

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события / стр. 2/

Внешний рынок долга / стр. 3/

- Рынок труда США приятно удивил, но есть вопросы

Денежно-кредитный рынок / стр. 4/

- Рынок приходит в хорошую форму
- Рубль укрепился на фоне восстановления котировок нефти

Российский долговой рынок / стр. 5/

- Евробонды провели нейтральный день
- Локальный рынок завершил пятницу «в плюсе»

Первичный рынок / стр. 6/

Приложения

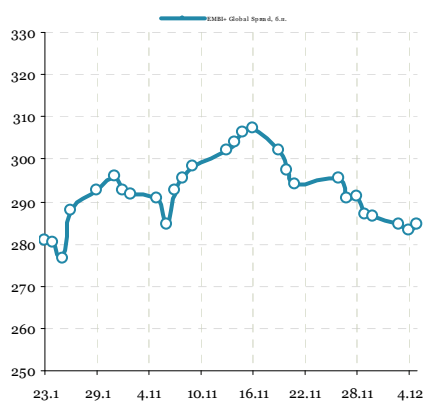
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ / стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка / стр. 18/
- Результаты торгов евробондами / стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов / стр. 22/

Динамика ключевых показателей

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

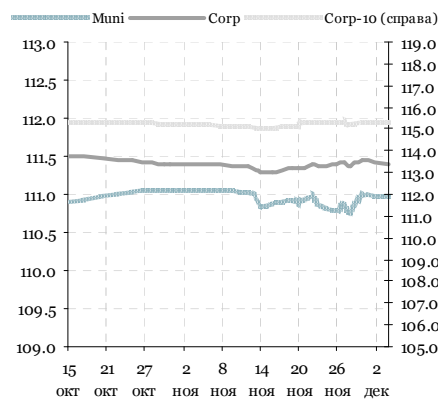
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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 «МКБ» установило ставку первого купона облигаций 11-й серии объемом 3 млрд руб. в размере 12,25% годовых, что соответствует доходности к погашению на уровне 12,63% годовых. Срок обращения займа составит 5,5 года. /Интерфакс/

Удмуртия 11 декабря начнет размещение облигаций на 2,5 млрд руб. со ставкой первого купона в размере 9,1% годовых. Срок обращения выпуска составляет 5 лет, погашение номинальной стоимости облигаций осуществляется частями (амортизация долга) в дату выплаты четвертого, пятого, седьмого и десятого купонных доходов. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

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.)

Сегодня: 10.12.2012 – понедельник

• **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.)

Завтра: 11.12.2012 – вторник

Статистика США: Wholesale inventories, Trade balance

• **Выплата купона:** Россельхозбанк, 2014-2 (LPN4) (9%, 45 млн руб.), Газпром, 2014-3 (LPN) (10.5%, 13.1 млн руб.), Мечел, 19 (8.4%, 209.4 млн руб.), КИТ Финанс Капитал, 02 (11%, 219.4 млн руб.), Свердловская область, 34001 (9.27%, 69.3 млн руб.), Москва, 48 (7%, 1 млрд руб.), Россельхозбанк, 07 (6.85%, 170.8 млн руб.), Московская область, 34008 (9%, 213.2 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 03 (6.9%, 52.9 млн руб.), ВТБ-Лизинг Финанс, 04 (6.65%, 51 млн руб.), ХКФ Банк, 06 (7.75%, 96.6 млн руб.)

• **Размещение:** ВТБ Капитал Финанс, 04 (1 млрд руб.), ДельтаКредит, 09-ИП (5 млрд руб.), Правоурмийское, 01 (3 млрд руб.), Московский Кредитный банк, 11 (3 млрд руб.), Вологодская область, 34003 (4.6 млрд руб.)

Внешний рынок долга

Рынок труда США приятно удивил, но есть вопросы

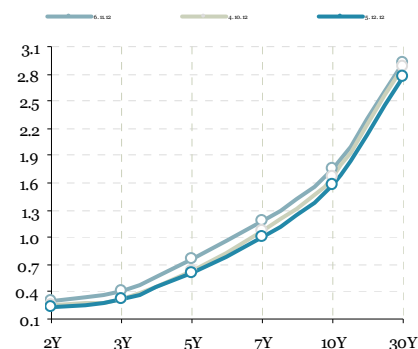
Ключевая статистика прошлой недели – данные по рынку труда США – оказались заметно сильнее ожиданий рынка. Уровень безработицы снизился в ноябре с 7.9% до 7.7%, а прирост числа рабочих мест вне с/х сектора составил 146 тыс. при среднем прогнозе в 85 тыс. Несмотря на это, у этой статистики есть определенные искажения, которые не позволяют говорить об их надежности для оценки состояния рынка труда. В частности, снижение уровня безработицы вызвано скорее сокращением числа рабочей силы на внушительные 350 тыс. чел., что снизило долю трудоспособного населения с 63.8% до 63.6%. Число безработных сократилось на 229 тыс. до 12.029 млн чел., при этом количество отчаявшихся найти работу и «выпавших» из списка рабочей силы составило 166 тыс. В то же время, судя по опубликованным данным, влияние урагана «Сэнди» на американский рынок труда было минимальным.

Число рабочих мест в частном секторе выросло в ноябре на 147 тыс., в государственном – сократилось на 1 тыс. (против сокращения на 51 тыс. в октябре). Производственный сектор подтверждает предыдущие данные, отражающие его слабость. Занятость здесь снизилась за месяц на 22 тыс. против роста на 18 тыс. в октябре, аутсайдерами стали строительство (-20 тыс.) и промпроизводство (-7 тыс.). В сфере услуг картина была очень похожа на октябрьскую. Единственное, что можно отметить здесь – это перераспределение роста числа рабочих мест в сторону торговли от строчки деловых и профессиональных услуг.

Рынок труда США, несмотря на кажущуюся его силу при беглом взгляде на индикаторы, демонстрирует слабый рост, отражающий нейтральные темпы экономического роста. Снижение уровня безработицы вызвано не ростом экономической активности, а скорее статистическими факторами, тогда как занятость вне с/х сектора выглядит внушительно лишь за счет меньшего влияния на нее госсектора.

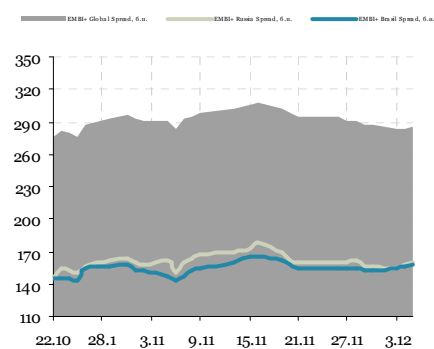
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



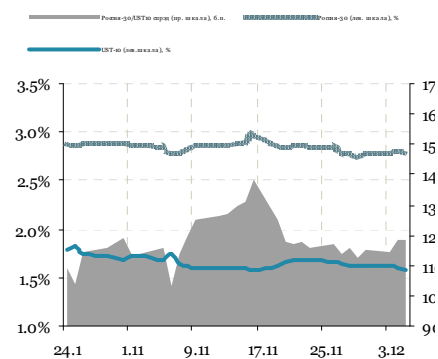
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



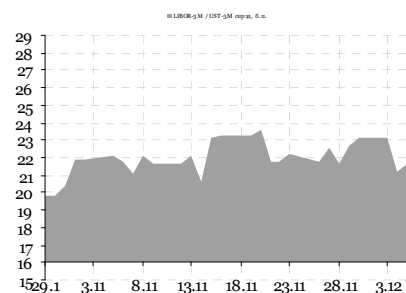
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Рынок приходит в хорошую форму

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка в пятницу немного улучшилась в ответ на снижение спроса на рублевую ликвидность. На рынке МБК стоимость 3-дневных кредитов снизилась в среднем на 25 бп до 6.00% годовых, междилерское репо с облигациями через выходные обходилось в среднем под 6.25% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ баки привлекли весь запрошенный объем в сумме на 210 млрд руб. против 287 млрд руб. днем ранее. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ сократилась на 234.2 млрд руб. до 1 131.2 млрд руб.

Условия рынка должны продолжить улучшение на текущей неделе, поскольку на рынке не запланировано каких-либо важных событий. В то же время, потенциал снижения краткосрочных процентных ставок, на наш взгляд, ограничен 25-50 бп.

Рубль укрепился на фоне восстановления котировок нефти

Коррекционное восходящее движение котировок нефти помогло рублю укрепить свои позиции в конце прошлой недели. В пятницу курс бивалютной корзины снизился на 13 коп. до отметки 34.94 руб. В период российских торгов цена барреля Brent поднялась с локального минимума на 106.80 долл. до 107.10 долл. Новая неделя начинается нейтрально для рубля, при этом котировки нефти держатся чуть ниже значений пятницы. Мы ожидаем продолжения консолидации рубля на уровне 35 руб. за корзину.

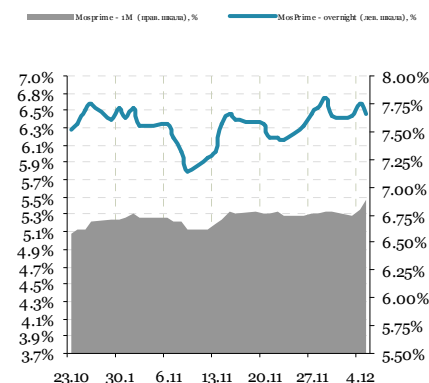
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

Дата	Аукционы ЦБ и Фонда ЖКХ, поступление и возврат средств на счета комбанков, уплата налогов	Прямое репо с ЦБ РФ, 1 день, млрд руб.
Понедельник		
Вторник	Аукцион Казначейства 7 недель, 70 млрд руб., от 6.5% годовых	
Среда	Аукцион ОФЗ Возврат в бюджет	ОФЗ 26209, 10 лет, 30 млрд руб. 71 млрд руб.
Четверг	Аукцион Казначейства	6 недель, 42 млрд руб., от 6.5% годовых
Пятница	Возврат в бюджет	49 млрд руб.

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

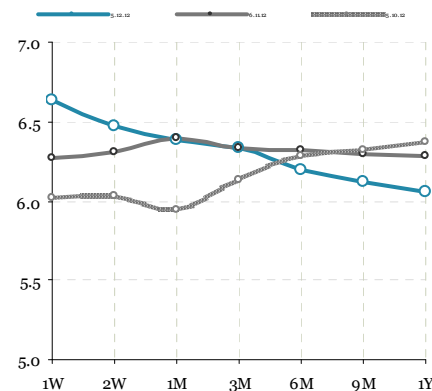
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды провели нейтральный день

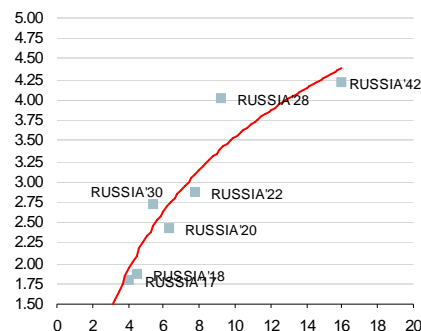
Спрэды долгов развивающихся стран в пятницу сузились со стороны UST, где доходности выросли после неплохого отчета по рынку груди. Российские еврооблигации провели день в условиях низкой активности и незначительных ценовых изменений. На суверенной кривой изменения цен не выходили за пределы 5 бп, корпоративный сегмент также завершил день разнонаправленными колебаниями; достаточно выразительный день провели разве что выпуски VTB'49 и новый выпуск EUCHEM'17, прибавившие в ценах порядка 25 бп.

Локальный рынок завершил пятницу «в плюсе»

Локальный рынок завершил неделю ростом, отыграв большую часть снижения среды и четверга. На рынок ОФЗ во второй половине дня вернулся спрос, а цены прибавили до 50 бп на фоне достаточно средних показателей активности. В корпоративном сегменте за пределами короткой дюрации спрос был замечен в новых выпусках Алросы, Роснефти, котировки которых прибавили в районе 10 бп, ближе по кривой активно торговался выпуск МТС 04.

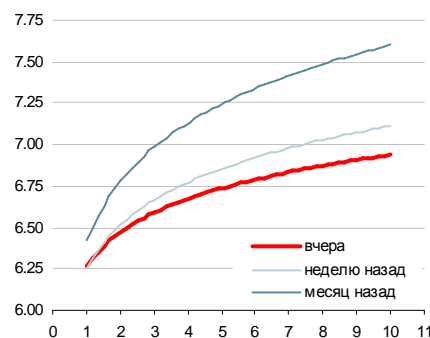
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



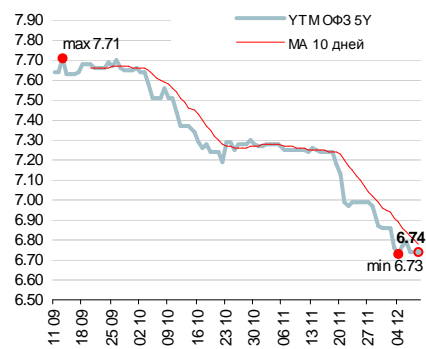
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



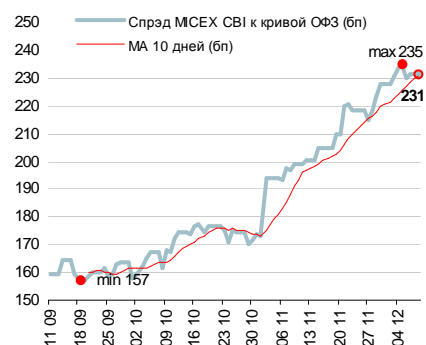
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



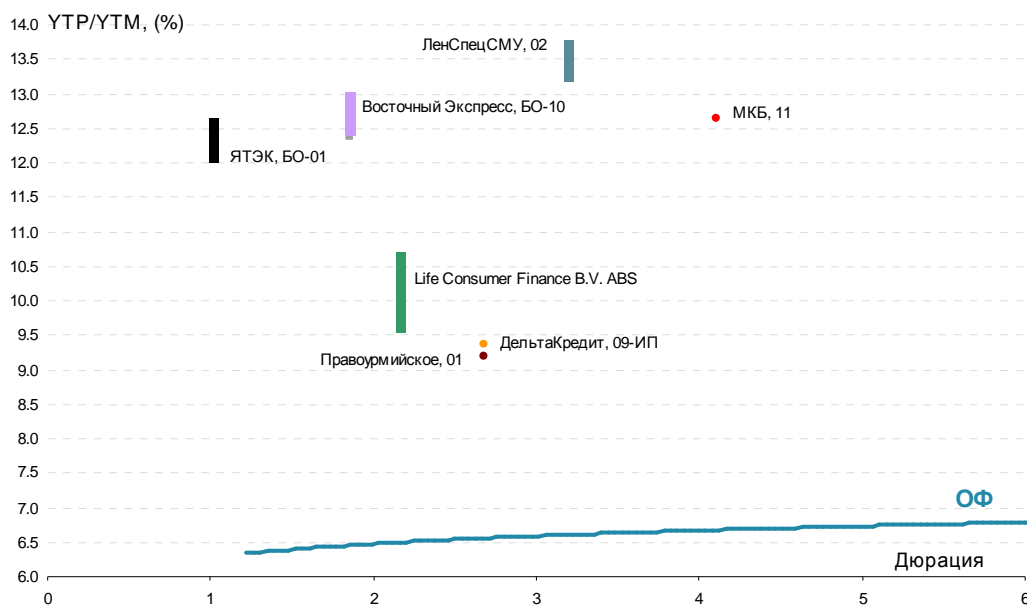
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Заккрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
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	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.

Источники: Interfax, Bloomberg, Cbonds

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Bid cover/ Размещ объем	Ориентир УТР/УТМ	Фактическая УТР/УТМ	Дата размещения	Амортизация/Дюрация
НЛМК, 08	BBB- / Baa3 / BBB-	да	10 000	2.0 / 100%	8.84-8.99	8.58	07.12.2012	нет / 2.71 г.
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	100.19	100.19	0.01	54	331 279	5.69	0.13			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.13	100.15	100.15	0.02	19	111 463	5.78	0.17			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.72	102.15	101.84	-0.01	4	12 100	5.90	0.29			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.00		100.00	-0.20	5	47 390	6.24	0.60	12	16	50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.45	100.50	100.50	0.08	4	30 101	6.08	0.83		7	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.88	101.00	101.00	0.02	10	199 547	6.35	1.21	2	43	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.91	109.16	109.05	-0.15	2	50 100	6.39	1.55		55	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.16	109.20	109.17	0.02	2	51 949	6.49	1.81	5	70	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.07	103.20	103.20	0.18	3	30 010	6.45	1.86		67	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.10	101.30	101.15	-0.05	4	9 432	6.60	2.33	8	87	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.00	101.09	101.09	-0.01	5	50 348	6.52	2.37		79	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	102.20	102.40	102.30		3	304 971	6.63	2.78	6	93	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.10	99.24					6.80	2.86	22	110	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.11	101.20	101.15	0.05	7	200 010	6.65	3.22	4	96	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	97.00	99.00					6.60	3.49		91	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.58	3.43	95	189	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.29	103.50	103.40	0.15	5	158 241	6.60	3.79		91	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.29	103.43	103.43	0.43	12	257 992	6.62	3.81		93	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.19	104.40	104.25	-0.05	2	9 273	6.64	4.41		93	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	91.50	94.10	91.38	-1.02	2	9 000	7.53	4.44	83	181	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	96.28	103.00					7.56	4.56	85	184	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	104.35	104.80	104.65	0.41	10	202 663	6.68	5.03		93	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							8.02	5.50	126	221	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	97.30	98.75					7.27	6.25	47	137	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	105.64	105.80	105.80	0.35	10	54 381	6.79	6.34		88	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	105.69	105.90	105.80	0.25	11	88 820	6.88	6.90	5	89	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23		92.30					7.16	7.36	31	111	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	111.03	111.20	111.20	0.50	27	462 072	7.02	8.76	12	79	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36		95.00					7.55	11.16	58	101	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.55	11.10		2	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	95.98	99.90	99.80		2	25 000	7.44	0.63	130	137	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	-------	--	---	--------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО1		04/12/12							-4.42	0.00			5 000
НЛМК ВО6		05/03/13	100.06	100.17					7.38	0.24		122	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.50	100.55	100.55	-0.01	2	1 000	7.81	0.51	173	171	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.50	100.54	100.52	-0.03	3	1 000	7.87	0.51	179	177	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15							8.21	1.64	180	238	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.07						8.37	1.81	193	258	10 000
НЛМК 7	16/03/15	05/09/22	100.15	100.25	100.25	0.06	1	4 900	8.54	2.08	206	279	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.90	100.11					7.84	0.32		170	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.05	100.08	100.08	0.03	3	14 002	8.20	0.67	205	214	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.25	99.70	99.25	-0.14	7	182	8.46	1.17	214	254	5 000
ММК ВО6		10/06/14							8.97	1.48	258	311	5 000
ММК ВО7		22/07/14	94.00						8.81	1.52	242	296	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.38	100.50	100.50		3	108	7.10	0.19		92	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	100.38	100.44	100.44	0.02	2	48	7.42	0.19		124	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.22	100.23	100.23		3	13 340	8.05	0.53	196	195	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.00	100.27	100.27	0.04	2	4 900	7.97	0.54	188	188	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.80	100.95					8.92	2.25	241	318	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.80	100.85					8.92	2.26	241	319	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.30	100.35	100.35		18	152 881	9.00	2.57	246	328	5 000
Алроса ВО2		30/10/15	100.30	100.39	100.30	-0.05	9	172 526	9.02	2.56	248	330	5 000

Евраз

Евраз 1	22/03/13	13/03/20	100.15	100.30					8.07	0.29		192	10 000
Евраз 3	22/03/13	13/03/20	98.06	100.10					7.82	0.29		167	5 000
Сибметинвест 1	16/10/14	10/10/19	107.60	107.85					9.08	1.68	266	326	10 000
Сибметинвест 2	16/10/14	10/10/19	107.60	107.75	107.71	-0.01	2	14	9.09	1.68	267	327	10 000
Евраз 2	26/10/15	19/10/20	100.44	101.70	101.70	-0.55	3	2 126	9.47	2.56	293	375	10 000
Евраз 4	26/10/15	19/10/20	100.00	101.80					9.76	2.56	322	404	5 000
Евраз 5	06/06/16	27/05/21	90.00	96.15					10.01	3.09	341	432	5 000
Евраз 7	02/06/16	25/05/21	90.02	96.50					12.35	3.08	575	666	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1	16/03/15	07/03/22	99.75	100.15	100.11		13	40 322	9.13	2.07	265	338	5 000
Металлоинвест 5	16/03/15	07/03/22	99.75	100.20	100.19	0.14	3	65 531	9.09	2.07	261	334	10 000
Металлоинвест 6	19/03/15	10/03/22	99.75	100.20	99.99	-0.02	1	5 000	9.20	2.07	272	345	10 000

Мечел

Мечел ВО2		12/03/13	99.16	99.70	99.15	-0.65	11	15 600	13.45	0.26		729	5 000
-----------	--	----------	-------	-------	-------	-------	----	--------	-------	------	--	-----	-------

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Мечел 5	16/04/13	09/10/18	96.00	100.00					11.11	0.35		497	5 000
Мечел ВО3		24/04/13	99.51	99.99	99.50	0.06	5	725	11.38	0.38		525	5 000
Мечел 2	15/06/11	12/06/13							14.01	0.49		790	5 000
Мечел 4	25/07/13	21/07/16	99.50	99.80					12.63	0.61	650	655	5 000
Мечел ВО4	11/02/14	10/02/15	94.58	96.75	96.00	0.70	4	3 207	14.50	1.11	820	856	5 000
Мечел 15	18/02/14	09/02/21	91.86	92.10	92.00		6	19 000	16.42	1.14	1011	1 049	5 000
Мечел 16	18/02/14	09/02/21	92.00	92.10	92.10	0.10	28	101 572	16.31	1.14	1000	1 038	5 000
Мечел ВО5		07/04/15							11.82	2.22	532	608	5 000
Мечел ВО7		07/04/15							11.82	2.22	532	608	2 000
Мечел ВО11		07/04/15							11.82	2.22	532	608	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	100.00						11.82	2.22	532	608	3 000
Мечел ВО6		07/04/15							11.55	2.08	507	580	2 000
Мечел 13	01/09/15	25/08/20	88.00	89.76					16.13	2.39	961	1 040	5 000
Мечел 14	01/09/15	25/08/20	85.03	88.95					20.69	2.38	1417	1 496	5 000
Мечел 17	02/06/16	27/05/21	81.17	84.97	81.17	-1.83	4	249	16.21	3.05	962	1 052	5 000
Мечел 18	02/06/16	27/05/21	83.38	87.47					15.18	3.06	859	949	5 000
Мечел 19	07/06/16	01/06/21							16.03	2.91	945	1 033	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	100.00	100.09	100.01	0.01	4	54 725	9.01	0.85	279	300	5 000
СУЭК													
СУЭК 1	05/07/13	26/06/20	100.35	100.46	100.43	0.01	9	917	8.73	0.55	263	264	10 000
РМК													
РМК 3	17/12/13	15/12/15	97.01	98.40					13.97	0.95	771	800	3 000
РМК 4	05/06/14	02/06/16	91.80	93.77					14.23	1.43	786	836	5 000
ЧТПЗ													
ЧТПЗ ВО1	05/06/12	04/12/12							-43.44	0.00			5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.10	97.90	97.76		8	658	10.65	1.41	428	478	5 000
Русал													
Русал 7	03/03/14	22/02/18	93.30	93.46	93.42	0.15	30	18 215	14.78	1.17	846	886	15 000
Русал 8	15/04/15	05/04/21	88.03	88.50	88.70	-0.05	2	16	14.82	2.14	833	908	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД ВО01		05/12/12							-4.76	0.00			15 000
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.55	99.84	99.55	-0.05	5	9 441	7.54	0.92	129	155	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.85	109.00	108.85		2	200	7.53	1.15	122	160	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.20	102.43					7.88	1.94	142	212	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.60	99.90					8.03	2.68	147	232	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17							8.24	3.01	165	255	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.85	100.15					8.29	4.48	159	257	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6	26/09/13	15/09/20	99.75	100.00					7.60	0.79	140	157	10 000
ФСК ЕЭС 8	26/09/13	15/09/20	99.75	100.00					7.39	0.79	119	136	10 000
ФСК ЕЭС 18	09/06/14	27/11/23							8.08	1.39	171	220	15 000
ФСК ЕЭС 15	23/10/14	12/10/23	101.49	101.50	101.50	-0.09	7	42 250	8.02	1.76	159	222	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.07		100.27	0.43	5	48 719	8.13	2.19	163	239	10 000
ФСК ЕЭС 10	24/09/15	15/09/20	99.00	99.70					8.32	2.53	178	260	10 000
ФСК ЕЭС 7	27/10/15	16/10/20	98.35	98.70					8.17	2.63	162	246	5 000
ФСК ЕЭС 12	22/04/16	19/04/19	96.01	99.80					8.33	2.99	174	264	10 000
ФСК ЕЭС 25	27/09/16	14/09/27	100.90	101.20	100.90	-0.15	2	2	8.49	3.28	188	280	15 000
ФСК ЕЭС 21	19/04/17	06/10/27							8.60	3.69	195	291	10 000
ФСК ЕЭС 9	24/10/17	16/10/20	98.00	98.70					8.64	4.09	196	294	5 000
ФСК ЕЭС 11	24/10/17	16/10/20	98.25	98.70					8.56	4.09	188	286	10 000
ФСК ЕЭС 19	18/07/18	06/07/23	97.00	98.35					8.70	4.48	200	298	20 000
ФСК ЕЭС 13		22/06/21	98.75	99.36					8.81	6.01	202	295	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.10	100.50					8.85	2.19	235	311	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1		29/11/16							9.67	3.22	306	398	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3	11/11/13	09/11/15	95.51	101.90	99.30	0.22	10	1 122	10.03	0.91	379	404	3 000
Водоканал													
Водоканал 1		09/12/15							9.40	2.59	285	369	2 000
Западный СД													
Западный СД 1	29/04/16	13/05/31	98.80	98.90					9.38	3.00	279	369	5 000
Западный СД 2	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.20	3.01	261	351	5 000
Западный СД 3	24/02/17	06/02/32							9.31	3.51	268	362	5 000
Западный СД 4	24/02/17	06/02/32							9.65	3.51	302	396	5 000
Западный СД 5	24/02/17	06/02/32	85.00	100.30					9.66	3.49	303	397	5 000
Почта России													
Почта России 1	25/03/14	22/03/16							8.06	1.24	173	215	7 000
Почта России 2	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	233	318	00000 000
Почта России 3	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	233	318	00000 000
Почта России 4	23/10/15	18/10/19							8.89	2.70	233	318	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	99.70	100.06					7.58	1.13	127	165	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.13	110.00					7.52	1.37	116	164	5 000
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22	101.10	101.50	101.35	0.10	15	133 983	8.42	4.06	174	273	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.10	102.15	101.35	0.13	17	545 181	8.42	4.06	174	273	10 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							9.19	0.02			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							-2.81	0.02			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.20	101.29	100.01	-0.04	5	620	7.53	0.98	127	156	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.58	101.00					-7.95	0.11			8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13		100.40	99.99		1	200	7.27	0.34		113	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13		100.30					7.27	0.34		113	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50	100.75					8.01	1.97	154	225	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.60	100.95					8.48	2.76	192	278	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.40	100.80					8.48	2.77	191	278	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.90	105.00					8.53	4.14	185	283	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	98.80	99.99					9.11	4.38	241	340	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.10	100.20	100.16	0.11	2	2	7.32	0.53	123	122	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.40	100.60					8.35	2.56	181	263	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	100.40	100.60					8.35	2.56	181	263	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.40	100.50	100.40		1	2 000	8.35	2.56	181	263	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40	100.00	99.96	0.10	8	710	7.42	0.77	122	139	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.07	100.12	100.11	0.01	12	10 064	8.71	0.03			15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.12	100.13					8.03	0.03			15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.12	100.13	100.10	-0.02	2	7 353	9.05	0.03			20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.15	101.30					8.13	0.97	187	216	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.20		101.20	-0.10	3	6 000	8.55	1.98	208	280	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	95.00	100.20					9.61	0.62	348	354	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	99.03	101.00	99.25	0.04	12	2 528	10.17	1.10	387	423	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21							10.78	2.94	420	509	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	95.00	99.45					10.78	2.95	420	509	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.70	99.90	99.90	-0.10	3	516	12.69	0.61	656	661	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.62	3.01	303	393	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.30	100.65	100.34	-0.26	10	219 260	8.19	0.57	208	210	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.01	100.06	100.06	0.04	13	53 610	7.04	0.04			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.02	100.09	100.09	0.09	4	13 861	7.43	0.13		123	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13							7.82	0.26		166	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13							8.42	0.26		226	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13							7.86	0.26		170	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	99.92	100.17	100.17	-0.05	1	4 795	7.94	0.73	176	189	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.55	99.80	99.55	-0.45	5	7 570	8.18	0.83	196	217	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	100.15	100.20					8.16	1.21	183	224	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	100.15	100.20					8.16	1.21	183	224	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	100.00	100.25					8.68	2.50	214	296	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.50	214	296	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.60						8.04	0.47		193	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14							8.92	1.83	247	313	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	99.99	100.10	100.10	0.01	1	1 000	8.19	0.69	203	213	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.60						8.39	0.09		217	10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16							8.47	0.22		230	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.90	100.50					7.66	0.38		153	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.20	0.77	200	217	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16							7.94	0.61	181	186	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.75					7.45	0.98	118	148	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50	99.80		18	410	8.58	1.24	225	267	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.00						7.25	0.86	102	124	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.05	100.67					8.21	2.06	173	246	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.99	101.00	100.88	-0.17	5	32 007	8.36	2.55	182	264	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	101.00	101.25					8.31	2.57	177	259	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.70	99.50	99.00	0.35	1	231	8.42	2.92	184	273	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.28	205	298	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.20	98.79					8.50	4.08	182	280	10 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.05		99.43	-0.51	6	78	8.10	1.29	176	220	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.25					8.53	1.77	209	273	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.90	101.25					8.47	1.77	203	267	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	87.56	101.50					8.80	1.89	235	303	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21		99.70					8.89	2.93	231	320	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	98.72	100.50	99.30	-0.40	1	2 000	9.04	2.93	246	335	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.40	100.60	100.40	-0.05	1	5 000	8.53	1.24	220	262	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.30	101.00					8.89	1.58	249	305	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	100.10	100.14					8.51	1.39	214	263	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	100.10	100.75					8.56	1.39	219	268	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.25	100.26	100.20	0.03	1	24 362	7.80	0.17		161	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.25	101.00	100.15	-0.10	1	1 000	8.14	0.17		195	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18							7.60	0.49		149	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	86.50	100.25	100.15	-0.10	1	20 999	8.09	0.64	195	202	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	100.25	100.45	100.15	0.27	1	1	8.10	0.65	195	203	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	98.22	100.21	100.21	0.11	5	55 000	8.13	0.70	196	208	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.25		100.20	0.05	6	31 748	8.14	0.70	197	209	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17							6.96	0.80	75	94	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.10	100.30	100.10	-0.11	4	55 550	8.23	0.87	200	223	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.48	100.49	100.52	-0.12	6	135 661	8.30	0.89	206	230	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.05	101.45	101.36	0.36	7	188 300	8.17	1.12	187	224	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.50	100.50					8.19	1.58	179	235	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	88.01	101.50	101.49	1.49	5	190 201	7.62	1.76	119	182	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	85.12	100.17	100.16	0.16	7	100 600	8.42	1.76	199	262	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.20	100.45					8.55	2.15	206	281	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.15	98.75					8.69	2.32	218	296	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.15	98.75					8.69	2.32	218	296	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.15	98.75					8.69	2.32	218	296	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	94.04		100.00	-0.02	1	2 000	8.59	0.05			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.20	99.35	99.35	0.05	5	6 698	7.98	0.61	185	190	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13							7.90	0.95	164	192	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	100.20						8.23	1.10	193	229	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.85	100.99	100.90		3	100 000	8.40	1.48	202	254	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16							8.68	2.71	212	297	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	100.00		100.00		3	4 000	8.67	2.58	213	295	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	100.00		100.00		3	5 250	8.67	2.58	213	295	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	100.00		100.00		2	2 400	8.67	2.58	213	295	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30	99.50					8.06	1.05	178	211	3 000
АИЖК-11 А1	15/09/14	15/09/43							8.44	1.64	203	261	7 000
АИЖК А9		15/02/17	98.47		100.60	1.20	18	342	7.34	1.76	90	154	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.60					8.50	1.79	206	271	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24		99.40					8.41	2.23	191	267	6 000
АИЖК А8		15/06/18							8.35	2.65	180	264	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.00	99.75					8.66	2.94	208	297	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23							8.61	2.94	203	292	7 000
АИЖК А21		15/02/20	100.00						8.92	3.12	232	323	15 000
АИЖК А11		15/09/20							8.67	3.70	202	298	10 000
АИЖК А16		15/09/21							8.98	4.84	225	324	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					9.06	5.43	230	326	8 000
АИЖК А20		15/12/27							8.88	8.37	199	270	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13							8.98	0.94	273	300	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13							9.10	0.94	285	312	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.75	99.95					9.62	1.52	323	377	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.52	313	367	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	86.00	100.10	99.98	-0.07	1	1	8.47	0.19		229	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.45	100.25					7.57	0.66	142	151	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.11	99.84					8.12	0.93	187	214	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	100.00					8.42	1.30	207	252	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.00	100.75					8.54	2.62	199	283	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.17	100.30					7.85	0.52	177	175	10 000
МТС 1		17/10/13	99.50	99.94					7.74	0.84	152	173	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.15	99.34	99.30	0.08	37	652 324	8.08	1.36	172	220	15 000
МТС 2		20/10/15	98.10	99.96					8.62	2.60	207	291	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	99.15	99.55	99.45	0.24	4	72 462	8.54	2.65	199	283	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.50	99.90					8.97	3.16	237	328	15 000
МТС 7		07/11/17	99.75	100.20	99.90	0.25	3	3 300	8.91	4.08	223	322	10 000
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.03	100.75	100.70	0.02	1	15 500	8.19	0.59	207	211	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.25	98.70	98.69	0.09	11	67 890	8.47	1.48	209	261	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	100.00	100.20					9.00	2.09	252	326	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	100.00	100.20	100.20	0.20	2	16	8.93	2.07	245	318	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	100.00	100.35	100.15	0.10	6	40 700	8.96	2.07	248	321	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.00	98.35					9.31	2.56	277	359	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.00	98.75					9.19	2.56	265	347	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.20	100.45	100.45	0.30	1	1	7.92	1.73	149	211	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	95.26	99.50					8.61	0.54	252	252	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	96.01						8.48	0.41		236	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	101.50	100.40	-0.35	1	80	8.70	1.12	240	276	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	101.69	100.50	-0.25	1	20 000	8.61	1.12	231	267	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.15	100.50	100.46	0.36	7	79	8.94	2.15	245	320	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.99					9.28	3.00	269	359	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.62	3.00	303	393	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00					9.58	3.00	299	389	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.82	99.95	99.82	-0.18	5	20 050	8.36	0.22		219	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13		100.10					8.46	0.74	228	242	1 000
Магнит БО-2		09/09/13		100.15					9.85	0.74	367	381	1 000
Магнит БО-3		09/09/20							8.29	0.74	211	225	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	91.07	100.00	100.00	-0.05	1	1	8.39	0.74	221	235	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.26	99.40	99.40	0.02	1	1 700	8.69	1.17	237	277	5 000
Магнит БО-6		22/04/14							8.71	1.32	236	282	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.50	100.64					8.94	2.49	240	322	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16		99.00					9.43	1.44	305	356	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00	99.00					8.10	1.45	172	223	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	97.01	104.50	100.17	-0.08	1	50 000	9.64	2.50	310	392	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.00					8.94	0.61	281	286	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.70	100.50	99.95		6	20 534	9.37	0.78	317	334	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.65	100.65	99.60		2	250	11.20	0.45		508	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.10		100.45	0.95	3	3 000	7.87	0.90	163	188	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	100.00	100.20					9.42	0.80	321	340	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	100.20		100.00	-0.30	1	5 000	11.30	1.93	484	554	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.92	99.95	99.95		13	2 864	12.96	0.52	688	686	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	94.06	94.60	94.05	0.03	31	23 735	11.66	2.27	515	593	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.26	96.00	96.00	0.75	3	140	11.81	1.52	542	596	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	96.70	99.95					9.46	1.62	305	363	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	91.02	95.99	94.30	0.07	1	30	12.40	1.08	611	646	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	99.97	100.11					-20.34	0.03			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	94.06	99.10	99.10		1	1 000	9.64	1.10	334	370	3 000
Камаз БО-3		01/10/15		101.60					10.76	2.47	423	504	2 000
УВЗ													
Уралвагонзав од 1	13/12/12	07/12/17	99.13	100.00					9.25	0.02			3 000
Уралвагонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.55	100.00	99.66	0.11	2	1 000	9.63	0.70	346	358	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00	99.50	99.00		1	10 000	12.05	0.85	583	604	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	101.00					8.59	0.74	241	255	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							9.64	0.04			3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.85		100.00		3	15 000	9.15	0.38		302	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.50	100.00	99.96	0.30	6	510	8.49	0.38		236	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	0.76	194	209	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	100.11	100.15					9.01	0.40		288	2 000
Соллерс 2		17/07/13	100.52	101.77	100.22	-1.48	9	1 975	12.42	0.58	631	634	3 000
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	98.00	101.61	100.60		8	82	10.69	1.95	423	493	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.92	100.08	100.00	-0.05	4	3 852	7.85	0.33		171	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.90	100.30					7.53	0.33		139	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.30	100.45	100.40	-0.01	1	1	7.69	0.22		152	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.05	100.50					8.76	1.64	235	293	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	97.01	102.00	100.55	0.80	4	6 061	9.12	1.32	277	323	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.21	100.54	100.45	0.05	1	6 000	9.99	2.01	352	424	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.20	100.55	100.51	-0.15	6	38	9.96	2.01	349	421	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.14	100.20	100.14	0.04	11	12 415	12.60	0.71	643	655	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.99	100.05	100.05	-0.06	29	16 507	12.78	0.85	656	677	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	99.90	101.20					10.09	0.29		394	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.05	101.90					12.69	0.29		654	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15							10.36	0.39		423	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	98.02	100.00					10.36	0.39		423	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.50	0.48		239	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							10.38	0.95	412	440	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	96.05	100.00					13.20	0.98	694	723	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.00	98.83					12.02	1.22	569	611	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	90.11	98.50	98.50	0.50	2	2 592	10.65	1.22	432	474	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.67	3.08	207	298	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	97.81	99.50					8.52	2.99	193	283	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	95.00	99.29					8.52	2.99	193	283	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.00	99.55					8.53	0.21		235	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.55	100.75					8.59	1.85	214	281	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15							8.96	2.48	243	324	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.05	100.25	100.10	0.03	1	1	8.95	2.59	240	324	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.90					8.23	2.18	173	249	3 000
ЭНЕЛ ОГК-5													
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.30	100.40	100.35		1	1	7.95	0.51	187	185	4 000
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14	86.10						8.26	1.45	188	239	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	91.01	96.96					12.91	1.42	654	704	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	90.00	92.40	92.40	1.40	1	5	11.80	2.95	522	611	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15							9.02	2.55	248	330	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	96.05	96.10					10.91	1.60	450	508	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	98.80	99.00	99.00	0.10	11	595	8.71	0.55	261	262	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	99.05						8.64	1.20	232	272	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.35	100.00	98.40	-0.02	6	2 820	10.84	0.66	469	478	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.10	86.96	86.96		61	9 968	30.84	0.75	2465	2 480	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.80	98.25	-1.30	2	2 800	11.25	0.82	504	523	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	106.10						9.30	0.94	305	332	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.01	98.75	98.30	-1.50	2	2 800	9.17	1.28	283	327	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.85	100.05	99.85	-0.10	1	400	8.61	0.72	243	256	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	95.01		99.32	0.31	1	1	14.30	0.38		817	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.90	98.60					11.52	0.71	535	547	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	100.00	100.29	100.25	0.25	1	35 873	8.98	2.26	247	325	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.45	2.66	290	374	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	97.50	103.00					4.30	0.79			4 000
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.20	101.79					8.80	0.93	255	282	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	99.95					11.26	1.41	489	539	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.00	98.00					10.46	1.41	409	459	4 000
Акрон БО1		13/10/15	99.88	100.65					9.74	2.52	320	402	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.18	98.89					10.50	1.28	416	460	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.15					9.17	0.15		297	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.05	0.52	397	395	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.06	100.30	100.30	0.04	9	1 746	9.77	0.73	359	373	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.45	100.60					11.29	1.19	497	537	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.30	98.40	98.40	-0.11	16	3 272	11.14	1.21	481	522	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.21	96.30					11.41	1.51	502	556	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.76						11.61	1.73	518	580	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.96	100.01	100.01		4	1 400	10.71	0.03			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.01	101.70					12.69	1.26	635	678	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.11		102.80	0.50	1	4 000	8.45	0.45		233	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.60	99.34	98.60	0.20	1	700	9.47	4.00	280	378	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.60	99.35					9.47	4.00	280	378	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.60	99.30					9.25	4.00	258	356	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.57	99.45	99.46	0.96	3	17	9.11	3.42	248	342	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.40	100.60	100.55	0.02	11	12 615	7.50	0.25		134	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.60	100.30					8.78	1.56	238	294	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.33	99.35	99.31	0.90	8	1 462	8.19	1.80	175	240	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.40	99.34	99.30	-0.11	15	2 503	12.02	0.59	590	594	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	99.81	100.39	99.81	-0.39	8	1 338	12.75	0.50	668	665	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.11	100.15	100.15	0.05	1	600	12.10	0.81	589	608	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.29	100.31	100.31	-0.03	1	1 000	8.36	0.44		224	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.20	100.40					8.45	0.53	237	235	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	99.90						8.51	0.56	240	242	5 000
РОСБАНК А3	06/05/11	06/11/13	98.40	98.50	98.50	-0.24	10	21 841	8.81	0.90	257	282	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15		100.70	100.40	-0.30	3	170 001	9.24	1.64	283	341	10 000
РОСБАНК А5	06/05/11	07/11/14	97.50	99.50					9.31	1.81	287	352	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2	07/06/13	02/12/16		101.00	100.67	-0.33	1	1	8.01	0.50		190	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15		100.22	100.22	0.03	4	7 300	8.30	0.79	210	227	10 000
Альфа-Банк 1	04/02/14	02/02/16	99.70	100.59					8.55	1.10	225	261	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.00	100.50					8.55	1.17	223	263	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/12	16/12/14							7.81	0.02			5 000
МДМ Банк 8	09/07/13	09/04/15	100.03	100.15	100.12	-0.06	11	2 516	8.99	0.58	288	290	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.18	1.23	285	327	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.83	99.86	99.83	0.14	3	5 290	8.62	0.36		248	5 000
НОМОС Банк 9	15/06/12	14/06/13							8.91	0.50		280	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.10	100.15	100.15		4	14 040	9.08	0.65	293	301	5 000
НОМОС Банк 12	25/08/13	28/08/13	99.41	99.75	99.75	0.35	3	18 000	9.03	0.70	286	298	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.65	99.80	99.75	-0.03	2	309	9.51	1.15	320	358	5 000
НОМОС Банк 11	02/07/14	02/07/14							9.80	1.44	342	393	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.05	100.10	100.01	-0.07	3	1 760	8.91	0.47		280	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.07	100.09	100.09	-0.03	8	72 502	8.40	0.17		221	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.10	100.10		3	650	8.41	0.19		223	3 000
Банк ЗЕНИТ 1	07/04/12	07/04/13	99.45						9.38	0.33		324	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.25	100.15	-0.10	3	1 000	8.87	0.49		276	5 000
Банк ЗЕНИТ 6	02/07/13	01/07/14	100.25	100.35	100.35		2	3 870	8.72	0.55	262	263	3 000
Банк ЗЕНИТ 8	28/08/13	23/08/17	100.26	100.28	100.26	0.03	14	20 303	8.98	0.70	281	293	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.77	142	159	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.15	100.25	100.25		1	922	9.00	0.92	275	301	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	100.16	-0.04	2	10	9.26	1.28	292	336	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2	20/02/13	18/02/15	99.90	100.14	100.00		4	645	8.83	0.21		265	5 000
Промсвязьбанк 4	20/02/13	18/02/15	100.01	100.05	100.05	0.03	1	4	8.57	0.21		239	5 000
Промсвязьбанк 6		17/06/13							8.83	0.51	276	273	5 000
Промсвязьбанк 3		04/02/14	98.50	99.70	99.40	-0.26	6	434	9.34	1.10	304	340	5 000
Промсвязьбанк ВО7	06/09/14	06/09/15	100.40	100.69					10.15	1.61	374	432	5 000
Промсвязьбанк 3		01/02/18	100.00	100.50	100.50		1	3 000	12.47	3.82	581	678	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	99.00						9.19	0.95	293	322	3 000
Банк СПб ВО2	26/03/12	23/09/13	99.85	99.95	99.85	0.45	3	26 087	9.38	0.77	318	335	5 000
Банк СПб ВО8	07/10/13	05/10/15	100.30	100.40	100.19	-0.06	1	1	9.44	0.81	323	342	5 000
МКБ													
МКБ 7	15/01/13	14/07/15		100.20	100.19	0.04	1	1	7.68	0.11		147	2 000
МКБ ВО-01	22/02/13	22/02/14	97.00	99.92	99.92	-0.03	10	14 174	8.97	0.21		280	3 000
МКБ ВО-03	27/04/13	27/04/15	99.87	99.94					9.72	0.39		359	4 000
МКБ ВО-02	25/09/13	25/09/15	99.81	99.99	99.99	0.09	3	10 050	9.96	0.78	376	393	3 000
МКБ 8	09/10/13	08/04/15	99.65	99.80	99.60	-0.20	1	498	10.49	0.82	428	447	3 000
МКБ ВО-04	15/10/12	15/04/14	99.96		99.96	-0.14	1	4	10.52	1.28	418	462	5 000
МКБ ВО-05		23/06/14	98.05	98.24					10.72	1.41	435	485	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14	100.00	100.21	100.13	-0.05	2	2 736	8.63	0.03			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15		100.59					8.94	0.72	277	289	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	100.12	101.00	100.25	0.15	2	10 000	8.99	0.69	283	293	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.30	100.40	100.40	-0.04	7	61 890	9.54	1.15	323	361	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.85	100.00					9.11	0.75	292	307	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.05	100.12					9.79	1.16	348	386	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13		100.30	100.20	-0.01	1	3 000	9.40	0.51	333	330	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.00	100.20	100.05	0.04	5	3 500	9.76	0.71	359	371	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	99.05					10.31	0.78	411	428	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.76	100.95	100.95	-0.10	2	1 106	11.03	1.08	474	509	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.99	1.10	469	505	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.00	100.40	100.30	0.30	1	30 500	11.17	1.15	486	524	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.62					11.01	1.87	456	523	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.69					11.16	1.96	469	540	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.95	99.15	99.15	-0.05	10	8 037	11.54	0.64	540	547	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.51	100.69	100.69	0.59	2	16 012	12.08	0.64	594	601	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК ВО4	18/04/13	16/04/15	100.60	100.70	100.70	0.10	5	2 412	11.43	0.36		529	2 000
ТКС БАНК ВО6	16/07/13	09/07/15	101.12	101.25	101.25	0.05	11	3 398	11.98	0.57	587	589	2 000
ТКС БАНК S 2		28/07/13	104.93	105.40	105.00	0.30	16	3 238	11.89	0.59	577	581	1 000
ТКС БАНК О1		20/09/13	101.56	102.50					10.36	0.75	417	432	2 000
ТКС БАНК ВО2	29/11/11	26/11/13	104.38	104.50	104.40	0.10	10	4 333	11.90	0.93	565	592	2 000
ТКС БАНК ВО3	21/08/12	18/02/14	102.32	102.90	102.50		18	1 291	12.01	1.11	571	607	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.07	100.08	100.08	-0.01	53	16 206	14.52	0.64	838	845	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.06	101.00	100.10	-0.90	1	40 000	10.63	0.89	439	464	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.90	100.10					9.00	0.78	280	297	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.40	100.36	-0.04	5	339	9.36	1.61	295	353	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.08					7.57	0.87	134	157	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19		101.15					7.90	1.11	160	196	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.02	1.13	171	209	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.50	100.75					8.57	2.04	209	282	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00						8.93	1.37	257	305	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.10	100.30					8.50	0.71	233	245	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.10	100.20	100.20		1	10 000	8.35	0.72	217	230	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	100.00					8.46	0.72	228	241	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.76	0.95	250	278	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.49	100.65	100.65	0.20	1	1 500	8.90	1.75	247	310	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.50	100.89	100.40	-0.15	2	40 000	9.05	1.76	261	325	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	241	334	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	101.00					7.98	0.97	172	201	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.65	99.85					7.81	0.95	155	184	5 000

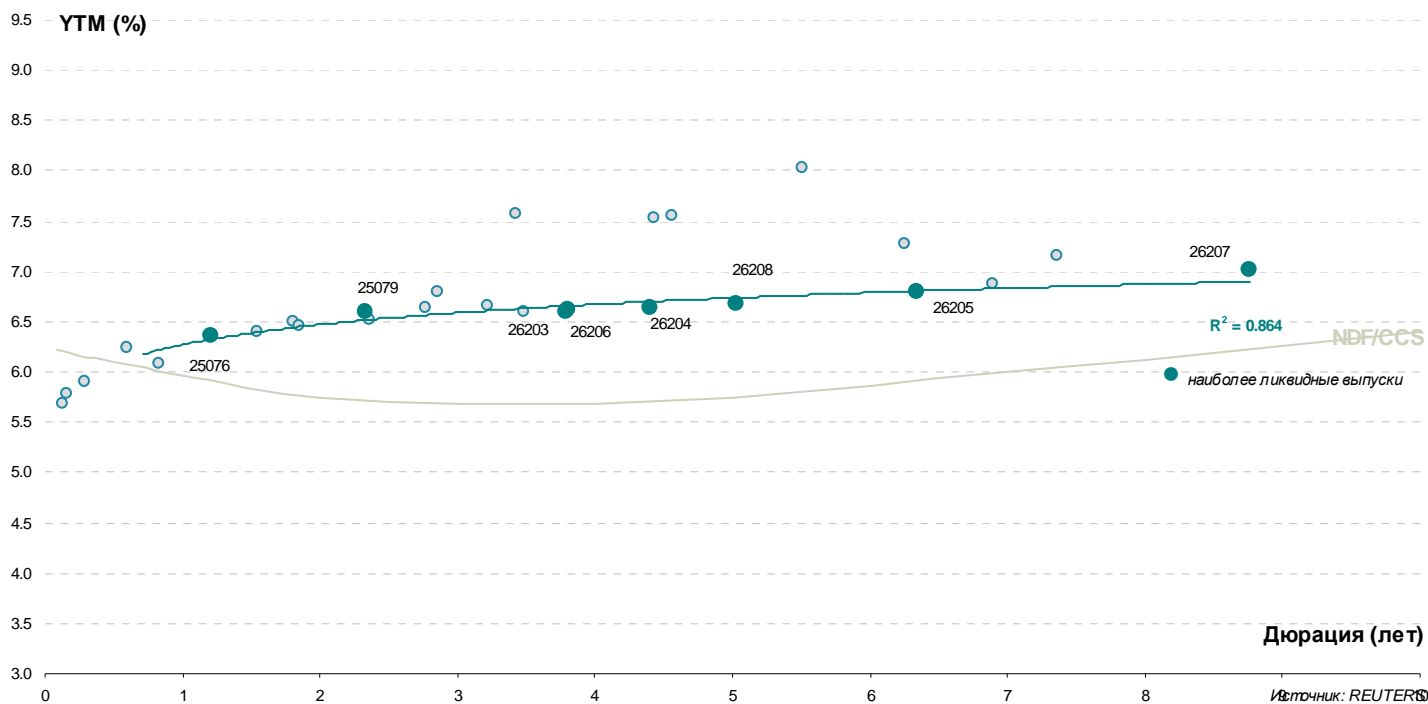
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		232	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.20	100.16	-0.04	6	744	9.41	0.90	317	342	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.19	100.02	-0.10	1	1	9.05	0.30		290	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.37					9.15	0.88	291	315	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13		99.88					10.18	0.25		402	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.57	100.70					10.55	0.67	439	449	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.70	100.09					10.09	0.84	387	408	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.00	100.94	100.59	-0.21	1	1 000	10.96	1.22	463	505	2 000
ЖФ Банк													
ЖФ Банк 6	12/03/13	10/06/14							9.69	0.25		353	5 000
ЖФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.96	100.12					8.91	0.35		277	4 000
ЖФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14							9.40	0.85	318	339	4 000
ЖФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.29	100.40	100.29	-0.11	4	10 000	9.96	2.13	347	422	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	99.60	99.56	-0.05	2	2	8.21	1.25	187	230	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.80						9.16	0.56	306	307	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	99.90					10.02	0.73	384	397	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15		101.50	100.24	-0.08	2	10	9.09	0.75	290	305	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.50					9.00	0.76	281	296	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	98.99					9.42	0.91	318	343	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.20					9.53	0.92	328	354	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15		100.79	100.76	0.06	3	21 298	9.77	1.77	333	397	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.45	100.75	100.50		2	9	8.61	0.64	247	254	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.34	97.90					8.88	1.42	251	301	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	1.77	296	360	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.25	100.41	100.41	-0.04	7	26 026	10.37	1.16	406	444	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.47	97.65	97.61	-0.11	12	2 188	10.51	1.24	418	460	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.32	96.45	96.45	0.05	5	5 013	10.61	1.53	422	476	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.11	0.49			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.00	100.20					9.37	0.47		326	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	99.00						10.16	0.57	405	407	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.00	100.29					9.88	0.82	367	386	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.15	100.15		4	12 500	9.81	0.81	360	379	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14		100.00					9.82	1.13	351	389	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.15	100.15	0.20	3	4 006	10.08	1.11	378	414	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.01	97.43	97.26	-0.04	7	8 830	10.52	1.33	417	463	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.70	99.90	99.86	-0.03	2	10	9.36	0.82	315	334	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	99.95	100.35					9.96	1.31	361	407	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14		100.05					8.40	0.03			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14							7.71	0.03			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.14	100.25	100.14	-0.01	1	40	9.45	0.36		331	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.55	100.65					9.65	0.52	357	355	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21			100.08	-0.02	2	3 000	6.17	0.04			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22		100.19	99.20	-1.20	3	32 287	11.21	0.38		508	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15							9.18	0.89	294	318	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.72	2.44	319	400	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	100.24					10.37	0.84	415	436	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	100.15	100.35					9.73	0.24		356	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	100.26	100.30	100.30	0.13	2	1 100	10.86	0.81	465	484	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	86.00						9.43	0.16		324	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	101.00	101.50					10.10	0.35		396	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	101.50					11.37	0.81	516	535	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	19/12/12	22/06/15	100.00	100.12					7.95	0.03			2 000
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	95.90	97.00					10.30	1.53	391	445	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.30					9.12	0.34		298	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	100.00	100.20					9.36	0.38		323	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.05	100.14	100.14	0.07	1	50	11.06	0.77	486	503	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.75	100.05	99.75	-0.30	1	10	10.53	0.95	428	455	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	100.20					12.19	0.71	602	614	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.18					8.94	0.17		275	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	100.05	100.09					10.23	0.61	410	415	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.36	100.42					10.30	0.66	415	424	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.71	0.47		360	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14		100.02	99.70	0.20	2	6	9.22	0.56	312	313	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.36	102.00					9.55	0.82	334	353	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	100.00	100.05	100.05	0.05	6	1 860	12.26	0.86	603	625	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.70	99.77	99.80	0.03	2	1 000	9.44	0.83	322	343	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15		100.35					9.66	0.84	344	365	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.25	100.44	100.26	0.06	7	24 150	11.03	0.39		490	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.00	100.68	100.69	0.12	1	13	11.87	0.79	567	584	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	86.00	100.00	99.95	0.05	1	1	11.14	0.04			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.65	101.00					11.84	0.66	569	578	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.60	100.00	100.00	0.01	3	50 000	11.06	0.86	483	506	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	99.76	100.00	100.00		6	19 694	12.65	0.95	639	667	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12							10.05	0.02			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.03	100.09	100.09	-0.03	6	1 550	10.97	0.20		479	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	99.12	100.26	100.15		1	2	9.70	0.22		353	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.65	99.99	99.95	-0.03	1	5 000	11.41	0.34		527	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.31	100.89	100.15	-0.60	2	2	13.21	0.82	699	719	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.11	99.45					11.61	0.98	535	564	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	98.01	100.41					12.72	1.27	638	682	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	511	578	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		103.40	104.45					5.85	0.48			30 000
Москва 53	01/09/13			100.14	99.80	-0.34	1	1	7.39	0.72	122	134	15 000
Москва 63	10/12/13								6.04	0.93		6	15 000
Москва 62	08/06/14								6.87	1.36	51	98	35 000
Москва 39	21/07/14		91.87	99.87	99.87	0.09	2	10 399	7.20	1.52	81	135	10 000
Москва 64	24/06/15		98.45	99.46					7.80	2.30	129	207	20 000
Москва 44	16/11/15		112.01						7.23	2.56	69	151	40 000
Москва 56	22/09/16		97.71	98.11					7.85	3.35	123	216	20 000
Москва 49	14/06/17		98.00	99.11					7.67	3.81	101	198	25 000
Москва 48	11/06/22								7.77	6.78	95	180	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13								8.14	0.49		203	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.40	99.65	99.65	0.05	3	10 088	8.44	1.30	209	254	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	236	296	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.03	102.80	102.72	0.12	3	141 274	8.70	2.18	220	296	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		101.20	103.30	103.30	-0.05	1	1	7.16	0.41		104	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		100.85	101.25	101.20	0.03	5	1 425	8.34	0.98	208	237	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.85	100.00					8.94	1.99	247	319	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.81	100.25					8.17	0.34		203	3 000
Якутия 9	19/09/13		99.21						7.83	0.52	175	173	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.61	100.35	99.60	-0.11	1	4 572	8.38	1.21	205	246	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	100.25					8.89	2.20	239	315	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.80	100.00					8.41	1.24	208	250	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 5	29/11/16		100.75	101.49	100.75	-0.65	5	17	8.71	1.43	234	284	9 000
КОМИ													
Коми Респ 7	22/11/13		99.81	100.00					8.16	0.94	191	218	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		98.50	99.71	98.50	0.23	1	1 500	8.52	1.30	217	262	2 000
Коми Респ 8	03/12/15		81.10	95.42					8.36	2.17	187	262	1 000
Коми Респ 10	15/12/16								9.13	2.21	263	339	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.55						8.54	2.46	201	282	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12		100.06	100.07	100.07	0.01	10	46 797	7.19	0.04			3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.52	100.70	100.70	0.25	30	42 614	9.41	1.76	298	361	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		103.20	103.55	103.23	0.20	5	12 002	9.50	2.17	300	376	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.60	101.85					8.87	1.65	245	305	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		99.82	101.00	100.08	-0.02	3	10 060	8.03	0.43		191	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.00	99.80					7.88	1.04	160	193	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.50	101.75					8.73	2.12	224	299	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		99.10	99.82					8.68	1.47	230	282	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12		100.06	100.14					4.37	0.04			2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13		102.80	103.80					7.67	0.96	141	170	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16								8.65	1.68	223	283	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6	12/06/14								8.83	0.67	267	277	3 000
Тверская Обл 5	26/12/13		106.45	107.10					8.20	0.97	194	223	4 000
Тверская Обл 7	15/12/15								9.43	2.36	291	370	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



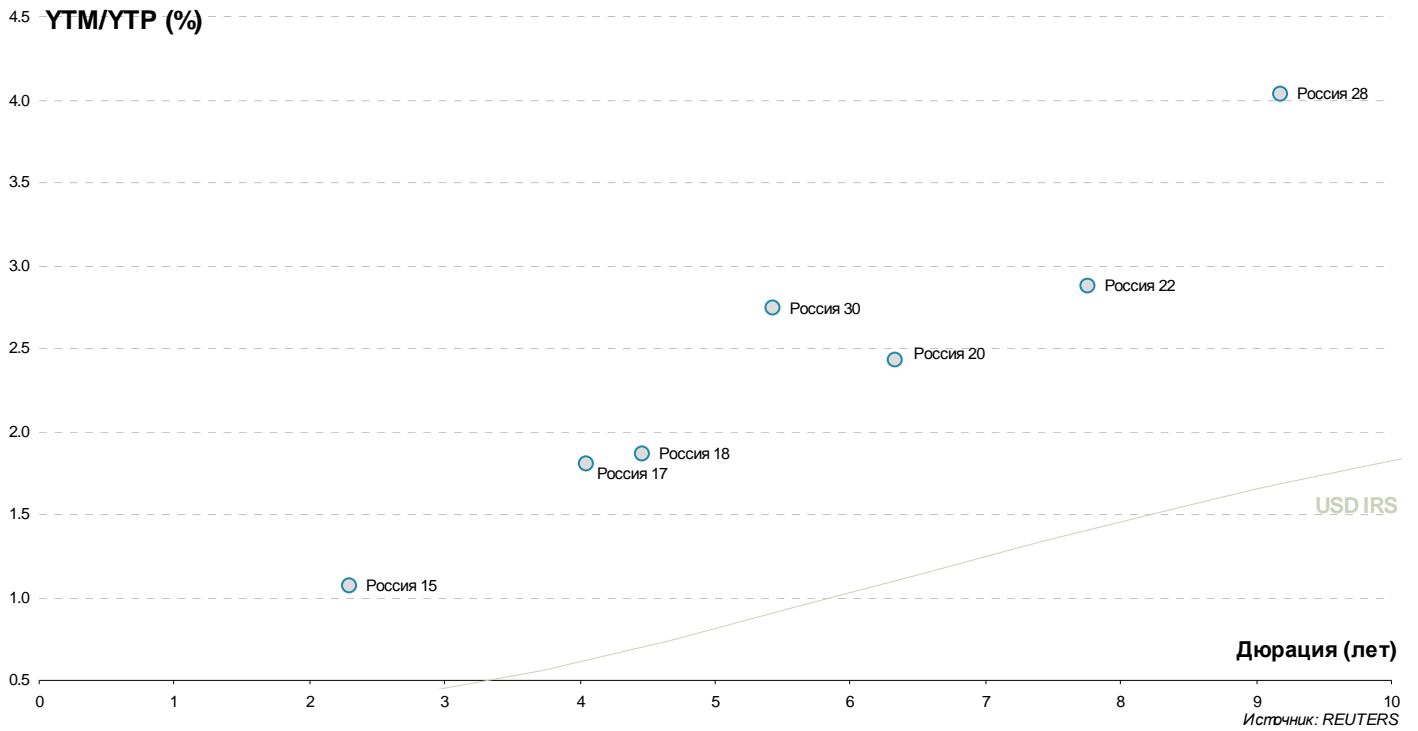
Результаты торгов евробондами

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		105.867	106.122	1.12	1.02	2.30	-0.07	75
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.875	106.125	1.83	1.77	4.04	0.03	123
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.278	149.722	2.05	1.68	4.47	-0.12	127
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.151	127.288	2.75	2.73	5.43	0.13	147
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.050	117.450	2.46	2.41	6.33	0.07	130
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		112.917	113.583	2.91	2.83	7.77	-0.05	144
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		199.447	200.553	4.06	4.00	9.19	0.05	220
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.125	123.625	4.24	4.21	15.97	-0.33	186
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.097	101.115	1.44	1.39	0.36	-0.01	115
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.410	101.707	1.61	0.79	0.35		132
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.969	101.986	1.34	1.29	0.33	0.17	105
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.652	104.152	1.68	0.91	0.62	-0.05	138
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		109.837	110.517	2.69	2.18	1.20	-0.22	240
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		109.333	109.993	2.81	2.30	1.18		251
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		108.867	109.867	2.54	1.95	1.53	-0.22	222
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.760	107.760	2.70	2.37	2.79	-0.11	229
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		106.834	107.834	2.85	2.56	3.21	-0.17	240
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.450	112.450	3.11	2.85	3.57	-0.17	259
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.625	123.125	3.46	3.37	4.48	0.25	272
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.120	130.620	3.86	3.79	5.10	-0.28	295
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.486	111.807	3.24	3.14	2.85	0.11	254
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.000	118.500	4.14	4.08	7.18	0.20	275
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		106.125	106.625	4.17	4.11	7.68	-0.13	269
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		142.125	143.125	5.31	5.25	11.76	-0.38	321
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.000	129.000	5.25	5.19	13.00	0.50	307
Газпром нефть										
GPN CAPITAL '22 4.375%	USD	19/09/22		101.241	101.642	4.22	4.17	7.99	0.49	271
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		103.998	105.998					
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		104.998	105.998	1.55	0.76	1.19		124
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		129.066	129.367	3.06	3.01	4.62	0.06	226
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.935	111.397	3.01	2.90	3.87	-0.06	244
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		112.523	113.523	4.07	3.95	7.42	-0.10	265
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.032	100.457	5.37	5.27	4.33	0.02	475
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.094	107.490	3.14	2.96	2.08	0.01	280
VTB'17 6%	USD	12/04/17		105.886	106.088	4.49	4.44	3.86	0.14	395
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		107.260	108.260	4.72	4.51	4.46	0.01	403
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		109.916	110.416	4.79	4.69	4.68	0.10	406
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		108.222	108.729	5.26	5.18	6.27	0.17	410
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		105.819	106.198	6.15	6.10	7.30	0.18	475
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.405	106.798	5.74	5.71	12.38	0.03	357
VTB' 9.5%	USD			106.105	106.701	8.58	8.49	6.76	0.13	732
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.112	102.154	2.24	2.14	0.42		195
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.130	107.130	3.82	3.37	2.10	-0.26	349
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.770	104.100	4.59	4.47	2.75	-0.23	422
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.750	101.750	5.82	5.57	3.92	0.44	530
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.769	108.973	3.12	3.07	3.75	0.14	257
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		110.008	110.509	3.24	3.14	4.42	0.04	257
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.636	119.139	4.02	3.95	6.03	0.11	288
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		112.375	113.375	4.42	4.30	7.38		300
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		119.161	119.660	4.80	4.75	9.17	0.28	301
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.002	103.030	2.35	2.30	0.53	-0.15	206
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.020	106.319	3.13	2.99	1.87		281
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.105	108.452	3.42	3.29	2.57	0.03	305
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.630	111.800	3.65	3.60	3.04	0.03	319
GAZPROMB'17 5.625%	USD	18/05/17		105.199	105.405	4.32	4.27	3.98	0.07	376
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		106.804	107.352	5.95	5.85	5.24	-0.07	508
GPB EURO' 7.875%	USD			101.428	102.085	7.54	7.39	4.45	0.14	692
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.218	103.264	1.94	-0.44	0.43	0.08	164

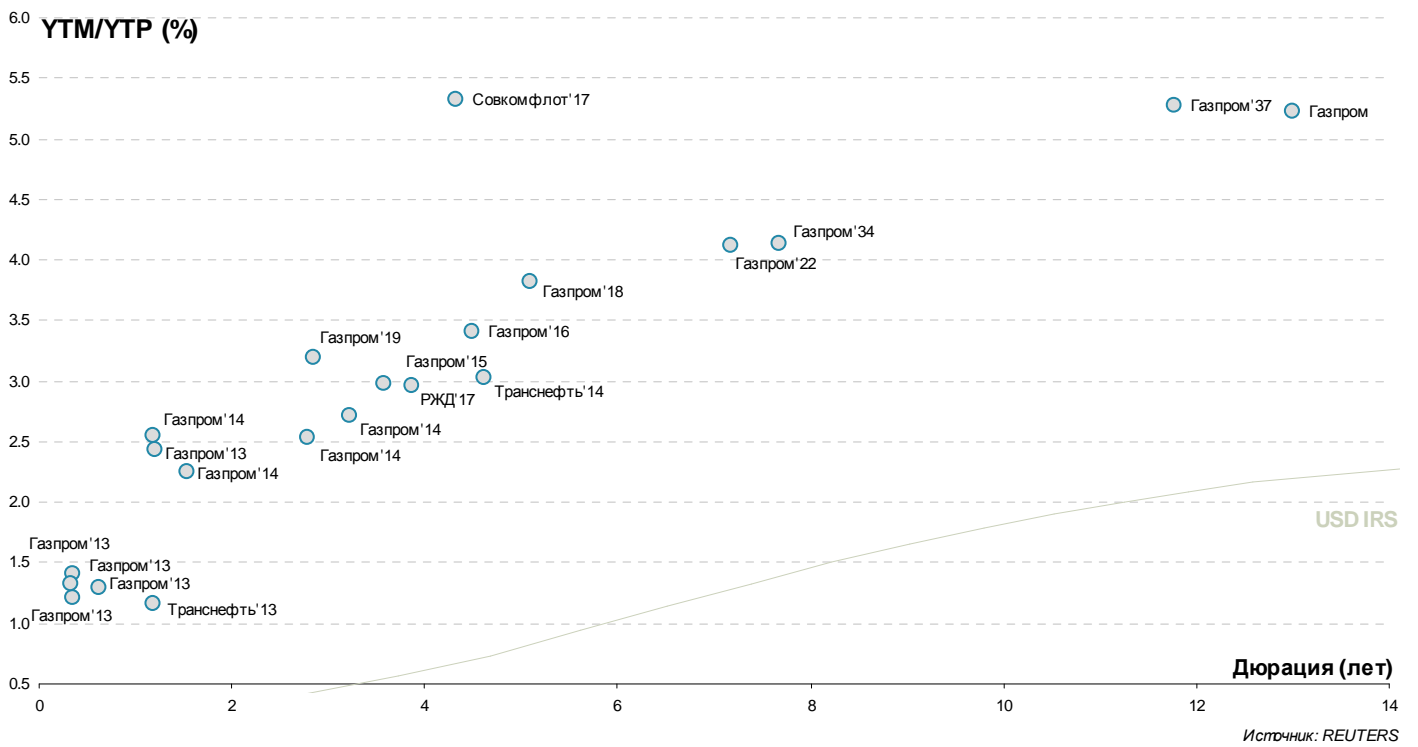
Выпуск	Валюта	Дата Погашения	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14	105.512	105.568	1.98	1.93	1.04	0.01	167
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14	109.152	109.229	2.72	2.67	1.44	0.01	241
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17	109.836	110.235	3.86	3.77	3.94	0.03	329
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17	105.808	106.042	4.01	3.96	4.41	0.06	333
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18	118.317	118.818	3.99	3.89	4.63	-0.01	324
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21	103.256	103.417	4.97	4.92	3.19	-0.37	456
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13	102.225	102.370	1.21	0.88	0.43		91
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13	102.635	103.010	1.68	1.02	0.54		138
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15	107.990	108.389	2.28	2.13	2.39	0.03	190
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17	108.074	108.573	3.36	3.24	3.86	-0.06	280
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17	106.107	106.306	3.36	3.31	3.76	-0.14	282
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19	106.825	107.123	3.99	3.93	5.55	-0.05	301
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21	109.016	110.016	4.43	4.30	6.77	-0.23	314
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22	112.463	113.463	4.45	4.33	7.15	0.34	307
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22	100.812	101.201	5.02	4.97	7.84	0.44	354
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ									
Евраз									
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13	102.369	102.869	2.33	1.01	0.37	0.24	205
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15	109.959	110.678	4.56	4.31	2.65	0.03	420
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17	103.046	103.428	6.58	6.48	3.79	0.43	610
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18	110.897	111.643	7.02	6.87	4.34	-0.01	640
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18	99.589	100.589	6.84	6.62	4.56	-0.03	618
Металлоинвест									
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16	103.125	103.625	5.53	5.38	3.20		512
НЛМК									
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19	99.735	100.020	5.00	4.95	5.79	-0.27	400
Альянс Ойл									
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15	108.569	108.789	5.75	5.65	2.03	-0.16	547
Агроса									
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14	110.341	110.813	3.30	3.06	1.81	-0.01	297
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20	114.188	114.685	5.51	5.44	6.14	-0.10	437
Вымпелком									
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13	102.250	102.500	2.43	1.79	0.38	-0.03	213
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14	99.889	102.111	4.44	2.97	1.49	0.11	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16	106.500	106.500	4.26	4.26	2.84	0.01	386
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16	111.293	111.782	4.66	4.52	3.08	-0.02	426
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17	104.750	105.750	4.99	4.73	3.73	-0.20	448
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18	117.132	117.624	5.41	5.32	4.42	-0.01	472
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21	110.830	111.830	6.04	5.90	6.15		490
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22	109.375	109.775	6.16	6.10	6.81		485
Лукойл									
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14	107.838	108.338	2.14	1.88	1.81	-0.17	180
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17	113.900	114.900	3.02	2.80	4.01	0.03	242
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19	120.368	121.368	3.86	3.71	5.66	-0.12	284
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20	114.065	114.429	4.03	3.98	6.47	0.19	283
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22	120.176	120.613	4.07	4.02	7.41	0.13	264
МТС									
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20	124.689	125.195	4.69	4.62	5.72	-0.11	360
НОВАТЭК									
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16	106.567	106.722	3.11	3.06	2.89	-0.05	270
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21	117.481	117.861	4.06	4.01	6.45	0.48	283
Северсталь									
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13	104.777	105.477	2.08	1.01	0.61	-0.15	178
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14	108.750	109.750	2.62	1.91	1.29	-0.55	231
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16	105.206	106.206	4.67	4.38	3.24	-0.01	423
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17	106.667	107.155	5.13	5.02	4.23	-0.02	452
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22	98.440	98.986	6.11	6.04	7.52	0.31	469
ТМК									
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18	102.301	102.731	7.20	7.10	4.22	-0.20	661
Распадская									
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17	103.439	103.821	6.82	6.72	3.77	-0.09	635
ТНК-ВР									
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13	101.629	104.629					
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15	107.338	108.338	2.69	2.23	2.00	-0.06	235
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16	115.492	116.492	2.93	2.66	3.17	-0.49	247
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17	114.125	115.125	3.07	2.84	3.78	-0.11	251
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18	121.011	122.011	3.46	3.28	4.43	-0.39	274
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20	120.775	121.775	3.89	3.75	5.73	-0.22	282
ЧАСТНЫЕ БАНКИ									
Альфа-Банк									
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13	103.358	103.412	2.86	2.76	0.51	-0.02	258
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15	108.096	108.582	4.21	4.00	2.09	0.01	389
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17	99.767	100.130	6.36	6.26	3.68	0.02	589
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17	110.988	111.988	5.25	5.02	4.06	0.24	465

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

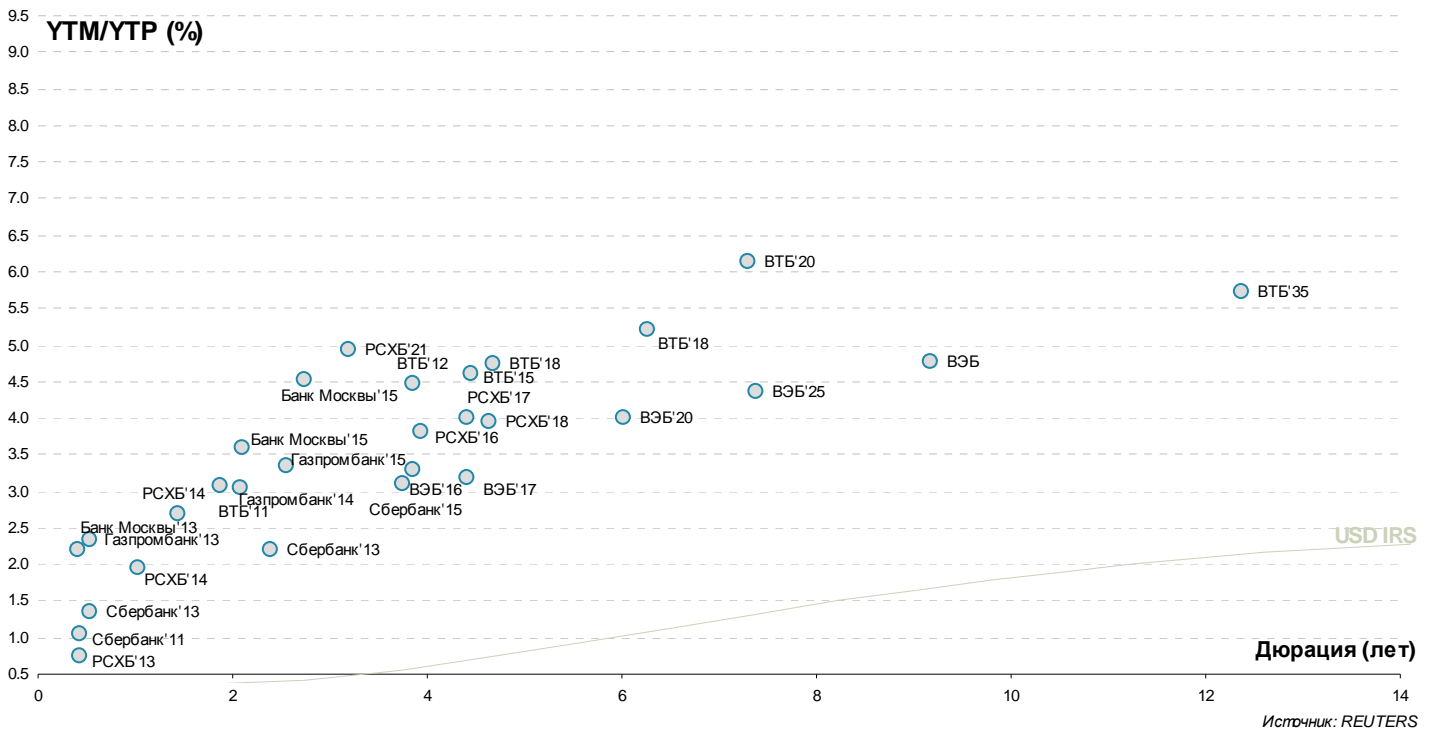
Россия



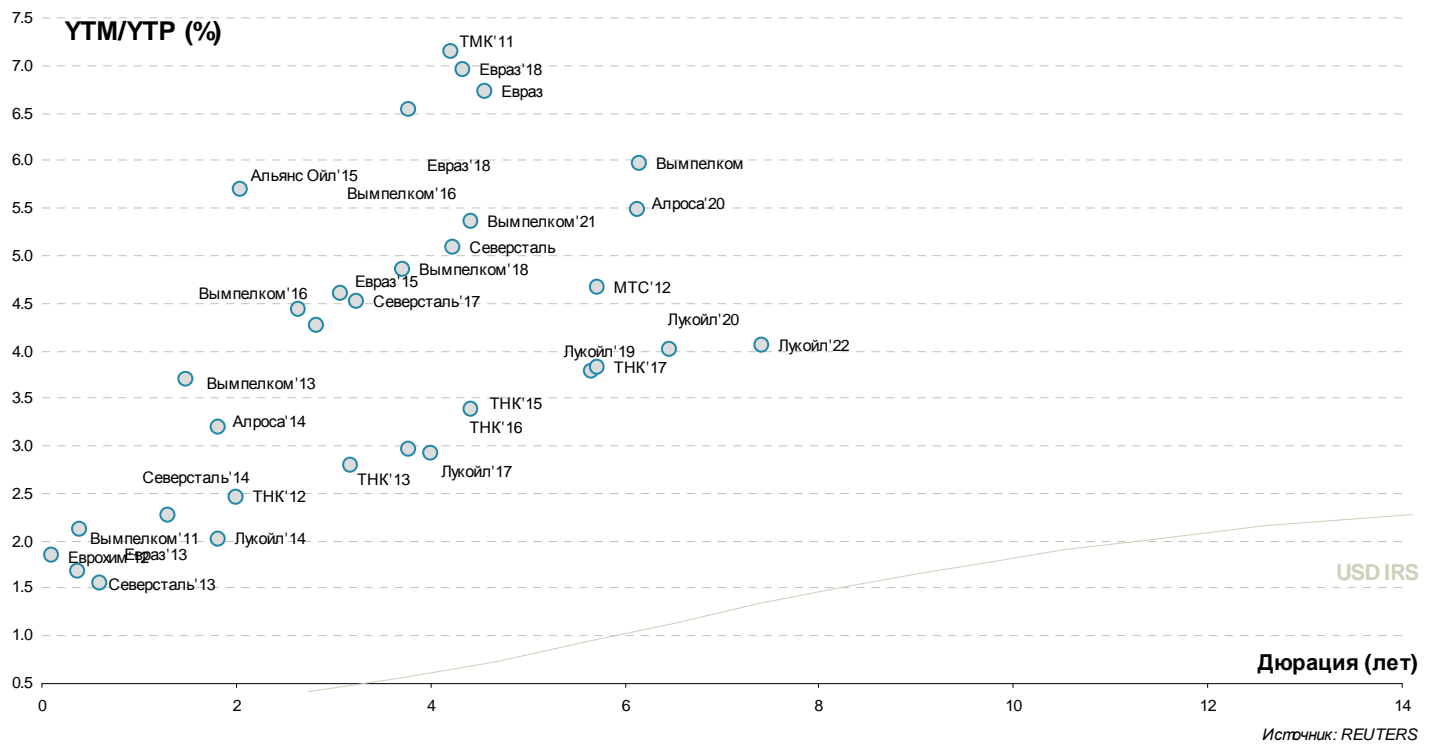
Госкомпании



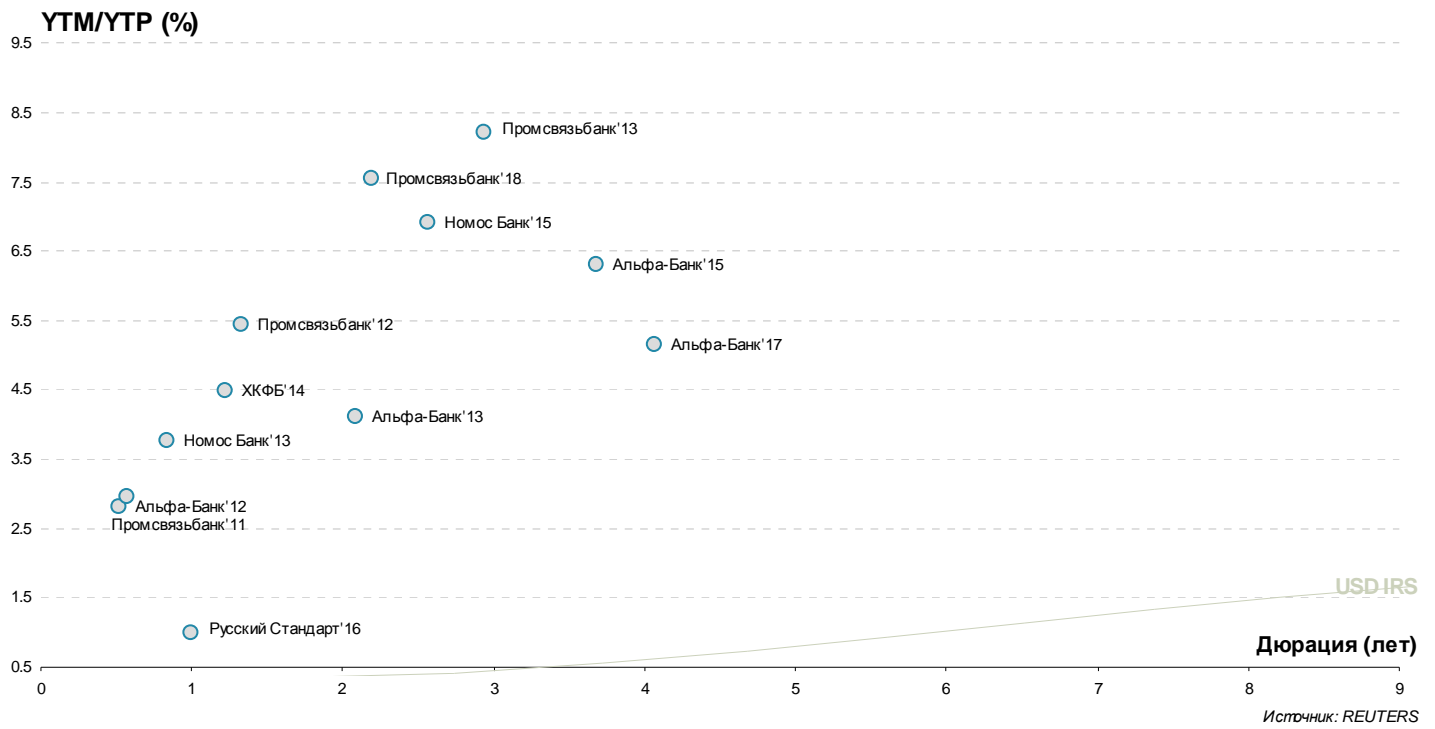
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

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

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

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

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

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