

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Внимание за итоги заседания FOMC и ОПЕК

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Рынок нейтрален, ликвидность пополняется за счет репо с ЦБ
- Рубль продолжает копировать динамику котировок нефти

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды подорожали
- Приток ликвидности создает спрос на среднесрочные ОФЗ

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

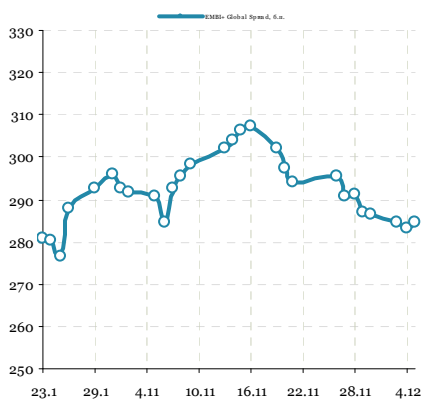
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

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

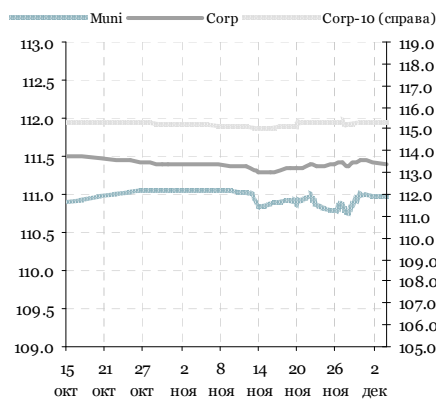
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETVI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETVI

	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

Рязанская область планирует 20 декабря начать размещение выпуска облигаций номинальным объемом 2,5 млрд рублей. Срок обращения займа - 5 лет, выпуск имеет амортизационную структуру погашения номинала. /Финам/

ОАО Банк «ОТКРЫТИЕ» открыло книгу заявок на пятилетние облигации серии 01 объемом 3 млрд руб. Условиями выпуска предусмотрена годовая оферта. Привлеченные средства эмитент планирует направить на финансирование основной деятельности, диверсификацию ресурсной базы, поддержание публичной кредитной истории. /Финам/

Ставка первого купона по облигациям АКБ «ТРАНСКАПИТАЛБАНК» серии 03 объемом 1 млрд руб. установлена по результатам сбора заявок на уровне 13% годовых, говорится в сообщении эмитента. Срок обращения займа составит 5,5 лет, оферта не предусмотрена. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 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.)

Сегодня: 12.12.2012 – среда

Статистика США: FOMC Rate decision, Monthly budget statement, PPI

- **Выплата купона:** ВТБ 24 (ЗАО), 5 (1-ИП) (8.65%, 323.5 млн руб.), Ханты-Мансийский банк, 02 (9.25%, 138.3 млн руб.), ТВЗ, БО-01 (6.5%, 64.8 млн руб.), Водоканал-Финанс, 01 (8.8%, 87.7 млн руб.), ЮниКредит Банк, БО-01 (9%, 224.4 млн руб.), Мечел, 02 (7.4%, 184.5 млн руб.), Москоммерцбанк, 03 (10%, 249.3 млн руб.)
- **Размещение:** Главная дорога, 06 (8.2 млн руб.), Ипотечный агент БЖФ-1, Б (328.7 млн руб.), Ипотечный агент БЖФ-1, А (1.1 млрд руб.), Транскапиталбанк, 03 (1 млрд руб.)
- **Оферта:** РосДорБанк, 01 (1 млрд руб.)
- **Погашение:** ММК, БО-02 (10 млрд руб.)

Завтра: 13.12.2012 – четверг

Статистика США: Retail sales, PPI, Initial jobless claims, Continuing claims

- **Выплата купона:** МТС-Банк (МБРР), 05 (9.5%, 236.8 млн руб.), Лукойл, БО-06 (9.2%, 229.3 млн руб.), Лукойл, БО-07 (9.2%, 229.3 млн руб.), ЕБРР, 04 (7.11%, 53.2 млн руб.), Департамент Финансов Тверской области, 34006 (12.5%, 93.5 млн руб.), Банк Санкт-Петербург, БО-04 (8.5%, 127.1 млн руб.), НПК Уралвагонзавод, 01 (9.25%, 138.3 млн руб.), Чувашия, 31008 (7.75%, 19.3 млн руб.), Московское областное ипотечное агентство, 03 (7.75%, 135.2 млн руб.), Национальный банк ТРАСТ, 2012-2 (CLN) (11%, 1.9 млн долл.)
- **Погашение:** Лукойл, БО-06 (5 млрд руб.), Лукойл, БО-07 (5 млрд руб.), Национальный банк ТРАСТ, 2012-2 (CLN) (35 млн долл.)

Внешний рынок долга

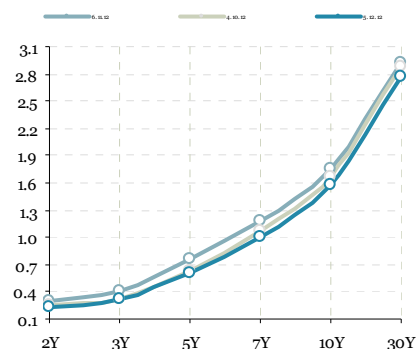
Внимание за итоги заседания FOMC и ОПЕК

Оптимизм глобальных рынков остается в силе и поддерживается как неполными экономическими данными, так и ожиданиями новых послаблений со стороны ключевых Центробанков. В частности вчера инвесторами был отмечен индекс доверия к экономике Германии, который по предварительной оценке вырос в текущем месяце до 6.9 против -15.7 п. в ноябре. Нервозность ожиданий переговоров по налогам и бюджету в США заметно смягчают ожидания, возложенные на 2-дневное заседание FOMC ФРС США, которое завершится сегодня. Завершение программы «твист» в конце текущего года позволяет рынкам надеяться, что один из наиболее податливых регуляторов объявит о дополнительном количественном смягчении через чистый выкуп долгосрочных US-Treasuries. Со стороны ФРС было бы логичным предложить рынкам продолжить выкуп долгосрочных казначейских обязательств, поскольку регулятор уже выкупает ипотечные ценные бумаги, для которых базовым активом служат долгосрочные UST. Продление программы «твист» возможно, но этот сценарий маловероятен. По состоянию на 5 декабря на балансе ФРС находилось казначейских обязательств со сроками погашения до 5 лет на сумму 396 млрд долл. против 1.258 трлн долл. более долгосрочных бумаг. Таким образом, запаса менее «длинных» бумаг у ФРС немного, поэтому если ФРС и объявит о намерении продолжить держать дальний конец кривой UST, то наиболее эффективным стали бы именно новые покупки (QE в чистом виде).

Помимо заседания ФРС сегодня стоит обратить внимание и на очередную встречу ОПЕК, по отношению к которой у участников рынка более сдержанное отношение. Наиболее вероятно, что картель сохранит прежнюю квоту добычи в 30 млн барр. в сутки, поскольку котировки нефти остаются на комфортном значении для добывающих стран и на не угрожающем для стран-потребителей.

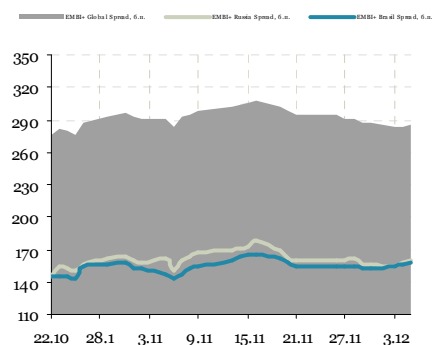
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



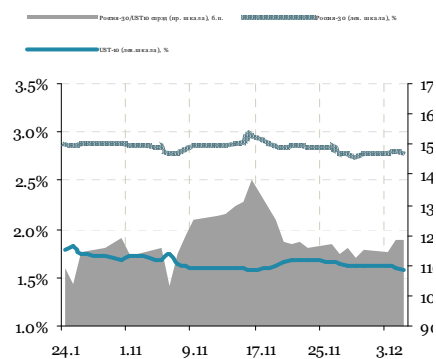
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



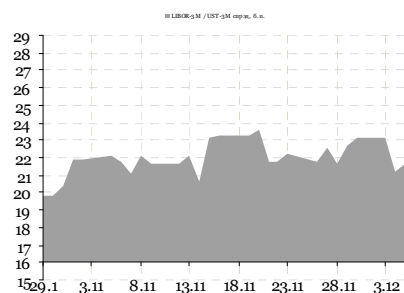
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Рынок нейтрален, ликвидность пополняется за счет репо с ЦБ

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка вчера существенно не изменилась. Уровень краткосрочных процентных ставок держался на уровне понедельника: кредиты овернайт на рынке МБК обходились в среднем под 6.45% годовых, 1-дневное междилерское репо с облигациями – под 6.35% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банкам удалось привлечь на 1 день 396 млрд руб. (спрос в 421 млрд руб., на 7 дней – 1.12 трлн руб. (1.09 трлн руб. неделей ранее). Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 81.5 млрд руб. до 941.4 млрд руб.

Состояние рынка остается довольно аморфным. Процентные ставки слабо реагируют на пополнение рублевой ликвидности, поскольку оно вызвано ростом спроса на репо с ЦБ РФ. Мы ожидаем сохранения ставок МБК вблизи текущих отметок до конца текущей недели.

Рубль продолжает копировать динамику котировок нефти

Торги на валютном рынке вчера завершились небольшим ослаблением рубля в рамках понижательной коррекции. Курс бивалютной корзины по итогам дня поднялся на 8 коп. до отметки 34.86 руб. Движение рубля отражает аналогичное поведение нефти. Так, цена барреля Brent вчера в течение дня оставалась немного ниже пиков, отмеченных в понедельник, чуть ниже 108 долл. Сегодня ситуация на глобальных рынках складывается нейтрально для рубля и, если заседание ОПЕК не преподнесет сюрпризов, рубль продолжит консолидацию вблизи текущих уровней.

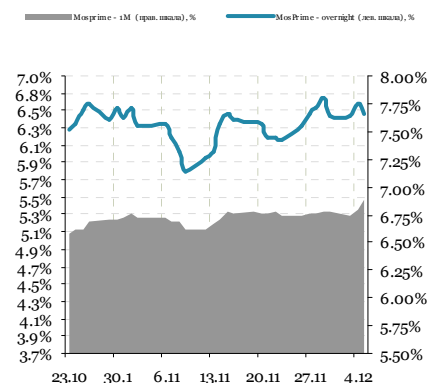
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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		377
Вторник	Аукцион Казначейства 7 недель, 70 млрд руб., от 6.5% годовых	396
Среда	Аукцион ОФЗ	ОФЗ 26209, 10 лет, 30 млрд руб.
	Возврат в бюджет	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

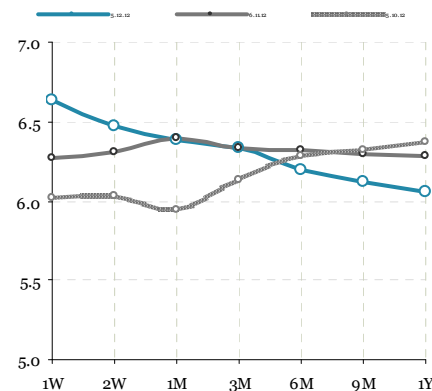
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды подорожали

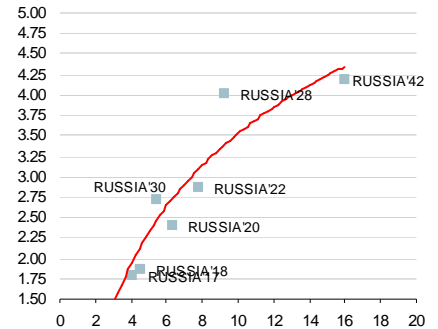
Спрос на российские евробонды во вторник подрос, что было в большей степени заметно в корпоративном сегменте. Спреды суверенных бумаг сокращались преимущественно со стороны роста доходностей UST, тогда как непосредственно на кривой был замечен лишь точечный рост цен, затронувший выпуски Russia'30 и Russia'42, и в обоих случаях не превышавший 25 бп. Корпоративный сектор торговался фронтально вверх по ценам и в среднем подорожал на те же 25 бп. На кривой Газпрома результат лучше рынка показал выпуск GAZPRU'22, прибавивший порядка 50 бп, со схожим результатом завершили день бумаги Роснефти. Еще лучше торговались выпуски ВТБ, прибавившие в ценах в среднем по кривой порядка 75 бп, а также дальние выпуски Сбербанка, показавшие такой же результат. В секторе частных компаний спрос был замечен на дальнем участке кривой Вымпелкома, где рост цен превышал 50 бп, почти на фигуру подорожал дальний выпуск Северстали SNMFRU'22.

Приток ликвидности создает спрос на среднесрочные ОФЗ

На локальном рынке инвесторы несколько снизили активность в ОФЗ, но котировки подросли – преимущественно в середине и ближе к началу кривой, видимо, отражая приток ликвидности в банковскую систему. Доходности на ближнем участке потеряли до 5 бп, но основная активность была сосредоточена в дальнем выпуске 26207, где цены в середине дня достигали отметки 112%, однако к вечеру опустились на уровень четверга – 111.80%, в итоге завершив день с нулевым результатом. В корпоративном секторе преобладал точечный спрос в первом эшелоне, где покупали выпуски ФСК 25 (+25 бп), Роснефть 04 и 05 (+20 бп), выше по уровню кредитного риска интерес инвесторов был замечен в бумагах Почты России, а также ТЕЛЕ2 05, подорожавших на 30 бп.

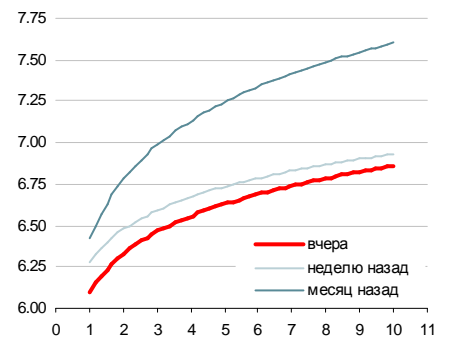
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



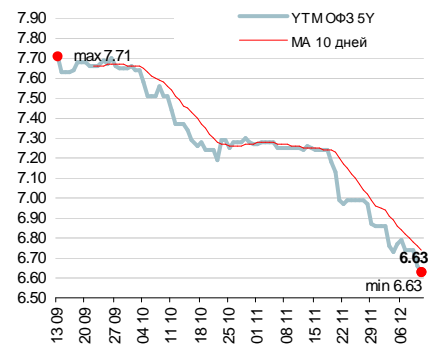
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



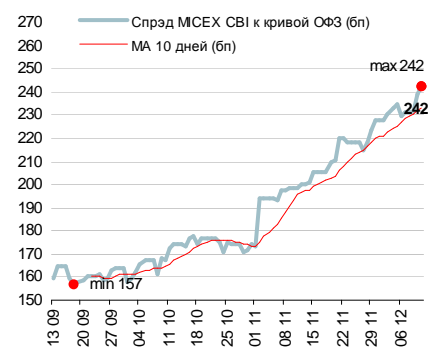
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



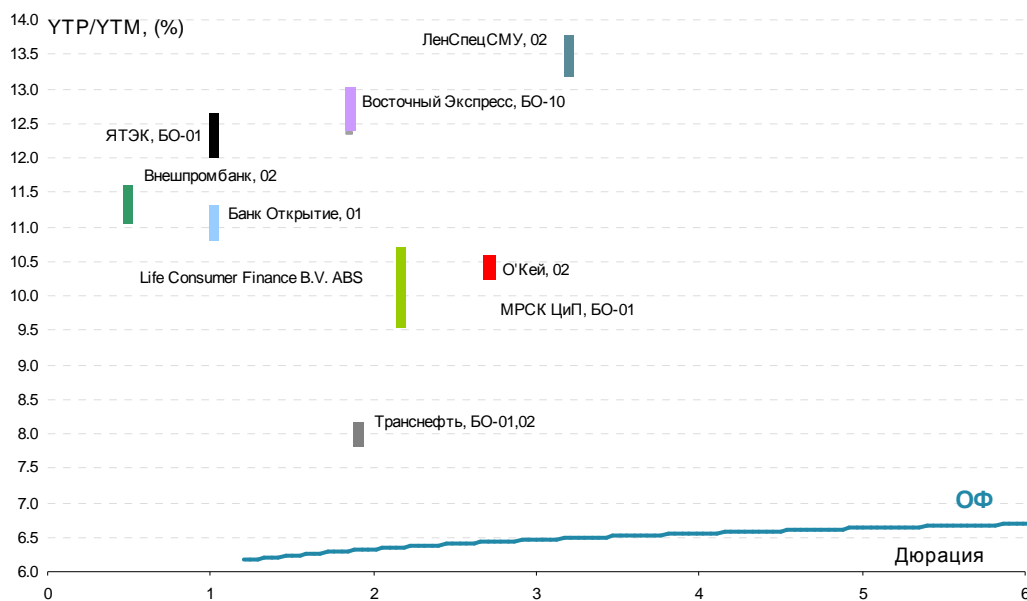
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Ориентир УТР/УТМ	Закрытие книги	Дата размещения	Амортизация/Дюрация	Оферта/Погашение
О'Кей, 02	- / - / В+	да	3 000	10.25-10.51	13.12.2012	18.12.2012	нет / 2.68 г.	3 г. / 5 лет
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Ва2 / -	да	4 000	9.41-9.94	14.12.2012	18.12.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
ЛенСпецСМУ, 02	В / - / -	да	5 000	13.10-13.65	14.12.2012	18.12.2012	да / 3.18 г.	нет / 5 лет
Внешпромбанк, 02	В / В2 / -	да	1 500	11.04-11.56	14.12.2012	19.12.2012	нет / 0.5 г.	0.5 г. / 5 лет
Банк Открытие, 01	В / - / В	да	3 000	10.78-11.30	14.12.2012	19.12.2012	нет / 1 г.	1 г. / 5 лет
ЯТЭК, БО-01	- / - / В-	да	3 000	12.01-12.55	19.12.2012	21.12.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
Транснефть, БО-01	BBB / Ваa1 / -	да	17 000	7.85-8.16	18.12.2012	24.12.2012	нет / 1.89 г.	2 г. / 3 г.
Транснефть, БО-02	BBB / Ваa1 / -	да	17 000	7.85-8.16	18.12.2012	24.12.2012	нет / 1.89 г.	2 г. / 3 г.
КБ Восточный Экспресс, БО-10	- / В1 / -	да	3 000	12.36-12.89	19.12.2012	25.12.2012	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
Правоурымское, 01	NR	нет	3 000	н/д / 100%	9.20	9.20	11.12.2012	нет / 2.68 г.
ДельтаКредит, 09-ИП	- / Ваa1 / -	да	5 000	1.7 / 100%	9.20-9.46	9.36	11.12.2012	нет / 2.68 г.
МКБ, 11	В+ / В1 / ВВ-	да	3 000	н/д / 100%	12.63-13.69	12.63	11.12.2012	нет / 4.11 г.
АгроКомплекс, БО-01	NR	нет	1 000	н/д / 100%	Конкурс	10.00	10.12.2012	нет / 1 г.
НЛМК, 08	BBB- / Ваa3 / BBB-	да	10 000	2.0 / 100%	8.84-8.99	8.58	07.12.2012	нет / 2.71 г.
Газпром Нефть, 12	BBB- / Ваa3 / -	да	10 000	3.7 / 100%	8.78-8.99	8.68	05.12.2012	нет / 4.17 г.
АИЖК, 24	BBB / Ваa1 / -	да	6 000	2.8 / 100%	8.69-8.90	8.43	05.12.2012	да / 2.64 г.
Глобэкс, БО-07	BB / - / ВВ	да	5 000	1.0 / 100%	9.15-9.36	9.20	04.12.2012	нет / 1 г.
ММК, 18	- / Ваa3 / ВВ+	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	ВВ+ / - / ВВВ-	да	10 000	н/д / 100%	8.63-8.89	8.73	08.11.2012	да / 2.70 г.
Европлан, 03	- / - / ВВ-	да	3 500	1.5 / 100%	11.57-12.10	11.57	06.11.2012	нет / 1.84 г.
Русфинанс Банк, БО-03	- / Ваa3 / ВВВ+	да	4 000	1.1 / 100%	9.73-10.25	10.25	02.11.2012	нет / 1.86 г.
АПРОСА, БО-01	ВВ- / Ва3 / ВВ-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 г.
АПРОСА, БО-02	ВВ- / Ва3 / ВВ-	да	5 000	н/д / 100%	8.93-9.26	9.15	02.11.2012	нет / 2.66 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	100.14	100.15	100.15	-0.00	45	214 933	5.87	0.12			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.12	100.13	100.13	0.03	28	262 650	5.87	0.16			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.70	101.75	101.75	-0.04	1	6 500	6.00	0.28			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.12		100.12	0.12	10	7 369	6.02	0.59	10		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.45	100.42	-0.03	2	174	6.17	0.82	14	17	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	101.02	101.15	101.15	0.03	19	72 338	6.22	1.20	6	31	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.10	109.45	109.15	0.05	7	71 248	6.30	1.54	6	46	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.25	109.50	109.25		2	7 000	6.43	1.80	14	65	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.30	103.38	103.35	0.15	15	85 532	6.35	1.85	5	58	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.50	101.65	101.60	0.18	9	18 513	6.39	2.32	1	67	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.25	111.45	101.35	0.22	2	2	6.40	2.36	2	68	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	102.84	103.05	102.68	0.18	2	20	6.48	2.77	5	79	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	98.80	99.45	99.45	0.40	3	21 344	6.67	2.85	23	98	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.70	101.80	101.70	0.40	5	154 995	6.47	3.22		79	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	99.00					6.91	3.51	40	123	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.59	3.41	109	191	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.69	103.90	103.80	0.15	3	10 010	6.49	3.78		81	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.70	103.90	103.75	0.35	10	129 486	6.53	3.80		85	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.64	104.85	104.75	0.05	5	25 022	6.52	4.40		82	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	92.25	94.50	96.35	4.97	6	99 104	6.28	4.44		57	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.70	101.90	101.70	3.60	5	75 599	6.73	4.56	13	102	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	105.19	105.40	105.25	0.40	6	121	6.56	5.01		82	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19							8.04	5.50	138	224	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	98.50	98.60	98.60	0.10	6	20 073	7.06	6.24	36	118	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	106.24	106.45	106.45	0.15	16	82 811	6.69	6.34		80	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	106.25	106.45	106.25	-0.15	14	155 972	6.62	6.89	9	86	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	92.70	94.09	91.70	0.10	1	1	7.14	7.38	38	112	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	111.80	112.00	111.80	-0.19	30	573 875	6.95	8.77	14	75	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.75	95.00	94.50	-0.50	3	3 001	7.54	11.16	65	103	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.55	11.10		5	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	99.76	99.95	100.00	0.20	3	55 900	7.10	0.62	116	103	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО6		05/03/13	100.05	100.30	100.05	-0.05	3	3 000	7.59	0.23		139	10 000
----------	--	----------	--------	--------	--------	-------	---	-------	------	------	--	-----	--------

НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.50	100.58	100.58	0.03	1	7 000	7.73	0.50		161	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	-------	------	------	--	-----	-------

НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.50	100.58					7.85	0.50		173	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	-------

НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.00	100.50					8.21	1.63	195	239	5 000
----------	----------	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

НЛМК ВО7		11/11/14							8.37	1.79	208	259	10 000
----------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК 7/d	16/03/15	05/09/22	100.20	100.50					8.54	2.07	220	280	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.92	100.04	99.98	0.06	1	1	7.81	0.31		164	8 000
---------	--	----------	-------	--------	-------	------	---	---	------	------	--	-----	-------

ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	100.00	100.10	100.05	0.05	3	5 000	8.25	0.66	229	219	5 000
---------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	-------	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.70	99.05	-0.61	4	1 800	8.65	1.16	250	273	5 000
---------	--	----------	-------	-------	-------	-------	---	-------	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО6		10/06/14							8.98	1.47	275	313	5 000
---------	--	----------	--	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО7		22/07/14	97.50	100.00					8.82	1.51	259	298	5 000
---------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.35	100.44	100.44	-0.06	2	201	7.27	0.18		103	10 000
--------------	--	----------	--------	--------	--------	-------	---	-----	------	------	--	-----	--------

Севсталь ВО4		15/02/13	99.95	100.44					7.27	0.18		103	5 000
--------------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	-------

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.21	100.22	100.18	-0.05	1	120 000	8.14	0.52	226	203	8 000
-----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	---------	------	------	-----	-----	-------

Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.22	100.23					8.05	0.53	216	195	8 000
-----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Алроса 23		18/06/15	100.02	101.79					8.92	2.24	256	319	7 000
-----------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Алроса 20		23/06/15	100.21	110.05	100.95	0.15	2	5 349	8.80	2.25	243	308	3 000
-----------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	-------	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО1		30/10/15	100.55	100.75	100.55	0.05	5	37 130	8.91	2.56	250	320	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО2		30/10/15	100.45	100.60	100.50	0.05	4	48 707	8.93	2.56	252	322	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Евраз

Евраз 1/	22/03/13	13/03/20	100.13	100.30	100.15	-0.20	3	170	8.78	0.28		260	10 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	-----	------	------	--	-----	--------

Евраз 3/	22/03/13	13/03/20	100.13	100.29	100.29	0.19	2	2	8.25	0.28		207	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	---	------	------	--	-----	-------

Сибметинвест 1/	16/10/14	10/10/19	107.60	107.75	107.60	-0.01	1	777	9.13	1.67	286	332	10 000
-----------------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	-----	------	------	-----	-----	--------

Сибметинвест 2/	16/10/14	10/10/19	107.60	107.70					9.06	1.67	279	325	10 000
-----------------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

Евраз 2/	26/10/15	19/10/20	100.70	101.73	101.50	-0.10	2	10 400	9.55	2.55	314	384	10 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Евраз 4/	26/10/15	19/10/20	100.00	101.72					9.76	2.55	335	405	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Евраз 5/	06/06/16	27/05/21	90.00	96.15	96.03	0.01	2	454	10.01	3.08	354	433	5 000
----------	----------	----------	-------	-------	-------	------	---	-----	-------	------	-----	-----	-------

Евраз 7/	02/06/16	25/05/21	90.00	96.50	96.03	6.03	2	132	10.01	3.07	354	433	15 000
----------	----------	----------	-------	-------	-------	------	---	-----	-------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест

Металлоинвест 1/d	16/03/15	07/03/22	100.00	100.03	100.03	0.03	8	4 386	9.18	2.05	284	344	5 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	-------	------	------	-----	-----	-------

Металлоинвест 5/d	16/03/15	07/03/22	100.00	100.10	100.00		4	41 565	9.19	2.05	285	345	10 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	--	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест 6/d	19/03/15	10/03/22	100.00	100.17	100.17	0.15	5	23 656	9.10	2.06	276	336	10 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Мечел

Мечел ВО2/		12/03/13	99.65	99.95	100.00	0.20	6	51 027	9.86	0.25		367	5 000
------------	--	----------	-------	-------	--------	------	---	--------	------	------	--	-----	-------

Мечел 5/d	16/04/13	09/10/18	96.00	100.00	100.00	-0.19	3	1 800	11.71	0.34		555	5 000
-----------	----------	----------	-------	--------	--------	-------	---	-------	-------	------	--	-----	-------

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот,			Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп		шт	УТМ/УТР	Дюрация	ОФЗ	свопам	
Мечел ВО3/		24/04/13											
Мечел 2/d	15/06/11	12/06/13											
Мечел 4/d	25/07/13	21/07/16	99.50	99.70									
Мечел ВО4/	11/02/14	10/02/15	94.65	95.25	95.25	-0.05	6	1 561	15.33	1.10	920	940	5 000
Мечел 15/d	18/02/14	09/02/21	91.81	92.00	92.00	0.05	5	512	16.49	1.13	1035	1 057	5 000
Мечел 16/d	18/02/14	09/02/21	91.85	92.00	92.00	0.01	8	10 415	16.49	1.13	1035	1 057	5 000
Мечел ВО5/		07/04/15											
Мечел ВО7/		07/04/15											
Мечел ВО11		07/04/15											
Мечел ВО12		07/04/15	99.30										
Мечел ВО6/		07/04/15											
Мечел 13/d	01/09/15	25/08/20	82.00	89.78									
Мечел 14/d	01/09/15	25/08/20	86.00	88.97	88.96	8.83	3	5	15.64	2.35	926	992	5 000
Мечел 17/d	02/06/16	27/05/21	81.21	84.00	81.22	0.04	5	3 254	16.21	3.03	975	1 053	5 000
Мечел 18/d	02/06/16	27/05/21	83.38	87.47	83.41	0.01	1	3	15.20	3.04	873	952	5 000
Мечел 19/d	07/06/16	01/06/21	81.74	84.97	84.97	3.47	3	458	14.48	3.06	801	880	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	100.00	100.09									
СУЭК													
СУЭК 1/d	05/07/13	26/06/20	100.27	100.40	100.36	0.16	9	22 207	8.85	0.54	295	275	10 000
РМК													
РМК 3/d	17/12/13	15/12/15	96.75	98.00	98.40	1.30	1	500	12.48	0.94	640	651	3 000
РМК 4/d	05/06/14	02/06/16	91.80	93.00	91.84	-1.93	2	918	15.95	1.42	974	1 009	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.11	97.79	96.52	-1.11	4	106	11.67	1.40	546	580	5 000
Русал													
Русал 7/d	03/03/14	22/02/18	94.21	94.50	94.46	0.06	14	1 047	13.77	1.16	762	785	15 000
Русал 8/d	15/04/15	05/04/21	89.31	89.59	89.31	-0.26	22	29 300	14.48	2.13	813	875	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.57	99.79									
РЖД 10		06/03/14	108.95	109.15	109.00	0.05	3	29 000	7.34	1.14	120	142	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.36	102.50	102.51	0.15	7	52 384	7.84	1.93	152	209	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.60	100.40	99.84	0.04	2	2	8.01	2.67	159	231	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.60	99.75									
РЖД 19	16/07/18	08/07/24		100.97									
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6/d	26/09/13	15/09/20	99.75	100.25									
ФСК ЕЭС 8/d	26/09/13	15/09/20	99.75	100.05									
ФСК ЕЭС 18/	09/06/14	27/11/23	100.78	100.98	100.80	-0.05	3	34 000	8.08	1.43	186	222	15 000
ФСК ЕЭС 15/	23/10/14	12/10/23	97.10	102.00	101.30	-0.12	3	40 500	8.14	1.75	186	235	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15		100.40	100.25	-0.05	5	2 599	8.13	2.18	177	240	10 000
ФСК ЕЭС 10/	24/09/15	15/09/20	99.17	99.90									
ФСК ЕЭС 7/d	27/10/15	16/10/20	98.25	98.95	98.25	-0.45	1	7	8.36	2.61	194	266	5 000
ФСК ЕЭС 12/	22/04/16	19/04/19	96.01	99.80									
ФСК ЕЭС 25/	27/09/16	14/09/27	101.25	101.40	101.05	0.25	6	114 003	8.44	3.27	195	276	15 000
ФСК ЕЭС 21/	19/04/17	06/10/27	101.10	103.00	101.15		3	110 000	8.60	3.68	207	292	10 000
ФСК ЕЭС 9/d	24/10/17	16/10/20	98.25	98.95	98.25	0.10	2	1 700	8.61	4.08	205	293	5 000
ФСК ЕЭС 11/	24/10/17	16/10/20	98.25	98.95									
ФСК ЕЭС 19/	18/07/18	06/07/23	97.00	99.00									
ФСК ЕЭС 13/		22/06/21	96.70	99.43	99.25		2	500	8.81	6.00	212	296	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.25	100.69									
Росавтодор													
Росавтодор 1/d		29/11/16	101.00	102.00									
Росводоканал													
Росводоканал 3/d	11/11/13	09/11/15	99.00	99.25	99.21	0.11	6	296	10.15	0.90	409	417	3 000
Водоканал													
Водоканал 1/d		09/12/15											
Западный СД													
Западный СД 1/d	29/04/16	13/05/31	98.80	99.20									
Западный СД 2/d	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20									
Западный СД 3/d	24/02/17	06/02/32											
Западный СД 4/d	24/02/17	06/02/32	98.90	100.25									
Западный СД 5/d	24/02/17	06/02/32	85.00	100.30									
Почта России													
Почта России 1/	25/03/14	22/03/16		100.50									
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.75		100.75	0.45	10	50 009	8.57	2.57	216	286	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	110.14									
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	100.50	100.50	0.10	10	189 001	8.67	2.57	226	296	3 000
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	99.71	100.00	99.80	0.05	2	37 001	7.53	1.12	139	161	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.00	109.40	109.20	-0.30	5	12 850	7.43	1.36	123	156	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	
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22	101.37	101.95	101.50	0.25	11	27 547	8.38	4.05	182	270	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.37	101.95	101.45	0.20	23	98 003	8.40	4.05	184	272	10 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							9.12	0.01			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							-23.01	0.01			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.20	100.55					7.52	0.97	143	156	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	99.18	99.37	99.37	-1.63	1	1 760	7.85	0.10		155	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13		100.20	99.99	-0.01	4	1 005	7.26	0.33		109	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13		100.99					7.26	0.33		109	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.55	100.75	100.75		6	10 199	8.01	1.96	169	226	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.28	101.50	100.80	0.30	7	1 801	8.37	2.75	194	267	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.75	101.47	100.75	0.25	4	3 844	8.39	2.76	196	270	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.50	105.00	105.00	2.75	1	1 013	7.85	4.15	128	216	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	99.45	99.99	99.50	2.50	2	20 000	8.49	4.37	191	279	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.06	100.14	100.12	-0.14	1	15 000	7.39	0.52	151	128	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.30	100.60	100.60	0.20	3	707	8.27	2.55	186	256	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.60	100.35	-0.05	1	1 425	8.37	2.55	196	266	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.20	100.60					8.35	2.55	194	264	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.41	100.00	99.86	-0.10	6	208	7.55	0.76	154	153	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.08	100.09	100.07		9	7 713	8.53	3.29	204	285	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	100.10	100.13					8.51	3.29	202	283	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	100.00	100.09	100.07	-0.03	2	50 999	8.53	3.29	204	285	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.00	101.20	101.00	0.01	3	5 000	8.44	0.96	235	248	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.15		101.30	0.10	1	50 000	8.50	1.97	218	275	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.90	100.20	99.90	-0.30	2	8 300	10.12	0.61	418	405	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	99.01	101.00	99.23	0.11	8	838	10.20	1.08	407	427	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	95.01	100.00					10.79	3.07	432	511	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21							10.78	2.94	433	510	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.81	99.90	99.90		6	3 575	12.69	0.59	676	661	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.79	3.00	333	411	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.49	100.55	100.50	0.12	4	15 395	7.87	0.56	196	178	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.04	100.07	100.07	0.02	44	288 333	6.00	0.03			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.98	100.12	100.12	-0.02	1	200	7.11	0.12		83	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13							7.82	0.25		163	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13							8.45	0.25		226	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13							7.86	0.25		167	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.01	100.25	100.15	0.07	1	1	7.96	0.72	197	193	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.61	99.91					8.19	0.82	216	219	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15							8.20	1.19	204	229	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15							8.24	1.19	208	233	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90		100.00		10	1 000	8.68	2.49	228	297	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90		100.00		10	1 000	8.68	2.49	228	297	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90						8.03	0.46		190	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14							8.92	1.82	262	314	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.00	100.20	100.05	-0.05	1	320	8.26	0.68	229	221	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.80	100.05					9.35	0.08			10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.25	99.75	99.75	0.10	1	1 290	7.90	0.25		171	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.99	100.45					7.63	0.37		148	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.20	0.76	219	218	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	98.80	99.60	98.80	-0.70	3	12	8.94	0.70	296	290	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.45	99.75					7.46	0.97	137	150	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50	99.80		1	90	8.58	1.23	241	268	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.40	99.75					7.26	0.85	122	127	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.35	100.73					8.20	2.05	186	246	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	101.05	110.00	99.25	-1.75	1	1	9.04	2.54	263	333	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.00	101.70	101.00		2	100 001	8.31	2.56	190	260	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	98.70	99.50					8.42	2.91	197	273	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21			100.00		10	820	8.67	3.27	218	299	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.20	99.25					8.50	4.07	194	282	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.05	99.40					8.42	1.28	224	253	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.90	101.50					8.53	1.76	224	274	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.75	101.15					8.47	1.76	218	268	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	
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.50	100.80	100.70		1	174	8.80	1.88	249	303	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	99.00						8.89	2.92	244	321	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	100.50	99.32	0.02	2	11 180	9.03	2.92	258	335	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.40	100.60	100.40		7	21 554	8.52	1.23	235	262	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.30	101.00	100.70	-0.05	2	11 164	8.92	1.57	267	309	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	100.05	100.20					8.49	1.38	228	262	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	100.10	100.75					8.52	1.38	231	265	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.15	101.00					7.78	0.16		153	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.15	100.60					8.07	0.16		182	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.35	99.79					7.61	0.50		149	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	100.19	100.20					8.09	0.63	214	203	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.45					8.09	0.64	214	203	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.19	100.20					8.14	0.69	216	210	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	98.05		100.20	0.01	3	18 999	8.14	0.69	216	210	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						6.95	0.79	93	94	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	100.01	100.10	100.09	-0.01	1	1	8.24	0.86	219	225	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	99.51	100.65	100.45	0.44	13	39 004	8.37	0.88	231	239	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.10	101.38					8.16	1.11	203	223	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.00	100.50					8.20	1.57	195	237	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	86.00	101.50					7.61	1.75	133	182	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22		100.20					8.42	1.75	214	263	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.20	100.45	100.20	-0.14	1	2 000	8.62	2.14	227	289	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.15	98.40					8.69	2.30	232	297	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.15	98.75					8.69	2.31	232	297	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.15	98.75					8.69	2.31	231	297	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.02		100.02	0.02	4	33 673	8.03	0.04			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.20	99.45	99.45		3	3 260	7.82	0.59	189	174	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	94.00						8.01	0.97	192	205	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15			100.70	0.25	2	7 000	7.99	1.09	186	206	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.85	100.89	101.00	0.15	3	1 965	8.33	1.47	210	248	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16		100.50	100.00		11	1 000	8.67	2.57	226	296	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	99.93						8.67	2.56	226	296	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	99.94						8.67	2.56	226	296	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	99.95						8.67	2.56	226	296	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30	100.00					8.12	1.04	201	218	3 000
АИЖК-11 А1	15/03/15	15/09/43							8.44	1.67	217	263	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.49	98.00	-1.49	3	38	8.94	1.74	266	315	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.50					8.51	1.78	222	272	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24		99.40					8.41	2.22	205	268	6 000
АИЖК А8		15/06/18							8.35	2.64	193	265	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.00	99.70					8.59	2.93	214	291	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23							8.61	2.93	216	293	7 000
АИЖК А21		15/02/20	100.21	101.30	101.10	1.10	1	1	8.71	3.11	224	303	15 000
АИЖК А11		15/09/20							8.67	3.69	214	299	10 000
АИЖК А16		15/09/21							8.98	4.82	236	325	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					9.06	5.42	240	327	8 000
АИЖК А20		15/12/27							8.88	8.37	208	273	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	99.15	100.22					8.98	0.97	289	302	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	100.00						9.10	0.97	301	314	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.75						9.62	1.51	339	378	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.51	329	368	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.98	100.00	100.03	0.05	1	1	8.18	0.18		194	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.35					7.56	0.65	160	150	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.30	99.84	99.75	-0.10	6	3 341	8.24	0.92	217	227	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	99.76					8.56	1.29	238	267	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.50	101.25					8.54	2.61	212	284	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.21	100.32	100.32	0.17	2	9 100	7.50	0.50	163	139	10 000
МТС 1		17/10/13	99.31	99.94					7.45	0.83	141	145	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.16	99.29					8.11	1.35	191	223	15 000
МТС 2		20/10/15	98.10	99.99					8.62	2.59	221	292	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.50	99.75	99.20	-0.24	3	4 823	8.64	2.64	222	294	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	98.60	100.00					8.97	3.15	249	329	15 000
МТС 7		07/11/17	99.65	100.20	100.00	0.21	5	1 801	8.89	4.07	233	321	10 000
Вымпелком													

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	
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.70	100.84					7.90	0.58	198	182	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.49	98.50	98.30	-0.11	4	90 000	8.76	1.47	253	291	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.75	100.20	99.95	-0.05	2	182 000	9.06	2.08	272	332	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.97	100.15	100.05	-0.15	5	114 333	9.01	2.06	267	327	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.75	100.35	100.34	0.27	10	79 618	8.86	2.06	252	312	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.30	98.74	98.75	0.35	3	88 000	8.99	2.55	258	328	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	97.50	99.00	97.50	-0.80	1	1	9.53	2.55	312	382	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.00	100.50	100.21	-0.24	2	10 001	8.07	1.72	179	227	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.00	99.45					8.65	0.54	275	255	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	98.00	100.00	98.00	-1.30	1	10	12.10	0.40		595	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	101.50	101.50	0.85	2	45 003	7.66	1.10	153	173	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	101.24	100.60	0.10	6	146 518	8.51	1.10	238	258	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.11	100.45	100.44	0.33	3	21 001	8.95	2.13	260	322	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.00					9.28	2.99	282	360	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00	96.53	-0.51	2	482	9.81	2.99	335	413	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.01	98.25					9.59	2.99	313	391	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	99.81	99.95	99.80	-0.02	4	6 588	8.50	0.21		228	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90						8.47	0.73	248	244	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90	100.15					9.87	0.73	388	384	1 000
Магнит БО-3		09/09/20	99.90						8.29	0.73	230	226	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	99.92	100.02	99.90		7	33 000	8.54	0.73	255	251	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.25	99.95					8.79	1.16	264	287	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.80	99.45	99.20	0.20	1	1	8.55	1.31	236	266	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.40	100.60	100.50	-0.10	1	500	8.87	2.48	247	316	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16		99.00					9.44	1.43	322	358	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	88.00	99.00					8.10	1.44	188	224	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.08	100.25	100.20	0.03	3	10 002	9.63	2.49	323	392	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	98.50	99.00	99.00		1	3	8.97	0.60	304	289	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.75	99.90	99.86	-0.14	4	270	9.50	0.77	349	349	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.61	100.00	99.85	0.24	1	55	10.59	0.44		446	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.15		100.30	1.25	2	2 800	8.05	0.89	199	207	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.01	100.19					9.42	0.79	340	341	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.30	1.92	499	554	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.90	99.97	99.97	0.01	9	3 634	12.93	0.51	705	682	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	94.00	94.60					11.69	2.26	532	597	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.31	95.80	95.26	-0.74	1	72	12.38	1.50	615	654	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	97.80	99.05	99.00	0.95	10	7 000	8.12	1.61	186	230	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	94.01	95.84					12.45	1.07	633	651	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	99.99	100.11					-35.35	0.02			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	99.07	99.25	99.07	-0.03	4	13 514	9.68	1.09	355	375	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	98.60	101.60	100.05	0.05	1	220	10.74	2.46	434	503	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	13/12/12	07/12/17							9.12	0.01			3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.55	99.65					9.89	0.69	391	385	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	97.01	99.47					12.06	0.84	602	606	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	100.95					8.58	0.73	259	255	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	98.50						10.17	0.03			3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.90	100.00	100.00		2	885	9.15	0.36		299	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.60	100.00	99.76		7	3 737	9.08	0.36		292	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17		101.00					8.13	0.75	212	211	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.91	100.15	100.15		1	725	8.99	0.39		284	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.05	101.81	101.83	0.25	8	137 672	9.46	0.57	355	337	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	
Гидромашсервис													
ГМС 02		13/02/15	100.46	101.99	100.65	-0.15	7	1 163	10.66	1.93	434	491	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.94	100.05	100.05	0.05	3	11 000	7.68	0.32		151	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	97.55	100.09					7.52	0.32		135	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.30	100.45	100.40		12	49 084	7.59	0.21		137	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.05	100.40					8.76	1.63	250	294	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	97.01	102.00	99.70	0.60	4	73 180	9.82	1.31	363	394	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.30	100.64	100.64	0.44	13	46 984	9.89	2.00	356	415	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.75	100.60	100.56	-0.10	2	10	9.93	2.00	360	419	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.00	100.10	100.10	-0.10	10	616	12.66	0.70	668	662	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	99.97	100.01	100.01	-0.01	49	12 870	12.83	0.84	679	683	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.21	100.95	100.25	-0.55	1	1	12.09	0.28		591	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.30	100.99					12.68	0.28		650	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.35						10.36	0.38		421	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.35	99.85					10.36	0.38		421	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15			100.20	-0.02	5	240 000	8.54	0.47		242	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15	99.00						10.38	0.94	430	441	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	97.00	100.00					13.23	0.96	714	727	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.02	97.50					12.05	1.21	589	614	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	96.45	98.30	96.45	-1.55	1	1	12.57	1.21	641	666	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.66	3.07	219	298	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру гидро 1	22/04/16	12/04/21	99.00	99.38					8.52	2.98	206	284	10 000
Ру гидро 2	22/04/16	12/04/21	98.29	99.39					8.81	2.98	235	313	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16							8.46	0.20		223	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.75	101.70	100.75	0.15	9	63 052	8.45	1.84	215	268	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.00	100.25					8.96	2.47	256	325	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.00	100.25	100.05	0.05	1	50 000	8.97	2.58	256	326	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.70					8.23	2.16	188	250	3 000
ЭНЕЛ ОГК-5													
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.30	100.39	100.39	0.05	6	6 847	7.86	0.50		174	4 000
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14							8.27	1.44	205	241	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	90.01	96.99					12.94	1.41	673	708	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	88.00	92.39	91.03	-1.37	2	1 092	12.37	2.93	592	669	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	100.05	100.55					9.02	2.54	261	331	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.53	98.97	96.10		3	13 280	10.93	1.59	468	510	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.62	0.04			2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.90	99.30	99.29	0.29	2	500	8.18	0.54	228	208	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	99.05	99.40					8.64	1.19	248	273	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.35	99.30	99.26	0.91	4	2 804	9.45	0.65	349	339	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.06	86.95	86.95	-0.04	28	715	31.18	0.74	2518	2 516	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.95	99.00	0.75	2	327	10.25	0.81	422	425	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	100.00						9.22	0.93	314	325	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00		98.20	-1.25	2	2 800	9.26	1.27	308	337	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.85	99.94					8.62	0.71	263	258	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	97.01						14.35	0.38		820	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.92	98.60	98.30	0.39	1	1	11.09	0.70	511	505	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	98.90	100.20	100.20	-0.05	1	3 000	9.00	2.25	263	328	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.45	2.65	303	375	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.55	99.99	99.00		1	1	9.77	0.75	376	375	4 000

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	
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	101.30	101.79	101.17	0.07	1	148	8.70	0.92	263	273	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	99.95					11.28	1.40	507	541	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.00	98.00					10.47	1.40	426	460	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.56	100.65	100.65	0.20	2	2	9.70	2.51	330	399	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.18	98.89					10.52	1.27	434	463	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Гру ппа 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.17					9.11	0.14		284	5 000
ЛСР Гру ппа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.04	0.51	416	393	2 000
ЛСР Гру ппа БО-2		10/09/13	100.05	100.34	100.29		2	8	9.78	0.72	379	375	2 000
ЛСР Гру ппа 3	14/03/14	08/09/17	100.05	100.60					11.29	1.18	514	538	3 000
ЛСР Гру ппа БО-3		20/03/14	98.20	98.39	98.35	0.05	13	4 029	11.20	1.20	504	529	2 000
ЛСР Гру ппа БО-5		24/07/14	96.25	96.30	96.25	0.10	3	824	11.36	1.50	513	551	2 000
ЛСР Гру ппа 04	24/10/14	20/10/17	99.81	100.25					11.61	1.72	533	581	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	100.01	100.30	100.02	0.03	7	6 135	10.04	0.02			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	100.27	102.00	101.03	-0.16	10	8 506	13.27	1.25	710	737	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	102.20						8.30	0.44		217	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	98.60	99.40	99.40	0.10	10	51 921	9.26	3.99	270	358	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	98.60	99.40					9.47	3.99	292	379	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	98.60	99.40					9.47	3.99	292	379	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.55	100.00	100.00	0.54	2	10	8.94	3.42	244	326	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.41	100.45	100.45	0.05	2	2 610	7.84	0.24		164	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.65	99.90	99.90	0.30	2	1 050	8.58	1.55	234	275	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.30	98.60	98.45	-0.01	15	95 444	8.71	1.79	242	293	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.50	99.32	99.28	-0.05	13	579	12.08	0.58	616	599	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.21	100.39	100.37	0.03	5	517	11.55	0.49		543	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.10	100.27					12.31	0.79	629	630	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.31	100.35	100.35	0.04	11	192 533	8.24	0.43		210	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.34	100.45	100.36	0.04	9	28 900	8.36	0.52	248	225	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	99.92	99.99	99.95	0.15	1	2 000	8.24	0.55	234	215	5 000
РОСБАНК А3/	06/05/11	06/11/13	98.70	98.79	98.76	0.06	15	36 428	8.51	0.89	245	253	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.61	100.75	100.73	0.33	11	32 604	9.02	1.62	276	320	10 000
РОСБАНК А5/	06/05/11	07/11/14	97.50	100.00					9.04	1.80	275	326	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2/d	07/06/13	02/12/16		100.82	100.82	-0.13	3	33 460	7.64	0.49		152	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.10	100.21	100.21	0.01	5	24 525	8.31	0.78	229	230	10 000
Альфа-Банк 1/d	04/02/14	02/02/16	99.70	99.85					8.55	1.09	242	262	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.00						8.55	1.16	240	263	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/13	16/12/14							9.68	0.95	360	372	5 000
МДМ Банк 8/d	09/07/13	09/04/15	100.08	100.20	100.16	0.08	7	814	8.90	0.56	299	281	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14		100.35					9.18	1.22	302	328	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14		99.88	99.80	-0.03	8	31 947	8.72	0.35		256	5 000
НОМОС Банк 9/d	15/06/12	14/06/13							8.92	0.48		280	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	99.90	100.13	100.05		11	222 109	9.24	0.64	329	318	5 000
НОМОС Банк 12/	25/08/13	28/08/13	96.75	99.79					9.04	0.68	307	300	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.50	99.80	99.80	0.05	3	9 375	9.47	1.14	333	355	5 000
НОМОС Банк 11/	02/07/14	02/07/14	99.65	101.00	100.00	0.05	2	275	9.72	1.42	350	386	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.03	100.10	100.10	0.07	1	25	8.69	0.45		256	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.05	100.15	100.13	0.03	1	1 904	8.10	0.16		185	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.15					8.37	0.18		213	3 000
Банк ЗЕНИТ 1/d	07/04/12	07/04/13	99.51	99.75					9.43	0.32		326	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.25					8.85	0.48		273	5 000
Банк ЗЕНИТ 6/d	02/07/13	01/07/14	100.25	100.33	100.33	0.03	1	1 915	8.74	0.53	285	264	3 000
Банк ЗЕНИТ 8/d	28/08/13	23/08/17	100.20	100.27	100.25	0.02	8	151 685	8.99	0.69	301	295	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.76	161	160	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.15	100.23					8.99	0.91	292	301	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.05	100.20					9.29	1.27	311	340	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2/d	20/02/13	18/02/15	99.98	100.05	99.98	-0.08	4	2 776	8.93	0.19		270	5 000
Промсвязьбанк 4/d	20/02/13	18/02/15		100.06					8.66	0.19		243	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	
Промсвязьбанк 6/d		17/06/13							8.84	0.50		272	5 000
Промсвязьбанк 3/d		04/02/14			99.40	0.07	6	134	9.35	1.09	322	342	5 000
Промсвязьбанк БО7	06/09/14	06/09/15	100.35	100.69	100.35		2	3 600	10.15	1.60	390	433	5 000
Промсвязьбанк 3/d		01/02/18	100.20	100.70					12.42	3.81	588	674	5 000
Банк СПб													
Банк СПб 1/d	09/10/12	09/04/13	95.00						8.27	0.04			5 000
Банк СПб 4/d	13/12/12	12/12/13							9.20	0.94	312	323	3 000
Банк СПб 2/d	26/03/12	23/09/13	99.80	99.91					9.30	0.76	329	328	5 000
Банк СПб 8/d	07/10/13	05/10/15	100.00	100.35	100.25	0.06	5	3 819	9.36	0.80	333	335	5 000
МКБ													
МКБ /d	15/01/13	14/07/15	100.10	100.22					7.47	0.10		117	2 000
МКБ -01/d	22/02/13	22/02/14	99.80	99.93	99.93	0.01	1	1	8.94	0.20		272	3 000
МКБ -03/d	27/04/13	27/04/15	99.88	99.95					9.76	0.38		361	4 000
МКБ -02/d	25/09/13	25/09/15	99.81	99.90	99.90	0.10	1	1 000	10.09	0.77	408	407	3 000
МКБ /d	09/10/13	08/04/15	99.60	99.80					10.50	0.81	447	450	3 000
МКБ -04/d	15/10/12	15/04/14	100.00						10.52	1.27	434	463	5 000
МКБ -05/d		23/06/14	98.15	98.25	98.25	0.18	5	670	10.73	1.40	452	486	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14							6.60	0.02			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	100.15	100.41					8.94	0.71	295	290	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15		100.27					8.98	0.68	301	293	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.43	100.60	100.40		1	667	9.53	1.13	339	361	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.85	99.89	99.85	-0.04	3	5 995	9.13	0.73	313	310	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.03	100.07					9.86	1.15	372	394	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.20	100.30	100.20		8	18 500	9.39	0.50		327	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	100.01	100.10	100.07	0.02	7	29 336	9.73	0.70	375	369	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	98.95					10.33	0.77	432	431	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.75	100.85	100.76	-0.19	3	12 430	11.21	1.07	509	527	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.98	1.08	485	505	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	100.00	100.29	100.30		6	13 560	11.16	1.14	502	524	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.70						11.00	1.85	470	523	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.70					11.16	1.95	484	541	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.98	99.05	99.00	-0.40	28	17 391	11.82	0.62	588	575	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.45	100.70	100.45		14	7 710	12.47	0.63	652	640	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК 4/d	18/04/13	16/04/15	100.58	100.65	100.58	-0.01	14	5 263	11.73	0.35		557	2 000
ТКС БАНК 6/d	16/07/13	09/07/15	101.20	101.24	101.24	-0.04	10	1 940	11.97	0.56	606	588	2 000
ТКС БАНК 2/d		28/07/13	105.45	105.48	105.45	-0.05	5	281	10.99	0.58	507	491	1 000
ТКС БАНК /d		20/09/13	101.11	103.15					10.30	0.74	430	428	2 000
ТКС БАНК 2/d	29/11/11	26/11/13	104.38	104.40	104.40	0.10	20	756	11.84	0.92	577	587	2 000
ТКС БАНК 3/d	21/08/12	18/02/14	102.67	102.95	102.70	-0.05	3	510	11.79	1.10	566	586	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.10	100.15	100.15	0.05	50	26 465	14.40	0.62	846	833	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.01	100.99	100.00	-0.01	3	3 301	10.75	0.88	469	477	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.90	100.10	100.10	0.15	3	69	8.72	0.76	271	270	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.40	100.20	-0.05	7	54 863	9.47	1.59	322	364	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16		100.03					7.56	0.86	151	157	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19							7.89	1.10	176	196	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18							8.02	1.12	188	209	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.20	110.25	100.75	0.36	1	50 000	8.38	2.04	205	264	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	101.02					8.93	1.36	273	305	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.10	100.29					8.50	0.70	252	246	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.00	100.30	100.20	0.07	2	22 000	8.35	0.71	236	232	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.65	99.50	0.07	1	1	8.36	0.71	237	232	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14							8.76	0.94	268	279	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.45	100.65	100.65	0.34	5	45 701	8.90	1.74	262	311	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15		100.65	100.65	-0.25	4	490	8.90	1.75	262	311	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	253	335	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	100.90	100.86		1	80	7.97	0.96	189	201	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.67	99.85					7.81	0.94	173	184	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		229	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.25	100.21	-0.08	7	489	9.35	0.89	329	337	5 000

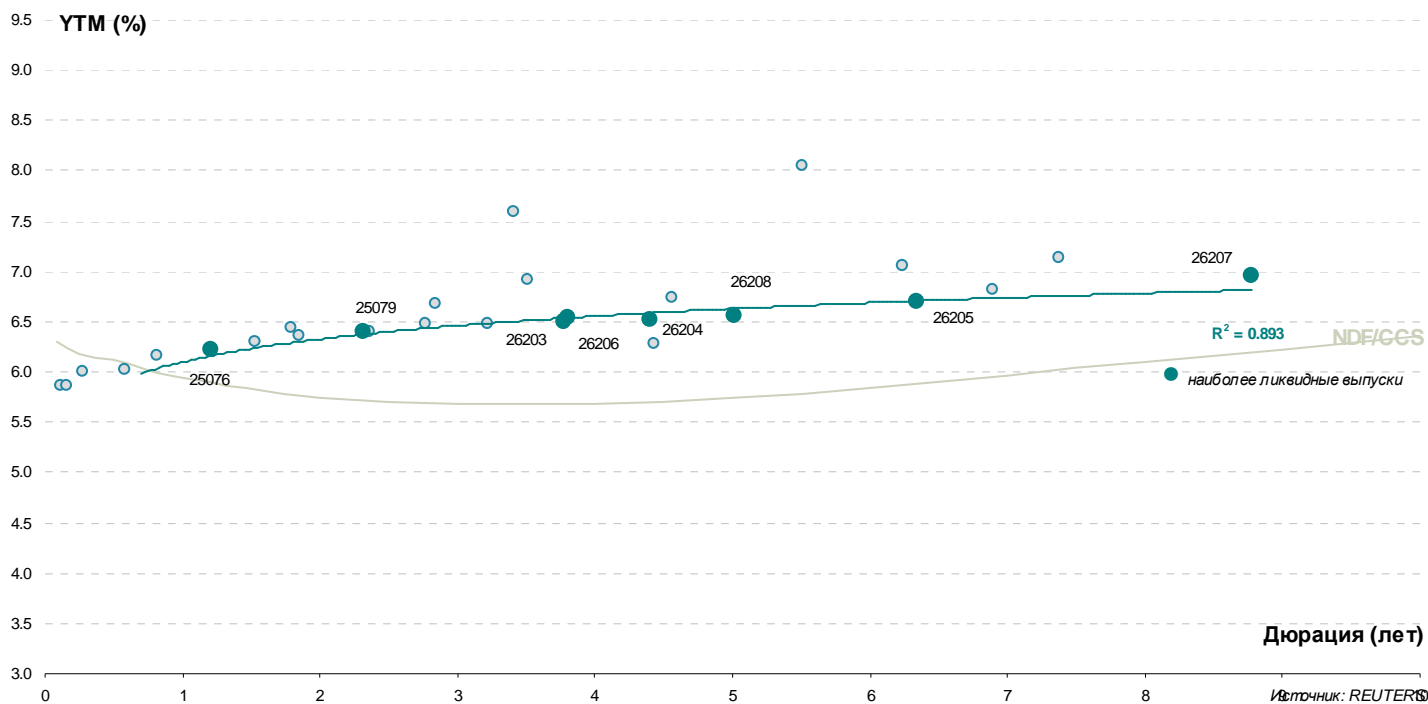
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.15					8.56	0.29		238	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.37					9.14	0.87	308	315	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.52	99.90					8.01	0.24		181	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.01	100.55	100.55	0.10	2	1 036	10.53	0.66	457	448	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.51	100.50					10.09	0.82	405	409	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30	100.70	100.89	0.29	2	1 935	10.69	1.21	453	478	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	12/03/13	10/06/14	99.96	100.10	100.01	0.03	3	11 603	9.68	1.41	347	382	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.96	100.10	100.10	0.15	1	25	8.44	0.34		228	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	98.90	99.95					9.42	0.84	338	342	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.10	100.35	100.29		3	1 101	9.96	2.12	361	423	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10					7.78	1.24	161	188	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	98.90		99.15	0.15	4	10 001	8.91	0.55	301	281	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.30	100.00	100.00	0.75	9	41 350	8.91	0.72	292	288	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	100.50					8.77	0.74	277	275	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.30	100.80	100.50	0.20	3	29 998	8.71	0.75	271	269	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	98.79					9.71	0.90	364	373	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.25					9.55	0.90	348	357	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.65	100.94	100.94	0.24	5	6	9.66	1.76	338	387	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.37	100.65	100.55	0.15	7	93 201	8.51	0.63	256	245	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.20	97.90					8.89	1.41	268	303	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	1.76	311	361	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.27	100.42	100.27	0.01	1	3	10.50	1.15	435	458	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.46	97.65	97.61	0.16	9	844	10.53	1.22	436	463	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.31	96.40	96.55	0.04	2	2 000	10.55	1.52	431	471	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.11	0.48			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.15	100.20	100.20	0.05	2	5 000	9.24	0.46		311	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	99.30	100.00					9.99	0.56	408	390	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.00	100.30					9.88	0.81	385	388	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.15	100.15	0.10	3	1 500	9.80	0.80	377	379	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	99.86						9.83	1.12	369	391	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.20					10.08	1.10	395	415	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.01	97.44	97.09	-0.01	2	232	10.68	1.32	449	480	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.70	99.90					9.36	0.81	333	336	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	99.95	100.35					9.96	1.30	377	407	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14							8.40	0.02			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14							7.32	0.02			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.10	100.25	100.24	0.10	1	3 695	9.13	0.35		297	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.52	100.65					9.45	0.51	357	334	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	20/12/12	09/12/21			99.75	-0.33	1	6	19.60	0.02			5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	99.75	100.19					11.27	0.37		512	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	100.10	101.05					9.18	0.89	312	320	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.71	2.44	332	400	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	100.20					11.27	0.83	523	527	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	98.85	100.15	100.10	-0.05	2	6	10.65	0.22		444	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	100.20	100.30					10.85	0.80	482	484	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14		99.90					9.48	0.15		322	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					10.07	0.34		391	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	99.00	100.85					11.36	0.80	534	535	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	20/12/13	22/06/15							10.32	0.95	424	436	2 000
Абсолют банк													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	91.00	96.95					10.31	1.52	407	447	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.30					9.10	0.33		293	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	100.00	100.08	100.10	0.05	2	15 001	9.63	0.37		348	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.00	100.20					11.05	0.76	504	503	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.70	100.05	100.00	0.25	3	5 000	10.24	0.93	416	427	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.80	100.49	100.49	0.59	1	130	11.28	0.70	530	524	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.15	100.12		1	5	9.08	0.16		283	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	98.00	101.00	100.14	0.09	4	4 920	10.06	0.59	413	398	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.00	100.45	100.41	-0.02	1	4 950	10.31	0.65	435	425	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.50	100.20	100.20	0.20	1	1	9.23	0.45		310	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.56	99.70					9.24	0.55	334	314	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.35	100.67					9.74	0.81	371	374	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	100.20	100.98	100.20	0.05	15	31 790	12.06	0.85	602	607	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.56	99.84	99.78	0.03	6	5 536	9.47	0.82	344	347	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15		100.35					9.66	0.83	362	366	5 000
УБРИР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	98.01	100.40	100.26	-0.08	8	7 711	11.00	0.38		485	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.40	100.70	100.60	-0.09	2	1 000	11.98	0.78	596	597	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14	86.00	100.00	99.99		1	1	10.14	0.03			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.75	101.00	100.75	-0.05	1	1	11.58	0.65	562	552	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.60	99.93	99.93	-0.02	1	44	11.15	0.85	510	516	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	100.01	100.20	100.00		18	88 333	12.65	0.94	657	668	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12							10.00	0.01			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.03	100.07	100.07	0.02	4	2 005	11.06	0.19		483	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.01	100.15	100.05	-0.10	4	3 678	10.17	0.21		395	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.65	99.95					11.41	0.33		524	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.20	100.70	100.70	-0.15	17	7 826	12.46	0.81	643	646	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.50	99.43					11.66	0.97	557	570	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.91	100.10	100.10	0.20	2	1 102	12.55	1.26	637	666	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	526	579	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		103.45	104.40					5.59	0.47			30 000
Москва 53	01/09/13		100.00	100.10	100.05	0.05	3	2 000	7.03	0.71	104	99	15 000
Москва 63	10/12/13		107.80	108.78					5.94	0.95			15 000
Москва 62	08/06/14		107.43	108.35	108.35	0.35	8	41 466	6.58	1.39	37	71	35 000
Москва 39	21/07/14		97.57	100.05	99.75	-0.14	1	1 275	7.29	1.51	106	145	10 000
Москва 64	24/06/15		98.45	99.46	99.46	0.93	4	17 002	7.37	2.29	100	165	20 000
Москва 44	16/11/15		112.00						7.21	2.55	80	150	40 000
Москва 56	22/09/16		98.01	98.11					7.86	3.33	136	218	20 000
Москва 49	14/06/17								7.67	3.80	113	199	25 000
Москва 48	11/06/22								7.77	7.03	103	180	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.01	100.90	100.89	0.39	1	24	7.28	0.50		116	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.50	100.10	99.60	0.15	5	10 416	8.48	1.29	230	259	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	03/12/12								-14.27	0.01			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.27	100.00					8.78	1.67	251	297	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.52	102.95					8.69	2.17	234	296	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		102.65	103.20					6.95	0.40		81	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.35	101.40	101.35	0.15	7	111 619	8.16	0.97	207	220	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.50	100.00					8.94	1.98	262	320	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.81	100.11	100.00		1	4 816	8.16	0.33		199	3 000
Якутия 9	19/09/13		101.10	101.40					7.37	0.50	150	126	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.30	100.35					8.38	1.20	222	247	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАИ													
Краснодарский край 2	14/12/12									0.01			2 000
Краснодар 02	05/11/15		99.26	100.30	99.44	-0.81	2	5 600	9.47	2.19	311	374	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.77	99.98					8.41	1.22	224	251	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАИ													
Красноярский край 5	29/11/16		100.97	101.17					8.52	1.42	231	266	9 000

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	
КОМИ													
Коми Респ 7		22/11/13	99.82	100.00					8.15	0.93	207	218	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.70	99.71					8.53	1.29	235	264	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	92.00	95.44					8.36	2.16	201	263	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							9.13	2.20	277	340	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.55	104.00					8.53	2.45	214	282	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12	100.03	100.04	100.03	-0.02	3	4 394	7.94	0.02			3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.52	100.65	100.65	-0.05	1	25	9.44	1.75	316	365	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16							9.51	2.16	316	378	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.70	101.90					8.90	1.64	264	308	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.00	100.45	100.20	0.12	1	2 300	7.72	0.42		158	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.00	99.80					7.88	1.03	177	194	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.65	101.75	100.80	-0.05	10	1 000	8.76	2.11	242	303	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	99.10	99.60	99.60		4	3 100	8.67	1.46	245	282	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12	99.90	100.08	100.06	-0.04	1	100 000	7.86	0.02			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	102.80	103.80					7.63	0.95	155	167	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16		101.48					8.64	1.71	236	284	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14							8.77	0.66	281	272	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13	106.22	107.00					8.00	0.96	192	204	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15							9.44	2.35	306	372	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



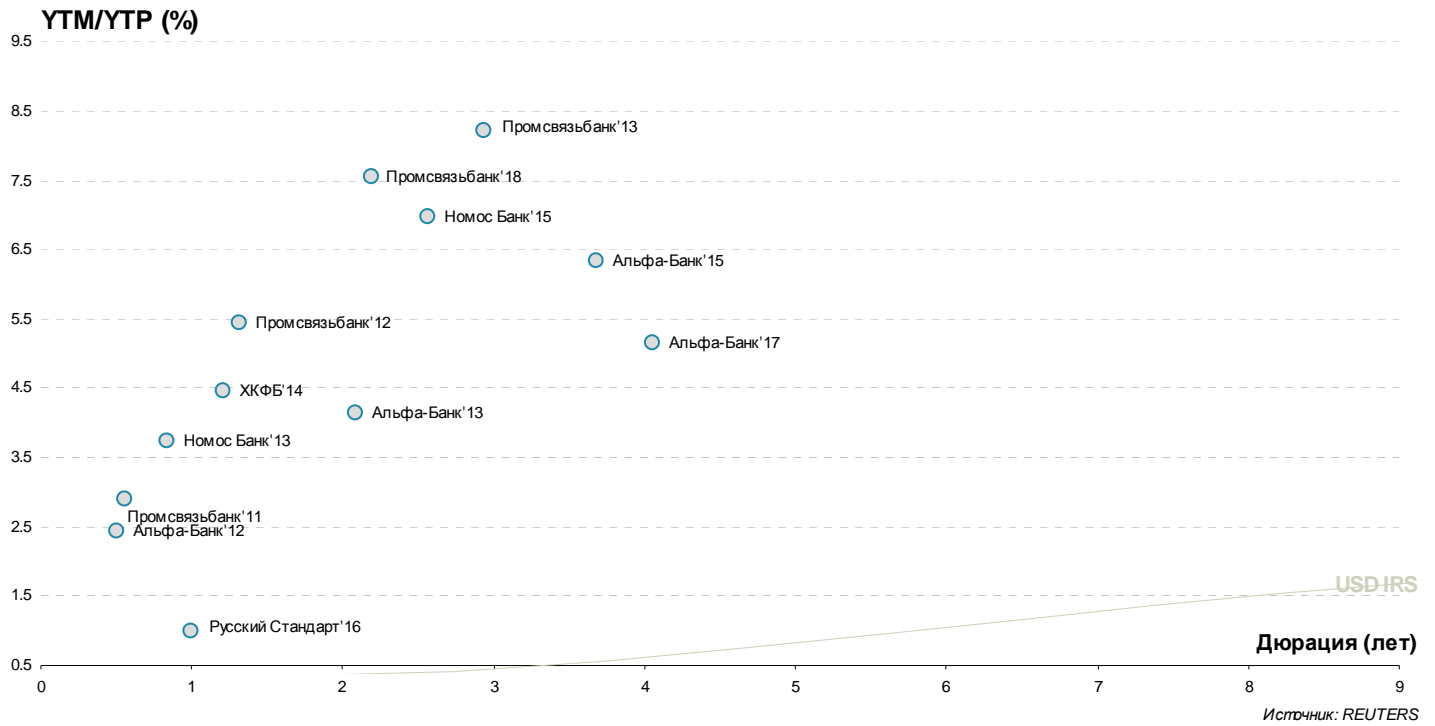
Результаты торгов евробондами

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		105.700	105.950	1.18	1.08	2.29	0.03	81
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.875	106.125	1.82	1.77	4.04	0.04	122
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.167	149.722	2.06	1.68	4.46	-0.22	125
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.215	127.353	2.73	2.71	5.43	0.28	143
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.250	117.650	2.43	2.38	6.33	0.22	124
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		113.000	113.500	2.90	2.84	7.76	0.03	139
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		199.333	200.667	4.06	3.99	9.18	-0.06	214
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.550	124.050	4.22	4.19	15.99	0.48	178
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.083	101.101	1.43	1.38	0.35	-0.01	114
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.387	101.684	1.62	0.78	0.35		133
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.760	102.010	1.87	1.12	0.33		158
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.675	103.805	1.59	1.39	0.61		130
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		109.837	110.517	2.66	2.15	1.19		237
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		109.333	109.993	2.78	2.26	1.18		249
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.056	109.309	2.41	2.26	1.52		209
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		106.875	107.250	2.66	2.53	2.79		226
GAZPR'16 4.95%	USD	23/05/16		107.000	107.300	2.80	2.71	3.21		236
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.750	112.250	3.03	2.90	3.57	0.13	250
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.625	123.125	3.46	3.37	4.48	0.18	271
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		131.000	131.500	3.73	3.65	5.10	0.65	279
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.375	111.875	3.27	3.12	2.85		255
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.500	119.000	4.08	4.02	7.18	0.50	265
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		106.500	107.000	4.12	4.06	7.68	0.25	261
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		141.250	142.000	5.36	5.31	11.73	-0.69	321
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		127.750	128.500	5.27	5.22	12.98	0.75	302
Газпром нефть										
GPN CAPITAL '22 4.375%	USD	19/09/22		100.750	101.250	4.28	4.22	7.98		273
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		103.998	105.998					
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		104.543	105.543	1.90	1.10	1.19	-0.46	159
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		128.721	129.021	3.11	3.06	4.62	-0.22	230
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		110.880	111.380	3.02	2.91	3.86	-0.07	244
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		112.606	113.020	4.06	4.01	7.41	0.11	260
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.126	100.551	5.34	5.24	4.32	0.15	471
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.150	107.500	3.11	2.95	2.08	0.10	277
VTB'17 6%	USD	12/04/17		106.650	106.950	4.30	4.22	3.86	0.90	374
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		107.471	107.709	4.68	4.63	4.45	-0.03	397
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		110.400	110.800	4.69	4.61	4.68	0.57	394
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		109.650	110.025	5.04	4.99	6.27	1.50	386
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		106.270	106.645	6.09	6.04	7.31	0.39	465
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		107.000	107.370	5.69	5.67	12.40	0.38	348
VTB' 9.5%	USD			105.927	106.521	8.60	8.52	6.75	-0.01	731
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.108	102.151	2.18	2.08	0.41		189
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.000	106.375	3.88	3.71	2.09	-0.25	355
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		104.070	104.380	4.48	4.37	2.74		411
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.800	101.800	5.81	5.55	3.92		529
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.714	108.918	3.13	3.08	3.74	0.09	257
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		110.500	111.375	3.14	2.96	4.42	0.56	244
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		118.995	119.499	3.97	3.90	6.02	0.41	281
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		113.250	114.125	4.32	4.21	7.39	0.88	284
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		119.270	120.145	4.79	4.70	9.17	0.28	295
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.120	103.320	2.08	1.72	0.52		179
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.000	106.260	3.14	3.01	1.86		281
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.875	108.425	3.50	3.30	2.56	-0.12	313
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.418	111.588	3.70	3.65	3.03	0.02	324
GAZPROMB'17 5.625%	USD	17/05/17		105.500	106.000	4.25	4.13	3.98	0.25	367
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		107.250	107.750	5.87	5.78	5.23	0.38	497
GPB EURO' 7.875%	USD			101.623	102.283	7.50	7.35	4.44	0.38	686
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.105	102.480	2.13	1.26	0.42		184

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		105.400	105.700	2.06	1.79	1.03	-0.10	175
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		109.300	109.600	2.60	2.41	1.43	-0.20	229
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		109.770	110.125	3.87	3.79	3.94	-0.08	329
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		105.757	105.991	4.02	3.97	4.40	0.01	332
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.125	118.875	4.02	3.88	4.63	-0.14	325
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		103.764	103.925	4.81	4.76	3.19	0.26	439
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		102.190	102.340	1.23	0.88	0.42		93
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		102.605	102.980	1.69	1.02	0.54		139
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		108.400	108.750	2.12	1.98	2.38	0.32	174
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		108.500	108.875	3.25	3.16	3.86	0.42	268
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		105.988	106.187	3.39	3.34	3.75	-0.26	284
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		106.584	106.880	4.02	3.97	5.54	-0.42	303
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		110.225	110.600	4.27	4.22	6.77	0.85	294
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		113.250	113.625	4.35	4.31	7.15	0.88	293
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		100.850	101.100	5.01	4.98	7.83	0.35	349
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.095	102.595	2.97	1.63	0.36		271
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		110.000	110.500	4.54	4.36	2.64	0.05	417
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		102.950	103.675	6.61	6.42	3.78	0.31	611
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		110.750	111.250	7.05	6.95	4.33	-0.11	640
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		100.050	100.550	6.74	6.62	4.56	0.58	606
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		103.750	104.250	5.34	5.19	3.20		492
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		100.250	100.625	4.91	4.84	5.79	0.38	388
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		108.810	109.030	5.63	5.53	2.03	-0.08	535
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.320	110.790	3.30	3.06	1.81	0.01	298
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		114.750	115.375	5.43	5.34	6.14	0.51	426
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.245	102.400	2.36	1.96	0.38		206
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.789	102.211	4.51	2.90	1.49		
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		106.500	106.500	4.25	4.25	2.83		386
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		111.254	111.742	4.67	4.53	3.08	-0.05	426
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		104.630	105.630	5.02	4.76	3.72	-0.12	450
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		117.500	118.125	5.34	5.21	4.42	0.45	462
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		110.630	111.630	6.07	5.92	6.14		489
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		109.900	110.300	6.08	6.03	6.81	0.53	474
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		107.900	108.250	2.09	1.91	1.81		176
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		113.875	114.500	3.02	2.88	4.00		241
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		120.750	121.500	3.80	3.69	5.65	0.12	275
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		113.875	114.500	4.06	3.97	6.46	-0.13	282
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		120.375	121.000	4.05	3.98	7.41	0.13	258
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		124.500	125.375	4.72	4.60	5.72	-0.11	360
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.489	106.643	3.14	3.09	2.89	-0.06	272
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		116.875	117.625	4.14	4.04	6.44	0.11	288
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		104.885	105.135	1.85	1.46	0.60		156
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		109.300	109.550	2.20	2.03	1.29	0.55	190
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		105.738	106.080	4.51	4.41	3.23	0.48	407
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		107.150	107.650	5.02	4.91	4.22	0.53	439
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		99.375	100.000	5.98	5.90	7.53	0.98	452
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		102.341	102.771	7.19	7.09	4.22	0.11	658
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		103.394	103.775	6.84	6.74	3.77	0.01	635
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		101.629	104.629					
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.400	107.700	2.66	2.52	1.99		231
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.500	116.000	2.92	2.79	3.17		246
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.413	114.629	3.00	2.95	3.77	0.17	243
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.025	121.292	3.46	3.41	4.42	0.03	272
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.000	121.500	3.85	3.78	5.72		278
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		103.400	103.700	2.72	2.16	0.51		244
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.000	108.450	4.25	4.05	2.09	-0.08	393
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		99.736	100.099	6.37	6.27	3.68		589
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		111.227	111.675	5.19	5.09	4.06	0.35	458

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.