

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки сдержанно реагируют на ЕЦБ в ожидании данных из США и Китая

Российский долговой рынок /стр. 4/

- Спрос на евробонды ослаб
- Рынок остался на месте

Первичный рынок /стр. 5/

Приложения

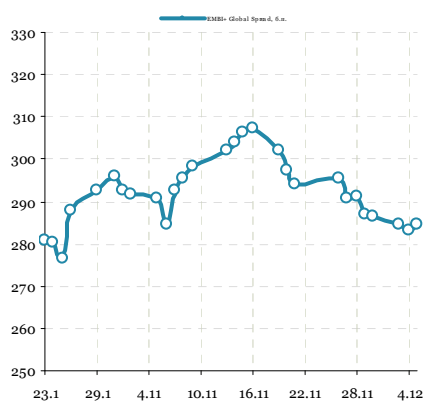
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 6/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.59	▼ -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

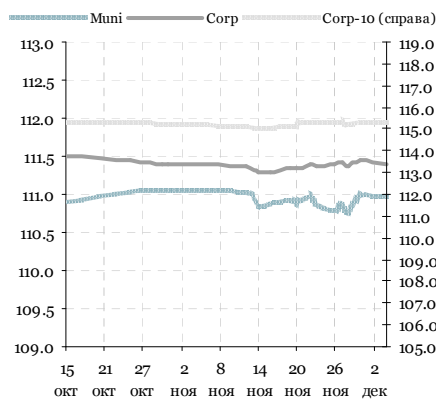
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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

ОАО «НОВАТЭК» разместило десятилетние евробонды на 1 млрд долл. со ставкой купона в размере 4,422% годовых. /Финам/

ООО «ВТБ Капитал Финанс» планирует 11 декабря открыть книгу заявок инвесторов на облигаций 5-й серии объемом 1 млрд руб. /Интерфакс/

ОАО «НК «Роснефть» и ExxonMobil подписали соглашение о создании СП, в котором «Роснефти» будет принадлежать 51%, а ExxonMobil - 49%, для опытной разработки месторождений в Западной Сибири. Работы будут вестись на принадлежащих «Роснефти» 23 лицензионных участках общей площадью более 10 тыс. кв. км. ExxonMobil предоставит финансирование в размере до 300 млн долл. на реализацию программы опытных работ, а также современные технологии и специалистов проектирования и заканчивания скважин. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 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, регр (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.)

Сегодня: 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.)

10.12.2012 – понедельник

Статистика Китая: Trade balance,
Exports, Imports

- Выплата купона: Москва, 62 (13%, 1.1 млрд руб.), РосДорБанк, 01 (11.5%, 60.5 млн руб.), Газпромбанк, БО-01 (7.75%, 388.6 млн руб.), ГЛОБЭКСБАНК, БО-03 (9%, 135.3 млн руб.), ГЛОБЭКСБАНК, БО-05 (9%, 90.2 млн руб.), Газпромбанк, 2013-2, CHF (LPN) (4.375%, 18.3 млн швейцарских франков), Альфа-Банк, 2015 (LPN) (10.125%, 11.4 млн долл.), Газпром, 2012, EUR (LPN4) (4.56%, 45.6 млн евро), РЖД, 16 (7.9%, 590.8 млн руб.), Москва, 63 (15%, 561 млн руб.), ФСК ЕЭС, 18 (8.5%, 635.7 млн руб.)
- Оферта: Промнефтесервис, 01 (3 млрд руб.), СКБ-банк, БО-04 (2 млрд руб.)
- Погашение: Газпром, 2012, EUR (LPN4) (1 млрд евро)
- Размещение: АгроКомплекс, БО-01 (1 млрд руб.)

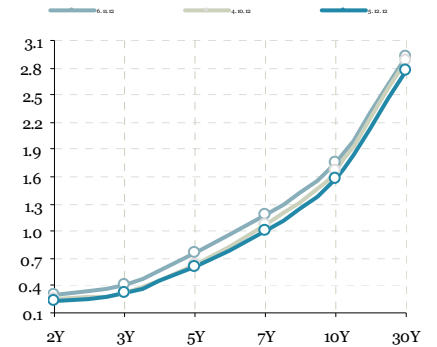
Внешний рынок долга

Рынки сдержанно реагируют на ЕЦБ в ожидании данных из США и Китая

Рынки провели четверг на траектории инерционного роста, фокусируясь на событиях предстоящего уикенда. Ключевым событием дня стало заседание ЕЦБ по ставке, которое, впрочем, не преподнесло сюрпризов. Ставка ожидаемо была сохранена, а прогнозы роста и инфляции – снижены. Регулятор признал неотвратимость рецессии в 2013г. и отнес ожидания восстановления ближе к концу следующего года. Итоговая пресс-конференция М.Драги тоже не дала новостей в части ключевых вопросов реализации ОМТ – все вводные параметры программы сохранены. Фондовые рынки не отреагировали на итоги заседания ЕЦБ: европейские индексы завершили день ростом в среднем более 50 бп. Более логичные движения были на форексе и долговых рынках: котировки евро опустились вниз более чем на фигуру – в район отметки \$1.2950, а доходности дальних облигаций стран южной Европы прибавили 15-20 бп. Ожидания на выходные скорее позитивны: сегодня будет опубликован ноябрьский отчет по рынку труда США, который, учитывая текущий скромный консенсус, вряд ли разочарует рынки. В воскресенье выходит большой блок данных по экономике Китая, включающий ценовые индексы, показатели промпроизводства, инвестиций, розничных продаж, которые способны подтвердить наметившееся ускорение экономики.

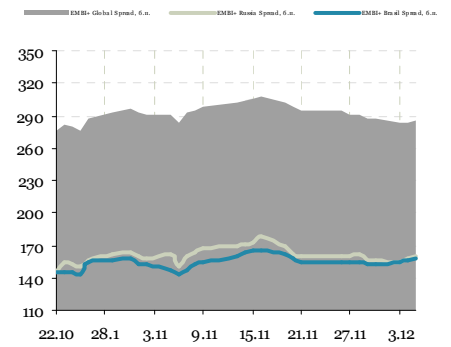
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Кривая US Treasures



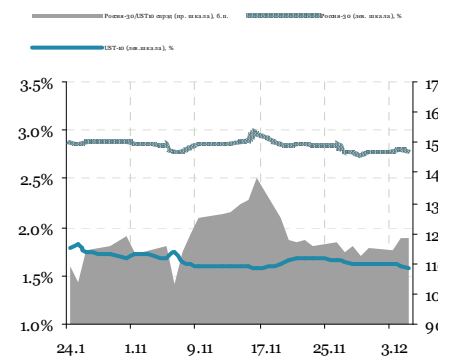
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



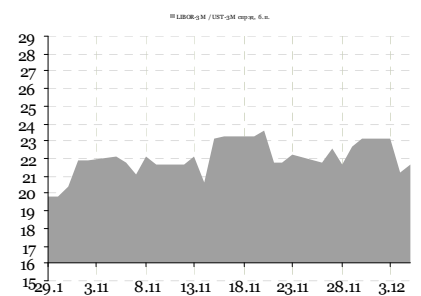
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Спрос на евробонды ослаб

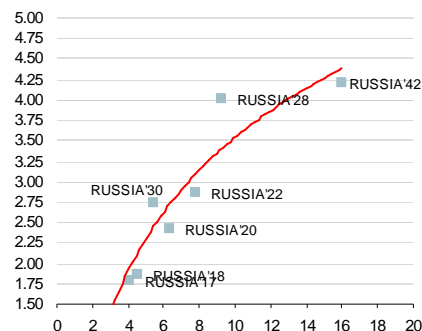
В четверг спрос в российском сегменте несколько ослаб. Цены вдоль суверенной кривой теряли до 20 бп, по-прежнему слабо выглядел дальний RUSSIA'42, потерявший к концу дня более 50 бп. Корпоративный сектор также торговался преимущественно вниз. Дальние выпуски Газпрома потеряли в ценах более 50 бп, среди частных компаний порядка 40 бп потеряли в ценах выпуски НОВАТЭК'22 и суборд Промсвязьбанк'15.

Рынок остался на месте

Рынок рублевого долга провел четверг бездейно. Активность в ОФЗ существенно снизилась, котировки по основной части бумаг простояли на отметках среды. Слабее рынка на среднем участке кривой выглядел выпуск 25080, к концу дня потерявший в ценах порядка 25 бп, на дальней дюрации продолжил дешеветь дальний 26207, потерявший 30 бп и опустившийся ниже отметки 111%. В корпоративном секторе активность была сосредоточена в выпусках Алросы и Новатэка, завершивших день минимальными ценовыми изменениями.

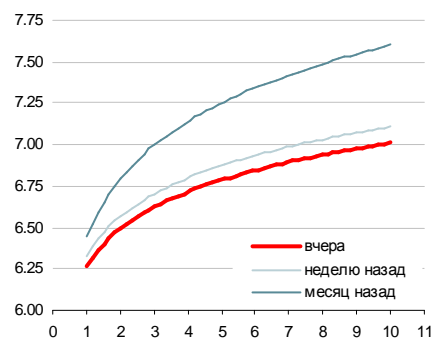
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



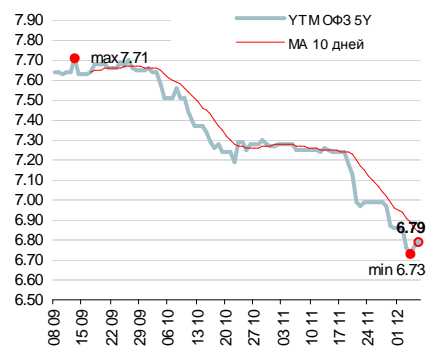
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



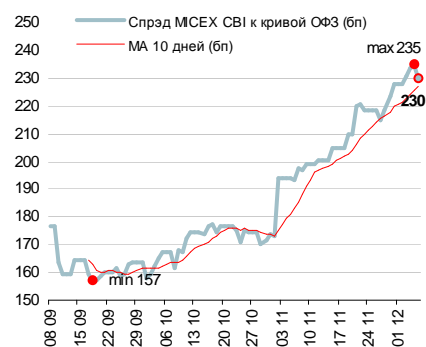
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



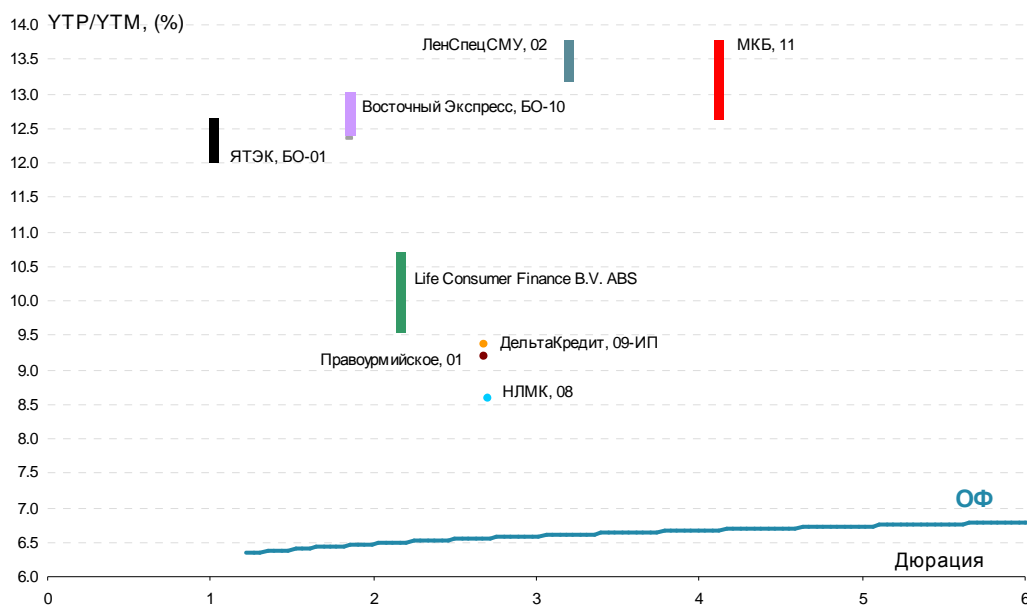
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
АгроКомплекс, БО-01	NR	нет	1 000	н/д	Конкурс	10.12.2012	н/д	н/д / 3 г.
Правоурмийское, 01	NR	нет	3 000	9.20	06.12.2012	11.12.2012	нет / 2.68 г.	3 г. / 7 лет
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	100.15	100.18	100.18	0.01	38	160 212	5.76	0.13			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.12	100.13	100.13	0.02	22	432 309	5.92	0.17			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.70	101.97	101.85	-0.14	2	5 800	5.94	0.30			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.10	100.19					5.89	0.60			50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.40	100.59	100.42	0.02	5	766	6.18	0.84	14		47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.90	100.98	100.98	0.02	10	110 865	6.37	1.22	4	38	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.91	109.20	109.20	0.20	3	300 400	6.31	1.55		38	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.14	109.15	109.15	0.04	1	205	6.51	1.81	5	63	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.02	103.40	103.02	-0.07	2	20	6.55	1.86	8	68	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.15	101.30	101.20	0.18	1	200 000	6.57	2.33	3	75	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	100.00	101.10	101.10	0.25	8	3 356	6.51	2.37		69	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	100.50	102.35					6.63	2.78	3	83	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.00	99.19	99.10	-0.05	3	10 700	6.80	2.86	19	100	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	100.00	101.10	101.10	0.10	1	1	6.66	3.23	1	87	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	99.00					6.60	3.49		81	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.57	3.43	91	178	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.14	103.35	103.25	-0.25	28	700 221	6.64	3.79		84	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.00	103.30	103.00	-0.45	7	28 011	6.73	3.81	3	93	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.19	104.40	104.30	0.01	1	1	6.63	4.41		81	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	84.10	94.10					7.27	4.45	52	144	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	98.20	102.10	98.10	-3.65	2	3 000	7.56	4.56	80	173	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	104.24	104.45	104.24		4	22	6.77	5.03		91	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							8.01	5.50	119	209	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	97.00	98.00	97.40	-1.60	4	31 505	7.27	6.25	41	126	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	105.24	105.45	105.45	0.10	1	10	6.85	6.35		83	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	105.44	105.60	105.55	0.10	4	1 045	6.92	6.90	3	82	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	82.10	92.20					7.16	7.36	25	100	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	110.58	110.80	110.70	-0.30	33	361 012	7.07	8.76	10	73	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	93.75	98.55	94.45	-0.05	2	2	7.55	11.17	51	90	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.55	11.10			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	95.01	99.80					7.43	0.63	131	134	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО1		04/12/12							-4.42	0.00			5 000
----------	--	----------	--	--	--	--	--	--	-------	------	--	--	-------

НЛМК ВО6		05/03/13	100.10	100.30					7.39	0.24		113	10 000
----------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	--------

НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.55	100.56	100.56	0.01	1	10 000	7.80	0.51	175	167	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.55	100.56					7.82	0.51	177	169	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15							8.21	1.64	178	230	5 000
----------	----------	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

НЛМК ВО7		11/11/14	101.07						8.37	1.81	191	249	10 000
----------	--	----------	--------	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.15	100.25	100.19	0.06	1	10 000	8.57	2.08	207	273	5 000
--------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.95	100.00	99.97	-0.01	5	52 103	7.84	0.33		162	8 000
---------	--	----------	-------	--------	-------	-------	---	--------	------	------	--	-----	-------

ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.04	100.07	100.05		7	69 627	8.25	0.67	211	218	5 000
---------	----------	----------	--------	--------	--------	--	---	--------	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО4		27/02/14	99.25	99.37	99.39	0.06	1	2	8.33	1.17	201	233	5 000
---------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	---	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО6		10/07/14							8.96	1.49	256	302	5 000
---------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО7		22/07/14	94.00						8.80	1.52	240	287	5 000
---------	--	----------	-------	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.38	100.50	100.50	0.04	6	5 942	7.14	0.19		88	10 000
--------------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	-------	------	------	--	----	--------

Севсталь ВО4		15/02/13	100.39	100.44					7.56	0.19		130	5 000
--------------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	-------

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.21	100.23	100.23		11	188 012	8.05	0.53	198	193	8 000
-----------	----------	----------	--------	--------	--------	--	----	---------	------	------	-----	-----	-------

Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.23	100.27	100.23	-0.02	15	150 980	8.06	0.54	199	194	8 000
-----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	----	---------	------	------	-----	-----	-------

Алроса 23		18/06/15	100.65	100.85					8.92	2.25	239	309	7 000
-----------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Алроса 20		23/06/15	100.65	100.90					8.92	2.27	239	309	3 000
-----------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО1		30/10/15	100.25	100.50	100.35		6	151 065	9.00	2.57	243	319	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	--	---	---------	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО2		30/10/15	100.25	100.35	100.35		10	150 520	9.00	2.57	243	319	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	--	----	---------	------	------	-----	-----	-------

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.00	100.44	100.35	0.10	1	550	8.09	0.29		185	10 000
---------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	-----	------	------	--	-----	--------

Евраз 3	22/03/13	13/03/20	98.06	100.40	100.42	2.40	1	1	7.83	0.29		159	5 000
---------	----------	----------	-------	--------	--------	------	---	---	------	------	--	-----	-------

Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.60	107.85					9.09	1.69	265	319	10 000
----------------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.63	107.75					9.09	1.69	265	319	10 000
----------------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

Евраз 2	26/10/15	19/10/20	101.41	102.24	102.25	0.65	2	117	9.24	2.56	267	343	10 000
---------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	-----	------	------	-----	-----	--------

Евраз 4	26/10/15	19/10/20	100.00	102.20	101.00	-0.65	1	10 000	9.77	2.56	320	396	5 000
---------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Евраз 5	06/06/16	27/05/21	90.00	98.99	96.02	-0.01	1	2	10.01	3.10	338	422	5 000
---------	----------	----------	-------	-------	-------	-------	---	---	-------	------	-----	-----	-------

Евраз 7	02/06/16	25/05/21	90.02	96.45					12.35	3.09	572	656	15 000
---------	----------	----------	-------	-------	--	--	--	--	-------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.75	100.15	100.11	0.11	2	40	9.13	2.07	263	329	5 000
-----------------	----------	----------	-------	--------	--------	------	---	----	------	------	-----	-----	-------

Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.75	100.10	100.05	0.05	3	6 721	9.17	2.07	267	333	10 000
-----------------	----------	----------	-------	--------	--------	------	---	-------	------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.98	100.20					9.19	2.08	269	335	10 000
-----------------	----------	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

Мечел

Мечел ВО2		12/03/13	99.69	99.99	99.80	0.10	15	18 641	10.69	0.26		444	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	98.50	100.20	100.19	0.19	2	11	11.11	0.35		490	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	99.01	99.45	99.44	0.44	4	350	11.54	0.38		535	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13	97.22	97.99	97.05	-0.85	2	39 804	13.97	0.50		783	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	98.82	100.00	99.50		1	5	12.62	0.61	651	653	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	95.30	95.97	95.30	-0.19	4	85	15.22	1.11	892	921	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	91.80	92.20	92.00	-0.60	1	1 649	16.40	1.14	1009	1 040	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	91.80	92.00	92.00	1.00	9	55 637	16.40	1.14	1009	1 040	5 000
Мечел ВО5		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	598	5 000
Мечел ВО7		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	598	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.81	2.22	528	598	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	100.00						11.81	2.22	528	598	3 000
Мечел ВО6		07/04/15	99.50						11.55	2.08	505	571	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	88.00	89.75					16.12	2.39	957	1 030	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	85.03	88.95					20.68	2.38	1413	1 486	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	80.13	83.00	83.00		1	1	15.36	3.05	873	957	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.38	87.47					15.18	3.06	855	939	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21							16.02	2.91	941	1 023	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.71	100.00					9.02	0.85	280	298	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.30	100.46	100.42		5	85	8.75	0.56	267	264	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.10	98.40					13.96	0.96	771	793	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.72	93.77	93.77	2.07	6	10	14.22	1.43	784	827	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12							-43.44	0.00			5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.12	97.90	97.76	-0.33	2	32	10.64	1.41	426	469	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.25	93.30	93.27	0.20	34	58 255	14.92	1.18	860	892	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	87.80	88.75	88.75	0.74	3	610	14.78	2.15	827	895	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД ВО01		05/12/12							-4.76	0.00			15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.60	99.84	99.60	-0.20	2	21	7.48	0.92	124	145	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.85	109.09	108.85	0.05	5	15 604	7.54	1.15	123	154	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.20	102.48	102.45	-0.06	1	2	7.88	1.95	140	203	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.60	99.90	99.80	0.10	3	1 299	8.03	2.68	144	222	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17							8.24	3.01	162	245	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.85	100.15					8.29	4.48	154	246	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.75	100.20	99.75	-0.20	2	1 987	7.60	0.79	141	156	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.75	99.99					7.39	0.79	120	135	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23							8.08	1.39	171	212	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.00	101.59					7.97	1.76	152	208	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.00	100.60					8.34	2.19	182	251	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.00	99.71	99.00	-0.17	1	23	8.31	2.53	174	250	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.30	98.70					8.17	2.63	159	236	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	96.01	99.80					8.33	2.99	171	254	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.85	101.25	101.05	-0.30	2	2	8.44	3.28	179	265	15 000
ФСК ЕЭС 21	19/04/17	06/10/27							8.60	3.69	191	280	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	98.00	98.50	98.15	-0.30	1	1	8.64	4.10	192	283	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	98.00	98.70					8.56	4.09	184	275	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	97.00	98.50					8.70	4.48	195	287	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	99.25	99.42	99.25	0.42	1	45 000	8.81	6.02	196	284	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	99.07	100.60					8.85	2.19	233	302	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16	101.50	102.50					9.67	3.22	303	388	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.51	101.90	99.08	-0.78	6	110	10.30	0.91	406	426	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15	85.00						9.40	2.59	282	359	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	99.00					9.38	3.01	276	359	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.20	3.01	258	341	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32	86.00						9.31	3.51	264	351	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.65	3.52	298	385	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	85.00	100.30					9.66	3.49	299	387	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16							8.06	1.24	172	208	7 000
Почта России 2	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	308	00000 000
Почта России 3	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	308	00000 000
Почта России 4	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	230	308	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		99.61					7.58	1.13	127	158	5 000	
Газпром А11		24/06/14		109.15	110.00	109.13	-0.07	1	1	7.53	1.38	116	157	5 000
Роснефть														
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22	101.15	101.25	101.25	0.01	14	1 516	8.45	4.06	173	265	10 000	
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.15	101.30	101.22	-0.28	13	50 001	8.46	4.06	174	266	10 000	
Лукойл														
Лукойл БО-6		13/12/12							9.18	0.02			5 000	
Лукойл БО-7		13/12/12							-1.19	0.02			5 000	
Лукойл 4		05/12/13	100.01	101.00	100.05	-0.05	1	800	7.48	0.98	122	145	6 000	
Газпром нефть														
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	99.20	101.00	101.00	2.49	3	4	-7.73	0.11			8 000	
Газпром нефть БО-5		09/04/13	100.00	100.50					7.27	0.34		105	10 000	
Газпром нефть БО-6		09/04/13	99.05	100.30					7.27	0.34		105	10 000	
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.55	101.60	100.75	0.20	2	178 100	8.01	1.97	152	216	10 000	
Газпром нефть 8		02/02/16	100.50	101.50	100.50	-0.20	1	14	8.48	2.76	188	268	10 000	
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.40	101.47	100.50	-0.20	1	14	8.48	2.78	188	268	10 000	
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.05	104.99					8.53	4.15	180	272	10 000	
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	97.50	99.99					9.11	4.38	237	329	10 000	
НОВАТЭК														
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	89.95	100.20					7.53	0.53	146	141	10 000	
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	99.75	100.60	100.40	0.12	15	195 001	8.35	2.57	178	254	10 000	
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.60	100.40	0.05	11	20 000	8.35	2.57	178	254	5 000	
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75	100.60	100.40	0.10	11	20 000	8.35	2.57	178	254	5 000	
ТАТНЕФТЬ														
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40	99.90	99.86	-0.05	6	84	7.55	0.77	136	151	5 000	
Башнефть														
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.01	100.13	100.10	-0.01	6	77	9.33	0.03			15 000	
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.00	100.18	100.13	-0.02	3	46 290	8.39	0.03			15 000	
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.00	100.15	100.12	-0.03	10	68 769	8.70	0.03			20 000	
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.01	101.30	101.29	-0.01	4	4	8.14	0.98	188	211	10 000	
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.05		101.30	0.15	3	1 202	8.50	1.99	201	266	10 000	
НК Альянс														
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	100.00	100.20	100.20	0.30	1	2 895	9.61	0.62	349	352	5 000	
НК Альянс БО-1		04/02/14	99.01	99.25	99.21	0.05	7	235	10.21	1.10	391	420	5 000	
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21							10.78	2.95	416	499	5 000	
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	95.02	98.99					10.78	2.95	416	499	7 000	
Сахатранснефтегаз														
Сахатрнф2		26/07/13	99.65	99.90	100.00	0.20	15	3 364	12.51	0.61	640	641	3 000	
БК Евразия														
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.61	3.02	299	382	5 000	
ГОСБАНКИ														
ВТБ														
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.41	100.50	100.60	0.10	3	201	7.71	0.58	162	160	15 000	
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.02	100.05	100.02		22	54 150	8.17	0.04			10 000	
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.02	100.10	100.00		6	5 550	8.15	0.14		188	10 000	
ВТБ БО-1		15/03/13	99.92	100.08					7.82	0.27		157	5 000	
ВТБ БО-2		15/03/13	99.92	100.09					8.41	0.27		216	5 000	
ВТБ БО-5		15/03/13	100.00	100.10					7.86	0.27		161	10 000	
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.00	100.17					7.86	0.73	169	181	10 000	
ВТБ 5		17/10/13	99.55	99.99					7.60	0.84	139	156	15 000	
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	99.50	100.20					8.16	1.21	183	217	5 000	
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.50	100.15	100.10		8	29 150	8.16	1.21	183	217	5 000	
ВТБ БО-19		01/10/15	100.00	100.25					8.68	2.50	212	287	15 000	
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.50	212	287	15 000	
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.50						8.04	0.48		189	6 000	
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14							8.92	1.83	246	305	15 000	
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	99.99	100.09	100.09	0.05	3	4 124	8.20	0.69	205	213	8 000	
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.60						8.34	0.09		207	10 000	
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16							8.44	0.23		218	5 000	
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					7.66	0.39		147	5 000	
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.20	0.77	201	216	8 000	
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16							7.94	0.62	183	185	5 000	
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	99.75					7.45	0.98	119	142	5 000	
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50	99.80		2	200	8.58	1.25	224	260	5 000	
ВЭБ														
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.00	100.00					7.25	0.86	103	121	15 000	
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.15	100.70					8.21	2.07	171	237	15 000	
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.00	101.00					8.29	2.55	172	248	10 000	
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.00	101.25					8.31	2.57	174	250	10 000	
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.75	99.00					8.55	2.92	194	276	15 000	
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.29	202	288	15 000	
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.30	98.75	98.30	-0.10	1	10	8.50	4.09	178	269	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	98.29	99.40					7.68	1.29	133	171	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	100.83					8.53	1.77	208	265	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.75	101.25	100.85	0.10	6	34 694	8.47	1.78	202	259	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	87.00	101.50					8.80	1.89	233	294	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		99.70	99.70	0.10	1	1 220	8.89	2.94	228	310	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	100.00	99.70	0.70	1	2 395	8.89	2.94	228	310	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.40	101.20					8.49	1.24	215	251	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22		101.00	100.75	0.05	1	1	8.89	1.58	247	297	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.90	100.15					8.51	1.40	213	256	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	100.02	100.75					8.56	1.40	218	261	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.00	100.30	100.17		1	226	8.01	0.17	175	175	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.00	100.20	100.25	0.15	2	1 501	7.55	0.17	129	129	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18							7.59	0.50	145	145	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.00	100.25	100.25		2	2	7.93	0.65	180	185	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.00		99.88	-0.22	1	1	8.53	0.65	240	245	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.15	100.20	100.10	1.89	1	6	8.29	0.71	213	223	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.15	100.20	100.15	0.15	14	23 258	8.22	0.71	206	216	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	87.00						6.96	0.80	76	92	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	97.03	100.24					8.10	0.88	187	206	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.25	100.65	100.64	0.19	8	25 001	8.16	0.89	193	212	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.29	101.00	-0.35	8	52 070	8.50	1.12	219	249	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.01	100.50					8.19	1.58	177	227	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.74	100.00	-0.10	1	1	8.52	1.76	207	264	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.19	100.00	-0.10	2	10 400	8.52	1.76	207	263	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.15	100.45					8.55	2.16	203	272	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.15	98.50					8.69	2.32	215	287	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.15	98.75					8.69	2.32	215	287	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.15	98.50					8.68	2.33	214	286	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.00	100.02	100.02	0.62	1	1 000	8.15	0.05			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.20	99.32	99.30	-0.02	1	6	8.06	0.61	195	196	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13							7.90	0.95	165	187	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.30	100.70	100.45	0.01	1	3 000	8.24	1.10	194	223	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.80	100.99	100.90	0.09	5	50 003	8.40	1.48	201	246	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16	85.00						8.68	2.71	209	288	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	100.00		100.00		15	1 200	8.67	2.58	210	286	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	100.00		100.00		16	1 500	8.67	2.58	210	286	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	100.00		100.00		18	6 718	8.67	2.58	210	286	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30	99.60					8.06	1.05	178	204	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43	86.00						8.44	1.64	201	253	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.40					8.07	1.77	162	219	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.60					8.50	1.79	204	262	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.41	2.24	188	258	6 000
АИЖК А8		15/06/18	96.48	98.54					8.35	2.65	177	254	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.00	99.75					8.66	2.94	204	287	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	100.50					8.61	2.94	199	282	7 000
АИЖК А21		15/02/20	100.00	101.50					8.92	3.12	229	313	15 000
АИЖК А11		15/09/20	97.10	99.25	99.24	-0.40	23	347	8.67	3.70	198	287	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.90	100.00	97.90	-0.09	5	198 780	8.98	4.84	220	313	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					9.06	5.43	225	315	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	193	259	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	0.94	273	295	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13							9.10	0.94	285	307	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14		99.80					9.62	1.52	322	369	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.52	312	359	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	86.00	100.07					8.09	0.20		183	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.45	100.25	100.29	0.40	2	2	7.57	0.66	143	149	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.11	99.85					8.12	0.93	188	209	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.00					8.42	1.30	207	245	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17							8.54	2.63	196	273	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.15	100.60	100.15	0.15	5	6 579	7.85	0.52	179	172	10 000
МТС 1		17/10/13	93.47	99.99	99.50	-0.25	5	161	7.74	0.85	152	170	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	98.80	99.24	99.22		2	194	8.14	1.36	177	218	15 000
МТС 2		20/10/15	98.10		98.25		3	170	8.62	2.60	204	281	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	99.20	99.60	99.21	-0.09	2	12 000	8.64	2.65	206	283	15 000	
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.70	100.50	99.25	0.01	1	19	8.97	3.16	233	318	15 000	
МТС 7		07/11/17	99.60	99.70					8.98	4.08	226	317	10 000	
Вымпелком														
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.68	100.80	100.68	0.66	2	40 560	8.23	0.59	213	213	10 000	
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.79	98.79	98.60		3	10 055	8.53	1.48	213	259	10 000	
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.75	100.20	100.07	-0.03	6	5 002	9.00	2.09	249	316	10 000	
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	100.00	100.20	100.00		2	6 030	9.03	2.07	253	319	10 000	
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.75	100.15	100.05	0.05	5	1 895	9.01	2.07	251	317	15 000	
Вымпелком 6		13/10/15	97.51	98.98					9.31	2.57	274	350	10 000	
Вымпелком 7		13/10/15	97.50	99.00					9.18	2.57	261	337	10 000	
Мегафон														
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.01	100.45					8.11	1.73	167	222	10 000	
Ростелеком														
Ростелеком 8		03/09/13	95.26	99.50					8.60	0.54	253	248		
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	96.01						8.47	0.41		229	2 000	
СПБ Теле2														
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.80	100.75	0.15	1	1	8.37	1.12	207	236	3 000	
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	100.80	100.75	0.30	1	1	8.37	1.12	207	236	4 000	
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.00	100.50					9.12	2.15	261	329	6 000	
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.99					9.28	3.00	266	349	5 000	
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.62	3.00	300	383	3 000	
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.58	3.00	296	379	5 000	
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ														
ВБД														
ВБД ПП 3		27/02/13	86.00	99.95						7.51	0.23		125	5 000
МАГНИТ														
Магнит БО-1		09/09/13		100.10					8.46	0.74	229	241	1 000	
Магнит БО-2		09/09/13	99.25	100.15	99.00	-0.95	7	225	9.85	0.74	368	380	1 000	
Магнит БО-3		09/09/13							8.29	0.74	212	224	2 000	
Магнит БО-4		09/09/13	99.25	100.05	100.05	0.05	7	131	8.32	0.74	215	227	2 000	
Магнит БО-5		28/02/14		99.40	99.38	0.01	1	2 180	8.71	1.17	239	271	5 000	
Магнит БО-6		22/04/14							8.71	1.32	235	274	5 000	
Магнит БО-7		21/09/15	100.50	100.55					8.94	2.49	238	312	5 000	
Х5														
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16							9.42	1.44	303	347	8 000	
Х5 Финанс 1		01/07/14	96.00	99.00					8.10	1.45	171	216	9 000	
Х5 Финанс БО1		01/10/15	99.27	104.50	100.25	0.25	1	1	9.61	2.50	305	380	5 000	
Копейка														
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.00					8.93	0.61	282	284	3 000	
Копейка БО-2		01/10/13	99.10	99.99	99.95	0.15	4	86	9.37	0.79	318	333	3 000	
ИНТУРИСТ														
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.61	100.70	99.60	0.05	3	133	11.20	0.45		504	2 000	
Черкизово														
Черкизово БО-3		08/11/13	98.51	99.55	99.50	-0.04	1	1 700	9.01	0.90	277	297	3 000	
Синергия														
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.50	100.19					9.42	0.80	322	338	3 000	
Синергия БО-3		03/06/15							11.13	1.94	465	528	2 000	
Русское Море														
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.91	99.96					12.96	0.52	690	683	1 000	
Детский мир														
Детский мир 1		26/05/15	92.28	94.00	94.02	0.02	1	1	11.67	2.27	514	584	1 000	
Мираторг														
Мираторг БО-1		29/07/14							12.36	1.52	596	643	3 000	
МАШИНОСТРОЕНИЕ														
АТОМЭНЕРГОПРОМ														
Атомэнергопром 6		15/08/14	86.00	99.95					9.45	1.62	303	354	10 000	
Трансмашхолдинг														
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	92.01	94.30					12.46	1.08	617	645	3 000	
КАМАЗ														
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	86.00	100.11					-18.03	0.03			2 000	
Камаз БО-2		04/02/14	98.70	99.10	99.10	0.10	1	1 000	9.64	1.10	334	363	3 000	
Камаз БО-3		01/10/15	100.00	101.60					10.76	2.47	420	494	2 000	
УВЗ														
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.13	100.00					9.23	0.02			3 000	
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.50	99.75					9.80	0.70	365	374	3 000	
УОМЗ														
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00		99.00		1	150	12.04	0.85	582	600	1 000	
ИРКУТ														
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	101.00					8.59	0.74	242	254	5 000	
ГСС														
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							9.54	0.04			3 000	
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.75		100.00		2	5 050	9.15	0.38		295	3 000	
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.50	99.70	99.66	0.01	2	8	9.35	0.38		315	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	195	209	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.00	100.15	100.15	0.25	3	9 000	9.01	0.40		283	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.51	101.70	101.70		5	3 366	9.75	0.58	366	364	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.30	100.67					10.69	1.95	421	484	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.97	100.10	100.05	0.05	2	9 740	7.69	0.34		147	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.90	100.35					7.53	0.34		131	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.30	100.42	100.41	-0.04	1	1	7.67	0.22		141	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.10	100.50					8.76	1.64	233	285	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.00	99.70					9.78	1.33	342	381	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.11	100.74	100.40		4	5 062	10.02	2.01	353	418	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.95	100.70	100.66	0.26	2	2	9.88	2.01	339	404	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	100.14	100.10	0.10	13	7 933	12.67	0.71	651	661	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.10	100.11	100.11	0.11	40	8 897	12.70	0.85	648	666	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.04	100.83	100.80	0.30	3	5 494	10.11	0.29		387	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.00	101.90					12.69	0.29		645	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15			100.00	0.05	1	1	10.36	0.39		417	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	98.02	100.00	100.00	0.05	1	1	10.36	0.39		417	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.51	0.48		237	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15			100.00		1	1	10.38	0.95	413	435	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	96.20	100.00	97.00	-1.00	11	210	13.19	0.98	693	716	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.02	98.83					12.02	1.22	569	603	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	98.00	98.50	98.00	-1.99	1	87	11.10	1.22	477	511	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.67	3.08	204	288	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	97.81	99.50					8.52	3.00	190	273	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	97.81	99.29					8.52	3.00	190	273	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.00	99.55					8.43	0.21		217	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.51	100.70	100.51	0.01	14	317 895	8.59	1.86	212	272	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15							8.96	2.49	240	314	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.02	100.25	100.07	0.07	1	20 000	8.96	2.59	239	315	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.80					8.23	2.18	171	240	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.28	100.40	100.35		13	74 705	7.96	0.51	191	183	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	86.10						8.26	1.45	187	232	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	90.00	96.00					12.90	1.43	652	695	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	87.76	92.40					12.37	2.95	575	658	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15							9.02	2.55	245	321	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.52	96.10					10.91	1.61	449	500	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					8.89	0.55	281	277	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70	99.40					8.63	1.21	230	264	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.20	100.00	98.42	-0.58	4	2 802	10.80	0.66	466	472	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.83	86.97	86.96	-0.14	18	268	30.76	0.76	2458	2 472	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.75	99.55	1.35	2	2 700	9.51	0.82	330	347	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	106.10						9.32	0.94	307	329	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00		99.80	1.20	2	3 000	7.90	1.28	155	192	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.86	100.00					8.46	0.72	230	241	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	99.01	99.31	99.01	-3.06	2	2	15.22	0.38		902	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.90	98.60					11.51	0.71	535	545	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	91.00	100.29					9.09	2.26	256	326	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.45	2.67	287	364	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	97.55	103.00					4.31	0.79			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.17	101.79					8.81	0.93	256	278	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.05	99.95					11.26	1.41	488	531	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.05	98.00					10.45	1.41	407	450	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.35	100.65					9.74	2.53	317	393	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.18	98.89					10.50	1.28	415	452	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13		100.19	100.10	-0.11	7	3 022	9.18	0.15		291	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.05	0.53	399	392	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.05	100.30	100.26	0.06	2	2	9.83	0.74	366	378	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.35	100.58	100.55	0.05	1	500	11.29	1.19	497	530	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.32	98.54	98.51	0.14	7	342	11.04	1.22	471	505	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.15	96.22	96.15		1	100	11.41	1.51	501	548	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.70						11.61	1.73	517	572	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.98	100.01	100.01		4	1 240	10.76	0.04			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.50	101.70	101.70		2	1 006	12.70	1.26	636	672	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.11						9.66	0.45		350	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.60	99.39					9.52	4.01	281	372	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.60	99.40	98.60	0.20	1	14	9.47	4.00	276	367	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.60	99.30					9.25	4.00	254	345	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.50	99.50					9.42	3.43	275	363	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.45	100.53					7.61	0.25		135	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.60	100.50	99.60	-0.60	3	501	8.78	1.56	237	286	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.30	98.45	98.41	-0.15	6	196	8.73	1.80	227	285	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.31	99.45	99.41		8	5 120	11.81	0.59	571	571	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.25	100.50					11.92	0.50	587	579	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.01	100.26	100.10	0.10	10	32 868	12.17	0.81	597	613	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.00	100.35	100.34	0.04	2	5 065	8.30	0.44		214	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	86.00	100.50					8.45	0.53	239	233	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	88.00						8.51	0.57	242	240	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	92.00	98.89	98.74	0.33	4	182	8.52	0.90	228	248	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.70		100.70		1	1	9.04	1.64	261	313	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	97.00						9.31	1.81	285	343	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16							7.31	0.48		116	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.22					8.34	0.79	215	230	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.75	100.80					8.55	1.11	225	254	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.01						8.55	1.17	223	255	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14			100.04		4	15 000	7.98	0.03			5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.03	101.00	100.18	0.03	6	100	8.87	0.58	278	276	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.17	1.23	283	318	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.80						9.03	0.36		283	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13							8.91	0.50		277	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.12	100.15	100.15	0.03	3	1 801	9.08	0.65	295	300	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/17	99.45	99.72	99.40	-0.10	2	50 002	9.57	0.70	342	351	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.50	99.78	99.78	-0.01	3	48 000	9.49	1.15	318	349	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14	99.65	100.25	99.88	-0.07	1	1	9.80	1.44	341	385	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.05	100.10	100.08	0.01	2	1 750	8.75	0.47		260	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.05	100.15					8.23	0.17		197	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.12					8.42	0.19		216	3 000
Банк ЗЕНИТ 1	07/04/12	07/04/13	99.45						9.36	0.33		314	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.25	100.25		1	700	8.65	0.49		251	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.25	100.35					8.72	0.55	264	260	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.16	100.27	100.23	0.01	4	184	9.03	0.70	287	297	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.78	143	158	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.25	100.50					9.00	0.92	276	297	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	40 902	9.23	1.28	288	325	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	98.10	100.09	100.00	-0.03	2	401	8.83	0.21		257	5 000
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15		100.10	100.02	-0.03	2	40 000	8.72	0.21		246	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13	99.45	99.80	99.80	0.10	2	1 220	8.82	0.51	277	269	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	95.21	99.70	99.66	0.22	4	64	9.09	1.10	279	308	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.35	100.69					10.15	1.61	373	424	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	100.00		100.50	0.50	2	2	12.47	3.83	577	667	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	294	316	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	86.00	100.00					10.01	0.78	382	397	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.30	100.38	100.25	-0.07	6	60 111	9.36	0.81	316	332	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15		100.20	100.15		1	4 000	8.11	0.11		184	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	99.92	99.95	99.95	0.01	1	1	8.82	0.21		256	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.87	99.96					9.72	0.39		353	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.89	99.99	99.90		1	3 000	10.09	0.78	390	405	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	99.66	99.80	99.80	0.05	9	72 001	10.22	0.82	402	418	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.96	100.10	100.10	0.05	1	3 000	10.41	1.28	406	443	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.05	98.25	98.25	0.06	4	40 000	10.72	1.42	434	477	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.00	100.20					7.51	0.04			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15		100.75					8.94	0.72	278	288	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.10	102.00	100.10	-0.10	1	1	9.22	0.69	307	315	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15		100.65	100.44	0.04	1	40 000	9.50	1.15	319	350	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.85	100.05					9.11	0.75	293	306	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.05	100.15	100.13	0.08	1	1	9.79	1.16	347	379	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.20	100.30	100.21	0.01	1	2 755	9.38	0.51	333	325	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.01	100.09					9.83	0.71	367	377	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.86	99.05					10.31	0.78	412	427	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.76	101.05	101.05	0.10	5	3 962	10.93	1.08	464	492	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.99	1.10	469	498	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.00	100.39					11.45	1.15	514	545	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.62					11.01	1.87	454	515	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.69					11.16	1.97	467	531	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.96	99.20	99.20	0.35	2	5 040	11.45	0.64	533	536	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.30	100.69					13.07	0.64	694	699	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.54	100.60	100.60	-0.14	14	665	11.75	0.36		555	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	14/07/15	101.23	101.30	101.20	0.19	8	9 164	12.08	0.58	599	597	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	104.81	105.00	104.70		1	1	12.42	0.60	632	632	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	100.66	106.00					10.37	0.76	419	433	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	104.30	104.40	104.30	0.15	44	11 816	12.02	0.93	577	599	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	102.50	102.90	102.50	0.40	18	7 510	12.01	1.11	571	600	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.03	100.09	100.09	0.05	41	18 207	14.51	0.64	839	842	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.04	101.00					9.54	0.90	331	350	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.90	100.10					9.00	0.78	281	296	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.40	100.40		3	21	9.34	1.61	292	343	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.08					7.57	0.88	134	153	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19							7.90	1.11	160	189	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.02	1.13	171	201	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.20	100.95					8.57	2.05	207	273	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00						8.93	1.37	256	297	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.10	100.30					8.50	0.71	234	244	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15		100.30	100.20	-0.05	1	1 500	8.36	0.73	219	231	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.80	99.43	0.08	1	1	8.45	0.72	229	240	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.76	0.95	251	273	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.30	100.69	100.45	-0.05	2	100 001	9.02	1.76	257	313	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15		101.00	100.55	-0.05	2	56 001	8.96	1.77	251	308	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	237	324	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	100.95	100.86		1	400	7.98	0.97	172	195	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.85					7.81	0.96	156	178	5 000

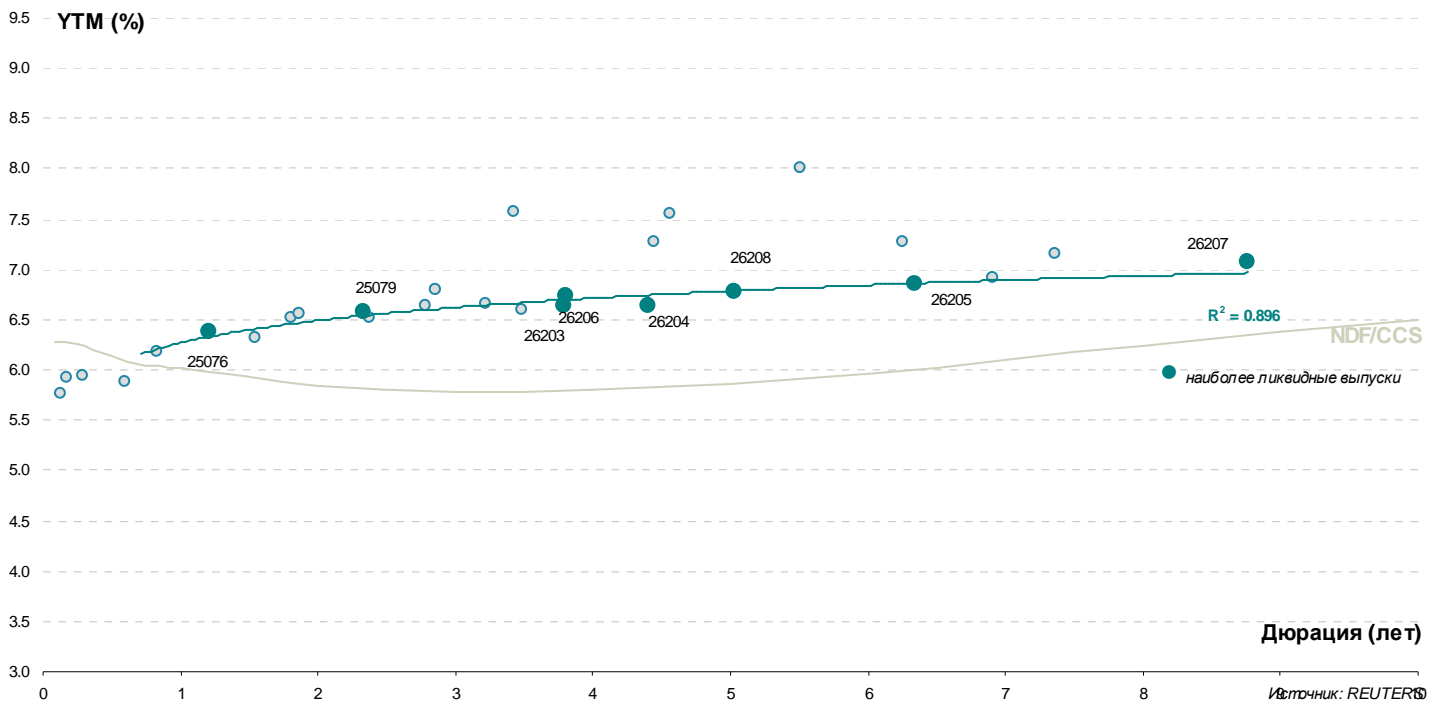
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		222	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.20	100.20	0.07	9	9 123	9.36	0.90	312	332	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.90	100.20	100.12	8.11	6	15 149	8.70	0.30		247	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.39	100.37	0.22	5	817	9.15	0.89	292	311	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.45	99.89					10.15	0.25		389	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.55	100.65	100.55	0.07	5	9 801	10.55	0.67	441	448	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	97.00	100.09					10.09	0.84	388	405	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.55	100.89	100.80	0.25	2	6 000	10.78	1.23	445	479	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	11/12/12	10/06/14							9.45	0.01			5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.95	100.12					8.91	0.36		270	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							9.40	0.85	318	336	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.20	100.37					9.91	2.13	340	408	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14		99.60					8.16	1.25	182	218	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.85						9.15	0.56	307	304	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00					10.01	0.73	384	396	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		101.50					8.98	0.76	280	294	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.50					9.00	0.76	282	296	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	99.19					9.41	0.92	317	337	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.20					9.53	0.92	329	350	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15		100.80	100.70	0.08	1	1	9.81	1.77	336	393	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.50	100.55	100.50	0.10	4	10 061	8.61	0.65	248	253	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.34	97.60					8.88	1.43	250	293	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						9.40	1.77	295	352	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.27	100.43	100.45	0.20	9	40 000	10.33	1.17	401	433	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.46	97.76	97.72	-0.04	6	180	10.41	1.24	407	443	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.43	96.55	96.40		1	36	10.64	1.53	423	471	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	100.00	100.20					9.37	0.47		322	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.00						10.15	0.57	406	404	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.00	100.30					9.89	0.82	369	385	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.15					9.81	0.82	361	377	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.82	1.14	351	382	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.00	99.95	-0.16	2	100	10.27	1.11	397	426	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	93.00	97.44	97.30	-0.10	4	4 419	10.48	1.33	412	451	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.70	99.90	99.89		1	1	9.32	0.82	311	328	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	99.95	100.25					9.96	1.32	360	399	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14			100.00		1	1	8.40	0.03			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14							7.77	0.03			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.14	100.15					9.43	0.36		323	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.45	100.65					9.65	0.53	359	352	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21		100.09	100.10	0.35	1	6	5.82	0.04			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22		100.19					7.77	0.38		158	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15							9.18	0.89	295	314	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	316	390	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	100.24					10.37	0.84	416	433	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	100.15	100.35	100.31	0.26	3	15 272	9.75	0.24		349	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	100.18	100.29	100.17	0.01	1	20	11.03	0.81	483	499	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	86.00	99.90					9.42	0.16		315	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					10.11	0.35		390	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	100.45	100.85					11.37	0.81	517	533	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.00	100.13					8.13	0.04			2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	90.31	96.95					10.29	1.53	388	436	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.30					9.13	0.35		292	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	100.00	100.20					9.36	0.38		317	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.03	100.14	100.07	0.01	1	3 690	11.16	0.78	497	512	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.75	100.05					10.19	0.95	394	416	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.90	100.01	99.90	0.20	2	3 100	12.19	0.72	603	613	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	100.14	100.15	100.15	-0.01	1	1	8.96	0.17		270	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	100.05	100.07	100.05	-0.01	3	20 001	10.23	0.61	412	413	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.38	100.42	100.42	0.01	1	1	10.30	0.66	416	422	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.45						9.71	0.47		356	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.11	100.02					9.60	0.56	352	349	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.35	100.80					9.56	0.82	335	352	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.95	100.05	100.00	-0.10	13	5 390	12.32	0.86	610	628	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.70	99.80	99.77	-0.02	3	6 001	9.48	0.84	327	344	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.60	100.35					9.66	0.84	345	362	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.21	100.39	100.20	-0.07	15	33 600	11.20	0.40		501	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.35	100.57	100.57	-0.08	1	2	12.04	0.79	585	600	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	86.00	100.00					12.36	0.04			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.68	100.93	100.60		1	2	11.84	0.66	570	576	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.60	100.00	99.99	-0.01	1	601	11.07	0.86	485	503	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	99.73	100.00	100.00		15	61 809	12.66	0.95	641	663	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12							10.03	0.02			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.08	100.12	100.12	0.07	11	59 963	10.82	0.21		456	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.98	100.32	100.15	0.15	4	17 249	9.71	0.22		345	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.85	99.98	99.98	0.18	2	1 499	11.31	0.34		509	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.20	100.75	100.75	0.60	8	2 293	12.41	0.83	620	637	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.01	99.46	99.49	0.49	2	935	11.61	0.98	535	558	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.00						12.72	1.28	637	674	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	510	569	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		103.50	104.45					5.90	0.48			30 000
Москва 53	01/09/13		99.51	100.14	100.14			3 025	6.90	0.72	74	84	15 000
Москва 63	10/12/13								6.06	0.93		3	15 000
Москва 62	08/06/14								6.88	1.36	51	92	35 000
Москва 39	21/07/14		99.61	100.05					7.27	1.52	87	134	10 000
Москва 64	24/06/15		98.45	99.46					7.80	2.30	126	198	20 000
Москва 44	16/11/15		112.00	113.67	113.67	0.77	1	155	7.24	2.56	67	143	40 000
Москва 56	22/09/16		98.00	98.55					7.85	3.35	119	206	20 000
Москва 49	14/06/17		98.01	99.00					7.67	3.81	97	187	25 000
Москва 48	11/06/22								7.77	6.78	89	169	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13								8.14	0.49		200	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.50	99.60	99.60	0.02	4	50 100	8.48	1.30	213	251	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	03/12/12								-14.27	0.01			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.30	100.00					8.78	1.68	234	288	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.03	103.00	102.60	-0.15	2	61 522	8.76	2.18	224	293	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		100.02	103.30					7.09	0.42		91	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		100.85	101.25	101.17	0.02	15	621 661	8.37	0.98	211	234	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.75	100.00	97.75	-0.25	5	12 000	8.94	1.99	245	310	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.81						8.16	0.34		194	3 000
Якутия 9	19/09/13		99.10						7.84	0.52	178	171	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.10	99.50					8.28	1.22	195	229	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАИ													
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	100.25	100.63	1.23	1	2 350	8.89	2.20	237	306	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.80	100.00					8.41	1.24	207	243	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАИ													
Красноярский край 5	29/11/16		101.00	101.40	101.40	0.25	1	5	8.23	1.43	185	228	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		99.71	100.00					8.16	0.94	191	213	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		97.00	98.50	98.27	0.27	2	51	8.71	1.30	236	274	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		92.05	95.42	95.40	0.40	1	10	8.36	2.17	184	253	1 000
Коми Респ 10	15/12/16		100.01	101.25					9.13	2.21	261	330	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.80	104.25	104.25	0.52	1	5	8.54	2.46	198	272	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12			100.05	100.06	-0.01	15	9 089	7.62	0.04			3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.45	100.48	100.45	-0.15	7	5 102	9.56	1.76	311	368	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		103.05	103.22	103.03	-0.17	1	6	9.59	2.18	307	376	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.56	101.85	101.85	0.25	2	4	8.88	1.65	245	297	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		99.80	103.15					7.99	0.44		182	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.00	99.85					7.88	1.04	160	186	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.50	101.75					8.74	2.12	223	291	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		99.21	99.60	99.60	-0.10	1	763	8.68	1.47	229	274	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12		100.08	100.16					4.80	0.04			2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13		102.80	103.80					7.67	0.96	141	164	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16								8.65	1.69	221	275	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6	12/06/14								8.85	0.68	271	278	3 000
Тверская Обл 5	26/12/13		106.40	107.10	107.10	0.70	1	33	8.23	0.97	197	220	4 000
Тверская Обл 7	15/12/15		98.30	98.48					9.43	2.37	288	361	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



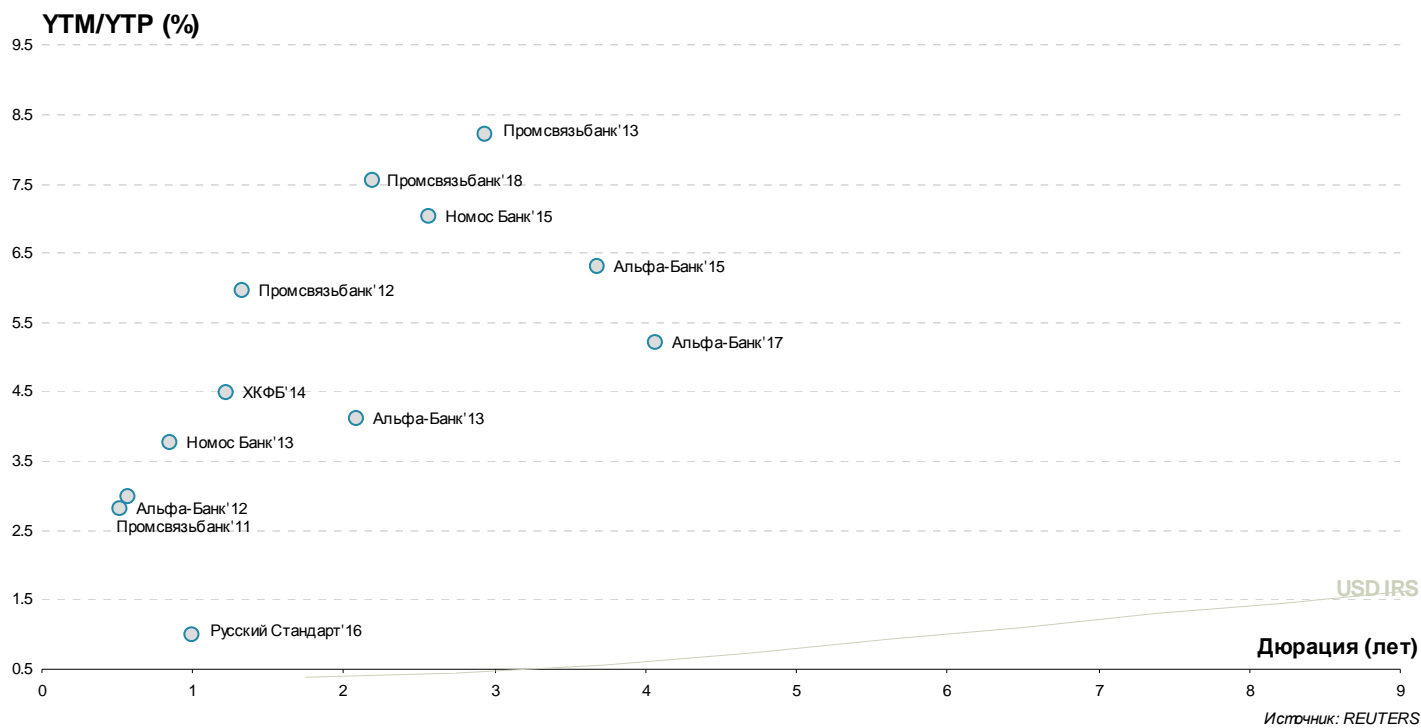
Результаты торгов евробондами

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		105.950	106.225	1.09	0.98	2.30	0.01	72
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.875	106.125	1.83	1.77	4.05	0.04	124
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.278	149.722	2.05	1.69	4.47	-0.25	127
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.072	127.210	2.76	2.74	5.43	0.21	151
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.050	117.450	2.46	2.41	6.34	0.06	132
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		113.000	113.500	2.90	2.84	7.77	-0.45	146
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		199.395	200.605	4.06	4.00	9.19	-0.05	221
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.500	124.000	4.22	4.19	15.99	-0.45	189
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.104	101.123	1.44	1.39	0.36	-0.01	115
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.422	101.723	1.61	0.79	0.35		132
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.971	101.988	1.39	1.34	0.33	0.16	109
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.648	104.148	1.71	0.95	0.62	-0.08	141
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		110.056	110.736	2.54	2.04	1.20	-0.13	224
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		109.333	109.993	2.83	2.31	1.18	-0.06	253
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.101	109.356	2.41	2.26	1.53	0.09	209
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.875	107.125	2.67	2.58	2.79		226
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.920	107.220	2.83	2.74	3.22	-0.08	237
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.625	112.125	3.06	2.94	3.58	0.02	254
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.000	122.823	3.58	3.43	4.48	-0.81	285
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.400	130.898	3.82	3.75	5.11	-0.17	293
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.494	111.815	3.24	3.14	2.86	0.11	254
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.000	119.000	4.14	4.03	7.19		278
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		106.740	107.490	4.09	4.00	7.69	0.24	265
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		142.220	143.220	5.30	5.24	11.77	-0.53	323
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		127.500	128.250	5.28	5.24	12.98	-0.37	309
Газпром нефть										
GAZPROM NEFT'22 4.37%	USD	19/09/22		101.626	102.029	4.17	4.12	8.00	0.75	269
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		104.001	106.001				0.08	
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		105.002	106.002	1.56	0.77	1.19		124
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		129.025	129.326	3.07	3.02	4.63	-0.32	228
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.964	111.426	3.01	2.90	3.87	-0.05	244
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		112.381	112.794	4.09	4.04	7.42	0.01	270
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.009	100.435	5.37	5.27	4.33	-0.07	476
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.079	107.475	3.15	2.97	2.09		281
VTB'17 6%	USD	12/04/17		105.820	106.022	4.51	4.46	3.86	0.19	396
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		107.227	107.465	4.73	4.68	4.46	0.10	404
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		109.861	110.361	4.80	4.70	4.68	0.05	408
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		107.865	108.370	5.31	5.23	6.27	0.03	418
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		105.667	106.046	6.17	6.12	7.31	0.25	480
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.396	106.789	5.74	5.71	12.38	0.02	362
VTB' 9.5%	USD			105.988	106.582	8.59	8.51	6.76	0.88	736
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.112	102.155	2.27	2.17	0.42	-0.39	198
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.392	106.615	3.71	3.61	2.10	0.27	338
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		104.000	104.350	4.51	4.38	2.75	0.25	414
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.310	101.310	5.94	5.68	3.93	-0.44	542
ВЭБ										
VEB'17 5.375%	USD	13/02/17		108.661	108.865	3.14	3.09	3.75	0.04	259
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		109.990	110.491	3.25	3.14	4.42	0.03	258
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.457	118.958	4.05	3.98	6.03	0.02	294
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		112.375	113.375	4.42	4.30	7.39	0.13	301
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		119.075	119.575	4.80	4.76	9.17	0.20	306
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		102.999	103.027	2.38	2.33	0.53	-0.17	209
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.010	106.259	3.14	3.02	1.87	-0.02	281
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.104	108.452	3.42	3.30	2.57	0.03	305
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.598	111.768	3.66	3.61	3.04		320
GAZPROMB'17 5.625%	USD	17/05/17		105.375	105.875	4.28	4.16	3.99	0.25	372
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		106.875	107.625	5.94	5.80	5.24		508
GPB EURO' 7.875%	USD			101.297	101.953	7.57	7.42	4.45	0.20	696
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.150	102.525	2.13	1.27	0.43		183

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		105.498	105.554	2.01	1.96	1.04	-0.13	169
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		109.146	109.223	2.74	2.69	1.44	-0.24	242
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		109.780	110.178	3.87	3.78	3.94	-0.03	331
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		105.743	105.977	4.03	3.98	4.41	-0.01	335
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.369	118.871	3.98	3.89	4.64	0.06	324
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		103.266	103.427	4.97	4.92	3.19	-0.48	456
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13		102.235	102.385	1.22	0.88	0.43		92
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		102.650	103.025	1.68	1.02	0.54		137
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		107.983	108.383	2.29	2.13	2.39	0.02	191
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.100	108.600	3.35	3.23	3.86	-0.04	280
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		106.250	106.750	3.33	3.20	3.76		279
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		106.758	107.055	4.00	3.95	5.55	0.13	304
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		109.335	109.707	4.39	4.34	6.77	0.08	312
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		111.867	112.266	4.53	4.48	7.14	-0.26	317
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		100.734	101.123	5.03	4.98	7.84	0.11	357
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.371	102.871	2.37	1.06	0.37	0.22	209
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.962	110.681	4.56	4.31	2.65	0.03	420
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		102.982	103.364	6.60	6.50	3.79	0.22	611
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		110.937	111.684	7.02	6.86	4.34	0.05	639
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		99.750	100.500	6.80	6.64	4.56	-0.45	615
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		103.125	103.625	5.53	5.38	3.21	-0.25	512
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		100.022	100.308	4.95	4.90	5.79	0.08	397
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		108.732	108.952	5.68	5.58	2.04	0.92	540
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.343	110.815	3.31	3.07	1.82	-0.01	298
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.366	114.864	5.48	5.41	6.15	0.07	437
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.295	102.455	2.36	1.95	0.39		206
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.789	102.211	4.51	2.90	1.50	-0.11	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.510	106.510	4.25	4.25	2.84	0.01	385
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.307	111.796	4.66	4.52	3.09	-0.01	425
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		104.950	105.950	4.94	4.68	3.73	0.18	442
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.185	117.678	5.40	5.31	4.43	0.05	472
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		110.830	111.830	6.04	5.90	6.15	-0.23	490
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		109.375	109.775	6.16	6.10	6.81		487
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		108.012	108.110	2.05	2.00	1.81	0.17	171
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.875	114.500	3.03	2.89	4.01	0.01	243
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.518	120.855	3.84	3.79	5.66	-0.18	283
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.750	114.250	4.07	4.01	6.47		289
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.087	120.524	4.08	4.03	7.41	0.11	268
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		124.860	125.367	4.67	4.60	5.73	0.06	360
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.622	106.777	3.10	3.05	2.90		268
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.790	118.171	4.02	3.97	6.46	0.10	281
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		104.955	105.205	1.84	1.46	0.61	0.16	154
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.337	109.479	2.22	2.12	1.29	0.02	190
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		105.493	105.835	4.59	4.49	3.24	0.23	415
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		106.703	107.192	5.13	5.02	4.23	0.03	452
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		98.366	98.912	6.12	6.05	7.53	0.12	473
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.501	102.931	7.16	7.06	4.22	0.15	657
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		103.529	103.911	6.80	6.70	3.78	-0.18	632
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		101.631	104.631				0.05	
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.400	107.700	2.67	2.53	2.00	-0.13	232
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.985	116.172	2.80	2.75	3.18	0.36	233
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.234	114.450	3.05	3.00	3.78	0.19	249
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.418	121.687	3.39	3.34	4.43		268
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.000	121.500	3.86	3.79	5.73	0.21	280
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		103.379	103.434	2.85	2.75	0.52	-0.16	257
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.084	108.570	4.22	4.01	2.09		390
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.748	100.112	6.37	6.27	3.69	-0.05	589
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		110.982	111.429	5.25	5.15	4.07	0.11	466

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

Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@zenit.ru
a.pashkevich@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
[e.gashigullina@zenit.ru](mailto.e.gashigullina@zenit.ru)

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

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

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

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