

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки продолжают реагировать лишь на переговорный процесс в США

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Условия рынка остаются неблагоприятными
- Рубль стабилен, игнорирует рост цен на нефть

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды укрепили позиции
- Спрос на ОФЗ невысок

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

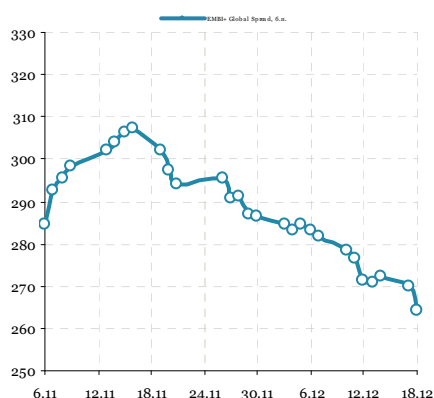
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:	
			MIN.	MAX.
Внешний рынок долга				
UST-10 yield	1.82 ▲	0.04	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	154 ▲	2	117	162
EMBI+ Glob.	264 ▼	-6	264	401
EMBI+ Rus sprd	132 ▼	-5	141	293
Russia 30 yield	2.64 ▼	-0.06	2.64	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	6.83 ■	0.00	6.35	6.91
Корсчета в ЦБ	964.0 ▲	140.5	446	1011
Депоз. в ЦБ	90.4 ▼	-8.8	65	238
NDF RU 3m	6.3 ▲	0.1	6	7
Валютный рынок				
USD/RUB	30.747 ▼	-0.251	30.46	33.26
EUR/RUB	40.664 ▼	-0.159	38.97	41.73
EUR/USD	1.323 ▲	0.006	1.21	1.32
Корзина ЦБ	35.224 ▼	-0.146	34.77	37.02
DXU Индекс	79.359 ▼	-0.209	78.85	84.01
Фондовые индексы				
RTS	1511.4 ▲	0.8%	1262	1589
Dow Jones	13351.0 ▲	0.87%	12411	13610
DAX	7653.6 ▲	0.64%	6132	7654
Nikkei 225	9923 ▲	2.39%	8366	9923
Shanghai Comp.	2162.5 ▼	-0.01%	1960	2319
Сырьевые рынки				
Нефть Urals	108.5 ▲	0.77%	88	117
Нефть Brent	108.8 ▲	0.04%	89	117
Золото	1671.1 ▲	0.25%	1553	1790
CRB Index	295.6 ▲	0.02%	267	321

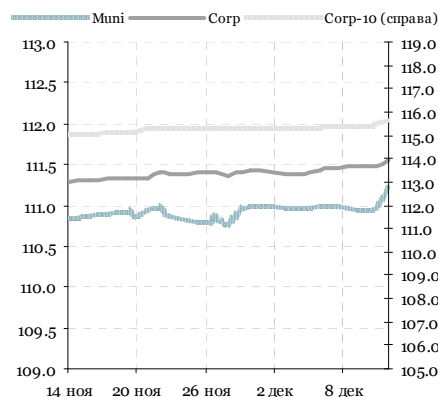
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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

Спрос по верхней границе установленного диапазона доходности на ОФЗ серии 26207 на аукционе составил 6,5 млрд руб. при предложенном объеме 16,4 млрд руб., и на ОФЗ серии 26210 – 21,4 млрд руб. при предложении в 30 млрд руб. Средневзвешенная цена по ОФЗ выпуска 26207 составила 111,0599% от номинала при доходности 7,03% годовых, и по ОФЗ выпуска – 101,6584% от номинала при доходности 6,62% годовых. /Финам/

Ставка 1-го купона по облигациям КБ «Восточный» серии БО-10 объемом 3 млрд руб. установлена в размере 12% годовых, что соответствует доходности к оферте на уровне 12,36% годовых. /Финам/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 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.)

Сегодня: 20.12.2012 – четверг

Статистика США: GDP, Personal Consumption, PCE Core, Initial jobless claims, Continuing claims, Existing Home sales

• **Выплата купона: БизнесЛайт, 01** (12%, 26.9 млн руб.), **Ипотечный агент МБРР, 1А** (8%, 12.7 млн руб.), **ХМАО, 25007** (10.4%, 103.7 млн руб.), **ХМАО, 25008** (10.8%, 107.7 млн руб.), **Минфин Республики Саха (Якутия), 34004** (9.75%, 29.1 млн руб.), **Газпромбанк, БО-04** (8.5%, 426.2 млн руб.), **АРИЖК, 01** (3%, 8.9 млн руб.), **АЛРОСА, 21** (8.25%, 164.5 млн руб.), **АЛРОСА, 23** (8.95%, 156.1 млн руб.), **Еврофинансы-Недвижимость, 02** (1.5%, 8.2 млн руб.), **Карелия, 34013** (9.71%, 42.1 млн руб.), **ЮТэйр-Финанс, БО-03** (9.45%, 35.3 млн руб.), **Национальный капитал, БО-01** (8.2%, 20.4 млн руб.), **Национальный капитал, БО-02** (8.2%, 20.4 млн руб.), **Волгоград, 34005** (9.5%, 23.7 млн руб.), **Россия, 36004(ГСО-ППС)** (7.6%, 1.9 млрд руб.), **Связь-Банк, 03** (8.5%, 211.9 млн руб.), **Приам, 01** (9%, 26 млн руб.), **БИНБАНК, БО-01** (9.85%, 148.1 млн руб.), **СБ Банк, 2017 (LPN2)** (12%, 3 млн долл.), **Костромская область, 34005** (9%, 26.9 млн руб.), **Ханты-Мансийский банк, 2018 (LPN)** (11%, 5.5 млн долл.), **Министерство финансов Самарской области, 35005** (9.3%, 9.8 млн руб.)

• **Погашение: БизнесЛайт, 01** (450 млн руб.), **ХМАО, 25007** (2 млрд руб.), **Костромская область, 34005** (3 млрд руб.)

• **Размещение: АБСОЛЮТ БАНК, БО-01** (5 млрд руб.), **Рязанская область, 34002** (2.5 млрд руб.), **Томская область, 34045** (5 млрд руб.), **Оренбургская область, 34001** (4 млрд руб.)

• **Оферта: КБ Центр-инвест, БО-01** (1.5 млрд руб.), **КБ Центр-инвест, БО-05** (1 млрд руб.), **МДМ Банк, БО-04** (5 млрд руб.)

Завтра: 21.12.2012 – пятница

Статистика США: Personal Income, Personal spending, PCE Core, Durable goods orders, U. of Michigan Confidence

• **Выплата купона: Департамент Финансов Тверской области, 34005** (15%, 3 млн руб.), **АиФ – МедиаПресса - финанс, 02** (12.75%, 63.5 млн руб.), **Прямые инвестиции-Финанс, 01** (8.25%, 41.1 млн руб.), **Риэл-лизинг Инвест, 01** (8.5%, 84.7 млн руб.), **ВТБ, БО-06** (8.5%, 211.9 млн руб.), **Гражданские самолеты Сухого, БО-01** (8.25%, 123.4 млн руб.), **Теле2-Санкт-Петербург, 01** (8.4%, 209.4 млн руб.), **Теле2-Санкт-Петербург, 02** (8.4%, 209.4 млн руб.), **Теле2-Санкт-Петербург, 03** (8.4%, 125.6 млн руб.), **Запсибкомбанк, БО-01** (9.75%, 97.2 руб.), **Россия, 35010(ГСО-ППС)** (7%, 2.7 млрд руб.), **Веста (ЗАО), 01** (10.2%, 27.9 млн руб.), **ИНВЕКТОР, 01** (7%, 9.1 млн руб.), **Профит-Гарант, 01** (7%, 9.6 млн руб.)

• **Погашение: СИБУР - Русские шины, 01** (12.6 млрд руб.), **АиФ – МедиаПресса - финанс, 02** (1 млрд руб.), **АЛРОСА, 21.12.2012 (zero, ECP)** (725 млн долл.)

• **Размещение: ЧТПЗ, БО-02** (2 млрд руб.), **ЧТПЗ, БО-03** (5 млрд руб.), **ЧТПЗ, БО-05** (1.2 млрд руб.), **ЯТЭК (бывш. Якутгазпром), БО-01** (3 млрд руб.), **Лизинговая компания УРАЛСИБ, БО-12** (2 млрд руб.), **Лизинговая компания УРАЛСИБ, БО-13** (1.5 млрд руб.)

• **Оферта: Башнефть, 01** (15 млрд руб.), **Башнефть, 02** (15 млрд руб.), **Башнефть, 03** (20 млрд руб.), **Металлинвестбанк, 01** (1.5 млрд руб.)

Внешний рынок долга

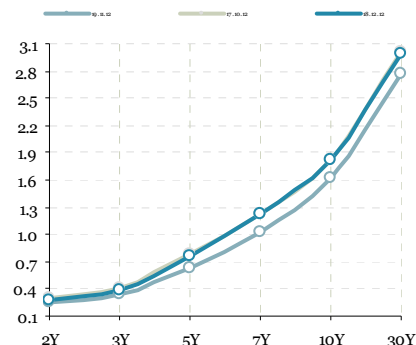
Рынки продолжают реагировать лишь на переговорный процесс в США

Внимание инвесторов продолжает оставаться прикованным к ходу процесса бюджетных переговоров в США. Новости о небольшом сближении позиций Администрации президента и лидером республиканцев вчера вызвали заметный рост спроса на риск. В Европе также ключевым событием было решение агентства S&P повысить рейтинг Греции на 6 ступеней до "B-", что позволит ЕЦБ вновь принимать в обеспечение суверенный долг страны. Помимо этого, определенный интерес представляет затягивание принятия бюджета на следующий год итальянским Сенатом, который отсрочивает уход в отставку нынешнего премьера М. Монти, с которым инвесторы связывают гарант разумной экономической политики страны.

К вечеру влияние процесса переговоров в США полностью изменило свой вектор. Спикер Палаты Представителей Д. Бейнер заявил, что намеревается провести через нижнюю палату свой законопроект (план «Б»). В ответ на это Б. Обама сообщил, что воспользуется правом вето и заблокирует эту инициативу. Как итог, рынки получили сигнал о том, что, несмотря на все ободряющие новости ранее, позиции оппонентов очень далеки друг от друга. Именно эта карта будет разыгрываться на сегодняшних торгах.

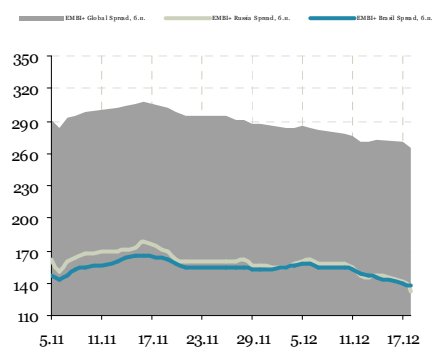
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



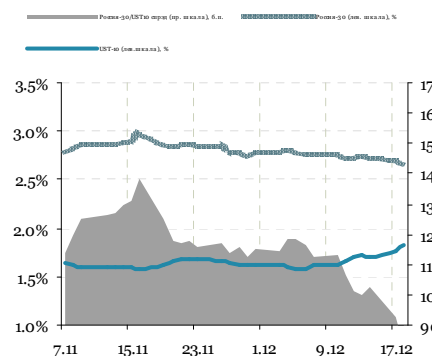
Источник: Reuters

Спрэды ЕМВІ+ (Россия, Бразилия)



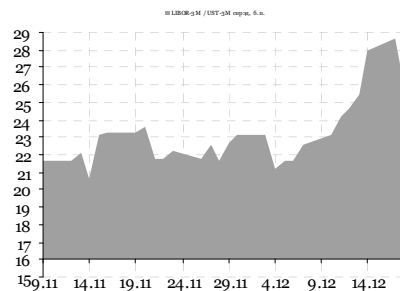
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Условия рынка остаются неблагоприятными

Конъюнктура локального денежно-кредитного рынка остается напряженной на фоне существенных оттоков ликвидности. Уровень краткосрочных процентных ставок вчера оставался вблизи среднесрочных максимумов. На рынке МБК кредиты овернайт обходились в среднем под 6.50% годовых, междилерское репо с облигациями на 1 день – под 6.35% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли 543 млрд руб. на 1 день против 694 млрд руб. во вторник. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ сократилась на 161.5 млрд руб. до 892.9 млрд руб.

На текущей неделе налоговый период продолжится, сегодня 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, продолжат удерживать рублевые ставки вблизи локальных максимумов.

Рубль стабилен, игнорирует рост цен на нефть

Торги на валютном рынке в среду завершились нейтрально для рубля. Курс бивалютной корзины по итогам дня снизился на 1 коп. до отметки 35.26 руб. Российская валюта находится в довольно комфортных условиях. Внутренняя поддержка исходит из перманентного дефицита ликвидности на денежном рынке, внешняя – от роста спроса на рискованные активы и рост котировок нети Brent почти до уровня в 110 долл. за барр. Сегодня рубль лишится внешней поддержки, поскольку рискованные стратегии вновь сворачиваются на фоне негативных новостей по бюджетным переговорам в США.

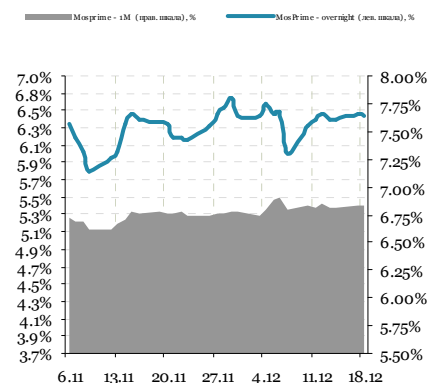
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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	694
	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.	
	Купоны ОФЗ	7 млрд руб.	
Четверг	Аукцион Казначейства	21 день, 40 млрд руб., от 6.5% годовых	
	Уплата налогов	НДС (~180 млрд руб.)	
Пятница	Возврат Казначейству	151 млрд руб.	

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

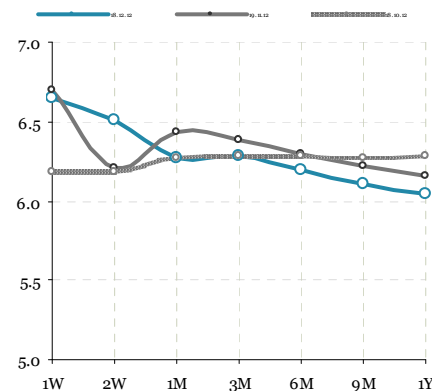
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды укрепили позиции

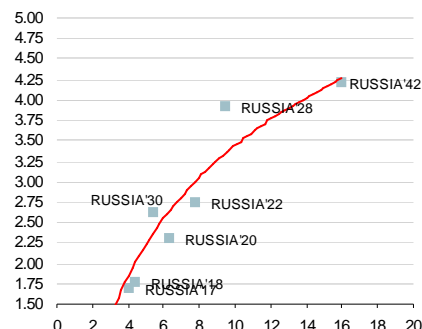
Российский сегмент в среду укрепил позиции. Суверенные бумаги торговались вверх по ценам вслед за UST, подорожав по итогам дня в среднем на 25 бп и сохранив спреды к UST в почти неизменном виде. Корпоративный сектор ускорил темпы роста, прибавив по итогам дня в среднем по рынку более 25 бп. Дальние выпуски Газпрома подорожали на фигуру, достаточно сильно смотрелись выпуски Газпром нефти SIBNEF'22 и РЖД RURAIL'17 и RURAIL'22, прибавившие в ценах порядка 50 бп. В частном секторе дальние выпуски Вымпелкома прибавили в районе фигуры, чуть более умеренный результат показали дальние выпуски Лукойла, а также бумаги EVRAZ'17 и выпуск МТС MOBTEL'20, прибавившие в ценах в районе 50 бп.

Спрос на ОФЗ невысок

На рублевом рынке спрос на ОФЗ продолжил снижение. Биды в дальних бумагах завершили день в среднем на 25 бп ниже отметок вторника, не отличался высоким спросом и еженедельный аукцион в ОФЗ. Минфин предложит рынку 46 млрд (30+16) 7- и 15-летних выпусков. В обоих случаях спрос в границах установленных диапазонов не превысил предложение, а фактически размещено было 70% и 40% заявленных объемов соответственно, при этом в дальнем выпуске сделки в конце дня проходили на 15 бп ниже цен аукциона. В корпоративном секторе цены выглядели стабильно, активность наблюдалась в выпусках НЛМК, Алросы, ФСК ЕЭС, выше по уровню кредитного риска покупали выпуск Русал 07, завершивший день ростом почти на 50 бп.

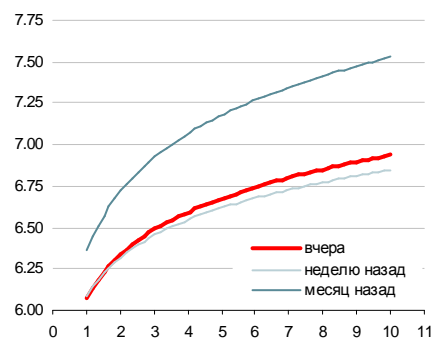
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



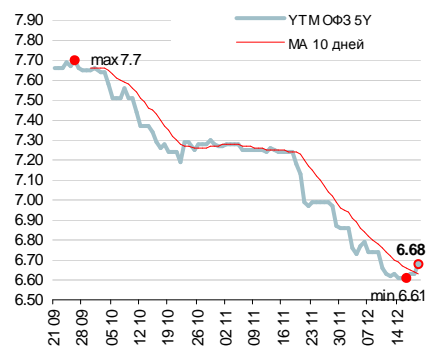
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



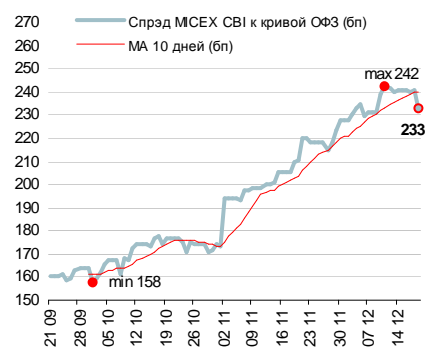
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



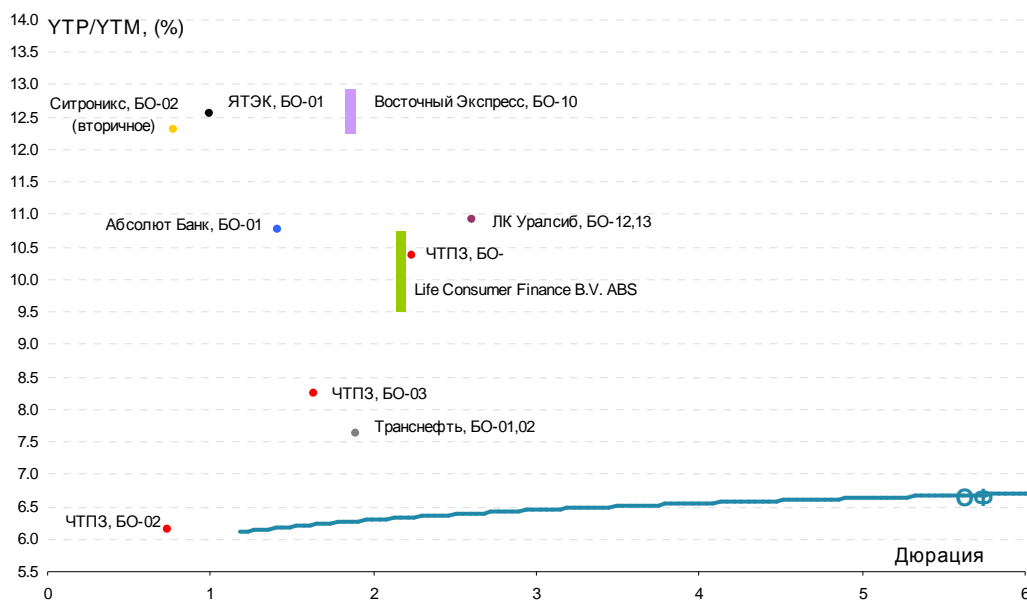
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
Абсолют Банк, БО-01	- / Ва3 / BB+	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	12.55	19.12.2012	21.12.2012	нет / 1 г.	1 г. / 3 г.
ЛК Уралсиб, БО-12	- / - / BB-	да	2 000	10.92	19.12.2012	21.12.2012	нет / 2.61 г.	нет / 3 г.
ЛК Уралсиб, БО-13	- / - / BB-	да	1 500	10.92	19.12.2012	21.12.2012	нет / 2.61 г.	нет / 3 г.
Ситроникс, БО-02 (вторичное)	- / В3 / В-	да	1 400	12.30	20.12.2012	21.12.2012	нет / 0.77 г.	нет / 0.8 г.
Транснефть, БО-01	BBB / Ваа1 / -	да	17 000	7.64	18.12.2012	24.12.2012	нет / 1.89 г.	2 г. / 3 г.
Транснефть, БО-02	BBB / Ваа1 / -	да	17 000	7.64	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.
ЧТПЗ, БО-02	- / WD / -	нет	2 000	6.14	н/д	27.12.2012	да / 0.74 г.	нет / 1 г.
ЧТПЗ, БО-03	- / WD / -	нет	5 000	8.24	н/д	27.12.2012	да / 1.64 г.	нет / 2 г.
ЧТПЗ, БО-04	- / WD / -	нет	1 225	10.38	н/д	27.12.2012	нет / 2.24 г.	нет / 2.5 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.

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds

Выпуск	Рейтинг, S&P/M/F	Ломбард ЦБ	Объем эмиссии, млн. руб.	Bid cover/Размещ объем	Ориентир УТР/УТМ	Фактическая УТР/УТМ	Дата размещения	Амортизация/Дюрация
Внешпромбанк, 02	В / В2 / -	да	1 500	н/д / 100%	11.04-11.56	11.30	19.12.2012	нет / 0.5 г.
Банк Открытие, 01	В / - / В	да	3 000	н/д / 100%	10.78-11.30	11.04	19.12.2012	нет / 1 г.
Татфондбанк, БО-03 (вторичное)	- / В3 / -	да	2 000	н/д / 100%	12.60-13.22	12.97	19.12.2012	нет / 0.91 г.
О'Кей, 02	- / - / В+	да	3 000	1.3 / 100%	10.25-10.51	10.36	18.12.2012	нет / 2.66 г.
МРСК Центра и Приволжья, БО-01	- / Ва2 / -	да	4 000	1.7 / 100%	9.46-9.73	9.36	18.12.2012	нет / 2.68 г.
ЛенСпецСМУ, 02	В / - / -	да	5 000	1.3 / 100%	13.10-13.65	13.54	18.12.2012	да / 3.17 г.
Правоуниверситетское, 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 / BB-	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- / Ваа3 / BBB-	да	10 000	2.0 / 100%	8.84-8.99	8.58	07.12.2012	нет / 2.71 г.
Газпром Нефть, 12	BBB- / Ваа3 / -	да	10 000	3.7 / 100%	8.78-8.99	8.68	05.12.2012	нет / 4.17 г.
АИЖК, 24	BBB / Ваа1 / -	да	6 000	2.8 / 100%	8.69-8.90	8.43	05.12.2012	да / 2.64 г.
Глобэкс, БО-07	BB / - / BB	да	5 000	1.0 / 100%	9.15-9.36	9.20	04.12.2012	нет / 1 г.
ММК, 18	- / Ва3 / BB+	да	5 000	2.1 / 100%	9.10-9.36	8.89	04.12.2012	нет / 2.70 г.
Росгосстрах 02 (вторичное)	NR	нет	3 500	н/д / 100%	10.76-11.06	н/д	04.12.2012	нет / 1 г.



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	100.07	100.08	100.07	-0.03	50	324 888	6.42	0.10		13	150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.05	100.07	100.07	0.02	37	634 155	6.22	0.13			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.55	101.60					5.81	0.26			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.08	100.11	100.11	-0.01	5	26 600	6.03	0.56	17		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.60					6.18	0.80	19	13	47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	101.00	101.15	101.12	-0.03	19	132 785	6.22	1.18	9	26	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.00	109.10	108.90	-0.33	1	1	6.38	1.52	15	49	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	108.00	109.43	109.42	0.02	3	18 000	6.29	1.82			40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.95	103.70	103.35	0.05	5	24 321	6.33	1.82	3	51	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.45	101.79	101.60	-0.10	10	155 004	6.38	2.29			150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.00	101.49	101.49	-0.01	3	125 001	6.34	2.33			150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	100.50	103.05	103.00	0.05	7	60 013	6.36	2.75			150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.55	99.70	99.55	0.05	8	11 004	6.63	2.83	17		80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.00	101.80	101.65	-0.15	5	113 852	6.48	3.19			150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	92.01	98.50	98.50	-0.50	1	1	6.45	3.49			24 000
ОФЗ 46019		20/03/19	75.01						7.62	3.39	109	189	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	100.15	104.10	103.80		5	75 933	6.48	3.76			150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.70	103.89	103.89	0.09	10	201 002	6.49	3.91			150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.70	105.30	103.85	-0.90	1	20 000	6.73	4.37	10		150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	94.45	94.65	94.45	-0.15	3	3	6.75	4.42	12		107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.40	101.55	101.40	-0.40	7	44 631	6.80	4.54	16	104	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	105.20	105.69	105.40	0.05	4	108 172	6.53	5.00			150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		70.00					5.26	5.36			27 000
ОФЗ 46018		24/11/21	97.90	98.40	98.40	-0.10	12	1 076 302	7.09	6.21	33	117	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	105.85	106.39	106.15	-0.35	9	52 134	6.74	6.32			150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	105.85	106.20	106.09	0.04	6	26	6.84	6.87	4		150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	91.00	92.70	91.82	0.12	1	1	7.13	7.36	31	107	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	110.90	111.00	110.86	-0.29	14	102 147	7.05	8.73	17	81	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.10	94.60	94.50	-0.25	1	30 000	7.54	11.14	56	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	99.79	99.90					7.10	0.59	122	101	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	--	--	--	--	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО6		05/03/13	100.07	100.30					7.30	0.21		107	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.50	100.70	100.58	0.08	5	118 109	7.69	0.50		158	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.50	100.77	100.48	0.03	1	1	7.90	0.50		179	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	99.50	100.50					8.31	1.61	206	244	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14	101.41	101.85	101.50	0.09	11	200 650	8.24	1.77	195	241	10 000
НЛМК 7/d	16/03/15	05/09/22	100.40	100.74					8.36	2.04	202	258	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.94	100.10	100.10	0.10	1	4	7.37	0.29		118	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15		100.15					8.36	0.64	246	228	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.70	99.66		4	32	8.10	1.14	198	213	5 000
ММК ВО6		10/07/14							9.00	1.45	279	310	5 000
ММК ВО7		22/07/14	94.00						8.87	1.48	265	298	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.01	100.36					7.32	0.16		106	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	99.95	100.39					7.64	0.16		138	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15							8.09	0.50		198	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15	100.19	100.21	100.15	-0.05	2	18 040	8.20	0.51	238	209	8 000
Алроса 23		18/06/15							8.82	2.22	245	305	7 000
Алроса 20		23/06/15	100.90	101.80	101.05		3	332	8.75	2.23	238	298	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.45	100.75	100.50	-0.09	11	405 000	8.93	2.53	251	318	5 000
Алроса ВО2		30/10/15			100.60	0.07	2	9 987	8.89	2.53	247	314	5 000

Евраз

Евраз 1/	22/03/13	13/03/20	100.11	100.30	100.24	0.09	1	1	8.35	0.25		214	10 000
Евраз 3/	22/03/13	13/03/20	100.11	100.29	100.15	-0.01	2	5 099	8.73	0.25		252	5 000
Сибметинвест 1/	16/10/14	10/10/19	107.23	107.64	107.21	-0.34	2	106	9.31	1.65	305	345	10 000
Сибметинвест 2/	16/10/14	10/10/19	107.69	107.70	107.66	0.46	2	16	9.04	1.65	278	318	10 000
Евраз 2/	26/10/15	19/10/20	101.61	101.79	101.60	-0.20	3	127	9.51	2.52	309	376	10 000
Евраз 4/	26/10/15	19/10/20	101.60	101.80					9.45	2.52	303	370	5 000
Евраз 5/	06/06/16	27/05/21	96.10	99.00					10.10	3.06	361	438	5 000
Евраз 7/	02/06/16	25/05/21	92.00	95.00	95.00	-1.03	1	1	10.41	3.05	392	469	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1/d	16/03/15	07/03/22	100.02	100.09	100.06	0.06	12	21 711	9.16	2.03	282	338	5 000
Металлоинвест 5/d	16/03/15	07/03/22	99.75	100.18	100.05	-0.05	2	10 508	9.16	2.03	282	338	10 000
Металлоинвест 6/d	19/03/15	10/03/22	99.75	100.18	100.14	0.14	2	8	9.12	2.04	278	334	10 000

Мечел

Мечел ВО2/		12/03/13	99.60	99.74	99.60	0.05	9	16 550	11.76	0.23		554	5 000
Мечел 5/d	16/04/13	09/10/18	96.05	99.80	100.00		1	2 000	11.71	0.32		553	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	99.40	99.49	99.40		1	5 000	11.82	0.35		565	5 000
Мечел 2/d	15/06/11	12/06/13	97.85	97.90	97.90	-0.10	5	357	12.39	0.48		627	5 000
Мечел 4/d	25/07/13	21/07/16	98.85	99.35	99.35		2	236	12.97	0.58	710	688	5 000
Мечел ВО4/	11/02/14	10/02/15	95.01	95.95	95.00	-1.08	3	248	15.69	1.07	959	971	5 000
Мечел 15/d	18/02/14	09/02/21	92.01	93.00	93.00	1.00	3	128	15.54	1.11	943	956	5 000
Мечел 16/d	18/02/14	09/02/21	92.11	92.69	92.47	0.01	1	1	16.12	1.11	1001	1 014	5 000
Мечел ВО5/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	545	605	5 000
Мечел ВО7/		07/04/15	99.50						11.82	2.22	545	605	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22	545	605	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22	545	605	3 000
Мечел ВО6/		07/04/15	99.50						11.55	2.05	521	577	2 000
Мечел 13/d	01/09/15	25/08/20	86.07	87.00	87.00	1.00	4	25	16.75	2.34	1036	1 099	5 000
Мечел 14/d	01/09/15	25/08/20	85.68	87.98	85.67	0.07	13	882	17.50	2.33	1111	1 174	5 000
Мечел 17/d	02/06/16	27/05/21	81.51	82.00					15.88	3.00	940	1 016	5 000
Мечел 18/d	02/06/16	27/05/21	80.05	83.50	83.50	-0.50	2	4	15.19	3.02	870	947	5 000
Мечел 19/d	07/06/16	01/06/21	81.08	84.99	84.98	-0.01	9	427	14.50	3.03	801	878	5 000
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.51	100.00	100.00	-0.13	2	15 001	9.02	0.82	302	298	5 000
СУЭК													
СУЭК 1/d	05/07/13	26/06/20	100.10	100.50	100.46		13	31 828	8.63	0.52	280	252	10 000
РМК													
РМК 3/d	17/12/13	15/12/15	96.16	99.60	98.00	-1.00	3	52	13.00	0.97	694	699	3 000
РМК 4/d	05/06/14	02/06/16	92.16	92.50	92.50		2	727	15.45	1.39	925	954	5 000
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	97.00	97.79	97.75	1.75	10	4 315	10.69	1.38	450	477	5 000
Русал													
Русал 7/d	03/03/14	22/02/18	94.45	94.90	94.74	0.44	23	155 546	13.58	1.14	746	761	15 000
Русал 8/d	15/04/15	05/04/21	90.56	90.68	90.68	0.18	17	12 079	13.72	2.11	737	795	15 000
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.71	99.95					7.37	0.88	134	134	15 000
РЖД 10		06/03/14	108.76	108.79	108.80		2	12 360	7.38	1.12	127	141	15 000
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.80	112.63	102.80	0.04	2	363	7.68	1.91	137	188	15 000
РЖД 11		18/11/15	99.75	100.40					8.01	2.65	157	227	15 000
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.36	99.77	99.77	0.02	5	19 817	8.14	3.09	164	242	15 000
РЖД 19	16/07/18	08/07/24		100.05					8.30	4.44	167	254	10 000
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6/d	26/09/13	15/09/20	99.75	100.25					7.59	0.75	162	153	10 000
ФСК ЕЭС 8/d	26/09/13	15/09/20	99.75	99.99					7.34	0.75	137	128	10 000
ФСК ЕЭС 18/	09/06/14	27/11/23	100.81	100.90	100.89	-0.11	1	20 000	8.00	1.41	180	209	15 000
ФСК ЕЭС 15/	23/10/14	12/10/23	101.40	101.43	101.36	0.11	4	24 006	8.09	1.72	181	225	10 000
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.00	100.10					8.06	2.15	170	229	10 000
ФСК ЕЭС 10/	24/09/15	15/09/20	99.12	99.85					8.17	2.50	175	242	10 000
ФСК ЕЭС 7/d	27/10/15	16/10/20	98.15	98.88					8.26	2.59	183	252	5 000
ФСК ЕЭС 12/	22/04/16	19/04/19	96.01	100.15	100.00		3	150 000	8.26	2.96	178	254	10 000
ФСК ЕЭС 25/	27/09/16	14/09/27	101.50	101.70	101.75	0.10	4	60 002	8.21	3.25	170	248	15 000
ФСК ЕЭС 21/	19/04/17	06/10/27		102.25	101.89	-0.06	1	2	8.39	3.66	183	266	10 000
ФСК ЕЭС 9/d	24/10/17	16/10/20	99.00	99.70	99.30	0.31	3	1 002	8.33	4.07	173	259	5 000
ФСК ЕЭС 11/	24/10/17	16/10/20	99.00	99.69					8.36	4.05	176	262	10 000
ФСК ЕЭС 19/	18/07/18	06/07/23	97.00	99.50	98.25	0.50	13	114 100	8.52	4.45	189	276	20 000
ФСК ЕЭС 13/		22/06/21	96.70	105.00					8.81	5.97	207	292	10 000
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.50	100.60					8.94	2.15	258	317	4 000
Росавтодор													
Росавтодор 1/d		29/11/16							9.34	3.38	281	361	3 000
Росводоканал													
Росводоканал 3/d	11/11/13	09/11/15	95.51		99.11	-0.17	8	692	10.30	0.87	428	427	3 000
Водоканал													
Водоканал 1/d		09/12/15	96.69	98.30	95.00	-3.03	1	1	11.10	2.67	466	536	2 000
Западный СД													
Западный СД 1/d	29/04/16	13/05/31	98.80	99.19					9.50	2.97	302	378	5 000
Западный СД 2/d	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.18	2.97	270	346	5 000
Западный СД 3/d	24/02/17	06/02/32	100.50						9.31	3.48	277	358	5 000
Западный СД 4/d	24/02/17	06/02/32	100.50						9.32	3.48	278	359	5 000
Западный СД 5/d	24/02/17	06/02/32	100.50						9.29	3.48	275	356	5 000
Почта России													
Почта России 1/	25/03/14	22/03/16		100.74					8.05	1.21	191	210	7 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	100.45					8.57	2.55	215	282	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	110.35					8.70	2.55	228	295	3 000
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	110.35					8.88	2.55	246	313	3 000
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	99.80	99.95	99.80		1	50 000	7.54	1.10	143	156	5 000
Газпром А11		24/06/14							7.21	1.34	103	128	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	101.60	101.50	0.10	4	200 001	8.38	4.02	179	264	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.45	101.75	101.45	0.05	3	14 610	8.40	4.03	181	266	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	100.10					7.42	0.95	137	141	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	99.35	99.50	99.50	0.20	2	1 901	8.05	0.07			8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.99	100.15	99.99	0.02	1	5 000	7.26	0.30		107	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	86.00	100.10					7.26	0.30		107	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50	100.99					7.98	1.94	166	219	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.60	101.25	101.00	-0.15	2	8 500	8.29	2.73	184	255	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.25	101.46					8.24	2.74	179	250	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	101.60	105.00	102.00	0.40	1	900	8.59	4.11	199	285	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	99.96	100.13	99.95	-0.05	5	102	8.38	4.35	176	263	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13	100.00	100.20	100.16	-0.05	3	2 002	7.30	0.50		119	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.60	100.80	100.60		3	99 368	8.27	2.53	185	252	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	100.60		100.68	0.08	1	10 000	8.23	2.53	181	248	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	100.60		100.70	0.20	1	9 994	8.22	2.53	180	247	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.50	101.00	99.72		7	1 224	7.76	0.74	180	170	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	100.00	100.05	100.05	0.02	6	763	8.51	3.47	197	278	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	98.61	100.05	100.00		2	3 001	8.53	3.47	199	280	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	99.05	100.00	100.00	-0.06	3	3 003	8.53	3.47	199	280	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14		101.22	101.15	-0.08	4	14 345	8.24	0.94	219	223	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.25	102.00	101.15	0.03	1	960	8.57	1.95	225	278	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	99.01	101.00					9.77	0.59	390	368	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	98.50	100.75	99.09	-0.07	11	6 428	10.36	1.06	426	437	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	96.75	100.00					10.14	3.05	365	442	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	96.75	99.48					10.79	3.05	430	507	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнфг2		26/07/13	99.67	99.90	100.00	0.30	3	1 001	12.52	0.57	666	642	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	90.00	100.00	96.86	-0.24	2	18	9.69	2.98	321	397	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.33	100.65	100.39	0.04	4	1 182	8.05	0.54	221	195	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14							-9.20	0.01			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.99	100.11	100.03	0.02	1	125 658	7.83	0.10		154	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.98	100.03	100.00	0.04	7	90 000	7.82	0.24		160	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.98	100.03	100.03	0.03	30	87 175	7.68	0.24		146	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.93	99.98	99.98	0.01	9	13 900	7.91	0.24		169	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.10	100.19	100.19	0.08	7	176 004	7.89	0.69	196	182	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.65	99.94	99.94	0.24	4	12 000	7.68	0.80	169	163	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	100.10	101.00					8.23	1.20	209	227	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	100.10	100.15					8.11	1.20	197	215	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	99.90						8.68	2.47	227	293	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.47	227	293	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.51						8.02	0.44		189	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	101.00					8.74	1.83	244	292	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	99.85	100.23					8.10	0.65	219	202	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.80	100.10					6.56	0.05			10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.25	99.74					8.00	0.23		178	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.99	100.40					7.58	0.35		141	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.00					8.19	0.74	223	213	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	99.00	99.50	99.32	0.32	1	169 644	8.16	0.68	223	209	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	99.75					7.46	0.95	141	145	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.58	1.21	244	263	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	99.35	99.97					7.78	0.82	178	174	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.50	100.65	100.45	0.05	2	2	8.33	2.03	199	255	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	101.00	101.40	100.90	-0.34	3	12	8.34	2.52	192	259	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	100.00	101.50	101.50	0.45	1	1	8.10	2.53	168	235	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.50	99.75	99.25	-0.05	2	100	8.33	2.89	186	260	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.25	216	294	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.70	99.19	98.10	-0.80	1	1	8.56	4.05	196	282	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	98.29	99.49	99.35	-0.15	4	34	8.18	1.25	202	224	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	101.00	101.40					8.28	1.74	200	244	5 000
ВЭБ-Лизинг 9	29/10/14	20/10/21	101.00	101.40					8.28	1.74	200	244	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	100.75		1	200	8.77	1.86	247	296	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	87.10	99.60	99.00	-0.50	1	10 000	9.15	2.90	268	342	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	100.50	99.00	-0.50	1	19 000	9.15	2.90	268	342	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.05	101.25	100.45	-0.75	1	4 850	8.47	1.21	233	252	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	101.15	101.40	101.25	0.45	8	27 166	8.54	1.55	230	266	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.25	100.70					8.45	1.36	226	253	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	99.25	100.75					8.45	1.36	226	253	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	99.50	100.21	100.20	0.01	1	1	7.50	0.13		123	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	99.50	100.25	100.25	0.05	2	2 001	7.14	0.14		87	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.69					7.41	0.48		129	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15		100.20	100.19	0.04	1	1	8.02	0.61	213	193	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.90	101.18	100.25	0.15	1	1	7.92	0.62	203	183	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	100.00	100.23	100.01	0.01	2	6 910	8.43	0.67	251	235	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	100.00	100.23					8.44	0.67	252	236	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17							6.93	0.77	96	87	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	99.90	100.25	100.25	0.16	2	53	8.03	0.84	202	199	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.10	100.55	100.54	-0.06	3	2 030	8.25	0.86	224	222	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.35					8.33	1.09	223	235	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.10	100.00	99.00	-0.62	1	300	8.63	1.55	239	275	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.19					7.60	1.73	132	176	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.24					8.48	1.72	220	264	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.35	100.85	100.35		11	10 501	8.55	2.12	220	278	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	98.35	99.25					8.61	2.28	223	285	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	98.35	99.25					8.70	2.29	232	294	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	98.35	98.50					8.60	2.29	222	284	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14							7.27	0.01			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14	99.47	99.55	99.47	-0.09	13	39 744	7.82	0.57	196	172	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	94.00	100.00					8.24	0.95	219	223	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15		100.65					8.18	1.07	208	220	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.85	100.90	100.83	-0.02	5	4 032	8.44	1.44	223	254	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16	86.00						8.44	2.55	202	269	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	99.96						8.67	2.54	225	292	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	94.97						8.67	2.54	225	292	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	94.97						8.67	2.54	225	292	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30						8.13	1.02	205	213	3 000
АИЖК-11 А1	15/03/15	15/09/43	100.10	100.20	100.11	0.01	1	1	8.45	2.06	211	267	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.01	99.40					8.38	1.73	210	254	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.00	100.00	99.50	0.15	1	6 200	8.21	1.75	193	238	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.42	2.20	205	265	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	99.48					8.48	2.67	204	274	5 000
АИЖК А10		15/11/18	91.75						8.46	2.90	199	273	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	100.50	100.50	1.50	10	500	8.06	2.91	159	233	7 000
АИЖК А21		15/02/20	101.00						8.55	3.09	205	283	15 000
АИЖК А11		15/09/20	99.25	100.00					8.67	3.75	210	293	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.90		102.00	3.35	1	10	8.07	4.94	140	229	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					8.94	5.40	224	312	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	201	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	100.15	100.12		2	6 175	9.06	0.95	301	305	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	99.80	100.00	100.00	-0.09	16	63 422	9.20	0.95	315	319	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14		99.80					9.59	1.49	337	370	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.49	330	363	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.90	100.08	100.00		13	79 224	8.35	0.16		209	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.25	99.95		1	30 000	8.11	0.63	221	203	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.10	100.00					8.30	0.89	227	227	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.15	99.95	99.95	0.30	1	2 000	8.45	1.27	229	251	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.70	110.05	100.70	-0.25	2	2	8.44	2.59	201	270	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.27	100.30	100.27	-0.05	4	19 325	7.58	0.50	177	147	10 000
МТС 1		17/10/13	99.30	99.84	99.75		1	1	7.43	0.81	144	138	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	95.00	99.30	99.22	0.12	1	15 000	8.16	1.33	198	223	15 000
МТС 2		20/10/15	98.11	98.50	98.50	0.40	1	170	8.52	2.57	209	277	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.25	99.45	99.45	0.10	5	50 500	8.54	2.62	211	280	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.75	100.00					8.72	3.13	222	300	15 000
МТС 7		07/11/17	99.55	100.03	100.01	-0.04	7	8 719	8.88	4.05	228	314	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	100.60	100.70					8.22	0.56	237	212	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.02	98.86	98.15	-0.27	3	3 032	8.89	1.45	268	299	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	99.95	100.10	100.00	0.03	4	6 003	9.03	2.05	269	325	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	100.05	100.10	100.05	0.04	1	1 470	9.01	2.04	267	323	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	100.00	100.10	100.05	-0.05	7	78 954	9.01	2.04	267	323	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.30	98.73	98.60	0.10	2	100 001	9.06	2.53	264	331	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.30	99.00	98.30	-0.59	4	55 002	9.19	2.53	277	344	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.00	100.50					8.20	1.69	193	235	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.00	99.65					8.73	0.54	289	263	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	98.00						6.68	0.38		52	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.95					8.69	1.08	259	271	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22		101.24					8.38	1.08	228	240	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.35	100.70	100.66	0.36	13	40 801	8.83	2.11	248	306	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21							9.54	2.97	306	382	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21							9.65	2.97	317	393	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21							9.54	2.97	306	382	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	86.00	99.95					7.78	0.19		154	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90	100.10					8.47	0.70	253	240	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90	100.10					9.92	0.70	398	385	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.90						8.29	0.70	235	222	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.90	100.00					8.35	0.70	241	228	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.35	99.60					8.56	1.14	244	259	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	86.00						8.57	1.28	240	263	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.60	100.70					8.83	2.46	242	308	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.00	99.99	98.50	0.50	1	3 000	9.06	1.41	286	315	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	98.00		98.70	0.20	1	2 500	9.07	1.42	287	316	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.15	100.59	100.58	0.08	6	130 000	9.46	2.47	305	371	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.12	98.90					9.03	0.58	316	294	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.70	100.09	100.05	0.09	4	190	9.23	0.75	327	317	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	98.66	101.00					10.21	0.42		407	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.16	100.64	99.22	-1.23	9	5 569	9.38	0.87	336	335	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	98.01	100.19					9.41	0.77	344	335	3 000
Синергия БО-3		03/06/15							11.30	1.90	499	550	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.05	99.51	99.51	-0.44	12	1 771	13.96	0.48		784	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.90	94.63	93.90	-0.10	4	3 920	11.77	2.24	540	600	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.51	96.24					11.86	1.48	564	597	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	97.80	99.05					8.46	1.58	222	259	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.55	96.00					10.73	1.05	464	474	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13	99.85						-61.63	0.97			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	99.00	99.30	99.14	-0.01	1	245	9.62	1.07	352	364	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	102.25	102.75					9.82	2.44	341	407	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	12/12/13	07/12/17	99.02	100.05					9.46	0.96	340	345	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.56	99.65	99.60	0.10	3	51 000	9.76	0.67	384	368	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00						12.09	0.82	609	605	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.40	100.80	100.75	0.35	5	65 003	8.30	0.70	236	223	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							8.42	0.95	237	241	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.85						9.14	0.34		297	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.65	100.00	99.76	-0.14	5	13 086	9.12	0.34		295	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.13	0.73	218	207	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.82	100.05	99.82	-0.23	4	13 010	9.94	0.36		378	2 000
Соллерс 2		17/07/13	101.55	101.65	101.50	-0.15	3	10 100	9.96	0.55	412	386	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	100.71	101.39	101.70	0.30	13	19 046	10.08	1.92	376	428	3 000
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1		08/04/13	99.90	100.04					7.59	0.30		140	6 000
Аэрофлот БО-2		08/04/13	99.99	100.05	100.05	0.04	3	3	7.66	0.30		147	6 000
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1		26/02/13		100.45	100.50	0.13	1	29	6.81	0.19		57	3 000
Трансконтейнер 2		04/06/15	100.21	101.00					8.72	1.61	247	285	3 000
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1		10/07/15	99.01	100.25	99.10	-1.14	2	5 000	10.33	1.29	416	439	3 000
Нов ПеревозКом БО-01		03/03/15	100.47	100.95	100.95	-0.05	5	27 927	9.72	1.98	339	394	5 000
Нов ПеревозКом БО-02		03/03/15	100.45	100.90	100.96	0.01	6	4 810	9.72	1.98	339	394	5 000
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.06	100.13	100.13	-0.03	16	15 195	12.61	0.68	668	654	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.05	100.19	100.20	-0.01	46	14 809	12.57	0.81	658	653	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1		26/03/13	100.01	101.20					8.12	0.26		191	2 000
Ю-Тэйр БО-2		26/03/13	100.35	100.84					8.97	0.26		276	2 000
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.31						10.36	0.35		419	2 000
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.30	99.65	99.80	0.50	3	51 729	10.98	0.35		481	2 000
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15							8.46	0.45		233	1 000
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15							10.38	0.92	434	436	2 000
Ю-Тэйр БО-3		19/12/13							9.80	0.94	375	379	2 000
Ю-Тэйр БО-4		26/03/14	96.01	97.80					12.09	1.18	595	613	2 000
Ю-Тэйр БО-5		26/03/14	96.11	97.00	96.05		1	4	13.01	1.18	687	705	2 000
Ю-Тэйр 5		21/07/16							8.66	3.05	217	294	2 000
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Ру сгидро 1	22/04/16	12/04/21	96.10	99.80					8.39	2.96	191	267	10 000
Ру сгидро 2	22/04/16	12/04/21	96.51	99.40					8.37	2.96	189	265	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16		99.70					9.12	0.18		287	5 000
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.65	101.00	100.65	-0.15	5	29 001	8.50	1.82	220	268	5 000
МОЭСК													
МОЭСК БО1		18/09/15	100.25	100.50	100.35	-0.15	1	25 000	8.83	2.45	242	308	5 000
МОЭСК БО2		26/10/15	100.35	100.45	100.35	-0.10	1	75 000	8.84	2.56	242	309	5 000
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.30	100.70					8.52	2.14	216	275	3 000
ЭНЭЛ ОГК-5													
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.34	100.64	100.55	0.15	9	75 982	7.48	0.50		137	4 000
ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18		25/06/14							8.28	1.41	208	237	5 000
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21							12.72	1.39	652	681	10 000
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	82.11	92.41					12.41	2.91	594	668	5 000
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1		14/10/15	100.05		100.42	-0.08	8	316 600	8.96	2.52	254	321	4 000
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	93.92	96.90	95.50	-0.60	3	4 900	11.39	1.57	515	551	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	98.50	99.15					8.73	0.52	290	262	5 000
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	92.11	99.00					21.29	1.17	1516	1 533	4 000
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.70	99.09	98.46	-0.40	7	17 406	10.87	0.63	497	479	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1		17/09/13	86.27	86.59	86.59	-0.01	51	5 457	32.60	0.72	2665	2 653	5 000
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.85	99.05	98.95	-0.75	7	52 030	10.35	0.79	437	430	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1		28/11/13	104.00						9.07	0.91	303	305	5 000
Ирку тЭнерго БО-1		08/04/14	85.00	98.50					9.04	1.25	289	309	3 000
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1		03/09/13	99.85	99.95	99.85	-0.10	1	100	8.62	0.69	269	255	3 000
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2		23/04/13	97.67						14.46	0.38		830	2 000
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.10	99.94	99.55	1.45	3	2 801	9.15	0.67	323	307	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.01						9.01	2.23	264	324	5 000
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.00	100.00					8.95	2.63	251	321	5 000
АКРОН													
Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.60	102.99					8.98	0.73	303	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	100.01	101.50	101.25	-0.25	3	150 000	8.57	0.90	254	255	4 000
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	96.01	99.85					11.33	1.38	514	541	4 000
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	97.01	99.90	97.00		2	350	10.50	1.38	431	458	4 000
Акрон БО1		13/10/15	100.50	100.75	100.95	0.20	3	10 352	9.57	2.49	316	382	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.24	98.91	98.90	0.07	1	14 000	9.72	1.25	357	377	2 000
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	99.98	100.15	100.00		23	168 100	9.86	0.12		358	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13	100.35	100.95					10.02	0.49		391	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.00	100.10	100.10	0.10	7	232	10.05	0.70	411	398	2 000
ЛСР Группа 3	14/03/14	08/09/17	100.05	100.60					11.10	1.15	497	513	3 000
ЛСР Группа БО-3		20/03/14	98.20	98.35	98.31	-0.04	9	1 902	11.26	1.18	513	530	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.15	96.20	96.25	0.10	3	335	11.39	1.47	517	549	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.92	100.20					11.58	1.69	531	573	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	100.10	100.19	100.19	0.19	23	33 698	13.77	1.38	758	785	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.20	101.75	101.31	-0.49	1	2	13.00	1.23	685	705	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.11						9.97	0.42		383	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17							9.18	3.97	259	344	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17							9.26	3.97	267	352	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17							9.32	3.97	273	358	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.50	100.50	100.03	1.53	2	2	8.93	3.40	240	320	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.35	100.43	100.45	0.01	4	15 850	7.63	0.21		140	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.90	100.25	100.20	0.25	1	66 319	8.38	1.53	215	250	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.50	98.65					8.39	1.76	210	256	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	98.71	99.10	99.06	-0.30	11	656	12.57	0.55	672	647	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	99.87	100.25	100.25	0.10	3	4 264	11.80	0.50		569	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.01	100.25	100.25	0.05	2	201	11.95	0.77	597	590	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.34	100.40	100.40		5	12 200	8.05	0.41		190	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13							8.17	0.49		206	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	100.00	100.15	100.00		1	4 500	8.14	0.53	230	204	5 000
РОСБАНК А3/	06/05/11	06/11/13	98.80	98.98	98.80	-0.01	2	23	8.49	0.87	247	246	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.87	101.10	101.00	0.05	1	5 555	8.84	1.60	259	297	10 000
РОСБАНК А5/	06/05/11	07/11/14	97.50						9.06	1.78	277	323	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2/d	07/06/13	02/12/16	100.30	100.85	100.40	-0.30	2	30 200	8.52	0.47		240	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.25					8.44	0.76	247	238	10 000
Альфа-Банк 1/d	04/02/14	02/02/16	97.51	100.00					8.60	1.07	250	262	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.15	100.25	100.25	0.10	3	1 002	8.53	1.13	241	256	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/13	16/12/14	100.05		100.05	0.01	14	107 875	9.67	0.97	361	366	5 000
МДМ Банк 8/d	09/07/13	09/04/15	100.05	100.20	100.25	0.09	9	2 553	8.71	0.54	287	261	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35					9.20	1.19	306	324	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.75	99.87	99.87	0.17	2	3 551	8.53	0.33		235	5 000
НОМОС Банк 9/d	15/06/12	14/06/13	99.80	100.24	99.90	0.06	3	755	9.16	0.48		304	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.20	100.05	-0.07	12	58 044	9.24	0.62	335	315	5 000
НОМОС Банк 12/	25/08/13	28/08/17	99.55	99.57	99.59	-0.01	1	1	9.31	0.66	339	323	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.50	99.77					9.48	1.12	337	351	5 000
НОМОС Банк 11/	02/07/14	02/07/14	97.99	103.00					9.73	1.40	353	382	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.03	100.10	100.03	0.03	1	550	8.84	0.43		270	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.00	100.12	100.00	-0.05	9	94 400	8.95	0.14		268	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.05	100.12	100.05	-0.03	6	13 824	8.62	0.16		236	3 000
Банк ЗЕНИТ 1/d	07/04/12	07/04/13	99.40						8.48	0.30		229	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.25	100.15		10	7 675	8.83	0.46		270	5 000
Банк ЗЕНИТ 6/d	02/07/13	01/07/14	100.25	100.29	100.29		11	4 502	8.80	0.51	298	269	3 000
Банк ЗЕНИТ 8/d	28/08/13	23/08/17	100.26	100.28	100.28	0.04	10	24 135	8.93	0.67	301	285	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.74	166	156	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.13	100.25	100.23	0.03	4	50 002	9.01	0.88	298	298	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.04	100.10	100.08	0.05	5	16	9.32	1.25	317	337	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2/d	20/02/13	18/02/15	99.95	100.06	100.02	0.02	2	11	8.69	0.17		244	5 000
Промсвязьбанк 4/d	20/02/13	18/02/15	99.95	100.06	100.06	0.06	6	5 001	8.44	0.17		219	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	99.51	99.90	99.96	0.30	18	39 541	8.51	0.49		240	5 000
Промсвязьбанк 3/d		04/02/14	95.01	99.50	99.12	-0.04	6	638	9.64	1.07	354	366	5 000
Промсвязьбанк БО7	06/09/14	06/09/15	99.00	100.69	100.60	-0.14	3	25 001	9.98	1.58	374	411	5 000
Промсвязьбанк 3/d		01/02/18	100.30	100.55	100.35	-0.20	2	15 697	12.52	3.79	595	678	5 000
Банк СПб													
Банк СПб 1/d	09/10/12	09/04/13	90.00						8.27	0.04			5 000
Банк СПб 4/d	13/12/12	12/12/13	86.00						9.54	0.96	348	353	3 000
Банк СПб 2/d	26/03/12	23/09/13	99.80	99.91	99.91	0.06	2	988	9.30	0.74	334	324	5 000
Банк СПб 8/d	07/10/13	05/10/15	100.12	100.40	100.40	0.14	2	1 901	9.14	0.78	316	309	5 000
МКБ													
МКБ /d	15/01/13	14/07/15	100.00	100.07					8.82	0.07			2 000
МКБ -01/d	22/02/13	22/02/14	99.92	99.95	99.90	0.03	8	1 021	9.15	0.18		290	3 000
МКБ -03/d	27/04/13	27/04/15	99.90	99.94	99.94	0.01	1	1	9.58	0.35		341	4 000
МКБ -02/d	25/09/13	25/09/15	99.71	99.90	99.77	-0.03	5	15 952	10.28	0.75	432	422	3 000
МКБ /d	09/10/13	08/04/15		99.80	99.70	0.10	2	128 000	10.37	0.78	439	432	3 000
МКБ -04/d	15/10/12	15/04/14	99.96	100.09	100.05	-0.04	16	14 851	10.44	1.25	428	449	5 000
МКБ -05/d		23/06/14							10.80	1.38	461	488	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	20/12/13	21/12/14	100.05	100.59	100.20	0.07	3	18 002	9.76	0.98	370	375	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	100.01	100.00	-0.02	1	10 000	9.06	0.68	313	299	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15	86.00	100.32					11.02	0.65	511	494	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	100.45	100.57	100.45	-0.03	5	470	9.48	1.11	337	350	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.73	99.78	99.78	-0.02	7	10 820	9.24	0.71	330	317	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.95	100.00	100.00		8	156 001	9.91	1.13	379	394	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.15	100.15	0.03	4	4 619	9.49	0.47		337	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	99.97	100.02	100.00		3	5 070	9.84	0.67	392	376	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	99.04	98.85	0.25	1	650	10.44	0.75	448	438	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.77	100.95	100.95	0.05	1	250	11.00	1.05	491	501	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.96	1.06	486	497	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.81	100.34					11.11	1.12	500	514	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	101.70						11.02	1.83	472	520	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.75	102.15	101.75	0.25	1	15	11.01	1.93	469	521	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.60	99.00	98.60	-0.25	14	61 853	12.61	0.60	673	652	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	100.01	100.30	100.30	0.28	3	1 019	12.71	0.61	682	662	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК 4/d	18/04/13	16/04/15	100.40	100.50	100.50	-0.04	12	2 110	11.86	0.33		568	2 000
ТКС БАНК 6/d	16/07/13	14/07/15	101.01	101.30	101.25	-0.05	3	30	11.87	0.54	603	577	2 000
ТКС БАНК 2/d		28/07/13	104.61	104.97	105.15	0.15	7	1 145	11.20	0.56	534	510	1 000
ТКС БАНК /d		20/09/13	101.51	102.00					11.63	0.72	568	556	2 000
ТКС БАНК 2/d	29/11/11	26/11/13	104.03	104.39	104.45	0.20	15	2 610	11.65	0.90	562	563	2 000
ТКС БАНК 3/d	21/08/12	18/02/14	102.50	102.92	102.50	-0.14	3	1 982	11.94	1.07	584	596	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.14	100.19	100.19	-0.03	56	19 569	14.33	0.60	845	824	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	100.30	100.88					10.68	0.86	466	465	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	99.70	100.05	99.90	-0.40	2	1 150	9.00	0.74	304	294	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	99.95	100.40	100.36	0.11	5	1 071	9.36	1.57	312	349	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.00					7.62	0.84	161	158	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19		101.29					7.88	1.08	178	190	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	99.70	100.50	99.75	-0.10	2	1 001	8.07	1.09	196	209	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19	100.50						7.45	2.01	112	167	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	100.50					8.53	1.33	235	260	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.15	100.30	100.30		2	30 000	8.18	0.68	225	211	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.15	100.30	100.30		6	125 000	8.19	0.69	226	212	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	94.00	99.50	99.44	0.09	1	10 000	8.48	0.69	255	241	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	86.00		100.40	-0.10	2	1 000	8.75	0.96	269	274	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.60	100.79	100.60		2	2	8.92	1.72	264	308	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.60	101.50					9.61	1.73	333	377	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	250	330	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	100.95	100.95	0.09	3	558	7.84	0.93	179	182	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.66	99.80					7.81	0.92	177	179	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		227	5 000
РуссСтандарт													
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.00	100.34	100.30	0.04	7	1 599	9.22	0.87	320	319	5 000

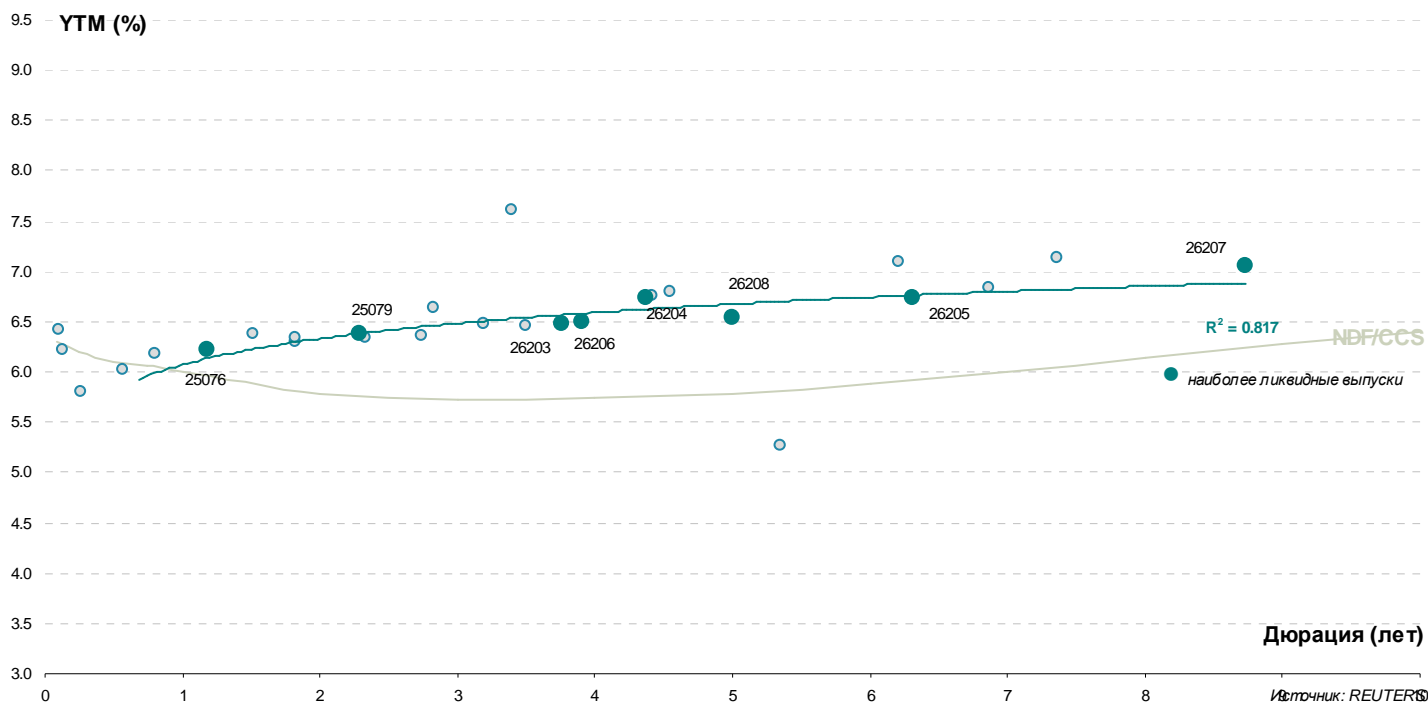
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.09	100.10	0.06	6	6 003	8.70	0.27		250	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.32					9.53	0.85	352	349	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.52	99.85					8.05	0.21		182	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	99.50	100.60	100.00	-0.50	2	32 001	11.44	0.64	554	536	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.00	105.00	99.00	-0.95	1	2	11.58	0.80	559	553	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14		100.60					11.04	1.19	490	508	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	12/03/13	10/06/14	96.00	100.15	100.01	0.11	1	1	9.67	1.39	347	376	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.90	100.25					8.76	0.32		258	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	98.80						9.46	0.81	347	342	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.15	100.35	100.20	0.03	5	5 055	10.01	2.09	366	424	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.50	100.40	100.46	0.40	12	502	7.43	1.22	128	148	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	99.00	99.25					9.28	0.52	345	317	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	99.25	100.00					9.06	0.69	313	299	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	86.00	100.50	100.28	-0.04	2	10	9.01	0.72	306	294	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.10	100.45	100.29	-0.11	1	4	9.00	0.72	305	293	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	99.30	98.79	0.24	2	54	9.54	0.88	352	351	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.20	99.20	0.15	10	505	9.02	0.88	299	299	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15		100.80	100.80	0.04	1	1	9.74	1.73	346	390	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.50	100.65	100.61	0.08	4	21 468	8.38	0.61	249	229	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.80	98.00	98.00	0.10	11	557	8.84	1.44	263	294	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		101.50					9.40	1.74	312	356	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.26	100.40	100.40		1	6	10.37	1.13	425	440	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.49	97.64	97.63	-0.02	10	1 092	10.54	1.20	440	458	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.40	96.55	96.51	-0.04	2	12	10.62	1.49	440	473	5 000
СКБ-Банк													
СКБ-Банк БО-4	05/12/12	05/06/13							0.12	0.46			2 000
СКБ-Банк БО-3	28/05/13	26/11/13	100.00	100.40	100.30		4	10 003	8.95	0.44		282	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.30	99.55					9.95	0.53	411	385	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.12	100.30					9.87	0.78	389	382	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.95	100.15	100.03		1	7 000	9.96	0.78	398	391	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14	99.86		99.90	-0.18	1	1	9.80	1.10	369	382	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	100.05	100.20	100.16	0.16	5	11 013	10.07	1.07	397	409	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	95.01	97.40	97.36	-0.10	8	35 901	10.48	1.30	431	455	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.90	100.00	99.97	0.06	4	6 711	9.21	0.79	323	316	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15		100.07	100.00	-0.07	2	4 000	9.97	1.28	381	403	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	18/12/12	17/06/14	99.95	100.10	100.00		3	14 002	8.39	1.42	219	248	2 000
ЦентрИнвест БО-5	18/12/12	17/06/14	99.95	100.10	100.00	-0.02	3	10 002	1.06	1.42			1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.00	100.15	100.10	0.10	2	10 000	9.52	0.33		334	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14							9.55	0.49		344	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	19/12/13	09/12/21							9.48	0.94	343	347	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	86.00	100.11	100.00		1	1	8.88	0.35		271	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	86.00						9.18	0.89	315	315	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22							9.71	2.44	330	396	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	99.50	99.80	99.80		2	1 000	11.01	0.81	502	496	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	90.00	100.30	100.00	-0.20	4	5	11.12	0.20		489	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	100.15	100.20					12.67	0.78	669	662	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	99.30	99.90	99.80	-0.10	1	1	10.46	0.12		419	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50	100.27		2	11 000	10.00	0.32		382	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	99.00	101.50					11.27	0.78	529	522	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	20/12/13	22/06/15	100.00	100.15					10.33	0.98	427	432	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 ПЕРВОБАНК	30/07/14	27/07/16	93.00	100.02	97.24	0.35	2	173 198	10.13	1.50	391	424	2 000
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.00					9.55	0.31		336	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13		100.05	100.00		2	11 000	9.91	0.35		374	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15		100.19					11.13	0.74	517	507	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.70	100.05					10.23	0.91	419	421	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.64	100.45					11.79	0.68	586	572	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14	86.00	100.13	100.10	0.01	3	10 002	9.09	0.14		282	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00	100.09	100.05		2	2	10.23	0.57	437	413	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15		100.40	100.40		4	16 045	10.31	0.62	441	422	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13							9.21	0.43		307	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14		100.00					9.97	0.53	414	387	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.50	101.00	100.50	-0.17	4	4 001	9.79	0.79	381	374	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.53	100.10					12.38	0.82	638	634	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.70	99.75					9.50	0.80	351	345	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15		100.39					9.60	0.81	361	355	5 000
УБРИР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.00	100.60					10.76	0.36		459	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.10	100.50	100.30	0.20	3	2 050	12.39	0.75	642	633	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14							0.05	1.43			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.02	102.00					11.79	0.63	589	571	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.61	99.80					11.40	0.83	540	536	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	100.01	100.05	100.00	-0.05	11	11 379	12.64	0.92	660	662	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	99.51	100.01	99.95	-0.05	2	7 000	11.76	0.17		551	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.99					9.46	0.19		322	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.88	99.95					11.52	0.30		533	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.35	100.45	100.45	-0.05	3	653	12.78	0.79	680	673	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13							12.19	0.95	614	618	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.94	100.10					12.54	1.24	639	659	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	526	575	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		102.02	104.30	104.10	-0.25	2	3 082	5.92	0.45			30 000
Москва 53	01/09/13		99.10						6.95	0.68	102	88	15 000
Москва 63	10/12/13		108.16	108.70					5.77	0.93			15 000
Москва 62	08/06/14		108.00	108.40	108.40		3	49 702	6.44	1.36	25	52	35 000
Москва 39	21/07/14		95.01	100.05					7.08	1.49	86	119	10 000
Москва 64	24/06/15								7.76	2.27	138	200	20 000
Москва 44	16/11/15		103.01						7.17	2.52	75	142	40 000
Москва 56	22/09/16		98.30	98.44	98.35	-0.73	2	20 000	7.65	3.32	113	192	20 000
Москва 49	14/06/17		91.00	97.99					7.67	3.92	109	193	25 000
Москва 48	11/06/22		92.92	92.99					7.77	7.01	97	176	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.60	100.89					8.29	0.48		217	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		98.51	99.85					8.23	1.27	207	229	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.30	99.77	99.77	0.50	3	250	8.46	1.65	220	260	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.75	102.93	103.19	0.62	1	50 000	8.45	2.15	209	268	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		102.65	103.00					7.02	0.38		86	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13								8.06	0.95	201	205	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		95.00	98.30	98.25	0.14	4	2 003	8.67	1.96	235	288	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.87	100.30	100.29	-0.01	8	107 915	7.15	0.30		96	3 000
Якутия 9	19/09/13								7.26	0.48		114	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.50	100.35					8.25	1.18	212	229	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ													
Краснодарский край 2	14/12/12									0.00			2 000
Краснодар 02	05/11/15		99.55	100.20					8.90	2.17	254	313	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.92	100.00					8.19	1.21	205	224	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ													
Красноярский край 5	29/11/16		90.00	101.30					8.50	1.39	230	259	9 000
КОМИ													

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 Респ 7	22/11/13		99.81	99.95					8.37	0.91	233	235	1 000
Коми Респ 9	18/10/14		98.58	99.50	98.58	-0.92	2	60 000	8.48	1.27	232	254	2 000
Коми Респ 8	03/12/15			97.40					8.06	2.13	170	229	1 000
Коми Респ 10	15/12/16		100.00		101.65	1.50	2	2 800	8.70	2.28	232	294	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05	24/11/16		103.55						8.41	2.42	201	266	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5	20/12/12								-1.77	0.00			3 000
Костромская область 6	17/11/16		100.60	100.79	100.70	-0.10	8	10 289	9.40	1.73	312	356	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02	14/12/16		103.11	103.50					9.50	2.20	313	373	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14	30/11/16		101.60	101.85	101.85	-0.05	3	3 114	8.85	1.62	260	299	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9	16/05/13		100.20	100.35	100.30	-0.05	6	26 700	7.43	0.40		128	3 000
Ярославская Обл 10	15/04/14		99.30	99.88					7.96	1.01	188	196	3 000
Ярославская Обл 11	21/08/15		100.50	100.95					8.80	2.08	245	303	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1	27/11/14		98.28	99.30	99.30	-0.20	7	5 201	8.90	1.44	269	300	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7	20/12/12								-10.51	0.00			2 000
ХМАО-Югра 8	19/12/13								7.57	0.93	153	155	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01	11/12/16		101.20	101.40	101.30	0.05	7	336 400	8.60	1.69	233	275	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6	12/06/14		103.20	104.20					9.18	1.08	308	320	3 000
Тверская Обл 5	26/12/13								7.83	0.93	178	181	4 000
Тверская Обл 7	15/12/15		98.30	98.55	98.55	0.05	1	4	9.44	2.38	304	368	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



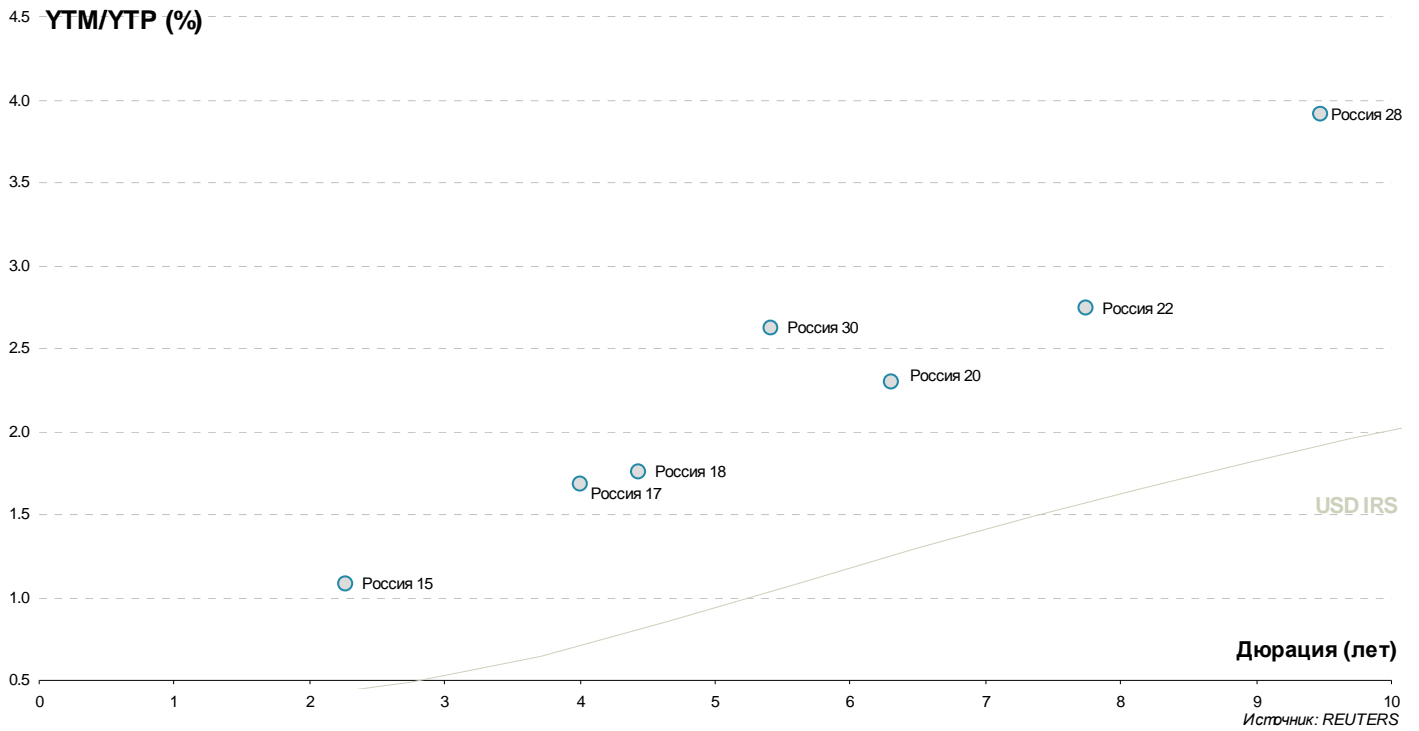
Результаты торгов евробондами

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		105.567	106.206	1.21	0.95	2.26	-0.08	80
RUSSIA'17 3.25%	USD	04/04/17		106.250	106.600	1.73	1.65	4.01	0.35	102
RUSSIA'18 11%	USD	24/07/18		147.789	150.105	1.93	1.59	4.44	-0.10	99
RUSSIA'30 7.5%	USD	31/03/30		127.822	127.961	2.63	2.61	5.42	0.27	120
RUSSIA'20 5%	USD	29/04/20		117.945	118.387	2.33	2.27	6.31	0.23	98
RUSSIA'22 4.5%	USD	04/04/22		114.097	114.553	2.77	2.72	7.74	0.10	110
RUSSIA'28 12.75%	USD	24/06/28		201.342	202.658	3.95	3.88	9.48	0.45	188
RUSSIA'42 5.625%	USD	04/04/42		123.444	124.083	4.22	4.19	15.96	0.02	164
ГОСКОМПАНИИ										
Газпром										
GAZPR'13 4.505%	USD	22/07/13		101.007	101.023	1.41	1.36	0.32	-0.02	111
GAZST'13 5.625%	USD	22/07/13		101.000	102.000	2.47	-0.57	0.32	-0.16	218
GAZPR'13 7.343%	USD	11/04/13		101.700	101.715	1.57	1.52	0.30	-0.10	126
GAZPR'13 7.51%	USD	31/07/13		103.497	103.997	1.62	0.81	0.59		131
GAZPR'14 10.5%	USD	25/03/14		109.700	110.380	2.61	2.08	1.17		229
GAZPR'14 10.5%	USD	08/03/14		109.250	109.910	2.68	2.15	1.15		236
GAZPR'14 8.125%	USD	31/07/14		109.255	109.338	2.20	2.15	1.50		185
GAZPR'15 5.092%	USD	29/11/15		107.020	107.270	2.59	2.50	2.76	0.02	211
GAZPR'16 4.95%	USD	23/05/16		107.099	108.099	2.76	2.46	3.18	-0.03	222
GAZPR'16 6.212%	USD	22/11/16		112.200	113.200	2.89	2.64	3.54	0.20	227
GAZPR'18 8.146%	USD	11/04/18		123.326	124.326	3.31	3.13	4.45	0.20	245
GAZPR'19 9.25%	USD	23/04/19		131.600	132.600	3.62	3.47	5.08	0.10	258
GAZPR'20 7.201%	USD	01/02/20		112.405	112.566	2.92	2.87	2.84	0.31	209
GAZPR'22 6.51%	USD	07/03/22		119.200	119.575	4.00	3.95	7.16	0.33	241
GAZPR'22 4.95%	USD	19/07/22		107.250	107.750	4.03	3.97	7.66	0.25	237
GAZPR'34 8.625%	USD	28/04/34		143.250	144.000	5.24	5.19	11.76	0.75	292
GAZPR'37 7.288%	USD	16/08/37		129.500	130.500	5.16	5.10	13.03	0.50	273
Газпром нефть										
GPN CAPITAL '22 4.375%	USD	19/09/22		101.942	102.345	4.13	4.08	7.97	0.19	245
Транснефть										
TRANSN'13 7.7%	USD	07/08/13		103.749	105.749				-0.25	
TRANSN'14 5.67%	USD	05/03/14		104.650	105.150	1.73	1.32	1.16	-0.13	140
TRANSN'18 8.7%	USD	07/08/18		128.612	128.910	3.11	3.06	4.59	0.11	218
РЖД										
RZD'17 5.739%	USD	03/04/17		111.990	112.990	2.75	2.51	3.84	0.49	206
RZD'22 5.7%	USD	05/04/22		113.917	114.336	3.90	3.85	7.40	0.54	231
Совкомфлот										
SOVKOM'17 5.375%	USD	27/10/17		101.546	101.976	5.01	4.91	4.30	0.53	427
ГОСБАНКИ										
ВТБ										
VTB'15 6.465%	USD	04/03/15		107.027	107.137	3.12	3.07	2.05	-0.22	274
VTB'17 6%	USD	12/04/17		107.429	107.633	4.10	4.05	3.83	0.18	344
VTB'18 6.315%	USD	22/02/18		108.952	109.952	4.36	4.15	4.44	0.33	353
VTB'18 6.875%	USD	29/05/18		111.549	112.549	4.46	4.26	4.66	0.67	358
VTB'20 6.551%	USD	13/10/20		110.366	111.016	4.93	4.84	6.25	-0.01	361
VTB'22 6.95%	USD	17/10/22		106.333	106.714	6.08	6.03	7.28	-0.54	451
VTB'35 6.25%	USD	30/06/35		107.155	107.905	5.68	5.63	12.39	0.33	331
VTB' 9.5%	USD			107.310	107.919	8.40	8.31	6.75	0.39	697
Банк Москвы										
BANK OF MOS'13 7.335%	USD	13/05/13		101.974	102.013	2.16	2.06	0.39		185
BANK OF MOS'15 6.699%	USD	11/03/15		106.750	107.125	3.50	3.33	2.06	0.46	313
BANK OF MOS'15 5.967%	USD	25/11/15		105.750	106.125	3.86	3.73	2.72	1.75	342
BANK OF MOS'17 6.02%	USD	10/05/17		101.230	102.230	5.70	5.44	3.89		505
ВЭБ										
VEB '17 5.375%	USD	13/02/17		109.762	109.967	2.86	2.81	3.72	0.89	220
VEB'17 5.45%	USD	22/11/17		111.050	111.800	3.01	2.86	4.39	0.05	220
VEB'20 6.902%	USD	09/07/20		121.140	121.507	3.67	3.62	6.01	0.76	237
VEB'22 6.025%	USD	05/07/22		115.125	115.750	4.09	4.02	7.38	0.13	245
VEB'25 6.8%	USD	22/11/25		121.500	122.375	4.58	4.50	9.18	0.25	257
Газпромбанк										
GAZPROMB'13 7.933%	USD	28/06/13		103.003	103.029	2.00	1.95	0.49		170
GAZPROMB'14 6.25%	USD	15/12/14		105.900	105.998	3.15	3.10	1.89	-0.01	278
GAZPROMB'15 6.5%	USD	23/09/15		108.022	108.159	3.41	3.36	2.53	0.02	298
GAZPROMB'16 7.35%	USD	08/05/16		111.636	111.805	3.61	3.56	3.01	0.03	307
GAZPROMB'17 5.625%	USD	17/05/17		106.303	106.510	4.05	4.00	3.95	0.30	337
GAZPROMB'19 7.25%	USD	03/05/19		108.342	108.898	5.67	5.57	5.21	0.84	465
GPB EURO' 7.875%	USD			103.573	104.258	7.06	6.90	4.43	1.24	629
РСХБ										
ROSSELKH'13 7.175%	USD	16/05/13		102.155	102.205	1.66	1.54	0.39	0.09	135

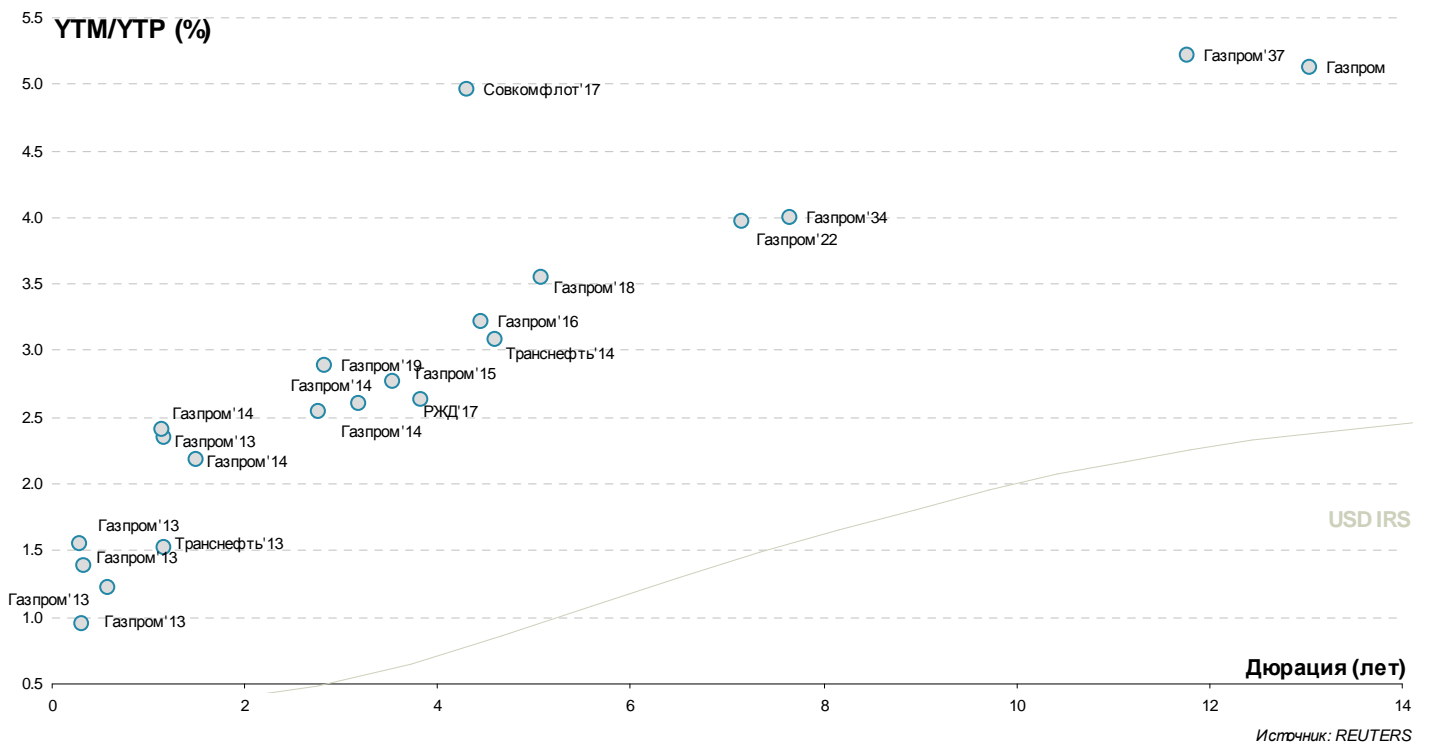
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.191	105.245	2.12	2.07	1.01	-0.19	180
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		109.492	109.569	2.36	2.31	1.40	0.39	202
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.250	110.750	3.75	3.63	3.91	0.22	307
ROSSELKH'17 5.298%	USD	27/12/17		107.125	107.625	3.73	3.62	4.38	0.13	289
ROSSELKH'18 7.75%	USD	29/05/18		118.890	119.160	3.86	3.81	4.60	0.41	298
ROSSELKH'21 6%	USD	03/06/21		104.044	104.205	4.71	4.66	3.16	0.29	421
Сбербанк										
SBER'13 6.48%	USD	15/05/13		101.750	102.250	1.96	0.71	0.39	-0.50	165
SBER'13 6.468%	USD	02/07/13		102.500	103.000	1.64	0.70	0.51		133
SBER'15 5.499%	USD	07/07/15		108.504	108.633	2.04	1.99	2.35	-0.15	161
SBER'17 5.4%	USD	24/03/17		109.059	109.268	3.11	3.06	3.83	0.09	244
Sber'17 4.95%	USD	07/02/17		107.500	108.000	3.00	2.88	3.73	0.25	234
SBER'19 5.18%	USD	28/06/19		109.268	109.572	3.57	3.52	5.53	0.39	245
SBER'21 5.717%	USD	16/06/21		110.992	111.992	4.17	4.03	6.93	-0.13	270
Sber'22 6.125%	USD	07/02/22		114.080	114.580	4.25	4.19	7.13	0.08	270
SBER'22 5.125%	USD	29/10/22		101.664	102.056	4.91	4.86	7.82	0.16	326
ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ										
Евраз										
EVRAZ'13 8.875%	USD	24/04/13		102.020	102.520	2.72	1.26	0.33	0.06	242
EVRAZ'15 8.25%	USD	10/11/15		109.999	110.999	4.50	4.15	2.61	-0.16	407
EVRAZ'17 7.4%	USD	24/04/17		104.780	105.495	6.12	5.94	3.76	0.34	551
EVRAZ'18 9.5%	USD	24/04/18		113.325	114.325	6.50	6.29	4.32	0.58	570
EVRAZ'18 6.75%	USD	27/04/18		102.351	103.351	6.22	6.01	4.54	0.38	542
Металлоинвест										
METALLOINV'16 6.5%	USD	21/07/16		104.875	105.375	4.99	4.84	3.17		448
НЛМК										
NLMK '19 4.95%	USD	26/09/19		101.095	101.384	4.76	4.71	5.76	0.59	361
Альянс Ойл										
Alliance '15 9.875%	USD	11/03/15		109.301	109.520	5.36	5.26	2.00	0.43	502
Агроса										
ALROSA'14 8.875%	USD	17/11/14		110.500	110.967	3.15	2.91	1.79		280
ALROSA'20 7.75%	USD	03/11/20		115.750	116.750	5.27	5.13	6.13	0.38	397
Вымпелком										
VIMPELC'13 8.375%	USD	30/04/13		102.250	102.750	1.88	0.50	0.35	0.13	156
VIMPELC'14 4.362%	USD	29/06/14		99.700	102.300	4.57	2.82	1.47		
VIP FIN'16 6.493%	USD	02/02/16		107.417	107.417	3.93	3.93	2.81	0.38	346
VIMPELC'16 8.25%	USD	23/05/16		112.488	113.488	4.28	3.98	3.05	0.88	378
VIMPELC'17 6.255%	USD	01/03/17		105.875	106.875	4.69	4.44	3.70		407
VIMPELC'18 9.125%	USD	30/04/18		119.700	120.700	4.89	4.70	4.40	0.70	406
VIP FIN'21 7.748%	USD	02/02/21		112.750	113.750	5.76	5.61	6.14	0.25	443
VIMPELC'22 7.504%	USD	01/03/22		113.625	114.125	5.59	5.52	6.83	1.63	409
Лукойл										
LUKOIL'14 6.375%	USD	05/11/14		107.850	108.350	2.06	1.80	1.78	0.01	168
LUKOIL'17 6.356%	USD	07/06/17		114.379	115.379	2.89	2.67	3.98	-0.03	217
LUKOIL'19 7.25%	USD	05/11/19		121.548	122.548	3.67	3.52	5.63	-0.06	247
LUKOIL'20 6.125%	USD	09/11/20		115.500	116.125	3.83	3.74	6.45	0.50	246
LUKOIL'22 6.656%	USD	07/06/22		121.017	122.017	3.97	3.85	7.39	-0.13	235
МТС										
MTS'20 8.625%	USD	22/06/20		125.625	126.375	4.55	4.45	5.89	0.59	330
НОВАТЭК										
NOVATEK'16 5.326%	USD	03/02/16		106.005	106.157	3.28	3.23	2.86	-0.12	279
NOVATEK'21 6.604%	USD	03/02/21		117.250	118.000	4.08	3.98	6.42	1.25	269
Северсталь										
SEVERSTAL'13 9.75%	USD	29/07/13		104.938	105.188	1.41	1.01	0.58	0.39	111
SEVERSTAL'14 9.25%	USD	19/04/14		108.833	109.833	2.40	1.68	1.26	0.08	207
SEVERSTAL'16 6.25%	USD	26/07/16		106.738	107.738	4.21	3.92	3.21	0.23	368
SEVERSTAL'17 6.7%	USD	25/10/17		108.966	109.419	4.61	4.51	4.20	0.19	386
Sev Stal '22 5.9%	USD	17/10/22		100.939	101.501	5.77	5.70	7.52	0.55	417
ТМК										
TMK'18 7.75%	USD	27/01/18		104.581	105.020	6.67	6.57	4.20	0.61	594
Распадская										
RASPAD'17 7.75%	USD	27/04/17		104.710	105.095	6.48	6.38	3.74	0.06	589
ТНК-ВР										
TNK '13 7.5%	USD	13/03/13		101.437	104.437					
TNK-BP'15 6.25%	USD	02/02/15		107.558	107.665	2.54	2.49	1.97	0.01	215
TNK-BP'16 7.5%	USD	18/07/16		115.602	116.602	2.87	2.60	3.14	-0.19	232
TNK-BP'17 6.625%	USD	20/03/17		114.046	114.260	3.07	3.02	3.75	0.05	241
TNK-BP'18 7.875%	USD	13/03/18		121.657	122.657	3.32	3.13	4.40	0.67	247
TNK-BP'20 7.25%	USD	02/02/20		121.522	122.522	3.77	3.63	5.70	0.27	253
ЧАСТНЫЕ БАНКИ										
Альфа-Банк										
ALFA BANK'13 9.25%	USD	24/06/13		103.401	103.452	2.37	2.27	0.50		207
ALFA BANK'15 8%	USD	18/03/15		108.246	109.246	4.09	3.65	2.06	-0.01	373
ALFA BANK'17 6.3%	USD	22/02/17		101.374	101.742	5.92	5.82	3.65	0.07	533
ALFA BANK'17 7.875%	USD	25/09/17		111.369	112.369	5.15	4.92	4.03	-0.01	443

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

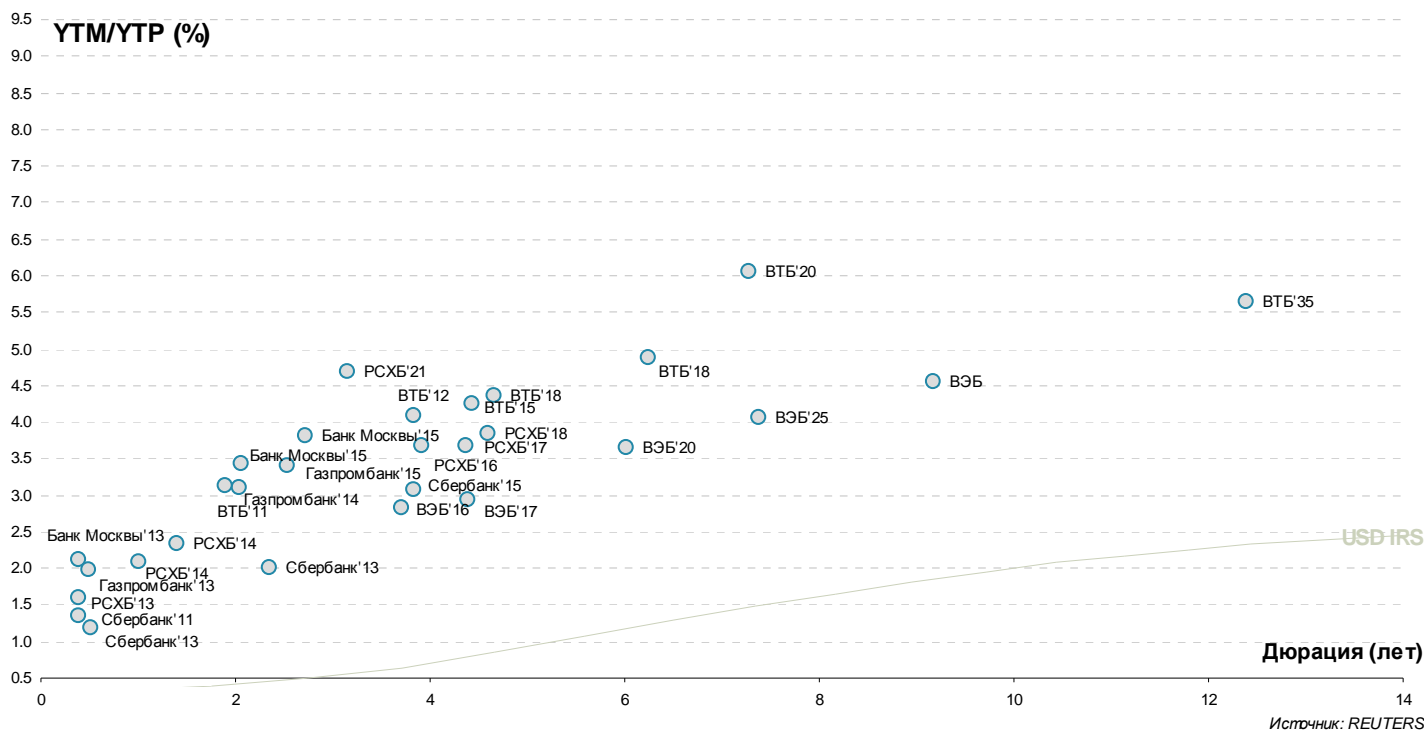
Россия



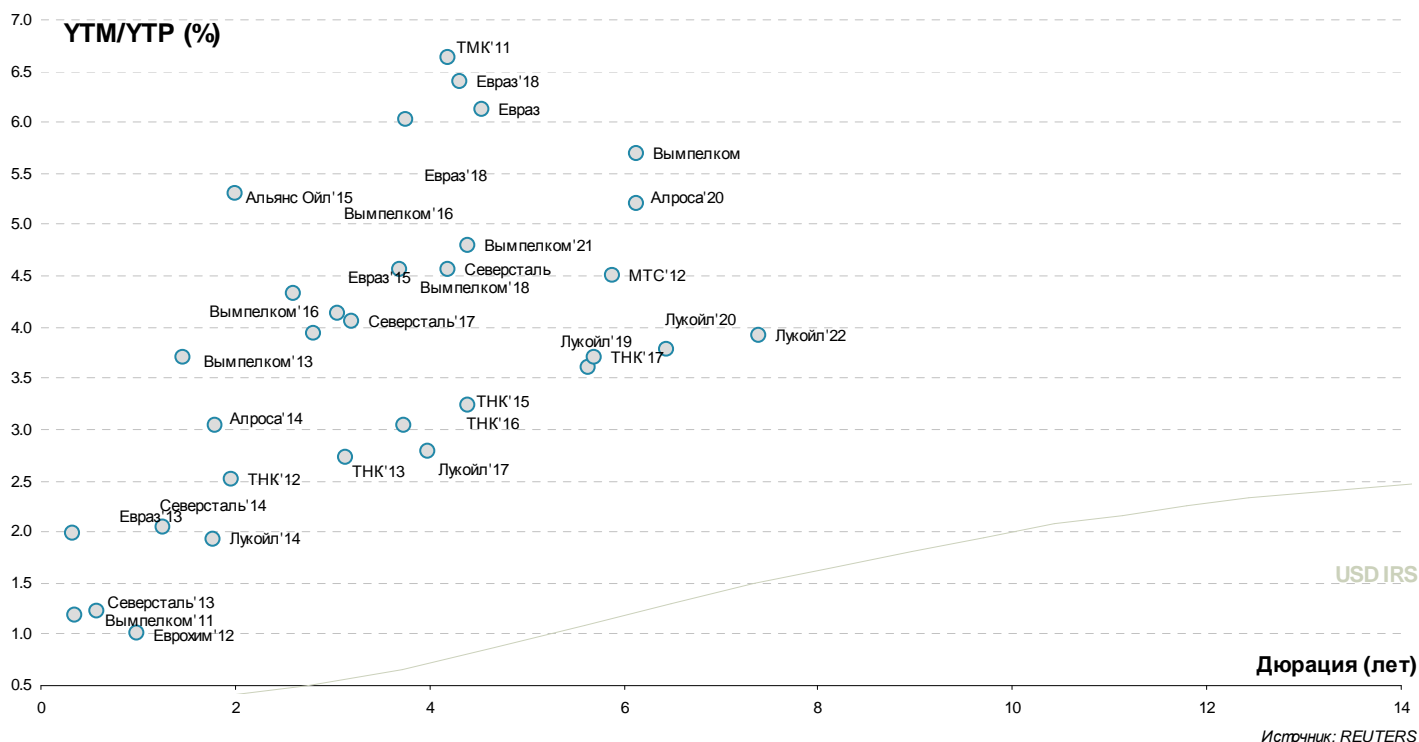
Госкомпании



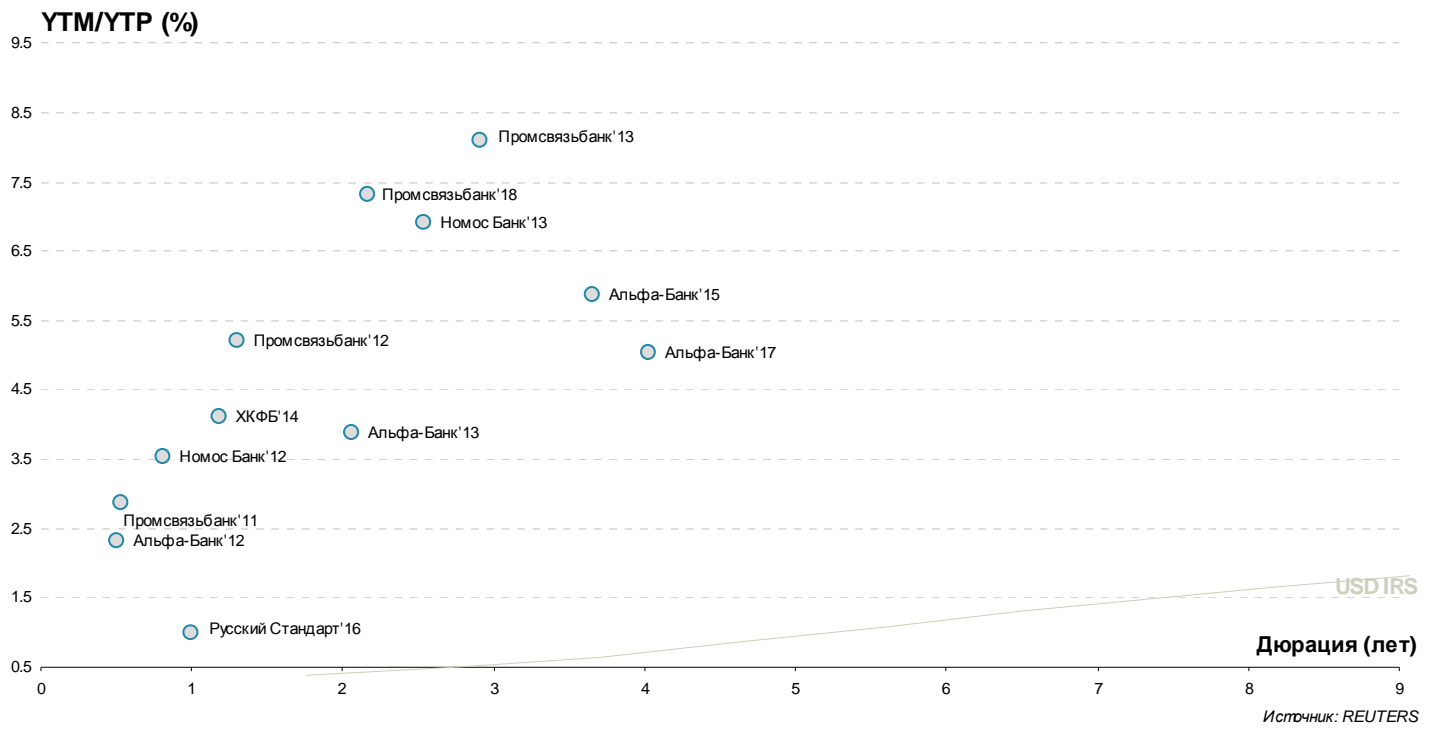
Госбанки



Частные компании



Частные банки



Инвестиционный Департамент

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

Начальник Департамента
Зам.начальника Департамента

Кирилл Копелович
 Константин Поспелов

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

Управление продаж

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

Юлия Шабанова
 Максим Симагин
 Александр Валканов
 Юлия Паршина

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

Аналитическое управление

Акции
 Облигации

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

Макроэкономика
 Макроэкономика/кредитный анализ
 Кредитный анализ
 Количественный анализ
 Акции

Владимир Евстифеев
 Кирилл Сычев
 Евгений Чердаков
 Дмитрий Чепрагин
 Евгения Лобачева

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

Управление рынков долгового капитала

Рублевые облигации

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

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

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

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

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

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