

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Продвижение в процессе бюджетных переговоров радует рынки

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Старт налогового периода не вызвал особых проблем
- Рубль резко подешевел

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Суверенные евробонды дешевеют, корпоративные – сокращают спреды
- Рублевые облигации: активность низка дальние ОФЗ дешевеют

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

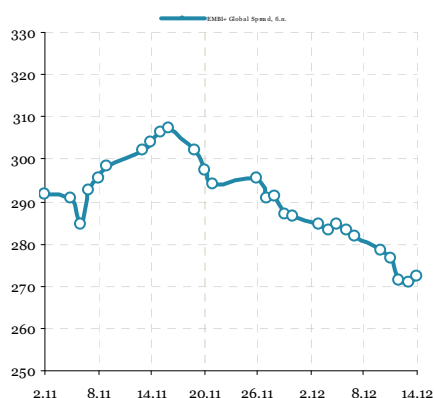
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.70	▼	-0.03	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	147	▼	-1	117	162
EMBI+ Glob.	272	▲	1	270	422
EMBI+ Rus sprd	147	▼	-1	141	327
Russia 30 yield	2.73	▼	0.00	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	6.81	▼	-0.01	6.35	6.91
Корсчета в ЦБ	707.3	▼	-128.6	446	1011
Депоз. в ЦБ	89.6	▼	-11.5	65	238
NDF RU 3m	6.3	▲	0.0	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	30.715	▲	0.022	30.46	33.26
EUR/RUB	40.339	▲	0.204	38.97	41.73
EUR/USD	1.316	▲	0.009	1.21	1.32
Корзина ЦБ	35.17	▲	0.076	34.77	37.02
ДXY Индекс	79.58	▼	-0.348	78.85	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1500.9	▼	-0.3%	1262	1589
Dow Jones	13135.0	▼	-0.27%	12411	13610
DAX	7596.5	▲	0.19%	6132	7615
Nikkei 225	9738	▲	0.94%	8366	9743
Shanghai Comp.	2150.6	▲	0.45%	1960	2319
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	108.5	▲	2.16%	88	117
Нефть Brent	109.2	▼	-0.61%	89	117
Золото	1696.1	▼	-0.40%	1553	1790
CRB Index	294.9	▲	0.75%	267	321

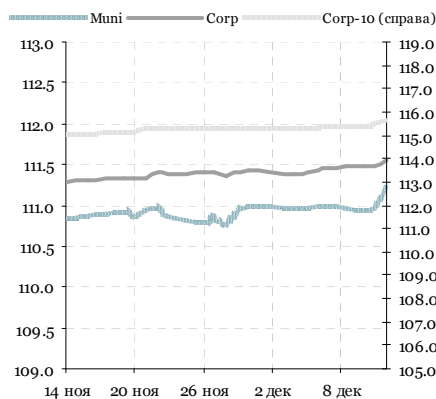
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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	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	22 514
Muni	1 004	▲	240	10	5 492
Corp	6 322	▲	473	19	44 858

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Главные новости

Ставка первого купона по облигациям АКБ «Абсолют Банк» серии БО-01 объемом 5 млрд руб. установлена по результатам сбора заявок на уровне 10,5% годовых. Срок обращения бумаг составит 3 года с даты начала размещения, предусмотрена оферта через 1,5 года. /Финам/

Совет директоров ЗАО «ИНГ БАНК» 24 декабря рассмотрит вопрос о размещении трех выпусков классических облигаций серий 06, 07 и 08 по 5 млрд руб. каждый. /Финам/

Ставка первого купона по облигациям ОАО Банк «ОТКРЫТИЕ» серии 01 объемом 3 млрд руб. установлена по результатам сбора заявок на уровне 10,75% годовых. Срок обращения бумаг составит 1820 дней, предусмотрена годовая оферта. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 17.12.2012 – понедельник

- **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.)

Сегодня: 18.12.2012 – вторник

- **Выплата купона:** Башнефть, 01 (12.5%, 934.9 млн руб.), Башнефть, 02 (12.5%, 934.9 млн руб.), Башнефть, 03 (12.5%, 1.2 млрд руб.), ВТБ, БО-03 (8%, 99.7 млн руб.), ВТБ, БО-04 (8%, 99.7 млн руб.), ЭнеЛ ОГК-5, БО-15 (8.5%, 169.5 млн руб.), СИТРОНИКС, БО-01 (12%, 119.6 млн руб.), РМК-ФИНАНС, 03 (10.4%, 155.5 млн руб.), КБ Центр-инвест, БО-01 (8.4%, 62.8 млн руб.), КБ Центр-инвест, БО-05 (8.4%, 41.8 млн руб.), Департамент Финансов Тверской области, 34007 (8.5%, 63.5 млн руб.), Мострансавто-Финанс, 01 (11.8%, 189.7 млн руб.), МТС, 03 (8%, 398.9 млн руб.)
- **Погашение:** Микро Капитал, 2012-2, EUR (1.1 млн евро), Мострансавто-Финанс, 01 (7.5 млрд руб.)
- **Размещение:** МРСК Центра и Приволжья, БО-01 (4 млрд руб.), ОКЕЙ, 02 (3 млрд руб.), ССМО ЛенСпецСМУ, 02 (5 млрд руб.), БизнесЛайт, БО-01 (600 млн руб.), Воронежская область, 34005 (5 млрд руб.), Ставропольский край, 34001 (5 млрд руб.)
- **Оферта:** НПК Уралвагонзавод, 01 (3 млрд руб.), АИЖК, 23 (14 млн руб.)

Завтра: 19.12.2012 – среда

Статистика США: Housing starts, Building permits

- **Выплата купона:** Стальфонд-Недвижимость, 01 (5%, 14.9 млн руб.), Банк Петрокоммерц, 05 (12.75%, 319.6 млн руб.), Россия, 26202 (11.2%, 1.1 млрд руб.), Новолипецкий металлургический комбинат, БО-02 (8.75%, 218.1 млн руб.), Новолипецкий металлургический комбинат, БО-03 (8.75%, 218.1 млн руб.), Еврофинансы-Недвижимость, 01 (1.5%, 8.2 млн руб.), Россия, 35009(ГСО-ППС) (6.7%, 501.1 млн руб.), Россия, 36001(ГСО-ППС) (7.1%, 1.2 млрд руб.), Казань, 34007 (8.75%, 37 млн руб.), РСГ-Финанс, 01 (10.75%, 80.4 руб.), ДельтаКредит, 06 (7.2%, 179.5 млн руб.), Россия, 26206 (7.4%, 5.5 млрд руб.), Металлинвестбанк, 01 (10.15%, 76.3 млн руб.), Еврофинансы-Недвижимость, 03 (1.5%, 5.6 млн руб.), Вологодская область, 34002 (10.65%, 66.6 млн руб.), Министерство финансов Самарской области, 35008 (9%, 336.6 млн руб.)
- **Размещение:** Внешпромбанк, 02 (1.5 млрд руб.), Банк ОТКРЫТИЕ, 01 (3 млрд руб.), Ипотечный агент НОМОС, А (3.7 млрд руб.), Ипотечный агент НОМОС, Б (1.2 млрд руб.)
- **Оферта:** КАМАЗ, БО-01 (2 млрд руб.), Т-Платформы Финанс, 01 (100 млн руб.)

Внешний рынок долга

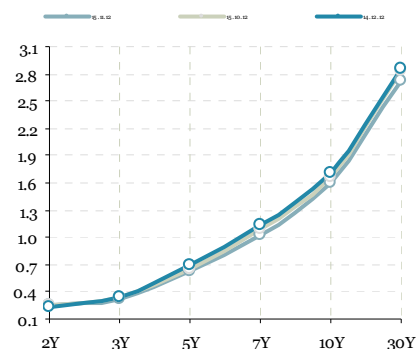
Продвижение в процессе бюджетных переговоров радует рынки

Все внимание рынков зафиксировано лишь на переговорах в США относительно налогово-бюджетной политики. Полученные подтверждения того, что республиканцы пошли на небольшие уступки и согласились на повышение налогов для граждан с годовым доходом более 1 млн долл., тогда как Обама настаивал на цифре 250 тыс. долл. в год. В терминах долгосрочного бюджета (на 10 лет) это означает дополнительное повышение доходов на 200 млрд долл. (с 800 млрд долл. до 1 трлн долл.). Помимо этого, спикер Палаты представителей Д. Бейнер также предложил сразу обсудить возможность поднятия «потолка» госдолга на 2013 г., чтобы в следующем году не возвращаться к этому вопросу.

Несмотря на все эти новости, позиции оппонентов пока еще очень далеки от достижения договоренностей: взгляды на источники дополнительных доходов бюджета и масштабе сокращения расходов все еще очень значительны и уступка Бейнера является лишь небольшой частью возможного консенсуса. Судя по тому, что лидер республиканцев призвал коллег ничего не планировать на рождественские каникулы, переговоры продолжатся вплоть до конца года. С точки зрения экономики существенного различия в том, будут ли бюджетные приняты меры сейчас или в январе будущего года нет, поэтому мы не исключаем, что переговоры затянутся на следующий год. Однако рынки явно закладывают в текущие котировки позитивный исход переговоров (принятие основной части требований демократов) до конца 2012 г.

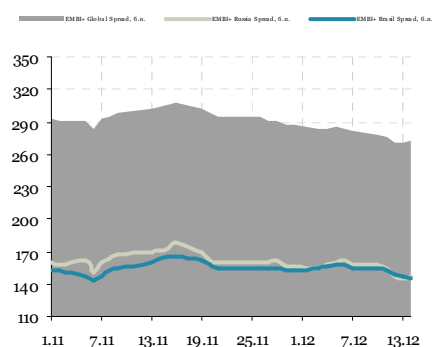
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



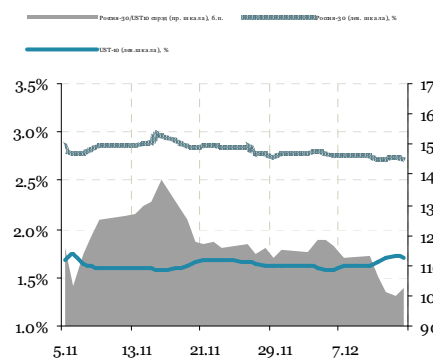
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВ1+ (Россия, Бразилия)



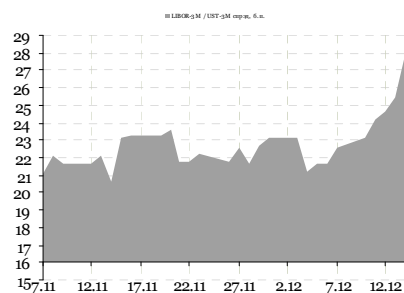
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Старт налогового периода не вызвал особых проблем

Условия локального денежно-кредитного рынка остаются напряженными. В то же время, завершившаяся вчера уплата страховых взносов в фонды, потребовавшая из банковской системы порядка 230 млрд руб. не привела к дальнейшему ухудшению конъюнктуры. Уровень краткосрочных процентных ставок держались вблизи пятничных значений. На рынке МБК кредиты овернайт обходились в среднем под 6.50% годовых, междилерское репо с облигациями на 1 день – под 6.40% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли 598 млрд руб. на 1 день (спрос 611 млрд руб.) и 40ю5 млрд руб. на 91 день. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 112.5 млрд руб. до 922.7 млрд руб.

На текущей неделе налоговый период продолжится, в четверг предстоит провести платежи по НДС, которые потребуют еще около 180 млрд руб. из банковской системы. Еще около 190 млрд руб. требуется банкам для возврата ранее привлеченных средств в Казначействе и Фонде ЖКХ. Таким образом, существенные оттоки ликвидности на текущей неделе, вероятно, продолжают удерживать рублевые ставки вблизи локальных максимумов.

Рубль резко подешевел

Торги на валютном рынке вчера завершились резким ростом курса бивалютной корзины на 37 коп. до 35.37 руб. Ни внешний, ни внутренний фон не располагали к столь существенному ослаблению рубля. Вероятно, рубль остается под давлением локальных игроков, не желающих оставаться в российской валюте на период длинных новогодних каникул. Явное нежелание нефти выйти вверх из сложившегося среднесрочного диапазона (выше 112 долл. за барр. Brent) добавляет рынкам нервозности при построении прогнозов на начало 2013 г., что выливается в избавление от рублей. Сегодня совокупность факторов для рубля выглядит умеренно оптимистичной, однако если игроки продолжают формировать защитные позиции на предстоящие выходные, российская валюта может вновь оказаться под давлением.

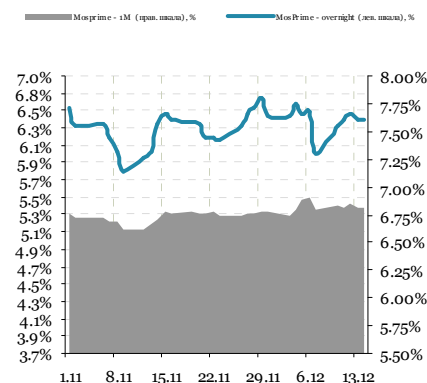
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	Уплата налогов	Страховые взносы в фонды (~230 млрд руб.)	589
Вторник	Ломбардный аукцион ЦБ	7 дней	
	Аукцион Казначейства	35 дней, 40 млрд руб., от 6.5% годовых	
Среда	Аукцион ОФЗ	7 лет, 30 млрд руб.	
	Возврат Казначейству	37.5 млрд руб.	
	Возврат Фонду ЖКХ	1.8 млрд руб.	
Четверг	Купоны ОФЗ	7 млрд руб.	
	Аукцион Казначейства	21 день, 40 млрд руб., от 6.5% годовых	
Пятница	Уплата налогов	НДС (~180 млрд руб.)	
	Возврат Казначейству	151 млрд руб.	

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

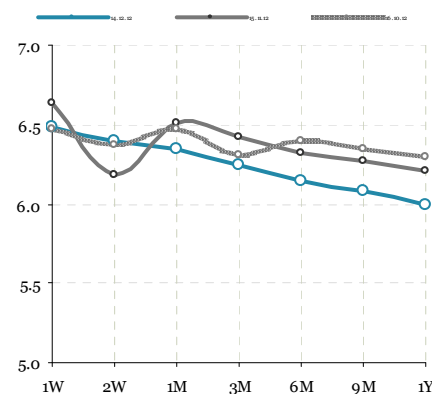
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Суверенные еврообонды дешевеют, корпоративные – сокращают спреды

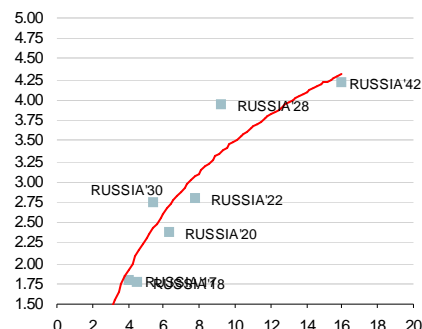
Суверенные еврообонды испытывают давление со стороны UST, где доходности за лень поднялись в пределах 5 бп. На этом фоне котировки на российской суверенной кривой потеряли в ценах до 20 бп, против рынка торговалась «тридцатка», прибавившая в ценах к концу дня порядка 15 бп. Корпоративный сектор в основном торговался «в плюс», однако темпы роста замедлились в среднем по рынку до не более 10 бп. Достаточно слабо выглядели дальние выпуски Газпрома GAZPRU'34 и GAZPRU'37, потерявшие в ценах порядка 75 бп. напротив, неплохую динамику показали дальние выпуски ВЭБа и старшие бумаги Сбербанка, прибавившие в среднем более 30 бп. В секторе частных компаний по-прежнему выделялись дальние выпуски Вымпелкома, прибавившие в ценах в среднем более 25 бп.

Рублевые облигации: активность низка дальние ОФЗ дешевеют

На локальном рынке активность в понедельник была не на высоком уровне. На кривой ОФЗ середина кривой осталась с минимальными оборотами, относительно активно торговали лишь ближними и дальними бумагами. По итогам дня цены на дальнем участке кривой потеряли в среднем более 25 бп, а дальний выпуск 26207 завершал день ниже отметки 111.5%. В корпоративном секторе активность сохранилась в бумагах Роснефти, где биды опустились на 15 бп, на такой же дюрации проходили сделки в выпусках ВЭБ 6 и РЖД 19. Ближе по кривой активность была заметна в выпуске НМТП БО2 (+25 бп) и МРСК Центра БО1. В верхнем сегменте доходности активно торговался выпуск Русал 08, потерявший в ценах по итогам дня порядка 30 бп.

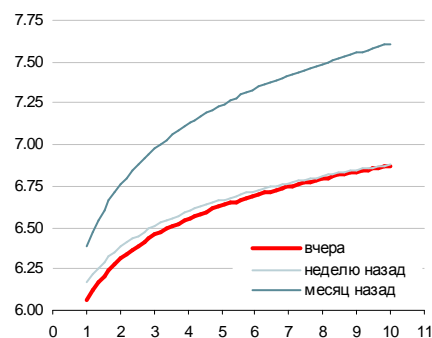
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



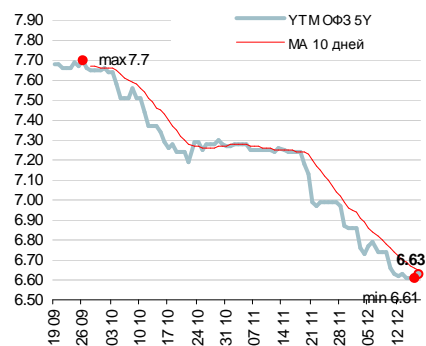
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



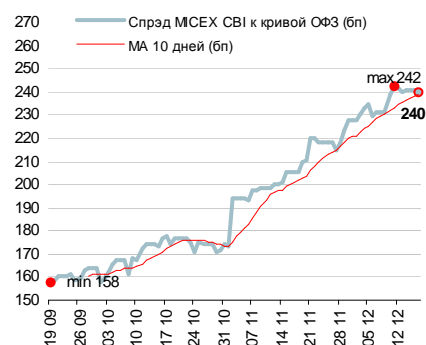
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



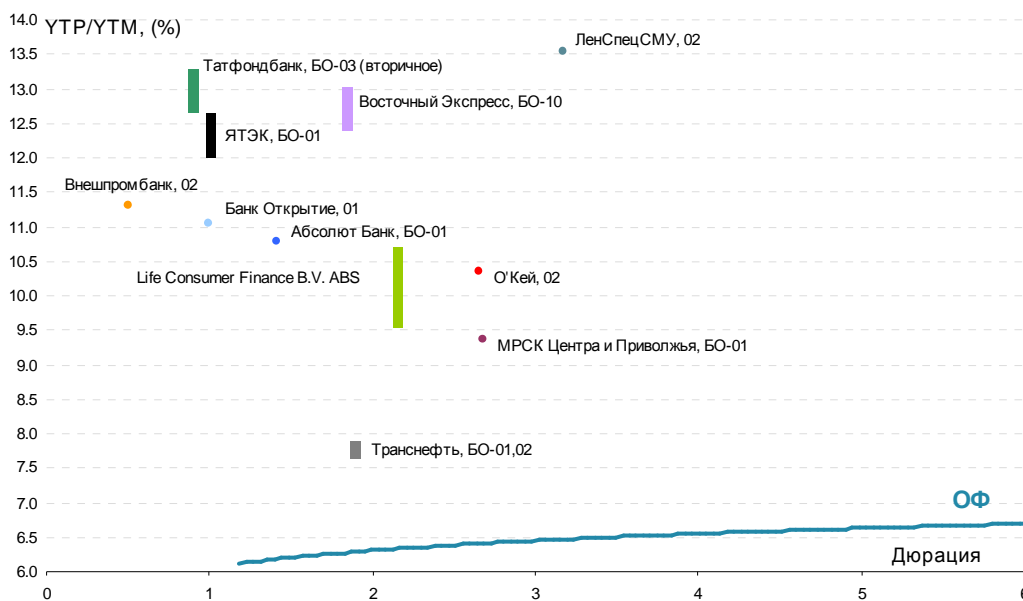
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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	10.36	13.12.2012	18.12.2012	нет / 2.66 г.	3 г. / 5 лет
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Ва2 / -	да	4 000	9.36	14.12.2012	18.12.2012	нет / 2.68 г.	нет / 3 г.
ЛенСпецСМУ, 02	В / - / -	да	5 000	13.54	14.12.2012	18.12.2012	да / 3.17 г.	нет / 5 лет
Внешпромбанк, 02	В / В2 / -	да	1 500	11.30	14.12.2012	19.12.2012	нет / 0.5 г.	0.5 г. / 5 лет
Банк Открытие, 01	В / - / В	да	3 000	11.04	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.
Абсолют Банк, БО-01	- / Ва3 / ВВ+	да	5 000	10.78	17.12.2012	20.12.2012	нет / 1.42 г.	1.5 г. / 3 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.
ЛК Уралсиб, БО-12	- / - / ВВ-	да	2 000	н/д	н/д	21.12.2012	н/д	н/д / 3 г.
ЛК Уралсиб, БО-13	- / - / ВВ-	да	1 500	н/д	н/д	21.12.2012	н/д	н/д / 3 г.
Транснефть, БО-01	ВВВ / Ваа1 / -	да	17 000	7.64-7.85	18.12.2012	24.12.2012	нет / 1.89 г.	2 г. / 3 г.
Транснефть, БО-02	ВВВ / Ваа1 / -	да	17 000	7.64-7.85	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	ВВВ / - / -	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	- / Ваа1 / -	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	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	ВВВ- / Ваа3 / ВВВ-	да	10 000	2.0 / 100%	8.84-8.99	8.58	07.12.2012	нет / 2.71 г.
Газпром Нефть, 12	ВВВ- / Ваа3 / -	да	10 000	3.7 / 100%	8.78-8.99	8.68	05.12.2012	нет / 4.17 г.
АИЖК, 24	ВВВ / Ваа1 / -	да	6 000	2.8 / 100%	8.69-8.90	8.43	05.12.2012	да / 2.64 г.
Глобэкс, БО-07	ВВ / - / 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	ВВ+ / - / ВВВ-	да	10 000	н/д / 100%	8.63-8.89	8.73	08.11.2012	да / 2.70 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	100.09	100.11	100.11	-0.01	67	326 280	6.03	0.10			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.07	100.09	100.09	-0.01	36	249 248	6.06	0.14			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.61	101.70					5.93	0.27			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.10	100.20	100.10	0.00	7	34 825	6.04	0.57	18		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.60					6.23	0.81	24	15	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	101.05	101.15	101.13	0.03	12	152 599	6.22	1.19	10	25	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.00	109.40	109.29	0.14	3	3	6.16	1.52		26	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	109.21	109.45	109.34	0.04	7	131 501	6.34	1.78	7	50	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	103.22	103.50					6.36	1.83	8	53	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.55	101.69	101.69	-0.06	2	2	6.34	2.30		57	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.30	103.99	101.30	-0.20	3	3	6.42	2.34	6	65	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	103.00	103.12	103.12	0.16	3	21	6.32	2.75		58	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.35	99.71	99.50	-0.13	4	203	6.65	2.83	22	92	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.80	102.20	101.80	-0.20	9	90 236	6.44	3.20		72	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	99.00					6.30	3.51		57	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.61	3.40	112	188	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.79	103.95	103.80	-0.10	28	7 758	6.48	3.76		74	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.70	103.85	103.75	-0.12	9	60 016	6.53	3.78		79	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.90	105.05	105.00		4	16 505	6.46	4.38		70	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	94.50	94.69					6.64	4.42	5	88	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.40	101.80					6.89	4.55	29	113	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	105.29	105.50	105.30	-0.20	4	10 568	6.55	5.01		77	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		70.00	76.00	10.00	1	5	5.25	5.36			27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	97.00	99.00	99.00	0.50	4	2 003	6.99	6.22	28	107	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	106.24	106.30	106.34	-0.06	2	11	6.71	6.32		78	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	106.14	106.30	106.30	-0.20	8	135 590	6.81	6.88	7	81	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	84.70	94.70					7.14	7.33	38	109	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	110.96	111.55	111.35	-0.40	21	175 413	7.00	8.75	17	76	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.00	96.00					7.54	11.15	63	99	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29							6.56	11.10		2	40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВО3		30/07/13	99.82	100.99					7.10	0.60	122	96	15 000
---------------	--	----------	-------	--------	--	--	--	--	------	------	-----	----	--------

НЛМК

НЛМК ВО6		05/03/13	100.06	100.30	100.10	0.05	1	11 455	7.32	0.21		104	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14							7.87	0.48		170	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14							7.97	0.48		180	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.00	100.50					8.21	1.61	198	233	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.40	101.80					8.30	1.78	203	246	10 000
НЛМК 7/d	16/03/15	05/09/22	100.42	100.70					8.36	2.05	204	257	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.95	100.05	100.00	0.02	1	4	7.74	0.30		151	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15	86.00	100.15	99.98	-0.03	2	2 000	8.36	0.64	245	223	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.70					8.10	1.14	199	212	5 000
ММК ВО6		10/06/14	84.10						9.00	1.46	280	309	5 000
ММК ВО7		22/07/14	94.90	99.25	97.90	-0.22	1	50 000	8.87	1.49	267	297	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.01	100.40	100.37	-0.01	4	493	7.46	0.16		115	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	99.95	100.33	100.33	0.03	2	1 500	7.71	0.16		140	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15							8.09	0.50	227	193	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.16	100.24	100.16		4	4 148	8.18	0.51	235	202	8 000
Алроса 23		18/06/15							8.82	2.22	248	305	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.80	101.05					8.75	2.24	240	298	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.49	100.65					8.89	2.54	250	314	5 000
Алроса ВО2		30/10/15	100.45	100.60	100.60	-0.10	9	54 647	8.89	2.54	250	314	5 000

Евраз

Евраз 1/	22/03/13	13/03/20	100.15	100.32	100.15	-0.05	2	2	8.74	0.26		249	10 000
Евраз 3/	22/03/13	13/03/20	100.16	100.26	100.16	-0.05	2	4 342	8.70	0.26		245	5 000
Сибметинвест 1/	16/10/14	10/10/19	107.50	107.84	107.55	0.29	3	28 016	9.12	1.66	288	325	10 000
Сибметинвест 2/	16/10/14	10/10/19	107.16	107.85	107.55	-0.21	1	10 000	9.12	1.66	288	325	10 000
Евраз 2/	26/10/15	19/10/20	101.60	101.79					9.42	2.53	303	367	10 000
Евраз 4/	26/10/15	19/10/20	101.60	101.80					9.45	2.53	306	370	5 000
Евраз 5/	06/06/16	27/05/21	94.00	100.00					10.10	3.07	364	438	5 000
Евраз 7/	02/06/16	25/05/21	92.00	95.70					10.02	3.06	356	430	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1/d	16/03/15	07/03/22	100.00	100.35	100.03	-0.03	3	13 880	9.18	2.04	287	339	5 000
Металлоинвест 5/d	16/03/15	07/03/22	100.10	100.17	100.10	-0.10	7	5 963	9.14	2.04	283	335	10 000
Металлоинвест 6/d	19/03/15	10/03/22	99.90	100.15	100.00		4	66 000	9.19	2.05	288	340	10 000

Мечел

Мечел ВО2/		12/03/13	99.60	99.78	99.78	0.08	11	12 366	10.88	0.23		462	5 000
Мечел 5/d	16/04/13	09/10/18	96.01	100.00					11.71	0.32		548	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	99.05	99.39									
Мечел 2/d	15/06/11	12/06/13	97.55	98.05			2	760	11.16	0.35		494	5 000
Мечел 4/d	25/07/13	21/07/16	98.60	99.90					12.22	0.48		605	5 000
Мечел ВО4/	11/02/14	10/02/15	95.01	96.85	94.17	-1.03	2	2	16.58	1.08	708	681	5 000
Мечел 15/d	18/02/14	09/02/21	91.76	92.98					16.60	1.11	1049	1 059	5 000
Мечел 16/d	18/02/14	09/02/21	92.00	92.44					16.60	1.11	1050	1 061	5 000
Мечел ВО5/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	548	605	5 000
Мечел ВО7/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	548	605	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	548	605	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	548	605	3 000
Мечел ВО6/		07/04/15	99.50						11.55	2.05	523	576	2 000
Мечел 13/d	01/09/15	25/08/20	87.15	88.00	88.00	-0.01	11	2 042	16.19	2.35	983	1 042	5 000
Мечел 14/d	01/09/15	25/08/20	85.06	86.00	86.00	1.00	8	173	17.30	2.34	1094	1 153	5 000
Мечел 17/d	02/06/16	27/05/21	80.10	82.00					15.87	3.01	942	1 015	5 000
Мечел 18/d	02/06/16	27/05/21	81.01	83.00					15.41	3.03	896	969	5 000
Мечел 19/d	07/06/16	01/06/21	80.74	85.00	84.97	-0.01	12	1 275	14.50	3.04	805	878	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.55	100.05					8.85	0.82	285	278	5 000
СУЭК													
СУЭК 1/d	05/07/13	26/06/20	100.10	100.46	100.34	-0.08	5	82 601	8.87	0.53	303	271	10 000
РМК													
РМК 3/d	17/12/13	15/12/15							12.99	0.93	695	695	3 000
РМК 4/d	05/06/14	02/06/16	92.01	92.99	92.02	-0.97	2	50 001	15.86	1.40	968	994	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	92.51	95.90	96.00	-0.51	4	162	12.13	1.38	595	620	5 000
Русал													
Русал 7/d	03/03/14	22/02/18	94.21	94.49	94.30	-0.20	16	12 177	14.00	1.15	789	802	15 000
Русал 8/d	15/04/15	05/04/21	89.72	90.49	89.72	-0.28	34	145 813	14.28	2.12	795	850	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.75	99.90	99.90	0.06	1	4 973	7.13	0.89	111	108	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.80	108.90	109.01	-0.24	4	12 362	7.24	1.12	114	126	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.55	102.76					7.84	1.92	155	203	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.70	100.00	99.70	-0.18	1	33	8.07	2.65	166	233	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.65	99.94	99.75	0.05	2	6 000	8.14	3.10	168	242	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	100.00	100.05	100.05		8	134 093	8.30	4.45	171	254	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6/d	26/09/13	15/09/20	99.70	100.20					7.59	0.76	162	150	10 000
ФСК ЕЭС 8/d	26/09/13	15/09/20	99.70	100.00	99.94	0.14	3	600	7.34	0.76	137	125	10 000
ФСК ЕЭС 18/	09/06/14	27/11/23	100.75	101.00	101.00	0.15	3	300	7.92	1.42	173	200	15 000
ФСК ЕЭС 15/	23/10/14	12/10/23	97.50	101.45	101.35	0.60	4	564 701	8.10	1.73	184	225	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.00	100.40	100.40	0.10	1	1	8.06	2.16	173	228	10 000
ФСК ЕЭС 10/	24/09/15	15/09/20	99.20	99.90					8.17	2.50	178	242	10 000
ФСК ЕЭС 7/d	27/10/15	16/10/20	98.30	99.00					8.36	2.60	196	261	5 000
ФСК ЕЭС 12/	22/04/16	19/04/19	99.50	100.15	100.00		1	3 100	8.26	2.97	181	254	10 000
ФСК ЕЭС 25/	27/09/16	14/09/27	101.55	101.74	101.60	0.10	2	105 000	8.26	3.26	178	253	15 000
ФСК ЕЭС 21/	19/04/17	06/10/27	87.00	102.50					8.38	3.67	186	265	10 000
ФСК ЕЭС 9/d	24/10/17	16/10/20	99.00	99.70					8.41	4.06	185	267	5 000
ФСК ЕЭС 11/	24/10/17	16/10/20	99.00	99.70					8.36	4.06	180	262	10 000
ФСК ЕЭС 19/	18/07/18	06/07/23	97.00	99.50	99.50	1.80	2	2 799	8.22	4.46	163	246	20 000
ФСК ЕЭС 13/		22/06/21	96.70	105.00					8.81	5.98	212	292	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.50	100.65	100.50	-0.25	14	513 861	8.95	2.16	262	317	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1/d		29/11/16							9.34	3.38	285	361	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3/d	11/11/13	09/11/15	99.15	100.00					10.24	0.88	422	419	3 000
Водоканал													
Водоканал 1/d		09/12/15	86.00	98.90					9.80	2.68	339	406	2 000
Западный СД													
Западный СД 1/d	29/04/16	13/05/31	98.80	99.19					9.50	2.98	305	378	5 000
Западный СД 2/d	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20	99.35	0.05	1	1	9.18	2.98	273	346	5 000
Западный СД 3/d	24/02/17	06/02/32			100.15		3	65 000	9.31	3.48	281	358	5 000
Западный СД 4/d	24/02/17	06/02/32			100.10	-0.15	4	40 342	9.32	3.48	282	359	5 000
Западный СД 5/d	24/02/17	06/02/32	100.04	100.20	100.20	0.05	3	45 000	9.29	3.48	279	356	5 000
Почта России													
Почта России 1/	25/03/14	22/03/16	100.46	100.80	100.46	0.06	1	1 000	8.00	1.21	187	204	7 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.30	101.00					8.57	2.56	218	282	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.30	110.35					8.71	2.56	232	296	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.30	100.45	100.30	-0.75	4	17 001	8.76	2.56	237	301	3 000
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	90.35	99.90					7.54	1.10	144	155	5 000
Газпром А11		24/06/14	109.05	109.35	109.40	-0.45	6	8 005	7.23	1.35	106	130	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	101.45	101.55	101.50	-0.10	9	293 500	8.38	4.03	183	264	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.45	101.65	101.55	-0.05	5	120 002	8.37	4.03	182	263	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	99.90	100.44	100.00		3	3 341	7.53	0.95	148	150	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	98.61	99.48					9.61	0.08			8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	86.00	100.00	99.97	0.01	1	1	7.33	0.31		110	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	86.00	100.99					7.26	0.31		103	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	92.00		100.80	-0.05	1	12 000	7.98	1.94	168	218	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.00	101.50	101.15	0.35	1	25 583	8.23	2.73	181	249	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.50	101.47	101.15	0.40	2	12 471	8.24	2.75	182	250	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.20	103.50					8.69	4.12	213	295	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/14	99.80	100.29	94.01	-5.84	2	2	9.90	4.33	332	415	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.10	100.22					7.20	0.50	138	104	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.55	100.70	100.55	0.05	10	8 499	8.29	2.54	190	254	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75		100.70	0.23	1	10 000	8.22	2.54	183	247	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75	100.50	100.70	0.20	1	6	8.22	2.54	183	247	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.50	99.80	99.50	-0.22	1	10	8.07	0.74	211	197	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16							8.53	3.27	205	280	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16							8.53	3.27	205	280	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16							8.53	3.27	205	280	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.05	101.25	101.17	-0.03	1	5 000	8.23	0.95	219	220	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22		102.00	101.20	0.95	1	500	8.55	1.96	225	275	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	100.10	100.20	99.98	0.13	1	214	9.99	0.59	411	385	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	98.85	99.20					10.25	1.07	416	426	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	96.25	100.00					10.14	3.05	368	442	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	96.25	99.45					10.79	3.06	433	507	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.68	99.90	99.90		9	2 922	12.70	0.58	683	656	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00					9.63	2.99	318	391	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.35	100.64	100.35	-0.19	1	84	8.14	0.55	229	199	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14							-0.62	0.01			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	100.00	100.10	100.01	-0.14	1	3 900	8.04	0.11		169	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.95	100.01	99.96	-0.04	3	898	8.00	0.24		174	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.95	100.00					7.73	0.24		147	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.99	100.00	100.00	-0.02	5	8 500	7.82	0.24		156	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.10	100.23					8.19	0.70	225	208	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.65	99.90	99.60	-0.10	3	111	8.13	0.81	214	205	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15							8.20	1.18	208	223	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15							8.25	1.18	213	228	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90						8.68	2.47	230	292	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.47	230	292	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.51						8.02	0.45		184	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	101.00					8.74	1.84	246	291	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.20	100.10	0.05	2	1 588	8.18	0.66	226	206	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.80	100.10					10.10	0.06			10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.25						7.97	0.23		171	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.99	100.50					7.59	0.36		138	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.00					8.19	0.74	223	209	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	99.00	99.60					8.98	0.68	305	287	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	99.75					7.46	0.95	141	143	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.58	1.22	245	262	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.40	99.79	99.40	0.40	1	1	7.78	0.83	178	171	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.45	100.70	100.40	-0.30	2	2	8.36	2.04	205	257	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.90	101.60	100.00	-1.07	1	1	8.72	2.52	233	297	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.10	110.25	101.06	-0.19	1	1	8.28	2.54	189	253	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.50	99.50	99.20	-0.30	1	266	8.34	2.89	190	261	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.26	219	294	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.70	99.20	99.25	0.07	3	3	8.25	4.06	169	251	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	99.30	99.50	99.50	-0.45	1	1	8.05	1.26	191	210	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	100.50	101.30	101.15	0.25	11	59 998	8.28	1.74	202	243	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	100.50	101.50	101.15	0.30	10	28 454	8.28	1.75	202	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	
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.50	101.00					8.77	1.86	249	295	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	99.00	99.50					8.96	2.91	252	323	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	87.00	100.50					8.96	2.91	252	323	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.35	100.58					7.82	1.21	169	186	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	100.30	100.90	100.80	-0.10	1	60 000	8.85	1.55	263	296	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.25	100.74	100.34	0.15	2	10 001	8.30	1.37	213	237	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	100.05	100.75	100.34	0.19	5	10 547	8.30	1.37	213	237	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	100.05	100.25					7.63	0.14		130	5 000
РСХБ 11	07/02/13	29/01/20	100.17	100.25					7.59	0.14		126	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.35	99.60	99.35	0.05	2	14 436	8.42	0.48		225	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	86.00	100.20					8.09	0.62	220	196	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00		100.10	-0.05	1	1	8.17	0.62	227	204	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.00	100.23	100.00	-0.15	3	18	8.44	0.68	251	232	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.22	100.23					8.21	0.68	228	209	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17							6.94	0.77	97	85	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	99.90	100.12					8.35	0.85	235	229	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	100.60	100.60		1	195	8.18	0.86	217	212	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.34	101.20	-0.15	4	73 707	8.29	1.09	220	230	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.10	100.00					8.20	1.55	198	231	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.74					8.48	1.74	222	263	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.29					8.48	1.73	222	263	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.36	100.85	100.45	-0.07	10	13 300	8.50	2.13	217	272	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.35	98.50					8.47	2.29	212	270	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.35	99.25					8.70	2.29	235	293	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.35	98.50					8.19	2.30	183	242	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14							7.60	0.02			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	11/07/14	99.49	99.55	99.47	-0.03	3	502	7.81	0.58	194	167	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	94.00	100.00					8.24	0.96	219	222	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15		100.75					8.18	1.07	209	219	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.82	100.92	100.90	0.04	8	56 532	8.39	1.45	220	248	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16	86.00	100.55	100.55	0.55	1	2	8.44	2.56	205	269	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	99.98						8.67	2.55	228	292	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	99.95						8.67	2.55	228	292	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	99.97						8.67	2.55	228	292	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30		99.50		1	16 000	8.13	1.02	206	212	3 000
АИЖК-11 А1	15/03/15	15/09/43	100.10	100.30	100.10		1	10 000	8.45	2.07	213	266	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.00	99.50	98.90	0.90	2	25 849	8.38	1.74	212	253	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	101.50	99.35	0.35	1	4 300	8.30	1.76	204	246	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.41	2.21	207	263	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	99.48	98.45	-0.30	1	20 810	8.48	2.67	207	274	5 000
АИЖК А10		15/11/18	98.00						8.46	2.91	202	273	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	99.50					8.61	2.91	217	288	7 000
АИЖК А21		15/02/20	101.55	103.00	101.55	0.20	3	100 000	8.55	3.10	209	283	15 000
АИЖК А11		15/09/20	96.59	100.00	99.50	0.26	5	96	8.60	3.74	207	287	10 000
АИЖК А16		15/09/21	96.00	102.00	98.65	0.75	3	78 788	8.81	4.91	219	303	10 000
АИЖК А17		15/04/22			102.15	0.65	5	150 000	8.94	5.41	228	312	8 000
АИЖК А20		15/12/27							8.88	8.37	207	269	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						9.06	0.95	301	303	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	90.10	100.17					9.09	0.95	304	306	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	99.55	99.95	99.70	-0.10	2	24 001	9.66	1.49	346	376	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14	86.00	100.00					9.52	1.49	332	362	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	100.00	100.15	100.00		5	15 022	8.35	0.17		204	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.30					8.11	0.63	221	198	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.70	99.94					8.30	0.90	227	226	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	101.00					8.70	1.27	255	275	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.75	110.05					8.73	2.60	233	298	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18							7.48	0.49		131	10 000
МТС 1		17/10/13	99.30	99.84	99.75	0.03	1	1	7.43	0.82	144	136	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	95.00	99.20					8.06	1.33	190	212	15 000
МТС 2		20/10/15	98.20	99.00					8.69	2.58	229	294	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.35	99.59	99.35	-0.15	1	6	8.58	2.62	218	283	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	96.01	100.00					8.72	3.13	226	300	15 000
МТС 7		07/11/17	100.10	100.35	100.10	-0.15	7	44 223	8.86	4.06	230	312	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	100.65	100.75					8.23	0.56	237	208	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	97.91	98.49	98.15	-0.15	3	30 001	8.88	1.45	269	297	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.97	100.10	100.03	0.28	2	2	9.02	2.06	270	323	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.75	100.10	100.01	0.26	9	20 001	9.03	2.04	272	324	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	99.97	100.10	100.00	-0.10	6	12 148	9.03	2.04	272	324	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.30	99.00					9.00	2.54	261	325	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.30	99.00					8.94	2.54	255	319	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.00	100.50					8.04	1.70	179	218	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.00	99.50					8.71	0.54	286	256	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	98.00						6.68	0.38		48	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.95					8.69	1.09	260	270	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	86.00	100.50					8.69	1.09	260	270	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.20	100.35	100.35	-0.11	24	28 117	8.99	2.12	266	321	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21	95.01	99.00					9.54	2.97	309	382	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21	96.00	107.00	97.00	0.30	3	15 000	9.65	2.97	320	393	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21	95.01	98.25					9.54	2.97	309	382	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	86.00	99.90					7.77	0.20		148	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90	100.10					8.47	0.71	253	236	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90	100.10					9.90	0.71	396	379	1 000
Магнит БО-3		09/09/20	99.90						8.29	0.71	235	218	2 000
Магнит БО-4		09/09/20	99.90	100.03					8.39	0.71	245	228	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.10	99.55	99.55	0.25	3	114 451	8.56	1.14	245	258	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	86.00	99.35					8.34	1.29	219	239	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.50	101.00					8.83	2.46	245	307	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.00	98.40					9.45	1.41	327	353	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	97.00						9.22	1.42	303	330	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.10	105.00	100.25	0.05	1	3 502	9.61	2.47	323	385	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.20	99.00	99.00		3	500	9.02	0.58	315	288	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.50	99.90					9.50	0.76	354	341	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.61	100.00	100.00	0.15	1	1	10.21	0.42		402	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	98.50	99.45					9.76	0.87	374	371	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	97.00	100.19					9.41	0.77	344	332	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	101.50						11.30	1.91	501	549	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.96		99.96	-0.03	2	2	12.96	0.49		679	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.90	94.00	94.00	-0.60	2	4 299	11.71	2.24	536	594	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.51	95.99	95.51	0.25	1	100	12.23	1.49	603	633	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	97.80	99.05					8.41	1.59	218	253	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.50	96.00	95.50	-0.35	11	7 880	11.23	1.05	515	523	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	86.00	100.05					-61.63	0.98			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	98.90	99.20					9.61	1.07	352	362	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	100.00	101.60	101.60	1.55	2	2 205	10.06	2.44	368	430	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	12/12/13	07/12/17	99.15	100.03	100.00		4	143 636	9.46	0.96	341	344	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.47	99.60	99.47	-0.09	7	2 090	9.96	0.67	404	384	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00	99.50	99.01	0.01	3	3 174	12.07	0.82	608	600	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	100.60	100.40	-0.40	1	100	8.83	0.71	289	272	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13	98.50						8.42	0.95	237	239	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.60	100.00					9.14	0.35		292	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.60	100.00					8.86	0.35		264	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	100.00					8.13	0.74	217	203	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	98.62	100.05	100.05	-0.10	1	1 000	9.26	0.37		305	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.50	101.75	101.50	-0.11	7	8 510	9.98	0.55	413	383	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	100.70	101.27	100.70	-0.16	2	2	10.63	1.92	434	482	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.95	100.07	99.95	-0.05	2	3 097	8.01	0.31		178	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.95	100.10	100.01	-0.07	3	5 000	7.81	0.31		158	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13	100.35	100.40	100.37	-0.01	6	41 008	7.58	0.19		129	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.40	100.70					8.72	1.61	249	285	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.00	100.25	99.10	0.20	2	4 600	10.33	1.29	418	438	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.21	100.42	100.42	-0.01	8	10 193	10.01	1.98	371	422	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	99.75	100.75					9.85	1.98	355	406	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.07	100.17	100.17	-0.07	8	2 299	12.55	0.68	662	644	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.10	100.21	100.22	0.08	19	1 984	12.54	0.82	655	647	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.35	100.80	101.20	0.25	1	1	8.21	0.26		196	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.01	100.90					9.05	0.26		280	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.30	99.80					10.36	0.36		415	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.30	99.65					16.57	0.36		1 036	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15			100.20	-0.02	1	2 000	8.52	0.45		234	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							10.38	0.92	435	434	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							9.80	0.95	376	377	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	95.81	97.80	97.00	-0.85	1	30	12.08	1.19	596	611	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	96.05	97.00	96.05	0.75	3	20 006	12.99	1.19	687	702	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.66	3.05	220	294	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	98.40	99.00	99.75	4.15	1	1	8.25	2.97	180	253	10 000
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	98.30	99.40					8.37	2.97	192	265	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16	98.65	99.80	98.65	-1.35	1	500	8.86	0.18		256	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.70	100.80	100.80	0.15	1	998	8.41	1.83	213	258	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.30	100.60	100.40	-0.10	1	1	8.81	2.46	243	305	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.30	100.60	100.50		6	90 003	8.78	2.56	239	303	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.30	101.10	101.10	0.10	1	2	8.13	2.15	180	235	3 000
ЭНЕЛ ОГК-5													
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13							7.97	0.48		180	4 000
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14							8.28	1.42	209	236	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21	89.05	97.00					12.99	1.40	681	707	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	89.00	92.41					11.82	2.92	538	609	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	100.05		100.50	0.05	6	189 001	8.93	2.52	254	318	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.92	97.00					10.95	1.58	473	507	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	86.00	99.10					8.71	0.52	288	255	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	90.00	99.40					21.23	1.18	1511	1 526	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.36	99.50					10.33	0.63	443	420	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.04	86.67	86.04	-0.50	53	20 739	33.56	0.73	2761	2 746	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.25	98.70					10.44	0.79	446	436	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	104.00						9.11	0.91	308	307	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00	98.80					9.04	1.25	290	309	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	99.85	99.95	99.95	0.05	1	5 000	8.47	0.69	254	236	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	99.00						14.43	0.38		822	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.00	99.95	98.10	-1.45	2	2 800	11.47	0.68	554	536	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	100.10	100.30					8.93	2.24	258	316	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00	98.70	1.20	6	46 601	8.95	2.64	255	320	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.60	102.99					8.98	0.74	302	288	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	100.40	101.35					8.29	0.90	226	225	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	99.85					11.31	1.38	513	538	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.00	99.90					10.50	1.38	432	457	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.50	100.75	100.70	-0.10	2	21 560	9.68	2.50	329	392	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.12	98.82	98.10	0.13	2	500	10.42	1.25	428	447	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	100.00	100.13	100.12	0.02	4	50 000	8.83	0.12		249	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.03	0.50		386	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.00	100.10	100.02	-0.05	1	5 000	10.17	0.71	423	406	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.05	100.65					11.30	1.16	519	532	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.20	98.39	98.20	-0.17	7	75	11.35	1.19	523	538	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.15	96.22	96.15	-0.15	1	20	11.46	1.48	526	556	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.95	100.25	98.00	-2.00	1	1	12.86	1.70	661	700	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14							13.91	1.35	774	798	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.20	101.90	101.75	0.15	8	6 306	12.62	1.23	648	666	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.15						10.04	0.42		385	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17	99.15	99.70					9.18	3.98	263	344	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17	99.40	99.70					9.26	3.98	271	352	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17	99.15	99.40	99.15	0.55	1	100	9.32	3.98	277	358	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.50	100.50	98.50	-1.46	2	5	9.42	3.40	293	369	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.37	100.45	100.25	-0.28	3	4 234	8.64	0.22		237	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.80	100.22					8.58	1.53	237	269	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.30	98.65					8.72	1.77	246	288	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.01	99.40					11.99	0.56	613	584	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13							11.80	0.47		563	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.02	100.10	100.02	0.01	4	21	12.28	0.78	631	619	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.32	100.39	100.36		6	81 073	8.17	0.41		197	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13							8.17	0.50		200	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	100.00	100.15	100.10	0.08	1	2 000	7.95	0.54	211	180	5 000
РОСБАНК А3/	06/05/11	06/11/13	98.85	98.98	99.00	0.13	10	52 877	8.24	0.87	223	219	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.85	100.96	100.85	-0.09	1	1	8.94	1.61	271	306	10 000
РОСБАНК А5/	06/05/11	07/11/14	97.50	103.00					9.05	1.78	278	321	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2/d	07/06/13	02/12/16	86.00	100.85					7.85	0.47		168	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.24	100.11	-0.12	4	105 002	8.44	0.76	247	235	10 000
Альфа-Банк 1/d	04/02/14	02/02/16	99.80	99.90	99.80	0.30	2	2	8.60	1.08	251	261	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.05	100.30					8.49	1.14	238	251	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/13	16/12/14	100.03		100.07	0.03	6	24 963	9.65	0.98	360	363	5 000
МДМ Банк 8/d	09/07/13	09/04/15	100.06	100.11					8.97	0.55	312	282	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.19	1.20	306	322	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	86.00						9.07	0.33		285	5 000
НОМОС Банк 9/d	15/06/12	14/06/13	98.00	99.95	99.85		2	26 000	9.27	0.49		310	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.12					9.32	0.62	342	319	5 000
НОМОС Банк 12/	25/08/13	28/08/13	99.45	99.70	99.50	-0.15	2	2 002	9.45	0.67	353	333	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.50	99.77					9.48	1.12	338	350	5 000
НОМОС Банк 11/	02/07/14	02/07/14	99.50	99.99	99.85	-0.05	1	20 000	9.83	1.41	365	391	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.00	100.05	100.00	-0.07	2	976	8.92	0.44		273	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.05	100.12					8.43	0.14		210	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.07	100.11					7.72	0.16		141	3 000
Банк ЗЕНИТ 1/d	07/04/12	07/04/13	99.40		99.75	0.05	5	1 000	8.46	0.30		223	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.21	100.15		1	126	8.84	0.46		266	5 000
Банк ЗЕНИТ 6/d	02/07/13	01/07/14	100.25	100.33					8.79	0.52	296	263	3 000
Банк ЗЕНИТ 8/d	28/08/13	23/08/17	100.20	100.28	100.28	0.03	6	5 219	8.93	0.67	301	281	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.75	166	152	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.13	100.22					9.05	0.89	303	300	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.03	100.20					9.26	1.25	312	331	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2/d	20/02/13	18/02/15	97.00	100.17					8.64	0.18		234	5 000
Промсвязьбанк 4/d	20/02/13	18/02/15	100.00	100.03	100.00	-0.02	2	100	8.81	0.18		251	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	99.65	99.70	99.70	-0.10	10	41 410	9.08	0.50		291	5 000
Промсвязьбанк 3/d		04/02/14	95.01	99.70					9.35	1.07		326	5 000
Промсвязьбанк БО7	06/09/14	06/09/15	99.21	100.74	100.74	-0.06	3	702	9.89	1.58		367	5 000
Промсвязьбанк 3/d		01/02/18	100.20	100.70					12.47	3.80		594	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	99.70						9.20	0.96		315	3 000
Банк СПб 2/d	26/03/12	23/09/13	99.80	99.91					9.36	0.75		340	5 000
Банк СПб 8/d	07/10/13	05/10/15	100.12	100.20	100.12	-0.16	2	5 000	9.53	0.78		355	5 000
МКБ													
МКБ /d	15/01/13	14/07/15	100.00	100.10	100.05	0.02	4	45 226	8.87	0.08			2 000
МКБ -01/d	22/02/13	22/02/14	99.85	99.94	99.90	0.02	3	3 000	9.13	0.18		283	3 000
МКБ -03/d	27/04/13	27/04/15	99.88	99.93	99.88	-0.02	2	770	9.76	0.36		355	4 000
МКБ -02/d	25/09/13	25/09/15	99.81	99.90	99.90	0.05	3	26	10.09	0.75		413	3 000
МКБ /d	09/10/13	08/04/15	99.60	99.75	99.60	-0.15	1	157	10.50	0.79		452	3 000
МКБ -04/d	15/10/12	15/04/14	99.96	100.10					10.41	1.25		427	5 000
МКБ -05/d		23/06/14							10.79	1.39		461	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	20/12/13	21/12/14							9.86	0.93		382	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	100.37					9.03	0.69		310	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	86.00	100.80					9.16	0.66		324	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.25	100.50	100.45	-0.10	3	16 128	9.48	1.12		338	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.78	99.97					9.09	0.72		314	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	100.00	100.05					9.86	1.13		375	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.20	100.12	0.02	4	16 900	9.56	0.48		339	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	99.91	100.00	99.91	-0.14	3	1 005	9.98	0.68		405	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.80	99.04					10.79	0.75		483	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.75	101.05	100.75	-0.12	2	1 150	11.21	1.05		513	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.97	1.07		488	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.80	100.34					11.11	1.12		501	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.20	101.65					11.00	1.84		472	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.50	101.70					11.15	1.94		485	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.80	98.95	98.80	-0.19	7	3 005	12.23	0.61		634	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.02	100.49	100.20	-0.25	5	4 303	12.89	0.61		700	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК 4/d	18/04/13	16/04/15	100.43	100.61	100.61		2	900	11.53	0.33		531	2 000
ТКС БАНК 6/d	16/07/13	09/07/15	100.30	101.25	101.21	-0.18	15	3 768	11.97	0.55		612	2 000
ТКС БАНК 2/d		28/07/13	105.06	105.47	105.47	-0.23	18	494	10.72	0.57		486	1 000
ТКС БАНК /d		20/09/13	101.01	102.00					10.21	0.73		426	2 000
ТКС БАНК 2/d	29/11/11	26/11/13	104.20	104.40	104.20	-0.24	12	1 923	11.98	0.90		595	2 000
ТКС БАНК 3/d	21/08/12	18/02/14	102.50	102.65	102.50	-0.15	8	1 192	11.96	1.08		587	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.16	100.17	100.17	-0.01	36	3 735	14.36	0.61		847	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.02	100.15	100.02	-0.08	4	2 534	10.72	0.87		471	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.85	100.00	100.00	-0.10	1	2 971	8.86	0.75		290	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	100.00	100.40	100.25		2	8 001	9.43	1.58		321	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	92.00	100.00					7.63	0.85		163	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19							7.88	1.08		179	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18			98.01	-2.03	2	101	9.77	1.10		367	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.50	103.00					7.46	2.02		115	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00						8.93	1.34		276	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.15	100.30					8.18	0.68		225	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.10	100.30	100.15		3	12 270	8.42	0.70		248	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	95.01	99.95	99.35	-0.15	2	5 595	8.61	0.69		268	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	86.00	100.50	100.50	-0.25	4	141	8.64	0.96		259	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.50	100.75	100.75	0.40	3	46 500	8.83	1.73		258	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15		101.50	100.50	1.50	2	53 500	8.99	1.74		273	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39		254	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.80	100.90	100.76	-0.11	2	800	8.06	0.94		202	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.70	99.80					7.81	0.93		177	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		223	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.03	100.30					9.29	0.87		328	5 000

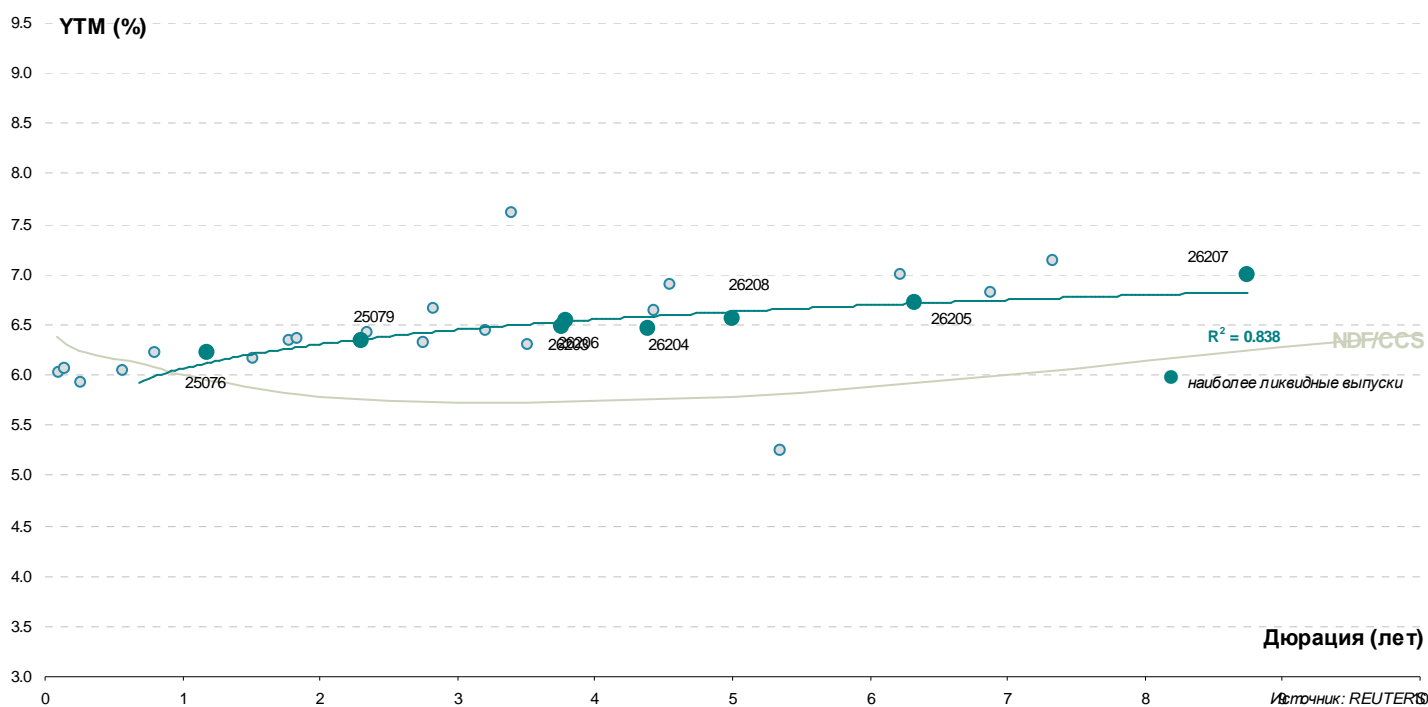
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.16					8.63	0.27		239	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.01	100.19	100.05	-0.15	2	7 303	9.53	0.86	352	347	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.52	99.85					8.04	0.22		177	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.35	100.85	100.50	-0.03	1	7 100	10.59	0.64	468	447	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.00	100.00					10.28	0.81	429	420	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.51	100.60	100.49	-0.08	1	3 900	11.04	1.20	491	507	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	12/03/13	10/06/14	96.00	100.08					9.76	1.40	358	384	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.93	100.12					8.76	0.33		254	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	98.80	99.00	99.00	-0.01	8	109 128	9.45	0.82	346	338	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.17	100.34	100.17	0.03	2	3 500	10.02	2.10	370	424	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.20	99.65					7.78	1.22	165	182	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	99.00	99.50					9.26	0.53	342	310	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	99.94					8.98	0.70	304	287	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	86.00	100.50					8.96	0.73	301	286	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.45					8.84	0.73	289	274	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	101.00					9.83	0.88	381	378	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.25					9.20	0.89	318	315	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.70	100.95					9.76	1.74	350	391	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.40	100.60	100.58	-0.03	1	20 000	8.44	0.62	255	231	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16							8.91	1.40	273	299	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	1.74	314	355	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.25	100.34	100.25	-0.10	3	5 000	10.51	1.14	440	453	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.55	97.77					10.57	1.21	444	461	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.40	96.55	96.55		7	12 274	10.58	1.50	437	468	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.12	0.47			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.00	100.40					8.96	0.44		278	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/06/14	99.10	99.55					9.94	0.54	409	379	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.11	100.20					9.87	0.79	389	379	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	100.03	100.11					9.96	0.79	398	388	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.63	1.11	353	364	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.95	100.19					10.22	1.08	413	423	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.01	97.49	97.40	0.12	1	19 900	10.44	1.30	428	450	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.70	99.99					9.29	0.79	331	321	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	100.00	100.05					9.91	1.28	376	396	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнв ест БО-1	18/12/12	17/06/14							8.39	0.00			2 000
ЦентрИнв ест БО-5	18/12/12	17/06/14							1.06	0.00			1 000
ЦентрИнв ест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.10	100.15					9.31	0.33		309	2 000
ЦентрИнв ест 2	25/06/13	24/06/14							9.56	0.50		339	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	19/12/13	09/12/21							9.48	0.95	344	345	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	99.75	100.19					11.37	0.35		515	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	99.75	100.90					9.18	0.89	316	313	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.71	2.44	333	395	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинв естбанк БО-1	19/10/13	19/04/14		100.00	100.00	0.40	2	9 768	10.74	0.81	475	467	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	90.00	100.40	100.00		3	58	11.13	0.21		485	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	99.42	105.00					10.98	0.78	500	490	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	99.30	99.90					9.57	0.13		323	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					10.02	0.32		379	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	99.00	100.95					11.27	0.78	529	519	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинв естбанк 01	20/12/13	22/06/15							10.33	0.94	429	430	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	96.95					10.41	1.50	420	451	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.10	100.10	0.10	1	15	9.55	0.32		332	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	100.00	100.10	100.00	-0.20	1	2 000	9.92	0.35		370	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15	99.95	100.12					11.13	0.75	517	503	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.70	100.05					10.24	0.92	421	420	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.50	100.50					11.79	0.68	586	568	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.14					9.05	0.14		272	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/13	98.00	100.11					10.23	0.58	436	409	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.40	100.54	100.40	-0.03	1	15 000	10.31	0.63	441	418	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	100.10	100.20					9.69	0.44		350	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.60	99.70					8.12	0.53	228	196	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.25	100.67					9.56	0.79	358	348	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.53	100.88					12.38	0.83	638	631	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.76	99.80	99.76	-0.04	4	1 534	9.50	0.81	351	342	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.80	100.29	100.19	0.04	1	50 000	9.60	0.81	361	353	5 000
УБРИР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.20	100.50					10.93	0.37		472	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.30	100.58	100.30	-0.30	4	500	12.39	0.76	642	630	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14							0.09	1.44			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.25	100.90	101.00		6	104 031	11.13	0.63	523	500	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.60	99.90					11.18	0.83	518	511	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	99.95	100.00	100.00	-0.10	13	50 754	12.65	0.92	662	661	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	99.90	100.02	100.02		8	42 105	11.33	0.18		503	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.17					10.42	0.19		413	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.85	99.95	99.95		1	55	11.41	0.31		518	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.10	100.30	100.21	0.01	13	23 198	13.11	0.80	713	703	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13	99.55	99.90	99.90	0.40	7	11 847	11.17	0.95	512	514	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.91	100.10	99.91	-0.19	2	1 002	12.71	1.25	657	675	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	528	574	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61		03/06/13	103.05	104.00					5.47	0.45			30 000
Москва 53		01/09/13							6.95	0.69	102	84	15 000
Москва 63		10/12/13	107.99	108.80					5.82	0.93			15 000
Москва 62		08/06/14	107.43	108.45					6.47	1.37	30	54	35 000
Москва 39		21/07/14	95.01	100.10					7.08	1.49	88	118	10 000
Москва 64		24/06/15	98.60		98.62	0.14	3	27 000	7.76	2.27	141	199	20 000
Москва 44		16/11/15							7.18	2.53	79	143	40 000
Москва 56		22/09/16	97.87	98.50					7.41	3.32	93	168	20 000
Москва 49		14/06/17	91.05						7.67	3.92	113	193	25 000
Москва 48		11/06/22	92.90	93.75					7.66	7.02	91	165	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8		11/06/13	100.50	100.90					8.30	0.48		213	19 000
Московская Обл 7		16/04/14	99.00	99.60					8.15	1.27	200	220	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 5		#N/A	The record could not be found	#N/A	The record could not be found	#N/A	The record could not be found	#N/A	The record could not be found	#3НАЧ!	#3НАЧ!	#3НАЧ!	found 000
Нижегородская Обл 6		07/10/15	99.30	100.20					8.78	1.65	254	291	5 000
Нижегородская Обл 7		16/11/16	102.22	102.85	102.52	-0.21	3	131 569	8.78	2.15	245	300	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6		10/05/13	102.70	103.10	103.10		1	51	7.13	0.39		93	2 000
Самарская Обл 5		19/12/13							8.08	0.95	203	205	8 000
Самарская Обл 7		30/11/16	97.10	98.30	98.11	-0.09	3	50 225	8.75	1.96	245	295	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1		11/04/13	99.87	100.25	100.30	0.30	1	20	7.14	0.31		91	3 000
Якутия 9		19/09/13							7.29	0.49		112	2 000
Якутия 7		17/04/14	99.25	100.35					8.25	1.19	213	228	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2		14/12/12								0.00			2 000
Краснодар 02		05/11/15		100.20	99.45	-0.75	2	5 600	9.47	2.17	313	369	1 000
Краснодарский край 3		27/09/14	99.71	99.90	99.71	-0.09	1	1	8.45	1.21	232	249	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 5		29/11/16	100.25	101.50					8.51	1.40	233	259	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					8.37	0.91	234	233	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	97.00	99.50					7.52	1.27	137	157	2 000
Коми Респ 8		03/12/15							8.06	2.14	173	228	1 000
Коми Респ 10		15/12/16	100.01		101.60	0.85	2	3 000	8.72	2.29	237	295	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.55						8.42	2.43	204	266	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12							5.50	0.01			3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.70	100.80	100.70	-0.08	3	7	9.40	1.73	314	355	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16							9.50	2.15	317	372	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	101.35	101.65	101.65	-0.15	2	1 190	8.98	1.62	275	311	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.10	100.38					7.44	0.41		124	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.30	99.88					7.97	1.01	190	196	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.50	100.80					8.75	2.09	243	297	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14	99.12	99.60					8.75	1.44	256	284	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12							2.93	0.01			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13							7.59	0.93	155	156	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	100.50	101.40					8.54	1.70	229	268	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	103.85	104.20					9.20	1.09	311	321	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13							7.89	0.94	185	186	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15							9.44	2.34	308	367	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



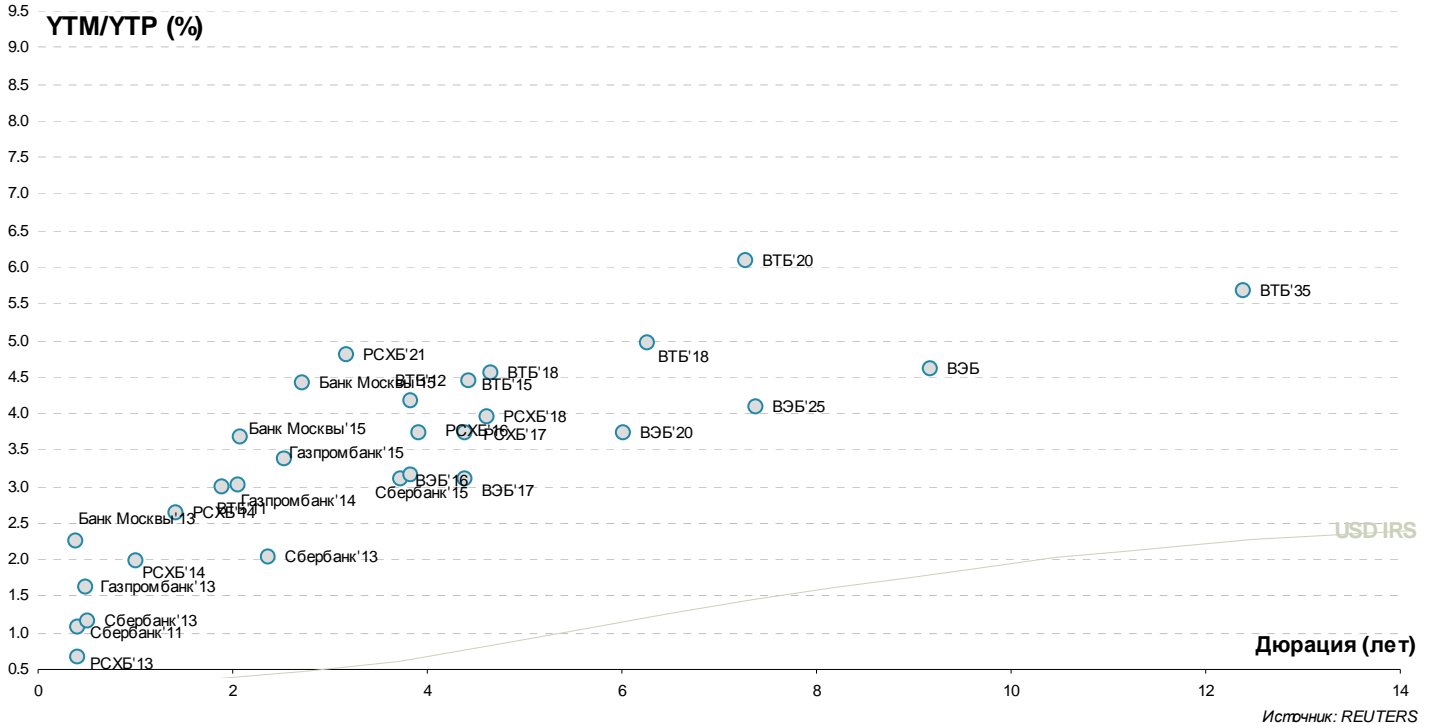
Результаты торгов евробондами

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	1.17	1.06	2.27	0.03	77
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		105.625	106.250	1.88	1.73	4.02	-0.15	121
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.900	150.100	1.93	1.60	4.45	0.23	105
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.044	127.181	2.75	2.73	5.41	0.03	137
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.350	117.700	2.41	2.37	6.31		115
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		113.750	114.100	2.81	2.77	7.75	0.26	123
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		200.694	201.861	3.98	3.92	9.19	1.06	199
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.150	123.650	4.24	4.21	15.95	-0.17	176
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.038	101.055	1.42	1.37	0.34	-0.01	112
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		100.850	101.694	3.02	0.52	0.33	-0.01	274
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.801	101.817	1.46	1.41	0.31		116
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.503	104.003	1.71	0.92	0.60	-0.01	142
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		109.500	110.180	2.82	2.30	1.18		254
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		109.250	109.910	2.74	2.22	1.16		246
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.402	109.486	2.15	2.10	1.51		183
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.070	107.320	2.58	2.50	2.77	0.07	214
GAZPR'16 4.95%	USD	23/05/16		107.150	107.450	2.75	2.66	3.19	0.03	225
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		111.850	112.350	2.99	2.86	3.55	-0.45	243
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		123.136	124.136	3.35	3.17	4.46	-0.02	253
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		131.000	131.498	3.72	3.64	5.08	-0.50	271
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		111.945	112.059	3.08	3.04	2.84	0.19	228
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		119.000	120.000	4.02	3.90	7.17	0.63	252
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		107.000	107.750	4.06	3.97	7.67	0.25	248
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		142.300	143.300	5.29	5.23	11.75	0.14	308
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		128.500	129.000	5.22	5.19	12.99		290
Газпром нефть										
GPN CAPITAL '22 4.375%	USD	19/09/22		101.700	102.200	4.16	4.10	7.97	0.08	254
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		104.002	106.002				-0.01	
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		104.782	105.782	1.65	0.85	1.17	-0.01	135
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		128.468	128.767	3.14	3.09	4.60	-0.09	226
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.283	111.744	2.92	2.81	3.85	-0.09	227
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		113.491	113.908	3.95	3.90	7.41	-0.01	242
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		100.979	101.408	5.14	5.04	4.31	0.30	444
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.052	107.551	3.13	2.90	2.06	-0.04	277
VTB'17 6%	USD	12/04/17		107.079	107.283	4.19	4.14	3.84	0.20	356
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		108.477	108.717	4.46	4.41	4.44	0.23	368
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		110.898	111.402	4.59	4.49	4.66	0.13	375
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		109.863	110.379	5.01	4.93	6.26	-0.17	374
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		106.100	106.480	6.11	6.06	7.29	-0.65	461
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		106.954	107.453	5.70	5.66	12.39	-0.05	341
VTB' 9.5%	USD			106.913	107.518	8.46	8.37	6.75	-0.44	709
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		101.980	102.020	2.29	2.19	0.40		200
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.311	106.531	3.71	3.61	2.07	-0.01	337
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		103.750	104.750	4.58	4.23	2.73	-0.32	419
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		101.000	102.000	5.76	5.50	3.90	-0.13	517
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		108.720	108.923	3.12	3.07	3.73	-0.16	250
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		110.438	110.940	3.14	3.04	4.40	0.14	237
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		120.451	120.961	3.77	3.70	6.02	-0.04	251
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		115.000	115.625	4.11	4.04	7.39	1.13	255
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		120.961	121.469	4.63	4.58	9.18	0.46	272
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.251	103.278	1.65	1.60	0.50	0.24	136
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		106.091	106.387	3.07	2.92	1.90	-0.02	272
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.001	108.398	3.43	3.29	2.54		302
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.613	111.782	3.63	3.58	3.02	-0.02	312
GAZPROMB'17 5.625%	USD	17/05/17		105.989	106.196	4.12	4.07	3.96	-0.01	348
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		108.000	108.500	5.73	5.64	5.22	0.50	476
GPB EURO' 7.875%	USD			102.322	102.991	7.34	7.19	4.43	-0.08	662
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.109	103.156	1.92	-0.59	0.41	-0.02	163

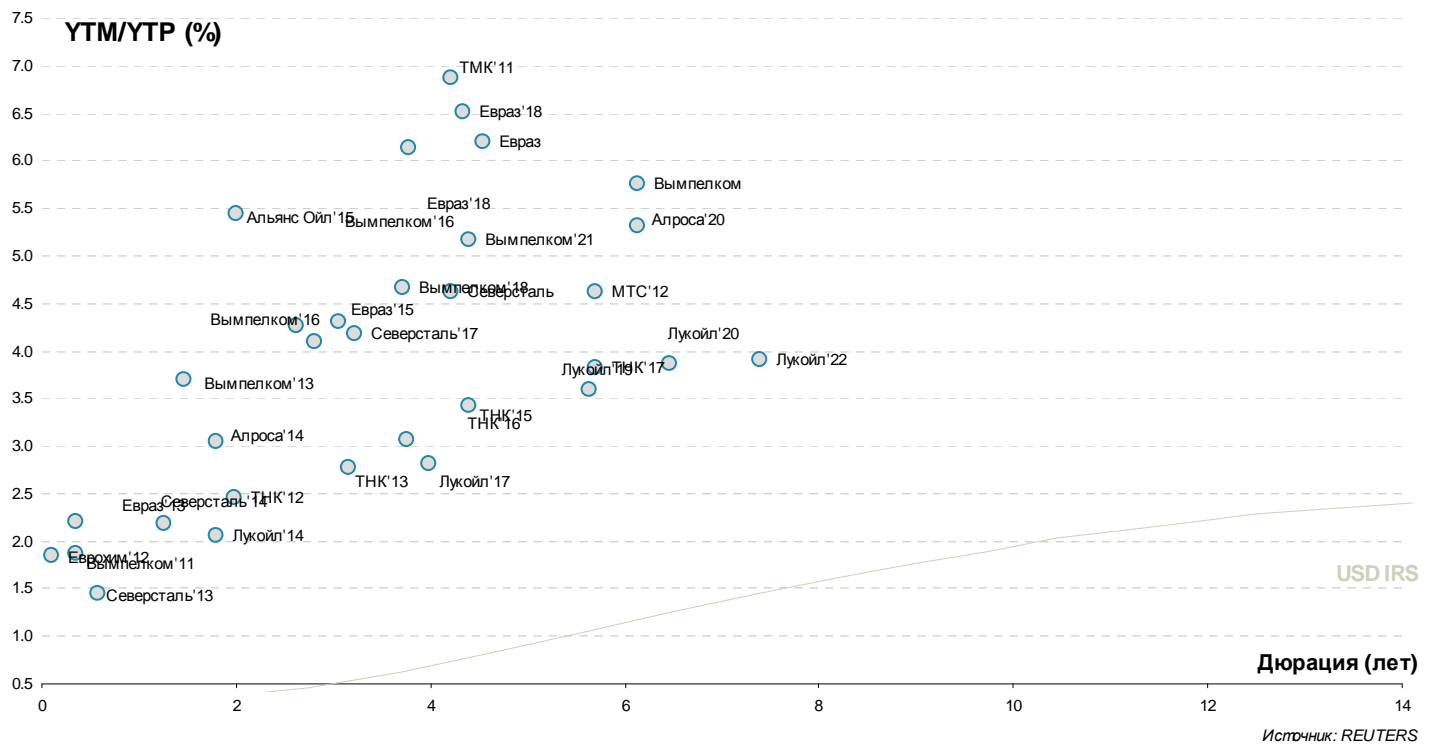
Выпуск	Валюта	Дата Погашения	Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14	105.381	105.436	2.00	1.95	1.02		170
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14	109.104	109.180	2.66	2.61	1.41	-0.02	235
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17	110.099	110.497	3.79	3.69	3.92	0.12	313
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17	107.000	107.300	3.76	3.69	4.39	0.25	298
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18	118.264	118.764	3.98	3.89	4.61	-0.13	314
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21	103.745	103.906	4.81	4.76	3.17		434
Сбербанк									
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13	102.056	102.275	1.34	0.81	0.40	-0.01	104
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13	102.651	102.987	1.46	0.84	0.52	-0.01	116
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15	108.364	108.762	2.11	1.96	2.36	0.08	170
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17	108.633	109.133	3.21	3.09	3.84	-0.09	258
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17	107.500	107.900	3.01	2.91	3.74	0.25	239
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19	108.248	108.549	3.74	3.69	5.53	0.12	267
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21	111.078	111.457	4.16	4.11	6.94	0.45	275
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22	113.180	113.583	4.36	4.31	7.13	-0.44	287
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22	100.955	101.344	5.00	4.95	7.82	-0.30	341
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ									
Евраз									
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13	102.019	102.519	2.91	1.50	0.34	0.02	265
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15	110.343	111.060	4.40	4.15	2.62	-0.06	399
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17	104.415	105.125	6.22	6.04	3.77	0.18	565
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18	113.000	113.625	6.57	6.44	4.33	0.22	584
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18	102.233	102.689	6.25	6.15	4.55	0.40	549
Металлоинвест									
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16	104.875	105.375	5.00	4.85	3.19		452
НЛМК									
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19	100.586	100.873	4.85	4.80	5.77	0.09	375
Альянс Ойл									
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15	109.064	109.283	5.48	5.38	2.01	-0.06	518
Агроса									
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14	110.504	110.972	3.16	2.92	1.79	0.07	282
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20	115.237	115.738	5.35	5.28	6.13	0.16	410
Вымпелком									
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13	102.098	102.550	2.48	1.27	0.36	-0.10	219
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14	99.684	102.316	4.58	2.81	1.47	-0.11	
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16	106.970	106.970	4.09	4.09	2.82	-0.03	365
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16	112.222	112.713	4.37	4.22	3.06	-0.08	390
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17	105.500	106.500	4.79	4.53	3.71		421
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18	118.119	118.615	5.21	5.11	4.41	-0.12	441
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21	112.250	113.250	5.83	5.69	6.14	0.85	456
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22	111.400	111.900	5.88	5.81	6.81	0.15	445
Лукойл									
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14	107.838	107.934	2.09	2.04	1.79	-0.31	174
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17	114.500	115.125	2.87	2.73	3.99	0.35	220
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19	121.625	122.500	3.66	3.53	5.64	0.38	253
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20	115.000	115.503	3.90	3.83	6.46	0.25	258
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22	121.250	121.875	3.94	3.87	7.40	0.10	240
МТС									
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20	124.847	125.353	4.66	4.59	5.70	-0.18	346
НОВАТЭК									
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16	106.248	106.401	3.20	3.15	2.87	-0.08	275
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21	116.613	116.989	4.17	4.12	6.42	-0.18	284
Северсталь									
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13	104.603	105.418	2.09	0.80	0.59	-0.04	180
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14	109.100	109.350	2.26	2.08	1.27	0.35	196
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16	106.654	106.999	4.24	4.14	3.22	0.13	374
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17	108.745	109.197	4.66	4.56	4.21	-0.02	395
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22	100.484	101.043	5.83	5.76	7.53	-0.01	430
ТМК									
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18	103.482	103.916	6.93	6.83	4.20	0.21	624
Распадская									
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17	104.646	105.031	6.50	6.40	3.75	0.50	594
ТНК-ВР									
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13	101.439	104.439					
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15	107.550	108.050	2.56	2.33	1.98		221
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16	115.885	116.070	2.80	2.75	3.15	-0.02	228
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17	113.993	114.207	3.09	3.04	3.76	-0.30	246
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18	120.987	121.254	3.45	3.40	4.40	-0.07	265
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20	121.000	121.500	3.85	3.78	5.71		268
ЧАСТНЫЕ БАНКИ									
Альфа-Банк									
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13	103.400	103.452	2.51	2.41	0.49	-0.01	223
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15	108.086	108.568	4.18	3.97	2.07	0.07	384
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17	101.300	101.668	5.94	5.84	3.67	-0.03	539
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17	110.985	111.430	5.24	5.14	4.04	-0.14	456

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

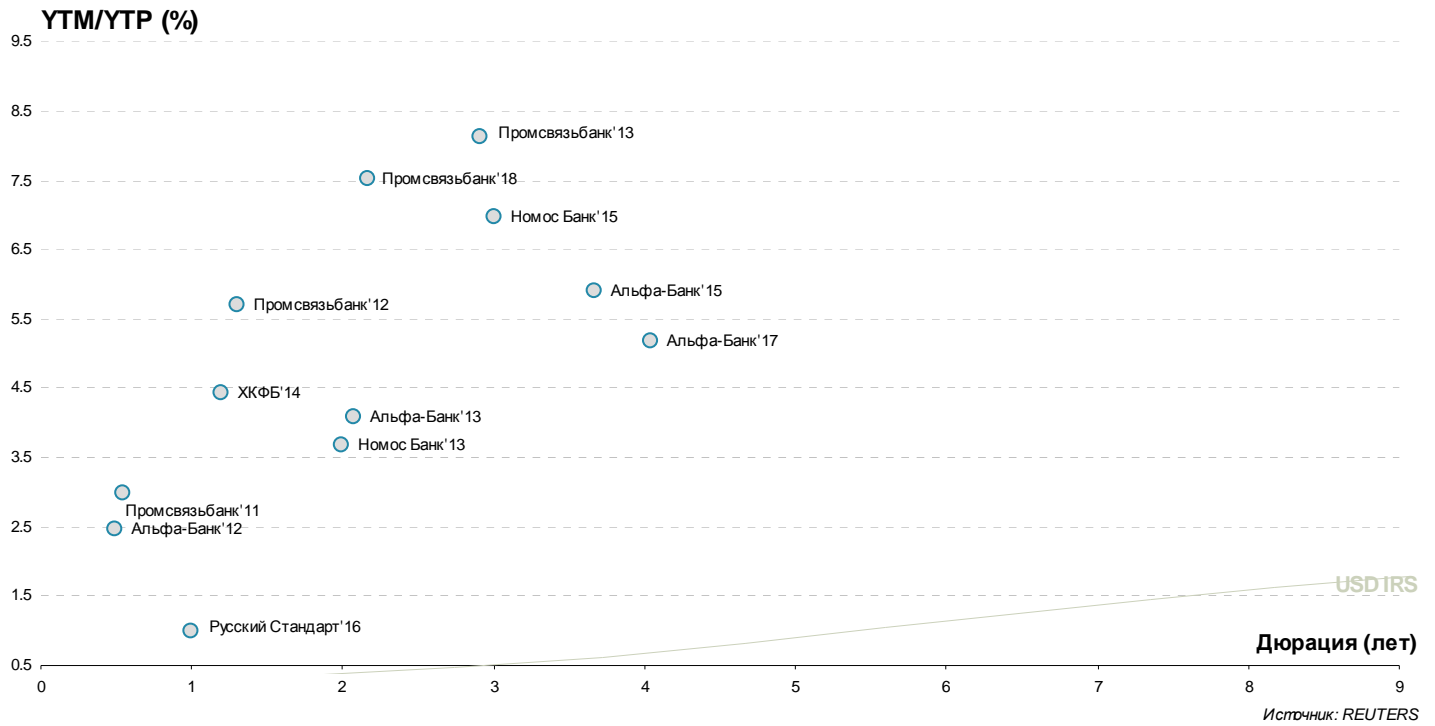
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
Максим Симагин
Александр Валканов
Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

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.