

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Основные события /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Бюджетные переговоры вновь заходят в тупик, нервозность растет

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Платежи по НДС не ухудшили условия рынка
- Рубль продолжает отыгрывать прежние потери

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды ускорили рост, «тридцатка» на новом максимуме
- Активность на рублевом рынке снижается

Первичный рынок /стр. 6/

Приложения

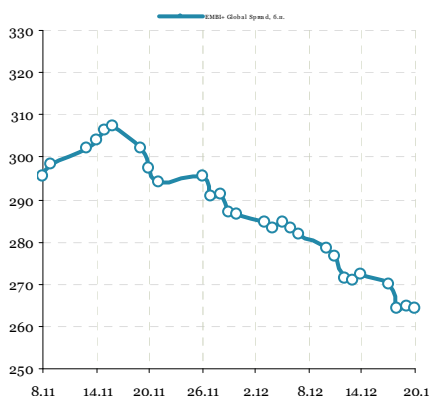
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 7/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 18/
- Результаты торгов евробондами /стр. 19/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 22/

Динамика ключевых показателей

	знач.	Δ за день	за 6 месяцев:		
			MIN.	MAX.	
Внешний рынок долга					
UST-10 yield	1.80	▼	0.00	1.39	1.87
UST 10-2Y sprd	153	▼	0	117	162
EMBI+ Glob.	264	▼	0	264	401
EMBI+ Rus sprd	124	▼	-1	131	291
Russia 30 yield	2.54	▼	-0.08	2.54	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	6.86	▲	0.01	6.35	6.91
Корсчета в ЦБ	911.2	▲	105.5	446	1011
Депоз. в ЦБ	75.7	▼	-11.6	65	238
NDF RU 3m	6.3	▲	0.1	6	7
Валютный рынок					
USD/RUB	30.708	▼	-0.056	30.46	33.26
EUR/RUB	40.617	▼	-0.143	38.97	41.73
EUR/USD	1.324	▲	0.002	1.21	1.32
Корзина ЦБ	35.153	▼	-0.064	34.77	37.02
DXU Индекс	79.261	▼	-0.008	78.85	84.01
Фондовые индексы					
RTS	1528.9	▼	-1.2%	1262	1589
Dow Jones	13311.7	▲	0.45%	12496	13610
DAX	7672.1	▲	0.05%	6132	7672
Nikkei 225	10039	▼	-0.99%	8366	10160
Shanghai Comp.	2168.4	▼	-0.69%	1960	2319
Сырьевые рынки					
Нефть Urals	109.6	▲	0.09%	88	117
Нефть Brent	110.2	▼	-0.37%	89	117
Золото	1647.7	▼	-0.05%	1553	1790
CRB Index	294.5	▼	-0.38%	267	321

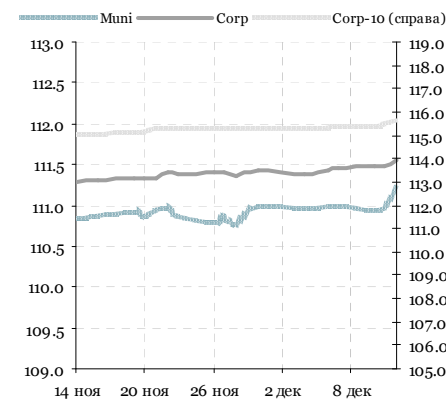
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

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

ОАО «ИнтерСофт» 27 декабря планирует разместить по открытой подписке выпуск пятнадцатилетних облигаций 2-й серии объемом 10 млрд руб. Размещение будет осуществляться путем сбора адресных заявок со стороны покупателей на приобретение облигаций по цене размещения. Ставка 1-го купона установлена в размере 2% годовых. /Интерфакс/

ОСАО «РЕСО-Гарантия» приняло решение разместить два выпуска десятилетних облигации 3-й и 4-й серий по 3 млрд руб. каждый. /Интерфакс/

Основные события: вне рынка / на рынке

Вчера: 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 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.)
- **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.)

Сегодня: 21.12.2012 – пятница

Статистика США: Personal Income, Personal spending, 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, ЕСР) (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.)

24.12.2012 – понедельник

- **Выплата купона:** МТС, 2020 (LPN) (8.625%, 32.3 млн долл.), НКНХ, 2015 (LPN) (8.5%, 5.9 млн долл.), Московский Кредитный банк, БО-05 (9.2%, 230.6 млн руб.), ВТБ, 2013, CNY (LPN) (2.95%, 14.7 млн китайских юаней), Кокс, 2016 (LPN) (7.75%, 13.5 млн долл.), РЖД, 15 (10.02%, 749.4 млн руб.), Администрация города Томска, 34003 (10.13%, 14.1 млн руб.), Национальный капитал, БО-03 (8.2%, 20.4 млн руб.), Национальный капитал, БО-04 (8.2%, 20.4 млн руб.), Кузбассэнерго-Финанс, 01 (8.05%, 401.4 руб.), Россия, 2028 (12.75%, 2.7 млрд руб.), Москва, 44 (7%, 702 млн руб.), Московская область, 2012 (CLN) (9%, 315 млн руб.), Альфа-Банк, 2013 (LPN) (9.25%, 18.5 млн руб.)
- **Погашение:** Московская область, 2012 (CLN) (7 млрд руб.), Транснефть, БО-01 (17 млрд руб.), Транснефть, БО-02 (17 млрд руб.)
- **Оферта:** Банк Петрокоммерц, 05 (5 млрд руб.), Риэл-лизинг Инвест, 01 (10 млрд руб.), Связь-Банк, 03 (5 млрд руб.)

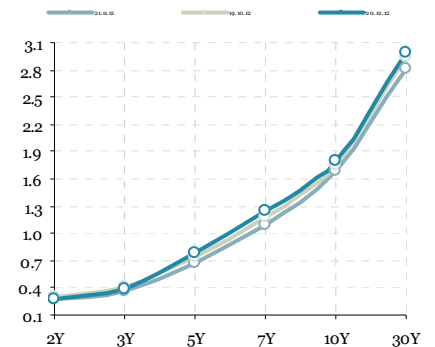
Внешний рынок долга

Бюджетные переговоры вновь заходят в тупик, нервозность растет

Глобальные рынки продолжают пристально следить за ключевой темой второй половины декабря – переговорами Администрации президента США с представителями республиканцев в нижней палате Парламента. Вчера наиболее важной была тема противостояния Б.Обамы намерению Д. Бейнера провести через Палату Представителей «План Б» подразумевающий меньшее налоговое бремя для состоятельных американцев и большее сокращение расходов бюджета в части социальных программ. Под угрозой наложения вето спикер от республиканцев отказался от этой идеи, что рынки расценили негативно. Учитывая всю нервозность ситуации, инвесторы, видимо, уже согласны на любой исход по «бюджетному обрыву», который хоть как-то поможет экономике в следующем году. Сейчас же переговорный процесс может вновь зайти в тупик: Бейнер не готов идти на дальнейшие уступки, хотя, по законам жанра, настала его очередь на сближение позиций. Кроме того, с отменой голосования, авторитет Бейнера в глазах республиканцев получил существенный удар, поэтому мы не исключаем смены переговорщика со стороны консерваторов.

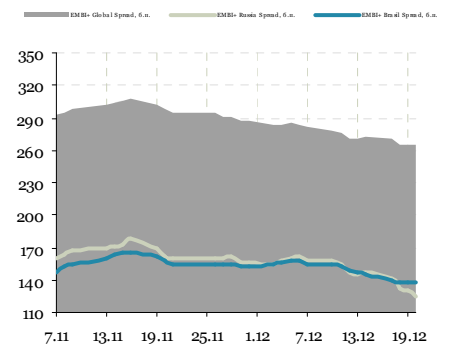
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasures



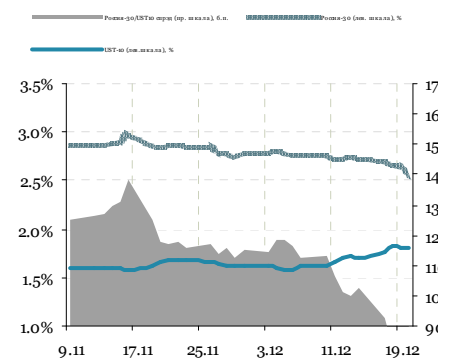
Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



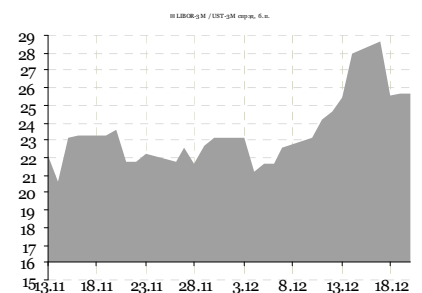
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд LIBOR-3M / UST-3M



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Платежи по НДС не ухудшили условия рынка

Условия локального денежно-кредитного рынка остаются напряженными на фоне существенных оттоков ликвидности, сопряженных с возвратом банками задолженности в бюджет и уплатой налогов. Как итог, уровень краткосрочных процентных ставок держится вблизи среднесрочных максимумов. На рынке МБК кредиты овернайт обходились в среднем под 6.6% годовых, междилерское репо с облигациями на 1 день – под 6.4% годовых. На аукционах прямого репо с ЦБ РФ банки привлекли весь заявленный объем в 587 млрд руб. на 1 день против 543 млрд руб. во вторник. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ увеличилась на 94.0 млрд руб. до 986.9 млрд руб.

До конца текущей недели банка предстоит вернуть Казначейству и Фонду ЖКХ около 190 млрд руб. На следующей неделе пройдут платежи по НДС, акцизам и налогу на прибыль, которые в сумме могут потребовать еще порядка 380-400 млрд руб. Учитывая грядущие оттоки ликвидности и задолженность банков перед ЦБ по операциям репо на уровне 1.95 трлн руб., российский денежный рынок останется в сложных условиях до конца 2012 г.

Рубль продолжает отыгрывать прежние потери

Валютные торги четверга завершились позитивно для рубля. Курс бивалютной корзины по итогам дня снизился на 10 коп. до отметки 36.16 руб. Несмотря на сохранение негативных настроений на внешних площадках, рубль получил поддержку от растущих котировок нефти. В частности, баррель Brent вчера торговался выше уровня в 110 долл. Судя по характеру торгов, рубль слабо реагирует даже на ключевые для него факторы, поэтому до конца года мы ожидаем сохранение котировок бивалютной корзины в диапазоне 35.00-35.50 руб.

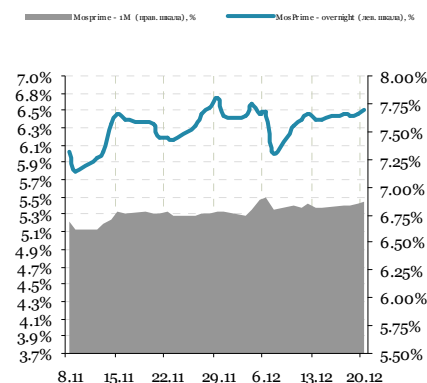
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

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.	543
	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	587
	Уплата налогов	НДС (~180 млрд руб.)	
Пятница	Возврат Казначейству	151 млрд руб.	

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

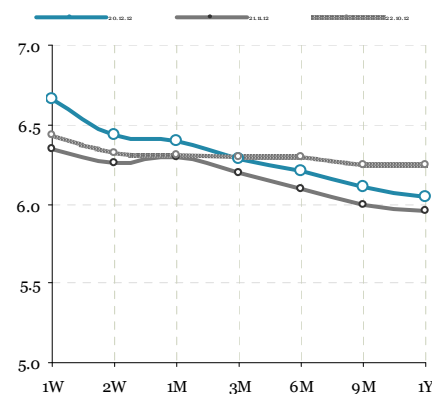
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды ускорили рост, «тридцатка» на новом максимуме

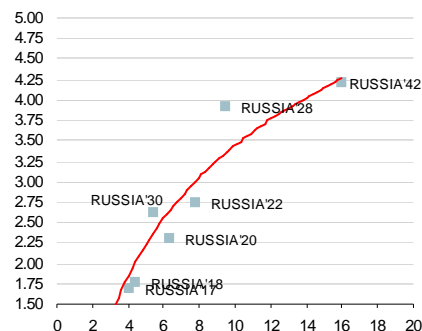
Российский сегмент в четверг ускорил рост на фоне нейтральной динамики других ЕМ. Цены суверенных бумаг прибавили до 50 бп, «тридцатка» обновила максимумы, завершив день выше отметки 128%. Корпоративный сектор в течение дня двигался «в плюс», завершив день со средним результатом +20 бп. Дальние выпуски Газпрома прибавили в ценах 50-75 бп, в секторе частных компаний в числе лидеров остались выпуски Вымпелкома, со средним результатом на дальнем участке кривой, превосходящем фигуру, планку +50 бп удалось преодолеть дальним бумагам Евраза, а также суборду NOMOS'19.

Активность на рублевом рынке снижается

На рублевом рынке активность в секторе ОФЗ снизилась и сместилась ближе к началу кривой, биды в дальних бумагах опустились в среднем на 20 бп. Корпоративный сектор в целом сохранил занятые ценовые уровни. Активность была сосредоточена в выпусках РЖД 23, бумагах Роснефти, НЛМК БО7, ВЭБ 18 и Газпромбанк ОБ. Выше по уровню кредитного риска спрос сохранился в выпуске ЛСР 02, в банковском секторе внимание инвесторов было сосредоточено вокруг выпусков НОМОС 11, Промсвязь БО7, МКБ БО3.

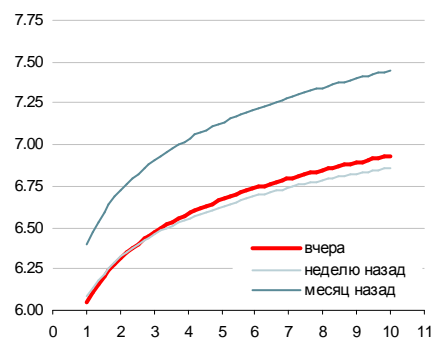
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



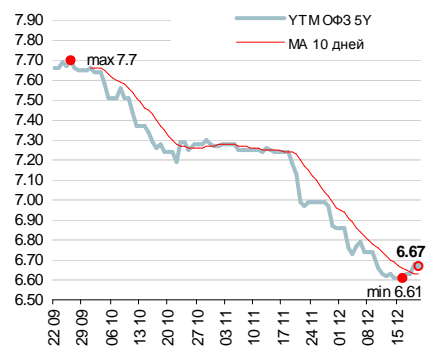
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



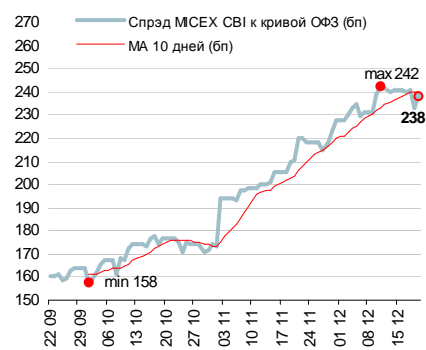
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спрэд индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



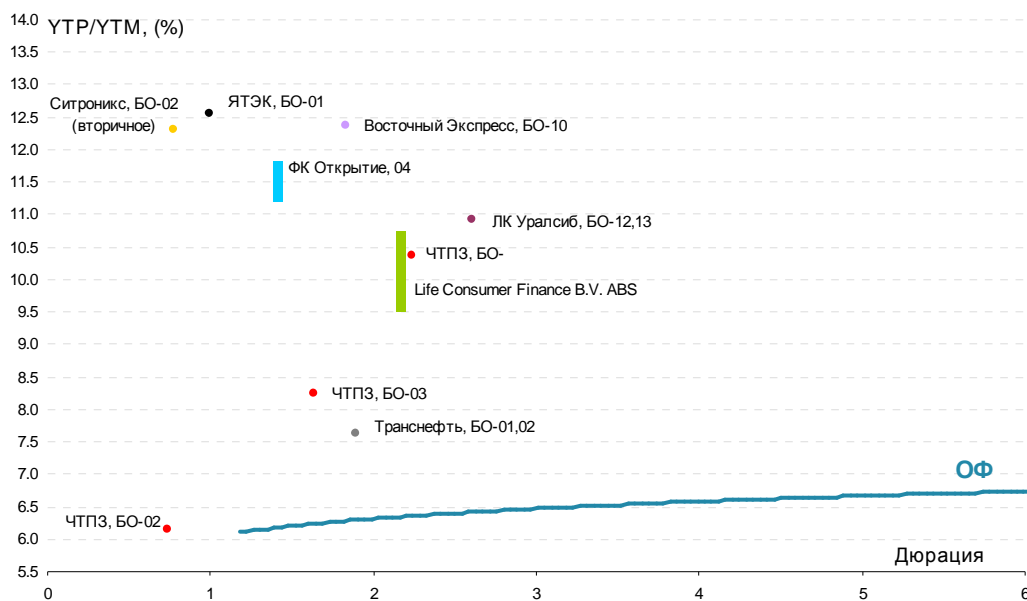
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

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
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	- / - / ВВ-	да	2 000	10.92	19.12.2012	21.12.2012	нет / 2.61 г.	нет / 3 г.
ЛК Уралсиб, БО-13	- / - / ВВ-	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 / Baa1 / -	да	17 000	7.64	18.12.2012	24.12.2012	нет / 1.89 г.	2 г. / 3 г.
Транснефть, БО-02	BBB / Baa1 / -	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	19.12.2012	25.12.2012	нет / 1.83 г.	2 г. / 3 г.
ФК Открытие, 04	NR	нет	5 000	11.19-11.73	24.12.2012	26.12.2012	нет / 1.40 г.	1.5 г. / 5 лет
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
Абсолют Банк, БО-01	- / Baa3 / ВВ+	да	5 000	н/д / 100%	10.78	10.78	20.12.2012	нет / 1.42 г.
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	- / Baa2 / -	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.
Правоурмийское, 01	NR	нет	3 000	н/д / 100%	9.20	9.20	11.12.2012	нет / 2.68 г.
ДельтаКредит, 09-ИП	- / Baa1 / -	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	BBB- / Baa3 / ВВВ-	да	10 000	2.0 / 100%	8.84-8.99	8.58	07.12.2012	нет / 2.71 г.
Газпром Нефть, 12	BBB- / Baa3 / -	да	10 000	3.7 / 100%	8.78-8.99	8.68	05.12.2012	нет / 4.17 г.
АИЖК, 24	BBB / Baa1 / -	да	6 000	2.8 / 100%	8.69-8.90	8.43	05.12.2012	да / 2.64 г.
Глобэкс, БО-07	ВВ / - / ВВ	да	5 000	1.0 / 100%	9.15-9.36	9.20	04.12.2012	нет / 1 г.
ММК, 18	- / Baa3 / ВВ+	да	5 000	2.1 / 100%	9.10-9.36	8.89	04.12.2012	нет / 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	100.08	100.09	100.08	0.01	27	72 539	6.30	0.09			150 000
ОФЗ 25078		06/02/13	100.04	100.07	100.07	0.00	29	313 742	6.18	0.13			100 000
ОФЗ 25065		27/03/13	101.50	101.66	101.58	-0.09	1	37	6.09	0.26			46 000
ОФЗ 26200		17/07/13	100.09	100.18	100.18	0.07	1	10 000	5.90	0.56	8		50 000
ОФЗ 26201		16/10/13	100.38	100.50	100.50	0.10	3	208 537	6.05	0.80	9		47 000
ОФЗ 25076		13/03/14	100.81	101.15	101.12		14	2 181 015	6.22	1.18	11	21	155 000
ОФЗ 25068		20/08/14	108.91	109.16					6.38	1.51	17	44	45 000
ОФЗ 26202		17/12/14	108.51	109.45					6.28	1.82	0	40	40 000
ОФЗ 25071		26/11/14	102.95	103.80					6.33	1.82	5	45	80 000
ОФЗ 25079		03/06/15	101.55	101.65	101.65	0.05	11	85 644	6.36	2.29		52	150 000
ОФЗ 25075		15/07/15	101.37	101.49	101.40	-0.09	7	26 003	6.38	2.33	1	55	150 000
ОФЗ 25077		20/01/16	102.90	103.10	102.90	-0.10	4	15 000	6.40	2.74		59	150 000
ОФЗ 46017		03/08/16	99.50	99.75					6.63	2.82	18	82	80 000
ОФЗ 26203		03/08/16	101.70	101.80	101.70	0.05	5	152 772	6.47	3.19		67	150 000
ОФЗ 48001		31/10/18	90.00	98.49					6.45	3.49		64	24 000
ОФЗ 46019		20/03/19							7.62	3.39	110	181	26 000
ОФЗ 25080		19/04/17	103.64	103.80	103.75	-0.05	1	50 000	6.49	3.76		67	150 000
ОФЗ 26206		14/06/17	103.61	103.82	103.75	-0.14	7	80 008	6.53	3.91		71	150 000
ОФЗ 26204		15/03/18	104.79	104.94	104.70	0.85	3	1 601	6.53	4.37		70	150 000
ОФЗ 46021		08/08/18	94.45	94.90					6.75	4.42	13	91	107 000
ОФЗ 46014		29/08/18	101.30	101.50	101.40		2	83 000	6.80	4.54	17	96	62 000
ОФЗ 26208		27/02/19	105.19	105.40	105.35	-0.05	2	979	6.54	5.00		68	150 000
ОФЗ 46005		09/01/19		70.00					5.26	5.36			27 000
ОФЗ 26210		11/12/19	101.50	101.70	101.52		5	10 788	6.63	5.68		70	150 000
ОФЗ 46018		24/11/21	98.00	98.89	98.89	0.49	3	10 002	7.01	6.21	26	101	133 000
ОФЗ 26205		14/04/21	105.89	106.05	105.95	-0.20	6	86 011	6.77	6.31	1	76	150 000
ОФЗ 26209		20/07/22	105.79	105.92	105.90	-0.19	4	46 240	6.87	6.87	8	80	150 000
ОФЗ 46022		19/07/23	91.00	92.82					7.13	7.32	32	100	45 000
ОФЗ 26207		03/02/27	110.60	110.90	110.60	-0.26	12	32 439	7.08	8.72	20	77	150 000
ОФЗ 46020		06/02/36	94.00	94.50	94.50		3	14 285	7.54	11.13	57	91	135 000
ОФЗ 46012		05/09/29	77.00	100.00	100.00	10.00	1	1	5.57	11.27			40 000

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

НорНикель ВОЗ		30/07/13	99.50	99.95	99.95	-0.05	11	5 800	7.19	0.59	135	101	15 000
---------------	--	----------	-------	-------	-------	-------	----	-------	------	------	-----	-----	--------

НЛМК

НЛМК ВО6		05/03/13	100.07	100.30					7.30	0.21		96	10 000
НЛМК ВО2	19/06/13	17/12/14	100.50	100.70	100.59	0.01	1	1	7.66	0.50		145	5 000
НЛМК ВО3	19/06/13	17/12/14	100.50	100.70	100.58	0.10	1	7 100	7.68	0.50		147	5 000
НЛМК ВО4	08/09/14	07/09/15	100.00	100.50	100.30	0.15	1	30 000	8.21	1.60	198	228	5 000
НЛМК ВО7		11/11/14		101.50	101.50		8	73 301	8.24	1.77	197	235	10 000
НЛМК 7/d	16/03/15	05/09/22	100.40	100.75					8.36	2.04	204	251	5 000

ММК

ММК ВО5		04/04/13	99.88	100.10					7.37	0.29		108	8 000
ММК ВО8	15/08/13	12/02/15							8.36	0.63	249	219	5 000
ММК ВО4		27/02/14	99.05	99.50	99.46	-0.20	2	22	8.29	1.13	219	228	5 000
ММК ВО6		10/07/14							9.01	1.45	282	306	5 000
ММК ВО7		22/07/14	96.00						8.88	1.48	268	293	5 000

Севсталь

Севсталь ВО2		15/02/13	100.41	100.44	100.44	0.06	9	52 372	6.87	0.16		49	10 000
Севсталь ВО4		15/02/13	99.95	100.40					7.60	0.16		122	5 000

Алроса

Алроса 21	25/06/13	18/06/15	100.00	100.25	100.20		2	11 573	8.08	0.51	229	187	8 000
Алроса 22	28/06/13	23/06/15							8.19	0.50	241	198	8 000
Алроса 23		18/06/15	100.75	101.05	100.80	-0.10	1	17 990	8.87	2.26	251	303	7 000
Алроса 20		23/06/15							8.75	2.23	240	291	3 000
Алроса ВО1		30/10/15	100.50	100.70	100.70	0.20	3	19 200	8.85	2.53	245	303	5 000
Алроса ВО2		30/10/15	100.00	102.00	100.00	-0.60	2	2	9.14	2.53	274	332	5 000

Евраз

Евраз 1/	22/03/13	13/03/20	100.08	100.35					8.34	0.25		204	10 000
Евраз 3/	22/03/13	13/03/20	100.12	100.34					8.72	0.25		242	5 000
Сибметинвест 1/	16/10/14	10/10/19	107.36	107.84	107.60	0.39	5	724	9.07	1.65	283	315	10 000
Сибметинвест 2/	16/10/14	10/10/19	107.17	107.79	107.78	0.12	1	1	8.96	1.65	272	304	10 000
Евраз 2/	26/10/15	19/10/20	101.61	101.80	101.60		2	3 536	9.50	2.52	310	368	10 000
Евраз 4/	26/10/15	19/10/20	101.60	101.80	101.65	-0.08	1	5 000	9.48	2.52	308	366	5 000
Евраз 5/	06/06/16	27/05/21	95.85	96.00	96.10	0.30	1	670	9.99	3.06	351	419	5 000
Евраз 7/	02/06/16	25/05/21	95.49	95.50					10.41	3.05	393	461	15 000

Металлоинвест

Металлоинвест 1/d	16/03/15	07/03/22	100.00	100.35	100.31	0.25	10	36 804	9.03	2.03	271	318	5 000
Металлоинвест 5/d	16/03/15	07/03/22	99.75	100.15	100.04	-0.01	5	4 540	9.17	2.03	285	332	10 000
Металлоинвест 6/d	19/03/15	10/03/22	99.75	100.18	100.14		2	6	9.12	2.04	280	327	10 000

Мечел

Мечел ВО2/		12/03/13	99.75	99.79	99.70	0.10	6	643	11.30	0.22		498	5 000
------------	--	----------	-------	-------	-------	------	---	-----	-------	------	--	-----	-------

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Мечел 5/d	16/04/13	09/10/18	99.00	100.00	100.00		1	500	11.71	0.32		543	5 000
Мечел ВО3/		24/04/13	99.35	99.50	99.50	0.10	4	1 116	11.51	0.34		524	5 000
Мечел 2/d	15/06/11	12/06/13	97.76	97.85	97.84	-0.06	9	4 532	12.56	0.48		634	5 000
Мечел 4/d	25/07/13	21/07/16	99.20	99.30	99.20	-0.15	3	562	13.26	0.58		743	5 000
Мечел ВО4/	11/02/14	10/02/15	95.00	96.50					15.70	1.07		963	5 000
Мечел 15/d	18/02/14	09/02/21	91.71	93.00					15.56	1.10		948	5 000
Мечел 16/d	18/02/14	09/02/21	92.11	92.99	92.99	0.52	2	107	15.57	1.10		949	5 000
Мечел ВО5/		07/04/15	99.50						11.82	2.22		547	5 000
Мечел ВО7/		07/04/15	99.50						11.82	2.22		547	2 000
Мечел ВО11		07/04/15	99.50						11.82	2.22		547	3 000
Мечел ВО12		07/04/15	99.50						11.82	2.22		547	3 000
Мечел ВО6/		07/04/15	99.50						11.55	2.04		523	2 000
Мечел 13/d	01/09/15	25/08/20	86.25	86.50	86.50	-0.50	24	2 705	17.03	2.33		1066	1 120
Мечел 14/d	01/09/15	25/08/20	86.03	86.99	86.99	1.32	3	8	16.76	2.33		1039	1 093
Мечел 17/d	02/06/16	27/05/21	80.30	82.40	80.25	-1.75	3	19 500	16.72	3.00		1025	1 092
Мечел 18/d	02/06/16	27/05/21	80.06	84.79	80.25	-3.25	1	15 779	16.72	3.00		1025	1 092
Мечел 19/d	07/06/16	01/06/21	81.01	86.46	86.40	1.42	11	425	13.88	3.02		741	808
ТМК													
ТМК ВО1		22/10/13	99.71	100.00	99.75	-0.25	5	14 871	9.35	0.82		338	324
СУЭК													
СУЭК 1/d	05/07/13	26/06/20	100.01	101.25	100.23	-0.23	3	17	9.09	0.52		330	289
РМК													
РМК 3/d	17/12/13	15/12/15	98.00	99.69					13.00	0.97		697	695
РМК 4/d	05/06/14	02/06/16	91.51	92.50	92.51	0.01	1	1	15.45	1.39		928	948
КОКС													
КОКС ВО2		28/05/14	91.11	97.79	96.72	-1.03	5	120	11.54	1.37		537	557
Русал													
Русал 7/d	03/03/14	22/02/18	94.05	94.37	94.05	-0.69	23	17 155	14.30	1.14		820	829
Русал 8/d	15/04/15	05/04/21	89.70	91.24					13.73	2.11		740	789
ИНФРАСТРУКТУРА													
РЖД													
РЖД 09	18/05/11	13/11/13	99.72	99.88					7.37	0.88		137	129
РЖД 10		06/03/14	108.55	108.80	108.60	-0.20	1	55 000	7.54	1.11		145	152
РЖД 23	29/01/15	16/01/25	102.55	102.75	102.42	-0.38	25	130 473	7.88	1.91		158	201
РЖД 11		18/11/15	99.65	99.90	99.65	-0.19	2	5 914	8.09	2.65		167	227
РЖД 16	06/06/16	05/06/17	99.60	99.75	99.65	-0.12	2	20 150	8.18	3.09		170	238
РЖД 19	16/07/18	08/07/24	99.85	100.15					8.30	4.44		168	246
ФСК ЕЭС													
ФСК ЕЭС 6/d	26/09/13	15/09/20	99.75	100.00					7.59	0.75		165	146
ФСК ЕЭС 8/d	26/09/13	15/09/20	99.80	99.98					7.34	0.75		140	121
ФСК ЕЭС 18/	09/06/14	27/11/23	100.90	101.00	100.90	0.01	4	18 941	7.99	1.41		181	203
ФСК ЕЭС 15/	23/10/14	12/10/23	97.10	101.43	101.42	0.06	4	18 800	8.05	1.72		179	215
ФСК ЕЭС ВО1	22/04/15	21/10/15	86.00	100.40	100.10	-0.30	3	4	8.21	2.15		187	237
ФСК ЕЭС 10/	24/09/15	15/09/20	99.35	99.70					8.17	2.50		177	234
ФСК ЕЭС 7/d	27/10/15	16/10/20	98.45	99.00					8.26	2.59		185	244
ФСК ЕЭС 12/	22/04/16	19/04/19	96.01	100.15	99.60	-0.40	2	1 000	8.40	2.96		194	260
ФСК ЕЭС 25/	27/09/16	14/09/27	101.60	101.85	101.80	0.05	3	3	8.19	3.25		169	239
ФСК ЕЭС 21/	19/04/17	06/10/27	101.50	102.25	101.90	0.01	3	250 000	8.38	3.66		183	257
ФСК ЕЭС 9/d	24/10/17	16/10/20	99.30	99.70					8.33	4.05		174	251
ФСК ЕЭС 11/	24/10/17	16/10/20	99.15	99.69					8.36	4.05		177	254
ФСК ЕЭС 19/	18/07/18	06/07/23	97.00	99.50					8.52	4.45		190	268
ФСК ЕЭС 13/		22/06/21	96.70	105.00					8.81	5.97		208	284
НМТП													
НМТП БО-2		29/04/15	100.55	100.64	100.55	0.05	4	35 653	8.92	2.15		258	308
Росавтодор													
Росавтодор 1/d		29/11/16							9.34	3.38		282	353
Росводоканал													
Росводоканал 3/d	11/11/13	09/11/15	95.51		99.05	-0.06	6	188	10.37	0.87		438	428
Водоканал													
Водоканал 1/d		09/12/15	86.00						11.10	2.67		468	528
Западный СД													
Западный СД 1/d	29/04/16	13/05/31	98.80	99.19					9.50	2.97		303	370
Западный СД 2/d	29/04/16	13/05/31	99.30	100.20					9.18	2.97		271	338
Западный СД 3/d	24/02/17	06/02/32	100.90	101.50					9.31	3.47		278	350
Западный СД 4/d	24/02/17	06/02/32	100.90	101.20					9.32	3.48		279	351
Западный СД 5/d	24/02/17	06/02/32		101.50	100.90	0.70	1	1 000	9.08	3.48		255	327
Почта России													
Почта России 1/	25/03/14	22/03/16	86.00	100.70					8.05	1.20		193	205
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	100.60	100.45	-0.30	1	30 000	8.69	2.55		228	287
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	100.60	100.60	0.18	2	2	8.63	2.55		222	281
Почта России /d	23/10/15	18/10/19	100.00	100.60					8.88	2.55		247	306
НЕФТЬ И ГАЗ													
ГАЗПРОМ													
Газпром А9		12/02/14	90.96	99.99					7.54	1.10		146	152

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	
Газпром А11		24/06/14							7.20	1.34	104	122	5 000
Роснефть													
Роснефть 4	23/10/17	17/10/22	101.11		101.47	-0.03	6	223 000	8.39	4.02	181	257	10 000
Роснефть 5	23/10/17	17/10/22	101.40	101.85	101.45		6	194 709	8.40	4.02	182	258	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	100.09	100.09	-0.01	11	10 458	7.43	0.94	141	137	6 000
Газпром нефть													
Газпром нефть 3	15/01/13	12/07/16	99.35	99.60	99.52	0.02	1	4 856	8.04	0.07			8 000
Газпром нефть БО-5		09/04/13	99.95	100.10	100.15	0.16	4	6 703	6.70	0.30		42	10 000
Газпром нефть БО-6		09/04/13	86.00	100.20	99.95	-0.04	2	2	7.40	0.30		112	10 000
Газпром нефть 11	03/02/15	25/01/22	100.50						7.98	1.93	168	212	10 000
Газпром нефть 8		02/02/16	100.60	101.50					8.29	2.73	186	248	10 000
Газпром нефть 9	08/02/16	26/01/21	100.24	101.49					8.24	2.74	181	243	10 000
Газпром нефть 10	05/02/18	26/01/21	102.50	103.00	102.50	0.50	3	21 109	8.46	4.11	187	264	10 000
Газпром нефть 4	10/04/18	09/04/19	99.50	100.05	98.81	-1.14	1	1	8.66	4.34	205	283	10 000
НОВАТЭК													
НОВАТЭК БО-1		25/06/13							7.30	0.49		109	10 000
НОВАТЭК БО-2		12/10/15	100.55	100.75	100.75	0.15	5	24 656	8.20	2.53	180	238	10 000
НОВАТЭК БО-3		12/10/15	99.75	100.75	100.75	0.07	1	19 988	8.20	2.53	180	238	5 000
НОВАТЭК БО-4		12/10/15	99.75	100.75	100.75	0.05	2	11 441	8.20	2.53	180	238	5 000
ТАТНЕФТЬ													
Татнефть БО-1		20/09/13	99.55	101.00	99.77	0.05	2	86	7.69	0.73	176	155	5 000
Башнефть													
Башнефть 1	18/12/12	13/12/16	99.50	100.04					8.51	3.47	198	270	15 000
Башнефть 2	18/12/12	13/12/16	99.50	100.13					8.53	3.47	200	272	15 000
Башнефть 3	18/12/12	13/12/16	99.50	100.03	100.04	0.04	3	1 631	8.51	3.47	198	270	20 000
Башнефть БО1	05/12/13	02/12/14	101.03	101.25	100.70	-0.45	6	26 077	8.75	0.94	273	269	10 000
Башнефть 4	13/02/15	04/02/22	101.25	102.00	101.25	0.10	6	1 073	8.52	1.95	222	266	10 000
НК Альянс													
НК Альянс 3	30/07/13	21/07/20	95.00	100.45					9.77	0.59	393	359	5 000
НК Альянс БО-1		04/02/14	98.25	100.80	98.50	-0.59	10	4 389	10.96	1.06	489	493	5 000
НК Альянс 4	07/06/16	01/06/21	96.75	100.00					10.14	3.04	366	434	5 000
НК Альянс 6	10/06/16	04/06/21	96.75	99.45					10.79	3.05	431	499	7 000
Сахатранснефтегаз													
Сахатрнф2		26/07/13	99.70	99.90	99.90	-0.10	1	190	12.71	0.57	688	652	3 000
БК Евразия													
БК Евразия 1	22/06/16	20/06/18	96.85	100.00					9.70	2.98	323	390	5 000
ГОСБАНКИ													
ВТБ													
ВТБ 6	10/07/13	06/07/16	100.25	100.44	100.43	0.04	4	11 005	7.97	0.54	216	177	15 000
ВТБ БО-6	21/12/12	19/12/14							-24.05	0.00			10 000
ВТБ БО-7	25/01/13	23/01/15	99.98	100.11					7.81	0.10		138	10 000
ВТБ БО-1		15/03/13	99.94	100.04	100.03	0.03	3	11 400	7.68	0.23		137	5 000
ВТБ БО-2		15/03/13	99.93	100.04	100.01	-0.02	2	10 150	7.77	0.23		146	5 000
ВТБ БО-5		15/03/13	99.94	100.04	100.00	0.02	6	1 692	7.82	0.23		151	10 000
ВТБ БО-8	03/09/13	01/09/15	100.11	100.32	100.11	-0.08	7	100 004	8.01	0.69	211	186	10 000
ВТБ 5		17/10/13	99.55	99.94	99.94		1	2	7.68	0.80	172	157	15 000
ВТБ БО-03	18/03/14	17/03/15	100.16	100.35	100.16	0.14	2	7 500	8.10	1.19	198	210	5 000
ВТБ БО-04	18/03/14	17/03/15	99.50	100.18	100.07	-0.08	1	135 434	8.18	1.19	206	218	5 000
ВТБ БО-19		01/10/15	100.00						8.68	2.47	229	285	15 000
ВТБ БО-20		01/10/15	99.90						8.68	2.47	229	285	15 000
ВТБ 24 3	30/05/12	29/05/13	99.51						8.02	0.44		179	6 000
ВТБ 24 1-ИП	14/12/11	10/12/14	99.20	101.00	100.40	0.07	1	494	8.70	1.83	242	282	15 000
ВТБ 24 5	22/08/13	20/02/14	100.10	100.25					8.10	0.65	222	194	8 000
ВТБ-Лизинг 2	08/01/13	07/07/15	99.80						6.57	0.05			10 000
ВТБ-Лизинг 4	12/03/13	07/06/16	99.50	99.74					8.01	0.22		169	5 000
ВТБ-Лизинг 8	07/05/13	01/08/17	99.99	100.50					7.57	0.35		131	5 000
ВТБ-Лизинг 1	07/11/13	06/11/14	99.55	100.10					8.19	0.73	226	205	8 000
ВТБ-Лизинг 3	10/09/13	07/06/16	99.15	99.60					8.16	0.68	226	201	5 000
ВТБ-Лизинг 9	05/02/14	02/08/17	98.50	99.75					7.46	0.95	144	140	5 000
ВТБ-Лизинг 7	04/06/14	30/11/16	99.80	100.50					8.58	1.21	246	258	5 000
ВЭБ													
ВЭБ 8	22/10/13	13/10/20	86.00	100.00					7.78	0.82	181	168	15 000
ВЭБ 21	10/03/15	17/02/32	100.54	100.60	100.50	0.05	1	25 398	8.30	2.03	198	245	15 000
ВЭБ 18	09/10/15	17/09/32	100.00	103.00	101.20	0.30	16	115 004	8.22	2.52	182	240	10 000
ВЭБ 19	15/10/15	23/09/32	102.00						8.10	2.53	170	228	10 000
ВЭБ 9	24/03/16	18/03/21	97.50	99.75	99.00	-0.25	1	1	8.42	2.88	197	261	15 000
ВЭБ 10	27/09/16	21/09/21							8.67	3.25	217	287	15 000
ВЭБ 6	17/10/17	13/10/20	98.60	98.99	98.60	0.50	3	28 560	8.42	4.05	183	260	10 000
ВЭБ-Лизинг													
ВЭБ-Лизинг 3	11/04/14	02/04/21	98.39	99.50	99.35		2	22	8.18	1.25	205	219	5 000
ВЭБ-Лизинг 8	28/10/14	19/10/21	101.05	101.20	101.05	-0.10	1	999	8.34	1.73	208	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 9	29/10/14	20/10/21	101.05	101.20	101.05	-0.10	1	1 305	8.34	1.74	208	244	5 000
ВЭБ-Лизинг 6		31/01/17	100.75	101.20					8.77	1.85	249	289	10 000
ВЭБ-Лизинг 4	08/04/16	02/04/21	87.10		99.85	0.85	13	11 050	8.83	2.90	237	302	5 000
ВЭБ-Лизинг 5	08/04/16	02/04/21	86.00	101.00	99.45	0.45	14	99 003	8.98	2.90	252	317	5 000
МСП Банк													
МСП Банк 01	27/03/14	17/03/22	100.10		100.45		1	2 500	8.47	1.21	235	247	5 000
МСП Банк 02	21/08/14	11/08/22	101.00	101.40	101.00	-0.25	2	3 500	8.71	1.54	250	277	5 000
РСХБ													
РСХБ 8	22/05/14	14/11/19	99.25	100.25	100.20	0.05	3	14 722	8.41	1.36	225	244	5 000
РСХБ 9	22/05/14	14/11/19	99.25	100.75	100.19	0.04	1	1	8.42	1.36	226	245	5 000
РСХБ 10	06/02/13	29/01/20	99.50	101.00					7.46	0.13		106	5 000
РСХБ 11	07/02/13	30/01/20	100.16	100.24	100.16	-0.09	2	1 501	7.81	0.13		141	5 000
РСХБ 7	11/06/13	05/06/18	99.40	99.90					7.41	0.47		119	5 000
РСХБ БО-2	06/08/13	03/02/15	86.00	100.25					8.01	0.61	215	183	5 000
РСХБ БО-3	08/08/13	05/02/15	99.00	100.55					7.91	0.61	205	174	5 000
РСХБ БО-1	29/08/12	28/08/13	98.30	100.99	100.19	0.18	1	10 000	8.14	0.67	225	198	5 000
РСХБ БО-5	29/08/12	28/08/13	98.96		100.15	0.15	8	34 575	8.20	0.67	231	204	10 000
РСХБ 4	02/10/13	27/09/17	99.50						6.93	0.76	99	81	10 000
РСХБ БО-6	01/05/12	29/10/13	99.90	100.24	100.20	-0.05	2	10 001	8.09	0.84	211	199	10 000
РСХБ 15	05/11/13	26/10/21	100.00	100.55	100.47	-0.07	5	16 250	8.33	0.85	234	224	10 000
РСХБ 3	13/02/14	09/02/17	101.00	101.39					8.33	1.08	225	231	10 000
РСХБ 6	15/08/14	09/02/18	86.10	100.00					8.63	1.54	242	269	5 000
РСХБ 18	23/10/14	13/10/22	99.75	100.74					7.59	1.73	133	169	5 000
РСХБ 17	21/10/14	11/10/22	99.75	100.29					8.48	1.72	222	258	10 000
РСХБ 16	13/04/15	04/04/22	100.45	101.00	100.50	0.15	2	31 999	8.47	2.12	213	263	10 000
РСХБ 14	07/07/15	29/06/21	86.00	99.25					8.61	2.28	225	277	10 000
РСХБ 12	09/07/15	01/07/21	84.00	99.25					8.70	2.28	234	286	5 000
РСХБ 13	10/07/15	02/07/21	84.00	98.50	98.40	0.05	1	700	8.58	2.29	221	274	5 000
Газпромбанк													
Газпромбанк БО-4	24/12/12	20/12/14	100.06	100.10	100.06	0.04	20	510 950	3.05	0.01			10 000
Газпромбанк БО-2	22/07/13	18/07/14			99.45	-0.02	11	55 710	7.86	0.57	203	167	10 000
Газпромбанк БО-1		08/12/13	94.00	100.00					8.24	0.95	221	218	10 000
Газпромбанк БО-3	05/02/14	01/02/15	86.00	100.75	100.40	-0.10	1	90	8.27	1.07	220	224	10 000
Газпромбанк 6	14/07/14	07/07/16	100.86	100.95	100.95	0.12	9	116 032	8.35	1.44	216	239	10 000
Газпромбанк 7	21/10/15	17/10/16	86.00						8.44	2.55	203	262	10 000
Газпромбанк 10	19/10/15	12/10/17	99.94						8.67	2.54	226	285	10 000
Газпромбанк 11	19/10/15	10/10/19	99.97						8.67	2.54	226	285	10 000
Газпромбанк 12	19/10/15	06/10/22	99.98						8.67	2.54	226	285	10 000
АИЖК													
АИЖК А6		15/07/14	99.30	99.75					8.13	1.01	208	209	3 000
АИЖК-11 А1	15/03/15	15/09/43							8.45	2.06	213	260	7 000
АИЖК А9		15/02/17	93.01	99.40					8.39	1.73	213	249	5 000
АИЖК А7		15/07/16	99.40	100.09	99.60	0.10	1	47 803	8.15	1.75	189	225	4 000
АИЖК А19	15/05/15	15/11/24	99.00	99.40					8.42	2.20	207	258	6 000
АИЖК А8		15/06/18	95.00	99.48					8.48	2.67	206	266	5 000
АИЖК А10		15/11/18	91.75						8.46	2.90	200	266	6 000
АИЖК А18	15/04/16	15/07/23	99.00	100.50					8.06	2.91	160	226	7 000
АИЖК А21		15/02/20							8.55	3.09	207	275	15 000
АИЖК А11		15/09/20	99.25	100.00					8.67	3.75	211	286	10 000
АИЖК А16		15/09/21	97.90						8.07	4.90	141	221	10 000
АИЖК А17		15/04/22	100.50	103.50					8.94	5.40	224	304	8 000
АИЖК А20		15/12/27	99.80	102.50					8.88	8.37	202	261	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	100.15	0.03	1	250	9.02	0.95	300	296	3 000
ГЛОБЭКС БО-5	08/06/12	08/12/13	86.00	100.00	100.00		1	4	9.20	0.95	318	314	2 000
ГЛОБЭКС БО-4	01/08/12	01/08/14	86.00	99.80					9.59	1.48	339	364	3 000
ГЛОБЭКС БО-6	01/08/12	01/08/14							9.52	1.48	332	357	2 000
ГЛОБЭКС БО-1	16/02/11	16/02/13	99.90	100.30					8.35	0.16		197	5 000
Транскредитбанк													
Транскредитбанк 5		12/08/13	99.40	100.30					8.11	0.62	224	194	3 000
Транскредитбанк БО-1		17/11/13	99.25	100.35					8.30	0.89	230	222	5 000
Транскредитбанк 6		17/04/14	99.70	99.95					8.45	1.27	231	246	4 000
ТЕЛЕКОМЫ													
Ростелеком													
Ростелеком 17	05/11/15	02/11/17	100.50						8.44	2.59	203	262	10 000
МТС													
МТС 3	20/06/13	12/06/18	100.27	100.29					7.58	0.50		137	10 000
МТС 1		17/10/13	99.31	99.84	99.75		2	2	7.43	0.81	147	132	10 000
МТС 4	19/05/11	13/05/14	95.25	99.20					8.16	1.32	201	218	15 000
МТС 2		20/10/15	98.25	99.00					8.52	2.57	211	270	10 000
МТС 8	12/11/15	03/11/20	99.00	99.46	99.45		11	123 120	8.54	2.62	212	272	15 000
МТС 5	26/07/12	19/07/16	99.50	100.10					8.72	3.13	223	292	15 000
МТС 7		07/11/17	100.02	100.10	100.02	0.01	5	7 765	8.88	4.05	229	306	10 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Вымпелком													
Вымпелком Инв 1		19/07/13	100.61	100.74	100.66	0.01	2	25 001	8.20	0.56	238	201	10 000
Вымпелком 3	12/07/11	08/07/14	98.00	98.41	98.37	0.22	5	270	8.72	1.44	253	276	10 000
Вымпелком 2	23/03/15	14/03/22	100.00	100.10	100.00		2	2	9.03	2.05	271	318	10 000
Вымпелком 1	17/03/15	08/03/22	99.95	100.14					9.01	2.04	269	316	10 000
Вымпелком 4	17/03/15	08/03/22	100.05	100.15	100.15	0.10	19	32 634	8.96	2.04	264	311	15 000
Вымпелком 6		13/10/15	98.40	98.73	98.41	-0.19	1	20 000	9.14	2.53	274	332	10 000
Вымпелком 7		13/10/15	98.30	98.80					9.19	2.53	279	337	10 000
Мегафон													
Мегафон Фин 05	09/10/14	29/09/22	100.01	100.50					8.20	1.69	195	229	10 000
Ростелеком													
Ростелеком 8		03/09/13	98.00	99.50					8.74	0.54	293	254	
Ростелеком 1	18/08/11	08/08/13	98.00						6.68	0.38		43	2 000
СПБ Теле2													
ТЕЛЕ2 4	10/02/14	31/01/22	100.40	100.95					8.69	1.08	261	267	3 000
ТЕЛЕ2 5	10/02/14	31/01/22	96.00	101.24					8.38	1.08	230	236	4 000
ТЕЛЕ2 7	14/04/15	05/04/22	100.25	100.75	100.60	-0.06	3	80 022	8.86	2.11	253	302	6 000
ТЕЛЕ2 1	17/06/16	11/06/21							9.54	2.96	307	374	5 000
ТЕЛЕ2 3	17/06/16	11/06/21							9.65	2.96	318	385	3 000
ТЕЛЕ2 2	17/06/16	11/06/21							9.54	2.96	307	374	5 000
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ													
ВБД													
ВБД ПП 3		27/02/13	95.01	99.90	99.90	-0.05	3	4 387	8.06	0.19		171	5 000
МАГНИТ													
Магнит БО-1		09/09/13	99.90						8.47	0.70	256	232	1 000
Магнит БО-2		09/09/13	99.90						9.92	0.70	401	377	1 000
Магнит БО-3		09/09/13	99.90						8.28	0.70	237	213	2 000
Магнит БО-4		09/09/13	99.90	100.03					8.34	0.70	243	219	2 000
Магнит БО-5		28/02/14	99.10	99.99					8.56	1.13	246	255	5 000
Магнит БО-6		22/04/14	98.00	99.50					8.57	1.28	243	258	5 000
Магнит БО-7		21/09/15	100.40	100.60					8.83	2.45	244	300	5 000
Х5													
Х5 Финанс 4	05/06/14	02/06/16	98.50	99.50					9.06	1.40	288	310	8 000
Х5 Финанс 1		01/07/14	98.00		99.00	0.30	2	934	8.85	1.42	267	289	9 000
Х5 Финанс БО1		01/10/15	100.15	100.55	101.10	0.52	4	60 001	9.24	2.46	285	341	5 000
Копейка													
Копейка БО-1	24/07/12	23/07/13	95.12	98.90					9.04	0.58	321	285	3 000
Копейка БО-2		01/10/13	99.61	100.00	99.96	-0.09	2	2	9.36	0.75	343	323	3 000
ИНТУРИСТ													
Интурист 2	22/05/12	21/05/13	99.70	100.00	100.00		2	18	10.21	0.42		397	2 000
Черкизово													
Черкизово БО-3		08/11/13	99.16	100.64	100.45	1.23	2	2 800	7.85	0.87	186	176	3 000
Синергия													
Синергия БО-1	04/10/12	03/10/13	96.26	100.19					9.41	0.76	347	329	3 000
Синергия БО-3		03/06/15	103.00	103.50					11.30	1.90	501	543	2 000
Русское Море													
Русское Море 01	25/06/13	23/06/15	99.36	99.65	99.55	0.04	4	1 451	13.88	0.48		766	1 000
Детский мир													
Детский мир 1		26/05/15	93.80	94.25					11.77	2.23	541	593	1 000
Мираторг													
Мираторг БО-1		29/07/14	95.51	96.24					11.87	1.48	567	592	3 000
МАШИНОСТРОЕНИЕ													
АТОМЭНЕРГОПРОМ													
Атомэнергопром 6		15/08/14	98.00	99.05					8.46	1.58	224	253	10 000
Трансмашхолдинг													
Трансмашхолдинг БО-1		23/01/14	95.51	96.00	96.00	0.01	2	71	10.73	1.05	467	470	3 000
КАМАЗ													
Камаз БО-1	17/12/12	16/12/13							-61.63	0.97			2 000
Камаз БО-2		04/02/14	99.00	99.30	99.30	0.16	1	291	9.46	1.07	339	343	3 000
Камаз БО-3		01/10/15	103.00	103.50					9.82	2.44	343	399	2 000
УВЗ													
Уралв агонзав од 1	12/12/13	07/12/17	99.55	100.44	100.33	0.33	2	4	9.08	0.96	305	302	3 000
Уралв агонзав од 2	27/08/13	20/02/18	99.58	99.64	99.63	0.03	8	38 505	9.71	0.66	382	355	3 000
УОМЗ													
УОМЗ 04	22/10/13	21/04/15	99.00						12.09	0.81	612	598	1 000
ИРКУТ													
Иркут БО-1		10/09/13	100.35	101.50	100.75		1	1	8.29	0.70	238	214	5 000
ГСС													
Сухого ГС БО-1	21/12/12	20/12/13							8.42	0.94	240	236	3 000
Сухого ГС БО-2	23/04/13	22/04/14	99.85						9.14	0.34		287	3 000
Сухого ГС БО-3	23/04/13	22/04/14	99.60	100.00	99.76		2	2	9.12	0.34		285	3 000
ГСС 01	19/09/13	26/03/17	86.00	101.00					8.13	0.73	221	199	5 000
СОЛЛЕРС													
Соллерс БО-2	02/05/12	01/05/13	99.81	100.05					9.94	0.36		368	2 000

Соллерс 2	17/07/13	101.55	101.65	101.50		3	140 873	9.95	0.54	414	375	3 000	
Гидромашсервис													
ГМС 02	13/02/15	100.52	101.25	101.00	-0.70	13	40 814	10.47	1.91	417	460	3 000	
ТРАНСПОРТ													
Аэрофлот													
Аэрофлот БО-1	08/04/13	99.95	100.05					7.59	0.30		131	6 000	
Аэрофлот БО-2	08/04/13	98.99	100.05					7.66	0.30		138	6 000	
Трансконтейнер													
Трансконтейнер 1	26/02/13	100.10	100.45					6.77	0.19		41	3 000	
Трансконтейнер 2	04/06/15	100.21	100.70					8.72	1.61	249	280	3 000	
Глобалтранс													
Нов ПеревозКом 1	10/07/15	99.00	100.25					10.33	1.29	419	434	3 000	
Нов ПеревозКом БО-01	03/03/15	100.57	100.90	100.94	-0.01	2	54	9.73	1.98	342	388	5 000	
Нов ПеревозКом БО-02	03/03/15	100.55	100.90	100.90	-0.06	2	2 300	9.75	1.98	344	390	5 000	
Трансаэро													
ТРАНСАЭРО БО-01	03/09/13	03/03/15	100.02	100.05	100.06	-0.07	10	5 747	12.72	0.67	683	657	3 000
ТРАНСАЭРО 1	25/04/12	23/10/13	100.02	100.05	100.01	-0.19	27	6 123	12.82	0.81	685	671	3 000
Ю-Тэйр													
Ю-Тэйр БО-1	26/03/13							8.07	0.25		177	2 000	
Ю-Тэйр БО-2	26/03/13							8.93	0.25		263	2 000	
Ю-Тэйр БО-6	30/04/13	22/04/15	99.31	100.00				10.36	0.35		410	2 000	
Ю-Тэйр БО-7	30/04/13	22/04/15	99.30	99.65	99.65	-0.15	3	14	11.45	0.35	519	2 000	
Ю-Тэйр БО-16	03/06/13	26/05/15						8.46	0.45		223	1 000	
Ю-Тэйр БО-8	02/12/13	26/05/15						10.38	0.91	437	431	2 000	
Ю-Тэйр БО-3	19/12/13	95.00	99.99	99.99		3	24	9.80	0.96	377	375	2 000	
Ю-Тэйр БО-4	26/03/14	96.01	97.80	97.40	0.40	3	61 000	11.72	1.18	561	571	2 000	
Ю-Тэйр БО-5	26/03/14	96.11	97.00	97.00	0.95	1	103	12.10	1.18	599	609	2 000	
Ю-Тэйр 5	21/07/16							8.66	3.05	218	286	2 000	
ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ													
РУСГИДРО													
Русгидро 1	22/04/16	12/04/21	99.40	99.80				8.39	2.96	193	259	10 000	
Русгидро 2	22/04/16	12/04/21	98.29	99.40	99.40		1	49	8.37	2.96	191	257	5 000
МОСЭНЕРГО													
Мосэнерго 2	21/02/13	18/02/16						9.25	0.17		288	5 000	
Мосэнерго 3	06/12/12	28/11/14	100.60	101.00				8.50	1.82	222	262	5 000	
МОЭСК													
МОЭСК БО1	18/09/15	100.20	100.40	100.38	0.03	1	100	8.82	2.45	243	299	5 000	
МОЭСК БО2	26/10/15	100.23	100.50					8.84	2.55	243	302	5 000	
ЛЕНЭНЕРГО													
Ленэнерго 4	21/04/15	18/04/17	100.00	100.70	100.30		2	30 006	8.52	2.14	218	268	3 000
ЭНЕЛ ОГК-5													
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-15	19/06/12	18/06/13	100.31	100.39	100.39	-0.16	10	29 276	7.82	0.49		161	4 000
ЭНЕЛ ОГК-5 Б-18	25/06/14							8.29	1.41	211	233	5 000	
КузбасЭнерго													
КузбасЭнерго-Фин 1	23/06/14	14/06/21						12.73	1.39	656	676	10 000	
КузбасЭнерго-Фин 2	21/04/16	15/04/21	83.11	92.41				12.41	2.91	595	661	5 000	
МРСК ЦЕНТРА													
МРСК Центра БО1	14/10/15	100.40	100.58	100.58	0.16	1	600	8.90	2.52	250	308	4 000	
МРСК ЮГА													
МРСК Юга 2	30/08/11	26/08/14	94.30	96.90				11.40	1.57	518	547	6 000	
ТГК-1													
ТГК-1 03	25/12/12	14/12/21						7.67	0.04			2 000	
ТГК-1 02	02/07/13	01/07/14	98.15	99.15				8.74	0.52	295	253	5 000	
ТГК-1 01	13/03/12	11/03/14	92.11	98.80				21.32	1.17	1521	1 531	4 000	
ТГК-9													
ТГК-9 1	12/08/13	07/08/17	98.50	99.55	98.48	0.02	1	4 900	10.85	0.62	498	468	7 000
ТГК-2													
ТГК-2 БО-1	17/09/13	86.41	86.60	86.60	0.01	21	8 230	32.67	0.72	2675	2 653	5 000	
ТГК-5													
ТГК-5 1	11/10/13	06/10/17	98.60	99.05	99.05	0.10	4	3 980	10.22	0.79	427	410	5 000
Иркутскэнерго													
Ирку тЭнерго-1	28/11/13	104.00						9.05	0.90	304	298	5 000	
Ирку тЭнерго БО-1	08/04/14	85.00		99.55	1.07	2	2 800	8.12	1.24	199	213	3 000	
ЯКУТСКЭНЕРГО													
Якутскэнерго БО-1	03/09/13	99.85	99.95					8.62	0.68	272	247	3 000	
ГЭС													
Газпром-газэнергосеть 2	23/04/13	97.67						14.47	0.38		822	2 000	
ТГК-6													
ТГК-6 1	29/08/13	24/08/17	98.20	99.94	98.17	-1.38	2	2 800	11.39	0.67	550	523	5 000
ХИМИЧЕСКИЕ													
ЕВРОХИМ													
Еврохим 2	30/06/15	26/06/18	91.01					9.01	2.23	266	317	5 000	
Еврохим 3	18/11/15	14/11/18	90.01	100.00				8.95	2.63	253	313	5 000	
АКРОН													

Выпуск

Дата

Котировки

Цена

Кол-во

Оборот,

Спрэд к (бп)

Объем

Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп	сделок	шт	УТМ/УТР	Дюрация	ОФЗ	свопам	млн руб.
--------	-----------	---------	---------	------	---------	--------	----	---------	---------	-----	--------	----------

Акрон 2	22/09/11	19/09/13	99.60	102.99				8.98	0.73	306	284	4 000	
Акрон 3	23/05/12	20/11/13	100.00	101.59				8.57	0.90	257	249	4 000	
Акрон 4	27/05/14	18/05/21	97.01	99.85				11.33	1.38	516	536	4 000	
Акрон 5	27/05/14	18/05/21	95.00	99.90				10.51	1.38	434	454	4 000	
Акрон БО1		13/10/15	100.45	100.70	100.70	-0.25	4	4 400	9.68	2.49	328	385	5 000
КУАЗ													
КУАЗ-Инвест 4	10/04/14	07/04/16	98.29	98.98				9.72	1.24	359	373	2 000	
СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ													
ЛСР													
ЛСР Группа 2	31/01/13	01/08/13	99.99	100.23	100.00		9	270 353	9.85	0.12		343	5 000
ЛСР Группа БО-1	26/06/12	25/06/13							10.02	0.49		381	2 000
ЛСР Группа БО-2		10/09/13	100.00	100.10	100.07	-0.03	3	385	10.10	0.70	419	395	2 000
ЛСР Группа 3		08/09/17	100.05	100.65	100.53	-0.21	4	22 470	11.30	1.15	520	529	3 000
ЛСР Группа БО-3	14/03/14	20/03/14	98.20	98.38	98.31		7	3 582	11.26	1.18	515	525	2 000
ЛСР Группа БО-5		24/07/14	96.05	96.25	96.15	-0.10	1	30 000	11.48	1.47	528	553	2 000
ЛСР Группа 04	24/10/14	20/10/17	99.80	100.21					11.58	1.69	533	567	5 000
РеноваСтройГрупп													
РСГ-Финанс-1	19/12/12	18/06/14	100.20	100.30	100.30	0.11	8	6 073	13.67	1.38	750	770	3 000
РСГ-Финанс-2	15/04/14	13/10/15	101.30	101.75	101.30	-0.01	3	4 653	13.01	1.22	689	701	3 000
ЛенСпецСМУ													
ЛенСпецСМУ 1		07/12/12							-30.83	0.00			2 000
ЛенСпецСМУ БО-2		23/05/13	100.13						9.94	0.41		370	2 000
ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ													
РОСНАНО													
РОСНАНО 1		20/12/17							9.18	3.97	260	336	8 000
РОСНАНО 2		20/12/17							9.26	3.97	268	344	10 000
РОСНАНО 3		20/12/17							9.32	3.96	274	350	15 000
СИСТЕМА													
АФК Система 3	29/11/12	24/11/16	98.50	100.50					8.93	3.39	241	312	19 000
АФК Система 1		07/03/13	100.35	100.45	100.45		1	5	7.60	0.21		127	6 000
АФК Система 2	14/08/12	12/08/14	99.12	99.98	99.98	-0.22	13	6 573	8.53	1.53	232	259	20 000
АФК Система 4		15/03/16	98.52	98.60	98.57	-0.43	1	20 000	8.65	1.76	238	276	20 000
ПРОФМЕДИА													
ПрофМедиа Финанс 1	18/07/13	16/07/15	99.07	99.35	99.07	0.01	9	11 944	12.56	0.55	674	637	3 000
СИТРОНИКС													
Ситроникс БО-1	19/06/12	18/06/13	100.20	100.39	100.25		6	1 062	11.79	0.49		558	2 000
Ситроникс БО-2	08/10/12	07/10/13	100.01	100.25					11.95	0.77	600	583	3 000
ЧАСТНЫЕ БАНКИ													
РОСБАНК													
РОСБАНК ВО3	16/05/13	16/11/14	100.38	100.41	100.38	-0.02	4	5 638	8.10	0.40		185	10 000
РОСБАНК ВО1	25/06/13	25/06/13							8.16	0.49		195	5 000
РОСБАНК ВО2		08/07/13	100.00	100.15					8.15	0.53	235	195	5 000
РОСБАНК А3/	06/05/11	06/11/13	98.80	98.98	98.98	0.18	1	5 000	8.27	0.86	228	218	5 000
РОСБАНК ВО4	12/09/14	12/09/15	100.90	101.20	101.08	0.08	4	11 855	8.78	1.60	255	285	10 000
РОСБАНК А5/	06/05/11	07/11/14	97.50	100.50					9.06	1.78	279	317	5 000
Альфа-Банк													
Альфа-Банк 2/d	07/06/13	02/12/16	100.00	100.69	100.69	0.29	1	2	7.84	0.46		162	5 000
Альфа-Банк ВО3	28/09/13	28/09/15	100.15	100.25	100.25	0.14	3	50 001	8.24	0.75	230	211	10 000
Альфа-Банк 1/d	04/02/14	02/02/16	99.05	100.00					8.60	1.07	253	257	5 000
Альфа-Банк ВО7	28/02/14	31/08/15	100.15	100.20	100.15	-0.10	3	3 098	8.63	1.13	254	261	5 000
МДМ Банк													
МДМ Банк ВО4	16/12/13	16/12/14	100.00	100.10	100.01	-0.04	4	31 990	9.71	0.97	368	366	5 000
МДМ Банк 8/d	09/07/13	09/04/15	100.06	100.14	100.06	-0.19	30	81 990	9.09	0.54	328	289	6 000
МДМ Банк ВО2		21/03/14	86.00	100.35	100.35	1.35	1	194	7.99	1.19	188	199	5 000
НОМОС Банк													
НОМОС Банк ВО2	18/04/13	18/10/14	99.70	99.86	99.85	-0.02	1	200	8.59	0.33		232	5 000
НОМОС Банк 9/d	15/06/12	14/06/13	99.82	100.00	99.82	-0.08	3	3 540	9.34	0.48		312	5 000
НОМОС Банк ВО3	09/08/13	09/08/15	100.00	100.15					9.24	0.61	338	307	5 000
НОМОС Банк 12/	25/08/13	28/08/17	96.00	99.60	99.50	-0.09	2	2 001	9.46	0.66	357	330	5 000
НОМОС Банк ВО1	24/02/12	24/02/14	99.50	99.75					9.48	1.12	339	346	5 000
НОМОС Банк 11/	02/07/14	02/07/14	90.00	100.00	100.00	0.01	5	106 955	9.72	1.40	354	376	5 000
Банк ЗЕНИТ													
Банк ЗЕНИТ ВО6	26/05/13	26/05/14	100.01	100.10	100.00	-0.03	2	2	8.92	0.43		268	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО4	07/02/13	07/02/15	100.03	100.09	100.03	0.03	2	50	8.71	0.13		231	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО5	14/02/13	14/02/15	100.07	100.10	100.07	0.02	10	9 502	8.47	0.15		209	3 000
Банк ЗЕНИТ 1/d	07/04/12	07/04/13	99.40						8.48	0.30		220	5 000
Банк ЗЕНИТ t 5	05/06/12	04/06/13	100.15	100.25	100.18	0.03	6	73 590	8.75	0.45		252	5 000
Банк ЗЕНИТ 6/d	02/07/13	01/07/14	100.25	100.29	100.27	-0.02	3	70 308	8.84	0.51	305	263	3 000
Банк ЗЕНИТ 8/d	28/08/13	23/08/17	100.25	100.29	100.29	0.01	5	6 868	8.91	0.67	302	275	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО2	22/09/12	22/09/13							7.62	0.74	169	149	5 000
Банк ЗЕНИТ ВО3	15/11/13	15/11/14	100.10	100.21					9.01	0.88	301	293	3 000
Банк ЗЕНИТ ВО7	12/04/14	12/04/15	100.08	100.23	100.23	0.15	3	14 851	9.19	1.24	306	320	5 000
Промсвязьбанк													
Промсвязьбанк 2/d	20/02/13	18/02/15	100.00	100.04	100.00	-0.02	1	1	8.81	0.17		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	
Промсвязьбанк 4/d	20/02/13	18/02/15	86.00	100.03	99.89	-0.17	1	1	9.50	0.17		313	5 000
Промсвязьбанк 6/d		17/06/13	99.51	99.85	99.85	-0.11	10	2 653	8.75	0.49		254	5 000
Промсвязьбанк 3/d		04/02/14	95.01	99.50	99.50	0.38	5	1 012	9.26	1.07	319	323	5 000
Промсвязьбанк БО7	06/09/14	06/09/15	100.50	100.69	100.51	-0.09	7	125 206	10.04	1.57	382	411	5 000
Промсвязьбанк 3/d		01/02/18	100.31	100.55	100.55	0.20	3	3 901	12.46	3.79	590	664	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	86.00						9.54	0.96	351	348	3 000
Банк СПб 2/d	26/03/12	23/09/13	99.90	99.91	99.90	-0.01	2	2 505	9.31	0.74	338	318	5 000
Банк СПб 8/d	07/10/13	05/10/15	100.00	100.40	99.97	-0.43	1	1	9.73	0.78	378	361	5 000
МКБ													
МКБ /d	15/01/13	14/07/15	99.95	100.17	100.00	-0.05	1	1 000	9.53	0.07			2 000
МКБ -01/d	22/02/13	22/02/14	99.85	99.93	99.85	-0.05	10	18 776	9.46	0.18		310	3 000
МКБ -03/d	27/04/13	27/04/15	99.85	99.94	99.87	-0.07	10	15 720	9.80	0.35		354	4 000
МКБ -02/d	25/09/13	25/09/15	99.70	99.85	99.70	-0.07	3	50 792	10.38	0.74	445	425	3 000
МКБ /d	09/10/13	08/04/15	99.65	99.95	99.80	0.10	2	10 001	10.23	0.78	428	411	3 000
МКБ -04/d	15/10/12	15/04/14	99.80	99.99	99.99	-0.06	7	1 690	10.50	1.25	437	451	5 000
МКБ -05/d		23/06/14							10.80	1.38	463	483	5 000
ПЕТРОКОММЕРЦ													
Петрокоммерц 5	20/12/13	21/12/14	100.10	100.49	100.25	0.05	4	16 030	9.70	0.98	366	365	5 000
Петрокоммерц БО-01	03/09/13	03/03/15	86.00	100.05					9.06	0.68	316	291	3 000
Петрокоммерц БО-02	23/08/13	23/08/15		100.32					11.02	0.65	514	486	3 000
Петрокоммерц БО-03	23/02/14	23/08/15	86.00	100.35	100.30	-0.15	3	25 001	9.62	1.11	353	360	5 000
Банк УРАЛСИБ													
Уралсиб 04	13/09/13	10/03/17	99.73	99.78					9.24	0.71	333	310	5 000
Уралсиб 05	28/02/14	25/08/17	99.95	100.04					9.91	1.12	382	389	7 000
ЛК УРАЛСИБ													
Уралсиб Лизинг БО-3		29/10/13	100.10	100.15	100.15		1	2 000	9.48	0.47		326	3 000
Уралсиб Лизинг БО-1		28/02/14	99.80	100.05					9.84	0.67	395	368	2 000
Уралсиб Лизинг БО-4		03/07/14	98.85	99.04					10.44	0.74	451	431	3 000
Уралсиб Лизинг БО-5		05/02/15	100.65	100.95	100.99	0.04	4	26 038	10.96	1.05	490	493	3 000
Уралсиб Лизинг БО-6		10/02/15	100.00	101.00					10.96	1.06	489	493	3 000
Уралсиб Лизинг БО-7		22/04/15	99.81	100.40	100.40	0.05	4	7 700	11.06	1.11	497	504	2 000
Уралсиб Лизинг БО-2		12/01/15	102.00	102.15					11.02	1.83	474	514	2 000
Уралсиб Лизинг БО-9		17/02/15	101.70	102.15	101.75		1	1 000	11.01	1.93	471	515	2 000
КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ													
РенКап БО-3	05/08/13	05/08/14	98.52	98.88	98.88	0.28	9	3 831	12.11	0.60	626	593	3 000
РенКап БО-2	09/08/13	09/08/15	99.90	100.49	100.25	-0.05	1	160	12.80	0.61	695	662	2 000
ТКС БАНК													
ТКС БАНК 4/d	18/04/13	16/04/15	100.48	100.75	100.65	0.15	13	8 080	11.34	0.33		507	2 000
ТКС БАНК 6/d	16/07/13	14/07/15	100.78	101.28	101.28	0.03	11	480	11.80	0.54	599	560	2 000
ТКС БАНК 2/d		28/07/13	104.79	105.25	105.25	0.10	7	5 501	10.98	0.56	516	479	1 000
ТКС БАНК /d		20/09/13	101.40	102.00					11.62	0.72	570	548	2 000
ТКС БАНК 2/d	29/11/11	26/11/13	104.00	104.26	104.27	-0.18	15	7 660	11.85	0.90	585	577	2 000
ТКС БАНК 3/d	21/08/12	18/02/14	102.51	102.93	102.97	0.47	2	270	11.48	1.07	541	545	2 000
Связной Банк													
Связной Банк 1	08/08/13	06/08/15	100.18	100.25	100.23	0.04	54	28 399	14.25	0.60	840	807	2 000
РОСГОССТРАХ													
Росгосстрах 2	07/11/13	02/11/17	99.92	100.29	100.30	0.25	14	7 518	10.37	0.86	438	428	5 000
РЕСО-ГАРАНТИЯ													
Ресо гарантия 02	24/09/13	13/09/22	86.00	100.00					9.00	0.74	307	287	5 000
Ресо гарантия 01	01/09/14	22/08/22	99.95	100.40	100.18	-0.18	2	136	9.48	1.57	326	355	5 000
ЕАБР													
ЕАБР 3	29/10/13	25/10/16	90.10	100.08					7.62	0.84	164	152	5 000
ЕАБР 1	03/02/14	28/01/19		101.25					7.87	1.07	180	184	5 000
ЕАБР 4	11/02/14	06/02/18	86.00	100.10	99.82	0.07	1	1	8.01	1.09	193	199	5 000
ЕАБР 2	26/02/15	21/02/19							7.45	2.01	113	160	5 000
Юникредит Банк													
Юникредит Банк 4	13/05/14	10/11/15	96.00	100.50					8.53	1.33	237	255	10 000
Юникредит Банк БО02	30/08/13	27/02/15	100.15	100.30	100.23	-0.07	1	1	8.29	0.67	240	214	5 000
Юникредит Банк БО03	04/09/13	04/03/15	100.10	100.30					8.19	0.69	229	204	5 000
Юникредит Банк 5	03/09/13	01/09/15	99.45	100.00					8.48	0.68	258	233	5 000
Юникредит Банк БО01	11/12/13	10/12/14	86.00	100.50					8.74	0.95	271	268	5 000
Юникредит Банк БО04	24/10/14	23/10/15	100.50	100.74	100.74	0.14	3	1 541	8.83	1.72	258	293	5 000
Юникредит Банк БО05	28/10/14	27/10/15	100.65	101.00					9.61	1.73	335	371	5 000
Юникредит Банк 1		07/09/16							9.03	3.39	251	322	5 000
Райффайзенбанк													
Райффайзен 4	06/12/11	03/12/13	100.86	100.95	100.86	-0.09	1	8	7.94	0.93	192	188	10 000
Райффайзен БО-7		27/11/13	99.66	99.85					7.81	0.92	180	174	5 000
ИНГ Банк													
ИНГ Банк 2	12/02/13	18/11/14							8.48	0.25		218	5 000
РуссСтандарт													

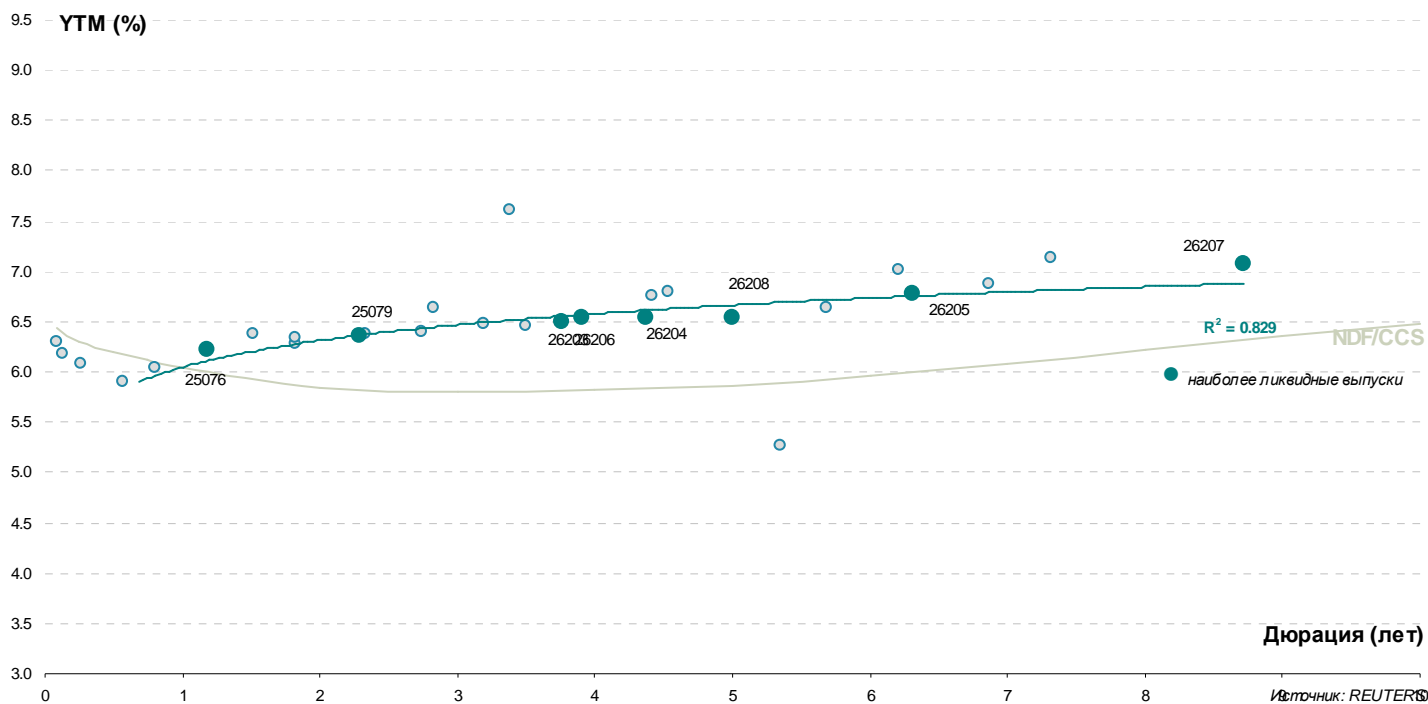
Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
РуссСтандарт БО-1	08/11/13	07/11/14	100.17	100.39	100.35	0.05	4	60	9.16	0.86	317	307	5 000
РуссСтандарт БО-2	26/03/13	24/03/15	99.00	100.09					8.70	0.26		240	5 000
РуссСтандарт БО-6	03/11/13	03/05/15	100.00	100.20					9.53	0.85	355	344	5 000
Вост-Экспресс													
Вост-Экспр Банк БО-1	10/03/11	07/03/13	99.52	99.84	99.85	-0.05	1	20	8.31	0.21		198	1 000
Вост-Экспр Банк БО-4	16/08/13	14/08/15	100.17	100.60	100.17	0.17	3	32 002	11.15	0.64	528	498	3 000
Вост-Экспр Банк БО-5	19/04/12	17/10/13	99.20	105.00					11.58	0.80	562	547	2 000
Вост-Экспр Банк БО-2	27/03/14	25/09/14	100.30	100.60					11.03	1.19	492	503	2 000
ХКФ Банк													
ХКФ Банк 6	12/03/13	10/06/14	96.00	100.19	100.25	0.24	1	1	9.48	1.39	331	351	5 000
ХКФ Банк 5	19/10/11	17/04/13	99.90	100.25	100.05	0.05	2	3 001	8.59	0.32		231	4 000
ХКФ Банк БО-3	22/10/13	22/04/14	85.00		98.85	-0.15	1	5	9.67	0.81	370	356	4 000
ХКФ Банк 7	26/04/12	23/04/15	100.15	100.32					10.01	2.09	368	416	5 000
БНП Париба													
БНП Париба 1		29/03/14	99.50	100.50					7.43	1.22	131	143	2 000
РусфинансБанк													
РусфинансБанк БО-01	04/07/13	04/07/14	99.00	99.25					9.29	0.52	349	309	4 000
РусфинансБанк БО-02	06/09/13	06/03/15	86.00	100.00	100.00	0.10	1	250	8.91	0.69	301	276	4 000
РусфинансБанк 8	16/09/13	14/09/15	100.00	101.00					9.01	0.72	309	287	2 000
РусфинансБанк 9	17/09/13	15/09/15	100.30	100.45					9.00	0.72	308	286	2 000
РусфинансБанк 10	12/11/13	10/11/15	86.00	101.00					9.54	0.88	354	346	2 000
РусфинансБанк 11	13/11/13	11/11/15	85.00	99.20					9.02	0.88	302	294	2 000
РусфинансБанк БО3	02/11/14	02/11/15	100.60	100.90	100.81	0.01	2	16 300	9.73	1.73	347	383	4 000
ДЕЛЬТА КРЕДИТ													
Дельта Кредит БО3	07/08/13	07/08/15	100.45	100.50	100.48	-0.13	3	8 504	8.60	0.61	274	242	4 000
Дельта Кредит 6	18/06/14	15/06/16	97.70	98.40	98.00		2	137	8.84	1.44	265	288	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	100.20	99.46	-0.54	1	1	9.74	1.73	348	384	4 000
ОТП Банк БО-2	04/03/14	03/03/15	100.31	100.38					10.37	1.13	428	435	6 000
ОТП Банк 2		25/03/14	97.47	97.72	97.68	0.05	6	146	10.50	1.20	438	450	3 000
ОТП Банк БО-1		29/07/14	96.40	96.55					10.62	1.49	442	467	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					8.95	0.44		272	3 000
СКБ-Банк БО-6	09/07/13	08/07/14	99.31	99.55					9.96	0.53	416	376	2 000
СКБ-Банк БО-5	10/10/13	10/04/14	100.00	100.25	100.15	-0.10	1	5 000	10.00	0.78	405	388	2 000
КредитЕвропа Банк													
КредЕврБанк БО-3	09/10/13	09/10/15	99.90	100.09	100.09	0.06	7	10 005	9.88	0.78	393	376	5 000
КредЕврБанк 6	21/08/12	18/02/14							9.80	1.10	372	378	4 000
КредЕврБанк БО-2	10/02/14	10/02/15	99.70	100.05					10.07	1.07	400	404	5 000
КредЕврБанк БО-1		27/04/14	97.10	97.45	97.41	0.05	2	22	10.44	1.29	429	446	5 000
Банк Интеза													
Интеза 03	11/10/13	13/04/15	99.80	100.00					9.21	0.79	326	309	5 000
Интеза БО1	25/04/14	25/10/15	99.90	100.14	100.00		1	1 800	9.97	1.28	383	398	3 000
Центр-Инвест													
ЦентрИнвест БО-1	17/12/13	17/06/14		100.10					9.94	0.97	391	389	2 000
ЦентрИнвест БО-5	17/12/13	17/06/14	99.95	100.10					9.94	0.97	391	389	1 000
ЦентрИнвест БО-2	18/04/13	16/04/15	100.10	100.15					9.52	0.33	325	325	2 000
ЦентрИнвест 2	25/06/13	24/06/14							9.55	0.49	334	334	3 000
Связь-Банк													
СвязьБанк 03	19/12/13	09/12/21	99.75						9.48	0.98	344	343	5 000
СвязьБанк 04	24/04/13	13/04/22	100.00	100.15					8.88	0.34		261	5 000
СвязьБанк БО1	01/11/13	01/11/15	86.00						9.18	0.89	318	310	5 000
СвязьБанк 05	16/04/15	07/04/22	99.75						9.71	2.44	332	388	5 000
Крайинвестбанк													
Крайинвестбанк БО-1	19/10/13	19/04/14	86.00	99.80	99.78	-0.02	6	20 017	11.03	0.81	507	492	2 000
Судостроительный банк													
Судостр БО01	03/03/13	03/03/14	99.99	100.30	100.00		1	1	11.12	0.20		478	2 000
Судостр 04	10/04/12	08/10/13	99.02	100.28	100.28	1.28	2	102	10.86	0.78	491	474	2 000
Меткомбанк													
Меткомбанк БО-1	02/02/13	02/08/14	99.30	99.90	99.30	-0.50	2	2	15.05	0.12		864	2 000
Меткомбанк 01	13/04/13	15/04/15	97.50	101.50					9.99	0.31		371	2 000
Меткомбанк БО5	08/10/13	06/10/15	100.10	100.57	100.30	-0.25	1	4 004	11.62	0.77	567	550	2 000
Металлинвестбанк													
Металлинвестбанк 01	20/12/13	22/06/15	100.00	100.02	100.02	-0.05	2	5 000	10.38	0.98	434	433	2 000

Выпуск	Дата		Котировки		Цена		Кол-во сделок	Оборот, шт	УТМ/УТР	Дюрация	Спрэд к (бп)		Объем млн руб.
	Оферты	Погашения	Покупка	Продажа	Посл	Изм. пп					ОФЗ	свопам	
Абсолют банк													
Абсолют банк 5	30/07/14	27/07/16	93.00	99.00					10.13	1.49	393	418	2 000
ПЕРВОБАНК													
Первобанк БО2	11/04/13	10/04/14	86.00	100.00					9.54	0.31		326	2 000
Первобанк БО1	25/04/12	24/04/13	99.99	100.10	100.10	0.10	3	10 072	9.59	0.34		332	2 000
Первобанк БО3	24/09/13	22/09/15		100.10					11.13	0.74	520	500	2 000
СМП Банк													
СМП Банк 01	26/11/13	23/05/17	99.70	100.05	100.05	0.05	5	2 570	10.17	0.91	416	410	3 000
ПРОБИЗНЕСБАНК													
Пробизнесбанк 7	03/09/13	05/09/15	99.64	100.15					11.79	0.68	589	564	2 000
ЛОКО-Банк													
ЛОКО-Банк БО1	07/02/13	06/02/14		100.14					9.07	0.13		267	3 000
ЛОКО-Банк 05	25/07/13	23/07/15	98.00	100.09					10.23	0.57	440	404	3 000
ЛОКО-Банк БО3	13/08/13	11/08/15	100.35	100.39	100.37	-0.03	3	25 100	10.35	0.62	449	418	3 000
НОВИКОМ Банк													
Новиком Банк 1	26/05/13	25/11/13	99.50	100.20	100.26	0.07	1	10 000	9.03	0.43		279	2 000
Новиком Банк БО1	07/07/13	07/07/14	99.15	99.70	99.70	0.35	2	30 001	9.27	0.53	347	307	3 000
Новиком Банк БО4	11/10/13	11/10/15	100.50	100.67	100.50		5	5 000	9.78	0.78	383	366	2 000
Внешпромбанк													
Внешпромбанк БО2	26/10/13	26/10/15	99.60	100.10	100.10	0.15	12	5 942	12.18	0.82	621	608	3 000
АК Барс Банк													
АК Барс Банк 4	17/04/12	15/10/13	99.55	99.65	99.65	-0.11	2	5 002	9.65	0.80	369	354	5 000
АК Барс Банк БО1	17/10/13	15/10/15	99.75	100.20					9.59	0.80	363	348	5 000
УБРиР													
УБРР 2	30/04/13	01/05/14	100.30	100.40	100.40	0.08	5	18 040	10.52	0.36		426	2 000
УБРР БО1	01/10/13	29/09/15	100.01	100.50	100.50	0.20	1	3 000	12.10	0.75	616	597	2 000
Запсибкомбанк													
Запсибкомбанк БО1	21/12/12	20/06/14							0.03	1.43			2 000
Запсибкомбанк БО2	16/08/13	14/08/15	100.00	100.70	100.60		1	14 430	11.79	0.62	592	562	2 000
Российский Капитал													
РосКапитал 03	26/10/13	28/10/15	99.71	99.80	99.80	0.06	9	70 575	11.32	0.82	535	522	3 000
Татфондбанк													
Татфондбанк БО-3	28/11/13	27/11/14	99.92	99.95	99.95	-0.05	8	4 461	12.70	0.91	669	663	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	100.00	100.00	0.05	4	2 713	11.45	0.17		508	3 000
Татфондбанк 6	28/02/12	26/02/13	100.00	100.99	100.00	-0.17	1	1 980	10.42	0.19		406	2 000
Татфондбанк БО-5	09/04/13	07/04/15	99.80	99.95					11.52	0.30		524	2 000
Татфондбанк БО-6	15/10/13	13/10/15	100.31	100.35	100.35	-0.10	7	12 922	12.91	0.79	695	679	2 000
Татфондбанк БО-1	28/06/12	26/12/13							12.19	0.94	617	613	2 000
Татфондбанк БО-2	18/10/12	17/04/14	99.92	100.05	99.90	-0.20	2	10	12.72	1.24	659	673	2 000
Европлан													
Европлан 03	04/11/14	31/10/17							11.56	1.84	528	568	00000 000
РЕГИОНАЛЬНЫЕ													
МОСКВА													
Москва 61	03/06/13		102.02	104.30	104.30	0.20	3	110 825	5.41	0.44			30 000
Москва 53	01/09/13		99.10						6.95	0.68	105	80	15 000
Москва 63	10/12/13		108.15	108.80					5.75	0.92			15 000
Москва 62	08/06/14		107.70	108.45	108.00	-0.40	1	4	6.72	1.36	55	75	35 000
Москва 39	21/07/14		95.01	100.05					7.08	1.48	88	113	10 000
Москва 64	24/06/15								7.76	2.27	140	192	20 000
Москва 44	16/11/15		103.00		113.67		1	3	7.17	2.52	77	135	40 000
Москва 56	22/09/16		97.87	98.35					7.65	3.31	114	184	20 000
Москва 49	14/06/17		91.00	97.99					7.68	3.91	111	186	25 000
Москва 48	11/06/22		92.24	92.99	92.24	-0.66	2	7 374	7.88	7.00	108	179	30 000
МОСКОВСКАЯ ОБЛ													
Московская Обл 8	11/06/13		100.00	100.80	100.45	0.05	2	2	8.17	0.47		195	19 000
Московская Обл 7	16/04/14		99.75	99.80	99.75	-0.15	2	201	8.36	1.26	222	237	16 000
НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ													
Нижегородская Обл 6	07/10/15		99.30	99.75					8.46	1.65	222	254	5 000
Нижегородская Обл 7	16/11/16		102.50	102.83	102.80	-0.39	1	40 000	8.63	2.14	229	279	8 000
САМАРСКАЯ ОБЛ													
Самарская Обл 6	10/05/13		100.00	103.00					6.96	0.38		71	2 000
Самарская Обл 5	19/12/13		101.40	101.65					8.07	0.96	204	202	8 000
Самарская Обл 7	30/11/16		97.00	98.30	98.30	0.05	18	100 065	8.64	1.96	234	278	12 000
ЯКУТИЯ													
Якутия 1	11/04/13		99.87	100.30					7.15	0.30		87	3 000
Якутия 9	19/09/13		100.01	101.30					7.25	0.49		104	2 000
Якутия 7	17/04/14		99.30	100.35					8.25	1.18	214	224	3 000
КРАСНОДАРСКИЙ КРАИ													
Краснодарский край 2	14/12/12									0.00			2 000
Краснодар 02	05/11/15		100.05	100.20	100.20	-0.40	4	14 389	9.10	2.16	276	326	1 000
Краснодарский край 3	27/09/14		99.75	99.90	99.90	-0.10	5	5 622	8.28	1.20	216	228	4 000
КРАСНОЯРСКИЙ КРАИ													
Красноярский край 5	29/11/16		101.00	101.30	101.00		1	10	8.50	1.39	233	253	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	99.90	99.90	0.09	2	14 959	8.27	0.90	226	220	1 000
Коми Респ 9		18/10/14	98.58	99.50					8.48	1.26	234	249	2 000
Коми Респ 8		03/12/15	82.00	97.20					8.06	2.13	172	222	1 000
Коми Респ 10		15/12/16	100.00	101.30	100.15	-1.50	2	2 800	9.41	2.28	305	357	2 000
УДМУРТИЯ													
Удмуртия 05		24/11/16	103.55						8.41	2.42	202	258	2 000
КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Костромская область 5		20/12/12							-1.77	0.00			3 000
Костромская область 6		17/11/16	100.61	100.79	100.70		1	1 000	9.40	1.73	314	350	4 000
ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ													
Вологодская обл. 02		14/12/16	100.29	103.45	103.33	0.13	2	13 930	9.43	2.19	308	359	3 000
РЕСП КАРЕЛИЯ													
Карелия 14		30/11/16	100.31	103.00	101.65	-0.20	1	40 000	8.97	1.62	274	305	1 000
ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Ярославская Обл 9		16/05/13	100.26	100.30					7.42	0.40		117	3 000
Ярославская Обл 10		15/04/14	99.30	99.88					7.96	1.01	191	192	3 000
Ярославская Обл 11		21/08/15	100.80	100.95	100.85	0.15	9	62 045	8.72	2.08	239	287	3 000
РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Рязанская Обл 1		27/11/14		99.77					8.90	1.43	271	294	2 000
ХМАО													
ХМАО-Югра 7		20/12/12							-10.51	0.00			2 000
ХМАО-Югра 8		19/12/13	102.80	103.80					7.56	0.97	152	151	2 000
СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Свердловская обл. 01		11/12/16	101.20	101.80	101.20	-0.10	11	63 473	8.66	1.69	241	275	3 000
ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ													
Тверская Обл 6		12/06/14	103.50	104.20	103.85	-0.05	1	1 500	9.22	1.08	314	320	3 000
Тверская Обл 5		26/12/13							7.80	0.93	178	174	4 000
Тверская Обл 7		15/12/15	98.41	98.75	98.75	0.20	4	137	9.35	2.38	297	352	3 000

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



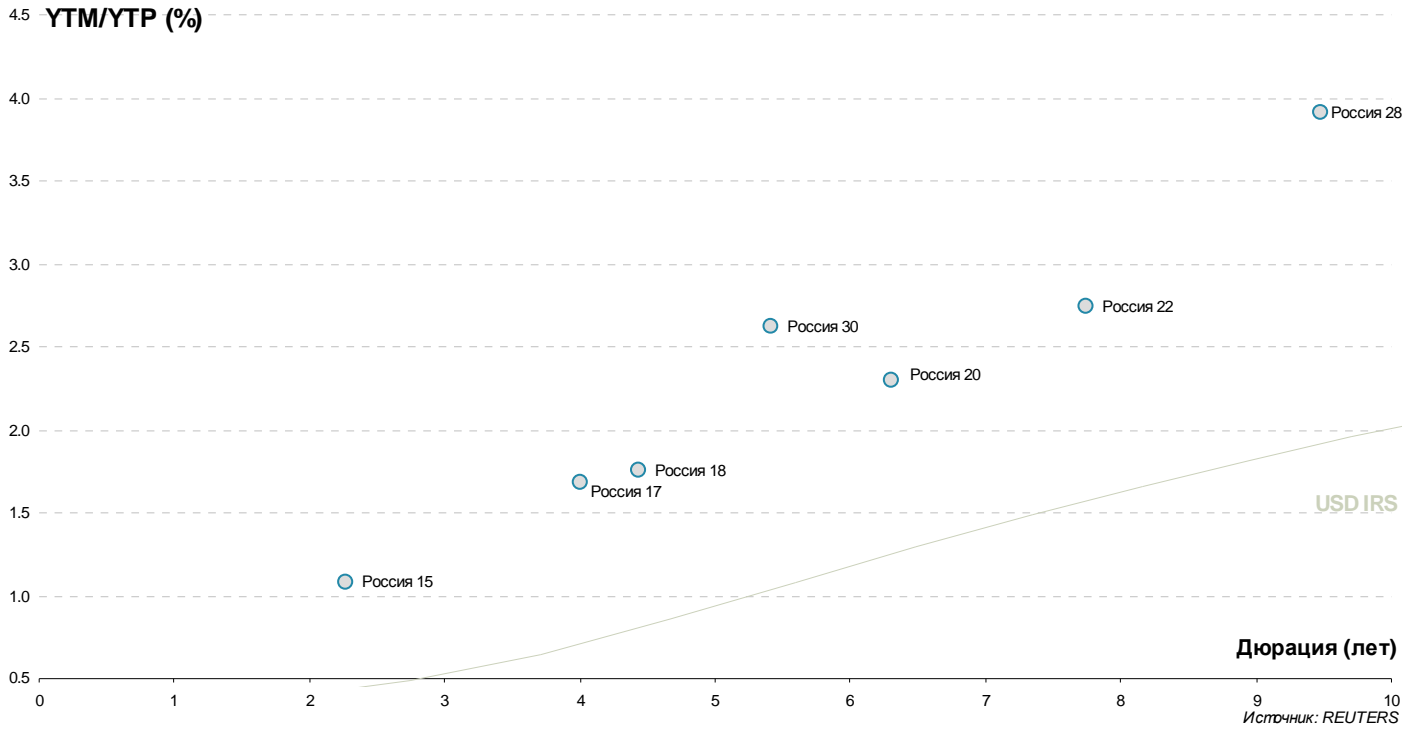
Результаты торгов евробондами

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

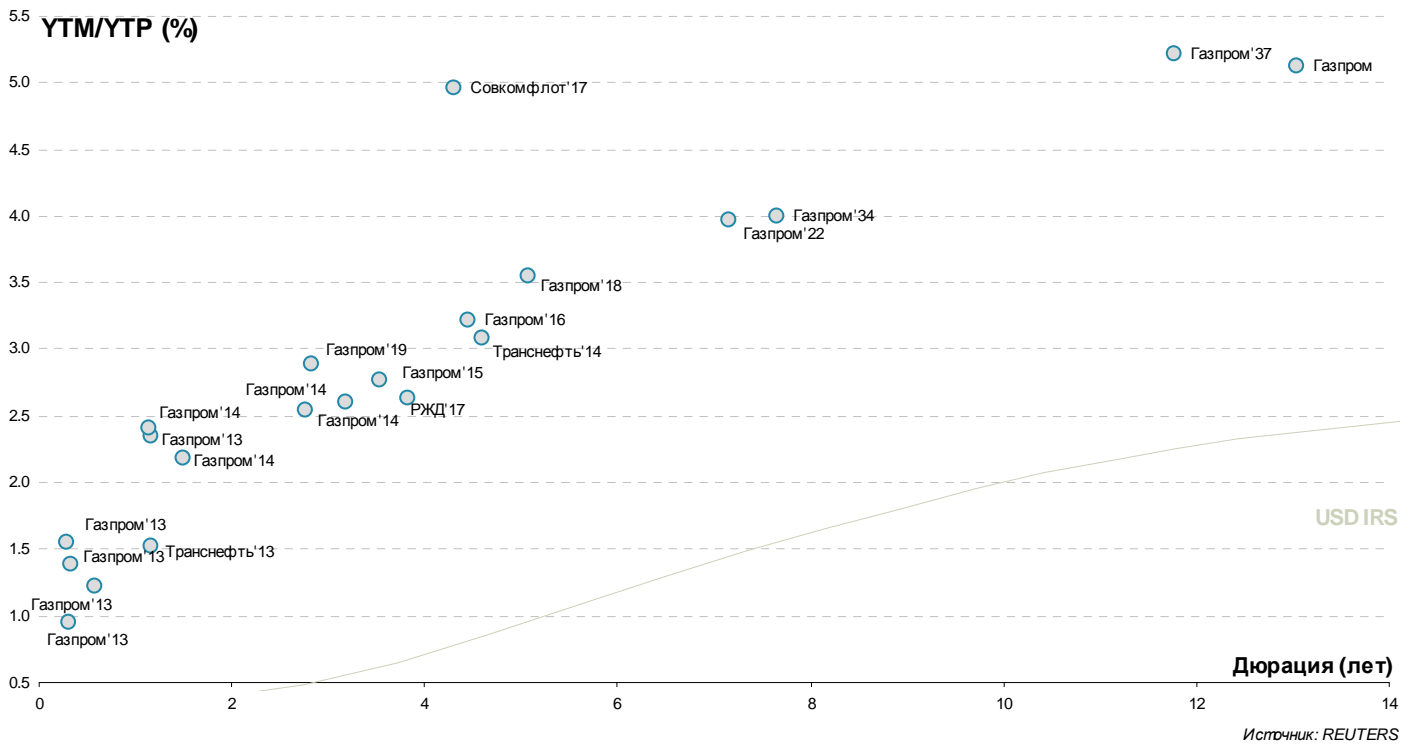
Выпуск	Валюта	Дата		Цена		Доходность		Дюрация	Изм-е, % (по покупке)	Z-спрэд
		Погашения		Покупка	Продажа	Покупка	Продажа			
ROSSELKH'14 7.125%	USD	14/01/14		105.191	105.245	2.12	2.07	1.01	-0.19	180
ROSSELKH'14 9%	USD	11/06/14		109.492	109.569	2.36	2.31	1.40	0.39	202
ROSSELKH'17 6.299%	USD	15/05/17		110.250	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

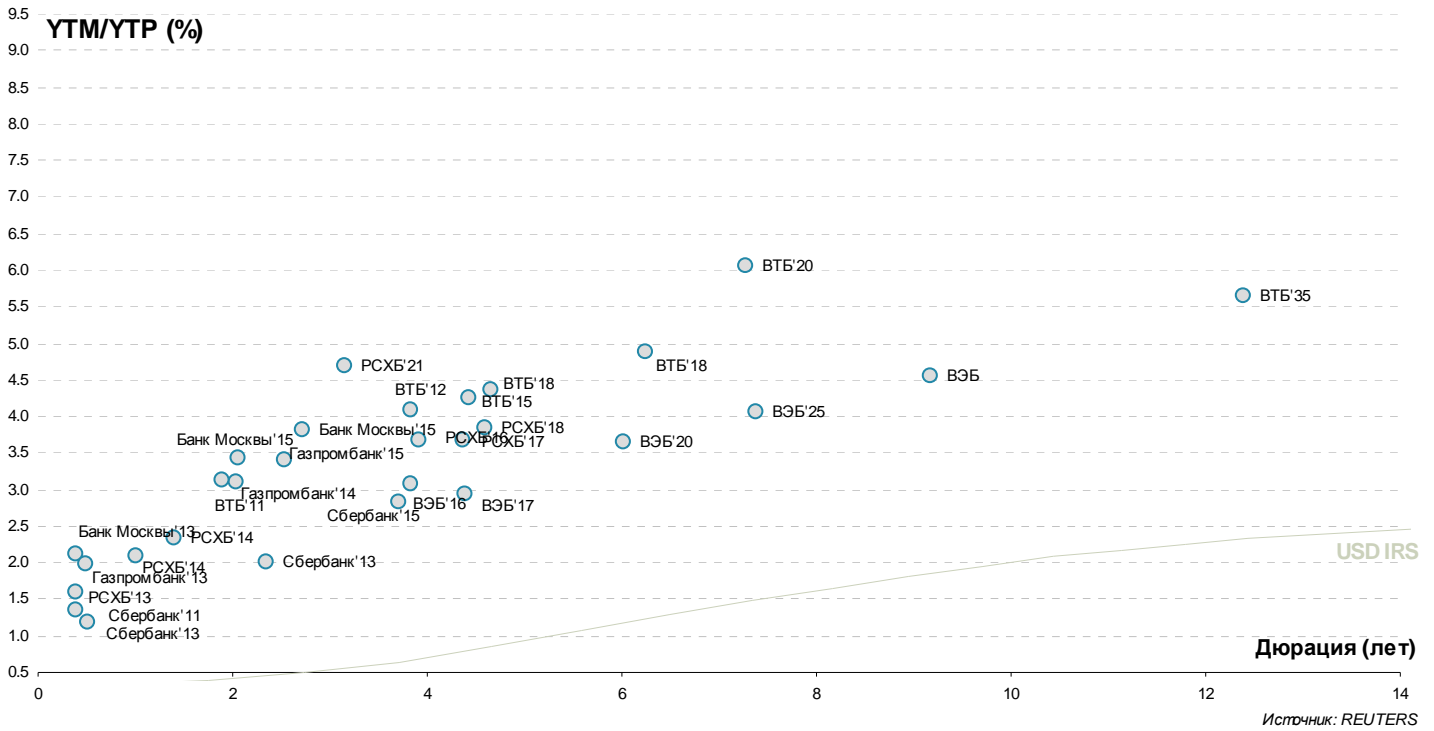
Россия



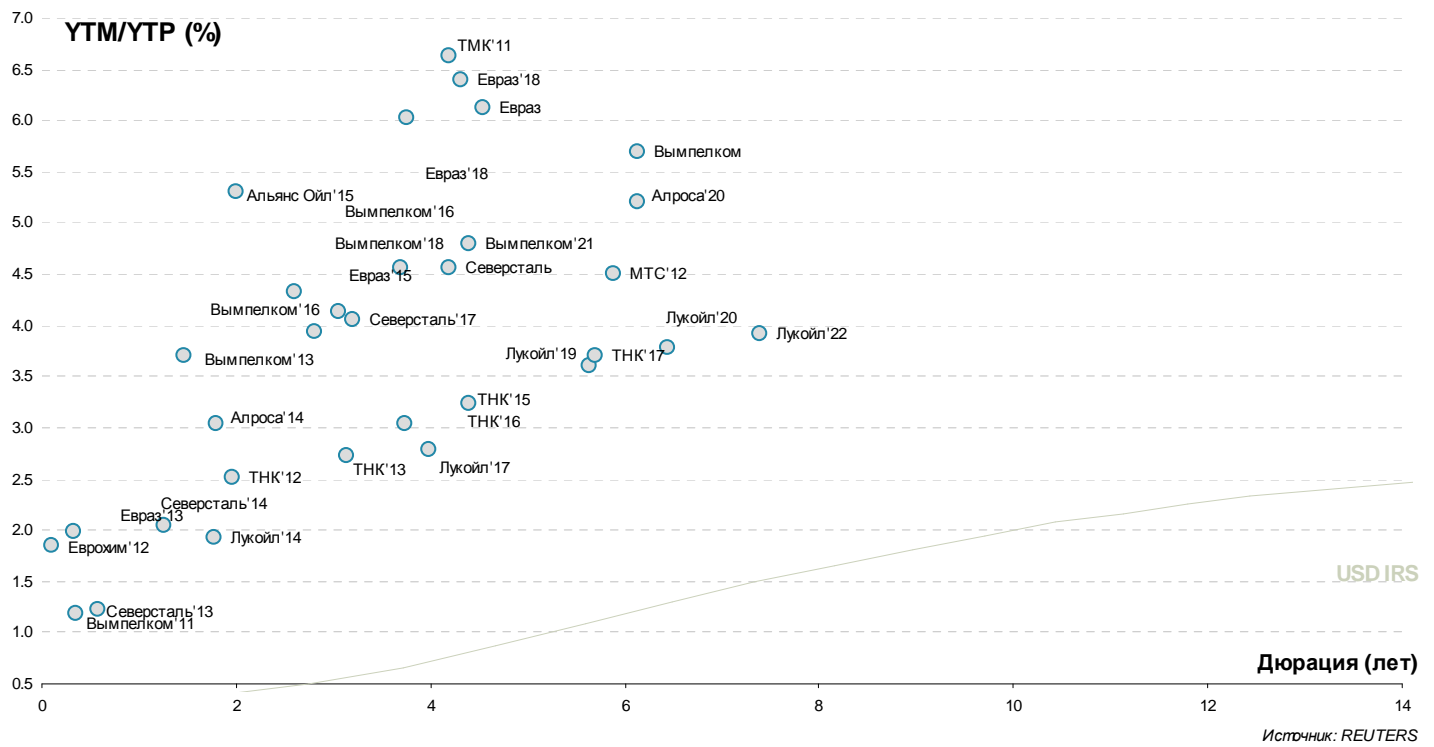
Госкомпании



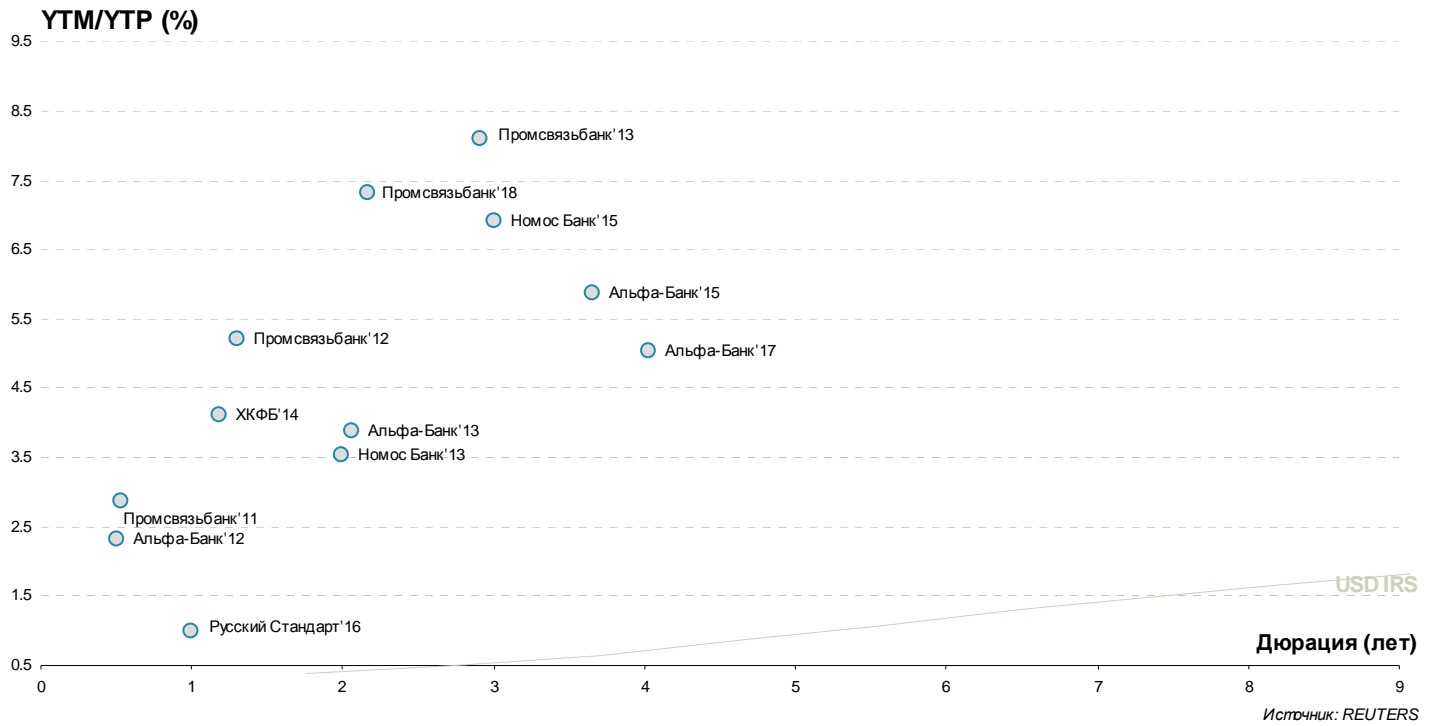
Госбанки



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

Макроэкономика
 Макроэкономика/кредитный анализ
 Кредитный анализ
 Количественный анализ
 Акции

Акции
 Облигации

Владимир Евстифеев
 Кирилл Сычев
 Евгений Чердаков
 Дмитрий Чепрагин
 Евгения Лобачева

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

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.