

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Республиканцы дали рынкам надежду

Российский долговой рынок /стр. 4/

- Евробонды выглядят нейтрально
- Слабый спрос на аукционе Минфина прервал ралли в ОФЗ

Первичный рынок /стр. 5/

Приложения

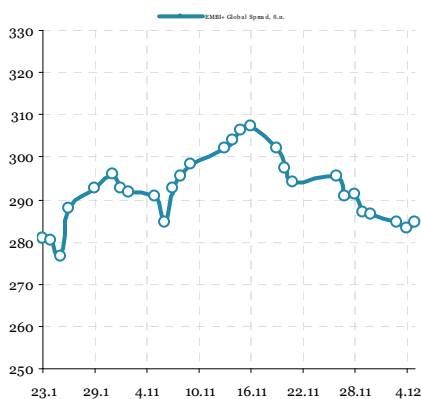
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 6/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 17/
- Результаты торгов евробондами /стр. 18/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 21/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.59	▼ -0.02	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	135	▼ -1	117	162
EMBI+Glob.	285	▲ 1	270	441
EMBI+Rus sprd	159	▲ 3	141	332
Russia 30 yield	2.77	▼ -0.02	2.72	4.12
Денежный рынок				
Libor-3m	0.31	■ 0.00	0.31	0.47
Euribor-3m	0.19	▼ 0.00	0.19	0.66
MosPrime-1m	6.88	▲ 0.09	6.35	6.89
Корсчета в ЦБ	702.3	▼ -309.1	446	1011
Депоз. в ЦБ	93.4	▼ -26.5	65	238
NDF RU 3m	6.3	▼ 0.0	6	7
Валютный рынок				
USD/RUB	30.773	▼ -0.087	30.46	33.26
EUR/RUB	40.244	▼ -0.122	38.97	41.73
EUR/USD	1.307	▼ -0.003	1.21	1.31
Корзина ЦБ	35.181	▼ -0.078	34.82	37.02
DXU Индекс	79.774	▲ 0.130	78.85	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1469.5	▲ 0.0%	1228	1589
Dow Jones	13034.5	▲ 0.64%	12101	13610
DAX	7454.6	▲ 0.26%	5969	7455
Nikkei 225	9469	▲ 0.81%	8296	9469
Shanghai Comp.	2031.9	▼ -0.13%	1960	2390
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	107.2	▼ -0.92%	88	117
Нефть Brent	108.8	▲ 0.01%	89	117
Золото	1694.0	▼ -0.23%	1553	1790
CRB Index	297.9	▲ 0.24%	267	321

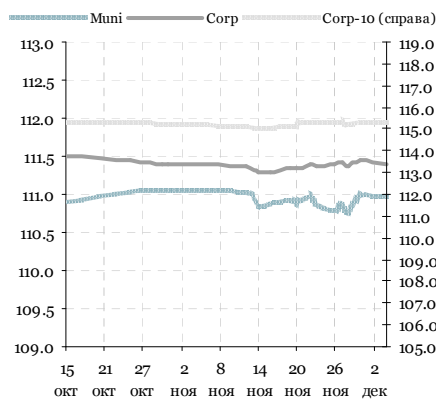
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	124.1	▲ 0.99	107.5	124.1
Muni	111.0	▼ -0.02	109.6	112.4
Corp	111.4	▼ -0.05	110.7	112.1
Corp-10	115.3	▲ 0.05	115.0	117.1
Total Return				
OFZ	285.3	▲ 1.37	233.3	285.3
Muni	351.5	▲ 0.18	327.6	351.5
Corp	349.2	▲ 0.21	325.7	350.9
Corp-10	350.9	▲ 0.40	327.1	350.9
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	393	▼ -552	0	22 514
Muni	1 123	▲ 280	10	5 492
Corp	7 767	▲ 1 874	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Минфин разместил 15-летние ОФЗ серии 26207 на 9 млрд руб. при спросе 9,091 млрд руб. и предложении в 25 млрд руб. Цена отсечения облигаций была установлена на уровне 111,3111% от номинала, средневзвешенная цена - 111,4675% от номинала. Доходность по цене отсечения составила 7,0% годовых, по средневзвешенной цене - 6,99% годовых. /Финам/

ОАО «НОВАТЭК» заключает контракт с энергетической компанией группы «Газпром» - «Мосэнерго», который предусматривает поставку 27 млрд куб. м газа в период с 2013 года по 2015 год. /Интерфакс/

ОАО «Мечел» договорилось с банками о введении 12-месячного льготного периода в отношении синдицированного кредита на 1 млрд руб., чтобы сохранить ликвидность в следующем году.

Комитет финансов Санкт-Петербурга установил новый диапазон ставки купона по пятилетним облигациям объемом 7 млрд руб. на уровне 7,75% – 8,15% годовых, что соответствует доходности к погашению облигаций 7,89% – 8,31% годовых. /Финам/

ОАО «МКБ» утвердило 11 декабря датой начала размещения облигаций серии 11 со сроком обращения 5,5 лет и объемом 3 млрд руб. Ориентир ставки первого купона по облигациям находится в диапазоне 12,25% - 13,25% годовых, что соответствует доходности к погашению на уровне 12,63% - 13,69% годовых. /Финам/

Наблюдательный совет НОМОС-БАНКа одобрил сделку по размещению субординированных еврооблигаций объемом до 300 млн долл. сроком до 7 лет. Процентная ставка по займу установлена в диапазоне от 10% до 10,5% годовых. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 05.12.2012 – среда

Статистика Еврозоны: Retail sales, PMI Composite

Статистика США: ADP Employment Change, ISM Non-Manf. Composite

- Выплата купона: ТрансФин-М, 04 (9.5%, 11.8 млн руб.), ТрансФин-М, 05 (9.5%, 11.8 млн руб.), ТрансФин-М, 06 (9.5%, 23.6 млн руб.), ТрансФин-М, 07 (9.5%, 23.6 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 07 (8.15%, 70.3 млн руб.), РейлТрансАвто (РТА), 01 (17.5%, 42.7 млн руб.), РЖД, БО-01 (9.4%, 703 млн руб.), СКБ-банк, БО-04 (10.75%, 107.2 млн руб.), Министерство финансов Волгоградской области, 34004 (7.75%, 54.1 млн руб.), Министерство финансов Самарской области, 35007 (7.49%, 227.7 млн руб.), Россия, 25079 (7%, 5.2 млрд руб.), Синергия, БО-03 (11%, 109.7 млн руб.), Россия, 46018 (8%, 2.6 млрд руб.), Сатурн, 03 (8%, 139.6 млн руб.), Липецкая область, 34006 (8.98%, 16.7 млн руб.)
- Оферта: Трудовое, 01 (23 млн руб.), Внешпромбанк, БО-01 (3 млрд руб.), Татфондбанк, БО-03 (2 млрд руб.)
- Погашение: РЖД, БО-01 (15 млрд руб.)

Сегодня: 06.12.2012 – четверг

Статистика Еврозоны: GDP, ECB Announces interest rate

- Выплата купона: ФОРМАТ, 01 (17%, 42.4 млн руб.), ТрансФин-М, 08 (9.5%, 14.2 млн руб.), ТрансФин-М, 09 (9.5%, 14.2 млн руб.), ТрансФин-М, 10 (9.5%, 23.6 млн руб.), ТрансФин-М, 11 (9.5%, 23.7 млн руб.), Трансконтейнер, 02 (8.8%, 131.6 млн руб.), РМК-ФИНАНС, 04 (9%, 224.4 млн руб.), Мечел, 18 (8.4%, 209.4 млн руб.), Мечел, 17 (8.4%, 209.4 млн руб.), ЕвразХолдинг Финанс, 05 (8.4%, 209.4 млн руб.), Мехпрачечная СвЖД, 02 (8%, 98.9 млн руб.), ВТБ, 2014, SGD (3.4%, 5.1 млн сингапурских долл.), Элемент Лизинг, БО-01 (13.5%, 33.6 млн руб.), ВТБ, перр (LPN, Step Up) (9.5%, 71.2 млн руб.), Детский мир - Центр, 01 (8.5%, 49.3 млн руб.), Лукойл, 04 (7.4%, 221.4 млн руб.), Элемент Лизинг, 02 (1%, 1.7 млн руб.), ИКС 5 ФИНАНС, 04 (7.75%, 309.1 млн руб.)
- Оферта: Мосэнерго, 03 (5 млрд руб.)
- Погашение: ФОРМАТ, 01 (1 млрд руб.)
- Размещение: Санкт-Петербург, 25039 (7 млрд руб.)

Завтра: 07.12.2012 – пятница

Статистика США: Change in Nonfarm Payrolls, Unemployment rate, U.of Michigan Confidence

- Выплата купона: ССМО ЛенСпецСМУ, 01 (16%, 15.8 млн руб.), Промнефтесервис, 01 (8.25%, 123.4 млн руб.), Альфа-Банк, 02 (9.25%, 230.6 млн руб.), ВТБ Капитал Финанс, 11 (0.1%, 2.5 млн руб.), Ленинградская область, 26002 (12%, 77.8 млн руб.), Лукойл, 2017 (6.356%, 15.9 млн руб.), Лукойл, 2022 (6.656%, 16.6 млн руб.)
- Оферта: Сатурн, 03 (3.5 млрд руб.)
- Погашение: ССМО ЛенСпецСМУ, 01 (2 млрд руб.)
- Размещение: Новолипецкий металлургический комбинат, 08 (10 млрд руб.)

Внешний рынок долга

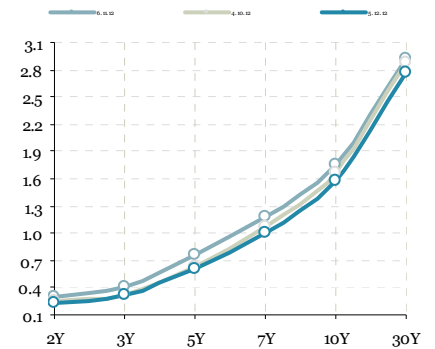
Республиканцы дали рынкам надежду

Глобальные рынки понемногу восстанавливают спрос на риск, укрепляя надежды на скорое достижение, по крайней мере, краткосрочного соглашения по бюджетному дефициту США. Таким настроениям рынков способствовали вчерашние призывы части республиканцев пойти на уступки и рассмотреть возможности повышения налогов на семьи с годовым доходом более \$500 тыс. (требуемая демократами планка - \$250 тыс.), а также продлить налоговые льготы для среднего класса. Несколько укрепила отношение к риску и вчерашняя американская статистика, показавшая недельный рост активности на ипотечном рынке, хороший сервисный ISM за ноябрь и скорее нейтральные данные по рынку труда от ADP. На этом фоне фондовые индексы по обе стороны Атлантики прибавили в пределах 50 бп, доходности дальних UST торговались без единого тренда.

Плохой новостью стало снижение греческого рейтинга агентством S&P (с CCC до SD), которое рассматривает обратный выкуп греческого долга со значительным дисконтом в виде «мягкой» реструктуризации, по сути, являющейся единственной возможностью получить одобрение «тройки» кредиторов на очередной транш помощи. Однако инвесторы сдержанно восприняли эту новость, справедливо полагая, что лучше получить деньги и полудефолтный рейтинг, чем не получить ничего и вскоре оказаться в реальном дефолте. Новость отыгрывалась преимущественно на форексе, где котировки евро опустились на 60 бп в район отметки \$1.3050, а на долговом рынке доходности испанских и итальянских бондов поднялись в пределах 20 бп.

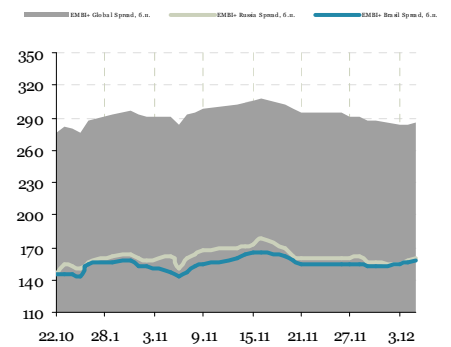
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



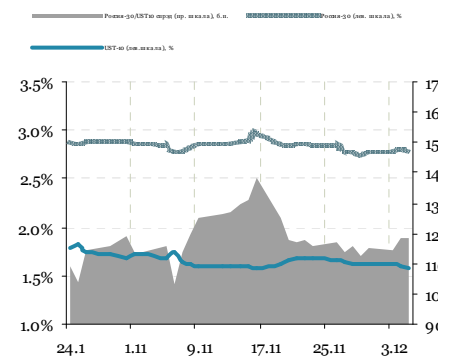
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



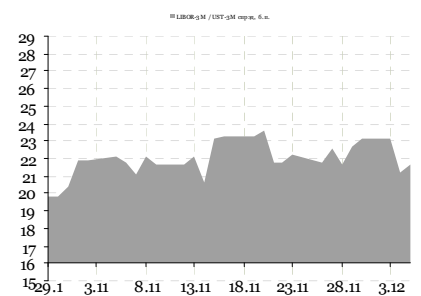
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды выглядят нейтрально

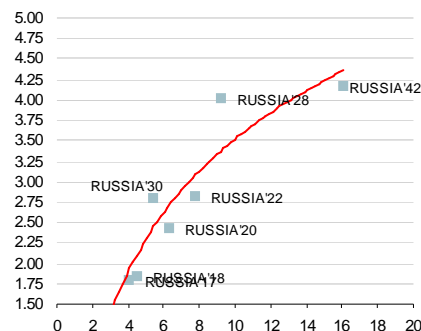
В среду спрос на долги ЕМ выглядел слабо, а спрэды незначительно расширились на фоне волатильности на рынке UST. В российском сегменте котировки суверенных бумаг в основном простояли на отметках вторника, чуть ниже ушел лишь выпуск Россия'42, потерявший более 25 бп и завершивший день в районе отметки 124%. Корпоративный сектор выглядел заметно лучше. Здесь цены в среднем по рынку прибавили порядка 20 бп, против рынка продолжили торговаться разве что дальние выпуски GAZPRU'34 и GAZPRU'37, потерявшие в ценах еще порядка 30-40 бп. Напротив, достаточно позитивно выглядела вся кривая ВЭБа, где цены прибавили порядка 50 бп, среди частных банков схожий результат показал выпуск ALFARU'22.

Слабый спрос на аукционе Минфина прервал ралли в ОФЗ

Доходности ОФЗ на локальном рынке в среду подросли. Поводом для продаж стали скромные показатели спроса на аукционе Минфина, который в рамках объявленного диапазона собрал лишь чуть более трети заявок на выпуск 26207, который в условиях продолжающегося ралли рассматривался рынком в качестве основной идеи на рынке госбумаг, дающей премию к кривой. В итоге к концу дня сделки в выпуске проходили на 30 бп ниже цены аукциона и на 50 бп ниже отметок вторника. В среднем же по рынку доходности дальних госбумаг выросли в пределах 5 бп. Корпоративный сектор, тем не менее, торговался преимущественно «в плюс». Основные идеи были по-прежнему сосредоточены в дальних выпусках Роснефти и ФСК 25, прибавивших в ценах 15-30 бп, ближе по дюрации достаточно активно покупали годовой выпуск Башнефть БО1.

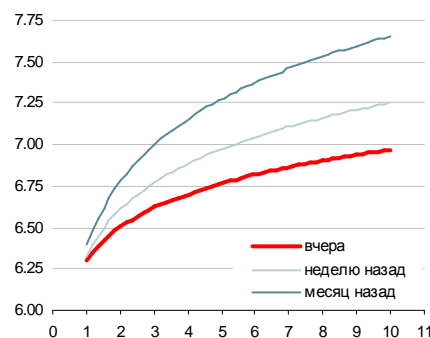
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



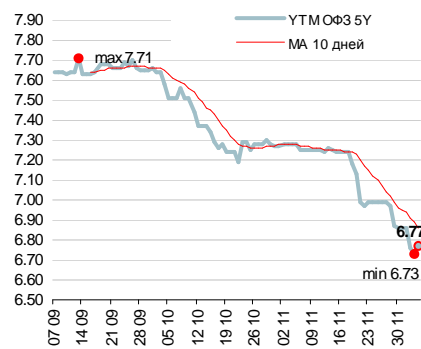
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



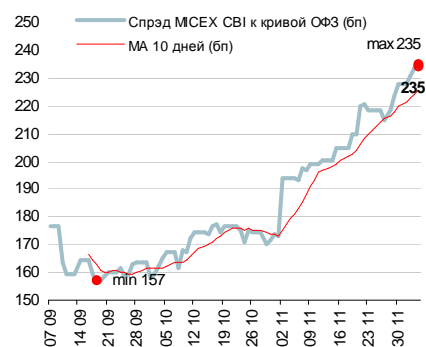
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



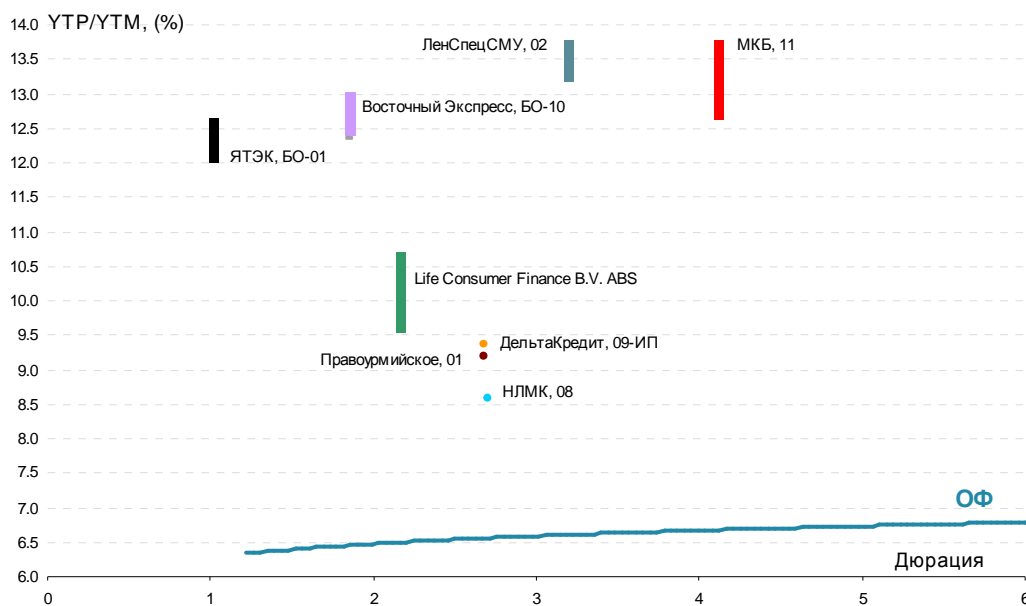
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Закрытие книги	Дата размещения	Амортизация/ Дюрация	Оферта/ Погашение
НЛМК, 08	BBB- / Baa3 / BBB-	да	10 000	8.58	04.12.2012	07.12.2012	нет / 2.71 г.	3 г. / 10 лет
Правоурмийское, 01	NR	нет	3 000	9.20	06.12.2012	10.12.2012	нет / 2.68 г.	3 г. / 7 лет
АгроКомплекс, БО-01	NR	нет	1 000	н/д	Конкурс	10.12.2012	н/д	н/д / 3 г.
ДельтаКредит, 09-ИП	- / Baa1 / -	да	5 000	9.36	04.12.2012	11.12.2012	нет / 2.68 г.	3 г. / 5 лет
МКБ, 11	B+ / B1 / BB-	да	3 000	12.63-13.69	07.12.2012	11.12.2012	нет / 4.11 г.	нет / 5.5 лет
ЛенСпецСМУ, 02	B / - / -	да	5 000	13.10-13.65	14.12.2012	18.12.2012	да / 3.18 г.	нет / 5 лет
ЯТЭК, БО-01	- / - / B-	да	3 000	12.01-12.55	19.12.2012	21.12.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
КБ Восточный Экспресс, БО-10	- / B1 / -	да	3 000	12.36-12.89	19.12.2012	21.12.2012	нет / 1.83 г.	2 г. / 3 г.
Life Consumer Finance B.V., ABS	BBB / - / -	да	3 200	9.58-10.65	13.12.2012	XX.12.2012	да / 2.15 г.	нет / 4 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
Газпром Нефть, 12	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	3.7 / 100%	8.78-8.99	8.68	05.12.2012	нет / 4.17 г.
АИЖК, 24	BBB / Baa1 / -	да	6 000	2.8 / 100%	8.69-8.90	8.43	05.12.2012	да / 2.64 г.
Глобэкс, БО-07	BB / - / BB	да	5 000	н/д / 100%	9.15-9.36	9.20	04.12.2012	нет / 1 г.
ММК, 18	- / Baa3 / BB+	да	5 000	2.1 / 100%	9.10-9.36	8.89	04.12.2012	нет / 2.70 г.
Росгосстрах, 02 (вторичное)	NR	нет	3 500	н/д / 100%	10.76-11.06	н/д	04.12.2012	нет / 1 г.
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	- / Baa3 / BBB+	да	4 000	1.1 / 100%	9.73-10.25	10.25	02.11.2012	нет / 1.86 г.
АПРОСА, БО-01	BB- / Baa3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
АПРОСА, БО-02	BB- / Baa3 / BB-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
Связь-Банк, БО-01	BB / - / BB	да	5 000	1.2 / 100%	9.20-9.46	9.20	01.11.2012	нет / 1 г.
ЮниКредит Банк, БО-05	BBB / - / BBB+	да	5 000	2.0 / 100%	9.31	9.31	30.10.2012	нет / 1.88 г.
Трансфин-М, БО-11	NR	нет	2 000	н/д / 100%	н/д	10.78	29.10.2012	нет / 2.64 г.
Роснефть, 04	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
Роснефть, 05	BBB- / Baa1 / BBB	да	10 000	н/д / 100%	8.99-9.31	8.78	29.10.2012	нет / 4.17 г.
МОЭСК, БО-02	BB- / Baa2 / -	да	5 000	3.7 / 100%	8.99-9.20	8.99	29.10.2012	нет / 2.69 г.



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	100.05	100.17	100.17		25	231 895	5.87	0.13			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.11	100.13	100.11	-0.01	20	226 084	6.07	0.17			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.40	101.99	101.99	0.14	1	4 000	5.52	0.30			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	90.00	100.19	100.20	0.05	7	6 735	5.89	0.60			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.40	100.41	100.40	-0.06	5	5 361	6.21	0.84		11	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.88	100.97	100.96	-0.06	17	70 221	6.39	1.22	3	36	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.91	109.20	109.00	-0.13	3	6 002	6.44	1.55	1	48	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.10	109.15	109.11	-0.14	3	30 000	6.54	1.82	7	63	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.04	103.25	103.09	0.09	3	170	6.51	1.86	3	60	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.10	101.20	101.02	-0.13	1	1	6.66	2.33	12	80	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.06	100.85					6.62	2.37	7	76	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	102.17	102.37	102.30	-0.10	3	21	6.63	2.78	3	79	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.90	99.50					6.78	2.87	18	94	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.00	101.30	101.00	-0.10	3	90	6.69	3.23	5	86	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	92.40	100.00					6.60	3.49		76	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.57	3.43	91	173	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.29	103.40	103.50	0.21	5	3 622	6.57	3.79		72	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.10	103.45	103.45	-0.00	11	10 537	6.61	3.81		76	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.09	104.30	104.29	-0.11	2	2	6.63	4.41		76	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	93.00	94.30					7.27	4.45	54	139	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.20	102.00					6.72	4.57		84	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	104.29	104.50	104.24	-0.16	5	590	6.77	5.03	0	86	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		76.00					8.01	5.50	122	204	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	98.50	99.00	99.00	0.25	19	669	6.99	6.26	16	93	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	105.34	105.80	105.35	-0.50	12	300 083	6.87	6.35	3	80	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	105.45	105.55	105.45	-0.70	8	100 043	6.93	6.91	7	78	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	88.00	94.09	91.60	1.10	1	1	7.16	7.39	28	95	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	110.05	111.15	111.00	-0.55	20	350 521	7.04	8.77	11	65	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.50	95.25	94.50		2	2	7.54	11.20	54	83	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.55	11.10			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	99.75	99.80	99.80	0.05	2	6 001	7.43	0.63	126	127	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	-------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО1		04/12/12							-4.42	0.00			5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.08	100.30					7.39	0.25		107	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.55	100.57	100.55	-0.03	1	1	7.82	0.52	171	162	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.55	100.56	100.55		5	48 473	7.82	0.52	171	162	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.00	100.30					8.21	1.64	177	226	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.08						8.37	1.81	190	245	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.25	100.50					8.60	2.08	209	272	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.93	99.98	99.98	0.01	1	500	7.81	0.33		153	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.06	100.08					8.25	0.67	207	210	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.30	99.33	99.33	-0.33	2	701	8.39	1.18	204	235	5 000
ММК ВО6		10/07/14							8.96	1.49	255	298	5 000
ММК ВО7		22/07/14	96.01						8.80	1.52	238	283	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.03	100.46	100.46	0.03	13	22 207	7.39	0.20		106	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.40	100.44					7.60	0.20		127	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.20	100.23	100.23	0.05	11	33 101	8.05	0.54	193	186	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.29	100.30	100.25	0.15	10	26 909	8.02	0.55	190	183	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.65	100.85					8.92	2.25	238	305	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.70	100.90	100.70	-0.20	1	1	8.92	2.27	238	305	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.23	100.32	100.35	0.15	47	224 537	9.00	2.57	243	315	5 000
Алроса ВО2		30/10/15	100.20	100.35	100.35	0.15	17	15 102	9.00	2.57	243	315	5 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.00	100.44					8.46	0.29		216	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	98.16	100.43	98.02	-2.28	3	1 048	16.94	0.29		1 064	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.66	107.85	107.72	-0.13	1	9 000	9.10	1.69	265	316	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.72	107.80	107.72	0.02	1	40 000	9.10	1.69	265	316	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.40	101.60					9.51	2.56	294	366	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	101.40	101.80					9.49	2.56	292	364	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21							10.00	2.97	338	417	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	90.03	96.50					12.35	3.09	572	652	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.80	100.15	100.00	-0.11	9	15 454	9.19	2.07	268	331	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	100.02	100.10	100.00	-0.11	6	44 052	9.19	2.07	268	331	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	100.00	100.20	100.01	0.01	4	51 550	9.19	2.08	268	331	10 000

Мечел

Мечел ВО2		12/03/13	99.62	99.70	99.70	0.01	12	25 263	11.09	0.27		478	5 000
-----------	--	----------	-------	-------	-------	------	----	--------	-------	------	--	-----	-------

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот,			Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп		шт	УТМ/УТР	Дюрация	ОФЗ	свопам	
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	96.01	100.00	100.00	-10.05	3	73	11.71	0.35		544	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	99.00	99.45	99.00	0.15	1	58 000	12.82	0.38		656	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	97.75	97.90	97.90	0.15	11	21 198	12.03	0.50		582	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	100.00	99.50	-0.50	1	85	12.62	0.62	646	645	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.01	95.97	95.49	1.34	4	263	15.01	1.11	868	896	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	91.80	92.70	92.60	0.80	7	96	15.74	1.14	940	970	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.60	92.39	91.00	-0.94	10	571	17.47	1.14	1113	1 143	5 000
Мечел ВО5		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	594	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	594	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	594	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	594	3 000
Мечел ВО6		07/04/15	99.50						11.55	2.08	504	567	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	84.00	89.74					16.12	2.40	957	1 026	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	85.02	88.93					20.67	2.38	1412	1 481	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21							15.36	2.91	875	953	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21							15.17	2.92	856	934	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21							16.02	2.92	941	1 019	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.81	100.00	100.00	0.09	3	2 590	9.02	0.86	277	292	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.20	100.46	100.42	-0.04	8	214	8.75	0.56	262	257	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	96.15	98.40					13.95	0.96	766	787	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16							16.01	1.36	962	1 001	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12								-43.44	0.00		5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.11		98.09	-0.11	4	16	10.38	1.41	398	439	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	92.97	93.07	93.07	0.06	33	19 179	15.11	1.18	876	907	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	88.01	88.75	88.01		10	392	15.22	2.15	870	935	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД ВО01		05/12/12								-4.76	0.00		15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.79	99.80	99.80	0.20	7	3 001 999	7.24	0.92	96	115	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.65	108.80	108.80		5	1 297	7.60	1.15	126	156	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.20	102.50					7.85	1.95	136	196	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.60	99.80	99.70	-0.20	8	303 763	8.07	2.69	148	222	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17							8.24	3.01	162	241	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.85	100.15					8.29	4.48	156	241	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.75	100.20					7.33	0.79	110	122	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.75	100.15	99.90		1	1	7.39	0.79	116	128	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23							8.08	1.39	169	208	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	96.51	101.60	101.59	0.19	5	31 000	7.97	1.76	151	204	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.00	100.60	99.84	-0.66	2	2	8.34	2.19	181	247	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.05	99.17					8.24	2.53	167	239	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.40	98.70					8.17	2.63	159	232	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	96.01	99.80					8.33	3.00	171	250	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	101.00	101.35	101.35	0.30	6	94 900	8.34	3.29	170	250	15 000
ФСК ЕЭС 21	19/04/17	06/10/27	101.05	102.50	101.15	-0.05	1	80 000	8.60	3.70	192	276	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	98.25	98.70	98.45	0.75	1	1	8.56	4.10	185	270	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	98.00	98.70	98.45	0.65	1	1	8.56	4.10	185	270	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	97.00	98.50					8.70	4.48	197	282	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	97.00	105.00					8.88	6.01	206	286	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.50	100.70	100.70	0.20	3	150 460	8.85	2.19	232	298	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.50					9.67	3.22	303	384	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	99.00	99.90	99.86	0.60	6	176	9.36	0.91	309	327	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	85.00	99.00					9.40	2.60	282	355	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	99.29	99.30					9.38	3.01	276	355	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.20	3.01	258	337	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	98.90	101.20					9.31	3.52	265	347	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32	98.90	101.20					9.65	3.52	299	381	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	85.00	100.30					9.66	3.50	300	382	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16		100.59	100.40	0.12	3	102	8.06	1.24	170	204	7 000
Почта России 2	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	304	00000 000
Почта России 3	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	304	00000 000
Почта России 4	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	304	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	99.60	99.98					7.58	1.14	124	154	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.00	109.20	109.20	-0.07	10	17 350	7.49	1.38	110	149	5 000
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22	101.15	101.24	101.24	0.14	9	427 002	8.45	4.06	174	260	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.10	101.50	101.50	0.25	18	55 301	8.39	4.06	168	254	10 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							9.17	0.02			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							0.04	0.02			5 000
Лукойл 4		05/12/13							7.43	0.95	115	135	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.52	100.99					15.39	0.11		905	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.99	100.75					7.27	0.34		99	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	94.02	100.74					7.27	0.34		99	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.51	101.50					8.12	1.98	162	224	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.50	100.70	100.70		1	1	8.41	2.76	182	257	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.41	100.70	100.70		1	1	8.41	2.78	181	257	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.07	102.55	102.25	-10.00	2	2	8.53	4.15	182	267	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	98.00	99.99					9.11	4.38	238	324	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.19	100.20					7.53	0.53	141	134	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.30		100.28	-0.02	1	50 000	8.40	2.57	183	255	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.35	100.35		1	7 700	8.37	2.57	180	252	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75						8.39	2.57	182	254	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.50	99.95	99.91	0.14	4	186	7.48	0.78	126	137	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.15	100.16	100.11	-0.02	15	2 190	9.27	0.04			15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.00	100.17	100.15	0.02	7	15 388	8.12	0.04			15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.00	100.16	100.15	-0.02	3	6 021	8.12	0.04			20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.05	101.25	101.30	0.30	12	237 919	8.13	0.98	184	206	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22		110.18	101.15	0.05	2	30 000	8.58	1.99	208	270	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.90	100.20					10.12	0.63	396	396	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	99.01	99.20	99.16	0.16	8	470	10.26	1.10	393	421	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	95.00	96.99					10.78	2.95	417	495	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	95.00	99.45					10.78	2.96	417	495	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.60	99.79	99.80	0.30	4	1 719	12.86	0.61	670	669	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.61	3.02	299	378	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.37	100.60	100.50		7	48 055	7.90	0.58	176	172	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.02	100.05	100.02	-0.01	11	21 749	8.20	0.04			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.98	100.10	100.00	-0.03	1	1	8.16	0.14		182	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.91	100.09	100.00	0.05	2	1 501	7.82	0.27		151	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.85	100.00	99.85	-0.06	4	3 002	8.41	0.27		210	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	110.01	99.99	0.03	5	33 999	7.86	0.27		155	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.10	100.15					7.86	0.73	165	173	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.57	99.99	100.00	0.05	1	580	7.60	0.84	135	150	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.50	100.20	100.10	-0.02	1	1	8.16	1.21	181	213	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.50	100.10	100.10	-0.02	1	15 000	8.16	1.21	181	213	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90	100.25					8.68	2.51	211	283	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.51	211	283	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.55		100.05	0.15	1	1	8.04	0.48		183	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14							8.92	1.83	245	301	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.10	100.04		1	1 000	8.28	0.69	209	214	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15							8.28	0.09		193	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16							8.42	0.23		210	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.50	101.00					7.67	0.39		141	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.20	0.78	198	209	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16							7.93	0.62	177	177	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	100.00					7.45	0.99	116	138	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80		99.80	0.40	15	490	8.58	1.25	222	256	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	86.00		99.80		1	6 490	7.25	0.86	99	115	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.45	100.59	100.70	-0.05	2	2	8.21	2.07	170	233	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.30	101.30	101.05	-0.15	2	105 000	8.29	2.56	172	244	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.65	110.25					8.31	2.57	174	246	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.70	99.00	98.65	-0.15	1	1	8.55	2.93	194	272	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.29	203	283	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.00	98.70	98.40	1.57	4	62 002	8.47	4.09	176	261	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	86.00	99.30	99.94	0.94	2	879	7.68	1.30	131	167	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.50					8.53	1.78	206	261	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.90	101.10					8.53	1.78	206	261	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.70	101.50	100.70	0.01	3	74	8.80	1.89	232	290	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21							8.92	2.94	231	309	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	100.00	99.00	0.01	1	7	9.15	2.94	254	332	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.00		100.45		1	13 331	8.49	1.25	213	247	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.55	101.00	100.70	0.40	13	17 470	8.93	1.58	250	297	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.90	100.14					8.51	1.40	211	252	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19		100.15					8.56	1.40	216	257	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20		100.17	100.17	0.02	4	4 374	8.03	0.17	170	170	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.10	102.00	100.10	-0.10	1	1 000	8.46	0.18	213	213	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.30	99.90					7.59	0.50	138	138	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	86.00	100.25	100.25		1	1	7.93	0.65	176	178	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.30	100.10	-0.08	1	1	8.18	0.65	200	203	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	98.20	100.20	98.21	-1.89	1	6	11.18	0.71	498	505	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.00	100.19	100.00	-0.15	13	199 463	8.44	0.71	224	231	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						6.97	0.81	73	86	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	97.03	100.30					8.10	0.88	184	201	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	100.55	100.45	0.45	2	9 400	8.39	0.90	212	230	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.50	101.35	-0.05	1	5 085	8.18	1.13	185	213	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.00	100.50					8.19	1.58	176	223	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.75	100.10	0.09	2	25 100	8.46	1.77	200	254	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.05	100.10	0.09	1	1	8.46	1.76	200	253	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.15	100.50					8.55	2.16	203	268	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.15	98.50	98.15		1	200	8.69	2.32	215	283	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.15	98.75					8.68	2.33	214	282	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.15	98.50					8.68	2.33	214	282	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	99.57	100.03	99.40	-0.64	1	3 000	21.49	0.05			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.20	99.32	99.32	0.02	1	1	8.02	0.61	186	185	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13							7.90	0.95	162	182	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	99.50	100.71	100.44	0.14	8	28 931	8.25	1.11	192	220	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.85	100.99	100.81	-0.09	1	350	8.47	1.48	206	249	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	209	284	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17							8.68	2.71	209	284	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19							8.68	2.71	209	284	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22							8.68	2.71	209	284	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30	99.60					8.06	1.05	175	200	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43	86.00						8.44	1.64	200	249	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.40	99.40	0.70	5	41	8.07	1.78	160	215	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.60					8.50	1.79	203	258	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.41	2.24	188	254	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	98.98	98.75	0.50	1	1	8.35	2.66	177	250	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.05	99.65					8.66	2.94	205	283	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	100.50	99.00	0.50	1	12	8.61	2.95	200	278	7 000
АИЖК А21		15/02/20	86.00	101.50					8.92	3.13	229	309	15 000
АИЖК А11		15/09/20	97.20	99.65	99.64	1.42	29	375	8.56	3.71	188	272	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.90						8.95	4.83	219	305	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50	101.50	-0.50	2	2	9.06	5.44	227	310	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	196	254	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43	86.00										7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13							8.98	0.95	270	290	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13							9.10	0.95	282	302	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.75	99.85	99.75	0.15	6	6 001	9.62	1.53	320	365	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.53	310	355	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13		100.05	100.05	-0.05	1	121	8.10	0.20		177	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.89	100.20	99.89	-0.19	2	4 778	8.20	0.67	202	205	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.70	99.85					8.12	0.93	184	204	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.40					8.42	1.31	204	241	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.45	110.47					8.54	2.63	196	269	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.03	100.40	100.00	-0.25	1	20	8.15	0.52	204	195	10 000
МТС 1		17/10/13	99.50	99.85	99.75		1	600	7.42	0.85	117	132	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.29	99.30	99.22	0.07	6	16 322	8.14	1.36	175	214	15 000
МТС 2		20/10/15	98.10	98.25					8.62	2.61	204	277	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	
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.11	99.60	99.30	0.10	1	24	8.60	2.66	202	275	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.75	99.25	99.24	0.74	3	13 452	8.98	3.16	235	315	15 000
МТС 7		07/11/17	99.65	100.20	99.65		3	169	8.98	4.09	227	312	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.70	100.89					9.39	0.60	324	322	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.25	98.65	98.60	0.21	2	13 805	8.53	1.48	212	255	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	100.00	100.20	100.10	0.08	1	300	8.98	2.09	247	310	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	100.00	100.17	100.00	-0.10	8	25 470	9.03	2.08	252	315	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.75	100.20	100.00	-0.35	7	50 319	9.03	2.08	252	315	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	97.50	99.00	98.00	0.49	2	565	9.31	2.57	274	346	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.51	99.00	98.30	-0.34	1	1	9.18	2.57	261	333	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.20	100.45					8.11	1.73	165	218	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	95.26	99.50					8.59	0.54	247	240	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	96.01						8.45	0.42		221	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.80	100.60	0.20	1	1 100	8.51	1.12	218	246	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	100.79					8.65	1.12	232	260	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.14	100.40	100.10			200 303	9.12	2.15	260	325	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.99					9.28	3.01	266	345	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.62	3.01	300	379	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.58	3.01	296	375	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	86.00	100.00					7.51	0.23		119	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90	100.10					8.46	0.74	225	234	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90	100.10					8.46	0.74	225	234	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.90						8.29	0.74	208	217	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.90	100.10					8.39	0.74	218	227	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.30	99.37	99.37	0.07	4	26 605	8.71	1.18	236	267	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	99.00	99.45					8.70	1.32	232	269	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.57	100.64					8.94	2.50	238	308	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16							9.42	1.39	303	342	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.90	99.00					8.10	1.46	169	212	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	99.76	100.43	100.00	-0.20	2	2	9.72	2.50	315	387	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.00					8.92	0.62	276	275	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.70	99.80	99.80	-0.16	9	101 162	9.58	0.79	335	347	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.50	99.95					11.32	0.46		510	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	98.50						8.96	0.91	269	287	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.46	100.10					9.43	0.81	319	332	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	100.40						11.13	1.94	464	524	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.75	99.95	99.95		9	7 970	12.96	0.52	685	676	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15							11.68	2.18	516	581	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.25	95.99	95.25	-0.49	2	5 000	12.36	1.52	594	639	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	96.70	99.95					9.45	1.62	301	350	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	91.01	96.00					12.44	1.08	612	639	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	86.00	100.11					-16.08	0.03			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	95.71	99.10	99.00		11	45 500	9.73	1.11	340	368	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.01	101.21	100.00	-1.00	1	6	10.76	2.47	420	490	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.13	100.00					9.22	0.02			3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.52	99.62	99.55		1	500	9.80	0.70	360	366	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00		99.00	-0.35	3	5 000	12.04	0.85	579	594	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.30	101.00	100.58	0.09	1	1	8.60	0.74	239	248	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							9.47	0.04			3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	86.00	100.00					9.15	0.38		289	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	94.00	99.69	99.65	-0.02	4	64	9.37	0.38		311	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	
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	99.00					8.13	0.77	191	201	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.00	100.14	99.90		2	25	9.69	0.40		344	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.55	101.70	101.70	0.10	2	7	9.77	0.58	363	359	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.60	101.12	100.60	-0.05	1	2	10.69	1.95	420	480	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.92	100.05					7.85	0.34		157	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.90	100.10	100.10	0.10	5	605	7.54	0.34		126	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.30	100.40					7.51	0.23		119	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15							8.76	1.58	233	280	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.00	100.25	99.75	-0.05	2	12 000	9.78	1.33	340	377	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.20	100.40	100.40		9	7 090	10.02	2.02	352	414	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.75	100.75	100.40		1	60	10.02	2.02	352	414	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	100.09	100.00	-0.04	10	1 436	12.82	0.72	662	669	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.97	100.00	100.00	0.07	21	3 948	12.85	0.85	660	675	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.21	101.20					11.22	0.30		492	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.60	100.99					12.69	0.30		639	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.35		99.95	-0.05	1	1	10.50	0.39		425	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.35	100.00	99.95	0.01	1	1	10.50	0.39		425	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.51	0.49		230	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15			100.00		1	1	10.38	0.95	410	430	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	97.00	101.00					12.02	0.98	573	595	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.00	97.96					12.01	1.22	565	598	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	90.13	98.50	99.99	1.49	1	11	9.31	1.22	295	328	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.67	3.09	204	284	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	99.00	99.50	99.00	4.50	4	33	8.52	3.00	190	269	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	99.00	99.29	99.00	4.44	5	1 698	8.52	3.00	190	269	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.00	98.51	98.51	0.22	2	500	8.33	0.21		200	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.50	100.59	100.50	0.10	20	284 750	8.60	1.86	212	269	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.00	100.50					8.96	2.49	240	310	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.00	100.25					8.99	2.59	241	314	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.90					8.23	2.18	170	236	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.30	100.35	100.35		17	92 047	7.96	0.52	185	176	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	86.10						8.26	1.45	185	228	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	91.01	96.96					12.89	1.43	649	690	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.72	92.40					12.37	2.95	576	654	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	100.05	100.35					9.02	2.56	245	317	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.10	98.97					10.90	1.61	446	495	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.62	0.05			2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.09	98.90	0.05	3	1 500	8.88	0.56	275	269	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70						8.63	1.21	228	260	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	90.00	100.00					9.84	0.67	366	369	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	87.03	87.10	87.10	-0.16	18	775	30.41	0.76	2419	2 429	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.75	98.20	-0.30	2	2	11.30	0.83	506	520	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	106.01						9.33	0.95	305	325	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00	98.75					8.91	1.28	254	289	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.81	99.95	99.95		2	5 600	8.47	0.73	226	234	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	95.00						6.47	0.41		22	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.90	98.40					11.50	0.71	530	537	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													

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 2	30/06/15	26/06/18	98.90	101.09					9.09	2.27	255	322	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.45	2.67	287	360	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	97.51	102.99					4.33	0.79			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.17	101.30	101.10	0.10	4	250	8.81	0.94	253	273	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	99.95					11.25	1.42	485	526	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	97.05	98.00					10.45	1.42	405	446	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.50	100.65	100.55	-0.10	9	7 003	9.74	2.53	317	389	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.18	98.89					10.50	1.28	413	448	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.18	100.21	100.21	0.03	5	2 824	8.45	0.16		211	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.05	0.53	394	385	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.05	100.20	100.20	-0.20	3	732	9.92	0.74	371	380	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.35	100.55	100.50	0.10	2	1 931	11.34	1.19	499	531	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.31	98.40	98.37		8	554	11.16	1.22	480	513	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.15	96.25	96.15		3	1 200	11.40	1.51	498	543	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.86	100.25					11.62	1.73	516	569	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.90	100.01	100.01		19	16 400	10.77	0.04			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.50	101.70	101.70		2	15 235	12.70	1.27	633	668	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-10.78	0.01			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.20	102.80	102.30		2	12 000	9.70	0.45		347	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.60	99.34					9.52	4.01	282	367	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.60	99.30					9.52	4.01	282	367	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.60	99.30					9.25	4.01	255	340	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16		100.00					9.42	3.44	276	358	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.43	100.53	100.53	0.13	4	1 806	7.64	0.25		132	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.65	100.50	100.20	0.55	1	5	8.38	1.57	195	242	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.30	98.60	98.56	0.10	9	462	8.64	1.81	217	272	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.25	99.45	99.41	0.76	18	1 053	11.80	0.59	565	563	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.20	100.30	100.20		2	310	11.92	0.51	582	572	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	99.83	100.10	100.00		8	667	12.31	0.81	607	620	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14		100.35	100.30	-0.05	2	50 001	8.40	0.44		217	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	86.00	100.50					8.45	0.53	234	226	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13			99.80		3	20 401	8.51	0.57	237	233	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	92.00	99.00	98.41	-0.06	9	974	8.91	0.90	264	282	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15		100.75	100.70	-0.05	5	71 240	9.04	1.64	260	309	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	97.00	99.00	97.05	0.15	3	10 000	9.31	1.82	284	340	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16							7.32	0.48		111	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.14	100.19	100.19		7	5 026	8.35	0.79	212	224	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.85	100.00					8.55	1.11	222	250	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.06	100.40	100.24	-0.16	1	20 000	8.55	1.17	221	251	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14	100.01	100.04	100.04	0.01	1	10 000	8.11	0.03			5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.08	100.20	100.15	0.11	12	33 759	8.93	0.58	279	275	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.17	1.23	281	314	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.80						9.03	0.37		276	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13	100.00		100.01	-0.06	1	1	8.91	0.50	281	271	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.10	100.14					9.13	0.65	295	298	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.55	99.88	99.50		1	9 924	9.41	0.70	322	327	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.78	99.79	99.79	0.09	2	5 150	9.48	1.16	314	344	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.56	100.00	99.95	0.02	7	34 000	9.75	1.44	335	376	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.03	100.08	100.07	0.04	6	1 503	8.77	0.47		255	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.08		100.12	0.02	6	43 000	8.24	0.18		191	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.12	100.10	0.05	1	9 800	8.43	0.19		210	3 000
Банк ЗЕНИТ 1	07/04/12	07/04/13	99.45						9.35	0.34		307	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.21	100.25	100.25	0.10	2	1 225	8.65	0.50		244	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.25	100.35					8.72	0.55	259	253	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.20	100.24	100.22	-0.02	6	244	9.04	0.71	284	291	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.78	139	151	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.15	100.25	100.25		2	501	9.00	0.92	272	291	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	
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.05	100.20	100.20		4	37 650	9.23	1.28	286	321	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	97.00	100.03	100.03	0.03	1	42 030	8.68	0.21		235	5 000
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15	100.00	100.02	100.05	0.05	1	430	8.58	0.21		225	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.67	99.98	99.70	0.05	6	4 275	9.03	0.51	293	283	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	95.21	99.45	99.44	0.04	9	5 102	9.30	1.11	297	325	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.35	101.00	100.35	0.25	26	60 302	10.15	1.61	371	420	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	99.00	101.70					12.61	3.83	592	676	5 000
Банк СПб													
Банк СПб ВО1	09/10/12	09/04/13							8.27	0.04			5 000
Банк СПб ВО4	13/12/12	12/12/13							9.19	0.96	290	311	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.40	99.95					10.00	0.78	377	389	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.25	100.40					9.27	0.82	303	316	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15	100.10	100.15	100.15		3	999	8.14	0.11		180	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.80	99.94					8.87	0.22		254	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.87	99.95	99.89	-0.01	6	16 403	9.72	0.39		347	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.86	99.94					10.09	0.78	386	398	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	99.25	99.80	99.75		4	80 500	10.29	0.82	405	418	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.96	100.10	100.05	-0.05	1	1	10.45	1.29	408	443	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.06	98.19	98.19	0.04	3	5 501	10.76	1.42	436	477	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.10	100.21	100.18	-0.02	2	7 001	7.88	0.04			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	100.80					8.95	0.72	275	282	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.20	100.79					9.07	0.69	288	293	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.05	100.45	100.40		6	62 948	9.54	1.15	320	350	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.85	99.95	99.86	0.01	2	2	9.11	0.75	289	299	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.05	100.25	100.05	-0.02	6	4 899	9.86	1.16	352	382	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.20	100.30					9.40	0.51	330	320	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.01	100.20	100.01	-0.04	1	5	9.83	0.71	363	370	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.86	98.89	98.89	-0.01	3	1 109	10.30	0.78	407	419	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.80	100.95	100.95	0.20	8	6 309	11.04	1.09	472	499	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					11.00	1.10	467	495	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.90	100.39					11.45	1.15	511	541	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.62					11.01	1.87	453	511	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.69					11.16	1.97	466	527	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.90	99.18	98.85	-0.14	31	43 802	12.04	0.64	587	588	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.00	100.69	100.10	-0.50	4	5 416	13.07	0.65	690	691	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.53	100.66	100.74		2	139	11.35	0.37		508	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	101.01	101.19	101.01	-0.17	6	8 515	12.44	0.58	630	626	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	104.70	104.93	104.70	-0.07	14	1 688	12.46	0.60	631	629	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	101.50	103.00					10.38	0.76	416	426	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	104.05	104.15	104.15	-0.04	24	2 958	12.21	0.94	593	613	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	102.07	102.20	102.10	0.10	4	358	12.39	1.11	606	634	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.01	100.04	100.04	0.03	55	34 800	14.59	0.64	842	843	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.05	100.70	101.00	0.98	4	798	9.55	0.90	328	346	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.90	100.00	99.90	-0.10	1	3 278	9.00	0.78	277	289	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.20	100.40	100.40	0.20	1	100	9.34	1.61	290	339	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16		100.05					7.57	0.88	131	148	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19		101.05					7.90	1.12	157	185	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.02	1.13	169	197	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.20	100.95					8.57	2.05	206	269	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	101.05					8.93	1.37	254	293	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.05	100.35					8.50	0.72	230	237	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.00	100.30	100.25	0.15	2	3	8.28	0.73	207	215	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.79					8.57	0.73	236	244	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.76	0.95	248	268	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.30	100.86	100.50		1	1	8.99	1.76	253	306	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.30	101.00	100.60		3	103 001	8.93	1.77	247	301	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	238	319	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	101.00	100.86		1	50	7.99	0.97	170	191	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.85					7.81	0.96	152	173	5 000

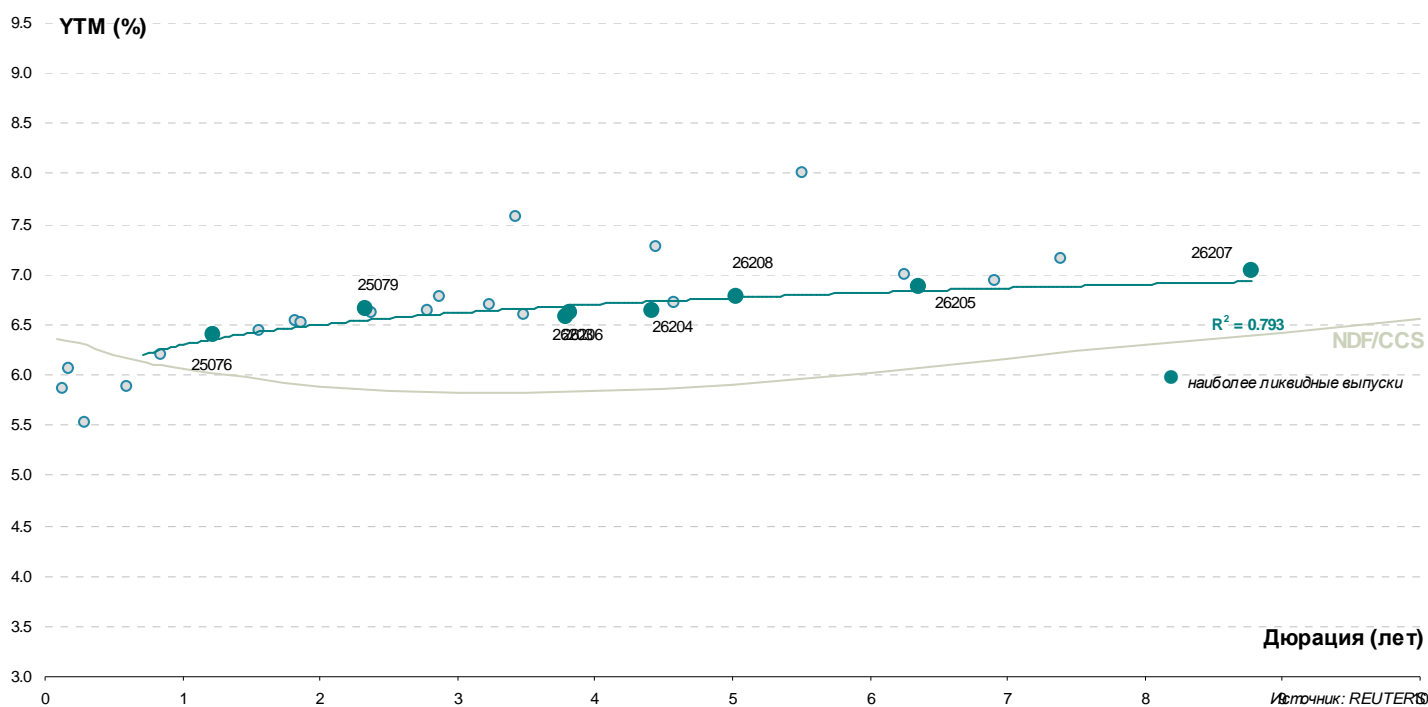
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		216	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.17	100.13	-0.08	6	440	9.45	0.90	318	336	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	96.03	99.89	92.01	-8.19	11	4 128	42.79	0.30		3 649	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.40	100.15	0.01	3	4 478	9.42	0.89	316	333	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13		99.90					10.12	0.25		380	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.60	100.70					10.67	0.68	449	453	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.45	100.10					10.09	0.84	384	399	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.40	100.59	100.55	-0.04	2	500	11.00	1.23	464	497	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14							9.18	0.02			5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.92	100.05	99.95	-0.10	17	14 000	8.91	0.36		264	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	98.75	99.35					9.39	0.85	314	329	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.17	100.40	100.40	0.10	5	7 458	9.91	2.13	339	404	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	99.30					8.16	1.26	179	214	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90		99.00	0.08	1	5 000	9.14	0.56	301	296	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00					10.01	0.73	380	388	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	101.50	100.32	-0.08	2	7 750	8.98	0.76	276	286	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.35	100.40					9.01	0.76	279	289	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	101.00					9.41	0.92	314	332	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.15					9.53	0.92	326	344	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.55	100.79	100.62	-0.03	4	9 501	9.86	1.77	339	394	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.30	100.60	100.40	0.05	1	1	8.77	0.65	260	262	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.20	97.60					8.88	1.43	248	289	5 000
Дельта Кредит 8	05/11/14	02/11/16											5 000
ОТП Банк													
ОТП Банк БО-3	01/11/12	30/10/14							9.40	1.78	293	348	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.26	100.30					10.52	1.17	418	448	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.46	97.80	97.76		8	340	10.37	1.24	401	435	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.31	96.40	96.40	0.10	2	2	10.64	1.53	422	467	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.11	0.50			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.11	100.20	100.15	-0.05	2	20 001	9.37	0.48		315	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.00						10.14	0.57	400	396	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.01	100.28					9.89	0.82	365	378	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.10	100.15	100.15	0.15	1	2 200	9.81	0.82	357	370	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.82	1.14	348	378	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.00					10.12	1.11	379	407	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.31	97.44	97.40	-0.05	2	212	10.39	1.33	401	438	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.89	99.90	99.89	0.18	4	3 203	9.32	0.83	308	322	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	100.00	100.25					9.96	1.32	358	395	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14			100.00		1	1	8.40	0.04			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14		100.15					7.82	0.04			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	86.00	100.15					9.43	0.37		316	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.45	100.65	100.50		1	2 000	9.65	0.53	354	345	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21		100.05	99.75	-0.25	1	6	15.05	0.04			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22		100.19	100.40	0.51	2	26 736	7.78	0.38		152	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15							9.18	0.89	292	309	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	316	386	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	100.19					10.37	0.85	412	427	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	100.15	100.34					10.92	0.24		460	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	100.20	100.29					11.05	0.82	481	494	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	86.00	99.90					9.41	0.16		307	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					10.12	0.35		385	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	
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	99.00						11.38	0.81	514	527	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.00	100.07	100.07	-0.05	1	1	8.25	0.04			2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	91.00	96.95	96.95		1	1	10.29	1.53	387	432	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.25					9.14	0.35		287	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13		100.20	100.20	-0.01	3	25 246	9.37	0.38		311	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.02	100.15					11.17	0.78	494	506	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.75	100.05					10.19	0.95	391	411	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	99.95					12.49	0.72	629	636	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.15	100.17	100.16	0.02	4	15 561	8.92	0.18		259	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00	100.05	100.06		1	920	10.21	0.61	405	404	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.41	100.43	100.41		3	8 560	10.32	0.66	414	417	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.71	0.47		349	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.15	99.70	99.50	0.08	1	1	9.59	0.57	346	341	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.35	100.70					9.56	0.82	332	345	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.95	100.10	100.10	0.10	14	42 501	12.19	0.86	593	609	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.65	99.79	99.79	-0.01	4	31 933	9.45	0.84	320	335	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.55	100.25					9.66	0.84	341	356	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.25	100.34	100.27	-0.20	6	9 600	11.02	0.40		477	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.30	100.65	100.65	0.35	7	16 717	11.93	0.79	570	582	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	86.00	100.00					12.20	0.04			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.60	100.95					11.85	0.67	567	570	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.61	100.00	100.00	0.05	1	1	11.06	0.87	480	496	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	99.86	100.10	100.00		8	21 496	12.66	0.95	638	658	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12	100.00	100.10	100.00		4	13 163	10.01	0.02			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.05	100.15	100.05		11	25 863	11.20	0.21		487	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.15	100.00	-0.30	2	6	10.43	0.23		411	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.50	100.00	99.80	-0.10	2	26	11.89	0.34		561	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.10	100.15	100.15	0.05	9	23 808	13.21	0.83	697	711	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.00	99.47	99.00		1	5	12.15	0.98	586	608	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.91	100.09					12.72	1.28	635	670	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	508	565	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		103.51	104.45	104.43	0.03	2	2	5.95	0.48			30 000
Москва 53	01/09/13		100.07	100.14	100.14	0.04	2	2	6.90	0.72	70	77	15 000
Москва 63	10/12/13								6.08	0.93			15 000
Москва 62	08/06/14								6.89	1.36	50	89	35 000
Москва 39	21/07/14		98.75	99.98					7.27	1.53	85	130	10 000
Москва 64	24/06/15		98.43	99.45					7.80	2.31	126	194	20 000
Москва 44	16/11/15		111.85		112.90	0.87	1	32 700	7.53	2.56	96	168	40 000
Москва 56	22/09/16		97.96	98.79					7.85	3.35	120	201	20 000
Москва 49	14/06/17		96.70	99.29					7.67	3.82	98	182	25 000
Москва 48	11/06/22								7.77	6.79	91	164	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13								8.14	0.49		193	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.40	99.58	99.58	0.08	1	3	8.49	1.30	211	248	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	03/12/12								-14.27	0.01			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.28	100.00	99.27	-0.28	1	15	8.78	1.69	233	284	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.61	103.05					8.69	2.18	216	282	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		102.86	103.30					7.15	0.42		91	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		100.87	101.15	101.15	0.30	3	54 500	8.39	0.98	210	232	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		98.00	98.20	98.00		5	28 301	8.79	2.00	229	291	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		100.00	100.30					8.16	0.34		188	3 000
Якутия 9	19/09/13		99.15						7.85	0.52	174	165	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.51	99.80	99.71	-0.09	2	2 000	8.28	1.22	192	225	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12									0.02			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	
Краснодар 02	05/11/15		86.00	100.50	99.40	-0.15	2	2 440	9.49	2.21	296	362	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.70	100.00					8.41	1.24	205	239	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 5	29/11/16		101.15	101.50	101.15	-0.16	3	4 801	8.42	1.43	202	243	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		99.74	100.00					8.15	0.95	187	207	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.82	99.71					8.94	1.30	256	293	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		93.15	95.40					8.56	2.17	204	269	1 000
Коми Респ 10	15/12/16		86.00	101.25					9.13	2.21	260	326	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.51	104.00					8.77	2.46	221	291	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12		100.05	100.07	100.07		10	32 179	7.41	0.04			3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.45	100.65	100.60		3	605	9.47	1.77	301	355	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		103.00	103.20	103.20	0.01	11	14 034	9.51	2.18	299	364	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.60	101.90	101.60	-0.20	2	8	9.04	1.66	259	309	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		100.11	100.50					7.99	0.44		176	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.00	99.85					7.88	1.05	157	182	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.50	101.75					8.74	2.12	222	287	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		99.20	99.60	99.70		1	260	8.60	1.48	219	262	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12		99.90	100.17					5.15	0.04			2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13		102.81	103.80					7.68	0.96	139	160	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16								8.65	1.69	220	271	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6	12/06/14								8.86	0.68	267	272	3 000
Тверская Обл 5	26/12/13		106.40	106.90	106.40	0.40	3	26	8.96	0.97	267	288	4 000
Тверская Обл 7	15/12/15		98.35	98.55					9.43	2.37	288	357	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



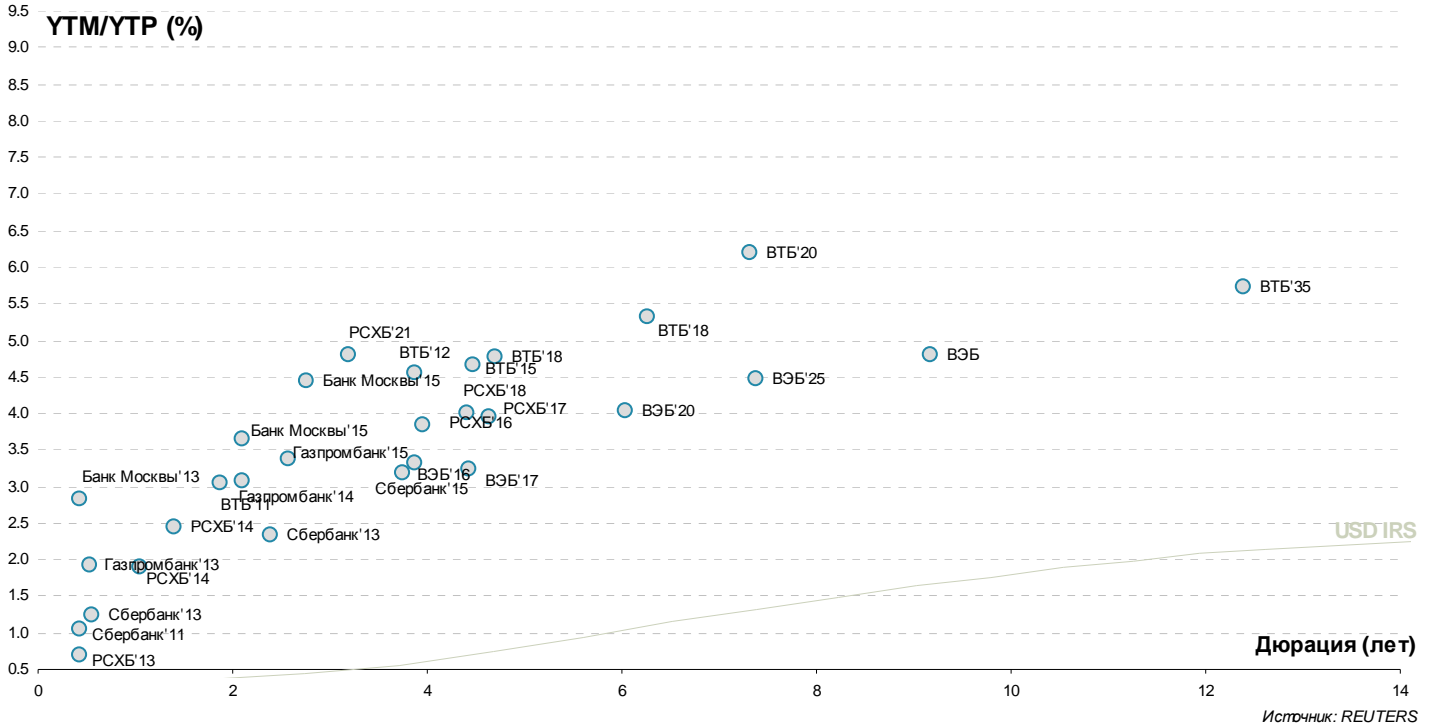
Результаты торгов евробондами

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		106.000	106.275	1.08	0.97	2.31	-0.07	70
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.847	106.139	1.84	1.77	4.06	-0.19	123
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.528	149.972	2.03	1.67	4.48	-0.11	121
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.788	127.039	2.81	2.77	5.44	-0.31	154
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.050	117.450	2.46	2.41	6.35	-0.19	130
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		113.447	114.079	2.85	2.78	7.79	-0.30	138
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		199.639	200.861	4.05	3.98	9.20		217
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		124.150	124.650	4.19	4.16	16.04	-0.57	184
ГОСКOMPАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.133	101.152	1.46	1.41	0.37	-0.01	116
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.473	101.770	1.59	0.80	0.37	0.53	130
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		102.020	102.038	1.43	1.38	0.34	-0.01	114
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.851	104.000	1.50	1.28	0.63	-0.01	119
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.188	110.938	2.51	1.96	1.21		220
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		109.405	110.155	2.83	2.26	1.17		253
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.058	110.058	2.47	1.89	1.54	0.02	214
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.994	107.440	2.63	2.48	2.81	0.02	222
GAZPR'16 4.95%	USD	23/05/16		106.856	107.856	2.86	2.56	3.23	-0.02	239
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.892	112.488	3.00	2.85	3.59	-0.02	247
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.678	123.503	3.46	3.31	4.50	-0.30	271
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.927	131.426	3.75	3.68	5.12	-0.30	283
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.481	111.803	3.26	3.16	2.87	0.10	254
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.571	118.993	4.08	4.03	7.20	-0.16	269
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		106.500	107.250	4.12	4.03	7.70		264
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		142.847	143.361	5.26	5.23	11.79	-0.12	317
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.813	129.329	5.20	5.17	13.04	-0.09	301
Газпром нефть										
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		101.282	101.684	4.21	4.16	8.01	0.41	270
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		103.968	105.968				-0.02	
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.080	105.400	1.53	1.28	1.21		121
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		129.164	129.466	3.06	3.01	4.64	-0.17	224
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.885	111.348	3.03	2.92	3.88	-0.01	245
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		111.954	112.954	4.14	4.02	7.43	-0.30	273
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		99.980	100.406	5.38	5.28	4.34	0.26	474
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.099	107.497	3.16	2.98	2.10	0.10	281
VTB'17 6%	USD	12/04/17		105.500	105.875	4.59	4.50	3.87		403
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		107.072	108.072	4.76	4.56	4.47	0.11	406
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		109.794	110.294	4.82	4.72	4.69	-0.06	407
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		107.676	108.181	5.34	5.26	6.28	0.08	419
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		105.264	105.641	6.23	6.18	7.31	-0.12	483
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.392	106.788	5.74	5.71	12.39	-0.16	360
VTB' 9.5%	USD			105.110	105.695	8.72	8.64	6.76	0.69	747
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		101.772	102.072	3.17	2.49	0.43	-0.36	289
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.058	107.058	3.87	3.43	2.11	-0.07	354
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		104.000	104.350	4.51	4.39	2.76	0.25	412
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.440	101.440	5.90	5.65	3.94	-0.06	537
ВЭБ										
VEB'17 5.375%	USD	13/02/17		108.224	108.724	3.26	3.13	3.76	-0.18	269
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.625	110.500	3.33	3.15	4.43	0.06	264
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.296	118.798	4.07	4.00	6.04	0.12	293
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		111.625	112.625	4.52	4.40	7.39	0.25	308
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		118.850	119.349	4.83	4.78	9.18	0.30	305
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.244	103.394	2.06	1.79	0.54		176
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.097	106.347	3.12	2.99	1.88	0.01	278
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.097	108.446	3.43	3.31	2.58	0.02	305
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.590	111.761	3.67	3.62	3.05	-0.01	320
GAZPROMB'17 5.625%	USD	17/05/17		105.254	105.460	4.31	4.26	4.00	0.25	373
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		106.729	107.278	5.97	5.87	5.25	-0.02	508
GPB EURO' 7.875%	USD			100.974	101.625	7.65	7.50	4.46	0.13	701
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.331	103.377	1.85	-0.45	0.44	-0.03	155

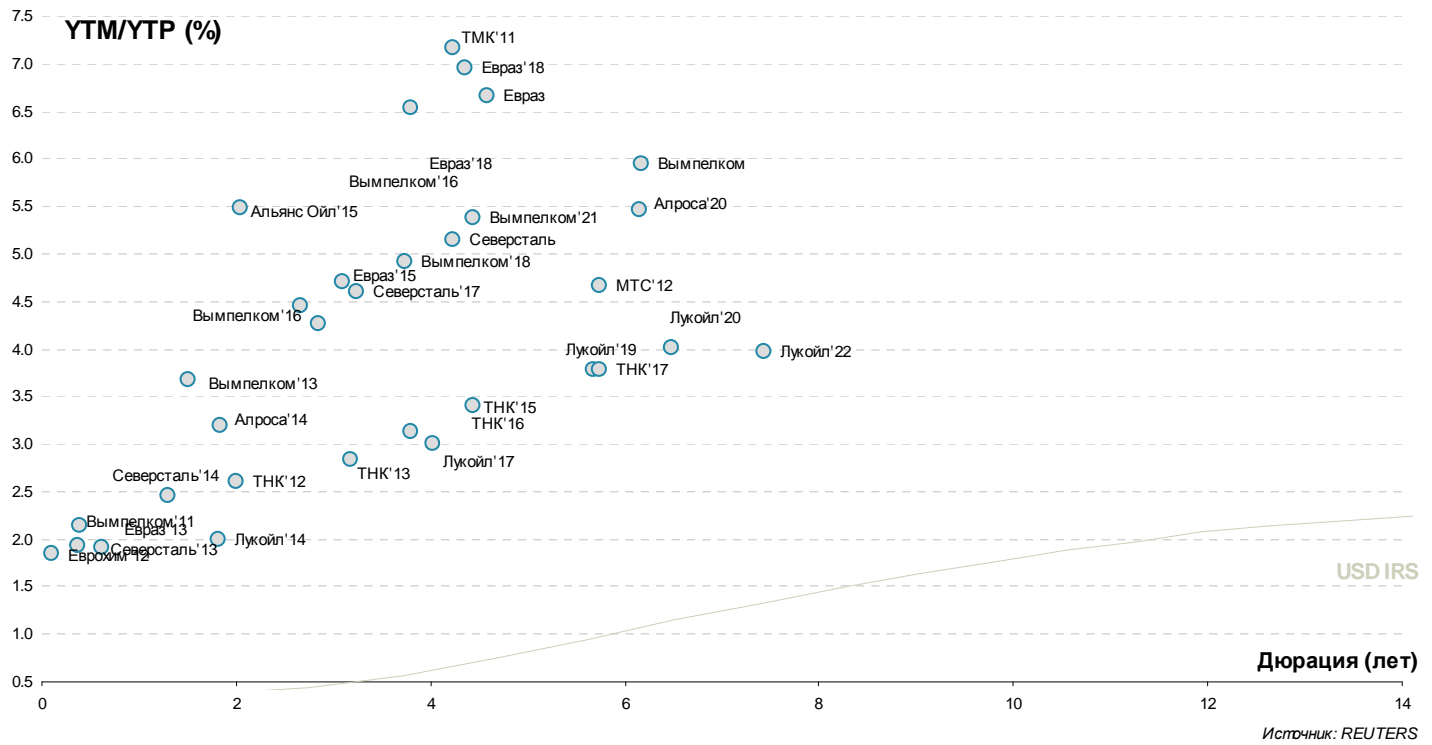
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.419	105.916	2.12	1.69	1.05	-0.01	181
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		109.439	109.935	2.59	2.27	1.39	-0.01	227
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		109.735	110.134	3.89	3.80	3.96	-0.02	330
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		105.713	105.947	4.04	3.99	4.42	-0.04	334
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.253	118.755	4.01	3.91	4.65	-0.03	324
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		103.740	103.903	4.82	4.77	3.20	-0.01	440
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		102.295	102.445	1.22	0.88	0.44	0.07	91
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		102.832	103.073	1.45	1.04	0.55	-0.01	115
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.726	108.126	2.40	2.24	2.40	0.15	201
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.018	108.519	3.38	3.26	3.87	-0.06	280
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		106.056	106.806	3.38	3.19	3.77	-0.07	282
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		106.503	106.800	4.04	3.99	5.56	0.38	306
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		108.792	109.792	4.47	4.33	6.78	0.02	317
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		112.035	113.035	4.51	4.38	7.16	-0.05	313
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		100.781	101.169	5.02	4.97	7.85	0.16	354
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.370	102.870	2.56	1.28	0.38	0.28	228
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.953	110.674	4.57	4.32	2.66	0.01	420
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		102.820	103.595	6.64	6.44	3.80	-0.04	615
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		110.925	111.673	7.02	6.87	4.36	-0.12	638
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.140	100.587	6.72	6.62	4.58	0.26	604
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		103.120	103.620	5.54	5.38	3.22		511
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		99.764	100.049	4.99	4.94	5.80	-0.07	398
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		108.710	109.730	5.71	5.25	2.05	0.96	540
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.395	110.870	3.31	3.07	1.83		298
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.316	114.813	5.49	5.42	6.16	-0.06	435
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.365	102.525	2.35	1.95	0.40	0.04	205
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.889	102.222	4.44	2.91	1.51	0.11	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.480	106.480	4.27	4.27	2.85		386
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		110.940	111.429	4.78	4.64	3.10	-0.17	436
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		104.520	105.520	5.05	4.80	3.74		452
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.075	117.567	5.43	5.33	4.44	0.03	472
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		111.060	112.060	6.01	5.86	6.17	0.16	484
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		109.550	109.950	6.13	6.08	6.83		483
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		107.916	108.416	2.13	1.87	1.82	-0.13	177
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.841	114.293	3.04	2.94	4.02	-0.02	243
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.723	121.225	3.81	3.74	5.67	0.06	278
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.996	114.498	4.04	3.97	6.48	0.08	284
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.724	121.602	4.01	3.91	7.43	0.13	259
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		124.708	125.215	4.70	4.63	5.74	-0.27	360
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.567	106.722	3.12	3.07	2.91		270
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.483	117.863	4.06	4.01	6.47	0.10	282
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		104.732	105.261	2.30	1.51	0.62	-0.04	201
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		108.992	109.135	2.51	2.41	1.31	-0.01	220
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		104.956	105.956	4.75	4.46	3.25	-0.15	430
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.369	106.857	5.20	5.10	4.24	-0.24	457
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		98.263	98.807	6.14	6.06	7.54	0.11	471
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.248	102.678	7.22	7.12	4.23	-0.03	661
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		103.646	104.029	6.77	6.67	3.79	-0.14	628
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		101.631	104.631				-0.10	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.325	107.870	2.72	2.47	2.01	0.01	236
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.484	116.418	2.95	2.70	3.19	0.01	247
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		113.391	114.468	3.25	3.00	3.79	-0.22	268
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.038	121.844	3.47	3.32	4.44	-0.31	273
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.044	122.090	3.86	3.71	5.74	-0.28	279
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		103.445	103.695	2.86	2.41	0.53	-0.03	257
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.109	108.597	4.23	4.01	2.11	0.01	390
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.745	100.110	6.37	6.27	3.70	0.56	588
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		110.644	111.644	5.33	5.11	4.08	-0.11	472

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

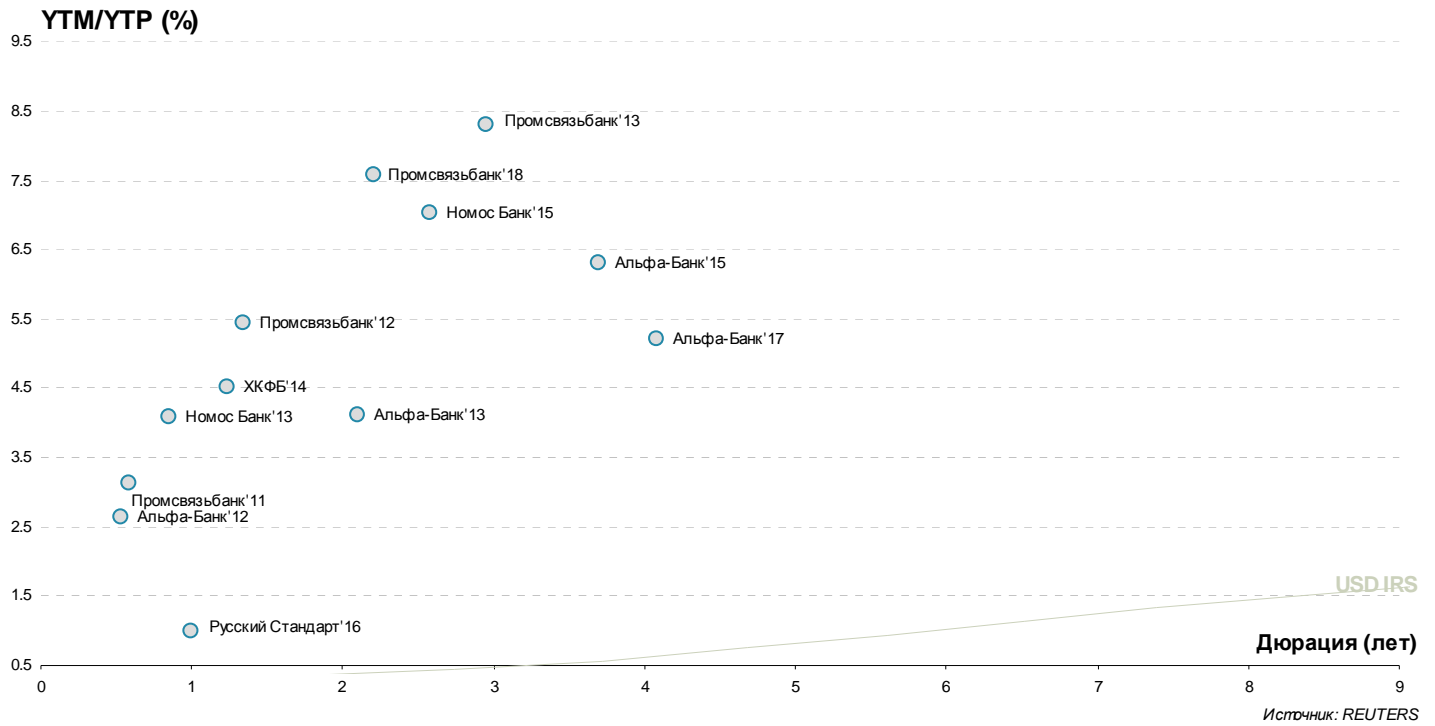
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
 Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
 Максим Симагин
 Александр Валканов
 Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Макроэкономика
 Макроэкономика/кредитный анализ
 Кредитный анализ
 Количественный анализ
 Акции

Акции
 Облигации

Владимир Евстифеев
 Кирилл Сычев
 Евгений Чердаков
 Дмитрий Чепрагин
 Евгения Лобачева

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

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.