

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события / стр. 2/

Внешний рынок долга / стр. 3/

- Рынки остаются в режиме ожидания

Денежно-кредитный рынок / стр. 4/

- Пик налоговых платежей придется на следующую неделю
- Рубль немного скорректировал прежний рост

Российский долговой рынок / стр. 5/

- Евробонды неактивны
- Спрос на ОФЗ не иссякает

Первичный рынок / стр. 6/

Приложения

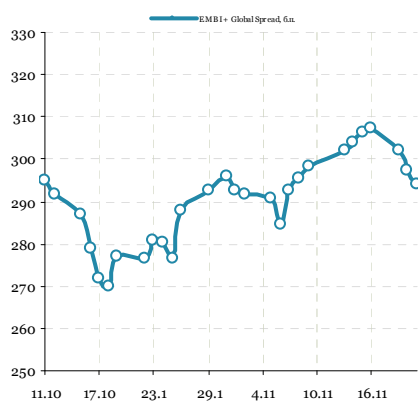
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.68	■	0.00	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	141	■	0	117	162
EMBI+ Glob.	294	▼	-3	270	441
EMBI+ Rus sprd	160	▼	-7	141	332
Russia 30 yield	2.86	▲	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	0.68
MosPrime-1m	6.78	▲	0.02	6.35	6.89
Корсчета в ЦБ	708.0	▼	-107.6	446	940
Депоз. в ЦБ	111.8	▼	-2.1	65	238
NDF RU 3m	6.2	▼	0.0	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	31.81	▲	0.005	30.46	33.67
EUR/RUB	40.146	▲	0.190	38.97	41.81
EUR/USD	1.288	▲	0.006	1.21	1.31
Корзина ЦБ	35.196	▲	0.109	34.82	37.28
DXU Индекс	80.699	▼	-0.233	78.85	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1419.9	▲	0.5%	1228	1589
Dow Jones	12836.9	▲	0.38%	12101	13610
DAX	7245.0	▲	0.84%	5969	7452
Nikkei 225	9223	▲	1.56%	8296	9232
Shanghai Comp.	2155.6	▲	0.58%	2004	2390
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	110.3	▲	0.23%	88	117
Нефть Brent	110.6	▼	-0.22%	89	117
Золото	1729.6	▲	0.10%	1553	1790
CRB Index	297.6	■	0.00%	267	321

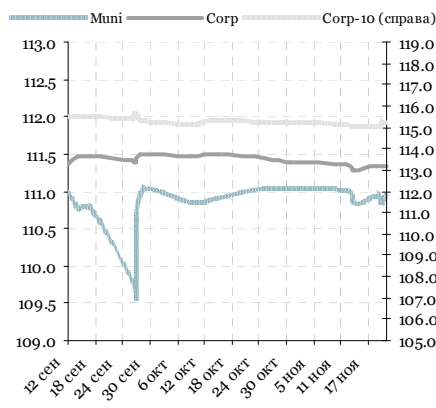
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	121.3	▲	0.69	107.5	121.3
Muni	110.9	▲	0.06	109.6	112.8
Corp	111.3	▲	0.01	110.7	112.1
Corp-10	115.3	▲	0.18	115.0	117.1
Total Return					
OFZ	279.5	▲	1.61	233.3	279.5
Muni	350.3	▲	0.29	325.1	350.3
Corp	348.0	▲	0.10	324.0	349.7
Corp-10	349.7	▲	0.60	325.3	349.7
Объем торгов в сегменте (млн руб.)					
OFZ	936	▼	-116	0	22514
Muni	770	▼	-2	10	5492
Corp	6251	▼	-1444	19	44858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Life Consumer Finance B.V. с 23 ноября начнет сбор заявок инвесторов на приобретение облигаций первой серии объемом 3,2 млрд руб. /Интерфакс/

Evgaz plc продает ЗАО «Нефтетранссервис» свою транспортную «дочку» ООО «Евразтранс» за 9,45 млрд руб. Покупатель получит 4114 полувагонов, Evgaz сохранит в собственности и продолжит оперировать вагонами-хопперами, используемыми для перевозки окатышей. /Интерфакс/

Совет директоров **ОАО «Транснефть»** утвердил инвестиционную программу на 2013 год в размере 161 млрд руб. Компания планирует направить 82 процента средств на проекты развития системы магистральных нефтепроводов, в том числе «Заполярье – Пурпе», «Куюмба – Тайшет», расширение ВСТО-1 и ВСТО-2. Инвестпрограмма в 2014-2015 годах составит 325,3 млрд руб. /Bloomberg/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 22.11.2012 – четверг

Статистика США: Initial jobless claims, Continuing claims, U. of Michigan confidence

- **Выплата купона:** Россельхозбанк, 08 (10.1%, 251.8 млн руб.), Россельхозбанк, 09 (10.1%, 251.8 млн руб.), ССМО ЛенСпецСМУ, БО-02 (14.5%, 39.7 млн руб.), Республика Хакасия, 34001 (8.2%, 13.6 млн руб.), Внешэкономбанк, 2017 (LPN) (5.45%, 16.3 млн долл.), Внешэкономбанк, 2025 (LPN) (6.8%, 34 млн руб.), Санкт-Петербург, 25038 (7.76%, 387 млн руб.), Мехпрачечная СвЖД, 01 (8%, 99.7 млн руб.), Минфин Республики Саха (Якутия), 35003 (7.95%, 50.1 млн руб.), Калужская область, 34005 (8.2%, 51.1 млн руб.), Костромская область, 34006 (9.5%, 94.7 млн руб.), Газпром, 2016 (LPN7) (6.212%, 41.9 млн долл.), Газпромбанк, 05 (6.85%, 683.2 млн руб.), Иркутская область, 31006 (9.15%, 6.6 млн руб.), РЖД, 12 (0.1%, 7.5 млн руб.)
- **Погашение:** Матрица Финанс, 03 (700 млн руб.), Газпромбанк, 05 (20 млрд руб.), Иркутская область, 31006 (3.8 млрд руб.)

Сегодня: 23.11.2012 – пятница

- **Выплата купона:** Москва, 66 (9.248%, 699.3 млн руб.), РК Казначей, 01 (10.5%, 157 млн руб.), ВТБ Капитал, 2016-2, RUB (Structured) (11%, 41.5 млн руб.), Газпром, 2016-2 (LPN24) (4.95%, 24.7 млн долл.), Республика Коми, 35007 (8%, 40.3 млн руб.), Ярославская область, 34011 (9.1%, 68 млн руб.), Вымпелком, 2016 (LPN) (8.25%, 24.7 млн долл.), Россия, 39002(ГСО-ФПС) (6.5%, 1.3 млрд руб.)

26.11.2012 – понедельник

- **Выплата купона:** НОВИКОМБАНК, 01 (9.5%, 95.2 млн руб.), Инвестторгбанк, БО-01 (10.25%, 103.3 млн руб.), Удмуртская республика, 34004 (8.6%, 86.7 млн руб.), ИСО ГПБ-Ипотека Два, А (7.5%, 19.7 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-С, RUB (RMBS, FRN) (12%, 2.7 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-С, RUB (RMBS, Step Up) (11.5%), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Da, RUB (RMBS) (12%, 3.3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-Dz, RUB (RMBS) (12%, 1.1 млн руб.), SovCo Capital Partners B.V., 2015 (15%, 2.8 млн руб.), Банк Москвы, 2015 (LPN) (5.967%, 8.9 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2046-В, RUB (RMBS, FRN) (9%, 3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А1, RUB (RMBS, Step Up) (8.35%, 13.4 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-В, RUB (RMBS, Step Up) (8.75%, 2.3 млн руб.), Банк ГПБ-Ипотека, 2047-А2 (RMBS, Step Up) (8.5%, 2.2 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-А (RMBS) (8.75%, 21.9 млн руб.), КИТ Финанс ИБ (ООО), 2040-В (RMBS) (9%, 4.6 млн руб.), НИИ ВТБ 001, 1А (10.5%, 15 млн руб.), ТрансФин-М, БО-07 (8.5%, 21.2 млн руб.), Медведь-Финанс, 02 (12.5%, 31.1 млн руб.), Банк Зенит, БО-06 (7.25%, 182.7 млн руб.), ВТБ 24 (ЗАО), 2-ИП, класс Б (3%, 10.2 млн руб.), ВТБ 24 (ЗАО), 2-ИП, класс А (9%, 61.4 млн руб.)
- **Оферта:** Россельхозбанк, 08 (5 млрд руб.), Россельхозбанк, 09 (5 млрд руб.), СУ-155 Капитал, 04 (1 млрд руб.), РЖД, 12 (15 млрд руб.)
- **Размещение:** ВТБ Капитал Финанс, 02 (1 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Рынки остаются в режиме ожидания

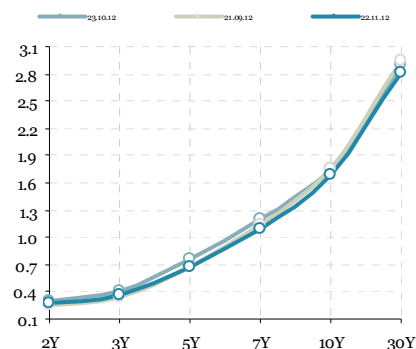
Настроения на глобальных площадках остаются умеренно позитивными, однако инвесторы продолжают следить за важными политическими событиями, которые предопределят поведение ключевых экономик в следующем году. Выходной день в США переключил внимание на европейские события и старт саммита ЕС, а также статистику из Китая. В поднебесной был опубликован индекс активности в производственном секторе в ноябре, который впервые за 13 месяцев перешагнул выше рубежа в 50 п., увеличившись с 49.5 п. до 50.4 п.

В отношении Европы продолжают поступать разочарования, связанные, прежде всего, с тем, что Кипр так и не смог согласовать с международными кредиторами условия предоставления кредита. Источниками разногласий стали слишком жесткие требования «тройки» к программе экономии: Кипр не согласился на снижение индексации зарплат госслужащих и необходимости приватизации ряда компаний с госучастием. Учитывая то, что Кипр выглядит даже еще более принципиальным, нежели Греция и остальные страны, обратившиеся за финансовой помощью, угроза получения первого дефолта в ЕС здесь высока.

Начавшийся вчера 2-дневный саммит лидеров ЕС, основной целью которого является согласование общего бюджета стран Евросоюза до 2020 г., указал на все недостатки союза неоднородных экономик. Тем не менее, поиски компромиссов продолжаются: председатель ЕС предложил перераспределить ряд расходов бюджета на 2014-2020 гг при сохранении его совокупного объема на прежнем уровне 1 трлн евро. Херман Ван Ромпей считает необходимым добавить 19млрд евро на поддержку сельскохозяйственного сектора, что теоретически должно найти отклик у лидеров Испании и Франции. Тем не менее, французский президент все равно не доволен параметрами рамочного бюджета ЕС из-за отсутствия в нем стратегии роста, а премьер Швеции назвал архаизмом увеличение финансирования аграрного сектора. Наиболее проблемные экономики пытаются выбить расходы на свою поддержку, Британский премьер требует еще большего сокращения расходных статей. Все эти разногласия делают утопичными создание по-настоящему сбалансированного бюджета ЕС, поэтому есть вероятность того, что очередной саммит ЕС пройдет безрезультатно.

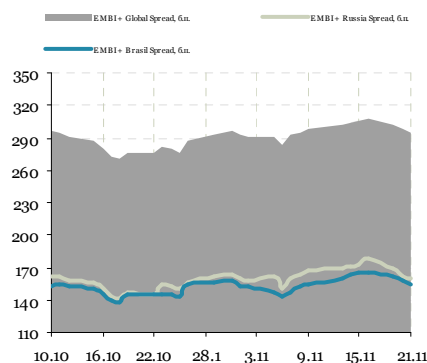
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



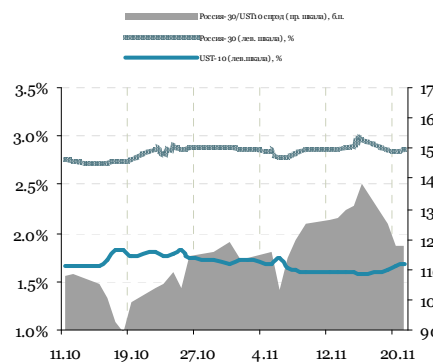
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



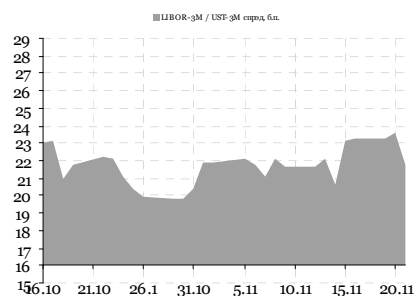
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Пик налоговых платежей придется на следующую неделю

Условия локального денежно-кредитного рынка вчера существенно не изменились. Краткосрочные процентные ставки держались на уровне предыдущего дня: овернайт на рынке МБК обходился в среднем под 6.15% годовых, 1-дневное междилерское репо с облигациями – под 6.30% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ спрос остроты банков был удовлетворен полностью, объем заключенных составил 152 млрд руб.. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 11.4 млрд руб. до 831.2 млрд руб.

Потенциал роста краткосрочных процентных ставок сохраняется. Пик налоговых платежей придется на первую половину следующей недели, когда предстоит провести платежи по НДС, акцизам и налогу на прибыль. В сумме эти платежи потребуют не менее 350 млрд руб., что способно вызвать повышение процентных ставок на 25-50 бп.

Рубль немного скорректировал прежний рост

Торги на валютном рынке в четверг завершились ослаблением рубля по отношению к бивалютной корзине на 4 коп. до отметки 35.19 руб. Рубль не нашел поводов для сохранения растущей динамики, тогда как стоимость барреля Brent на момент российских торгов снижалась на 1 долл. до отметки 110 долл. Крупные налоговые платежи следующей недели способны ненадолго оказать локальную поддержку рублю. В то же время, поведения рубля в большей степени по-прежнему зависит от поведения цен на нефть и общего отношения к риску на внешних рынках.

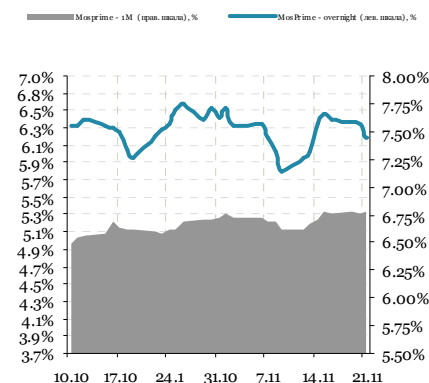
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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			327
Вторник	Уплата налогов	НДС, 1/3 за III квартал (~170 млрд руб.)	351
	Аукцион Казначейства	28 дней, 40 млрд руб., от 6.3% годовых	
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26208 (7 лет), 35 млрд руб.	149
	Возврат Казначейству	40 млрд руб.	
Четверг	Аукцион Казначейства	28 дней, 40 млрд руб., от 6.3% годовых	152
Пятница			

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

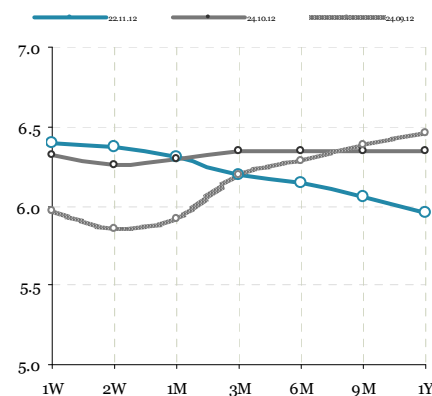
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды неактивны

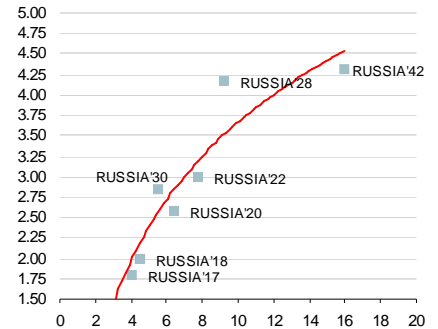
Российский сегмент в четверг был лишен активности: выходной день в США сократил базу активных инвесторов и лишил рынок ценовых ориентиров. В этих условиях котировки вдоль суверенной кривой в течение дня простояли на месте, за исключением дальних бумаг, где биды индикативно повысились в пределах 25-40 бп. В корпоративном сегменте цены двигались вверх весьма умеренными темпами. Лучше рынка выглядели выпуски VTB'20, суборд VTB'22, дальние EVRAZ'18, а также VIP'22, подорожавшие в пределах 20 бп.

Спрос на ОФЗ не иссякает

Рынок рублевого долга в четверг остался на траектории роста и в целом копировал картину среды с поправкой на более скромные результаты. Доходности вдоль кривой ОФЗ опустились еще в пределах 5 бп, но активность и объем торгов при этом возросли и достигли весьма внушительных уровней, а рост цен по отдельным дальним бумагам достигал 50 бп. В корпоративном сегменте биды в ликвидных выпусках подвинулись вверх в среднем на 10 бп, лучше рынка торговались выпуски АЛРОСА БО2 (УТМ 8.98%/D 2.6г. +228бп к ОФЗ) и ФСК 21 (УТР 8.79%/D 3.7г. +194бп к ОФЗ), подорожавшие на 15-20 бп.

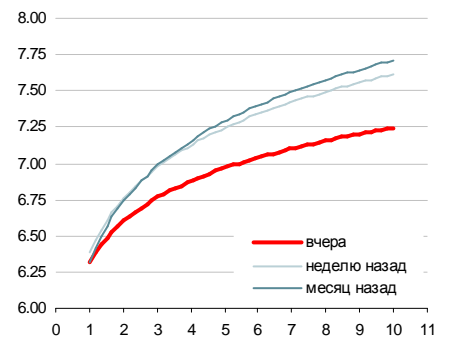
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



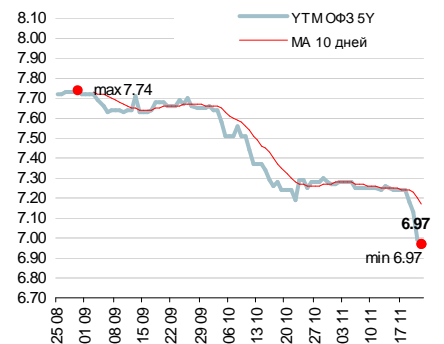
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



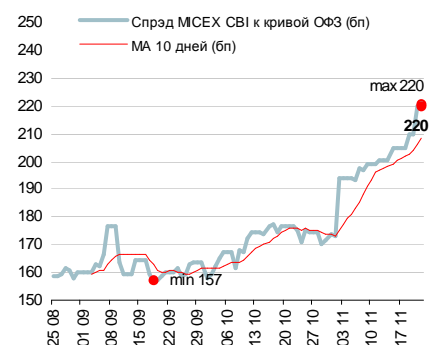
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



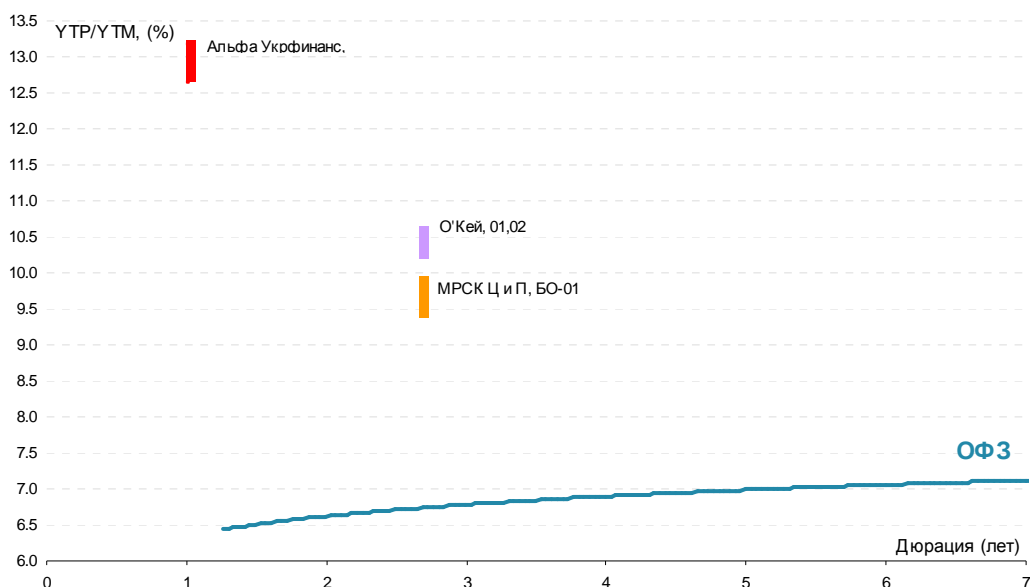
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Закрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
Альфа Укрфинанс, 01	NR	нет	3 000	12.63-13.16	XX.11.2012	XX.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.
Life Consumer Finance B.V., 01	BBB / - / -	да	3 200	н/д	13.12.2012	н/д	н/д	н/д

Источники: 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
Нижне-Ленское-Инвест, 04	NR	нет	1 200	н/д / 100%	Конкурс	14.49	16.11.2012	нет / 1.40 г.
Ютэйр-Финанс, БО-09	NR	нет	1 500	н/д / 100%	11.74-12.28	12.28	16.11.2012	нет / 1 г.
Ютэйр-Финанс, БО-10	NR	нет	1 500	н/д / 100%	11.74-12.28	12.28	16.11.2012	нет / 1 г.
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	- / Ваa3 / 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- / Ваa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
Роснефть, 05	BBB- / Ваa1 / 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 Интеза, БО-01	- / Ва1 / -	да	3 000	1.8 / 100%	9.73-10.25	9.99	25.10.2012	нет / 1.43 г.
РСХБ, 18	- / Ваa1 / 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.



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	100.20	100.20	100.20	-0.01	26	148 521	5.96	0.17			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.14	100.16	100.15	-0.01	18	118 041	5.99	0.21			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	102.00	102.50					5.88	0.33			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.10		100.10	0.10	2	99 997	6.07	0.64			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.41	100.41	0.03	7	32 650	6.21	0.87	18		47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.86	100.95	100.86	0.05	18	202 074	6.49	1.25	5	52	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.00	109.20	109.12	0.16	10	237 844	6.48	1.59		56	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.05	109.15	109.10	0.05	8	134 153	6.62	1.85	1	75	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.93	103.00	103.00		5	20 502	6.59	1.83		71	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	100.96	101.10	101.00	0.10	29	1 739 978	6.67	2.29		83	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.70	100.80	100.70	-0.10	5	101 401	6.69	2.41		85	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	101.80	102.00	101.90		10	150 178	6.78	2.82		95	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.88	99.08	98.88	-0.12	5	5 020	6.88	2.90	8	106	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	100.50	100.85	100.80	0.30	4	640	6.76	3.27		93	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18							8.18	3.53	130	235	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							8.39	3.47	151	256	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	102.45	102.65	102.60	0.01	5	11 712	6.82	3.83		98	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	102.45	102.65	102.70	-0.10	2	11	6.81	3.85		97	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	103.55	103.65	101.51	-2.04	7	25	7.28	4.44	30	141	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	92.50	93.50	92.45	-0.55	2	20	7.25	4.48	27	138	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	100.50	101.24					7.00	4.61	0	112	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	103.40	103.55	103.45	0.20	7	71 022	6.93	5.06		101	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							7.96	5.50	89	199	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	97.30	97.80	97.70	0.45	11	550 016	7.22	6.14	10	118	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	104.19	104.40	104.29	0.14	5	32	7.04	6.37		98	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	104.19	104.35	104.30	0.40	26	560 244	7.10	6.92		97	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	89.00	90.95	88.75	-1.00	2	20	7.61	7.37	41	142	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	108.15	108.36	108.05	0.50	60	2 259 849	7.36	8.73	9	100	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	91.50	93.00	91.50	0.50	2	17 940	7.85	11.03	48	119	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29		100.00					6.53	11.21			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	99.70	99.85	99.70	0.50	1	1	7.57	0.67	140	150	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	---	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО1		04/12/12	100.07	100.18					5.40	0.03			5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.10	100.12					7.27	0.28		108	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.59	100.70	100.70		1	1 915	7.60	0.55	151	149	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.57	100.63	100.59	0.01	1	1	7.80	0.55	171	169	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.85	100.35	100.15	0.27	3	206	8.31	1.68	174	241	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.20	101.50	101.30	-0.05	2	12 951	8.39	1.85	178	252	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.10	100.20	100.15	0.13	1	10 000	8.59	2.12	193	274	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.93	100.00	100.00		1	5 000	7.76	0.36		160	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.03	100.05	100.03	0.08	1	30 000	8.28	0.71	208	222	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.14	99.23	99.19	0.19	12	134 990	8.50	1.21	207	252	5 000
ММК ВО6		10/07/14	97.90	98.20					8.92	1.53	240	299	5 000
ММК ВО7		22/07/14	97.92	98.22					8.70	1.56	217	278	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.45	100.58	100.45	-0.05	2	1 055	7.81	0.23		161	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.46	100.58					7.81	0.23		161	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.20	100.28	100.21	0.06	1	7 000	8.11	0.57	200	201	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.25	100.29	100.28	0.13	3	16 250	7.99	0.58	188	189	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.85	100.97					8.88	2.29	218	304	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.85	101.00	100.85	-0.05	5	3 339	8.86	2.30	216	302	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.35	100.40	100.37	0.12	7	25 510	8.99	2.61	224	316	5 000
Алроса ВО2		30/10/15	100.35	100.50	100.40	0.20	8	127 000	8.98	2.61	223	315	5 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.34	100.35	100.35		2	1 287	8.25	0.33		208	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	100.26	100.37					8.25	0.33		208	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.70	107.80	107.80	0.05	2	21	9.13	1.73	255	324	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.70	107.89	107.90	0.30	2	2 100	9.07	1.73	249	318	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.25	101.31	101.25		1	15	9.67	2.60	292	384	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.25	101.32	101.25	0.15	2	34	9.67	2.60	292	384	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	95.88	98.00	96.70	0.82	1	13	9.74	3.01	293	392	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	95.65	96.75					9.82	3.00	301	400	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.70	100.10	100.06	0.31	6	222	9.16	2.11	250	331	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.70	100.10	100.00	0.10	7	58 112	9.19	2.11	253	334	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	100.02	100.10	100.02	0.27	2	4 815	9.18	2.12	252	333	10 000

Мечел

Мечел ВО2		12/03/13	99.26	99.50	99.35	0.11	1	4 529	12.25	0.30		607	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	
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	96.00	102.00					-12.35	0.39			5 000
Мечел ВО3		24/04/13	98.74	99.20					12.06	0.42	591		5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	96.90	97.00	96.90	-0.14	4	1 141	13.82	0.53	774	771	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	100.34					11.72	0.65	556	564	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	93.21	95.00					16.42	1.15	1002	1 043	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	91.61	92.14	91.80	0.20	6	5 003	16.37	1.18	996	1 039	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.30	92.53					16.05	1.18	964	1 007	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.81	2.22	512	597	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.81	2.22	512	597	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.81	2.22	512	597	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.30						11.81	2.22	512	597	3 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.55	2.12	488	570	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	88.00	89.00					14.75	2.44	802	891	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	88.52	90.01					15.53	2.42	881	969	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	80.12	84.00					16.44	2.95	963	1 062	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.38	87.47					13.99	2.96	718	817	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21	83.51	85.00	83.55	-0.45	2	438	15.02	2.97	821	920	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	89.82	99.78	99.90	-0.10	2	2 000	9.15	0.89	285	312	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.40	100.60	100.56	0.22	6	99	8.54	0.59	242	244	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.02	98.00					13.83	0.99	749	782	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	90.28	91.69					15.77	1.40	928	982	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12	100.01	100.19	100.01	-0.05	3	128	12.19	0.03			5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.11	97.90	96.61	-1.14	6	30 186	11.51	1.39	503	556	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.05	93.15	93.15	0.07	13	3 756	14.85	1.21	842	887	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	88.20	88.44					15.02	2.18	834	918	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД ВО01		05/12/12	100.01	100.08					6.23	0.04			15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.65	99.80	99.75	0.10	1	5 000	7.30	0.96	97	128	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.92	109.25					7.64	1.19	122	166	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.25	102.56					7.88	1.98	124	203	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.40	99.65					7.96	2.72	119	213	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.70	99.95	99.60		4	9 287	8.19	3.05	137	237	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.10	100.40					8.23	4.52	124	235	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.50	99.90					7.40	0.83	114	136	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.50	99.90					7.58	0.83	132	154	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23	100.85	101.25					7.98	1.43	148	204	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.30	101.69	101.14	-0.16	3	27 200	8.25	1.80	166	237	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	100.05	100.15	100.11	0.01	6	120 002	8.21	2.23	152	237	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	98.65	99.34					8.17	2.57	142	234	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.00	98.70					8.16	2.67	140	233	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	96.01	100.00					8.26	3.04	144	244	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.35	100.39	100.35	0.10	2	330 000	8.67	3.32	181	284	15 000
ФСК ЕЭС 21	19/04/17	06/10/27	100.00	100.50	100.50	0.15	5	95 030	8.79	3.73	188	296	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	97.30	97.70	97.45		1	6	8.82	4.13	187	297	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	97.00	97.70	97.45		5	105 016	8.82	4.13	187	297	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	90.00						9.03	4.51	204	315	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	98.00	105.00	98.00	0.60	1	5 000	9.03	6.04	192	301	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.80	100.20	100.20	0.05	1	1	9.10	2.23	241	326	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.25	102.25					9.66	3.22	282	384	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	99.00	100.00	99.96	0.94	7	3 743	9.24	0.95	292	322	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15		98.90					9.39	2.63	263	356	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.10					9.38	2.92	258	356	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30						9.20	2.92	240	338	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.55	242	348	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.65	3.55	276	382	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32		100.20					9.35	3.55	246	352	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16	100.80		100.15	-0.05	1	50	8.28	1.28	183	231	7 000
Почта России 2	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	212	306	00000 000
Почта России 3	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	212	306	00000 000
Почта России 4	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	212	306	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	
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	99.75	100.05	99.75	-0.15	2	130	7.57	1.17	116	159	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.25	109.50					7.59	1.41	110	165	5 000
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22							8.78	4.16	183	293	00000 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22							8.78	4.16	183	293	00000 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12	100.02	100.17	100.17	0.07	2	249	6.16	0.06			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							5.63	0.06			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.11	101.30	100.11	-0.39	3	31	7.42	0.98	108	141	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.85	99.15					8.81	0.15		256	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.90	100.50					7.30	0.38		114	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13							7.05	0.38		89	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.55	100.80	100.75	-0.96	2	130 000	8.02	2.01	138	217	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.60	100.90	100.60		4	3 915	8.45	2.80	167	262	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.60	100.89	100.55	0.14	2	50 015	8.47	2.81	168	264	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.45	102.50					8.75	4.18	179	290	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	99.00	99.50	99.00	-1.50	11	3 103	8.61	4.42	163	274	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	86.17	100.05	100.06	-0.02	3	3	7.51	0.57	141	141	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.35	100.40	100.37	0.04	3	40 000	8.37	2.61	162	254	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	100.35	100.40	100.26	-0.07	4	133 000	8.41	2.61	166	258	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.35	100.40	100.35	0.02	3	45 700	8.38	2.61	163	255	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40	100.65	99.64		4	82	7.84	0.81	159	180	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.35	100.38	100.35	-0.02	6	10 071	7.43	0.07			15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.35	100.40	100.35	-0.08	6	17 649	7.43	0.07			15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.35	100.38	100.35	0.05	6	130 829	7.43	0.07			20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.30	101.39	101.14	-0.16	3	2 195	8.34	0.97	201	233	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.20		101.20	0.03	3	550 000	8.56	2.02	191	271	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	100.00	100.20					10.11	0.66	394	403	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	98.50	99.09	99.05	0.10	8	234	10.34	1.14	394	435	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	95.01	96.59	95.60	0.45	3	50 100	10.63	2.98	382	481	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	95.01	99.40					10.11	2.99	330	429	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатранф2		26/07/13	99.06	99.18	99.00	-0.10	4	3 146	14.20	0.64	804	812	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.60	3.05	278	378	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.45	100.53	100.45	0.29	2	3 970	8.04	0.61	190	195	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.07	100.08	100.04	0.04	5	51 270	8.17	0.08			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.05	100.12					7.80	0.18		157	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.91	100.03					7.53	0.30		135	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.91	100.07	100.00	0.14	5	12 900	7.81	0.30		163	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	100.07					7.81	0.30		163	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.02	100.08	100.06	0.01	1	11 110	8.10	0.75	188	205	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.45	99.75	99.41		1	38	8.33	0.87	204	230	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.50	100.15					8.16	1.25	172	219	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.50	100.20					8.24	1.25	180	227	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90						8.68	2.54	194	285	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.54	194	285	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13							8.36	0.50		223	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.20					8.82	1.87	221	295	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.30					8.27	0.73	206	221	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.60	99.85	99.85	0.01	11	855	7.82	0.13		156	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.30	99.70	99.75		11	640	7.80	0.27		161	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					7.97	0.42		182	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.41	0.81	216	237	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60					7.72	0.65	156	164	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.75					8.83	1.02	248	282	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.97	1.12	258	298	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.50	99.80	99.80	-0.05	2	2	7.25	0.90	95	122	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32							8.49	2.10	183	264	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.55	100.65	100.60	0.20	3	14 000	8.48	2.59	173	265	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.55	100.65	100.55	0.15	2	6 000	8.50	2.61	175	267	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.01	103.00	98.25		3	25 297	8.69	2.96	188	287	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.33	181	284	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	96.70	98.00					8.30	4.12	135	245	10 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.05	99.30	99.26	0.10	2	38	8.23	1.33	176	227	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21							8.45	1.81	185	257	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.75	101.10	100.30	-0.70	1	25 000	8.81	1.81	221	293	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.65	100.75	100.65	0.05	16	175 079	8.83	1.93	221	297	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		99.75					9.14	2.97	233	332	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	99.00	99.20	99.05	0.03	1	7	9.13	2.97	232	331	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.00	100.50					8.58	1.28	213	262	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.41	100.90					8.93	1.62	238	302	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19		100.10	100.08	-0.12	3	42 784	8.52	1.44	202	258	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	100.05	100.09	100.08	-0.12	10	100 100	8.52	1.44	202	258	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.20	100.30					7.81	0.21		159	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20		100.60	100.24		2	1 001	7.88	0.21		167	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.32	99.49					8.13	0.53	205	202	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.15	100.20					7.95	0.68	177	188	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.15	100.25					8.11	0.69	192	204	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.24	100.25					8.16	0.75	194	211	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.15	100.19	100.18	0.03	4	2 850	8.19	0.75	197	214	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						7.31	0.84	104	127	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.20	100.35	100.30	-0.20	1	8 200	8.01	0.92	170	199	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	100.90					8.34	0.93	203	232	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.30	101.49					8.26	1.16	185	228	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18		100.50					8.19	1.62	164	228	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	100.00	100.09	100.05	0.10	16	138 499	8.49	1.80	189	261	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	100.00	100.09	100.05	0.10	4	29 549	8.49	1.79	190	261	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22							8.48	2.19	180	264	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21							8.06	2.35	135	222	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21		98.20					8.06	2.36	135	222	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21							8.86	2.36	215	302	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк 5		22/11/12							81.66	0.00			20 000
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.00	100.13					7.49	0.09		121	10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.20	99.45					7.99	0.65	183	191	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.00	100.00					8.00	0.99	166	199	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.30	100.73					8.16	1.14	176	217	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.84	100.85	100.80		5	15 072	8.48	1.52	196	255	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	191	285	00000 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	191	285	00000 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	191	285	00000 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	191	285	00000 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14		99.75					7.85	1.09	147	185	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43		100.20					8.42	1.68	185	252	7 000
АИЖК А9		15/02/17		99.00					8.27	1.81	167	239	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	99.40					8.34	1.83	174	246	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24		99.40					8.31	2.27	161	247	6 000
АИЖК А8		15/06/18	97.50	98.97					8.67	2.70	190	284	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.00	99.40					8.61	2.98	180	279	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	98.50		98.50		1	13	8.79	2.98	198	297	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.75	3.16	191	293	15 000
АИЖК А11		15/09/20		101.50					8.96	3.74	205	313	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	98.00					9.36	4.86	234	346	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	102.00					9.26	5.47	219	330	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	163	256	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	0.98	264	297	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	98.10	100.15	100.09	-0.09	3	16 200	9.10	0.98	276	309	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.51	100.00					9.58	1.56	305	366	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14		100.00					9.51	1.56	298	359	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.94	100.15	99.98	0.03	2	1 592	8.47	0.24		227	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.20					8.30	0.70	211	224	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.60	99.80	99.80	0.10	3	9 000	8.17	0.97	184	215	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	101.00					8.42	1.34	195	246	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.19	100.35	100.25	0.08	6	100 000	8.63	2.66	187	280	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.00	100.25					8.14	0.56	205	203	10 000
МТС 1		17/10/13	99.10	99.75					7.41	0.88	112	138	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.10	99.30	99.20	0.10	3	16	8.14	1.40	165	219	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 2		20/10/15	96.83	98.45	98.88		1	1	8.35	2.64	159	252	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.00	99.20	98.80		2	24	8.80	2.69	203	297	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.65	100.00					9.17	3.20	233	335	15 000
МТС 7		07/11/17	98.56	99.49	99.10	0.20	3	56	9.13	4.12	218	328	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.75	100.99	100.70		1	1 500	8.26	0.63	211	217	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.91	98.50	98.47	0.22	4	539	8.60	1.52	208	267	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.72	100.00	99.89	-0.11	2	6	9.09	2.13	242	324	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.81		99.89	0.12	3	17 702	9.09	2.11	243	324	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	98.50	100.00	99.90	0.20	2	1 852	9.09	2.11	243	324	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	96.01						9.30	2.61	255	347	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.49	98.60					9.26	2.61	251	343	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.15	100.30	100.20	0.07	6	50 525	8.08	1.77	149	219	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	95.26	99.50					8.46	0.54	238	235	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	96.01	99.40					8.25	0.45		211	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.75	100.85	100.80	0.40	1	25 000	8.35	1.16	194	236	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	100.85					8.64	1.16	223	265	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.10	100.40	100.36	0.26	2	38	9.00	2.19	232	316	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	96.85	97.20	97.20	0.45	11	635	9.55	3.04	273	373	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.85	107.00					9.71	3.04	289	389	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.85	97.99					9.65	3.04	283	383	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13		99.90					7.92	0.27		173	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.75	100.12					8.39	0.78	215	234	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.70	100.03					8.39	0.78	215	234	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.75	100.12					8.39	0.78	215	234	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	100.02	100.10	100.02	-0.03	5	5 081	8.37	0.78	213	232	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.05	99.95	99.34	-0.06	2	1 001	8.73	1.21	230	275	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.77	99.45					9.01	1.36	253	306	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	99.00	100.40	100.25		3	12 400	8.98	2.53	224	315	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.50	99.00					9.31	1.42	281	337	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.50	99.00					9.24	1.49	272	331	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.03	100.20					9.70	2.54	296	387	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	97.01	99.00					8.83	0.65	267	275	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.73	100.10	100.06	0.10	4	13 644	9.22	0.82	296	318	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.61	99.65	99.50	0.64	2	500	11.37	0.49		524	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.16		99.15	-1.14	2	3 000	9.40	0.94	308	338	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	96.26	100.15					9.70	0.84	343	366	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.87	452	526	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.90	99.98	99.90	-0.08	4	1 407	13.03	0.56	693	692	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.72	94.50					11.63	2.21	495	579	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.26	95.75					11.92	1.56	539	600	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	96.70	99.95					9.42	1.66	286	352	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.50	96.00					10.46	1.12	407	447	3 000
КАМАЗ													
КамАЗ БО-1	17/12/12	16/12/13	100.02	100.17					8.42	0.07			2 000
КамАЗ БО-2		04/02/14	98.80	99.05					9.75	1.14	335	376	3 000
КамАЗ БО-3		01/10/15	86.00	101.50					10.44	2.51	370	461	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.23	100.05					9.81	0.06			3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	98.60	100.08	99.52	-0.12	2	90	9.81	0.74	359	376	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00						12.13	0.89	584	610	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	100.70	100.44	-0.16	1	1	8.82	0.78	258	277	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							8.94	0.08			3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.92	100.10	100.05	0.10	3	38 000	9.04	0.42		289	3 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.50	99.90	99.86	0.85	2	78	8.76	0.42		261	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17		99.00					8.14	0.81	189	210	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.90	100.15	100.00		1	200	9.44	0.44		330	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.68	101.75	101.65	-0.10	2	30	10.01	0.62	387	392	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.51	100.70	100.66	-0.04	4	48	10.66	1.99	402	481	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.95	100.11					7.86	0.38		170	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	100.00	100.05					7.86	0.38		170	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.40	100.55					7.80	0.26		161	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.31	100.81					8.54	1.61	199	263	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	97.01	99.99					10.01	1.36	353	406	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.34	100.40	100.40	0.07	5	14 616	10.02	2.05	337	417	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.25	101.00	100.48	-0.67	5	1 522	9.98	2.05	333	413	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.85	99.99	99.85	-0.06	14	3 537	13.04	0.75	682	699	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.98	100.00	99.98	-0.02	18	633	12.89	0.89	660	686	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.03	101.14					9.05	0.33		288	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.02	101.39	100.70	0.19	1	100	10.76	0.33		459	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15							11.91	0.43		576	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	98.02	100.00					10.88	0.43		473	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.44	0.51	238	232	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							10.38	0.97	405	436	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							7.70	1.02	135	169	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.10	98.14	98.00	2.97	2	105	11.05	1.26	461	508	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	90.11	98.90					10.39	1.26	395	442	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.68	3.12	185	286	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	96.01	99.20	99.00	-0.35	1	15	8.51	3.04	169	269	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	94.65	99.00	99.00		1	150	8.51	3.04	169	269	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.06	98.20					9.51	0.25		331	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.01	100.12					7.98	0.04			5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.00	100.30					8.69	2.53	195	286	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	99.91	100.05	99.99	0.05	7	180 000	8.99	2.63	223	316	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	99.70	100.20					8.38	2.22	170	254	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.40	100.44	100.40		5	2 398	7.90	0.55	181	179	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	98.00		98.45	0.15	2	200 000	8.32	1.49	181	239	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	86.02	97.00					12.70	1.47	619	676	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	89.00	90.00	89.00	1.00	5	49	13.18	2.98	637	736	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	99.60	100.40	100.40	0.45	2	3	8.98	2.59	223	315	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.10	99.47					10.85	1.64	429	494	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.63	0.09		135	2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.77	99.00	99.00		5	9 720	8.58	0.59	246	248	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.91	99.50					8.61	1.24	217	264	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.11	98.37	98.33	0.01	4	2 802	10.81	0.70	462	475	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	80.20	80.63	80.63	0.08	56	619	42.39	0.79	3614	3 635	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.35	98.56	99.35	0.85	2	3 000	9.74	0.86	346	371	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13							9.55	0.92	324	353	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	98.60		98.60	-1.15	3	3 002	8.88	1.32	242	292	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	99.90	100.00					8.46	0.76	223	241	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	95.00						6.91	0.48		78	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.61	98.15	97.95	-0.05	11	26 008	11.43	0.75	521	538	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													

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	
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	98.70	100.49	100.20	-0.70	1	14 500	9.00	2.30	230	316	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.03	2.70	226	320	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.00	100.30					8.35	0.83	209	231	4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.15	101.60					7.98	0.97	165	197	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21							9.05	1.40	256	310	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21							9.05	1.40	256	310	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.30	100.40	100.35	0.05	10	7 000	9.83	2.56	308	400	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.02	98.68					10.05	1.32	359	409	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.15	100.31					8.78	0.19		256	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					8.98	0.56	288	287	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.25	100.42	100.38	0.05	4	30	9.68	0.78	344	363	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	99.90	101.15					11.13	1.23	470	516	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.33	98.59	98.55	-0.01	7	374	10.97	1.25	453	500	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	95.80	96.10	95.80	0.10	1	1 500	11.60	1.55	507	568	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	100.05	100.40	99.60	-0.79	1	1	11.81	1.77	522	592	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.95	100.03	100.04	0.04	2	18 800	10.49	0.07			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.00	101.69					12.91	1.30	645	695	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12	100.06	100.49	100.48	0.48	1	3	4.19	0.04			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	102.50		102.50	1.40	1	1 089	9.65	0.49		352	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.50	99.00					9.62	4.04	268	378	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17		98.90					9.36	4.04	242	352	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17		99.00					9.45	4.04	251	361	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	99.90	100.00	100.06	0.02	2	4	8.94	3.27	209	311	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.60	100.71	100.60	0.18	5	1 900	7.67	0.29		149	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.50	100.20					8.84	1.60	229	293	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.25	98.40	98.36	0.01	8	15 116	8.75	1.84	215	287	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.31	98.84	98.80	0.58	10	224	12.80	0.63	665	671	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.05	100.14	100.05	-0.15	2	64	12.22	0.54	614	611	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.95	100.10	100.15	0.17	4	437	12.12	0.85	585	609	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.25	100.40	100.39	0.09	2	1 800	8.26	0.48		213	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.25	100.55					8.48	0.57	238	238	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	99.50	99.90					8.39	0.61	226	230	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.13	98.40	98.36	-0.04	2	6	8.91	0.94	259	289	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.25	100.39	100.06	-0.15	1	1	9.46	1.68	289	356	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	96.50	99.00	96.50	-0.20	5	125 002	9.61	1.85	300	374	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16	100.00	100.95					7.45	0.52	139	133	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.21	100.22		1	3 000	8.32	0.83	206	228	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.66	99.90	99.66	0.04	3	4 192	8.72	1.15	232	273	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.00		100.00		4	702	8.77	1.21	234	279	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО1		29/11/12							6.85	0.02			5 000
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.07	100.13	100.07	-0.04	2	16	8.41	0.07			5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.00	100.15	100.15	0.10	5	604	8.95	0.62	281	286	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.15	1.27	270	318	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.70	99.75	99.75		6	5 576	8.80	0.40		265	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	98.00	100.15					8.92	0.54	284	281	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	99.95	100.35					9.09	0.69	290	302	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.45	99.69	99.68	0.02	2	30 000	9.11	0.74	290	306	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	86.00	100.10					9.22	1.19	280	324	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.51	100.00					9.96	1.48	345	403	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14							8.91	0.49		278	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.05	100.12					8.73	0.21		252	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.12					8.76	0.23		255	3 000
Банк ЗЕНИТ 1	07/04/12	07/04/13	99.45	99.75					9.19	0.37		303	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.25	100.40					8.68	0.51	262	256	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.32	100.41					8.63	0.59	251	253	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.18	100.25	100.24	0.03	5	642	9.03	0.74	281	298	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 ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.81	136	158	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.07	100.24	100.07	-0.01	2	1 001	9.22	0.96	289	320	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.10	100.27	100.25		1	20 870	9.19	1.32	273	323	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	99.95	100.11	100.10	0.05	1	1	8.41	0.25		221	5 000
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15	100.00	100.08	100.00	-0.10	2	1 001	8.84	0.25		264	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.60	99.74					8.88	0.55	279	277	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	98.00	99.00	98.95	-0.20	11	71 783	9.75	1.14	335	376	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.00	100.40	100.40	0.01	2	7 001	10.13	1.65	357	422	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	99.00	101.70					12.33	3.87	541	649	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							8.70	0.06			3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.40	100.24	100.00	-0.45	1	1	9.18	0.81	292	314	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15							9.51	0.85	323	348	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.22	100.25	100.22	0.02	2	3 500	7.99	0.15		174	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.85	99.94	99.91	-0.02	2	34	8.97	0.25		278	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.89	99.97	99.97		1	13 825	9.51	0.43		336	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.76	99.94	99.90	-0.05	6	16 586	10.09	0.82	383	405	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15							9.96	0.86	368	393	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.95	100.10					10.45	1.32	399	449	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.06	98.20	98.20	-0.05	2	6	10.72	1.45	422	478	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.30	100.35	100.35	-0.02	7	40	7.85	0.07			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.10	101.25					9.14	0.76	291	309	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	86.00	100.30					9.23	0.73	302	317	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	86.00	100.50	100.37		2	55	9.58	1.19	316	360	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.60	99.90	99.85	0.10	5	80 001	9.12	0.79	288	308	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.96	100.05					9.86	1.20	344	388	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.21	100.30	100.20		5	11 727	9.44	0.55	335	333	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.00	100.20					9.75	0.61	361	366	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.90	99.05	98.90	-0.15	3	9 000	10.22	0.82	396	418	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.72	100.90	100.85	-0.05	2	5 700	11.16	1.12	477	517	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.21	101.00					11.03	1.14	463	504	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.95	100.35					11.60	1.19	518	562	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.70					11.08	1.91	446	522	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.70					11.18	2.01	454	533	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.10	98.18	98.16	0.16	48	16 528	13.07	0.68	689	700	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.09	100.80					10.97	0.68	479	490	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.80	101.20	100.80	0.50	6	257	11.40	0.40		525	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	100.71	101.10	101.00	0.20	17	12 912	12.55	0.61	641	646	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	104.75	104.95	104.87	0.37	11	3 151	12.58	0.64	643	650	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	101.80	103.80					10.56	0.79	431	452	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13							13.47	0.90	717	744	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	101.07	101.45	101.06	-0.24	4	660	13.42	1.15	702	743	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	99.99	100.00	100.00		33	18 081	14.66	0.68	848	859	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.08	101.00	100.15	0.08	1	315	10.59	0.93	427	457	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22		100.05					8.86	0.82	260	282	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.40	100.36	0.16	2	54	9.37	1.65	281	346	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	99.90	100.06	100.03	0.23	1	5 000	7.60	0.92	129	158	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.70	101.10					8.07	1.15	167	208	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.01	1.17	160	203	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19							8.57	2.04	192	272	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00						8.94	1.41	245	300	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.18	100.30	100.30	0.10	1	15 500	8.22	0.75	200	217	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.11	100.20					8.23	0.76	200	218	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.50					8.60	0.76	237	255	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.77	0.99	243	276	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.32	100.37	100.37	0.12	1	900	9.08	1.79	249	320	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.30	100.40	100.34	0.09	1	1	9.10	1.81	250	322	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.02	3.39	215	319	5 000
Райффайзенбанк													

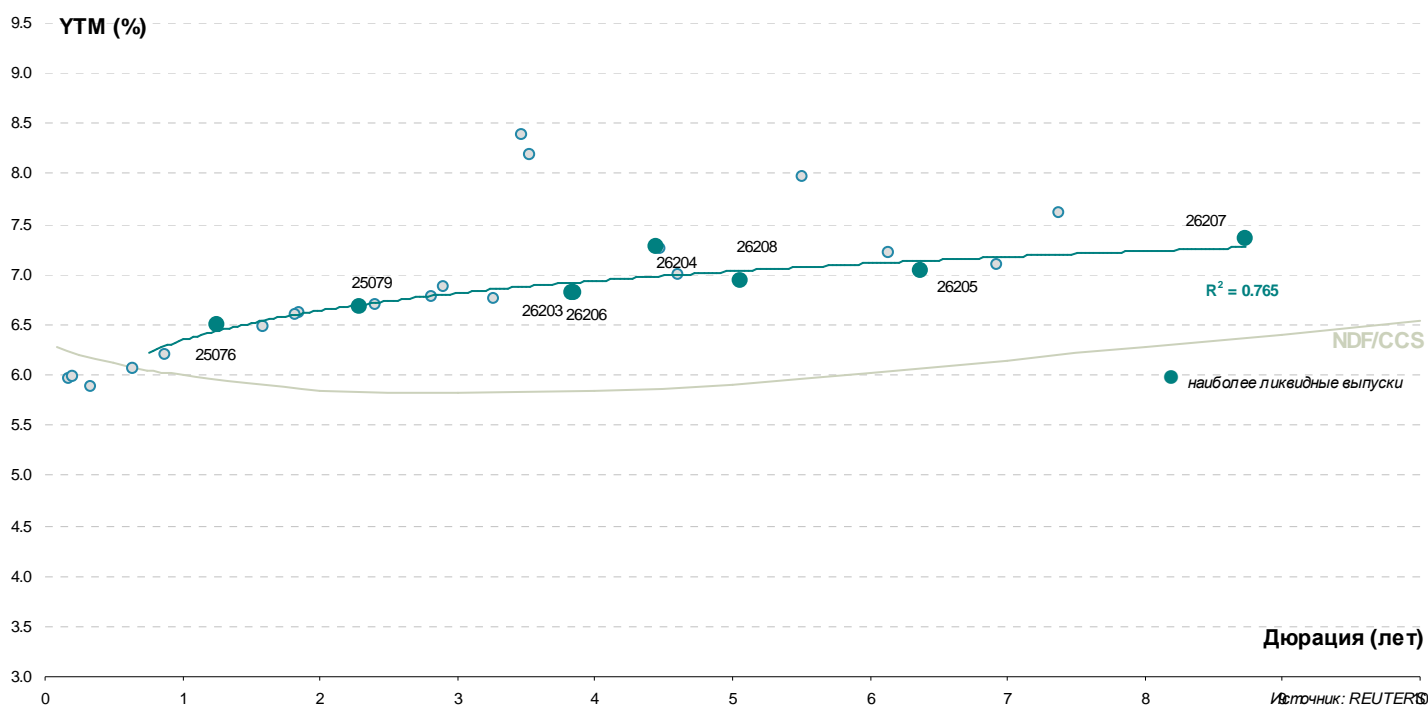
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	101.00					7.94	0.97	161	193	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.80					7.86	0.96	153	184	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		229	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.15	100.39	100.36	0.15	5	870	9.20	0.94	288	318	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	100.10	100.27					8.51	0.34		234	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.20	100.42	100.42	-0.05	2	46	9.12	0.93	281	310	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13		100.10					7.51	0.48		138	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.31	100.70	100.70	0.20	2	5 004	10.37	0.71	417	431	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	105.00	100.10	0.20	3	5 002	10.10	0.88	381	407	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30	101.00	100.75	0.22	3	7 551	10.84	1.27	440	487	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14	99.02	100.06					8.32	0.05			5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	100.00	100.05	100.05	0.05	1	3 000	8.62	0.39		247	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							9.35	0.89	306	332	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.07	101.10	100.10	0.05	7	11 354	10.06	2.17	339	422	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.00	100.06	0.11	2	2	7.78	1.29	133	182	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.75	98.95					9.12	0.60	300	302	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15							8.98	0.77	275	293	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	100.17					9.24	0.79	299	320	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.00	100.50					9.16	0.80	291	312	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15		101.00					9.37	0.95	305	335	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15		98.95					9.48	0.96	315	346	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.55	100.60	100.46	-0.09	8	25 002	9.96	1.81	336	408	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.40	100.45	100.45	-0.04	3	15 012	8.73	0.68	255	266	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.30	97.55					9.17	1.47	266	323	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	99.46						9.41	1.81	281	353	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.35	100.45	100.37	0.02	9	31 222	10.42	1.21	400	444	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.46	97.80	97.76	0.26	8	238	10.32	1.28	387	435	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.55	96.87	96.84	0.44	10	69 604	10.27	1.57	373	435	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13	100.00	100.30	100.10		1	2	0.54	0.51			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13							9.29	0.49		316	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	98.95						9.70	0.61	357	361	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	99.90	100.30					9.86	0.86	358	383	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.00	100.10	100.10	0.05	2	2	9.89	0.85	361	386	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	86.00	100.55					9.83	1.18	342	385	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.10					10.13	1.15	373	414	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.00	97.44					10.68	1.37	420	473	5 000
Банк Интеза													
Интеза О3	11/10/13	13/04/15	99.84	99.85	99.82	-0.03	1	10 000	9.40	0.86	312	337	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	100.00	100.05	100.05	-0.01	9	41 025	9.94	1.35	347	399	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	100.00	100.15					8.42	0.07			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	100.00	100.15					8.12	0.07			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.20	100.30	100.30	0.05	1	600	9.08	0.40		293	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.61	100.79	100.79	0.14	2	1 401	9.17	0.56	307	306	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк О3	20/12/12	09/12/21							3.85	0.08			5 000
СвязьБанк О4	24/04/13	13/04/22		100.11	100.05		1	10 000	8.78	0.42		263	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	99.90	100.00					9.20	0.98	287	319	5 000
СвязьБанк О5	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	299	388	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	99.00	100.50					10.75	0.88	446	472	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	100.10	100.39					11.17	0.28		498	2 000
Судостр О4	10/04/12	08/10/13	100.25	100.99					12.64	0.85	636	661	2 000
Меткомбанк													

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	
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14		99.90					9.30	0.20		308	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	99.97	101.50	100.20		1	2 000	10.41	0.39		425	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	100.60	102.00	100.60	-0.10	1	1	11.28	0.85	501	525	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.12	100.15	100.14	-0.01	1	10 000	8.20	0.07			2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	96.34	96.99					10.25	1.57	371	433	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14		100.25					9.96	0.38		380	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	86.02	100.25	100.15	0.02	1	5 000	9.56	0.42		341	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.26	100.10	100.10	0.07	2	5 001	11.13	0.81	487	509	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17							10.25	0.94	393	423	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.65	99.90	99.75	-0.20	11	510	12.40	0.75	618	635	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.15	100.18	100.16	-0.06	1	10 000	9.09	0.21		288	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	100.00	100.11	100.02	-0.13	4	5 002	10.28	0.65	412	420	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.40	100.44	100.42	0.01	6	38 000	10.34	0.70	415	427	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.72	0.48		359	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14							10.16	0.60	403	407	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.25	101.50					10.17	0.86	389	414	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.50	100.00	100.00		4	4 000	12.33	0.90	603	630	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.60	99.85	99.75	0.01	4	36 682	9.49	0.87	320	346	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15		100.45					9.68	0.88	339	365	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	99.91	100.15	100.10	-0.05	2	8 000	11.53	0.44		539	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.20	100.40	100.35	0.15	4	2 029	12.37	0.83	611	633	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	99.00	100.25					11.12	0.08			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.46	100.84	100.65	-0.69	5	62 100	11.82	0.70	563	576	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03		28/10/15							11.00	0.98	467	499	
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	29/11/12	27/11/14							30.26	0.02			2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	99.81	105.00					9.85	0.06			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	99.39	100.00	100.05	0.03	4	672	11.24	0.24		504	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.05	100.25					9.42	0.26		323	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.75	99.95	99.95	0.05	4	845	11.42	0.38		526	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.00	100.03	100.00		9	12 324	13.42	0.87	714	739	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.11	99.20	99.00	-0.90	4	280	12.10	1.02	575	609	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.91	100.10	100.00		10	3 373	12.64	1.32	618	668	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	495	568	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		104.22	104.99					5.64	0.50			30 000
Москва 53	01/09/13		99.70	100.19					6.81	0.76	58	76	15 000
Москва 63	10/12/13		108.00	109.00					6.28	0.97		26	15 000
Москва 62	08/06/14		108.00	108.15	108.15	0.05	3	5	6.93	1.40	44	98	35 000
Москва 39	21/07/14		92.50						7.35	1.56	82	143	10 000
Москва 64	24/06/15		98.04	99.15	99.12	0.31	6	35 701	7.51	2.34	80	167	20 000
Москва 44	16/11/15		105.01						7.27	2.59	52	144	40 000
Москва 56	22/09/16		97.00	98.00	97.76	0.06	15	8 601	7.83	3.39	96	200	20 000
Москва 49	14/06/17		97.25	97.50	97.25	0.55	2	45	7.87	3.85	95	203	25 000
Москва 48	11/06/22		91.76	92.00	92.45	1.15	37	1 049	7.84	6.80	68	172	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.26	100.90					7.42	0.53	135	130	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.01	99.55					8.53	1.34	206	257	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	02/12/12		100.00	100.50	100.16	-0.03	3	848	6.72	0.03			3 000
Нижегородская Обл 4	17/11/12								-99.91	0.00			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.30	99.85					8.39	1.72	181	250	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.50	102.80					8.73	2.22	205	289	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		100.00	104.20					7.00	0.45		86	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.00	101.20					8.38	1.02	203	237	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		96.00	100.00					8.78	1.99	214	293	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.85	100.33	99.85	0.05	2	76	8.59	0.38		243	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.11	102.00					7.79	0.56	170	168	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	
Якутия 7		17/04/14	99.25	99.79					8.27	1.25	183	230	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАИ													
Краснодарский край 2		14/12/12	99.80	99.95	99.86	-0.03	1	1 280		0.06			2 000
Краснодар 02		05/11/15	86.00	100.75					9.25	2.24	256	341	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	99.51	100.00					8.41	1.28	196	244	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАИ													
Красноярский край 5		29/11/16	90.00	101.49					8.55	1.40	206	260	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13							8.89	0.47		276	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	99.71					9.73	1.34	326	377	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	86.02	95.49					8.53	2.21	185	269	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							9.44	2.25	275	360	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16							8.84	2.38	212	300	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12	99.77	100.15	100.15		5	3 163	7.18	0.08			3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.31	100.50	100.38	0.08	10	26 266	9.61	1.80	301	373	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16	103.00	103.49					9.46	2.21	278	362	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16							8.95	1.61	240	304	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.00	100.44					7.22	0.47		109	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.20	99.88					8.61	1.08	223	261	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.80	101.00	100.80	0.05	5	23 600	8.77	2.11	211	292	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14							9.00	1.02	265	299	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	100.23	100.25	100.25		4	1 115	7.05	0.08			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	102.80	103.78					7.47	1.00	113	146	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	101.20	101.50	101.50	0.10	1	200	8.51	1.73	193	262	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	100.00	103.09					9.05	0.72	285	299	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13	100.51	107.24					8.14	1.01	179	213	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.12	98.75	98.75	0.30	1	9	9.33	2.41	261	349	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



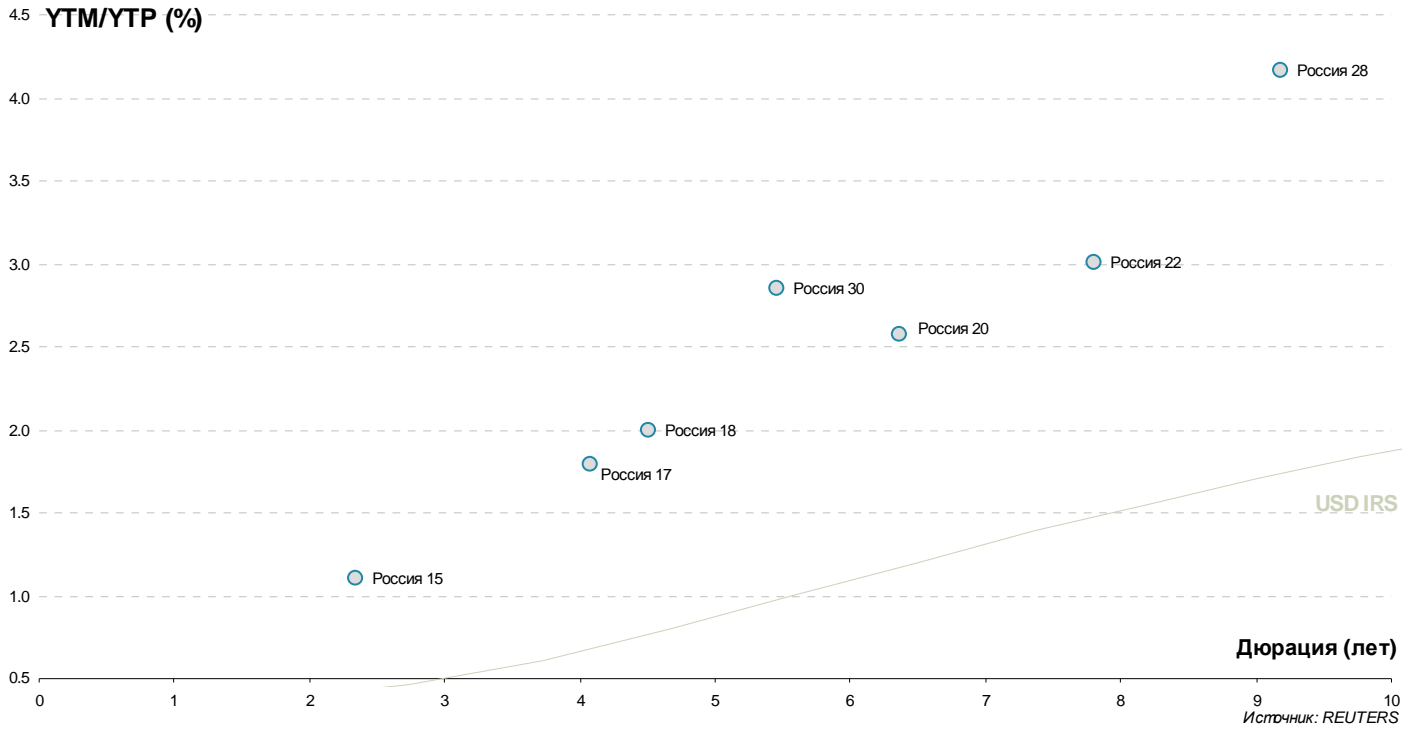
Результаты торгов евробондами

Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа		
РОССИЯ									
RUSSIA'15 3.625%	USD	29/04/15		105.860	106.181	1.16	1.03	2.34	75
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.911	106.226	1.83	1.76	4.09	-0.01
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.389	148.556	2.08	1.91	4.50	0.05
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.470	126.820	2.87	2.82	5.46	
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		116.080	116.514	2.60	2.54	6.37	-0.02
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		111.800	112.450	3.04	2.97	7.80	-0.08
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		197.194	198.361	4.19	4.13	9.19	0.06
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		121.187	121.969	4.34	4.30	15.92	-0.03
ГОСКОМПАНИИ									
Газпром									
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.205	101.225	1.49	1.44	0.40	-0.01
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.594	101.891	1.57	0.83	0.39	0.24
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.139	102.158	1.55	1.50	0.37	
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.997	104.497	1.52	0.81	0.66	0.06
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.375	111.125	2.53	1.99	1.24	
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		109.900	110.650	2.61	2.05	1.20	
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.214	109.301	2.47	2.42	1.57	-0.01
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.807	107.256	2.72	2.57	2.77	0.02
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.567	107.567	2.96	2.66	3.26	0.05
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.374	111.971	3.15	3.00	3.61	
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		121.521	122.339	3.69	3.54	4.52	-0.02
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		129.957	130.617	3.92	3.82	5.14	0.02
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		110.980	111.570	3.45	3.26	2.89	-0.02
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		117.188	117.606	4.25	4.20	7.21	-0.01
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		105.000	105.500	4.31	4.25	7.71	
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		139.805	140.583	5.45	5.40	11.72	0.03
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		125.315	126.089	5.42	5.37	12.92	0.02
Газпром нефть									
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		100.250	100.625	4.34	4.30	8.02	-0.40
Транснефть									
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		104.131	106.131	1.69	-1.07		
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.030	106.030	1.66	0.89	1.23	-0.14
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		129.044	129.347	3.10	3.05	4.67	-0.15
РЖД									
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.502	110.965	3.14	3.03	3.91	-0.01
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		111.501	111.912	4.20	4.15	7.45	0.39
Совкомфлот									
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		99.481	99.906	5.50	5.40	4.37	-0.02
ГОСБАНКИ									
ВТБ									
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		106.807	106.921	3.32	3.27	2.12	0.08
VTB'17 6%	USD	12/04/17		104.844	105.046	4.76	4.71	3.90	-0.01
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		105.748	106.748	5.05	4.84	4.50	0.22
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		108.319	108.813	5.12	5.02	4.57	-0.01
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		105.752	106.247	5.64	5.56	6.29	0.03
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		103.658	104.028	6.44	6.39	7.32	0.31
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.416	106.916	5.74	5.70	12.42	-0.01
VTB' 9.5%	USD			101.603	102.149	9.25	9.17	6.52	0.14
Банк Москвы									
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.611	102.658	1.63	1.53	0.46	
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.257	106.483	3.82	3.72	2.14	0.01
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.150	103.500	4.83	4.70	2.79	0.15
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.130	101.130	5.99	5.73	3.96	
ВЭБ									
VEB'17 5.375%	USD	13/02/17		108.245	108.450	3.26	3.21	3.79	0.33
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		108.432	108.918	3.59	3.49	4.46	-0.03
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		117.495	117.987	4.19	4.13	6.06	0.02
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		111.250	112.250	4.56	4.44	7.41	
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		117.430	117.921	4.96	4.92	9.18	-0.19
Газпромбанк									
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.498	103.528	1.90	1.85	0.57	
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		105.750	105.852	3.32	3.27	1.91	-0.16
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.736	107.875	3.59	3.54	2.61	0.16
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.269	111.440	3.79	3.74	3.08	0.22
GAZPROMB'17 5.625%	USD	18/05/17		103.877	104.082	4.65	4.60	4.02	0.01
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		106.250	106.625	6.06	5.99	5.27	0.04
GPB EURO' 7.875%	USD			100.307	100.950	7.80	7.66	4.48	0.17
РСХБ									
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.385	102.760	2.04	1.26	0.47	-0.10

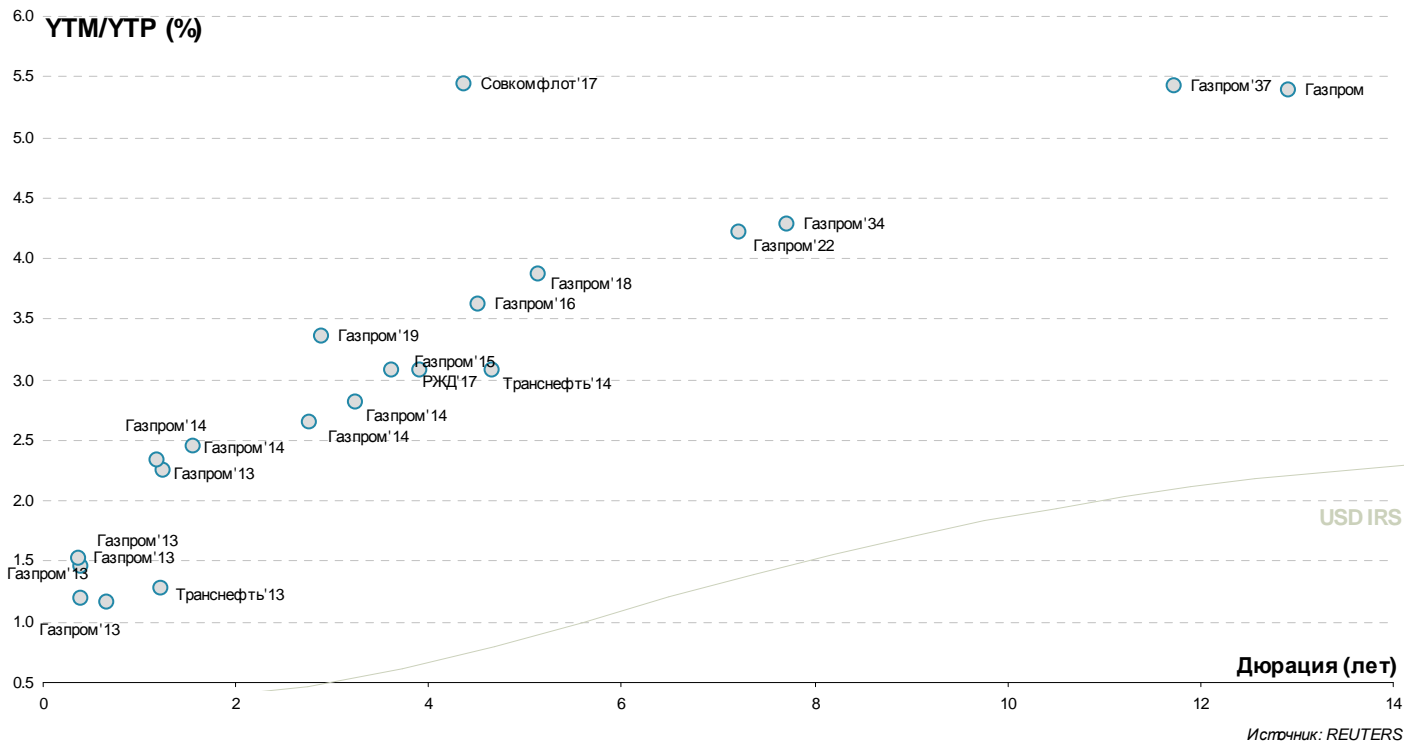
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.629	105.687	2.06	2.01	1.08	0.01	173
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		110.131	110.211	2.26	2.21	1.42	-0.16	192
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		109.935	110.420	3.86	3.74	3.98	-0.02	321
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		105.625	106.125	4.06	3.96	4.45		330
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.273	118.758	4.02	3.93	4.53	-0.01	319
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		104.495	104.660	4.60	4.55	3.14	-0.23	412
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		102.250	102.750	1.62	0.57	0.47	0.05	131
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		102.875	103.250	1.61	0.99	0.58	0.06	130
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		106.945	107.435	2.72	2.54	2.43	0.01	231
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.132	108.628	3.36	3.24	3.90	0.20	273
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		105.735	106.485	3.47	3.28	3.80	-0.14	285
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		105.758	106.054	4.17	4.12	5.58	0.06	312
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.006	108.374	4.58	4.53	6.80	0.28	321
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		110.384	110.777	4.72	4.67	7.16	-0.41	327
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		99.950	100.175	5.13	5.10	7.87	-0.15	358
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.378	102.878	2.96	1.76	0.41	0.02	269
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		108.845	109.745	4.99	4.68	2.69	-0.22	459
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		101.775	102.350	6.92	6.77	3.82	0.17	637
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		110.447	111.399	7.14	6.93	4.38	-0.01	643
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		98.491	98.932	7.09	6.99	4.60	0.20	636
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		102.000	102.500	5.88	5.73	3.24	-0.40	541
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		99.125	99.625	5.10	5.01	5.83	0.23	403
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		106.431	106.649	6.79	6.69	2.07	0.25	650
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.285	110.765	3.44	3.20	1.86	0.01	308
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		112.812	113.302	5.72	5.65	6.17	0.03	451
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.500	102.750	2.42	1.84	0.43		212
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.800	102.200	4.50	2.96	1.55		
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.300	106.300	4.35	4.35	2.88		390
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.480	111.480	4.94	4.65	3.12	-0.05	448
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		103.520	104.520	5.32	5.06	3.77		474
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		115.826	116.314	5.69	5.60	4.46	-0.01	493
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		109.300	110.300	6.28	6.13	6.18		505
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		107.750	108.150	6.38	6.33	6.83	0.25	501
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		107.753	107.852	2.26	2.21	1.85	-0.35	189
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		112.763	113.212	3.30	3.20	3.94	-0.01	263
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		119.496	119.831	4.00	3.95	5.69	0.51	291
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		111.900	112.614	4.34	4.24	6.50	0.04	307
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		119.042	119.906	4.21	4.11	7.24	-0.02	272
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		123.572	124.075	4.86	4.79	5.75	0.02	370
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.447	106.603	3.18	3.13	2.93	0.07	271
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		116.250	116.875	4.23	4.15	6.49	-0.69	293
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		105.083	105.817	2.09	1.04	0.65	0.02	178
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.089	109.234	2.57	2.47	1.33	0.09	223
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		104.269	105.269	4.96	4.67	3.28	-0.13	447
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		105.735	106.178	5.36	5.26	4.26	0.65	466
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		97.923	98.467	6.18	6.11	7.56	0.43	469
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		101.731	102.160	7.34	7.24	4.26	-0.02	667
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		103.007	103.389	6.95	6.85	3.81	-0.72	640
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		101.999	104.999	0.69	-8.90			
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.232	107.342	2.81	2.76	2.04		242
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		114.885	115.071	3.14	3.09	3.21	0.02	261
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		112.376	113.447	3.51	3.26	3.82	-0.01	288
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		119.214	120.009	3.83	3.68	4.46	-0.02	304
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		118.923	119.951	4.17	4.02	5.76	0.01	304
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		103.651	103.710	2.80	2.70	0.55		251
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		107.250	107.477	4.65	4.55	2.13	-0.65	430
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.490	99.855	6.44	6.34	3.72	0.01	589
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		109.401	109.843	5.62	5.52	4.10	0.13	496

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

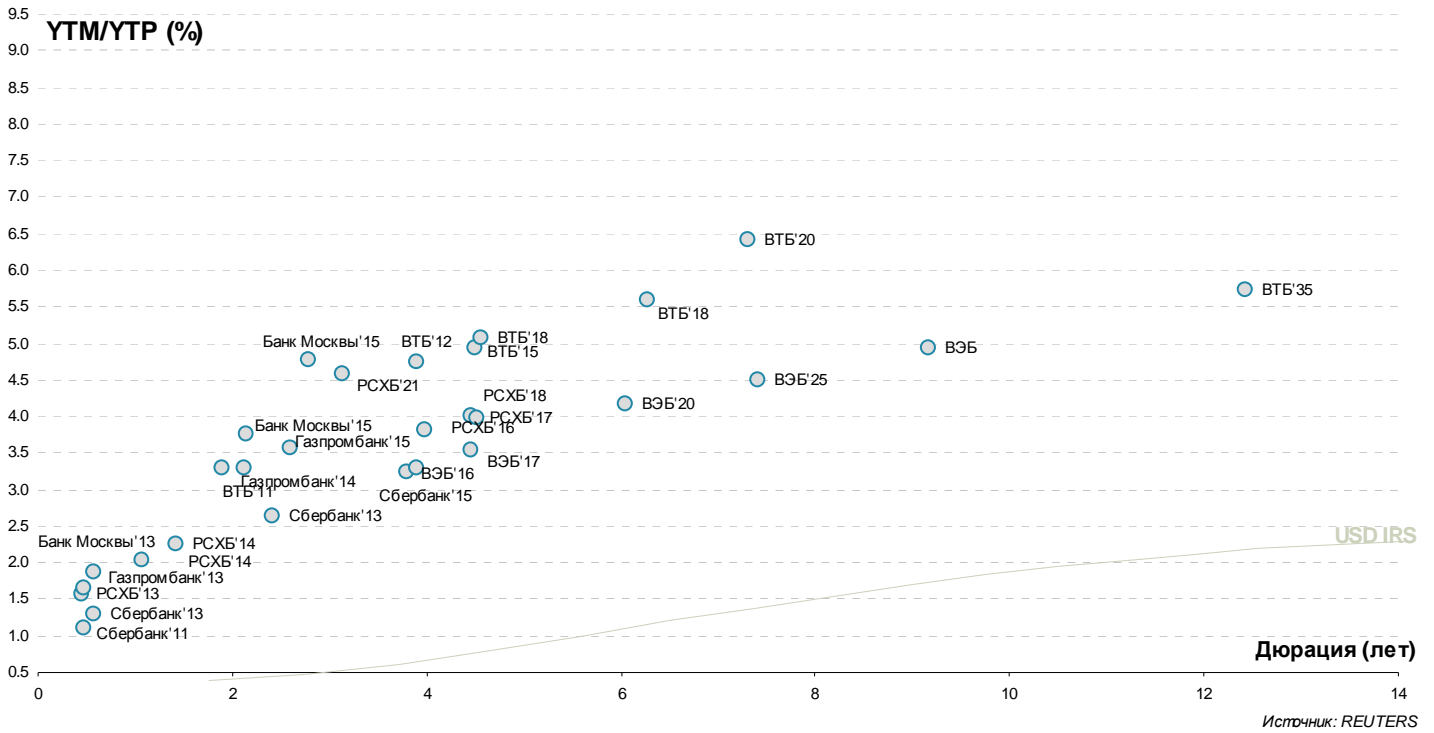
Россия



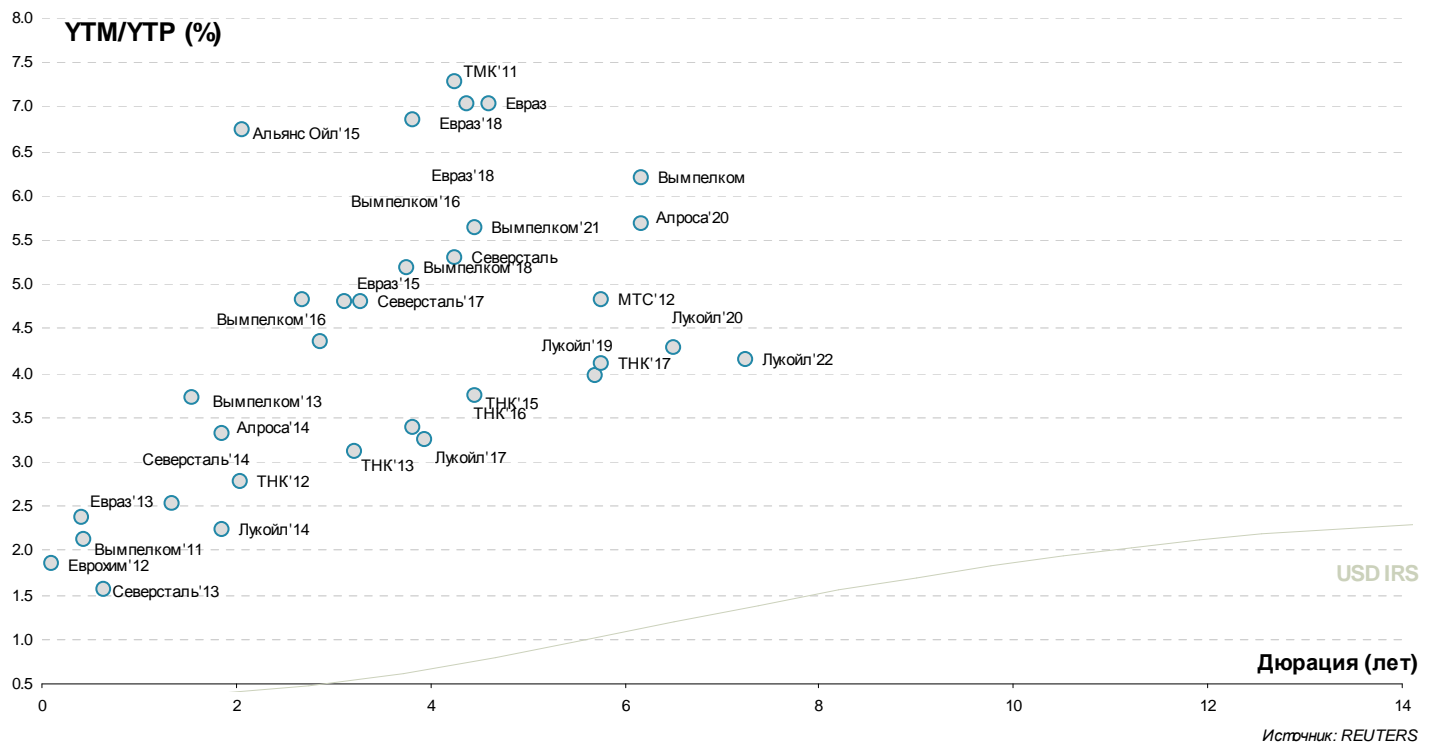
Госкомпании



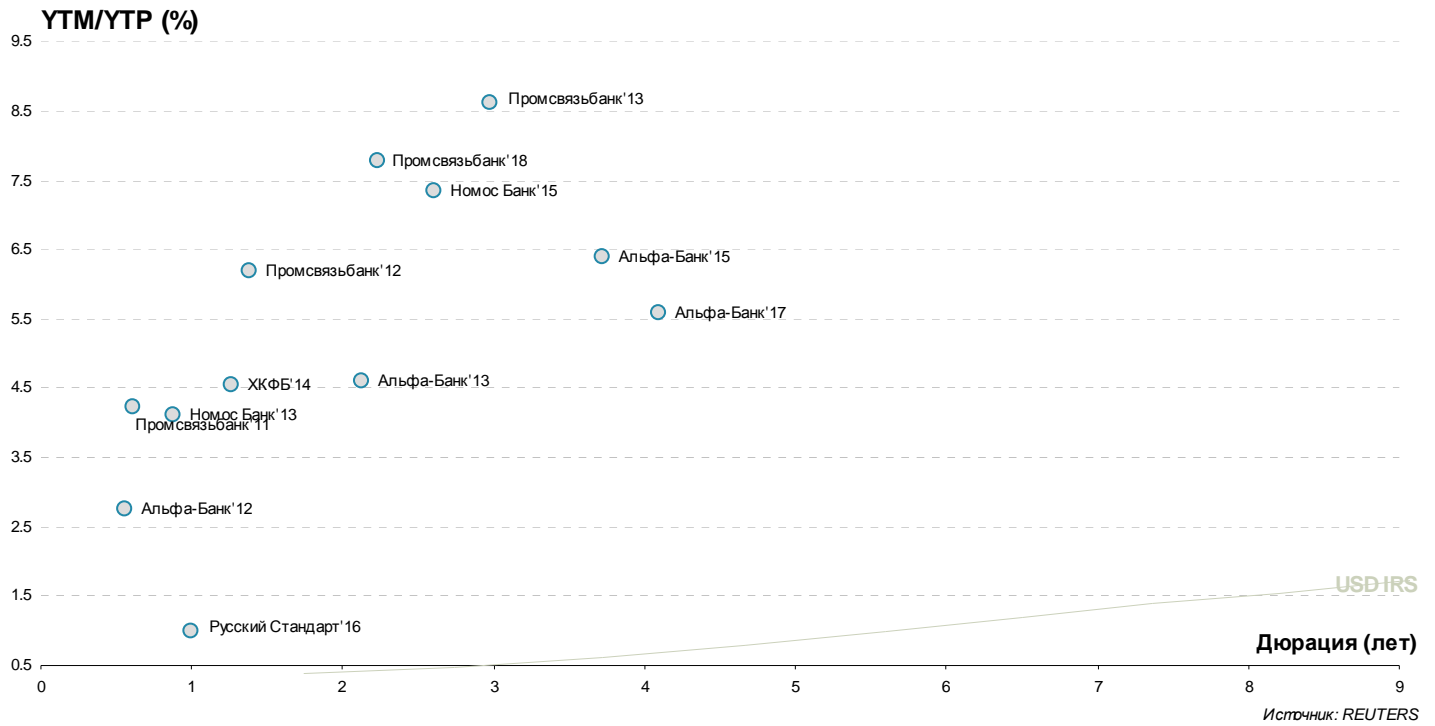
Госбанки



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

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.

