

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Решение ФРС не вызвало эйфории, фокус вновь на переговоры по бюджету

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Условия рынка далеки от комфортных
- Рубль продолжает реагировать исключительно на нефть

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Суверенные евробонды копируют динамику UST, в корпоративном секторе растет спрос на металлургию
- Рублевые облигации под давлением коррекционных настроений

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

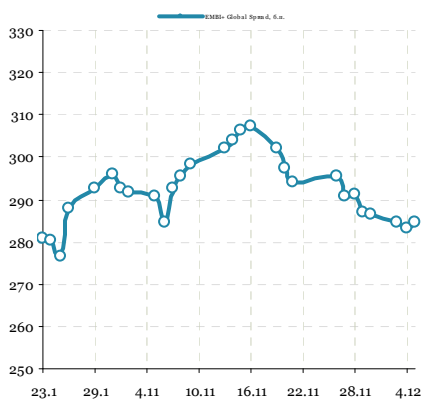
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

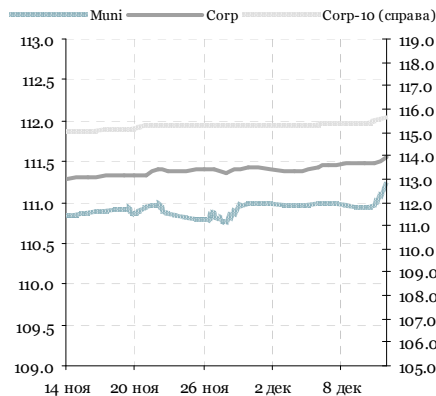
	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.70 ▲	0.04	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	146 ▲	5	115	162
EMBI+Glob.	285 ▲	1	270	441
EMBI+Rus sprd	159 ▲	3	141	332
Russia 30 yield	2.73 ▲	0.01	2.71	4.08
Денежный рынок				
Libor-3m	0.31 ■	0.00	0.31	0.47
Euribor-3m	0.18 ▲	0.00	0.18	0.66
MosPrime-1m	6.82 ▼	-0.02	6.35	6.91
Корсчета в ЦБ	835.8 ▼	-5.9	446	1011
Депоз. в ЦБ	101.1 ▲	1.4	65	238
NDF RU 3m	6.2 ▲	0.0	6	7
Валютный рынок				
USD/RUB	30.587 ▼	-0.126	30.46	33.26
EUR/RUB	39.881 ▼	-0.023	38.97	41.73
EUR/USD	1.307 ▲	0.007	1.21	1.31
Корзина ЦБ	34.882 ▼	-0.084	34.77	37.02
DXY Индекс	79.815 ▼	-0.246	78.85	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1506.9 ▲	0.0%	1262	1589
Dow Jones	13245.5 ▼	-0.02%	12128	13610
DAX	7580.6 ▼	-0.45%	6132	7615
Nikkei 225	9581 ▲	1.68%	8366	9581
Shanghai Comp.	2082.7 ▼	-1.02%	1960	2319
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	108.0 ▲	0.71%	88	117
Нефть Brent	109.5 ▼	-0.32%	89	117
Золото	1711.7 ▼	-0.73%	1553	1790
CRB Index	295.2 ▲	0.46%	267	321

Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Ценовые индексы ZETVI



Динамика индексов ZETVI

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Price Return				
OFZ	125.1 ▲	0.73	107.5	125.1
Muni	111.2 ▲	0.24	109.6	112.4
Corp	111.6 ▲	0.07	110.7	112.1
Corp-10	115.6 ▲	0.12	115.0	117.1
Total Return				
OFZ	287.9 ▲	1.75	233.3	287.9
Muni	353.0 ▲	0.83	327.9	353.0
Corp	350.4 ▲	0.29	326.0	352.5
Corp-10	352.5 ▲	0.43	328.6	352.5
Объем торгов в сегменте (млн руб.)				
OFZ	409 ▼	-281	0	22514
Muni	1 004 ▲	240	10	5 492
Corp	6 322 ▲	473	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Торги, на которые выставили «ММК-транс», выиграла Globaltrans. Вместе с «ММК-трансом» продается пятилетний контракт на обслуживание не менее 70% потребностей ММК в железнодорожных перевозках. 50% «ММК-транса» Globaltrans купит у своих же топ-менеджеров — Сергея Мальцева и Александра Елисеева, которые владеют этими акциями через кипрскую Verres Investments. Сумма сделки может составить примерно 300 млн долл. /Коммерсантъ/

Ставка первого купона по облигациям Ставропольского края выпуска 34001 объемом 5 млрд руб. установлена по результатам сбора заявок на уровне 9,2% годовых. Срок обращения выпуска составит 5 лет с даты начала размещения. Выпуск имеет амортизационную структуру погашения номинала. /Финам/

ЗАО АКБ «Абсолют Банк» 17 декабря проведет сбор заявок на биржевые облигации серии БО-01 объемом 5 млрд руб. /Финам/

Ставка первого купона по облигациям Воронежской области выпуска 34005 объемом 5 млрд руб. установлена по результатам сбора заявок на уровне 7,85% годовых. Погашение номинальной стоимости бумаг выпуска осуществляется амортизационными частями: по 25% в даты выплаты 7-го и 9-го купонов, по 15% - в даты выплаты 11-го и 13-го купонов и по 10% - в даты выплаты 17-го и 20-го купонов. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 13.12.2012 – четверг

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

- **Выплата купона:** МТС-Банк (МБПП), 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.)

Сегодня: 14.12.2012 – пятница

- **Выплата купона:** Татфондбанк, 07 (10%, 49.7 млн руб.), ВТБ, БО-01 (7.6%, 94.7 млн руб.), ВТБ, БО-02 (7.6%, 94.7 млн руб.), ВТБ, БО-05 (7.6%, 189.5 млн руб.), НК Альянс, 06 (8.85%, 308.9 млн руб.), Интурист, ВАО, 2012 (CLN) (9.75%, 0.1 млн долл.), Т-Платформы Финанс, 01 (13%, 6.4 млн руб.), ДИГ-Банк, 04 (11%, 0.6 млн руб.), АБ ИНТЕРПРОГРЕССБАНК, 01 (11%, 27.5 млн руб.), Краснодарский край, 34002 (6%, 22.4 млн руб.), Москва, 49 (7%, 877.5 млн руб.), НОМОС-БАНК, 09 (8.75%, 218.1 млн руб.)
- **Оферта:** ТрансФин-М, 04 (500 млн руб.), ТрансФин-М, 05 (500 млн руб.), ТрансФин-М, 06 (500 млн руб.), ТрансФин-М, 07 (500 млн руб.), ХКФ Банк, 06 (5 млрд руб.)
- **Погашение:** Татфондбанк, 07 (1 млрд руб.), Интурист, ВАО, 2012 (CLN) (20 млн долл.), Краснодарский край, 34002 (1.5 млрд руб.)
- **Размещение:** ВТБ Капитал Финанс, 05 (1 млрд руб.), ЭкспертГрупп, БО-01 (600 млн руб.)

17.12.2012 – понедельник

- **Выплата купона:** АИЖК, 12 (10.5%, 368.4 млн руб.), АИЖК, 16 (8.25%, 205.7 млн руб.), АИЖК, 20 (8.6%, 107.2 млн руб.), Газпромбанк, 2014 (LPN) (6.25%, 31.2 млн долл.), АИЖК, 23 (7.94%, 277.2 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2011-2, А2 (6%, 111.5 млн руб.), Ипотечный агент АИЖК 2011-2, А1 (8.25%, 74.3 млн руб.), Республика Коми, 32010 (9.5%, 100 млн руб.), Москоммерцбанк, 2034-С (RMBS) (7%, 26.1 тыс долл.), Газпромбанк, 2015, RUB (LPN) (8.617%, 287.2 млн руб.), АИЖК, 08 (7.63%, 57 млн руб.), АИЖК, 11 (8.2%, 204.4 млн руб.), Второй ипотечный агент АИЖК, 1А (8.5%, 48.9 млн руб.), Второй ипотечный агент АИЖК, 2Б (9.5%, 13.9 млн руб.), МДМ Банк, 2052-А (RMBS) (10%, 20.2 млн руб.), Лукойл, 2015 (CNV) (2.625%, 19.6 млн долл.), Сбербанк России ОАО, 2021 (LPN) (5.717%, 28.5 млн руб.), МДМ Банк, БО-04 (9.5%, 238.1 млн руб.), ВТБ, 2016, CHF (LPN) (3.15%, 4.2 млн швейцарских франков), Банк Русский стандарт, 2015 (LPN) (7.73%, 7.7 млн долл.), ЭкспертГрупп, 01 (12%, 26.9 млн руб.), НОМОС-БАНК, 2012 (LPN) (9.25%, 9.2 млн руб.), КАМАЗ, БО-01 (9%, 89.7 млн руб.), ПромПереоснастка, 01 (1%, 0.7 млн руб.), Томская область, 34034 (7%, 24.5 млн руб.), Промсвязьбанк, 06 (8.25%, 205.7 млн руб.)
- **Оферта:** МТС-Банк (МБПП), 05 (5 млрд руб.), ТрансФин-М, 08 (500 млн руб.)

Внешний рынок долга

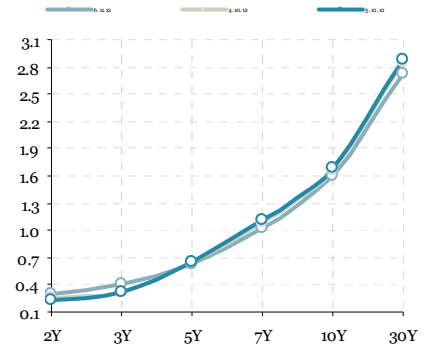
Решение ФРС не вызвало эйфории, фокус вновь на переговоры по бюджету

Решение ФРС об увеличении программы выкупа активов до 85 млрд долл. в месяц за счет покупки долгосрочных казначейских обязательств в дополнение к ипотечным ценным бумагам, не вызвало особой реакции рынков. Это событие было весьма ожидаемым, поскольку логика была бы нарушена, если бы регулятор выкупал лишь ипотечные бумаги, минуя покупку базовых активов. Поддержать спрос на риск также оказались неспособны неплохие еженедельные данные по рынку труда, указавшие на снижение числа первичных пособий за безработицей сильнее ожиданий инвесторов.

Ясность в отношении дальнейших действий ФРС переключает внимание рынка на нерешенность главной проблемы – бюджетного обрыва. Переговоры Администрации президента США со спикером Палаты представителей вчера продолжились, но длились всего 50 минут. В американских СМИ появилась информация о все большей склонности республиканцев поддержать предложения Обамы с некоторым оговорками и вновь поднять вопрос о более значительных сокращениях госрасходов на переговорах о повышении планки госдолга в 2013 г. Тем не менее, обозначенная позиция спикера Бейнера остается неуклонной, республиканцы по-прежнему выступают за гораздо большее сокращение расходов и против увеличения налогового бремени на состоятельных американцев.

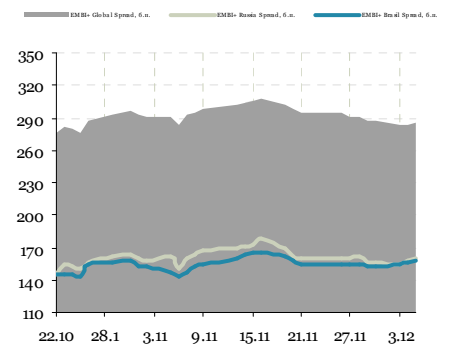
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



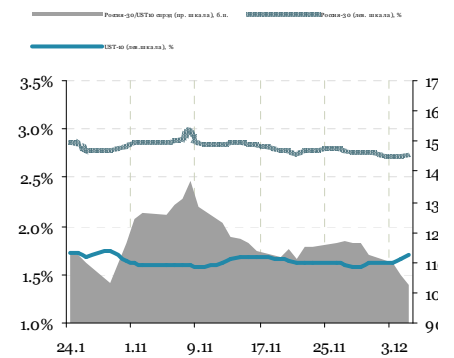
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



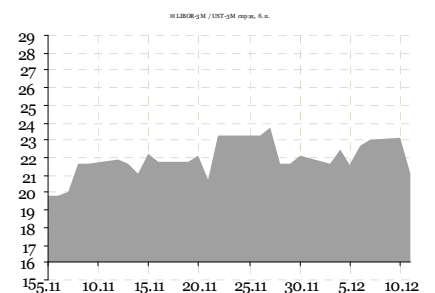
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Условия рынка далеки от комфортных

Локальный денежно-кредитный рынок остается далек от комфортных условий в преддверии налогового периода декабря, который стартует на следующей неделе. Уровень краткосрочных процентных ставок вчера практически не изменился и держался вблизи локальных максимумов. 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 весь заявленный объем - 451 млрд руб. против 549 млрд руб. накануне. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ сократилась на 140 млрд руб. до 796.6 млрд руб.

Условия рынка остаются подавленными, при этом старт налогового периода на следующей неделе создает угрозу дальнейшего роста краткосрочных процентных ставок. Отток ликвидности на уплату налогов на неделе с 17 по 23 декабря составит порядка 410 млрд руб.: 230 млрд руб. пойдет на страховые взносы за ноябрь, еще около 180 млрд руб. – на уплату 1/3 НДС за III квартал. Учитывая относительно высокую задолженность банков перед ЦБ по операциям репо (1.75 трлн руб.), эти платежи способны поднять ставки денежного рынка до локальных максимумов.

Рубль продолжает реагировать исключительно на нефть

Валютные торги четверга прошли негативно для рубля. Курс бивалютной корзины по итогам дня вырос на 14 коп. до отметки 34.92 руб. Российская валюта продолжает четко следовать за котировками нефти, которые в период внутренних торгов опустились на 1 долл. до 108.50 долл. за барр. Brent. Учитывая нежелание котировок нефти идти выше верхней границы среднесрочного коридора (выше 112 долл. за барр.) и общее снижение спроса на риск на внешних площадках вынуждает рубль прервать восходящее движение. Таким образом, при сохранении котировок нефти вблизи текущих уровней, рубль, вероятно, продолжит консолидацию в верхней точке краткосрочных границ волатильности, расположенной на уровне в 35.0 руб. за корзину

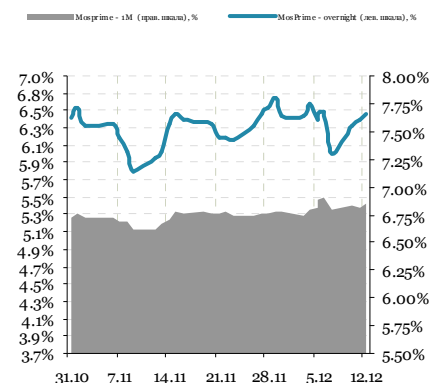
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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		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

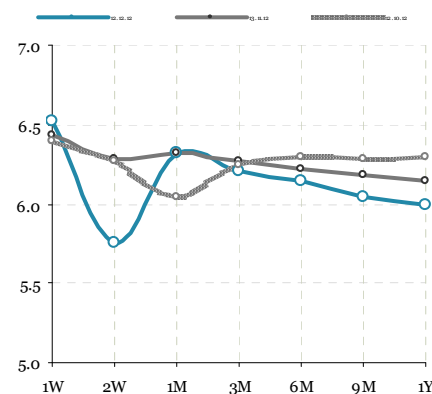
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Суверенные евробонды копируют динамику UST, в корпоративном секторе растет спрос на металлургию

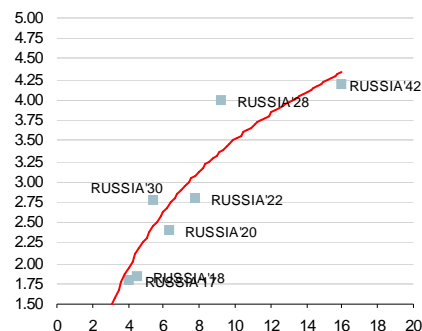
Суверенные евробонды в четверг копируют траекторию UST, где доходности на дальнем конце кривой подросли в пределах 5 бп; в результате биды вдоль суверенной кривой опустились на 10-20 бп. Корпоративный сектор провел в целом нейтральный день: котировки колебались вокруг отметок среды. В секторе госкомпаний лучше рынка торговался дальний выпуск Газпрома GAZPRU'37, а также РЖД RURAIL'22 и ВЭБа VEBBNC'20, прибавившие 25-50 бп. В секторе частных компаний фронтальный рост был замечен в металлургии, где дальние выпуски Евраза, Металлоинвеста, Северстали прибавили в ценах 50-100 бп, вверх по ценам торговался также новый выпуск Еврохима EUCHEM'17, подорожавший 50 бп.

Рублевые облигации под давлением коррекционных настроений

Локальный рынок провел день в контексте общих коррекционных настроений. Цены на дальнем участке кривой ОФЗ опустились на 25-40 бп, торговая активность заметно сократилась, а на среднем участке кривой сделки носили скорее точечный характер. Корпоративный сектор завершил день без единого тренда, а активность была сосредоточена в выпусках Роснефти, ФСК ЕЭС 25 и ВТБ-БО6, торговавшихся в широких ценовых диапазонах.

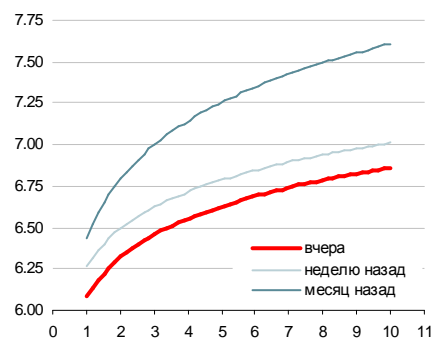
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



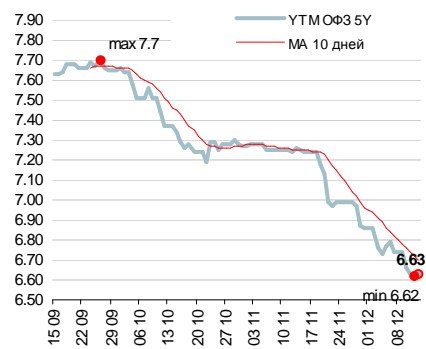
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



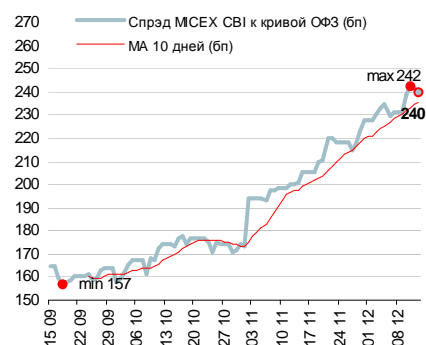
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



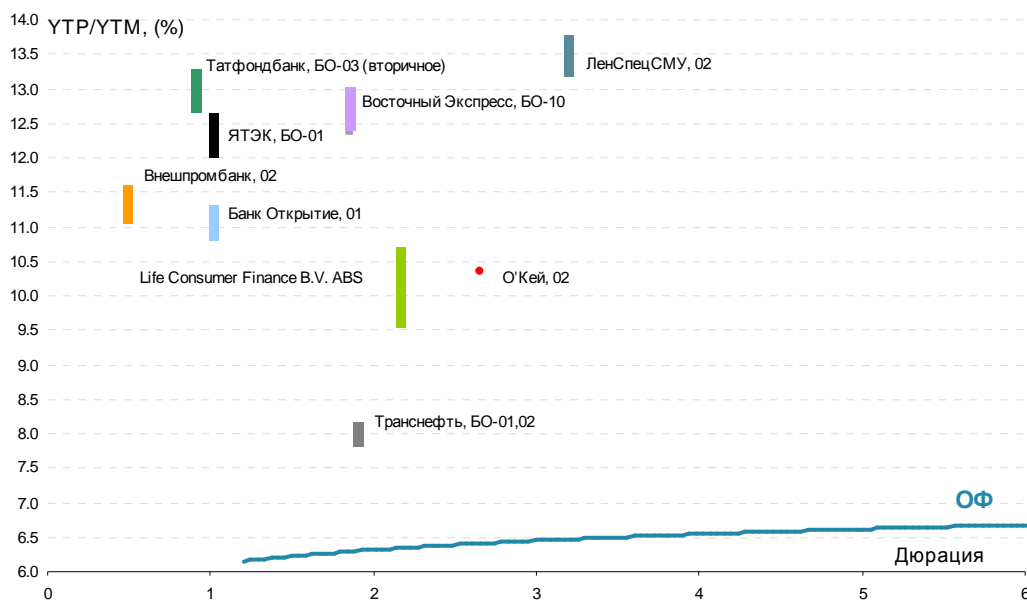
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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	- / - / V+	да	3 000	10.36	13.12.2012	18.12.2012	нет / 2.66 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	V / - / -	да	5 000	13.10-13.65	14.12.2012	18.12.2012	да / 3.18 г.	нет / 5 лет
Внешпромбанк, 02	V / 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	V / - / В	да	3 000	10.78-11.30	14.12.2012	19.12.2012	нет / 1 г.	1 г. / 5 лет
Татфондбанк, БО-03 (вторичное)	- / В3 / -	да	2 000	12.60-13.22	18.12.2012	19.12.2012	нет / 0.92 г.	1 г. / 2 г.
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	05.02.2013	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
Правоурмийское, 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	V+ / В1 / ВВ-	да	3 000	1.7 / 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 / ВВВ-	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	- / Ва3 / 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	BB+ / - / 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	BB- / 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	100.11	100.13	100.13	-0.00	43	197 250	5.98	0.11			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.10	100.11	100.10	-0.02	21	202 825	6.06	0.15			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.65	101.75					6.06	0.28			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.09		100.10	-0.05	1	3 000	6.06	0.58	16		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.37	100.60	100.50	0.15	3	9 600	6.07	0.82	6	4	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	101.10	101.15	101.15	-0.01	12	143 967	6.21	1.20	7	29	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	109.14	109.99	109.17		1	7 954	6.27	1.53	4	42	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.30	109.40	109.40	-0.00	2	5 901	6.34	1.79	6	55	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.25	103.42	105.32	0.33	2	11	5.27	1.84			80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.55	101.62					6.39	2.31	2	66	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.40	101.50	101.40	-0.11	1	1	6.38	2.35	1	65	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	103.00	103.10	103.00		4	124 238	6.37	2.76		67	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.25	99.76	99.90	0.35	1	400 000	6.50	2.84	6	80	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.00	102.00	101.70	0.20	5	17 855	6.47	3.21		78	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	99.00	99.00	2.00	1	1	6.30	3.51		60	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.60	3.41	110	191	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.75	103.84	103.81	0.01	8	155 022	6.48	3.78		78	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.70	103.80	103.80		7	155 061	6.52	3.79		82	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.65	104.85	104.85	0.05	3	51 001	6.50	4.38		79	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	94.50	94.90	94.99	0.59	6	243 612	6.62	4.44	3	91	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.00	105.85	101.00	-0.70	5	12 600	6.89	4.56	29	117	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	105.19	105.40	105.30	-0.10	6	20 621	6.55	5.02		82	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		76.00					8.04	5.50	138	225	27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	98.40	98.50	98.40	-0.30	11	78 593	7.09	6.23	39	122	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	106.31	106.40	106.50		7	50 867	6.68	6.34		80	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	106.20	106.35	106.25	-0.25	14	150 055	6.62	6.90	8	87	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	91.70	97.70					7.14	7.34	38	114	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	111.50	111.65	111.50	-0.40	20	224 265	6.98	8.74	16	79	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.55	95.00	94.55	-0.45	4	51 850	7.54	11.15	64	104	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.56	11.10		7	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	99.63	100.05					7.10	0.61	118	100	15 000
---------------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО6		05/03/13	100.05	100.30					7.58	0.22		136	10 000
----------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	--------

НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.50	100.58					7.89	0.49		175	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	-------

НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.50	100.55	100.45	-0.05	1	4 201	7.99	0.49		185	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	-------	------	------	--	-----	-------

НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.00	100.60					8.21	1.62	196	238	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

НЛМК ВО7		11/11/14	101.41	101.75	101.40		1	6 000	8.30	1.79	202	251	10 000
----------	--	----------	--------	--------	--------	--	---	-------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК 7/d	16/03/15	05/09/22	100.45	100.70	100.55	0.10	3	18 401	8.39	2.06	206	264	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.88	100.02					7.81	0.31		162	8 000
---------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	--	-----	-------

ММК ВО8	15/08/13	12/02/15		100.10	100.03	-0.02	1	15 000	8.28	0.65	234	220	5 000
---------	----------	----------	--	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.69	99.66	0.46	2	28	8.09	1.15	196	216	5 000
---------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	----	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО6		10/07/14	84.00						8.98	1.47	277	312	5 000
---------	--	----------	-------	--	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

ММК ВО7		22/07/14	96.00	100.00					8.70	1.50	248	285	5 000
---------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	-------

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.01	100.40					7.20	0.18		96	10 000
--------------	--	----------	--------	--------	--	--	--	--	------	------	--	----	--------

Севсталь ВО4		15/02/13	100.30	100.33	100.30	-0.14	3	2 690	8.03	0.18		179	5 000
--------------	--	----------	--------	--------	--------	-------	---	-------	------	------	--	-----	-------

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.18	100.25	100.20	-0.01	3	18 002	8.10	0.52	224	197	8 000
-----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Алроса 22	28/06/13	23/06/15	99.95	100.22	100.25	0.10	3	501	8.00	0.52	214	187	8 000
-----------	----------	----------	-------	--------	--------	------	---	-----	------	------	-----	-----	-------

Алроса 23		18/06/15	100.60	101.79	100.90	0.30	2	10 405	8.82	2.23	247	308	7 000
-----------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Алроса 20		23/06/15	100.60	110.05	100.90		2	10 000	8.83	2.25	247	309	3 000
-----------	--	----------	--------	--------	--------	--	---	--------	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО1		30/10/15	100.35	100.65	100.65		11	30 007	8.87	2.55	247	315	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	--	----	--------	------	------	-----	-----	-------

Алроса ВО2		30/10/15	100.35	100.65	100.60	0.10	3	107 951	8.89	2.55	249	317	5 000
------------	--	----------	--------	--------	--------	------	---	---------	------	------	-----	-----	-------

Евраз

Евраз 1/	22/03/13	13/03/20	100.11	100.40	100.20	0.07	1	19 900	8.58	0.27		238	10 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	--	-----	--------

Евраз 3/	22/03/13	13/03/20	100.10	100.27	100.10	-0.05	1	1 520	8.97	0.27		277	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	-------	------	------	--	-----	-------

Сибметинвест 1/	16/10/14	10/10/19	107.30	107.85	107.30	-0.30	2	46 619	9.29	1.67	303	347	10 000
-----------------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Сибметинвест 2/	16/10/14	10/10/19	107.16	107.80	107.76	0.29	3	15 640	9.02	1.67	276	320	10 000
-----------------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Евраз 2/	26/10/15	19/10/20	101.70	101.80	101.65	0.05	4	110 788	9.49	2.54	309	377	10 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	---------	------	------	-----	-----	--------

Евраз 4/	26/10/15	19/10/20	101.60	101.80	101.73	0.08	3	150 011	9.45	2.54	305	373	5 000
----------	----------	----------	--------	--------	--------	------	---	---------	------	------	-----	-----	-------

Евраз 5/	06/06/16	27/05/21	94.00	96.00					10.01	3.08	355	432	5 000
----------	----------	----------	-------	-------	--	--	--	--	-------	------	-----	-----	-------

Евраз 7/	02/06/16	25/05/21	92.00	96.00					10.01	3.07	355	432	15 000
----------	----------	----------	-------	-------	--	--	--	--	-------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест

Металлоинвест 1/d	16/03/15	07/03/22	100.15	100.35	100.31	0.31	13	130	9.03	2.05	270	328	5 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	------	----	-----	------	------	-----	-----	-------

Металлоинвест 5/d	16/03/15	07/03/22	100.05	100.18	100.18	0.13	11	56 905	9.10	2.05	277	335	10 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	------	----	--------	------	------	-----	-----	--------

Металлоинвест 6/d	19/03/15	10/03/22	100.07	100.19	100.15	-0.05	9	89 589	9.11	2.06	278	336	10 000
-------------------	----------	----------	--------	--------	--------	-------	---	--------	------	------	-----	-----	--------

Мечел

Мечел ВО2/		12/03/13	99.60	99.79	99.51	-0.04	2	1 969	12.04	0.24		583	5 000
------------	--	----------	-------	-------	-------	-------	---	-------	-------	------	--	-----	-------

Мечел 5/d	16/04/13	09/10/18	99.10	100.00					11.70	0.33		552	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	99.03	99.40	99.40	0.38	2	70	11.74	0.36		557	5 000
Мечел 2/d	15/06/11	12/06/13	97.85	97.95	97.95	-0.10	19	10 635	12.12	0.50		598	5 000
Мечел 4/d	25/07/13	21/07/16	99.05	99.68					13.98	0.59	807	788	5 000
Мечел ВО4/	11/02/14	10/02/15	94.58	95.28	95.20	-0.08	2	601	15.40	1.09	929	946	5 000
Мечел 15/d	18/02/14	09/02/21	91.60	92.00	92.00		1	144	16.53	1.12	1041	1 060	5 000
Мечел 16/d	18/02/14	09/02/21	91.51	91.95	91.95		8	963	16.58	1.12	1046	1 065	5 000
Мечел ВО5/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	547	608	5 000
Мечел ВО7/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	547	608	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	547	608	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	547	608	3 000
Мечел ВО6/		07/04/15	99.50						11.55	2.06	522	580	2 000
Мечел 13/d	01/09/15	25/08/20	80.02	89.80					16.16	2.38	978	1 043	5 000
Мечел 14/d	01/09/15	25/08/20	83.02	85.00	83.50	-3.75	24	20 512	18.71	2.34	1234	1 298	5 000
Мечел 17/d	02/06/16	27/05/21	80.00	80.98	79.50	-2.50	9	7 000	17.04	3.02	1058	1 135	5 000
Мечел 18/d	02/06/16	27/05/21	80.02	84.79					15.38	3.04	892	969	5 000
Мечел 19/d	07/06/16	01/06/21	80.53	84.99	84.98	-0.01	9	835	14.48	3.05	802	879	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.51	100.07					9.02	0.84	300	300	5 000
СУЭК													
СУЭК 1/d	05/07/13	26/06/20	100.16	100.46	100.42		15	64 582	8.73	0.54	286	261	10 000
РМК													
РМК 3/d	17/12/13	15/12/15							12.96	0.94	690	698	3 000
РМК 4/d	05/06/14	02/06/16	92.00	92.99					15.97	1.41	977	1 010	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	96.51	97.79	96.50	-1.29	8	2 493	11.69	1.39	550	581	5 000
Русал													
Русал 7/d	03/03/14	22/02/18	94.08	94.49	94.10	-0.40	24	5 663	14.16	1.16	803	823	15 000
Русал 8/d	15/04/15	05/04/21	89.71	90.05	89.75		31	13 713	14.24	2.13	790	850	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.75	99.80	99.80	0.18	3	60 000	7.25	0.90	120	125	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.77	109.00	108.95	-0.05	10	122 256	7.35	1.13	123	142	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.45	102.76	102.60	0.09	3	50 126	7.79	1.93	149	202	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.65	99.95	99.88	0.04	1	50 000	8.00	2.67	159	229	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.75	99.90	99.80	0.08	5	7 627	8.13	3.11	166	244	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.85	100.15					8.29	4.47	170	258	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6/d	26/09/13	15/09/20	99.85	100.00					7.59	0.77	160	155	10 000
ФСК ЕЭС 8/d	26/09/13	15/09/20	99.85	99.90					7.46	0.77	147	142	10 000
ФСК ЕЭС 18/	09/06/14	27/11/23	100.85	100.99					7.96	1.43	176	209	15 000
ФСК ЕЭС 15/	23/10/14	12/10/23	97.10	102.10	101.63	0.33	5	125 501	7.93	1.74	166	213	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	100.20	100.50	100.97	0.97	2	2	7.78	2.17	144	204	10 000
ФСК ЕЭС 10/	24/09/15	15/09/20	99.30	100.00					8.17	2.51	178	245	10 000
ФСК ЕЭС 7/d	27/10/15	16/10/20	98.50	99.20					8.36	2.61	195	265	5 000
ФСК ЕЭС 12/	22/04/16	19/04/19	99.85	100.20	100.00	0.20	4	75 017	8.26	2.98	181	257	10 000
ФСК ЕЭС 25/	27/09/16	14/09/27	101.50	102.00	101.50	-0.15	12	405 004	8.29	3.27	181	260	15 000
ФСК ЕЭС 21/	19/04/17	06/10/27	102.00	102.10	102.05	1.05	7	24 401	8.34	3.68	182	264	10 000
ФСК ЕЭС 9/d	24/10/17	16/10/20	99.00	99.70					8.41	4.07	185	271	5 000
ФСК ЕЭС 11/	24/10/17	16/10/20	99.00	99.70					8.41	4.07	185	271	10 000
ФСК ЕЭС 19/	18/07/18	06/07/23	97.00	99.00					8.65	4.46	206	294	20 000
ФСК ЕЭС 13/		22/06/21	96.70	105.00	99.25		1	27	8.81	6.00	212	297	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.50	100.64	100.50	-0.19	3	3	8.95	2.17	261	321	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1/d		29/11/16	101.10	102.00					9.35	3.38	285	366	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3/d	11/11/13	09/11/15	99.00	99.80	99.76	0.69	9	3 912	9.48	0.89	344	348	3 000
Водоканал													
Водоканал 1/d		09/12/15		99.00	98.03	-0.97	4	9 600	9.80	2.69	338	409	2 000
Западный СД													
Западный СД 1/d	29/04/16	13/05/31	98.80	99.19					9.50	2.99	305	381	5 000
Западный СД 2/d	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.20	2.99	275	351	5 000
Западный СД 3/d	24/02/17	06/02/32							9.31	3.49	280	362	5 000
Западный СД 4/d	24/02/17	06/02/32							9.28	3.50	277	359	5 000
Западный СД 5/d	24/02/17	06/02/32	85.00	100.15					9.66	3.47	316	397	5 000
Почта России													
Почта России 1/	25/03/14	22/03/16	100.40	100.79	100.40		2	10 000	8.06	1.22	191	215	7 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.30	110.35					8.57	2.57	217	285	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.30	110.35	100.39	0.39	3	3	8.72	2.57	232	300	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.42	100.60					8.44	2.57	204	272	3 000
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	90.35	99.90					7.54	1.12	142	160	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.05	109.47	109.40	0.55	1	1	7.27	1.36	108	138	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	101.60	101.80	101.80	0.25	4	15 102	8.31	4.04	175	261	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.60	102.00	102.00	0.20	13	173 125	8.25	4.04	169	255	10 000
Лукойл													
Лукойл БО-6		13/12/12							9.12	0.00			5 000
Лукойл БО-7		13/12/12							-45.68	0.00			5 000
Лукойл 4		05/12/13	100.00	100.45	100.00	-0.50	4	1 170	7.53	0.96	146	156	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.70	99.35					8.53	0.09		224	8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	86.00	100.50	99.97	-0.43	2	10 301	7.33	0.32		114	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	86.00	100.49					7.26	0.32		107	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50	100.90	100.85	0.20	3	305	7.96	1.95	165	220	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.00	101.50					8.37	2.74	195	266	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.24	100.70					8.39	2.76	196	269	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.50	105.00	102.70	-2.30	1	5 051	8.41	4.13	185	271	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	100.00	100.10	100.10	0.35	4	177	8.34	4.37	176	263	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.05	100.25	100.21	0.09	2	2	7.21	0.51	135	108	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.20	101.40	100.50		2	3 562	8.31	2.55	191	259	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	100.20		100.57	0.22	2	1 001	8.28	2.55	188	256	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.20		100.50	0.15	2	3 001	8.31	2.55	191	259	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.40		99.71	-0.25	8	402	7.77	0.75	178	172	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16							8.54	3.28	206	285	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16							8.54	3.28	205	285	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16							8.54	3.28	206	285	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	100.96	101.35	101.30	0.15	1	9 900	8.10	0.96	203	212	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	100.00		100.25	-1.05	1	1	9.06	1.96	275	330	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.85	100.20	99.85	-0.05	1	1	10.21	0.61	430	411	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	98.50	100.85	99.10	-0.13	11	1 906	10.33	1.08	422	439	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	96.00	97.99	97.00	1.50	1	49 986	10.13	3.07	367	444	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21							10.79	2.93	434	510	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.76	99.85	99.85	-0.05	8	1 317	12.79	0.59	689	669	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	96.90	100.00	97.12	0.47	8	61 072	9.60	3.00	315	391	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.49	100.54	100.50		6	21 669	7.87	0.56	199	175	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14	100.00	100.13	100.10	0.04	17	211 593	3.92	0.02			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.98	100.10	100.10	-0.02	3	2 505	7.25	0.12		98	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13							7.82	0.25		161	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13							8.46	0.25		225	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13							7.86	0.25		165	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.10	100.19	100.10	0.18	3	10 001	8.04	0.71	207	198	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.65	99.94	99.95	0.40	2	82	7.67	0.82	166	164	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15							8.20	1.19	206	228	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15							8.24	1.19	210	232	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	100.00	100.25					8.68	2.48	229	296	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.48	229	296	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.90						8.03	0.46		188	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	100.40	100.20	0.17	1	5 000	8.82	1.85	253	304	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.20					8.26	0.67	231	218	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.80	99.98					9.57	0.07			10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.25						7.92	0.24		171	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.99	100.37					7.62	0.37		145	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.20	0.75	221	215	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	99.00	99.60					8.95	0.70	299	288	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	99.75					7.46	0.96	139	149	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.58	1.23	243	267	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.00	99.79	99.00	-0.40	1	2	8.28	0.84	226	226	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.35	100.70					8.20	2.05	188	245	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	101.05	101.30	101.30	0.25	3	3	8.18	2.53	178	246	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.00	101.25					8.20	2.55	180	248	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	99.40		99.50	0.20	7	85 000	8.23	2.91	179	253	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.27	219	298	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.70	99.30	99.30	1.00	6	50 417	8.24	4.07	168	254	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.10	99.90	99.86	0.80	2	28	7.75	1.27	159	185	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.50					8.43	1.75	216	263	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.50	101.50					8.46	1.76	219	266	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	100.99	100.80	0.25	2	50 174	8.74	1.87	244	296	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	86.00	100.00					8.89	2.92	245	320	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	100.50					9.03	2.92	259	334	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	99.40	100.58	101.20	0.77	1	2 800	7.83	1.22	168	192	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.30	100.90					8.79	1.56	256	295	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.25	100.75	100.19	0.09	9	1 708	8.42	1.38	223	254	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	99.25	100.17	100.10	0.04	1	7	8.49	1.38	230	261	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.05	101.00					7.73	0.15		147	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.15	100.60	100.20	-0.05	2	2 746	7.69	0.15		144	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.35	99.40	99.37	-0.33	5	17 314	8.35	0.49		221	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	99.90	100.20					8.09	0.63	217	200	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.90	100.25					8.09	0.63	216	200	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.00	100.20	100.00	-0.20	1	3 980	8.44	0.69	248	237	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.10	100.20	100.05	-0.10	3	23 797	8.37	0.69	241	230	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						6.95	0.78	95	91	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	99.90	100.29	100.00	-0.09	2	6 651	8.35	0.86	232	234	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.25	100.60					8.19	0.87	215	218	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.42	101.00	-0.36	1	1	8.49	1.10	237	255	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.01	100.00					8.20	1.56	197	236	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.75	100.75	0.66	27	1 601	8.06	1.75	179	226	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.17					8.52	1.74	225	272	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.20	100.75	100.20	-0.25	2	30 001	8.62	2.14	228	288	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.65	99.25	98.65	0.20	2	2	8.46	2.30	210	273	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.35	99.25					8.69	2.30	233	296	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.35	99.25	99.25	1.10	1	3	8.18	2.31	181	245	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14							7.92	0.03			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.41	99.50	99.40	-0.05	2	6	7.92	0.59	202	182	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	99.30	101.00	99.70	-0.20	2	1 000	8.23	0.97	216	226	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15			100.40	-0.10	2	60	8.28	1.08	217	234	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.90	100.95	100.90	-0.10	4	50 080	8.40	1.46	219	254	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16	100.00	101.10	100.40	0.15	3	15 000	8.51	2.57	211	279	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	99.97						8.67	2.56	227	295	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	99.96						8.67	2.56	227	295	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	99.98						8.67	2.56	227	295	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30						8.12	1.03	203	217	3 000
АИЖК-11 А1	15/03/15	15/09/43							8.44	1.66	219	262	7 000
АИЖК А9		15/02/17	94.00						8.95	1.75	268	315	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.29					8.51	1.77	223	271	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.41	2.22	206	267	6 000
АИЖК А8		15/06/18							8.36	2.64	195	265	5 000
АИЖК А10		15/11/18	99.00		99.55	0.55	1	10 000	8.46	2.92	201	277	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	100.50					8.61	2.92	216	292	7 000
АИЖК А21		15/02/20	101.00	102.00					8.68	3.10	221	299	15 000
АИЖК А11		15/09/20							8.67	3.68	215	297	10 000
АИЖК А16		15/09/21							8.98	4.82	237	326	10 000
АИЖК А17		15/04/22							9.06	5.41	241	328	8 000
АИЖК А20		15/12/27							8.88	8.37	208	274	5 000
АИЖК-11 А2	15/03/19	15/09/43											7 000
ГЛОБЭКС													
ГЛОБЭКС БО-3	08/06/12	08/12/13	86.00		100.12	-0.08	3	7 155	9.06	0.96	299	309	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	100.00	101.00					9.10	0.96	303	313	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.60	99.80	99.80	0.05	3	4 903	9.59	1.50	337	374	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.50	330	367	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.90	100.07	100.00	0.03	3	11 024	8.35	0.18		211	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.41	100.30	99.95	-0.34	2	25 000	8.11	0.64	218	202	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.10	99.85	99.10	-0.65	6	5 368	9.01	0.91	296	302	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.65	100.10	99.65	0.10	10	46 000	8.70	1.28	253	280	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.70	110.05	100.00	-0.52	4	10 002	8.73	2.61	232	302	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18							7.49	0.50		135	10 000
МТС 1		17/10/13	99.32	99.94	99.75	0.02	1	1	7.43	0.83	141	141	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	99.01	99.34	99.28	-0.02	3	326 207	8.10	1.34	192	221	15 000
МТС 2		20/10/15	98.11	99.95					8.62	2.59	222	291	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.40	99.70	99.50		4	15 556	8.52	2.64	211	281	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.81	100.00	99.90	0.15	5	10 012	8.76	3.15	229	307	15 000
МТС 7		07/11/17	99.80	100.20	100.20	0.15	4	3 260	8.83	4.07	227	313	10 000
Вымпелком													

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УПМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.60	100.70					8.16	0.58	226	205	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.76	98.75	98.41	-0.04	4	30	8.68	1.46	247	282	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.75	100.10	100.10	-0.09	5	85 165	8.98	2.07	265	323	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.75	100.20	100.10	0.05	2	16 000	8.98	2.05	265	323	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.75	100.15	100.15	0.10	8	17 140	8.96	2.05	263	321	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.30	98.80					9.00	2.55	260	328	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.30	98.90	98.95	1.45	1	7 000	8.91	2.55	251	319	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.00	100.50	100.25	0.05	1	10 000	8.05	1.71	179	224	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.00	99.50					8.66	0.54	279	254	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	99.50						12.17	0.39		601	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.95	100.40	-0.45	2	2	8.69	1.10	258	275	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	100.40	101.24	100.40	-0.20	1	3	8.69	1.10	258	275	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.25	100.50	100.45	0.10	5	1 379	8.94	2.13	260	320	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.99	98.00		11	600	9.28	2.99	283	359	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	95.01	107.00	96.70	0.17	2	6 000	9.75	2.98	330	406	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	96.80	107.00	97.30		1	54 500	9.53	2.98	308	384	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	89.80	99.90	99.80		5	1 535	8.52	0.21		229	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90						8.46	0.72	249	240	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90	100.10					9.88	0.72	391	382	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.90						8.29	0.72	232	223	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.91	100.05					8.45	0.72	248	239	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.25	100.00					8.79	1.15	266	286	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.80	99.85					8.34	1.30	217	244	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.60	100.90					8.83	2.47	244	311	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	97.00	100.00					9.44	1.42	324	357	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	96.00						8.10	1.44	190	223	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.00	101.00					9.65	2.48	326	393	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.00					8.99	0.59	308	289	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.71	99.80	99.80		7	2 187	9.58	0.77	359	354	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.51	100.00					10.59	0.44		444	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.15	99.35	99.35		3	2 801	9.20	0.88	316	320	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.01	100.19					9.42	0.78	342	338	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.30	1.92	500	553	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.95	99.96	99.96	-0.01	2	640	12.95	0.50	710	682	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	94.00	94.44					11.38	2.25	502	565	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.65	95.80					12.39	1.50	617	653	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	86.00	99.05	98.57	-0.43	1	13 700	8.41	1.60	217	258	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.50	95.85	95.85	0.05	2	4 000	10.81	1.07	471	486	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13							-50.18	0.01			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	94.05	99.30	99.15	0.08	2	1 500	9.60	1.08	349	366	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.00	101.60					10.74	2.45	435	502	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	12/12/13	07/12/17	99.13	100.05					9.46	0.98	339	349	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.55	99.65					9.80	0.68	385	373	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	98.75	99.00	99.00		3	5 050	12.07	0.83	605	605	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	100.85	100.80	0.22	2	50 001	8.25	0.72	228	219	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	98.50						8.47	0.96	240	250	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.93	100.00					9.14	0.36		297	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.60	99.79	99.75	-0.01	6	2 049	9.12	0.36		295	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	99.00					8.13	0.75	215	208	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.90	100.15	100.15	0.10	4	990	8.98	0.38		281	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.60	101.75	101.75		4	26 114	9.57	0.56	368	346	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	100.09	100.90	100.90	0.05	10	1 039	10.52	1.93	421	476	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.97	100.00	100.00		5	25 749	7.84	0.32		165	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.91	100.10					7.58	0.32		139	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.35	100.38					7.54	0.21		131	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.20	100.70	100.40		1	1 980	8.72	1.62	247	289	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.00	100.25	98.90	-0.80	2	4 400	10.49	1.30	432	459	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.45	100.60					10.00	1.99	368	425	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.75	100.75	100.71		4	8	9.85	1.99	353	410	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	99.96	100.30	100.14	0.12	6	350	12.60	0.69	664	653	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.01	100.02	100.02	-0.02	17	3 014	12.82	0.83	680	680	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.35	101.00	101.00		1	238	9.16	0.27		296	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.36	100.99	100.99	-0.01	2	200	9.19	0.27		299	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.30	100.00					10.36	0.37		419	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.30	99.99					10.98	0.37		481	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.48	0.47		234	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							10.38	0.93	432	440	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13	97.00	100.00					13.25	0.96	718	728	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.10	97.95	97.85	0.85	1	2 600	11.26	1.20	512	534	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	96.00	97.00	95.30	-1.65	2	20 000	13.69	1.20	755	777	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.66	3.07	220	297	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру сгидро 1	22/04/16	12/04/21	94.20	99.60					8.52	2.98	207	283	10 000
Ру сгидро 2	22/04/16	12/04/21	95.50	99.40					8.81	2.98	236	312	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.00	99.80					1.00	0.19			5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.60						8.47	1.84	218	269	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.30	100.50	100.30	0.05	12	91 101	8.85	2.47	246	313	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.15	100.50	100.34	0.09	2	50 001	8.84	2.57	244	312	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.20	101.00	100.90		1	2	8.23	2.16	189	249	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13							7.98	0.49		184	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14							8.27	1.43	207	240	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	91.01	96.00					12.96	1.41	676	709	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	89.00	92.40	91.03	-1.38	2	19 990	12.38	2.93	593	669	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	100.05	100.55	100.50		7	90 005	8.93	2.53	253	321	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.55	98.97					10.93	1.59	469	509	6 000
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21							7.61	0.04			2 000
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14		99.10	99.05	-0.05	3	6 000	8.67	0.53	280	255	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	86.70	100.00					8.65	1.19	251	273	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.35	98.90	98.86	-0.50	2	2	10.13	0.64	420	404	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.02	86.49	86.01	0.01	38	13 379	33.25	0.74	2727	2 720	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.20	98.80	97.50	-1.50	2	15 000	12.34	0.81	633	631	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	103.00						9.19	0.92	313	320	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00	98.50					9.27	1.26	311	337	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Яку тскэнерго БО-1		03/09/13	99.85	100.05					8.54	0.70	258	247	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	99.25						14.37	0.38		820	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	97.90	99.95	99.55	1.60	2	3 000	9.14	0.69	318	307	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.01	100.58	100.35	0.35	16	104 482	8.93	2.25	257	319	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					9.45	2.65	304	374	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.60	100.25					8.97	0.75	299	292	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	101.47	101.60					8.31	0.92	226	232	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.50	99.85					11.29	1.39	510	541	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.01	100.00					10.48	1.39	429	460	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.65	100.80	100.80	0.15	13	16 742	9.63	2.51	324	391	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.18	98.89					10.52	1.26	436	462	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.10	100.23	100.10		1	50	9.07	0.13		281	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.04	0.51	419	391	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.00	100.05	100.00	-0.07	8	10 032	10.20	0.72	423	414	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.05	100.65					11.34	1.17	520	542	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.20	98.40	98.36	0.16	10	606	11.19	1.20	505	527	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.15	96.30	96.30	0.05	3	352	11.33	1.49	511	547	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	100.00	100.25					11.55	1.71	529	574	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	99.93	100.02	100.00		5	24 650	11.07	0.02			3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.00	101.70					13.26	1.24	710	735	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.11	103.00	102.00	-0.80	4	1 847	10.17	0.43		402	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	99.15	99.70					9.26	3.99	271	356	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	99.15	99.70					9.26	3.99	271	356	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	99.15	99.70					9.47	3.98	292	377	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.55	100.00	99.96	-0.04	2	2	8.95	3.41	245	326	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.40	100.53	100.53	0.08	6	29 785	7.42	0.23		120	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.70	99.99	99.75	-0.15	2	3	8.68	1.55	245	283	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.35	98.70					8.72	1.78	244	292	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.10	99.40	99.10	-0.05	14	677	12.44	0.57	655	633	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13							11.81	0.48		567	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.06	100.35	100.35	0.12	11	16 019	11.82	0.79	582	578	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.30	100.37	100.35	0.03	11	222 696	8.23	0.42		207	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13	100.36	100.42	100.44	-0.01	4	1 391	8.19	0.51	234	206	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	100.00	100.09	100.02	0.07	1	5 500	8.10	0.55	222	198	5 000
РОСБАНК АЗ/	06/05/11	06/11/13	98.83	98.86	98.83	-0.03	4	341	8.43	0.88	239	243	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.80	100.95	100.90		17	21 761	8.91	1.62	266	308	10 000
РОСБАНК А5/	06/05/11	07/11/14	97.50	103.00					9.04	1.79	276	325	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2/d	07/06/13	02/12/16	100.00	100.87	100.75	-0.05	1	1	7.78	0.48		164	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.25					8.31	0.77	231	227	10 000
Альфа-Банк 1/d	04/02/14	02/02/16	99.00	99.99					8.89	1.09	278	295	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	99.00	100.30	100.30		2	6	8.49	1.15	236	256	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/13	16/12/14							9.68	0.94	362	370	5 000
МДМ Банк 8/d	09/07/13	09/04/15	100.05	100.20	100.16	0.11	8	330	8.90	0.56	301	279	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.19	1.21	304	327	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.50	100.00					8.70	0.35		252	5 000
НОМОС Банк 9/d	15/06/12	14/06/13							8.92	0.48		278	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.15					9.32	0.63	339	323	5 000
НОМОС Банк 12/	25/08/13	28/08/17	99.50	99.59					9.04	0.68	309	297	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.75	99.80	99.70		1	880	9.57	1.13	344	364	5 000
НОМОС Банк 11/	02/07/14	02/07/14	100.00	100.05	100.00	0.01	7	45 002	9.72	1.42	352	385	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.01	100.10	100.07	-0.03	1	800	8.75	0.45		260	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.06	100.10	100.10	-0.02	1	1 100	8.27	0.15		202	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.07	100.15					7.81	0.17		157	3 000
Банк ЗЕНИТ 1/d	07/04/12	07/04/13	99.40	99.75					8.60	0.32		241	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.24					8.85	0.47		271	5 000
Банк ЗЕНИТ 6/d	02/07/13	01/07/14	100.25	100.30					8.80	0.53	293	267	3 000
Банк ЗЕНИТ 8/d	28/08/13	23/08/17	100.20	100.28	100.25		8	588	8.98	0.68	303	291	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.76	163	157	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.10	100.24	100.10	-0.09	1	2	9.17	0.90	312	317	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.03	100.23	100.19	-0.04	2	10	9.23	1.26	307	333	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2/d	20/02/13	18/02/15	100.00	100.05	100.01	0.03	2	3 892	8.76	0.19		252	5 000
Промсвязьбанк 4/d	20/02/13	18/02/15	100.00	101.50	100.03	0.03	6	50 000	8.65	0.19		241	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							8.85	0.49		271	5 000
Промсвязьбанк 3/d		04/02/14						20 112	9.75	1.08	364	381	5 000
Промсвязьбанк БО7	06/09/14	06/09/15	100.40	100.65	100.57	0.22	4	30 000	10.00	1.59	376	416	5 000
Промсвязьбанк 3/d		01/02/18	100.30	100.70	100.70		1	200	12.42	3.81	588	672	5 000
Банк СПб													
Банк СПб 1/d	09/10/12	09/04/13							8.27	0.04			5 000
Банк СПб 4/d	13/12/12	12/12/13		100.06					9.20	0.98	313	323	3 000
Банк СПб 2/d	26/03/12	23/09/13	99.85	99.90	99.85		2	1 200	9.38	0.76	339	333	5 000
Банк СПб 8/d	07/10/13	05/10/15	100.15	100.40	100.30	-0.10	3	53 382	9.29	0.79	329	326	5 000
МКБ													
МКБ /d	15/01/13	14/07/15	100.10	100.30					7.34	0.09		105	2 000
МКБ -01/d	22/02/13	22/02/14	99.81	99.95	99.94	0.01	4	1 571	8.89	0.19		266	3 000
МКБ -03/d	27/04/13	27/04/15	99.87	99.94	99.87	-0.03	4	504	9.79	0.37		362	4 000
МКБ -02/d	25/09/13	25/09/15	99.80	99.85	99.85	0.03	5	4 582	10.16	0.76	417	411	3 000
МКБ /d	09/10/13	08/04/15		99.75	99.75		1	501	10.29	0.80	428	426	3 000
МКБ -04/d	15/10/12	15/04/14	99.96	100.09	100.09	0.09	1	200	10.41	1.27	425	451	5 000
МКБ -05/d		23/06/14	98.20	98.32	98.20	-0.12	3	1 131	10.78	1.40	458	490	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	19/12/12	21/12/14							4.62	0.02			5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15		100.34					9.03	0.70	307	296	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15		100.23	100.13	-0.02	1	3 000	9.17	0.67	322	309	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.35	100.55	100.55	0.07	2	100	9.39	1.13	327	346	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.83	100.00	99.87	-0.03	3	3 800	9.10	0.73	312	304	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.99	100.03	100.03	-0.07	7	19 501	9.88	1.14	375	395	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.12	100.29	100.10	-0.05	4	7 000	9.61	0.49		347	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	99.92	100.10	100.05		2	1 520	9.76	0.69	380	369	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.60	99.04	98.60	-0.39	3	1 150	10.76	0.76	477	471	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.75	101.05	100.87	-0.08	1	306	11.10	1.07	500	515	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.98	1.08	487	504	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.80	100.35	100.35	0.05	2	1 000	11.12	1.13	500	519	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.70						11.00	1.85	471	522	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.70					11.15	1.95	484	539	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	99.00	99.10	99.00	-0.10	11	4 907	11.84	0.62	592	575	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.20	101.44	100.21	-0.24	16	5 050	12.88	0.62	696	679	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК 4/d	18/04/13	16/04/15	100.41	100.61	100.61	-0.04	14	19 930	11.60	0.35		542	2 000
ТКС БАНК 6/d	16/07/13	14/07/15	101.22	101.30	101.30	-0.10	16	9 590	11.83	0.56	595	571	2 000
ТКС БАНК 2/d		28/07/13	105.53	105.91	105.51	-0.19	17	9 431	10.81	0.58	491	470	1 000
ТКС БАНК /d		20/09/13	101.41	103.15					10.27	0.74	429	422	2 000
ТКС БАНК 2/d	29/11/11	26/11/13	104.30	104.45	104.30	-0.20	22	3 728	11.92	0.92	587	593	2 000
ТКС БАНК 3/d	21/08/12	18/02/14	102.66	102.75	102.66	0.01	8	2 020	11.82	1.09	571	588	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.15	100.18	100.18	0.03	41	27 604	14.35	0.62	843	826	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.16	100.30					10.75	0.88	471	475	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.71	100.10	100.10	0.20	1	8	8.72	0.76	273	267	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.20	100.16	-0.04	3	2 042	9.50	1.59	326	366	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.02					7.63	0.86	160	162	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19	100.75	101.79					7.89	1.09	178	195	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18		99.80	97.10	-2.70	1	9 500	10.66	1.11	454	472	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.75						8.37	2.03	205	262	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	101.00					8.93	1.35	275	304	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.15	100.30					8.19	0.69	223	212	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15		100.30					8.20	0.71	224	214	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.70					8.37	0.70	241	230	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14		101.00					9.20	0.97	313	323	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.35	100.75	100.35	-0.35	2	2	9.08	1.74	281	327	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.50	101.00	99.00	-1.70	1	1	9.92	1.75	365	412	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	253	334	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.87	100.99	100.87	0.01	1	1	7.95	0.95	188	197	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.66	99.85					7.81	0.94	175	183	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		228	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.30	100.30	0.10	7	415	9.23	0.88	319	323	5 000

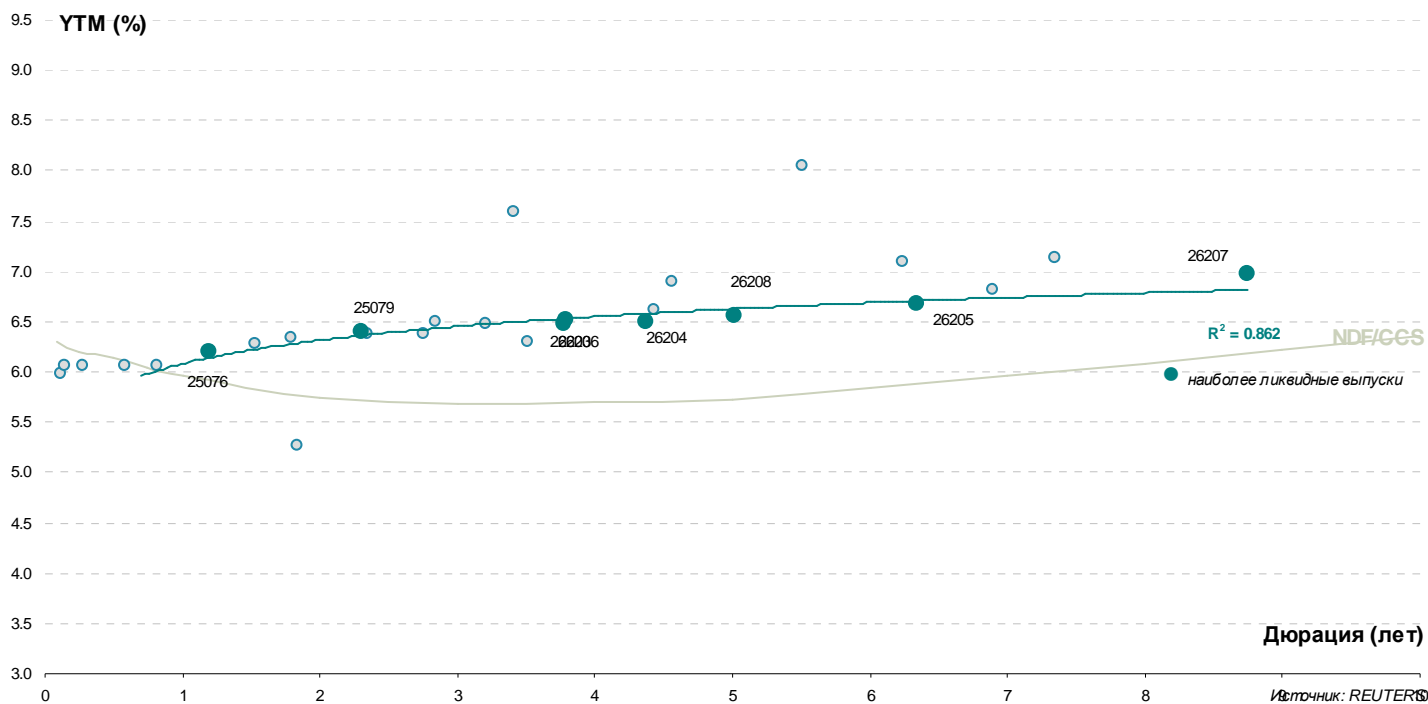
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.17					8.73	0.28		253	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.25	100.25		3	97	9.29	0.87	326	328	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.53	99.85					8.02	0.23		180	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15		100.60	100.60	0.15	1	200	10.44	0.65	450	436	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.51	100.15	100.00		3	96	10.22	0.82	421	419	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30	100.60	100.55	-0.04	4	6 201	10.99	1.21	484	507	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	12/03/13	10/06/14	96.00	100.04	99.90	-0.10	8	42 800	9.76	1.41	356	389	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.92	100.12					8.44	0.34		226	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	98.90	100.00					9.42	0.83	340	340	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.11	100.38	100.14	-0.15	3	2 705	10.04	2.11	370	430	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	100.10	100.06		2	2	7.78	1.24	163	187	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	99.00	99.25	99.00	-0.10	3	4	9.22	0.54	335	310	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.85	100.00	99.95	0.05	2	3 000	8.98	0.71	301	292	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	100.50	100.46		2	10	8.76	0.74	278	271	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.31	100.42					8.85	0.74	287	280	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	101.00	98.55	-0.07	3	205	9.81	0.90	376	381	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	99.05	99.25	99.05	0.30	2	2	9.19	0.90	314	319	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.65	100.95	100.78	0.03	4	35 003	9.75	1.75	348	395	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.37	100.65	100.61	0.11	3	17	8.40	0.63	248	231	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16							8.90	1.41	270	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							9.40	1.75	313	360	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.26	100.39	100.35	0.05	4	12 001	10.42	1.15	429	449	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.46	97.63	97.59	0.14	9	446	10.55	1.22	440	464	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.40	96.54	96.50	0.15	2	12	10.60	1.51	438	475	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.12	0.48			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.20	100.30	100.30	0.10	1	300	8.99	0.45		284	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.10		99.45	0.15	1	3 992	9.72	0.55	384	360	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.00	100.25					9.88	0.80	387	385	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.00	100.15					9.80	0.80	379	377	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.63	1.12	351	369	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.10	100.11	-0.09	2	6	10.12	1.09	401	418	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.00	97.44	97.40	0.39	3	10 190	10.42	1.31	425	453	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.90	99.95	99.91	-0.04	2	10	9.29	0.81	328	326	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	100.05	100.09	100.07	0.02	11	1 000	9.91	1.30	374	401	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14							8.40	0.01			2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14							6.89	0.01			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.10	100.25	100.10	-0.14	1	1	9.55	0.35		337	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14	100.50	100.60	100.50	-0.09	2	4 239	9.62	0.51	377	349	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	19/12/13	09/12/21							9.46	0.96	339	348	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	99.75	100.20					11.30	0.36		513	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	99.75	100.90					9.18	0.89	314	318	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.71	2.44	333	399	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	99.75					11.27	0.82	525	525	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.99	100.40					10.64	0.22		442	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	99.10	105.00					10.98	0.79	498	495	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	86.00	99.90					9.51	0.14		325	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					10.05	0.33		387	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	99.00	102.00	100.70	0.20	1	1	11.08	0.79	508	505	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	20/12/13	22/06/15							10.33	0.95	427	435	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	93.00	97.20	96.85	-0.10	1	10 000	10.39	1.51	417	454	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.30	99.95	-0.30	1	20 000	10.07	0.33		389	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	100.00	100.27	100.20	0.15	2	6 000	9.32	0.36		315	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	100.08						11.05	0.76	506	500	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	100.00	100.05	100.00		1	1 670	10.24	0.93	418	425	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	98.00	100.15					11.80	0.70	584	573	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.15					9.11	0.15		286	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00	100.10	100.05		1	1	10.23	0.59	433	413	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.39	100.43	100.42	0.03	1	20 000	10.29	0.64	436	420	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.50	100.20					9.21	0.45		306	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.65	99.75	99.70		3	10 848	9.24	0.55	336	312	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.20	100.65					9.73	0.80	372	370	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.95	100.98	99.95	-0.30	2	9	12.38	0.84	636	636	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.75	99.78	99.78	-0.01	2	200	9.47	0.82	346	344	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.85	100.30					9.65	0.82	363	363	5 000
УБРИР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.25	100.39	100.30	0.15	1	1	10.87	0.38		470	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.35	101.50					12.19	0.77	620	615	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14							10.25	0.02			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.70	100.80	100.80	0.05	2	150	11.49	0.64	556	540	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.60	99.90	99.90	-0.03	1	10	11.18	0.84	516	516	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	100.00	100.10	100.10	0.10	2	30	12.53	0.93	647	655	2 000
Татфондбанк 7	16/12/11	14/12/12							10.26	0.00			1 000
Татфондбанк БО-4	19/02/13	17/02/15	100.01	100.03	100.03		12	4 763	11.28	0.19		504	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.15	100.15		1	10	9.64	0.21		341	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.00	99.95	99.95		1	490	11.41	0.32		522	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.10	100.25	100.25	-0.15	27	17 990	13.07	0.81	706	704	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	98.44	99.47					11.67	0.96	560	570	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.93	100.10					12.55	1.26	639	664	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	527	578	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		103.45	104.45					5.48	0.46			30 000
Москва 53	01/09/13		99.90						6.95	0.70	99	88	15 000
Москва 63	10/12/13		107.80	108.80					5.92	0.94			15 000
Москва 62	08/06/14		107.43	108.20					6.70	1.38	51	82	35 000
Москва 39	21/07/14		91.87	100.10					7.08	1.50	86	123	10 000
Москва 64	24/06/15		98.80		98.87	-0.53	4	26 001	7.64	2.28	128	191	20 000
Москва 44	16/11/15		112.00						7.20	2.54	80	148	40 000
Москва 56	22/09/16		97.87	99.08					7.41	3.33	92	172	20 000
Москва 49	14/06/17								7.67	3.79	114	197	25 000
Москва 48	11/06/22		92.90	93.74	92.90	-0.05	2	2	7.77	7.03	103	181	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.70	100.90	100.40	-0.49	5	87	8.32	0.49		218	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.50	100.20	99.65	-0.10	4	10 068	8.44	1.28	227	254	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5	03/12/12								-14.27	0.01			3 000
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.27	100.20					8.78	1.67	252	296	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.73	103.05					8.55	2.16	221	281	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		100.20	103.15					6.84	0.40		68	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.20	101.65	101.40		1	1 000	8.09	0.96	202	212	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.51	98.30	98.30	0.15	1	1	8.64	1.98	233	288	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.85	100.20					8.17	0.32		198	3 000
Якутия 9	19/09/13								7.35	0.50		121	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.25	100.35					8.25	1.20	211	233	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАИ													
Краснодарский край 2	14/12/12									0.00			2 000
Краснодар 02	05/11/15		86.00	100.20	100.20		3	5 620	9.10	2.18	275	336	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.80	100.00					8.37	1.22	222	246	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАИ													
Красноярский край 5	29/11/16		101.00	101.25					8.51	1.41	231	264	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	99.81	100.00	99.81	-0.19	3	25	8.37	0.92	231	238	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	98.50	99.71					7.52	1.28	135	162	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	94.85	96.00	96.00	1.15	2	7	8.06	2.15	172	232	1 000
Коми Респ 10		15/12/16							9.13	2.19	278	339	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.55	104.50	104.50	0.80	1	1	8.42	2.45	203	270	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12							7.68	0.02			3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.60	100.80					9.37	1.75	310	357	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16							9.50	2.16	316	376	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.71	101.80	101.85	0.05	27	11 931	8.86	1.64	261	303	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.31	100.35	100.31	0.11	1	1 502	7.43	0.42		127	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.00	99.80					7.88	1.02	179	193	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.50	100.80					8.75	2.10	242	301	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	99.05	99.50	99.50	-0.10	1	700	8.75	1.45	254	288	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12							7.14	0.02			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13							7.62	0.94	156	164	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	101.21	101.40	101.25	-0.23	8	40 746	8.64	1.71	238	283	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	103.85	104.15	103.80	1.15	2	1 499	9.33	1.10	321	339	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13							7.94	0.95	187	196	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15							9.44	2.35	307	371	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



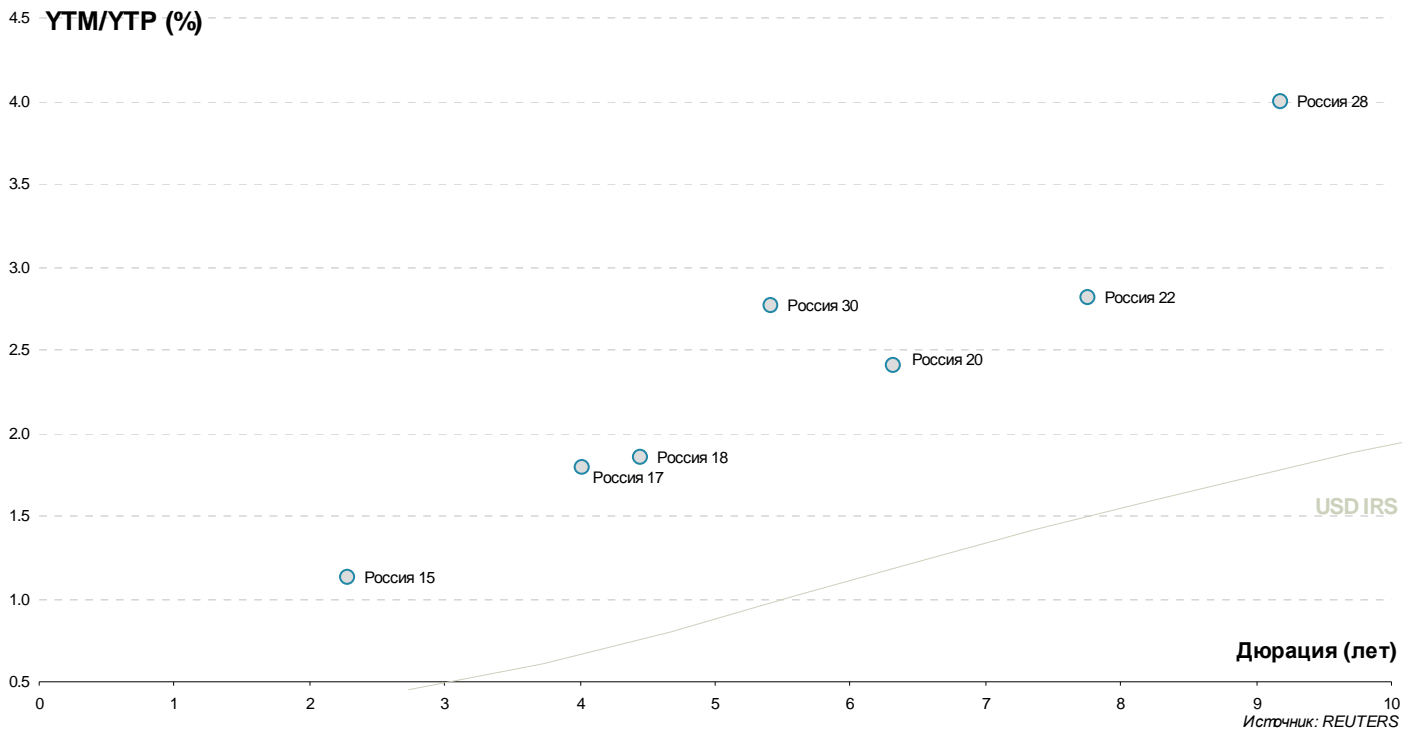
Результаты торгов евробондами

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		105.675	105.963	1.18	1.06	2.28	-0.01	80
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.875	106.125	1.82	1.76	4.03	0.04	117
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.289	149.605	2.02	1.68	4.45	0.01	120
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		126.911	127.048	2.77	2.75	5.41	-0.18	141
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.250	117.650	2.43	2.37	6.32	0.04	118
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		113.500	114.000	2.84	2.78	7.75	0.03	126
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		199.895	201.105	4.03	3.96	9.18	0.31	203
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.550	124.050	4.22	4.19	15.98	0.08	172
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.053	101.071	1.42	1.37	0.34	-0.01	113
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		100.864	101.722	3.02	0.52	0.33	-0.47	275
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.802	101.818	1.55	1.50	0.31	0.11	126
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.547	104.047	1.69	0.91	0.60		140
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		109.750	110.430	2.66	2.15	1.18		237
GAZPR'14 10.5%	USD	06/03/14		109.250	109.910	2.78	2.26	1.16	0.25	249
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.151	109.235	2.32	2.27	1.51	0.15	200
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.050	107.425	2.59	2.46	2.77	0.05	216
GAZPR'16 4.95%	USD	21/05/16		107.150	107.450	2.75	2.66	3.20	0.03	228
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.650	112.150	3.04	2.92	3.56	-0.10	248
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		122.770	123.270	3.42	3.33	4.47	0.16	261
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		130.850	131.350	3.74	3.67	5.09		278
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.375	111.875	3.26	3.10	2.84	-0.49	249
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		118.500	119.000	4.08	4.02	7.17		258
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		106.875	107.625	4.08	3.99	7.68	0.13	249
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		141.875	142.875	5.32	5.26	11.74	-0.38	309
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.500	129.250	5.22	5.17	13.00		294
Газпром нефть										
GPN CAPITAL '22 4.375%	USD	19/09/22		100.349	100.745	4.33	4.28	7.96	-0.90	272
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	17/08/13		103.998	105.998					
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		104.539	105.539	1.87	1.06	1.17	0.03	157
TRANSN'18 8.7%	USD	17/08/18		128.876	129.176	3.08	3.03	4.61	-0.17	220
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.130	111.630	2.96	2.84	3.85	0.27	233
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		113.122	113.538	4.00	3.95	7.41	0.25	247
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.058	100.482	5.36	5.26	4.31	-0.11	468
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.100	107.450	3.11	2.96	2.07	-0.13	277
VTB'17 6%	USD	12/04/17		106.875	107.375	4.24	4.12	3.85	-0.13	364
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		108.367	108.607	4.48	4.44	4.45	0.12	372
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		110.625	111.025	4.64	4.57	4.67	-0.01	383
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		109.770	110.145	5.02	4.97	6.26	0.13	377
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		106.670	107.045	6.04	5.99	7.30	0.17	453
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		107.000	107.370	5.69	5.67	12.39	-0.02	340
VTB' 9.5%	USD			106.999	107.604	8.45	8.36	6.76	0.44	708
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		102.109	102.150	2.04	1.94	0.40		175
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.250	106.625	3.75	3.58	2.08		341
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		104.070	104.380	4.47	4.36	2.73		407
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		100.940	101.940	5.77	5.52	3.91		522
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.644	108.847	3.14	3.09	3.73	-0.23	254
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		110.270	111.020	3.18	3.03	4.41	-0.18	243
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		120.048	120.557	3.82	3.75	6.02	0.46	259
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		113.875	114.625	4.24	4.15	7.38	0.25	269
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		119.650	120.525	4.75	4.67	9.16	0.15	284
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		102.999	103.026	2.19	2.14	0.51	-0.13	190
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.119	106.417	3.06	2.91	1.91	0.14	273
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		107.950	108.500	3.46	3.26	2.55	0.09	306
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.582	111.751	3.65	3.60	3.02	-0.03	315
GAZPROMB'17 5.625%	USD	18/05/17		105.919	106.127	4.14	4.09	3.97	0.17	352
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		108.050	108.550	5.72	5.63	5.23	1.05	476
GPB EURO' 7.875%	USD			102.150	102.817	7.38	7.23	4.44	0.49	668
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.118	103.164	1.97	-0.50	0.41	0.07	168

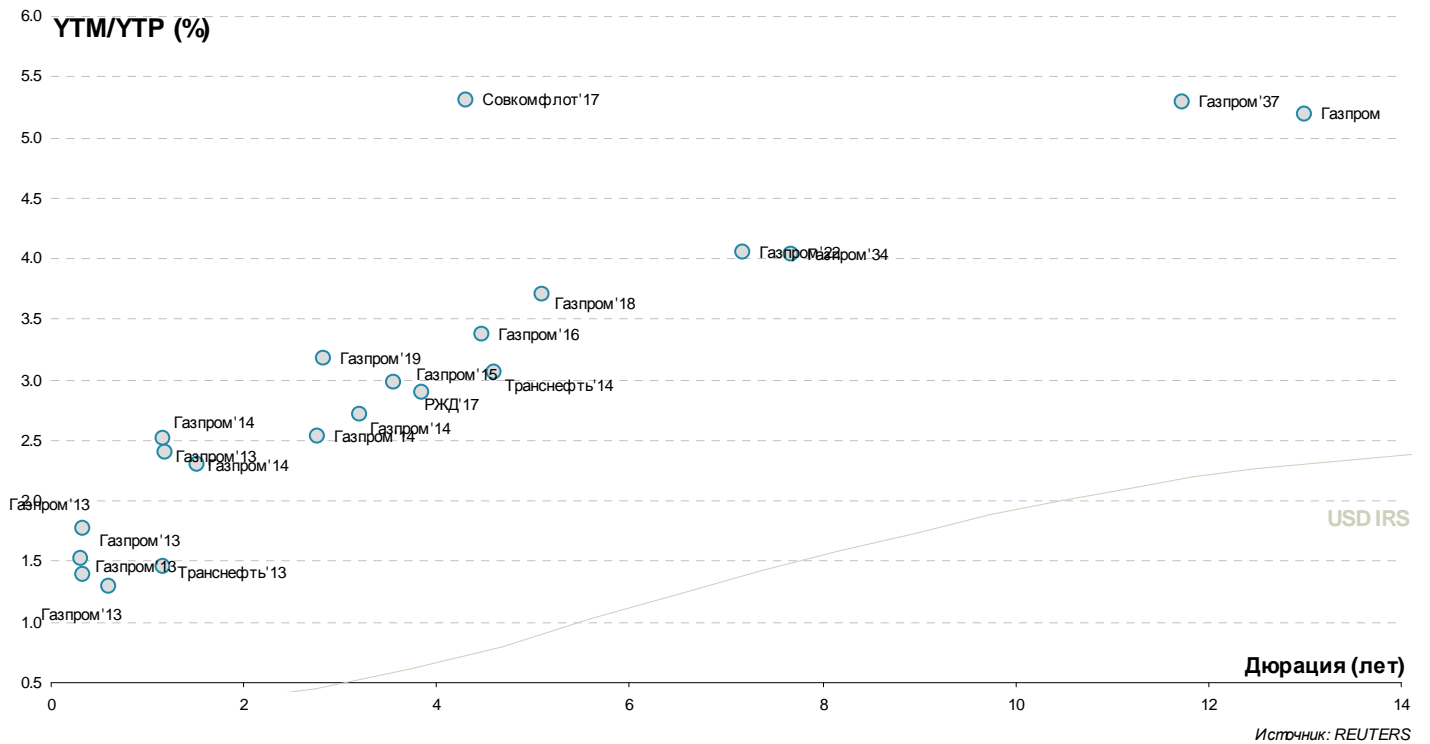
Выпуск	Валюта	Дата Погашения	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14	105.400	105.700	2.01	1.74	1.02		170
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14	109.300	109.600	2.56	2.36	1.42		225
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17	109.950	110.305	3.82	3.74	3.93	-0.02	319
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17	106.870	107.170	3.78	3.72	4.40	1.13	303
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18	118.375	119.125	3.97	3.83	4.62	0.39	314
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21	103.692	103.853	4.83	4.78	3.17	-0.06	438
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	05/05/13	102.250	102.750	0.94	-0.25	0.41	0.19	64
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13	102.500	103.000	1.78	0.88	0.52	-0.05	149
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15	108.400	108.750	2.10	1.97	2.37	0.09	171
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17	109.100	109.475	3.11	3.02	3.85	0.27	248
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17	107.250	107.650	3.07	2.97	3.74	0.25	246
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19	107.364	107.662	3.89	3.84	5.53	-0.39	283
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21	110.177	110.552	4.28	4.23	6.94	0.05	288
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22	113.231	113.635	4.35	4.30	7.13	-0.02	286
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22	100.889	101.278	5.01	4.96	7.83	-0.16	342
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ									
Евраз									
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13	102.369	102.869	2.03	0.65	0.35	0.34	174
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15	109.900	110.400	4.56	4.38	2.63	0.05	417
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17	103.750	104.250	6.40	6.27	3.77	0.48	585
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18	110.624	111.367	7.08	6.92	4.32	-0.12	637
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18	101.000	101.375	6.52	6.44	4.55	0.81	578
Металлоинвест									
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16	104.500	105.000	5.11	4.96	3.19	0.75	465
НЛМК									
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19	100.352	100.638	4.89	4.84	5.78	0.23	380
Альянс Ойл									
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15	109.040	109.259	5.51	5.41	2.02	0.10	521
Агроса									
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14	110.445	110.913	3.20	2.97	1.80	-0.02	287
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20	115.000	115.625	5.39	5.30	6.13	0.47	415
Вымпелком									
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13	102.000	102.250	2.83	2.17	0.37	-0.18	254
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14	99.889	102.222	4.44	2.88	1.48		
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16	106.700	106.700	4.18	4.18	2.82	-0.02	377
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16	111.795	112.285	4.50	4.35	3.07	-0.05	404
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17	105.380	106.380	4.82	4.57	3.71	0.38	427
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18	117.875	118.500	5.26	5.14	4.41	0.26	449
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21	111.450	112.450	5.95	5.80	6.14	0.18	471
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22	110.650	111.050	5.98	5.93	6.81	0.28	457
Лукойл									
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14	107.900	108.250	2.07	1.89	1.79		173
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17	114.250	115.000	2.93	2.77	3.99		227
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19	121.375	121.875	3.70	3.63	5.64	0.31	259
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20	114.750	115.375	3.93	3.85	6.46	0.50	263
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22	120.500	121.125	4.03	3.96	7.40	-0.32	250
МТС									
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20	124.375	125.125	4.73	4.63	5.71	-0.42	355
НОВАТЭК									
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16	106.308	106.461	3.19	3.14	2.88	-0.16	274
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21	116.750	117.500	4.15	4.05	6.43	-0.37	282
Северсталь									
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13	104.650	105.450	2.08	0.83	0.59	-0.15	180
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14	108.750	109.550	2.54	1.97	1.27		225
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16	106.250	106.750	4.36	4.21	3.22	0.58	387
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17	108.250	108.750	4.77	4.66	4.22	1.32	409
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22	100.500	101.250	5.83	5.73	7.54	0.89	429
ТМК									
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18	102.124	102.552	7.24	7.14	4.20	-0.22	658
Распадская									
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17	103.583	103.964	6.78	6.68	3.76	0.04	625
ТНК-ВР									
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13	101.629	104.629					
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15	107.550	107.900	2.57	2.41	1.98	0.15	222
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16	115.500	116.000	2.91	2.78	3.16		240
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17	114.181	114.395	3.05	3.00	3.76	-0.08	243
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18	120.876	121.143	3.48	3.43	4.41	-0.17	269
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20	121.250	121.750	3.81	3.74	5.71		268
ЧАСТНЫЕ БАНКИ									
Альфа-Банк									
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13	103.330	103.383	2.71	2.61	0.50	-0.07	243
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15	108.000	108.450	4.23	4.03	2.07	-0.04	390
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17	99.693	100.055	6.38	6.28	3.67	-0.06	585
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17	111.000	111.500	5.24	5.12	4.05	-0.25	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

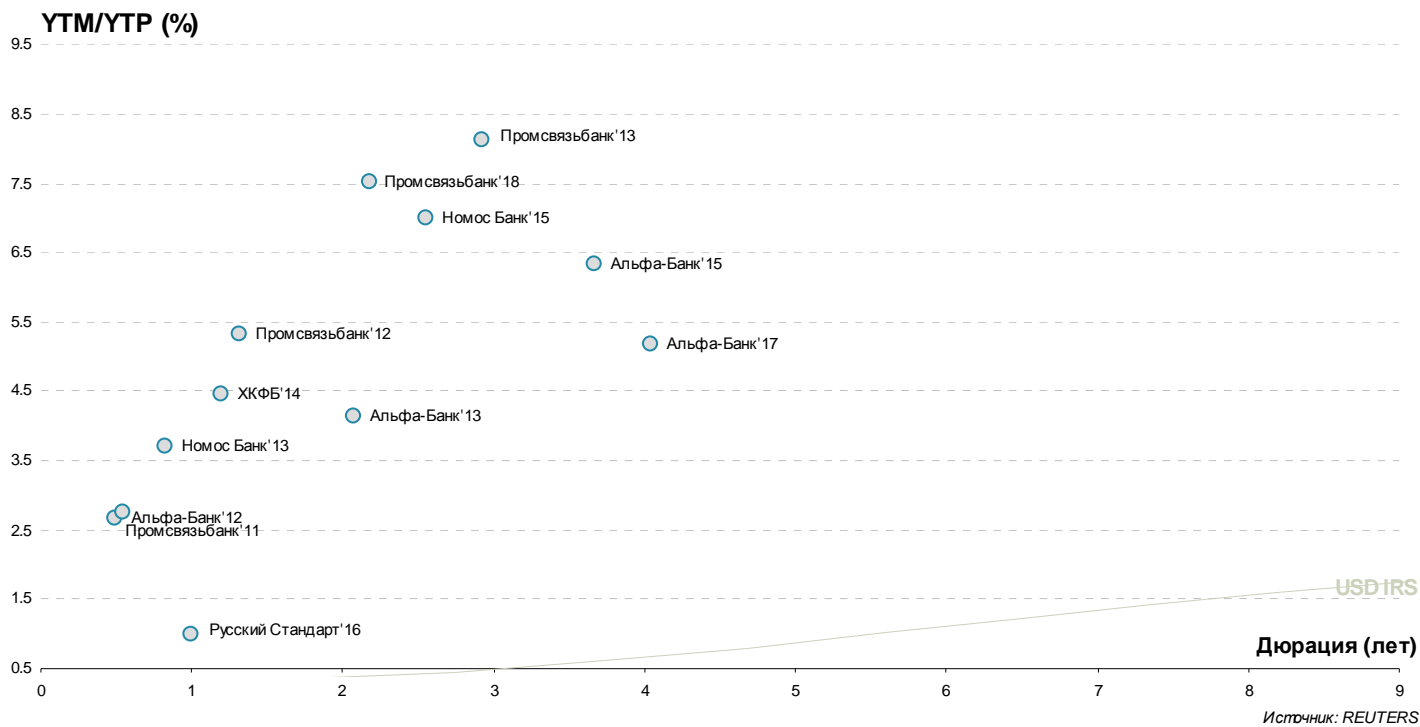
Россия



Госкомпании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
Макроэкономика/кредитный анализ
Кредитный анализ
Количественный анализ
Акции

Владимир Евстифеев
Кирилл Сычев
Евгений Чердаков
Дмитрий Чепрагин
Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

ibcm@zenit.ru
d.ruchkin@zenit.ru
a.pashkevich@zenit.ru
f.akhmetova@zenit.ru
m.nikishova@zenit.ru
vera.panova@zenit.ru
a.basov@zenit.ru
e.gashigullina@zenit.ru

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

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

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

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