	597
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.738	110.738	5.56	5.34	4.14	0.38	494
ALFA BANK'21 7.75%	USD	28/04/21		108.924	109.924	6.37	6.22	6.45	0.17	516
Номос Банк										
NOMOS BANK'12 9.25%	USD	17/12/12		100.450	100.575	4.44	3.20	0.10		438
NOMOS BANK'13 6.5%	USD	21/10/13		101.996	102.246	4.31	4.04	0.93		406
NOMOS BANK'15 8.75%	USD	21/10/15		104.865	105.865	6.89	6.52	2.65	0.11	658
NOMOS BANK'19 10%	USD	26/04/19		100.503	101.503	9.89	9.68	4.90	0.24	918
Промсвязьбанк										
PROMSVYAZB'18 12.5%	USD	31/01/18		101.500	102.500	5.24	0.90	0.22		513
PROMSVYAZB'13 10.75%	USD	15/07/13		104.884	105.134	3.36	3.00	0.65		309
Promsvyazb'14 6.2%	USD	25/04/14		100.896	101.396	5.55	5.19	1.41		531
PROMSVYAZB'15 12.75%	USD	27/05/15		110.757	111.757	7.99	7.57	2.15		775
PROMSVYAZB'16 11.25%	USD	08/07/16		106.936	108.936	8.97	8.36	3.02	0.18	867
PROMSVYAZB'17 8.5%	USD	25/04/17		100.592	101.592	8.34	8.07	3.79	0.09	789
ХКФБ										
HOME CREDIT'14 7%	USD	18/03/14		103.247	103.747	4.49	4.11	1.30	0.46	422

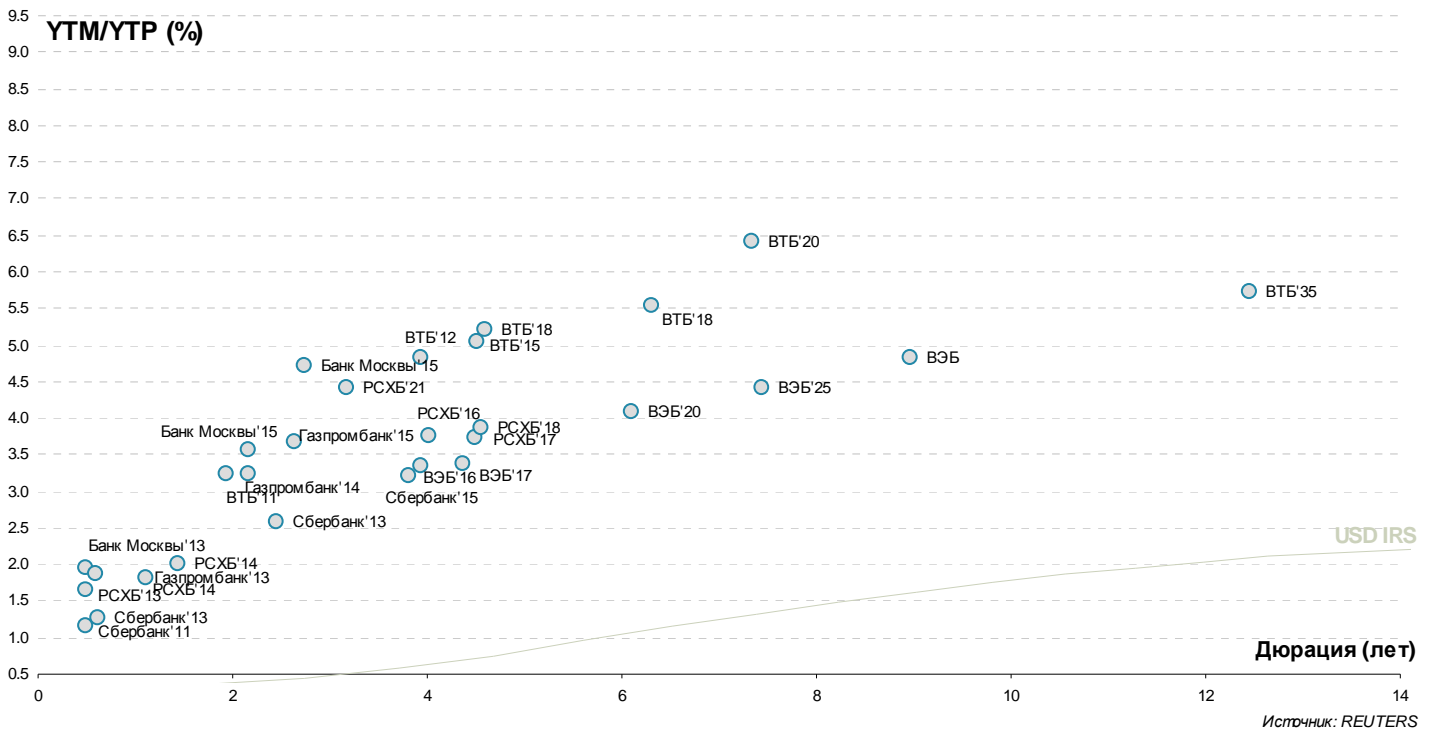
Россия



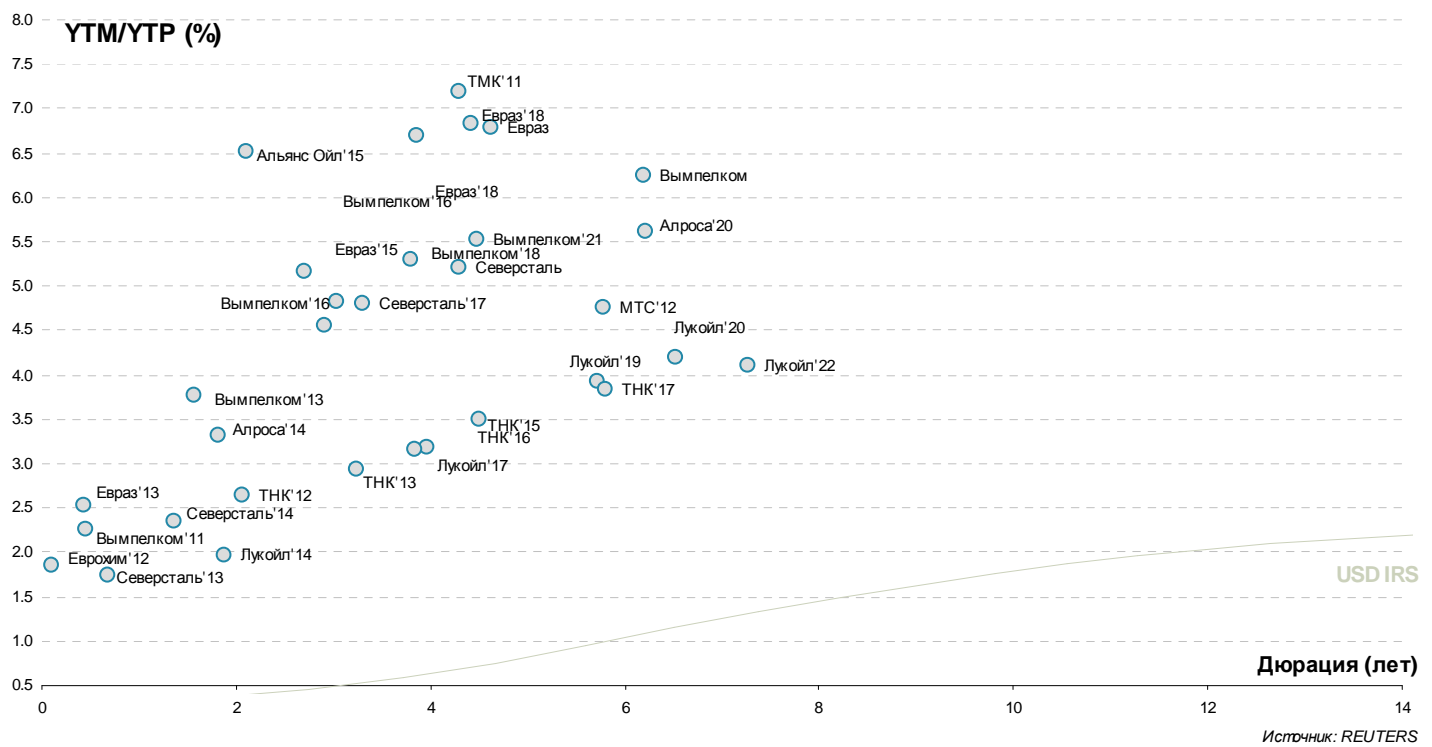
Госкомпании



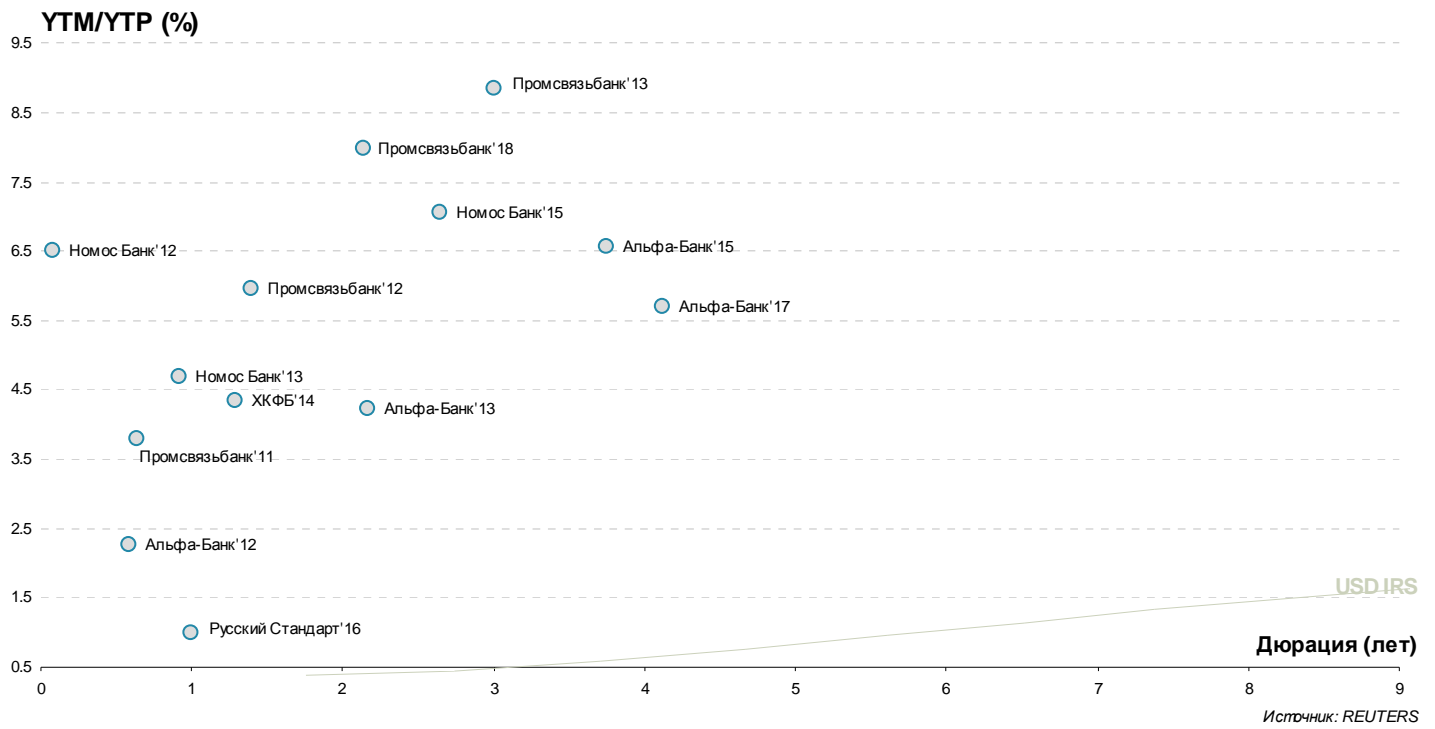
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
 Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
 Максим Симагин
 Александр Валканов
 Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

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](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.