

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный обзор

Торговые идеи /стр. 2/

Внешний рынок долга /стр. 3/

- Рынки находятся в невесомости в ожидании новых сигналов

Денежно-кредитный рынок /стр. 4/

- Старт налогового периода привел к росту ставок МБК
- Рубль сохраняет нейтральную динамику

Российский долговой рынок /стр. 5/

- Евробонды завершили день «в минусе»
- Рублевый рынок малоактивен

Первичный рынок /стр. 6/

- Сегодня Газпром Капитал открыл книгу заявок на 3 выпуска облигаций общим объемом 30 млрд. руб.

Приложения

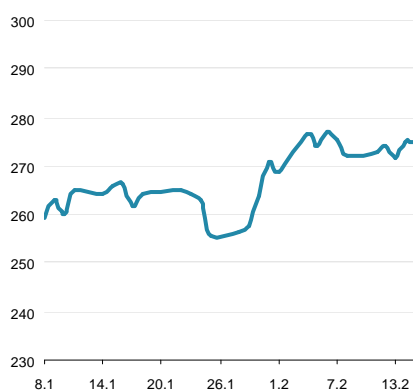
- Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ /стр. 8/
- Карты доходности рублевого рынка /стр. 20/
- Результаты торгов евробондами /стр. 21/
- Карты доходности рынка евробондов /стр. 24/

Динамика ключевых показателей

| | знач. | Δ за день | за 6 месяцев: | | |
|----------------------------|---------|-----------|---------------|-------|-------|
| | | | MIN. | MAX. | |
| Внешний рынок долга | | | | | |
| UST-10 yield | 2.00 | ▲ | 0.01 | 1.55 | 2.03 |
| UST 10-2Y sprd | 174 | ▲ | 0 | 133 | 175 |
| EMBI+ Glob. | 275 | ▼ | 0 | 245 | 325 |
| EMBI+ Rus sprd | 154 | ▲ | 6 | 114 | 211 |
| Russia 30 yield | 3.07 | ▲ | 0.04 | 2.51 | 3.29 |
| Денежный рынок | | | | | |
| Libor-3m | 0.29 | ■ | 0.00 | 0.29 | 0.44 |
| Euribor-3m | 0.23 | ▼ | 0.00 | 0.18 | 0.35 |
| MosPrime-1m | 6.30 | ▲ | 0.05 | 6.22 | 6.91 |
| Корсчета в ЦБ | 753.9 | ▲ | 9.2 | 446 | 1570 |
| Депоз. в ЦБ | 111.4 | ▼ | -16.8 | 66 | 403 |
| NDF RU 3m | 6.1 | ▲ | 0.1 | 6 | 7 |
| Валютный рынок | | | | | |
| USD/RUB | 30.119 | ▲ | 0.007 | 29.85 | 32.56 |
| EUR/RUB | 40.242 | ▲ | 0.092 | 39.50 | 40.88 |
| EUR/USD | 1.336 | ▼ | 0.000 | 1.23 | 1.36 |
| Корзина ЦБ | 34.663 | ▲ | 0.023 | 34.44 | 36.24 |
| DXU Индекс | 80.58 | ▲ | 0.122 | 78.85 | 82.60 |
| Фондовые индексы | | | | | |
| RTS | 1577.3 | ▲ | 0.1% | 1364 | 1636 |
| Dow Jones | 13981.8 | ▲ | 0.06% | 12542 | 14019 |
| DAX | 7593.5 | ▼ | -0.49% | 6895 | 7858 |
| Nikkei 225 | 11174 | ▲ | 2.09% | 8534 | 11464 |
| Shanghai Comp. | 2432.4 | ▼ | -0.42% | 1960 | 2434 |
| Сырьевые рынки | | | | | |
| Нефть Urals | 116.1 | ▼ | -0.10% | 105 | 117 |
| Нефть Brent | 117.7 | ▲ | 0.11% | 106 | 119 |
| Золото | 1610.1 | ▲ | 0.40% | 1610 | 1790 |
| CRB Index | 298.5 | ▼ | -0.41% | 291 | 321 |

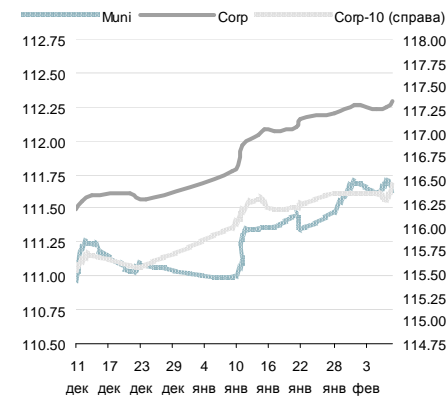
Источник: Reuters, Bloomberg, ЦБ

EMBI+ Global Sovereign Spread



Источник: JPM

Ценовые индексы ZETBI



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индексов ZETBI

| | знач. | Δ за день | за 6 месяцев: | | |
|---|-------|-----------|---------------|-------|-------|
| | | | MIN. | MAX. | |
| Price Return | | | | | |
| OFZ | 125.2 | ▲ | 0.38 | 107.5 | 126.0 |
| Muni | 111.6 | ▼ | -0.06 | 109.6 | 112.4 |
| Corp | 112.3 | ▲ | 0.04 | 110.7 | 112.3 |
| Corp-10 | 116.4 | ▲ | 0.15 | 115.0 | 117.1 |
| Total Return | | | | | |
| OFZ | 289.7 | ▲ | 0.90 | 233.3 | 290.5 |
| Muni | 358.6 | ▼ | -0.10 | 328.7 | 358.7 |
| Corp | 356.7 | ▲ | 0.21 | 329.1 | 359.2 |
| Corp-10 | 359.2 | ▲ | 0.52 | 331.3 | 359.2 |
| Объем торгов в сегменте (млн руб.) | | | | | |
| OFZ | 673 | ▼ | -1890 | 0 | 21838 |
| Muni | 1344 | ▲ | 618 | 10 | 5492 |
| Corp | 6974 | ▼ | -2752 | 19 | 23593 |

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Торговые идеи

ЛОКАЛЬНЫЕ ВЫПУСКИ

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Цена послед. сделки | УТР/УТМ | Дюрация | Комментарий |
|-----------------------|-------------------|---------------------|---------|---------|--|
| НПК, БО-01 | - / Ba3 / - | 102.10 | 8.98 | 1.81 | Спрэд 40-50 бп к выпускам рейтинговой категории В+/ВВ-, сильные операционные и кредитные показатели |
| НПК, БО-02 | | 102.17 | 9.10 | 1.81 | |
| О'Кей, 02 | - / - / В+ | 101.10 | 9.82 | 2.49 | Новое предложение среди компаний потребительского сектора, премия свыше 40 бп к бумагам X5 при одинаковых рейтингах |
| ЛенСпецСМУ, 02 | В / - / - | 102.10 | 12.70 | 3.03 | Один из самых доходных выпусков строительного сектора, с учетом сопоставимого кредитного качества, премию свыше 160 бп к кривой ЛСР лишь за более длинную дюрацию считаем избыточной |
| Промсвязьбанк, БО-07 | - / Ba2 / ВВ- | 101.01 | 9.29 | 1.41 | 390 бп к ОФЗ - слишком широкий спрэд для банка категории Ba2/ВВ- |
| Роснефть, 04 | ВВВ- / Baa1 / ВВВ | 103.45 | 7.86 | 3.87 | Наиболее ликвидное предложение среди качественных корпоративных заемщиков с госучастием: спрэд к ОФЗ на уровне 160-170 бп |
| Роснефть, 05 | | 103.45 | 7.81 | 3.87 | |
| ГТЛК, 01 | ВВ- / - / - | 101.25 | 9.92 | 2.60 | На текущий момент - наиболее доходное предложение среди финансовых компаний с госучастием на рынке |
| Русфинанс Банк, БО-03 | - / Ba1 / ВВВ+ | 102.20 | 8.79 | 1.57 | Спрэд около 300 бп к ОФЗ слишком широкий для рейтинговой категории ВВВ, премия около 30 бп к спредам Росбанка с аналогичным рейтингом |

Данные в таблице по состоянию на 15.02.2013

ЕВРООБЛИГАЦИИ

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Цена послед. сделки | УТМ | Дюрация | Комментарий |
|-----------------|------------------|---------------------|------|---------|--|
| VTB'17 | ВВВ / Baa1 / ВВВ | 108.03 | 3.88 | 3.68 | Выпуски ВТБ предлагают лучшую доходность среди старших выпусков в сегменте госбанков, предлагая дополнительные 100 бп над спредами ВЭБа и Сбербанка при одинаковых кредитных рейтингах |
| VTB'18 (6.315) | | 109.45 | 4.20 | 4.28 | |
| VTB'18 (6.875) | | 111.48 | 4.41 | 4.50 | |
| VTB'20 | | 110.81 | 4.84 | 6.10 | |
| RUSB'17 | В+ / Ba3 / В+ | 107.69 | 7.17 | 3.70 | Старший выпуск предлагает достаточно высокую доходность, торгуясь на уровне суборда HCFBRU'20 |
| CRBKMO'14 | - / B1 / ВВ- | 103.87 | 5.45 | 1.40 | Выпуск интересен для buy&hold с учетом короткой дюрации и предлагаемой доходности |
| GPBRU'19 (sub) | ВВ+ / Ba1 / - | 109.27 | 5.46 | 5.06 | Интересная идея в сегменте субординированного долга: выпуск все еще сохраняет потенциал сужения спреда к старшему выпуску GPBRU'17 на уровне 25 бп |
| ВKMOSC'17 (sub) | - / Ba3 / ВВВ- | 104.32 | 4.87 | 3.74 | Выпуск предлагает спрэд, сопоставимый с субордами материнского ВТБ, обеспечивая более высокую доходность при меньшей дюрации |
| EVRAZ'17 | В+ / B1 / ВВ- | 107.08 | 5.48 | 3.61 | Спреды выпусков к Северстали по-прежнему достаточно широки, при этом потенциал сужения мы оцениваем на уровне 50 бп за счет консолидации в отчетность Распадской с 2013 г. и улучшения конъюнктуры на рынке стали. |
| EVRAZ'18 (9.5) | | 115.71 | 5.93 | 4.18 | |

Данные в таблице по состоянию на 15.02.2013

Примечание:

15.01.2013 исключен выпуск SCFRU'17. За последний месяц выпуск подорожал почти на 4 фигуры, а спрэд SCFRU'17 к выпуску РЖД RURAIL'17 опустился ниже отметки 140 бп, что, на наш взгляд, близко к справедливому уровню и, вероятно, ограничивает краткосрочный потенциал роста цен "выше рынка". В то же время, SCFRU'17 по-прежнему сохраняет привлекательность в рамках консервативной стратегии buy&hold.

08.02.2013 исключен выпуск ОТП-Банк, БО-01. За последний месяц выпуск подорожал более чем на 100 бп, а его спрэд к ОФЗ сузился примерно до уровня Промсвязьбанка, что, на наш взгляд, делает бумаги последнего более интересной покупкой.

08.02.2013 исключен выпуск ВЭБ-Лизинг, 06. За последний месяц цена выпуска выросла более чем на 100 бп, в результате его спрэд к материнскому ВЭБу сократился до минимальных значений. В то же время в сегменте гос. лизинговых компаний появились выпуски ГТЛК, спреды которых выглядят достаточно широко.

Внешний рынок долга

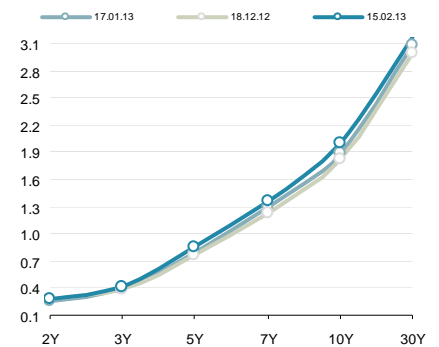
Рынки находятся в невесомости в ожидании новых сигналов

Неделя на глобальных площадках завершилась нейтрально. Отсутствие важных новостей лишает рынки любых драйверов для последующей динамики. Накопившийся потенциал для коррекционного движения пока не реализуется, поскольку серьезных поводов для такого поведения нет. Впрочем, и позитивные по характеру строчки новостных лент не воодушевляют инвесторов. Выжидательная позиция, возможно, связана с тем, что впереди у рынков сохраняется две интригующих даты: 24 февраля и 1 марта. Первая – это парламентские выборы в Италии, где, судя по соцопросам, отрыв фаворита рынков Пьера Луиджи Берсани от бывшего премьера Сильвио Берлускони сохраняется минимальным. Это создает угрозу того, что предпринятые Марио Монти антикризисные шаги по ограничению расходов бюджета могут быть смягчены в случае победы Берлускони.

В США ключевой остается дата 1 марта, когда вступит в силу автоматическое сокращение расходов бюджета, если чиновники в Конгрессе не смогут договориться о переносе этой даты на более поздний срок. Республиканцы оценивают, что требуемое до сентября сокращение расходов на 85 млрд долл. приведет к снижению темпов роста ВВП на 0.6 пп, однако это является необходимым для оздоровления экономики. В свою очередь, демократы на прошлой неделе внесли в Сенат новый проект секвестра, подразумевающий более мягкое сокращение расходов, а дефицит бюджета планируется сокращать за счет повышения налоговой нагрузки на богатых американцев и снижения расходов на оборону. Даже если Сенат, в котором по числу голосов лидируют демократы, примет этот законопроект, шансы на его одобрение Конгрессе крайне невысоки. До запуска секвестра осталось всего 2 недели, и, учитывая четкую позицию консерваторов, мала вероятность того, что демократы смогут вновь «выбить» отсрочку.

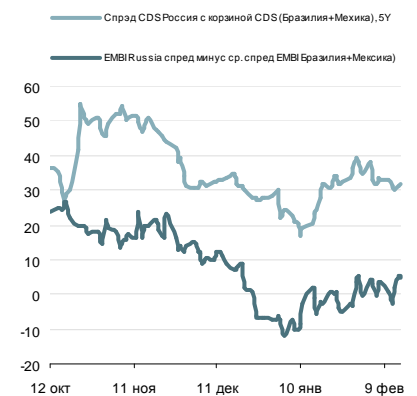
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Кривая US Treasuries



Источник: Reuters

Спрэды EMBI+ (Россия, Бразилия)



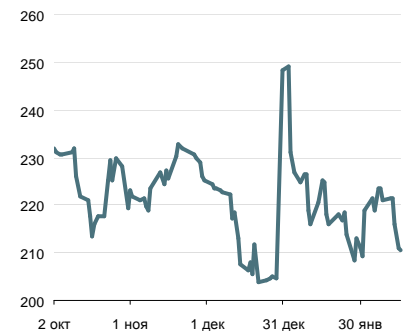
Источник: Bloomberg

Спрэд Россия-30 / UST-10Y



Источник: Reuters

Спрэд Russia EMBI Corp/Sovereign



Источник: Reuters

Денежно-кредитный рынок

Старт налогового периода привел к росту ставок МБК

Условия локального денежно-кредитного рынка продолжили ухудшаться в пятницу в ответ на старт налогового периода февраля при сохранении жестких лимитов ЦБ РФ на аукционах прямого репо. Как итог, уровень краткосрочных процентных ставок продолжил повышаться: 3-дневных кредиты на рынке МБК обходились в среднем под 5.95% годовых (+25 бп), междилерское репо с облигациями через выходные – под 5.90% годовых (+20 бп). На аукционах прямого репо банкам удалось привлечь лишь 100 млрд руб. на 3 дня при спросе в 193 млрд руб. Сегодня утром сумма средств на корсчетах и депозитах банков в ЦБ РФ сократилась на 7.8 млрд руб. до 865.3 млрд руб.

На текущей неделе налоговый период продолжится, в среду предстоит завершить платежи по НДС, которые потребуют еще около 70 млрд руб. из банковской системы. Учитывая ограничительную политику ЦБ по предоставлению банкам ликвидности, повышенный уровень краткосрочных процентных ставок может сохраниться на текущей неделе.

Рубль сохраняет нейтральную динамику

Торги на валютном рынке в пятницу прошли негативно для рубля, курс бивалютной корзины поднялся по итогам дня наб коп. до отметки 34.70 руб. Усиление дефицита рублей на внутреннем денежном рынке не отразилось на поведении рубля, а определяющими остались внешние факторы. В частности спрос на риск был невелик, а котировки нефти в течение дня опускались к локальным минимумам. Так, цена барреля Brent в пятницу снижалась до 116.5 долл., однако к концу дня вернулась на 111.70 долл. Рубль остается аморфным и слабо реагирует на любые раздражители. Ситуацию может изменить поведение нефтяных котировок: укрепление рубля до 34.00-34.50 руб. за корзину потребует роста цены барреля нефти до 120 долл. за барр.

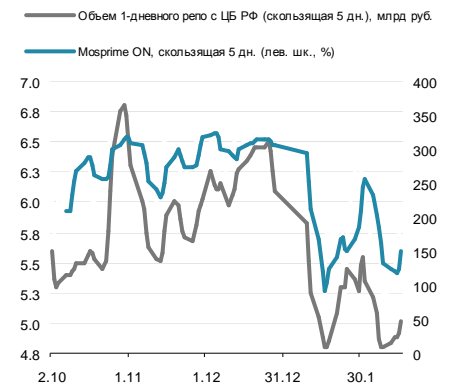
Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

| 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 | | |
| Вторник | Аукцион Казначейства | 7 дней, 10 млрд руб., от 5.6% годовых |
| Среда | Аукцион ОФЗ | -ОФЗ 26210 (7 лет) 20 млрд руб. -ОФЗ 26207 (15 лет), 10 млрд руб. |
| | Купоны ОФЗ | 5.8 млрд руб. |
| | Возврат в бюджет | 10 млрд руб. |
| | Уплата налогов | НДС, 1/3 за IV квартал (~170 млрд руб.) |
| Четверг | Аукцион Казначейства | 7 дней, 10 млрд руб., от 5.6% годовых |
| Пятница | Возврат в бюджет | 10 млрд руб. |

Источник: ЦБ РФ, Минфин, Фонд ЖКХ

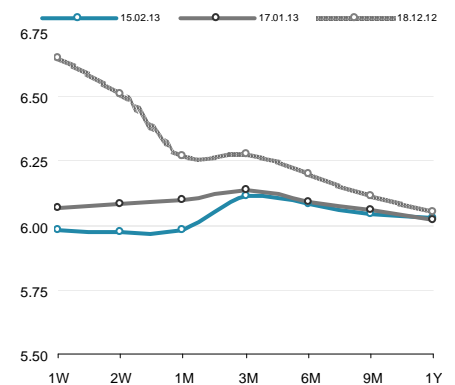
Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ставки МБК и репо с ЦБ РФ



Источник: Reuters, ЦБ

Кривая NDF



Источник: Reuters

Российский долговой рынок

Евробонды завершили день «в минусе»

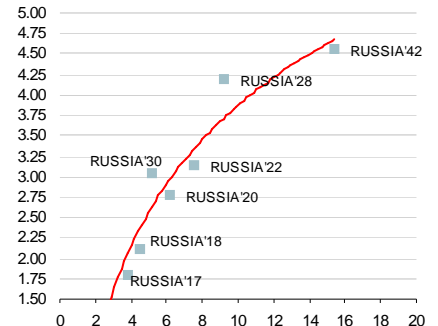
Спрос на российский риск в пятницу оставался слабым. Суверенные бумаги дешевели вслед за UST и потеряли в ценах порядка 20 бп, незначительно расширив спреды. Корпоративный сектор также шел вниз по ценам, потеряв в среднем по рынку чуть более 10 бп. Основные движения были сосредоточены внутри сектора госбанков, где около 50 бп потеряли суборды ВТБ, а дальние выпуски ВЭБа подешевели на 80-100 бп.

Рублевый рынок малоактивен

Локальный рынок завершил неделю в спокойном режиме. Котировки дальних ОФЗ колебались в районе нулевых изменений, а основная торговая активность сохранилась ближе к началу кривой. В корпоративном секторе спрос был замечен в бумагах Русал 07, который прибавил в ценах порядка 25 бп, а также в новых 5-летних выпусках Металлоинвеста, завершивших день на отметке 100.20%.

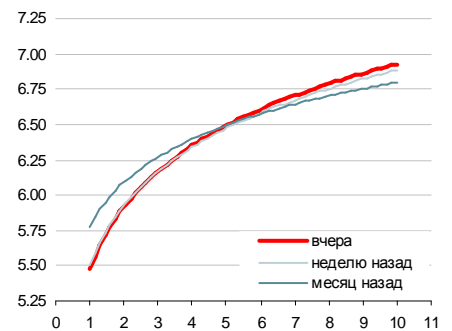
Кирилл Сычев
k.sychev@zenit.ru

Суверенные еврооблигации



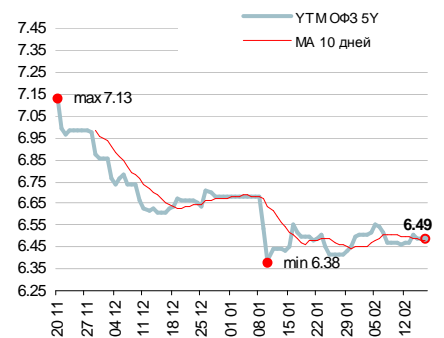
Источник: Reuters

Кривая ОФЗ



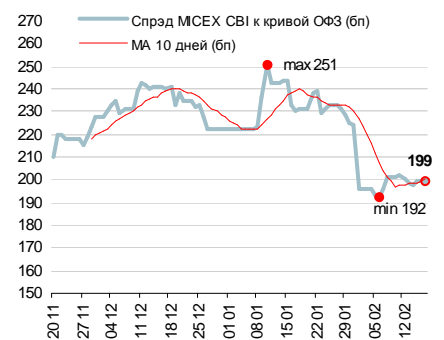
Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Доходности кривой ОФЗ в точке 5 лет



Источник: Reuters, расчеты Банка ЗЕНИТ

Спред индекса корп. облигаций ММВБ к кривой ОФЗ



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Первичный рынок

Первичный рынок

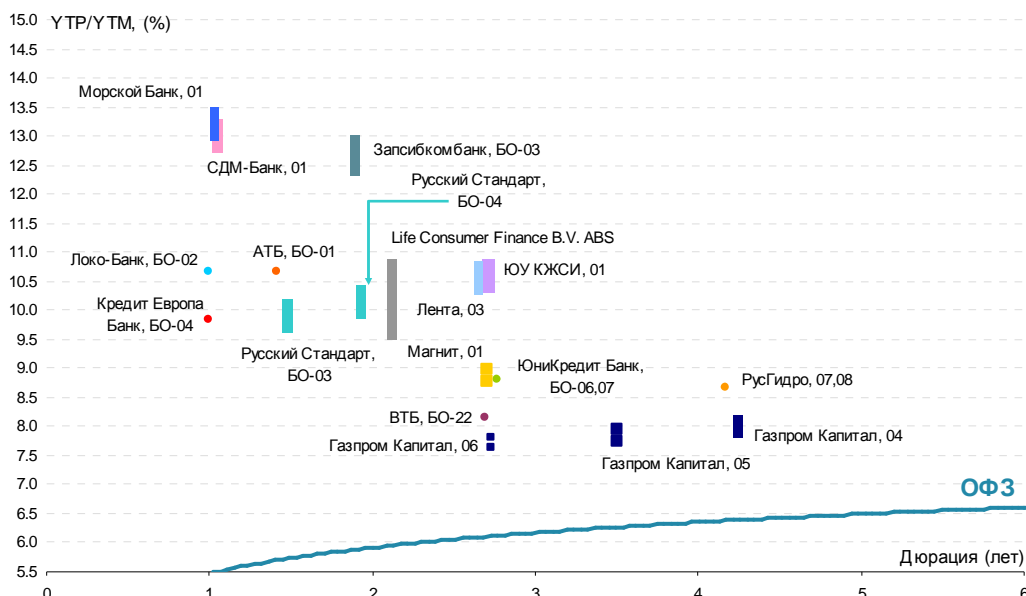
| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Возможность включения в Ломбард ЦБ | Объем размещения, млн. руб. | Ориентир УТР/УТМ, % годовых | Закрытие книги | Дата размещения | Амортизация/Дюрация | Оферта/ Погашение |
|---------------------------------|------------------|------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|-----------------|---------------------|-------------------|
| АТБ, БО-01 | - / B2 / - | да | 3 000 | 10.67 | 14.02.2013 | 19.02.2013 | нет / 1.42 г. | 1.5 г. / 3 г. |
| Кредит Европа Банк, БО-04 | - / Va3 / BB- | да | 5 000 | 9.83 | 15.02.2013 | 19.02.2013 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| ВТБ, БО-22 | BBB / Aaa1 / BBB | да | 15 000 | 8.14 | 15.02.2013 | 19.02.2013 | нет / 2.69 г. | нет / 3 г. |
| РЕСО-Лизинг, 01 | NR | нет | 2 500 | н/д | 18.02.2013 | 20.02.2013 | да / н/д | н/д / 3 г. |
| Газпром Капитал, 04 | NR | нет | 5 000 | 7.85-8.11 | 19.02.2013 | 21.02.2013 | нет / 4.22 г. | нет / 5 лет |
| Газпром Капитал, 05 | NR | нет | 10 000 | 7.74-7.95 | 19.02.2013 | 21.02.2013 | нет / 3.51 г. | нет / 4 г. |
| Газпром Капитал, 06 | NR | нет | 15 000 | 7.64-7.80 | 19.02.2013 | 21.02.2013 | нет / 2.73 г. | нет / 3 г. |
| Магнит, 01 | BB- / - / - | да | 5 000 | 8.78-8.99 | 20.02.2013 | 26.02.2013 | нет / 2.70 г. | нет / 3 г. |
| ЮУ КЖСИ, 01 | - / - / BB+ | да | 2 500 | 10.25-10.78 | 22.02.2013 | 26.02.2013 | нет / 2.65 г. | нет / 3 г. |
| Русский Стандарт, БО-03 | B+ / Va3 / B+ | да | 3 000 | 9.62-10.15 | 22.02.2013 | 26.02.2013 | нет / 1.43 г. | 1.5 г. / 3 г. |
| Русский Стандарт, БО-04 | B+ / Va3 / B+ | да | 3 000 | 9.88-10.41 | 22.02.2013 | 26.02.2013 | нет / 1.86 г. | 2 г. / 3 г. |
| Запсибкомбанк, БО-03 | B+ / - / - | да | 2 000 | 12.25-12.89 | 26.02.2013 | 28.02.2013 | нет / 1.83 г. | 2 г. / 3 г. |
| СДМ-Банк, 01 | - / - / B | да | 1 500 | 12.63-13.16 | 27.02.2013 | 01.03.2013 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| Морской Банк, 01 | - / B2 / - | да | 1 500 | 12.89-13.42 | XX.02.2013 | XX.02.2013 | нет / 1 г. | 1 г. / 3 г. |
| Лента, 03 | B+ / B1 / - | да | 4 000 | 10.25-10.78 | 01.03.2012 | 05.03.2012 | нет / 2.65 г. | 3 г. / 7 лет |
| Life Consumer Finance B.V., ABS | BBB / - / - | да | 3 200 | 9.58-10.65 | 05.03.2012 | XX.03.2013 | да / 2.15 г. | нет / 4 г. |

Цвета выделены выпуски, по которым идет сбор заявок

Источник: Interfax, Bloomberg, Cbonds

Последние размещения

| Выпуск | Рейтинг, S&P/M/F | Возможность включения в Ломбард ЦБ | Объем размещения, млн. руб. | Bid cover/ Размещ объем | Ориентир УТР/УТМ, % годовых | Фактическая УТР/УТМ, % годовых | Дата размещения | Амортизация/ Дюрация |
|----------------------------------|------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------|----------------------|
| Юникредит Банк, БО-06 | BBB / - / BBB+ | да | 5 000 | н/д / 100% | 8.89-9.10 | 8.79 | 14.02.2013 | нет / 2.7 г. |
| Юникредит Банк, БО-07 | BBB / - / BBB+ | да | 5 000 | н/д / 100% | 8.89-9.10 | 8.79 | 14.02.2013 | нет / 2.7 г. |
| РусГидро, 07 | BB+ / Va1 / BB+ | да | 10 000 | 1.0 / 100% | 8.68-8.94 | 8.68 | 14.02.2013 | нет / 4.17 г. |
| РусГидро, 08 | BB+ / Va1 / BB+ | да | 10 000 | 1.0 / 100% | 8.68-8.94 | 8.68 | 14.02.2013 | нет / 4.17 г. |
| Локо-Банк, БО-02 | - / B2 / B+ | да | 4 000 | 1.4 / 100% | 10.51-11.04 | 10.67 | 14.02.2013 | нет / 1 г. |
| Восточный Экспресс, 02 (суборд.) | - / B1 / - | да | 4 500 | н/д / 100% | 13.85-14.38 | 14.06 | 14.02.2013 | нет / 4 г. |
| МОЭСК, БО-03 | BB- / Va2 / - | да | 5 000 | н/д / 100% | 8.84 | 8.68 | 13.02.2013 | нет / 2.70 г. |
| Башнефть, 06 | - / Va2 / BB | да | 10 000 | 1.2 / 100% | 8.68-8.89 | 8.84 | 12.02.2013 | нет / 4.15 г. |
| Башнефть, 08 | - / Va2 / BB | да | 5 000 | 1.2 / 100% | 8.68-8.89 | 8.84 | 12.02.2013 | нет / 4.15 г. |
| Башнефть, 07 | - / Va2 / BB | да | 10 000 | 1.2 / 100% | 8.89-9.15 | 9.05 | 12.02.2013 | нет / 5.35 г. |
| Башнефть, 09 | - / Va2 / BB | да | 5 000 | 1.2 / 100% | 8.89-9.15 | 9.05 | 12.02.2013 | нет / 5.35 г. |



Первичный рынок

Сегодня Газпром Капитал открыл книгу заявок на 3 выпуска облигаций общим объемом 30 млрд. руб.

Вниманию инвесторов предлагаются 3-хлетний займ на 15 млрд. руб., 4-хлетний – на 10 млрд. руб. и 5-летний выпуск на 5 млрд. руб. Эмитентом бумаг выступает SPV-компания Газпром Капитал, поручителем – Газпром (BBB/Vaa1/BBB). Ожидается, что новым выпускам будет присвоен групповой рейтинг от всех 3-х агентств, что позволит включить бумаги в Ломбардный список и список РЕПО ЦБ. Новые выпуски предлагают спрэд около 150 бп к кривой ОФЗ по нижней границе маркетизируемого диапазона доходности, что соответствует среднему спрэду по бумагам РЖД (BBB/Vaa1/BBB). С учетом того, что единственный ликвидный выпуск Газпром А11 (YTM 6.92/D 1.26 г.) торгуется сейчас с премией свыше 120 бп к суверенной кривой, новые рублевые бумаги Газпрома выглядят достаточно привлекательно, предлагая около 30 бп премии к вторичному рынку уже по нижней границе ориентира. В то же время, как в рамках нефтегазового сектора, так и среди инфраструктурных компаний, на наш взгляд, есть более привлекательные предложения. Среди первых отметим недавно размещенные выпуски Роснефти (BBB-/Vaa1/BBB) – Роснефть 04/05 (YTP 7.85/D 3.88 г.) – торгующиеся со спрэдом около 170 бп к ОФЗ и характеризующихся наибольшей ликвидностью среди бумаг эмитентов нефтегазового сектора. Среди инфраструктурных компаний отметим ликвидные выпуски ФСК (BBB/Vaa2/-): ФСК 21 (YTP 7.88/D 3.51 г.) и ФСК 25 (YTP 7.87/D 3.10 г.) – также предлагающие премию 170-180 бп к ОФЗ.

Евгений Чердаков
e.cherdakov@zenit.ru

Основные параметры выпусков

| | |
|--------------------------------|---|
| Эмитент | ООО «Газпром Капитал» |
| Поручитель | ОАО «Газпром» |
| Рейтинг Группы | BBB / Vaa1 / BBB |
| Рейтинг выпусков (планируемый) | BBB / Vaa1 / BBB |
| Ломбардный список ЦБ | Соответствует требованиям |
| Тип размещения | Букбилдинг |
| Закрытие книги | 19 февраля 2013 г. |
| Размещение на ФБ ММВБ | 21 февраля 2013 г. |
| Организаторы | ВТБ Капитал, Газпромбанк, Ренессанс Капитал |
| Агент по размещению | ВТБ Капитал |
| Серия | 04 |
| Объем выпуска | 5 000 млн. руб. |
| Срок обращения | 5 лет |
| Купонный период | 182 дня |
| Ориентир по купону | 7.70-7.95% годовых |
| Ориентир по YTM | 7.85-8.11% годовых |
| Дюрация | 4.22 года |
| Серия | 05 |
| Объем выпуска | 10 000 млн. руб. |
| Срок обращения | 4 года |
| Купонный период | 182 дня |
| Ориентир по купону | 7.60-7.80% годовых |
| Ориентир по YTM | 7.74-7.95% годовых |
| Дюрация | 3.51 года |
| Серия | 06 |
| Объем выпуска | 15 000 млн. руб. |
| Срок обращения | 3 года |
| Купонный период | 182 дня |
| Ориентир по купону | 7.50-7.65% годовых |
| Ориентир по YTM | 7.64-7.80% годовых |
| Дюрация | 2.73 года |

Источник: Данные Организаторов, расчеты Банка ЗЕНИТ

Результаты торгов рублевыми облигациями на ММВБ

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | Объем млн руб. | |
|------------|--------|-----------|-----------|---------------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|----------------|---------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| ОФЗ | | | | | | | | | | | | | |
| ОФЗ 25065 | | 27/03/13 | | 100.71 100.85 | 100.85 | -0.03 | 21 | 246 730 | 4.22 | 0.11 | | да | 46 000 |
| ОФЗ 26200 | | 17/07/13 | | 100.41 100.45 | 100.45 | -0.05 | 6 | 240 325 | 5.09 | 0.41 | | да | 50 000 |
| ОФЗ 26201 | | 16/10/13 | | 100.70 101.00 | 101.00 | 0.13 | 3 | 1 082 | 5.11 | 0.65 | | да | 47 000 |
| ОФЗ 25076 | | 13/03/14 | | 101.57 101.60 | 101.60 | | 13 | 83 543 | 5.61 | 1.02 | | да | 155 000 |
| ОФЗ 25068 | | 20/08/14 | | 108.95 109.47 | 109.06 | 0.06 | 11 | 7 011 | 5.73 | 1.36 | | да | 45 000 |
| ОФЗ 26202 | | 17/12/14 | | 109.35 109.55 | 109.50 | 0.01 | 18 | 203 103 | 5.83 | 1.67 | | да | 40 000 |
| ОФЗ 25071 | | 26/11/14 | | 103.79 103.93 | 103.93 | 0.03 | 3 | 15 115 | 5.82 | 1.67 | | да | 80 000 |
| ОФЗ 25079 | | 03/06/15 | | 102.30 102.35 | 102.33 | 0.03 | 5 | 324 091 | 5.98 | 2.14 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 25075 | | 15/07/15 | | 102.00 102.18 | 102.10 | -0.10 | 3 | 33 668 | 6.02 | 2.25 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 25077 | | 20/01/16 | | 103.65 103.74 | 103.65 | | 9 | 260 842 | 6.06 | 2.68 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46017 | | 03/08/16 | | 100.35 100.45 | 100.40 | 0.10 | 2 | 56 058 | 6.30 | 2.72 | | да | 80 000 |
| ОФЗ 26203 | | 03/08/16 | | 102.70 103.00 | | | | | 6.03 | 3.14 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 48001 | | 31/10/18 | | 92.00 98.00 | | | | | 7.61 | 3.31 | | да | 24 000 |
| ОФЗ 46019 | | 20/03/19 | | | | | | | 6.84 | 3.22 | | да | 26 000 |
| ОФЗ 25080 | | 19/04/17 | | 104.90 105.00 | 104.90 | -0.25 | 2 | 7 948 | 6.14 | 3.61 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 26206 | | 14/06/17 | | 104.89 105.05 | 105.05 | 0.21 | 2 | 2 | 6.15 | 3.76 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 26204 | | 15/03/18 | | 106.45 106.55 | 106.35 | -0.30 | 2 | 112 | 6.12 | 4.22 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46021 | | 08/08/18 | | 95.30 95.50 | 95.30 | 0.05 | 1 | 10 000 | 6.55 | 4.40 | | да | 107 000 |
| ОФЗ 25081 | | 31/01/18 | | 100.95 100.95 | 100.95 | | 2 | 2 | 6.07 | 4.32 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46014 | | 29/08/18 | | 102.35 | | | | | 6.58 | 4.39 | | да | 62 000 |
| ОФЗ 26208 | | 27/02/19 | | 105.94 106.15 | 106.15 | 0.20 | 4 | 716 | 6.36 | 4.85 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46005 | | 09/01/19 | | | | | | | 6.61 | 5.19 | | да | 27 000 |
| ОФЗ 26210 | | 11/12/19 | | 102.05 102.25 | 102.20 | -1.37 | 2 | 2 016 | 6.50 | 5.53 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46018 | | 24/11/21 | | 99.30 99.45 | 99.40 | -0.00 | 4 | 2 731 | 6.91 | 6.07 | | да | 133 000 |
| ОФЗ 26205 | | 14/04/21 | | 106.84 107.05 | 106.84 | -0.06 | 4 | 48 | 6.61 | 6.17 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 26209 | | 20/07/22 | | 106.84 107.05 | 106.85 | -0.10 | 9 | 25 457 | 6.72 | 6.97 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 26211 | | 25/01/23 | | 102.15 102.30 | 102.30 | 0.30 | 8 | 100 013 | 6.79 | 7.32 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46022 | | 19/07/23 | | 91.30 92.00 | | | | | 7.41 | 7.48 | | да | 45 000 |
| ОФЗ 26207 | | 03/02/27 | | 110.70 110.84 | 110.84 | 0.08 | 18 | 233 505 | 7.05 | 8.56 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 26212 | | 19/01/28 | | 100.30 100.45 | 100.30 | -0.10 | 6 | 100 002 | 7.14 | 9.44 | | да | 150 000 |
| ОФЗ 46020 | | 06/02/36 | | 95.00 96.00 | 96.20 | 0.90 | 1 | 2 | 7.38 | 11.47 | | да | 135 000 |
| ОФЗ 46012 | | 05/09/29 | | | | | | | 5.44 | 10.88 | | да | 40 000 |

МЕТАЛЛУРГИЧЕСКАЯ И ГОРНОДОБЫВАЮЩАЯ ПРОМЫШЛЕННОСТЬ

НорНикель

| | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------|----------|--|---------------|--------|-------|---|--------|------|------|-----|-----|--------|
| НорНикель ВОЗ | | 30/07/13 | | 99.76 100.15 | 99.50 | -0.55 | 1 | 30 | 8.30 | 0.45 | | да | 15 000 |
| НЛМК | | | | | | | | | | | | | |
| НЛМК ВО6 | | 05/03/13 | | 100.03 100.10 | 100.10 | 0.07 | 3 | 60 010 | 5.67 | 0.05 | | да | 10 000 |
| НЛМК ВО2 | 19/06/13 | 17/12/14 | | 100.45 100.85 | | | | | 7.00 | 0.34 | | да | 5 000 |
| НЛМК ВО3 | 19/06/13 | 17/12/14 | | 100.45 100.84 | | | | | 7.62 | 0.34 | | да | 5 000 |
| НЛМК ВО4 | 08/09/14 | 07/09/15 | | 90.00 | | | | | 7.84 | 1.45 | 209 | да | 5 000 |
| НЛМК ВО7 | | 11/11/14 | | 101.81 102.55 | | | | | 7.96 | 1.61 | 215 | да | 10 000 |
| НЛМК 7 | 16/03/15 | 05/09/22 | | 101.00 101.78 | | | | | 7.58 | 1.88 | 168 | да | 5 000 |
| НЛМК 8 | 04/12/15 | 25/11/22 | | 101.00 102.25 | 101.50 | 0.10 | 2 | 30 001 | 7.94 | 2.52 | 192 | нет | 10 000 |
| ММК | | | | | | | | | | | | | |
| ММК ВО5 | | 04/04/13 | | 100.12 | 100.11 | 0.03 | 7 | 16 259 | 6.82 | 0.13 | | да | 8 000 |
| ММК ВО8 | 15/08/13 | 12/02/15 | | 100.01 | | | | | 8.25 | 0.50 | | да | 5 000 |
| ММК ВО4 | | 27/02/14 | | 99.21 100.08 | 100.04 | 0.24 | 2 | 44 | 7.75 | 0.98 | | да | 5 000 |
| ММК ВО6 | | 10/06/14 | | 85.00 | 98.82 | 0.10 | 1 | 1 077 | 8.27 | 1.35 | 255 | да | 5 000 |
| ММК ВО7 | | 22/07/14 | | 96.04 | | | | | 8.51 | 1.38 | 278 | да | 5 000 |
| ММК 18 | 01/12/15 | 22/11/22 | | 100.40 100.90 | | | | | 8.64 | 2.50 | 262 | да | 5 000 |
| Севсталь | | | | | | | | | | | | | |
| Севсталь ВО2 | | 15/02/13 | | | | | | | 9.86 | 0.00 | | да | 10 000 |
| Севсталь ВО4 | | 15/02/13 | | | | | | | 9.86 | 0.00 | | да | 5 000 |
| Алроса | | | | | | | | | | | | | |
| Алроса 21 | 25/06/13 | 18/06/15 | | 100.25 100.30 | 100.22 | -0.08 | 1 | 10 000 | 7.83 | 0.35 | | да | 8 000 |
| Алроса 22 | 28/06/13 | 23/06/15 | | 97.00 100.40 | | | | | 7.31 | 0.36 | | да | 8 000 |
| Алроса 23 | | 18/06/15 | | 100.18 102.60 | 102.20 | | 2 | 10 000 | 8.14 | 2.11 | 217 | да | 7 000 |
| Алроса 20 | | 23/06/15 | | 100.48 102.25 | 101.99 | -0.21 | 2 | 12 | 8.25 | 2.12 | 227 | да | 3 000 |
| Алроса ВО1 | | 30/10/15 | | 101.40 102.00 | 101.65 | 0.06 | 1 | 1 700 | 8.41 | 2.43 | 240 | да | 5 000 |
| Алроса ВО2 | | 30/10/15 | | | | | | | 8.44 | 2.43 | 243 | да | 5 000 |
| Евраз | | | | | | | | | | | | | |
| Евраз 1 | 22/03/13 | 13/03/20 | | 100.10 100.16 | 100.10 | 0.10 | 2 | 2 040 | 8.19 | 0.10 | | да | 10 000 |
| Евраз 3 | 22/03/13 | 13/03/20 | | 100.05 100.16 | | | | | 7.87 | 0.10 | | да | 5 000 |
| Сибметинвест 1 | 16/10/14 | 10/10/19 | | 107.01 107.50 | 107.25 | -0.35 | 2 | 1 162 | 8.90 | 1.49 | 313 | да | 10 000 |
| Сибметинвест 2 | 16/10/14 | 10/10/19 | | 106.55 107.50 | 107.50 | -0.10 | 6 | 284 | 8.74 | 1.49 | 297 | да | 10 000 |
| Евраз 2 | 26/10/15 | 19/10/20 | | 102.31 102.48 | | | | | 9.27 | 2.36 | 327 | да | 10 000 |
| Евраз 4 | 26/10/15 | 19/10/20 | | 102.30 | | | | | 9.07 | 2.37 | 306 | да | 5 000 |
| Евраз 5 | 06/06/16 | 27/05/21 | | 92.01 99.00 | | | | | 9.30 | 2.91 | 324 | да | 5 000 |
| Евраз 7 | 02/06/16 | 25/05/21 | | 92.01 99.00 | | | | | 9.30 | 2.90 | 324 | да | 15 000 |
| Металлоинвест | | | | | | | | | | | | | |
| Металлоинвест 1 | 16/03/15 | 07/03/22 | | 100.00 101.40 | 100.98 | -0.04 | 5 | 1 330 | 8.65 | 1.88 | 276 | да | 5 000 |
| Металлоинвест 5 | 16/03/15 | 07/03/22 | | 101.00 101.35 | | | | | 8.64 | 1.88 | 275 | да | 10 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|-----------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|-----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Металлоинвест 6 | 19/03/15 | 10/03/22 | 101.05 | 101.15 | 101.05 | 1.30 | 5 | 30 012 | 8.61 | 1.88 | 271 | да | 10 000 |
| Металлоинвест 2 | 02/02/18 | 27/01/23 | 99.65 | 100.30 | 100.30 | | 13 | 122 363 | 9.02 | 4.12 | 280 | нет | 5 000 |
| Металлоинвест 3 | 02/02/18 | 27/01/23 | 99.65 | | 100.20 | | 4 | 110 001 | 9.05 | 4.12 | 283 | нет | 5 000 |
| Мечел | | | | | | | | | | | | | |
| Мечел ВО2 | | 12/03/13 | 99.92 | 100.12 | | | | | 8.25 | 0.07 | | да | 5 000 |
| Мечел 5 | 16/04/13 | 09/10/18 | 99.85 | 100.30 | | | | | 8.37 | 0.16 | | да | 5 000 |
| Мечел ВО3 | | 24/04/13 | 99.92 | 100.08 | 100.00 | 0.05 | 5 | 2 929 | 9.84 | 0.19 | | да | 5 000 |
| Мечел 2 | 15/06/11 | 12/06/13 | 99.25 | 99.30 | 99.35 | 0.05 | 5 | 2 197 | 9.67 | 0.32 | | да | 5 000 |
| Мечел 4 | 25/07/13 | 21/07/16 | 100.15 | 100.50 | 100.15 | | 1 | 800 | 11.33 | 0.43 | | да | 5 000 |
| Мечел ВО4 | 11/02/14 | 10/02/15 | 97.25 | 97.40 | 97.40 | | 3 | 112 | 13.57 | 0.96 | | да | 5 000 |
| Мечел 15 | 18/02/14 | 09/02/21 | | | | | | | 13.59 | 0.95 | | да | 5 000 |
| Мечел 16 | 18/02/14 | 09/02/21 | | | | | | | 13.59 | 0.95 | | да | 5 000 |
| Мечел ВО5 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.84 | 2.22 | 585 | нет | 5 000 |
| Мечел ВО7 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.84 | 2.22 | 585 | нет | 2 000 |
| Мечел ВО11 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.84 | 2.22 | 585 | нет | 3 000 |
| Мечел ВО12 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.84 | 2.22 | 585 | нет | 3 000 |
| Мечел ВО6 | | 07/04/15 | 100.00 | | | | | | 11.55 | 1.97 | 562 | нет | 2 000 |
| Мечел 13 | 01/09/15 | 25/08/20 | 87.55 | 87.77 | 87.75 | 0.06 | 7 | 382 | 16.69 | 2.18 | 1071 | да | 5 000 |
| Мечел 14 | 01/09/15 | 25/08/20 | 86.66 | 87.90 | 87.60 | 0.46 | 7 | 122 | 16.78 | 2.18 | 1080 | да | 5 000 |
| Мечел 17 | 02/06/16 | 27/05/21 | 82.02 | 83.60 | 83.59 | -0.16 | 2 | 3 | 15.41 | 2.86 | 935 | да | 5 000 |
| Мечел 18 | 02/06/16 | 27/05/21 | 81.70 | 82.50 | 82.50 | 0.50 | 3 | 254 | 15.94 | 2.86 | 988 | да | 5 000 |
| Мечел 19 | 07/06/16 | 01/06/21 | 81.70 | 82.40 | 81.65 | -0.35 | 7 | 131 | 16.32 | 2.87 | 1026 | да | 5 000 |
| ТМК | | | | | | | | | | | | | |
| ТМК ВО1 | | 22/10/13 | 100.21 | 100.30 | 100.30 | 0.05 | 3 | 26 023 | 8.53 | 0.66 | | да | 5 000 |
| СУЭК | | | | | | | | | | | | | |
| СУЭК 1 | 05/07/13 | 26/06/20 | 100.45 | 100.49 | 100.35 | -0.10 | 7 | 101 | 8.53 | 0.38 | | да | 10 000 |
| РМК | | | | | | | | | | | | | |
| РМК 3 | 17/12/13 | 15/12/15 | 97.70 | 99.60 | | | | | 13.66 | 0.81 | | нет | 3 000 |
| РМК 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 93.34 | 93.59 | 93.52 | 0.10 | 2 | 16 450 | 15.15 | 1.24 | 947 | нет | 5 000 |
| КОКС | | | | | | | | | | | | | |
| КОКС ВО2 | | 28/05/14 | 98.41 | 98.84 | 98.80 | | 6 | 66 | 9.93 | 1.22 | 426 | да | 5 000 |
| Русал | | | | | | | | | | | | | |
| Русал 7 | 03/03/14 | 22/02/18 | 96.07 | 96.90 | 96.90 | 0.33 | 38 | 350 970 | 11.87 | 0.98 | | нет | 15 000 |
| Русал 8 | 15/04/15 | 05/04/21 | 93.41 | 94.00 | 93.30 | -0.25 | 2 | 3 238 | 12.47 | 1.96 | 655 | нет | 15 000 |
| ИНФРАСТРУКТУРА | | | | | | | | | | | | | |
| РЖД | | | | | | | | | | | | | |
| РЖД 09 | 18/05/11 | 13/11/13 | 99.90 | | | | | | 7.00 | 0.73 | | да | 15 000 |
| РЖД 10 | | 06/03/14 | 107.55 | 108.25 | 108.12 | 0.32 | 4 | 4 466 | 6.97 | 0.96 | | да | 15 000 |
| РЖД 23 | 29/01/15 | 16/01/25 | 103.10 | 104.00 | 103.20 | 0.10 | 3 | 5 851 | 7.34 | 1.83 | 146 | да | 15 000 |
| РЖД 11 | | 18/11/15 | | | 100.75 | | 1 | 4 099 | 7.63 | 2.49 | 161 | да | 15 000 |
| РЖД 16 | 06/06/16 | 05/06/17 | 99.40 | 101.28 | 101.20 | 0.05 | 3 | 29 242 | 7.62 | 2.94 | 155 | да | 15 000 |
| РЖД 19 | 16/07/18 | 08/07/24 | 101.80 | 102.00 | 101.85 | 0.10 | 3 | 30 000 | 7.87 | 4.47 | 158 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС | | | | | | | | | | | | | |
| ФСК ЕЭС 6 | 26/09/13 | 15/09/20 | 100.00 | 100.40 | | | | | 7.17 | 0.59 | | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 8 | 26/09/13 | 15/09/20 | 100.00 | 100.40 | | | | | 7.08 | 0.59 | | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 18 | 09/06/14 | 27/11/23 | 101.35 | 101.50 | | | | | 7.44 | 1.25 | 175 | да | 15 000 |
| ФСК ЕЭС 15 | 23/10/14 | 12/10/23 | 101.01 | 102.40 | 102.62 | 0.61 | 1 | 9 200 | 7.19 | 1.56 | 140 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС ВО1 | 22/04/15 | 21/10/15 | 87.00 | 101.29 | | | | | 7.65 | 2.00 | 172 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 10 | 24/09/15 | 15/09/20 | 100.00 | 100.60 | | | | | 7.58 | 2.34 | 158 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 7 | 27/10/15 | 16/10/20 | 99.30 | 100.00 | | | | | 7.64 | 2.44 | 163 | да | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 12 | 22/04/16 | 19/04/19 | 100.40 | 110.50 | | | | | 8.09 | 2.80 | 204 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 25 | 27/09/16 | 14/09/27 | 102.60 | 102.80 | 102.70 | -0.05 | 3 | 3 | 7.87 | 3.10 | 179 | да | 15 000 |
| ФСК ЕЭС 21 | 19/04/17 | 06/10/27 | 103.00 | 103.80 | 103.55 | 0.25 | 3 | 70 002 | 7.88 | 3.51 | 175 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 9 | 24/10/17 | 16/10/20 | 100.60 | 100.90 | 100.90 | 0.35 | 5 | 65 000 | 7.90 | 3.91 | 172 | да | 5 000 |
| ФСК ЕЭС 11 | 24/10/17 | 16/10/20 | 100.60 | 100.89 | 100.90 | 0.35 | 2 | 9 000 | 7.90 | 3.92 | 172 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 19 | 18/07/18 | 06/07/23 | 100.00 | 100.95 | 99.00 | -0.80 | 1 | 1 | 8.35 | 4.48 | 206 | да | 20 000 |
| ФСК ЕЭС 13 | | 22/06/21 | | 104.00 | | | | | 8.23 | 6.12 | 163 | да | 10 000 |
| ФСК ЕЭС 24 | 17/01/20 | 13/01/28 | 99.50 | 100.04 | | | | | 8.12 | 5.42 | 164 | нет | 10 000 |
| ТРАНСНЕФТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Транснефть БО1 | 22/12/14 | 21/12/15 | 86.00 | 100.50 | 100.50 | 0.50 | 4 | 15 003 | 7.33 | 1.75 | 148 | нет | 17 000 |
| Транснефть БО2 | 22/12/14 | 21/12/15 | 86.00 | 100.50 | 101.99 | 1.49 | 1 | 1 | 6.44 | 1.75 | 59 | нет | 17 000 |
| НМТП | | | | | | | | | | | | | |
| НМТП БО-2 | | 29/04/15 | 100.90 | 102.00 | | | | | 8.56 | 2.00 | 263 | да | 4 000 |
| Росавтодор | | | | | | | | | | | | | |
| Росавтодор 1 | | 29/11/16 | | | 102.00 | 0.40 | 1 | 1 | 9.31 | 3.21 | 321 | да | 3 000 |
| Росводоканал | | | | | | | | | | | | | |
| Росводоканал 3 | 11/11/13 | 09/11/15 | 98.75 | 99.80 | 99.76 | -0.20 | 6 | 758 | 9.53 | 0.72 | | да | 3 000 |
| Водоканал | | | | | | | | | | | | | |
| Водоканал 1 | | 09/12/15 | 86.00 | 100.00 | | | | | 8.99 | 2.52 | 297 | да | 2 000 |
| Западный СД | | | | | | | | | | | | | |
| Западный СД 1 | 29/04/16 | 13/05/31 | 99.55 | 100.20 | | | | | 9.01 | 2.81 | 296 | да | 5 000 |
| Западный СД 2 | 29/04/16 | 13/05/31 | 99.85 | | | | | | 9.19 | 2.90 | 313 | да | 5 000 |
| Западный СД 3 | 24/02/17 | 06/02/32 | 92.20 | | | | | | 8.10 | 3.33 | 199 | да | 5 000 |
| Западный СД 4 | 24/02/17 | 06/02/32 | | | | | | | 8.58 | 3.33 | 247 | да | 5 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | ЦБ | Объем млн руб. |
|--------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|-----|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Западный СД 5 | 24/02/17 | 06/02/32 | | | | | | | 8.10 | 3.33 | 199 | да | 5 000 |
| Почта России | | | | | | | | | | | | | |
| Почта России 1 | 25/03/14 | 22/03/16 | 86.00 | 100.30 | 100.30 | | 1 | 100 | 8.11 | 1.05 | 249 | да | 7 000 |
| Почта России 2 | 23/10/15 | 18/10/19 | 101.05 | 101.19 | | | | | 8.37 | 2.39 | 236 | да | 3 000 |
| Почта России 3 | 23/10/15 | 18/10/19 | 100.10 | 101.19 | 101.19 | -0.01 | 3 | 10 002 | 8.36 | 2.39 | 235 | да | 3 000 |
| Почта России 4 | 23/10/15 | 18/10/19 | 100.10 | 101.19 | 100.10 | -1.04 | 3 | 89 | 8.84 | 2.39 | 283 | да | 3 000 |
| НЕФТЬ и ГАЗ | | | | | | | | | | | | | |
| ГАЗПРОМ | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром А9 | | 12/02/14 | 100.30 | 100.40 | | | | | 6.81 | 0.98 | | да | 5 000 |
| Газпром А11 | | 24/06/14 | 108.20 | 108.90 | 108.81 | -0.09 | 4 | 76 678 | 6.92 | 1.26 | 123 | да | 5 000 |
| Роснефть | | | | | | | | | | | | | |
| Роснефть 4 | 23/10/17 | 17/10/22 | 103.35 | 103.50 | 103.45 | -0.05 | 2 | 401 | 7.85 | 3.88 | 168 | да | 10 000 |
| Роснефть 5 | 23/10/17 | 17/10/22 | 103.45 | 103.75 | 103.45 | -0.05 | 6 | 85 261 | 7.85 | 3.88 | 168 | да | 10 000 |
| Лукойл | | | | | | | | | | | | | |
| Лукойл 4 | | 05/12/13 | 100.40 | 100.50 | 100.55 | 0.05 | 1 | 1 | 6.78 | 0.79 | | да | 6 000 |
| Газпром нефть | | | | | | | | | | | | | |
| Газпром нефть БО-5 | | 09/04/13 | 86.00 | 100.20 | | | | | 6.47 | 0.15 | | да | 10 000 |
| Газпром нефть БО-6 | | 09/04/13 | 86.00 | 100.18 | | | | | 6.97 | 0.15 | | да | 10 000 |
| Газпром нефть 11 | 03/02/15 | 25/01/22 | 92.00 | | | | | | 7.70 | 1.85 | 181 | да | 10 000 |
| Газпром нефть 8 | | 02/02/16 | 102.25 | 102.37 | 102.22 | -0.13 | 2 | 2 | 7.79 | 2.68 | 175 | да | 10 000 |
| Газпром нефть 9 | 08/02/16 | 26/01/21 | 102.05 | 102.37 | | | | | 7.81 | 2.69 | 177 | да | 10 000 |
| Газпром нефть 10 | 05/02/18 | 26/01/21 | 104.45 | 104.85 | 104.45 | -0.40 | 2 | 2 | 7.96 | 4.14 | 173 | да | 10 000 |
| Газпром нефть 12 | 29/11/17 | 23/11/22 | 102.70 | 103.00 | 102.90 | 0.20 | 3 | 14 355 | 7.91 | 3.98 | 172 | нет | 10 000 |
| Газпром нефть 4 | 10/04/18 | 09/04/14 | 100.50 | 102.99 | 104.95 | 3.35 | 7 | 12 675 | 7.16 | 4.22 | 92 | да | 10 000 |
| НОВАТЭК | | | | | | | | | | | | | |
| НОВАТЭК БО-1 | | 25/06/13 | 100.06 | 100.49 | 100.45 | 0.41 | 2 | 2 | 6.27 | 0.36 | | да | 10 000 |
| НОВАТЭК БО-2 | | 12/10/15 | 101.40 | | 101.40 | -0.13 | 2 | 3 | 7.90 | 2.38 | 189 | да | 10 000 |
| НОВАТЭК БО-3 | | 12/10/15 | 99.75 | 101.85 | 101.85 | 0.35 | 1 | 2 050 | 7.70 | 2.38 | 169 | да | 5 000 |
| НОВАТЭК БО-4 | | 12/10/15 | 99.75 | 102.25 | | | | | 7.86 | 2.38 | 185 | да | 5 000 |
| ТАТНЕФТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Татнефть БО-1 | | 20/09/13 | 99.65 | 99.90 | 99.86 | -0.30 | 3 | 1 115 | 7.62 | 0.58 | | да | 5 000 |
| Башнефть | | | | | | | | | | | | | |
| Башнефть 1 | 18/12/12 | 13/12/16 | 99.50 | 100.50 | 99.50 | -1.46 | 2 | 3 | 8.68 | 3.31 | 257 | да | 15 000 |
| Башнефть 2 | 18/12/12 | 13/12/16 | 99.50 | 101.00 | | | | | 8.46 | 3.31 | 235 | да | 15 000 |
| Башнефть 3 | 18/12/12 | 13/12/16 | 99.50 | 101.00 | | | | | 8.44 | 3.31 | 233 | да | 20 000 |
| Башнефть БО1 | 05/12/13 | 02/12/14 | 101.25 | 101.47 | 101.45 | 1.20 | 2 | 20 423 | 7.57 | 0.78 | | да | 10 000 |
| Башнефть 4 | 13/02/15 | 04/02/22 | 87.00 | 101.75 | 101.75 | 0.05 | 1 | 1 | 8.20 | 1.87 | 231 | да | 10 000 |
| НК Альянс | | | | | | | | | | | | | |
| НК Альянс 3 | 30/07/13 | 21/07/20 | 100.31 | 100.49 | | | | | 8.88 | 0.45 | | да | 5 000 |
| НК Альянс БО-1 | | 04/02/14 | 100.05 | 100.60 | 100.56 | 0.10 | 8 | 728 | 8.82 | 0.95 | | да | 5 000 |
| НК Альянс 4 | 07/06/16 | 01/06/21 | 98.25 | 98.49 | 98.45 | 0.95 | 6 | 33 000 | 9.62 | 2.89 | 356 | да | 5 000 |
| НК Альянс 6 | 10/06/16 | 04/06/21 | 98.00 | 98.80 | 98.00 | 1.74 | 1 | 10 000 | 9.79 | 2.90 | 373 | да | 7 000 |
| Сахатранснефтегаз | | | | | | | | | | | | | |
| Сахатранфг2 | | 26/07/13 | 100.20 | 100.53 | 100.48 | -0.02 | 10 | 160 | 11.32 | 0.44 | | нет | 3 000 |
| Якутская ТЭК | | | | | | | | | | | | | |
| ЯТЭК БО1 | 20/12/13 | 27/10/15 | 95.50 | | | | | | 12.54 | 0.80 | | нет | 3 000 |
| БК Евразия | | | | | | | | | | | | | |
| БК Евразия 1 | 22/06/16 | 20/06/18 | 90.00 | 100.00 | 98.55 | | 4 | 34 | 9.10 | 2.95 | 303 | да | 5 000 |
| ГОСБАНКИ | | | | | | | | | | | | | |
| ВТБ | | | | | | | | | | | | | |
| ВТБ 6 | 10/07/13 | 06/07/16 | 100.60 | 100.66 | 100.61 | 0.01 | 7 | 3 330 | 7.15 | 0.39 | | да | 15 000 |
| ВТБ БО-6 | 21/12/12 | 19/12/14 | 100.30 | | 100.95 | 0.14 | 2 | 7 555 | 8.02 | 1.70 | 218 | да | 10 000 |
| ВТБ БО-7 | 25/01/13 | 23/01/15 | 100.70 | 100.80 | 100.75 | | 16 | 25 173 | 7.95 | 1.80 | 208 | да | 10 000 |
| ВТБ БО-1 | | 15/03/13 | 100.03 | 100.10 | | | | | 6.80 | 0.08 | | да | 5 000 |
| ВТБ БО-2 | | 15/03/13 | 100.04 | 100.10 | 100.05 | | 1 | 3 000 | 7.08 | 0.08 | | да | 5 000 |
| ВТБ БО-5 | | 15/03/13 | 100.05 | 100.08 | 100.05 | -0.02 | 5 | 3 251 | 7.08 | 0.08 | | да | 10 000 |
| ВТБ БО-8 | 03/09/13 | 01/09/15 | 100.25 | | | | | | 7.69 | 0.53 | | да | 10 000 |
| ВТБ 5 | | 17/10/13 | 100.01 | 100.19 | 100.10 | 0.10 | 2 | 2 | 7.44 | 0.65 | | да | 15 000 |
| ВТБ БО-03 | 18/03/14 | 17/03/15 | 100.35 | | | | | | 7.88 | 1.04 | 226 | да | 5 000 |
| ВТБ БО-04 | 18/03/14 | 17/03/15 | 100.35 | 100.50 | | | | | 7.88 | 1.04 | 226 | да | 5 000 |
| ВТБ БО-19 | | 01/10/15 | 99.90 | | | | | | 8.68 | 2.36 | 268 | да | 15 000 |
| ВТБ БО-20 | | 01/10/15 | 99.90 | | | | | | 8.68 | 2.36 | 268 | да | 15 000 |
| ВТБ БО-21 | | 19/01/16 | 100.40 | 100.80 | 100.80 | | 3 | 6 346 | 8.07 | 2.62 | 204 | нет | 15 000 |
| ВТБ 24 3 | 30/05/12 | 29/05/13 | 99.89 | | | | | | 2.62 | 0.28 | | да | 6 000 |
| ВТБ 24 1-ИП | 14/12/11 | 10/12/14 | 99.95 | 101.20 | | | | | 8.81 | 1.68 | 298 | да | 15 000 |
| ВТБ 24 5 | 22/08/13 | 20/02/14 | | | | | | | 7.53 | 0.50 | | да | 8 000 |
| ВТБ-Лизинг 2 | 08/04/14 | 07/07/15 | 99.88 | 100.50 | | | | | 8.09 | 0.91 | | да | 10 000 |
| ВТБ-Лизинг 4 | 12/03/13 | 07/06/16 | 100.00 | 100.05 | | | | | 6.77 | 0.07 | | да | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 8 | 07/05/13 | 01/08/17 | 100.00 | 100.50 | | | | | 7.05 | 0.22 | | да | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 1 | 07/11/13 | 06/11/14 | 99.95 | 100.40 | | | | | 8.16 | 0.59 | | да | 8 000 |
| ВТБ-Лизинг 3 | 10/09/13 | 07/06/16 | 99.15 | 100.00 | | | | | 7.48 | 0.52 | | да | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 9 | 05/02/14 | 02/08/17 | 98.70 | 100.00 | | | | | 7.48 | 0.89 | | да | 5 000 |
| ВТБ-Лизинг 7 | 04/06/14 | 30/11/16 | 99.80 | 100.50 | | | | | 8.30 | 1.05 | 268 | да | 5 000 |
| Банк Москвы | | | | | | | | | | | | | |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | ЦБ | Объем млн руб. |
|--------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|-----|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Банк Москвы БО1 | | 28/01/16 | | 99.88 | | | | | 8.30 | 2.65 | 226 | нет | 10 000 |
| ВЭБ | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ 8 | 22/10/13 | 13/10/20 | 99.85 | 99.97 | 99.97 | 0.12 | 2 | 13 | 7.05 | 0.67 | | да | 15 000 |
| ВЭБ 21 | 10/03/15 | 17/02/32 | 101.30 | 101.60 | 101.30 | -0.30 | 4 | 9 701 | 7.85 | 1.87 | 196 | да | 15 000 |
| ВЭБ 18 | 09/10/15 | 17/09/32 | 101.60 | 110.25 | | | | | 7.88 | 2.36 | 188 | да | 10 000 |
| ВЭБ 19 | 15/10/15 | 23/09/32 | 101.60 | | | | | | 7.98 | 2.38 | 197 | да | 10 000 |
| ВЭБ 9 | 24/03/16 | 18/03/21 | 100.00 | 101.20 | 101.20 | | 2 | 2 | 7.59 | 2.73 | 155 | да | 15 000 |
| ВЭБ 10 | 27/09/16 | 21/09/21 | | | | | | | 8.67 | 3.09 | 259 | да | 15 000 |
| ВЭБ 6 | 17/10/17 | 13/10/20 | 99.04 | 101.18 | 99.00 | -1.50 | 1 | 1 | 8.32 | 3.90 | 214 | да | 10 000 |
| ВЭБ-Лизинг | | | | | | | | | | | | | |
| ВЭБ-Лизинг 3 | 11/04/14 | 02/04/21 | 86.00 | | 99.91 | -0.04 | 2 | 46 | 7.71 | 1.10 | 207 | да | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 8 | 28/10/14 | 19/10/21 | 100.40 | 110.50 | 101.70 | | 1 | 1 500 | 7.85 | 1.58 | 206 | да | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 9 | 29/10/14 | 20/10/21 | 100.40 | 110.50 | 101.70 | | 1 | 2 199 | 7.85 | 1.58 | 205 | да | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 6 | | 31/01/17 | 87.32 | | | | | | 8.16 | 2.23 | 217 | да | 10 000 |
| ВЭБ-Лизинг 4 | 08/04/16 | 02/04/21 | 99.97 | 102.28 | | | | | 8.78 | 2.75 | 273 | да | 5 000 |
| ВЭБ-Лизинг 5 | 08/04/16 | 02/04/21 | 101.01 | 101.40 | | | | | 8.39 | 2.75 | 234 | да | 5 000 |
| МСП Банк | | | | | | | | | | | | | |
| МСП Банк 01 | 27/03/14 | 17/03/22 | 99.00 | 100.80 | | | | | 8.12 | 1.05 | 250 | да | 5 000 |
| МСП Банк 02 | 21/08/14 | 11/08/22 | | | | | | | 8.07 | 1.39 | 234 | да | 5 000 |
| РСХБ | | | | | | | | | | | | | |
| РСХБ 8 | 22/05/14 | 14/11/19 | 100.00 | | 100.75 | | 1 | 3 000 | 7.90 | 1.20 | 223 | да | 5 000 |
| РСХБ 9 | 22/05/14 | 14/11/19 | 99.25 | 100.85 | 100.75 | | 2 | 5 000 | 7.90 | 1.20 | 223 | да | 5 000 |
| РСХБ 10 | 04/02/15 | 29/01/20 | 100.10 | 100.59 | | | | | 8.08 | 1.85 | 219 | да | 5 000 |
| РСХБ 11 | 05/02/15 | 29/01/20 | 100.10 | 102.00 | 101.10 | 0.60 | 8 | 50 001 | 7.73 | 1.86 | 184 | да | 5 000 |
| РСХБ 7 | 11/06/13 | 05/06/18 | 99.85 | 100.00 | | | | | 7.06 | 0.32 | | да | 5 000 |
| РСХБ БО-2 | 06/08/13 | 03/02/15 | 86.00 | 100.53 | | | | | 7.56 | 0.47 | | да | 5 000 |
| РСХБ БО-3 | 08/08/13 | 05/02/15 | 86.00 | 100.50 | | | | | 7.39 | 0.48 | | да | 5 000 |
| РСХБ БО-1 | 29/08/12 | 28/08/13 | 99.00 | 101.05 | | | | | 7.61 | 0.51 | | да | 5 000 |
| РСХБ БО-5 | 29/08/12 | 28/08/13 | 90.40 | | | | | | 7.51 | 0.51 | | да | 10 000 |
| РСХБ 4 | 02/10/13 | 27/09/17 | 85.00 | | | | | | 7.62 | 0.61 | | да | 10 000 |
| РСХБ БО-6 | 01/05/12 | 29/10/13 | 100.38 | 100.45 | 100.44 | -0.01 | 5 | 6 | 7.66 | 0.68 | | да | 10 000 |
| РСХБ 15 | 05/11/13 | 26/10/21 | 100.87 | 100.92 | 100.87 | 0.02 | 4 | 20 000 | 7.60 | 0.70 | | да | 10 000 |
| РСХБ 3 | 13/02/14 | 09/02/17 | 101.34 | 101.60 | 101.50 | 0.10 | 2 | 2 033 | 7.80 | 0.97 | | да | 10 000 |
| РСХБ 6 | 15/08/14 | 09/02/18 | 86.00 | 100.50 | | | | | 7.86 | 1.44 | 211 | да | 5 000 |
| РСХБ 18 | 23/10/14 | 13/10/22 | 99.75 | 100.89 | 100.83 | 0.08 | 3 | 5 500 | 7.96 | 1.57 | 217 | да | 5 000 |
| РСХБ 17 | 21/10/14 | 11/10/22 | 100.75 | 100.89 | 100.80 | | 1 | 200 | 7.97 | 1.56 | 218 | да | 10 000 |
| РСХБ 16 | 13/04/15 | 04/04/22 | 100.35 | 101.37 | | | | | 8.19 | 1.96 | 227 | да | 10 000 |
| РСХБ 14 | 07/07/15 | 29/06/21 | 99.00 | 100.00 | | | | | 8.08 | 2.21 | 209 | да | 10 000 |
| РСХБ 12 | 09/07/15 | 01/07/21 | 99.00 | 100.35 | | | | | 8.01 | 2.22 | 202 | да | 5 000 |
| РСХБ 13 | 10/07/15 | 02/07/21 | 99.00 | 100.35 | | | | | 8.33 | 2.22 | 234 | да | 5 000 |
| Газпромбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Газпромбанк БО-4 | 24/12/12 | 20/12/14 | 101.05 | 101.99 | 101.20 | 0.01 | 6 | 33 000 | 7.93 | 1.73 | 209 | да | 10 000 |
| Газпромбанк БО-2 | 22/07/13 | 11/07/14 | | | | | | | 7.47 | 0.43 | | да | 10 000 |
| Газпромбанк БО-1 | | 08/12/13 | 100.15 | | | | | | 7.68 | 0.79 | | да | 10 000 |
| Газпромбанк БО-3 | 05/02/14 | 01/02/15 | | | | | | | 7.88 | 0.95 | | да | 10 000 |
| Газпромбанк 6 | 14/07/14 | 07/07/16 | 101.40 | 101.48 | 101.45 | 0.15 | 2 | 11 000 | 7.88 | 1.35 | 216 | да | 10 000 |
| Газпромбанк 7 | 21/10/15 | 17/10/16 | 100.95 | 101.05 | 101.10 | 0.10 | 6 | 55 500 | 8.19 | 2.39 | 218 | да | 10 000 |
| Газпромбанк 10 | 19/10/15 | 12/10/17 | | | | | | | 8.67 | 2.38 | 266 | да | 10 000 |
| Газпромбанк 11 | 19/10/15 | 10/10/19 | 99.00 | | | | | | 8.67 | 2.38 | 266 | да | 10 000 |
| Газпромбанк 12 | 19/10/15 | 06/10/22 | | | | | | | 8.67 | 2.38 | 266 | да | 10 000 |
| АИЖК | | | | | | | | | | | | | |
| АИЖК А6 | | 15/07/14 | 85.00 | 100.35 | | | | | 7.62 | 0.88 | | да | 3 000 |
| АИЖК-11 А1 | 15/03/15 | 15/09/43 | 100.20 | 100.40 | 100.30 | 0.05 | 2 | 1 000 | 8.34 | 1.90 | 244 | да | 7 000 |
| АИЖК А9 | | 15/02/17 | 93.00 | | | | | | 7.82 | 2.69 | 178 | да | 5 000 |
| АИЖК А7 | | 15/07/16 | | 101.57 | | | | | 8.00 | 1.63 | 219 | да | 4 000 |
| АИЖК А19 | 15/05/15 | 15/11/24 | 99.00 | 100.50 | | | | | 8.34 | 2.08 | 238 | да | 6 000 |
| АИЖК А24 | 01/11/15 | 01/11/22 | | | | | | | 7.90 | 2.44 | 189 | да | 6 000 |
| АИЖК А8 | | 15/06/18 | 95.00 | 100.00 | | | | | 7.87 | 2.53 | 185 | да | 5 000 |
| АИЖК А10 | | 15/11/18 | 91.76 | | | | | | 8.48 | 2.81 | 243 | да | 6 000 |
| АИЖК А18 | 15/04/16 | 15/07/23 | 99.00 | 100.00 | | | | | 8.24 | 2.81 | 219 | да | 7 000 |
| АИЖК А21 | | 15/02/20 | 102.87 | 103.17 | 103.25 | 0.60 | 3 | 5 002 | 7.94 | 3.02 | 186 | да | 15 000 |
| АИЖК А11 | | 15/09/20 | 99.26 | 101.45 | | | | | 8.28 | 3.60 | 214 | да | 10 000 |
| АИЖК А16 | | 15/09/21 | 99.00 | 100.45 | | | | | 8.40 | 4.74 | 206 | да | 10 000 |
| АИЖК А17 | | 15/04/22 | 103.00 | 105.80 | | | | | 8.71 | 5.37 | 224 | да | 8 000 |
| АИЖК А20 | | 15/12/27 | 102.30 | 104.00 | | | | | 8.59 | 8.27 | 160 | да | 5 000 |
| ГТЛК | | | | | | | | | | | | | |
| ГТЛК 01 | 26/01/16 | 23/01/18 | 100.25 | 101.29 | 101.25 | -0.05 | 4 | 5 620 | 9.73 | 2.61 | 370 | нет | 5 000 |
| ГТЛК 02 | 26/01/16 | 26/01/18 | 100.00 | 101.24 | 100.70 | -0.55 | 4 | 15 321 | 9.95 | 2.61 | 392 | нет | 5 000 |
| ГЛОБЭКС | | | | | | | | | | | | | |
| ГЛОБЭКС БО-2 | | 22/07/13 | 86.00 | 100.90 | | | | | 8.23 | 0.43 | | да | 5 000 |
| ГЛОБЭКС БО-7 | 04/12/13 | 04/12/15 | 99.90 | 99.99 | 99.90 | -0.10 | 4 | 34 033 | 9.31 | 0.78 | | нет | 5 000 |
| ГЛОБЭКС БО-3 | 08/06/12 | 08/12/13 | 100.14 | 100.55 | | | | | 8.90 | 0.79 | | да | 3 000 |
| ГЛОБЭКС БО-5 | 08/06/12 | 08/12/13 | 100.14 | | | | | | 8.83 | 0.79 | | да | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-4 | 01/08/12 | 01/08/14 | 99.60 | 100.20 | | | | | 9.46 | 1.39 | 373 | да | 3 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | ЦБ | Объем млн руб. |
|----------------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|-----|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| ГЛОБЭКС БО-6 | 01/08/12 | 01/08/14 | | 100.20 | | | | | 9.30 | 1.39 | 357 | да | 2 000 |
| ГЛОБЭКС БО-1 | 16/02/11 | 16/02/13 | | | | | | | -9.02 | 0.00 | | да | 5 000 |
| Транскредитбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Транскредитбанк 5 | | 12/08/13 | 100.10 | 100.30 | 100.15 | -0.07 | 6 | 42 002 | 7.72 | 0.49 | | да | 3 000 |
| Транскредитбанк БО-1 | | 17/11/13 | 100.02 | 100.29 | | | | | 7.82 | 0.73 | | да | 5 000 |
| Транскредитбанк 6 | | 17/04/14 | 99.50 | 100.35 | | | | | 8.07 | 1.11 | 243 | да | 4 000 |
| ТЕЛЕКОМЫ | | | | | | | | | | | | | |
| Ростелеком | | | | | | | | | | | | | |
| Ростелеком 17 | 05/11/15 | 02/11/17 | 101.70 | 101.80 | 101.65 | | 1 | 11 000 | 8.01 | 2.43 | 200 | да | 10 000 |
| Ростелеком 15 | | 24/01/18 | 100.13 | 101.00 | 100.18 | 0.02 | 1 | 1 700 | 8.32 | 3.98 | 213 | нет | 5 000 |
| Ростелеком 18 | | 24/01/18 | 100.15 | | 100.15 | 0.05 | 4 | 30 004 | 8.33 | 3.98 | 214 | нет | 10 000 |
| МТС | | | | | | | | | | | | | |
| МТС 3 | 20/06/13 | 12/06/18 | 99.80 | 100.45 | | | | | 7.18 | 0.34 | | да | 10 000 |
| МТС 1 | | 17/10/13 | 99.40 | 100.05 | | | | | 8.07 | 0.65 | | да | 10 000 |
| МТС 4 | 19/05/11 | 13/05/14 | 99.46 | 99.70 | 99.43 | -0.07 | 1 | 26 500 | 8.05 | 1.17 | 239 | да | 15 000 |
| МТС 2 | | 20/10/15 | 98.02 | 99.49 | | | | | 8.31 | 2.41 | 230 | да | 10 000 |
| МТС 8 | 12/11/15 | 03/11/20 | 100.10 | 100.15 | 100.10 | -0.10 | 2 | 3 950 | 8.27 | 2.46 | 225 | да | 15 000 |
| МТС 5 | 26/07/12 | 19/07/16 | 98.60 | 101.00 | 100.00 | -1.00 | 1 | 16 | 8.72 | 2.97 | 265 | да | 15 000 |
| МТС 7 | | 07/11/17 | 101.35 | 101.38 | 101.40 | 0.05 | 1 | 1 802 | 8.50 | 3.90 | 232 | да | 10 000 |
| Вымпелком | | | | | | | | | | | | | |
| Вымпелком Инв 1 | | 19/07/13 | 100.55 | 100.70 | 100.70 | | 1 | 1 000 | 7.65 | 0.42 | | да | 10 000 |
| Вымпелком 3 | 12/07/11 | 08/07/14 | 99.30 | 99.75 | 99.71 | 0.61 | 8 | 6 879 | 7.76 | 1.34 | 204 | да | 10 000 |
| Вымпелком 2 | 23/03/15 | 14/03/22 | 101.10 | 101.30 | 101.10 | -0.05 | 3 | 2 903 | 8.43 | 1.90 | 253 | да | 10 000 |
| Вымпелком 1 | 17/03/15 | 08/03/22 | 101.10 | 101.30 | 101.15 | 0.15 | 4 | 30 101 | 8.40 | 1.88 | 250 | да | 10 000 |
| Вымпелком 4 | 17/03/15 | 08/03/22 | 101.10 | 101.20 | 101.15 | 0.15 | 9 | 19 789 | 8.40 | 1.88 | 251 | да | 15 000 |
| Вымпелком 6 | | 13/10/15 | 99.50 | | 99.00 | -0.60 | 2 | 2 | 8.91 | 2.38 | 290 | да | 10 000 |
| Вымпелком 7 | | 13/10/15 | 99.00 | 100.50 | | | | | 8.64 | 2.38 | 263 | да | 10 000 |
| Мегафон | | | | | | | | | | | | | |
| Мегафон Фин 05 | 09/10/14 | 29/09/22 | 100.25 | 100.95 | | | | | 7.55 | 1.53 | 177 | да | 10 000 |
| Ростелеком | | | | | | | | | | | | | |
| Ростелеком 8 | | 03/09/13 | 96.00 | 100.49 | | | | | 7.36 | 0.29 | | да | |
| Ростелеком 1 | 18/08/11 | 08/08/13 | 96.01 | | | | | | 8.51 | 0.48 | | да | 2 000 |
| СПБ Теле2 | | | | | | | | | | | | | |
| ТЕЛЕ2 4 | 10/02/14 | 31/01/22 | 98.00 | 101.20 | | | | | 7.76 | 0.96 | | да | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 5 | 10/02/14 | 31/01/22 | 98.00 | 100.80 | | | | | 8.03 | 0.96 | | да | 4 000 |
| ТЕЛЕ2 7 | 14/04/15 | 05/04/22 | 101.35 | 101.45 | 101.38 | 0.08 | 14 | 50 046 | 8.41 | 1.95 | 249 | да | 6 000 |
| ТЕЛЕ2 1 | 17/06/16 | 11/06/21 | 98.75 | 99.99 | | | | | 9.03 | 2.94 | 296 | да | 5 000 |
| ТЕЛЕ2 3 | 17/06/16 | 11/06/21 | 95.01 | 100.34 | 98.83 | | 2 | 10 | 9.00 | 2.94 | 293 | да | 3 000 |
| ТЕЛЕ2 2 | 17/06/16 | 11/06/21 | 95.01 | 99.79 | | | | | 8.59 | 2.94 | 252 | да | 5 000 |
| ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЕ, ТОРГОВЛЯ | | | | | | | | | | | | | |
| ВБД | | | | | | | | | | | | | |
| ВБД ПП 3 | | 27/02/13 | 85.00 | 100.00 | | | | | 7.46 | 0.03 | | да | 5 000 |
| МАГНИТ | | | | | | | | | | | | | |
| Магнит БО-1 | | 09/09/13 | 95.55 | | | | | | 8.02 | 0.55 | | нет | 1 000 |
| Магнит БО-2 | | 09/09/13 | 97.27 | | | | | | 8.40 | 0.55 | | да | 1 000 |
| Магнит БО-3 | | 09/09/20 | 86.02 | 100.25 | | | | | 8.12 | 0.55 | | да | 2 000 |
| Магнит БО-4 | | 09/09/20 | 91.00 | | | | | | 8.12 | 0.55 | | да | 2 000 |
| Магнит БО-5 | | 28/02/14 | 85.00 | 100.00 | | | | | 8.25 | 0.98 | | да | 5 000 |
| Магнит БО-6 | | 22/04/14 | 86.00 | | | | | | 8.83 | 1.13 | 319 | да | 5 000 |
| Магнит БО-7 | | 21/09/15 | 101.15 | 101.45 | | | | | 8.55 | 2.30 | 255 | да | 5 000 |
| Х5 | | | | | | | | | | | | | |
| Х5 Финанс 4 | 05/06/14 | 02/06/16 | 98.50 | 99.00 | | | | | 9.01 | 1.25 | 333 | да | 8 000 |
| Х5 Финанс 1 | | 01/07/14 | 93.26 | | | | | | 9.17 | 1.32 | 346 | да | 9 000 |
| Х5 Финанс БО1 | | 01/10/15 | 100.70 | 101.25 | 101.00 | 0.35 | 1 | 1 | 9.26 | 2.31 | 326 | да | 5 000 |
| Копейка | | | | | | | | | | | | | |
| Копейка БО-1 | 24/07/12 | 23/07/13 | 93.01 | 99.89 | 99.90 | 0.90 | 1 | 44 | 7.43 | 0.43 | | нет | 3 000 |
| Копейка БО-2 | | 01/10/13 | 99.40 | 99.90 | 99.96 | 0.19 | 7 | 1 444 | 9.37 | 0.61 | | нет | 3 000 |
| О'КЕИ | | | | | | | | | | | | | |
| О'кей 02 | 15/12/15 | 12/12/17 | 100.92 | 101.50 | | | | | 9.87 | 2.50 | 385 | нет | 3 000 |
| ИНТУРИСТ | | | | | | | | | | | | | |
| Интурист 2 | 22/05/12 | 21/05/13 | 99.76 | 100.10 | 100.00 | | 3 | 221 | 10.12 | 0.26 | | нет | 2 000 |
| Черкизово | | | | | | | | | | | | | |
| Черкизово БО-3 | | 08/11/13 | 99.01 | | | | | | 11.45 | 0.71 | | да | 3 000 |
| Синергия | | | | | | | | | | | | | |
| Синергия БО-1 | 04/10/12 | 03/10/13 | 97.03 | 100.34 | | | | | 9.99 | 0.61 | | да | 3 000 |
| Синергия БО-3 | | 03/06/15 | | | | | | | 9.75 | 1.79 | 388 | нет | 2 000 |
| Русское Море | | | | | | | | | | | | | |
| Русское Море 01 | 25/06/13 | 23/06/15 | 100.01 | 100.18 | 100.18 | | 1 | 2 | 12.21 | 0.36 | | нет | 1 000 |
| Балтийский Берег | | | | | | | | | | | | | |
| Балт Берег 01 | 27/12/13 | 22/12/17 | | | | | | | | 1.00 | | нет | 00000 000 |
| Детский мир | | | | | | | | | | | | | |
| Детский мир 1 | | 26/05/15 | 94.42 | 95.00 | | | | | 11.34 | 2.08 | 538 | нет | 1 000 |
| Мираторг | | | | | | | | | | | | | |
| Мираторг БО-1 | | 29/07/14 | 95.76 | 96.75 | 96.75 | 0.74 | 1 | 50 | 11.55 | 1.39 | 582 | да | 3 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|--------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|-----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Микояновский МК | | | | | | | | | | | | | |
| Микоян БО-1 | 31/01/14 | 29/01/16 | 100.65 | 100.90 | 100.80 | -0.20 | 1 | 450 | 11.92 | 0.93 | | нет | 2 000 |
| МАШИНОСТРОЕНИЕ | | | | | | | | | | | | | |
| АТОМЭНЕРГОПРОМ | | | | | | | | | | | | | |
| Атомэнергопром 6 | | 15/08/14 | 98.50 | 99.68 | | | | | 7.96 | 1.42 | 222 | да | 10 000 |
| Трансмашхолдинг | | | | | | | | | | | | | |
| Трансмашхолдинг БО-1 | | 23/01/14 | 96.80 | 96.90 | 96.90 | 0.60 | 12 | 5 540 | 10.29 | 0.92 | | нет | 3 000 |
| КАМАЗ | | | | | | | | | | | | | |
| Камаз БО-1 | 17/12/12 | 16/12/13 | 99.90 | | | | | | -61.63 | 0.81 | | нет | 2 000 |
| Камаз БО-2 | | 04/02/14 | 98.76 | 100.20 | | | | | 8.55 | 0.95 | | нет | 3 000 |
| Камаз БО-3 | | 01/10/15 | 93.99 | | | | | | 10.77 | 2.28 | 477 | нет | 2 000 |
| УВЗ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралв агонзав од 1 | 12/12/13 | 07/12/17 | 98.76 | 101.28 | | | | | 9.36 | 0.80 | | нет | 3 000 |
| Уралв агонзав од 2 | 27/08/13 | 20/02/18 | 99.01 | 100.00 | | | | | 9.16 | 0.51 | | нет | 3 000 |
| УОМЗ | | | | | | | | | | | | | |
| УОМЗ 04 | 22/10/13 | 21/04/15 | 100.10 | 100.45 | 100.30 | | 1 | 177 | 10.24 | 0.66 | | да | 1 000 |
| ИРКУТ | | | | | | | | | | | | | |
| Иркут БО-1 | | 10/09/13 | 100.30 | 100.55 | 100.55 | 0.01 | 1 | 1 | 8.39 | 0.55 | | да | 5 000 |
| ГСС | | | | | | | | | | | | | |
| Сухого ГС БО-1 | 21/12/12 | 20/12/13 | 96.09 | 101.00 | | | | | 16.74 | 0.82 | | да | 3 000 |
| Сухого ГС БО-2 | 23/04/13 | 22/04/14 | 94.00 | | | | | | 9.07 | 0.18 | | да | 3 000 |
| Сухого ГС БО-3 | 23/04/13 | 22/04/14 | 99.70 | 100.01 | 99.97 | 0.03 | 7 | 10 052 | 8.49 | 0.18 | | да | 3 000 |
| ГСС 01 | 19/09/13 | 26/03/17 | 85.00 | 101.00 | | | | | 9.65 | 0.57 | | да | 5 000 |
| СОЛЛЕРС | | | | | | | | | | | | | |
| Соллерс БО-2 | 02/05/12 | 01/05/13 | 100.01 | 100.18 | 100.19 | 0.14 | 7 | 197 | 8.35 | 0.21 | | нет | 2 000 |
| Соллерс 2 | | 17/07/13 | 101.20 | 101.50 | 101.50 | -0.17 | 7 | 2 200 | 8.90 | 0.42 | | да | 3 000 |
| Гидромашсервис | | | | | | | | | | | | | |
| ГМС 02 | | 13/02/15 | 101.03 | 101.70 | 101.66 | -0.30 | 5 | 15 356 | 10.05 | 1.85 | 417 | да | 3 000 |
| ГМС 03 | 02/02/16 | 30/01/18 | | | | | | | 10.36 | 2.65 | 432 | нет | 00000 000 |
| ТРАНСПОРТ | | | | | | | | | | | | | |
| Аэрофлот | | | | | | | | | | | | | |
| Аэрофлот БО-1 | | 08/04/13 | 99.95 | 100.13 | | | | | 6.69 | 0.14 | | да | 6 000 |
| Аэрофлот БО-2 | | 08/04/13 | 100.00 | 100.07 | 100.07 | | 2 | 20 095 | 7.28 | 0.14 | | да | 6 000 |
| Трансконтейнер | | | | | | | | | | | | | |
| Трансконтейнер 1 | | 26/02/13 | 100.05 | 100.11 | 100.11 | 0.11 | 2 | 27 800 | 5.74 | 0.03 | | да | 3 000 |
| Трансконтейнер 2 | | 04/06/15 | | 101.50 | 100.55 | -0.10 | 1 | 100 | 8.57 | 1.45 | 282 | да | 3 000 |
| Трансконтейнер 4 | | 26/01/18 | 100.15 | 100.20 | 100.20 | 0.17 | 6 | 74 590 | 8.46 | 3.61 | 232 | нет | 5 000 |
| Глобалтранс | | | | | | | | | | | | | |
| Нов ПеревозКом 1 | | 10/07/15 | 99.70 | 101.00 | 99.50 | -0.50 | 1 | 10 | 10.00 | 1.27 | 431 | да | 3 000 |
| Нов ПеревозКом БО-01 | | 03/03/15 | 102.10 | 102.30 | 102.10 | 0.70 | 4 | 2 681 | 9.04 | 1.82 | 316 | да | 5 000 |
| Нов ПеревозКом БО-02 | | 03/03/15 | 101.70 | 102.29 | 102.26 | 0.86 | 3 | 3 | 8.95 | 1.82 | 307 | да | 5 000 |
| Трансаэро | | | | | | | | | | | | | |
| ТРАНСАЭРО БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 100.40 | 100.49 | 100.49 | | 11 | 1 251 | 11.86 | 0.52 | | нет | 3 000 |
| ТРАНСАЭРО 1 | 25/04/12 | 23/10/13 | 100.47 | 100.55 | 100.55 | 0.06 | 18 | 3 579 | 11.91 | 0.65 | | нет | 3 000 |
| Ю-Тэйр | | | | | | | | | | | | | |
| Ю-Тэйр БО-1 | | 26/03/13 | 100.00 | 100.42 | 100.42 | -0.02 | 2 | 15 990 | 8.70 | 0.11 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-2 | | 26/03/13 | 100.00 | 100.75 | | | | | 9.90 | 0.11 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-6 | 30/04/13 | 22/04/15 | 99.32 | 100.00 | 99.95 | -0.05 | 2 | 309 | 10.63 | 0.20 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-7 | 30/04/13 | 22/04/15 | 98.04 | 99.90 | | | | | 11.45 | 0.20 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-16 | 03/06/13 | 26/05/15 | | | | | | | 8.15 | 0.29 | | нет | 1 000 |
| Ю-Тэйр БО-09 | 15/11/13 | 13/11/15 | 100.00 | 100.89 | 100.89 | 0.69 | 1 | 2 | 10.92 | 0.73 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-10 | 15/11/13 | 13/11/15 | 100.03 | | 100.00 | 0.50 | 1 | 1 | 12.28 | 0.73 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-8 | 02/12/13 | 26/05/15 | | | | | | | 10.38 | 0.76 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-3 | | 19/12/13 | 99.90 | 101.60 | | | | | 7.71 | 0.81 | | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-4 | | 26/03/14 | 95.14 | 99.98 | 97.70 | -0.01 | 2 | 283 | 11.71 | 1.05 | 609 | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр БО-5 | | 26/03/14 | 96.02 | 98.75 | 98.75 | 1.00 | 2 | 580 | 10.60 | 1.05 | 498 | нет | 2 000 |
| Ю-Тэйр 5 | | 21/07/16 | | | | | | | 8.65 | 2.96 | 258 | нет | 2 000 |
| ЭНЕРГЕТИКА И СЕТИ | | | | | | | | | | | | | |
| РУСГИДРО | | | | | | | | | | | | | |
| Русгидро 1 | 22/04/16 | 12/04/21 | 95.00 | 100.25 | | | | | 8.13 | 2.81 | 208 | да | 10 000 |
| Русгидро 2 | 22/04/16 | 12/04/21 | 97.20 | 100.25 | | | | | 8.13 | 2.81 | 208 | да | 5 000 |
| МОСЭНЕРГО | | | | | | | | | | | | | |
| Мосэнерго 2 | 21/02/13 | 18/02/16 | 85.00 | 99.85 | | | | | 8.52 | 2.72 | 248 | да | 5 000 |
| Мосэнерго 3 | 06/12/12 | 28/11/14 | 100.70 | 101.70 | 100.70 | -0.50 | 1 | 4 | 8.43 | 1.66 | 261 | да | 5 000 |
| МОЭСК | | | | | | | | | | | | | |
| МОЭСК БО1 | | 18/09/15 | 100.00 | 101.75 | | | | | 8.28 | 2.29 | 228 | да | 5 000 |
| МОЭСК БО2 | | 26/10/15 | 100.20 | 101.20 | 101.09 | 0.09 | 3 | 15 005 | 8.50 | 2.40 | 249 | да | 5 000 |
| ЛЕНЭНЕРГО | | | | | | | | | | | | | |
| Ленэнерго 4 | 21/04/15 | 18/04/17 | 100.00 | 101.00 | | | | | 8.14 | 1.98 | 221 | да | 3 000 |
| ЭНЭЛ ОГК-5 | | | | | | | | | | | | | |
| ЭНЭЛ ОГК-5 Б-15 | 19/06/12 | 18/06/13 | 100.40 | 100.55 | 100.50 | 0.30 | 3 | 241 | 7.04 | 0.34 | | да | 4 000 |
| ЭНЭЛ ОГК-5 Б-18 | | 25/06/14 | 98.61 | 99.00 | | | | | 8.04 | 1.30 | 234 | да | 5 000 |
| КузбасЭнерго | | | | | | | | | | | | | |
| КузбасЭнерго-Фин 1 | 23/06/14 | 14/06/21 | 91.17 | 93.39 | | | | | 13.46 | 1.29 | 776 | нет | 10 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|---|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| КузбасЭнерго-Фин 2 МРСК ЦЕНТРА | 21/04/16 | 15/04/21 | 88.01 | 92.00 | 90.00 | 1.96 | 1 | 450 | 13.00 | 2.75 | 695 | нет | 5 000 |
| МРСК Центра БО1 МРСК ПРИВОЛЬЖЬЯ | | 14/10/15 | 100.81 | 101.89 | 101.99 | 1.19 | 2 | 26 202 | 8.26 | 2.36 | 226 | да | 4 000 |
| МРСК Ц. и Прив. БО1 МРСК ЮГА | | 15/12/15 | 101.45 | 101.75 | 101.51 | | 1 | 32 710 | 8.71 | 2.53 | 269 | нет | 4 000 |
| МРСК Юга 2 МРСК УРАЛА | 30/08/11 | 26/08/14 | 94.52 | 99.80 | | | | | 7.89 | 1.41 | 215 | нет | 6 000 |
| МРСК Урала БО1 ТГК-1 | | 28/01/16 | 99.85 | 99.90 | | | | | 8.61 | 2.67 | 257 | нет | 3 000 |
| ТГК-1 03 | 25/06/13 | 14/12/21 | | | | | | | 7.70 | 0.42 | | нет | 2 000 |
| ТГК-1 02 | 02/07/13 | 01/07/14 | 99.45 | 99.80 | 99.45 | -0.05 | 1 | 2 000 | 8.35 | 0.38 | | нет | 5 000 |
| ТГК-1 01 | 13/03/12 | 11/03/14 | 95.70 | 99.50 | | | | | 8.52 | 1.01 | | да | 4 000 |
| ТГК-9 ТГК-9 1 | 12/08/13 | 07/08/17 | 99.20 | 99.40 | 99.40 | -0.32 | 6 | 3 270 | 9.60 | 0.49 | | нет | 7 000 |
| ТГК-2 ТГК-2 БО-1 | | 17/09/13 | 86.00 | 86.40 | 86.40 | 0.43 | 94 | 10 401 | 40.11 | 0.56 | | нет | 5 000 |
| ТГК-5 ТГК-5 1 | 11/10/13 | 06/10/17 | 99.69 | 99.70 | 99.69 | 0.44 | 3 | 34 | 9.43 | 0.63 | | нет | 5 000 |
| Иркутскэнерго Ирку тЭнерго-1 | | 28/11/13 | | | | | | | 7.77 | 0.75 | | нет | 5 000 |
| Ирку тЭнерго БО-1 ЯКУТСКЭНЕРГО | | 08/04/14 | 88.86 | 98.90 | | | | | 8.80 | 1.09 | 317 | нет | 3 000 |
| Яку тскэнерго БО-1 ГЭС | | 03/09/13 | 99.98 | 100.50 | 100.05 | -0.05 | 1 | 300 | 8.31 | 0.53 | | да | 3 000 |
| Газпром-газэнергосеть 2 ТГК-6 | | 23/04/13 | 97.72 | 105.00 | | | | | 12.06 | 0.18 | | да | 2 000 |
| ТГК-6 1 | 29/08/13 | 24/08/17 | 97.90 | 99.40 | 99.35 | | 1 | 60 | 9.79 | 0.52 | | нет | 5 000 |
| ХИМИЧЕСКИЕ | | | | | | | | | | | | | |
| ЕВРОХИМ | | | | | | | | | | | | | |
| Еврохим 2 | 30/06/15 | 26/06/18 | 101.00 | 101.20 | 101.20 | 0.10 | 2 | 4 | 8.50 | 2.17 | 252 | да | 5 000 |
| Еврохим 3 | 18/11/15 | 14/11/18 | 93.00 | | | | | | 9.28 | 2.47 | 326 | да | 5 000 |
| АКРОН | | | | | | | | | | | | | |
| Акрон 2 | 22/09/11 | 19/09/13 | 99.51 | 100.32 | 99.99 | -1.41 | 3 | 407 | 8.36 | 0.57 | | да | 4 000 |
| Акрон 3 | 23/05/12 | 20/11/13 | 101.15 | 101.30 | 101.30 | 0.05 | 8 | 16 563 | 8.19 | 0.74 | | да | 4 000 |
| Акрон 4 | 27/05/14 | 18/05/21 | 97.10 | 100.00 | | | | | 8.29 | 1.22 | 261 | да | 4 000 |
| Акрон 5 | 27/05/14 | 18/05/21 | 97.11 | 99.77 | | | | | 9.42 | 1.22 | 374 | да | 4 000 |
| Акрон БО1 КУАЗ | | 13/10/15 | 101.90 | 102.00 | 101.90 | | 4 | 4 | 9.12 | 2.33 | 312 | да | 5 000 |
| КУАЗ-Инвест 4 | 10/04/14 | 07/04/16 | 98.80 | 99.00 | 98.80 | -0.05 | 5 | 968 | 9.95 | 1.09 | 432 | нет | 2 000 |
| СТРОИТЕЛЬСТВО И СТРОЙМАТЕРИАЛЫ | | | | | | | | | | | | | |
| ЛСР | | | | | | | | | | | | | |
| ЛСР Гру ппа 2 | 31/01/13 | 01/08/13 | 100.10 | 100.99 | | | | | 9.71 | 0.46 | | да | 5 000 |
| ЛСР Гру ппа БО-1 | 26/06/12 | 25/06/13 | 100.10 | 101.20 | | | | | 10.54 | 0.36 | | да | 2 000 |
| ЛСР Гру ппа БО-2 | | 10/09/13 | 100.10 | 100.45 | 100.41 | 0.15 | 5 | 41 | 9.43 | 0.54 | | да | 2 000 |
| ЛСР Гру ппа 3 | 14/03/14 | 08/09/17 | 101.40 | 101.50 | 101.50 | 0.15 | 6 | 4 950 | 10.22 | 0.99 | | да | 3 000 |
| ЛСР Гру ппа БО-3 | | 20/03/14 | 99.25 | 99.65 | 99.65 | 0.09 | 12 | 3 799 | 10.07 | 1.02 | 446 | да | 2 000 |
| ЛСР Гру ппа БО-5 | | 24/07/14 | 97.21 | 97.64 | 97.21 | -0.48 | 2 | 9 | 10.89 | 1.38 | 516 | да | 2 000 |
| ЛСР Гру ппа 04 РеноваСтройГрупп | 24/10/14 | 20/10/17 | 100.00 | 102.50 | | | | | 11.37 | 1.53 | 559 | да | 5 000 |
| РСГ-Финанс-1 | 19/12/12 | 18/06/14 | 102.00 | 102.24 | 102.00 | 0.09 | 10 | 162 | 12.12 | 1.22 | 644 | да | 3 000 |
| РСГ-Финанс-2 ЛенСпецСМУ | 15/04/14 | 13/10/15 | 101.25 | | | | | | 12.71 | 1.07 | 708 | да | 3 000 |
| ЛенСпецСМУ БО-2 ЛенСпецСМУ 02 | | 23/05/13 | | | | | | | 3.73 | 0.26 | | да | 2 000 |
| | | 12/12/17 | 102.10 | 102.50 | 102.10 | 0.10 | 7 | 458 | 12.77 | 3.02 | 669 | нет | 5 000 |
| ТЕХНОЛОГИИ, МЕДИА, ИНТЕГРИРОВАННЫЕ | | | | | | | | | | | | | |
| РОСНАНО | | | | | | | | | | | | | |
| РОСНАНО 1 | | 20/12/17 | 100.40 | 100.60 | | | | | 8.88 | 3.99 | 268 | да | 8 000 |
| РОСНАНО 2 | | 20/12/17 | 99.15 | 101.70 | | | | | 8.91 | 3.99 | 271 | да | 10 000 |
| РОСНАНО 3 | | 20/12/17 | 99.20 | 101.70 | | | | | 9.32 | 4.00 | 312 | да | 15 000 |
| СИСТЕМА | | | | | | | | | | | | | |
| АФК Система 1 | | 07/03/13 | 100.03 | 100.18 | 100.10 | -0.09 | 1 | 640 | 7.88 | 0.05 | | да | 6 000 |
| АФК Система 2 | 14/08/12 | 12/08/14 | 100.41 | 100.52 | 100.40 | -0.10 | 3 | 1 502 | 8.22 | 1.43 | 247 | да | 20 000 |
| АФК Система 4 | | 15/03/16 | 99.10 | 99.15 | 99.16 | | 7 | 15 650 | 8.34 | 1.61 | 254 | да | 20 000 |
| АФК Система 3 | 29/11/12 | 24/11/16 | 100.75 | 100.95 | 100.91 | 0.21 | 3 | 307 | 8.64 | 3.24 | 254 | да | 19 000 |
| ПРОФМЕДИА | | | | | | | | | | | | | |
| ПрофМедиа Финанс 1 СИТРОНИКС | 18/07/13 | 16/07/15 | 99.40 | 100.10 | 100.08 | -0.03 | 8 | 680 | 10.52 | 0.42 | | да | 3 000 |
| Ситроникс БО-1 Ситроникс БО-2 | 19/06/12 | 18/06/13 | 99.91 | 100.75 | | | | | 9.66 | 0.34 | | да | 2 000 |
| | 08/10/12 | 07/10/13 | 100.30 | 100.60 | 100.60 | -0.09 | 1 | 10 | 11.25 | 0.61 | | да | 3 000 |
| ЧАСТНЫЕ БАНКИ | | | | | | | | | | | | | |
| РОСБАНК | | | | | | | | | | | | | |
| РОСБАНК ВО3 | 16/05/13 | 16/11/14 | 100.39 | 100.45 | | | | | 7.25 | 0.25 | | да | 10 000 |
| РОСБАНК ВО1 | 25/06/13 | 25/06/13 | 100.59 | 100.65 | 100.65 | 0.05 | 1 | 5 500 | 7.10 | 0.36 | | да | 5 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | ЦБ | Объем млн руб. |
|----------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|-----|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| РОСБАНК ВО2 | | 08/07/13 | 100.31 | 100.38 | 100.31 | -0.07 | 4 | 4 419 | 7.28 | 0.39 | | да | 5 000 |
| РОСБАНК А3 | 06/05/11 | 06/11/13 | 99.63 | 99.68 | 99.67 | 0.05 | 3 | 31 434 | 7.49 | 0.71 | | да | 5 000 |
| РОСБАНК ВО4 | 12/09/14 | 12/09/15 | 102.05 | 102.20 | | | | | 8.04 | 1.44 | 229 | да | 10 000 |
| РОСБАНК А5 | 06/05/11 | 07/11/14 | 99.05 | 99.20 | | | | | 8.13 | 1.62 | 232 | да | 5 000 |
| РОСБАНК ВО5 | | 31/01/16 | 101.23 | 101.34 | 101.30 | 0.02 | 8 | 80 505 | 8.46 | 2.66 | 242 | нет | 5 000 |
| РОСБАНК ВО6 | | 01/02/16 | 101.20 | 101.30 | 101.30 | 0.15 | 19 | 27 974 | 8.46 | 2.66 | 242 | нет | 5 000 |
| Альфа-Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Альфа-Банк 2 | 07/06/13 | 02/12/16 | 98.88 | 100.50 | 100.50 | 0.05 | 3 | 15 001 | 7.64 | 0.31 | | да | 5 000 |
| Альфа-Банк ВО3 | 28/09/13 | 28/09/15 | 100.20 | | | | | | 7.90 | 0.60 | | да | 10 000 |
| Альфа-Банк 1 | 04/02/14 | 02/02/16 | 100.15 | 100.80 | 100.15 | -0.05 | 2 | 10 011 | 8.25 | 0.95 | | да | 5 000 |
| Альфа-Банк ВО7 | 28/02/14 | 31/08/15 | 100.25 | 101.50 | 100.51 | 0.01 | 1 | 36 120 | 8.23 | 0.98 | | да | 5 000 |
| МДМ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| МДМ Банк ВО4 | 16/12/13 | 16/12/14 | 100.41 | 100.60 | 100.50 | | 3 | 3 400 | 9.03 | 0.81 | | да | 5 000 |
| МДМ Банк 8 | 09/07/13 | 09/04/15 | 100.06 | 100.35 | 100.30 | -0.03 | 2 | 67 775 | 8.39 | 0.38 | | да | 6 000 |
| МДМ Банк ВО2 | | 21/03/14 | 96.03 | 100.35 | | | | | 9.74 | 1.09 | 411 | да | 5 000 |
| НОМОС Банк | | | | | | | | | | | | | |
| НОМОС Банк ВО2 | 18/04/13 | 18/10/14 | 99.91 | 100.05 | 100.05 | 0.05 | 4 | 51 001 | 7.74 | 0.17 | | да | 5 000 |
| НОМОС Банк 9 | 15/06/12 | 14/06/13 | 99.90 | 100.17 | 100.15 | 0.15 | 6 | 72 000 | 8.38 | 0.33 | | да | 5 000 |
| НОМОС Банк ВО3 | 09/08/13 | 09/08/15 | 100.30 | 100.50 | | | | | 8.74 | 0.48 | | да | 5 000 |
| НОМОС Банк 12 | 25/08/13 | 28/08/13 | | | | | | | 8.78 | 0.50 | | да | 5 000 |
| НОМОС Банк ВО1 | 24/02/12 | 24/02/14 | | | | | | | 8.99 | 0.96 | | да | 5 000 |
| НОМОС Банк 11 | 02/07/14 | 02/07/14 | 99.99 | 101.95 | 100.35 | | 3 | 50 000 | 9.42 | 1.31 | 371 | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ | | | | | | | | | | | | | |
| Банк ЗЕНИТ ВО6 | 26/05/13 | 26/05/14 | 100.15 | 100.27 | | | | | 8.27 | 0.27 | | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ ВО4 | 07/02/14 | 07/02/15 | 100.05 | 100.12 | 100.12 | 0.07 | 2 | 1 338 | 8.80 | 0.96 | | да | 3 000 |
| Банк ЗЕНИТ ВО5 | 14/02/14 | 14/02/15 | 100.00 | 100.07 | 100.05 | | 1 | 10 000 | 8.89 | 0.98 | | да | 3 000 |
| Банк ЗЕНИТ 1 | 07/04/12 | 07/04/13 | | | | | | | 12.14 | 0.14 | | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ t 5 | 05/06/12 | 04/06/13 | 100.23 | 100.35 | 100.23 | -0.04 | 1 | 600 | 8.30 | 0.30 | | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ 6 | 02/07/13 | 01/07/14 | 100.38 | 100.41 | | | | | 8.13 | 0.38 | | да | 3 000 |
| Банк ЗЕНИТ 8 | 28/08/13 | 23/08/17 | 100.44 | 100.53 | 100.50 | 0.01 | 2 | 976 | 8.38 | 0.51 | | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ ВО2 | 22/09/12 | 22/09/13 | | | | | | | 7.62 | 0.62 | | да | 5 000 |
| Банк ЗЕНИТ ВО3 | 15/11/13 | 15/11/14 | 100.35 | 100.60 | 100.50 | 0.05 | 1 | 20 000 | 8.54 | 0.73 | | да | 3 000 |
| Банк ЗЕНИТ ВО7 | 12/04/14 | 12/04/15 | 100.50 | 100.60 | 100.57 | 0.06 | 2 | 8 | 8.84 | 1.09 | 321 | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Промсвязьбанк ВО2 | 20/02/13 | 18/02/15 | | | | | | | 9.43 | 1.80 | 356 | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк ВО4 | 20/02/13 | 18/02/15 | | | | | | | 9.40 | 1.80 | 353 | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк 6 | | 17/06/13 | 99.95 | 100.05 | 99.95 | -0.05 | 9 | 8 061 | 8.52 | 0.33 | | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк ВО3 | | 04/02/14 | 95.01 | 99.99 | 99.87 | -0.05 | 5 | 629 | 8.93 | 0.95 | | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк ВО7 | 06/09/14 | 06/09/15 | 99.00 | 101.99 | | | | | 9.65 | 1.42 | 391 | да | 5 000 |
| Промсвязьбанк 3 | | 01/02/18 | | 104.00 | | | | | 12.33 | 3.87 | 616 | нет | 5 000 |
| Банк СПб | | | | | | | | | | | | | |
| Банк СПб ВО1 | 09/10/12 | 09/04/13 | | | | | | | 8.41 | 0.19 | | да | 5 000 |
| Банк СПб ВО4 | 13/12/12 | 12/12/13 | 86.00 | 101.00 | | | | | 9.07 | 0.80 | | да | 3 000 |
| Банк СПб ВО2 | 26/03/12 | 23/09/13 | 98.00 | 100.25 | 100.13 | -0.12 | 1 | 67 703 | 8.94 | 0.58 | | да | 5 000 |
| Банк СПб ВО8 | 07/10/13 | 05/10/15 | 100.42 | 100.45 | | | | | 8.97 | 0.62 | | да | 5 000 |
| МКБ | | | | | | | | | | | | | |
| МКБ 7 | 14/01/14 | 14/07/15 | 100.00 | 100.85 | | | | | 10.00 | 0.89 | | да | 2 000 |
| МКБ ВО-01 | 22/02/13 | 22/02/14 | | | | | | | 8.50 | 0.02 | | да | 3 000 |
| МКБ ВО-03 | 27/04/13 | 27/04/15 | 100.03 | 100.24 | | | | | 9.27 | 0.19 | | да | 4 000 |
| МКБ ВО-02 | 25/09/13 | 25/09/15 | 100.25 | 100.35 | 100.25 | -0.05 | 1 | 50 | 9.50 | 0.59 | | да | 3 000 |
| МКБ 8 | 09/10/13 | 08/04/15 | 85.00 | 100.50 | | | | | 9.98 | 0.62 | | да | 3 000 |
| МКБ ВО-04 | 15/10/12 | 15/04/14 | 99.81 | 100.69 | 99.81 | -0.39 | 4 | 9 | 10.67 | 1.09 | 504 | да | 5 000 |
| МКБ ВО-05 | | 23/06/14 | 99.00 | 99.10 | 99.10 | 0.10 | 3 | 3 000 | 10.16 | 1.28 | 446 | да | 5 000 |
| МКБ КВ 11 | | 05/06/18 | 99.80 | 100.05 | | | | | 12.60 | 3.97 | 641 | нет | 3 000 |
| ПЕТРОКОММЕРЦ | | | | | | | | | | | | | |
| Петрокоммерц 5 | 20/12/13 | 21/12/14 | 100.85 | 100.99 | 100.98 | 0.01 | 6 | 31 003 | 8.67 | 0.82 | | да | 5 000 |
| Петрокоммерц БО-01 | 03/09/13 | 03/03/15 | 100.15 | 100.75 | 100.15 | 0.03 | 1 | 2 000 | 8.78 | 0.53 | | да | 3 000 |
| Петрокоммерц БО-02 | 23/08/13 | 23/08/15 | 86.01 | 100.60 | | | | | 8.77 | 0.50 | | да | 3 000 |
| Петрокоммерц БО-03 | 23/02/14 | 23/08/15 | 86.00 | 102.00 | 100.75 | 0.25 | 1 | 1 | 9.11 | 0.95 | | да | 5 000 |
| Банк УРАЛСИБ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб 04 | 13/09/13 | 10/03/17 | 100.00 | 100.40 | | | | | 8.73 | 0.55 | | да | 5 000 |
| Уралсиб 05 | 28/02/14 | 25/08/17 | 100.70 | 100.85 | 100.80 | 0.05 | 5 | 15 000 | 9.06 | 0.97 | | да | 7 000 |
| ЛК УРАЛСИБ | | | | | | | | | | | | | |
| Уралсиб Лизинг БО-3 | | 29/10/13 | 100.25 | 100.40 | 100.25 | | 1 | 10 000 | 9.22 | 0.44 | | да | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-1 | | 28/02/14 | 100.00 | 100.45 | | | | | 9.83 | 0.52 | | да | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-4 | | 03/07/14 | 99.20 | 99.40 | 99.20 | | 3 | 59 195 | 9.96 | 0.72 | | да | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-5 | | 05/02/15 | 101.12 | 101.35 | 101.35 | -0.02 | 1 | 5 | 10.56 | 1.04 | 495 | да | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-6 | | 10/02/15 | 100.00 | 101.00 | 101.00 | | 1 | 150 | 10.94 | 1.05 | 532 | нет | 3 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-7 | | 22/04/15 | 100.05 | 100.90 | | | | | 10.51 | 1.10 | 487 | да | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-2 | | 12/01/15 | 101.45 | 101.80 | | | | | 10.86 | 1.72 | 502 | нет | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-9 | | 17/02/15 | | | | | | | 10.85 | 1.77 | 499 | нет | 2 000 |
| Уралсиб Лизинг БО-12 | | 18/12/15 | 100.00 | 100.50 | | | | | 10.96 | 2.53 | 494 | нет | 2 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|-----------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Уралсиб Лизинг БО-13 | | 18/12/15 | 100.00 | 100.55 | | | | | 10.92 | 2.61 | 489 | нет | 2 000 |
| КБ РЕНЕССАНС КАПИТАЛ | | | | | | | | | | | | | |
| РенКап БО-3 | 05/08/13 | 05/08/14 | 99.85 | 99.89 | 99.90 | -0.04 | 2 | 4 000 | 10.37 | 0.47 | | да | 3 000 |
| РенКап БО-2 | 09/08/13 | 09/08/15 | 100.85 | 101.43 | 101.43 | 0.28 | 3 | 11 | 10.01 | 0.48 | | нет | 2 000 |
| ТКС БАНК | | | | | | | | | | | | | |
| ТКС БАНК ВО4 | 18/04/13 | 16/04/15 | 100.60 | 100.65 | 100.65 | 0.19 | 5 | 447 | 9.32 | 0.17 | | да | 2 000 |
| ТКС БАНК ВО6 | 16/07/13 | 09/07/15 | 101.52 | 101.60 | 101.52 | 0.02 | 7 | 507 | 10.25 | 0.41 | | да | 2 000 |
| ТКС БАНК S 2 | | 28/07/13 | 104.41 | 104.55 | 104.40 | -0.15 | 9 | 268 | 9.87 | 0.45 | | да | 1 000 |
| ТКС БАНК О1 | | 20/09/13 | 101.40 | 104.00 | 101.30 | -2.70 | 1 | 1 | 12.19 | 0.56 | | да | 2 000 |
| ТКС БАНК ВО2 | 29/11/11 | 26/11/13 | 104.37 | 104.46 | 104.37 | 0.07 | 11 | 978 | 10.71 | 0.74 | | да | 2 000 |
| ТКС БАНК ВО3 | 21/08/12 | 18/02/14 | | | | | | | 10.90 | 0.92 | | да | 2 000 |
| Связной Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Связной Банк 1 | 08/08/13 | 06/08/15 | 101.70 | 101.73 | 101.73 | 0.08 | 14 | 1 589 | 10.69 | 0.48 | | нет | 2 000 |
| РОСГОССТРАХ | | | | | | | | | | | | | |
| Росгосстрах 2 | 07/11/13 | 02/11/17 | 101.00 | 101.19 | 101.00 | -0.15 | 2 | 1 650 | 9.21 | 0.70 | | нет | 5 000 |
| РОСГОССТРАХ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Росгосстрах Банк 03 | 28/02/13 | 31/08/14 | 99.95 | 100.08 | | | | | 9.81 | 0.04 | | да | 2 000 |
| Росгосстрах Банк 04 | 01/07/13 | 03/07/15 | 99.60 | 99.75 | | | | | 9.61 | 0.37 | | да | 3 000 |
| РЕСО-ГАРАНТИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Ресо гарантия 02 | 24/09/13 | 13/09/22 | 99.80 | 100.00 | 100.00 | 0.15 | 3 | 21 450 | 8.86 | 0.58 | | да | 5 000 |
| Ресо гарантия 01 | 01/09/14 | 22/08/22 | 100.40 | 101.20 | 101.16 | 0.31 | 3 | 1 420 | 8.76 | 1.41 | 302 | да | 5 000 |
| ЕАБР | | | | | | | | | | | | | |
| ЕАБР 3 | 29/10/13 | 25/10/16 | 90.10 | 100.35 | | | | | 7.22 | 0.68 | | да | 5 000 |
| ЕАБР 1 | 03/02/14 | 28/01/19 | 87.00 | 102.30 | | | | | 7.29 | 0.94 | | да | 5 000 |
| ЕАБР 4 | 11/02/14 | 06/02/18 | 86.00 | | | | | | 7.85 | 0.97 | | да | 5 000 |
| ЕАБР 2 | 26/02/15 | 21/02/19 | 100.50 | | | | | | 8.49 | 1.85 | 260 | да | 5 000 |
| Юникредит Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Юникредит Банк 4 | 13/05/14 | 10/11/15 | 100.50 | 101.00 | | | | | 8.38 | 1.18 | 272 | да | 10 000 |
| Юникредит Банк БО02 | 30/08/13 | 27/02/15 | 100.20 | 100.50 | | | | | 7.82 | 0.52 | | да | 5 000 |
| Юникредит Банк БО03 | 04/09/13 | 04/03/15 | 94.10 | 100.45 | 100.45 | | 1 | 1 | 7.78 | 0.53 | | да | 5 000 |
| Юникредит Банк 5 | 03/09/13 | 01/09/15 | 99.81 | 100.06 | 99.94 | 0.14 | 1 | 1 | 7.75 | 0.53 | | да | 5 000 |
| Юникредит Банк БО01 | 11/12/13 | 10/12/14 | 100.80 | 101.05 | 100.95 | -0.15 | 2 | 2 | 7.91 | 0.80 | | да | 5 000 |
| Юникредит Банк БО04 | 24/10/14 | 23/10/15 | 87.00 | 102.00 | 101.65 | | 1 | 480 | 8.18 | 1.56 | 239 | да | 5 000 |
| Юникредит Банк БО05 | 28/10/14 | 27/10/15 | | | | | | | 8.09 | 1.57 | 230 | да | 5 000 |
| Юникредит Банк 1 | | 07/09/16 | 99.00 | 99.50 | 99.30 | 1.30 | 1 | 40 | 8.61 | 3.05 | 253 | да | 5 000 |
| Райффайзенбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Райффайзен 4 | 06/12/11 | 03/12/13 | 101.13 | 101.24 | 101.20 | 0.05 | 4 | 15 600 | 7.28 | 0.78 | | да | 10 000 |
| Райффайзен БО-7 | | 27/11/13 | 100.20 | 100.50 | | | | | 7.27 | 0.76 | | да | 5 000 |
| ИНГ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| ИНГ Банк 2 | 15/05/13 | 18/11/14 | | | | | | | 8.48 | 0.25 | | нет | 5 000 |
| РуссСтандарт | | | | | | | | | | | | | |
| РуссСтандарт БО-1 | 08/11/13 | 07/11/14 | 100.36 | 100.57 | 100.53 | 0.10 | 7 | 283 | 8.78 | 0.71 | | да | 5 000 |
| РуссСтандарт БО-2 | 26/03/13 | 24/03/15 | 100.10 | 100.12 | 100.09 | -0.04 | 4 | 1 364 | 8.16 | 0.11 | | да | 5 000 |
| РуссСтандарт БО-6 | 03/11/13 | 03/05/15 | 100.23 | 100.50 | | | | | 8.92 | 0.69 | | да | 5 000 |
| Вост-Экспресс | | | | | | | | | | | | | |
| Вост-Экспр Банк БО-1 | 10/03/11 | 07/03/13 | 86.02 | 100.00 | 100.00 | | 1 | 1 400 | 7.51 | 0.05 | | да | 1 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-4 | 16/08/13 | 14/08/15 | 100.70 | 100.89 | 100.88 | 0.33 | 3 | 47 534 | 9.49 | 0.49 | | да | 3 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-5 | 19/04/12 | 17/10/13 | 100.01 | 100.83 | 100.17 | -0.05 | 1 | 200 000 | 9.92 | 0.64 | | да | 2 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-2 | 27/03/14 | 25/09/14 | 100.00 | 101.00 | | | | | 10.61 | 1.03 | 500 | да | 2 000 |
| Вост-Экспр Банк БО-10 | 23/12/14 | 22/12/15 | 100.42 | 101.39 | 100.90 | -0.35 | 2 | 1 350 | 11.75 | 1.69 | 592 | нет | 3 000 |
| ЖКФ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| ЖКФ Банк 6 | 12/03/13 | 10/06/14 | 100.10 | 100.75 | 100.32 | -0.38 | 1 | 300 000 | 9.40 | 1.23 | 372 | да | 5 000 |
| ЖКФ Банк 5 | 19/10/11 | 17/04/13 | 99.99 | 100.15 | | | | | 7.46 | 0.17 | | да | 4 000 |
| ЖКФ Банк БО-3 | 22/10/13 | 22/04/14 | 85.00 | 99.90 | | | | | 8.31 | 0.67 | | да | 4 000 |
| ЖКФ Банк 7 | 26/04/12 | 23/04/15 | 101.10 | 101.25 | 101.21 | -0.09 | 6 | 6 876 | 9.45 | 1.98 | 352 | да | 5 000 |
| БНП Париба | | | | | | | | | | | | | |
| БНП Париба 1 | | 29/03/14 | 99.50 | 100.45 | 100.41 | | 2 | 2 | 7.43 | 1.06 | 181 | да | 2 000 |
| РусфинансБанк | | | | | | | | | | | | | |
| РусфинансБанк БО-01 | 04/07/13 | 04/07/14 | 85.00 | | 99.69 | 0.03 | 3 | 21 000 | 8.12 | 0.38 | | да | 4 000 |
| РусфинансБанк БО-02 | 06/09/13 | 06/03/15 | 100.10 | 100.23 | 100.25 | 0.05 | 2 | 5 676 | 8.43 | 0.53 | | да | 4 000 |
| РусфинансБанк 8 | 16/09/13 | 14/09/15 | 95.02 | 100.80 | 100.33 | -0.10 | 3 | 1 953 | 8.82 | 0.56 | | да | 2 000 |
| РусфинансБанк 9 | 17/09/13 | 15/09/15 | 100.30 | 100.70 | | | | | 8.51 | 0.56 | | да | 2 000 |
| РусфинансБанк 10 | 12/11/13 | 10/11/15 | 86.00 | 100.50 | 99.79 | | 2 | 50 | 8.34 | 0.72 | | да | 2 000 |
| РусфинансБанк 11 | 13/11/13 | 11/11/15 | | | | | | | 8.39 | 0.72 | | да | 2 000 |
| РусфинансБанк БО3 | 02/11/14 | 02/11/15 | | 102.20 | | | | | 8.76 | 1.58 | 297 | да | 4 000 |
| ДЕЛЬТА КРЕДИТ | | | | | | | | | | | | | |

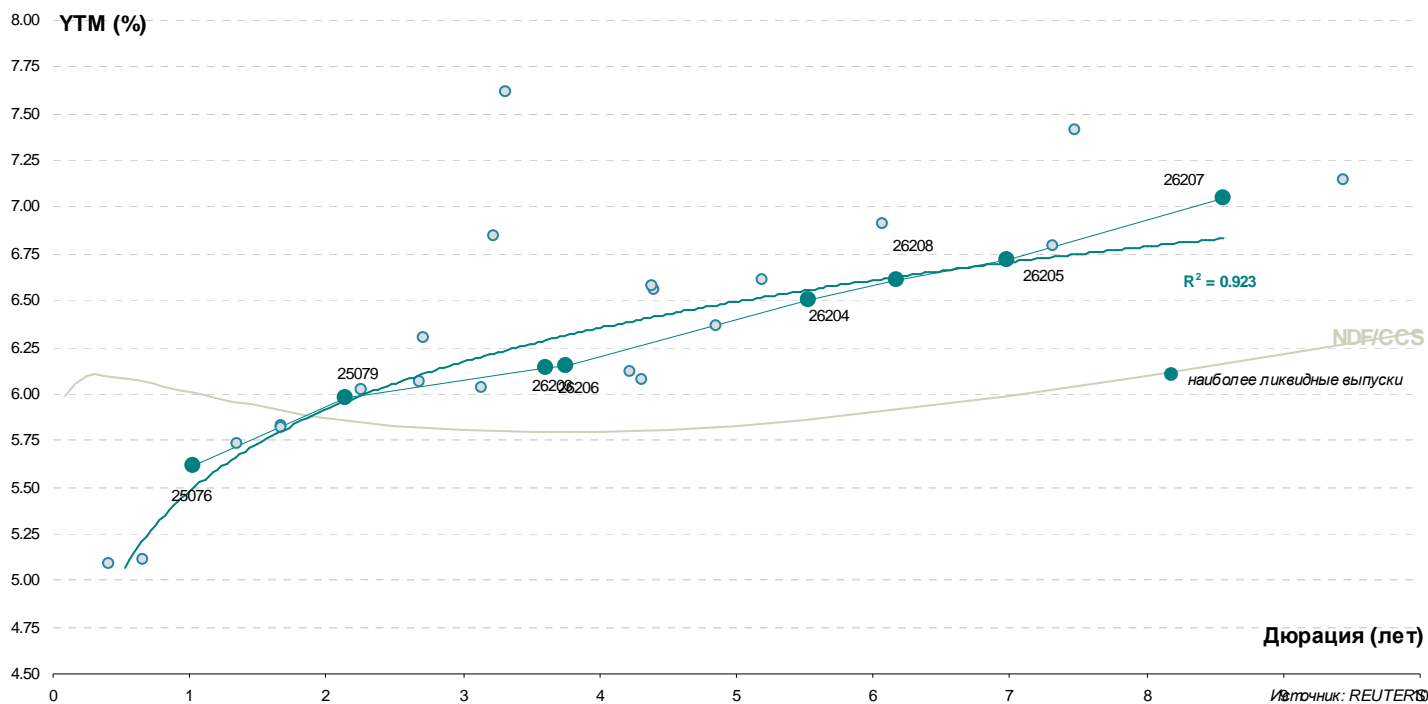
| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | ЦБ | Объем млн руб. |
|------------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|-----|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Дельта Кредит БО3 | 07/08/13 | 07/08/15 | 100.80 | 100.88 | 100.80 | | 5 | 19 000 | 7.63 | 0.47 | | да | 4 000 |
| Дельта Кредит 6 | 18/06/14 | 15/06/16 | 98.70 | 99.40 | | | | | 7.94 | 1.28 | 224 | да | 5 000 |
| Дельта Кредит 8 | 05/11/14 | 02/11/16 | 99.77 | 100.00 | | | | | 8.49 | 1.61 | 269 | да | 5 000 |
| ОТП Банк | | | | | | | | | | | | | |
| ОТП Банк БО-3 | 01/11/12 | 30/10/14 | | | | | | | 9.76 | 1.58 | 397 | да | 4 000 |
| ОТП Банк БО-2 | 04/03/14 | 03/03/15 | 101.11 | 101.30 | 101.20 | 0.10 | 2 | 1 701 | 9.48 | 0.98 | | да | 6 000 |
| ОТП Банк 2 | | 25/03/14 | 98.85 | 99.55 | 99.51 | 0.40 | 13 | 4 219 | 8.90 | 1.05 | 328 | да | 3 000 |
| ОТП Банк БО-1 | | 29/07/14 | 98.35 | 98.40 | 98.38 | -0.02 | 3 | 938 | 9.37 | 1.39 | 364 | да | 5 000 |
| СКБ-Банк | | | | | | | | | | | | | |
| СКБ-Банк БО-4 | 05/12/12 | 05/06/13 | | | | | | | 0.18 | 0.30 | | да | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-3 | 28/05/13 | 26/11/13 | 100.00 | | | | | | 8.29 | 0.28 | | да | 3 000 |
| СКБ-Банк БО-6 | 09/07/13 | 08/06/14 | 99.00 | | | | | | 10.16 | 0.39 | | да | 2 000 |
| СКБ-Банк БО-5 | 10/10/13 | 10/04/14 | 100.00 | | | | | | 9.61 | 0.62 | | да | 2 000 |
| КредитЕвропа Банк | | | | | | | | | | | | | |
| КредЕврБанк БО-3 | 09/10/13 | 09/10/15 | 100.35 | 100.44 | 100.35 | | 7 | 29 498 | 9.40 | 0.62 | | да | 5 000 |
| КредЕврБанк 6 | 21/08/12 | 18/02/14 | | | | | | | 9.72 | 0.99 | | да | 4 000 |
| КредЕврБанк БО-2 | 10/02/14 | 10/02/15 | 100.11 | 100.60 | 100.56 | 0.75 | 4 | 1 011 | 9.61 | 0.96 | | да | 5 000 |
| КредЕврБанк БО-1 | | 27/04/14 | 96.40 | 98.45 | 98.24 | 0.19 | 8 | 30 002 | 9.91 | 1.14 | 426 | да | 5 000 |
| Банк Интеза | | | | | | | | | | | | | |
| Интеза О3 | 11/10/13 | 13/04/15 | 100.00 | 100.30 | 100.26 | 0.25 | 2 | 14 | 8.73 | 0.63 | | да | 5 000 |
| Интеза БО1 | 25/04/14 | 25/10/15 | 100.00 | 100.97 | 100.15 | | 1 | 8 | 9.82 | 1.12 | 418 | да | 3 000 |
| Центр-Инвест | | | | | | | | | | | | | |
| ЦентрИнвест БО-1 | 17/12/13 | 17/06/14 | 100.10 | 100.30 | | | | | 9.62 | 0.81 | | да | 2 000 |
| ЦентрИнвест БО-5 | 17/12/13 | 17/06/14 | 100.10 | 100.30 | | | | | 9.68 | 0.86 | | да | 1 000 |
| ЦентрИнвест БО-2 | 18/04/13 | 16/04/15 | 100.08 | 100.20 | 100.13 | | 2 | 116 | 8.97 | 0.17 | | да | 2 000 |
| ЦентрИнвест 2 | 25/06/13 | 24/06/14 | 100.54 | 100.59 | 100.59 | | 1 | 5 000 | 8.80 | 0.36 | | да | 3 000 |
| Связь-Банк | | | | | | | | | | | | | |
| СвязьБанк 03 | 19/12/13 | 09/12/21 | 100.00 | 101.68 | | | | | 9.18 | 0.82 | | да | 5 000 |
| СвязьБанк 04 | 24/04/13 | 13/04/22 | 100.01 | 100.15 | | | | | 7.97 | 0.19 | | да | 5 000 |
| СвязьБанк БО1 | 01/11/13 | 01/11/15 | 86.00 | 100.39 | | | | | 9.16 | 0.69 | | нет | 5 000 |
| СвязьБанк 05 | 16/04/15 | 07/04/22 | 100.00 | | | | | | 9.71 | 2.44 | 370 | да | 5 000 |
| Крайинвестбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Крайинвестбанк БО-1 | 19/10/13 | 19/04/14 | 99.90 | 100.09 | 100.00 | 0.10 | 2 | 5 000 | 10.73 | 0.65 | | да | 2 000 |
| Судостроительный банк | | | | | | | | | | | | | |
| Судостр БО01 | 03/03/13 | 03/03/14 | 99.00 | 100.05 | | | | | 9.82 | 0.04 | | нет | 2 000 |
| Судостр 04 | 10/04/12 | 08/10/13 | 99.82 | 101.30 | | | | | 10.82 | 0.62 | | нет | 2 000 |
| Меткомбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Меткомбанк БО-1 | 02/02/13 | 02/08/14 | 100.20 | 100.65 | 100.65 | 0.05 | 1 | 50 | 10.78 | 1.38 | 505 | да | 2 000 |
| Меткомбанк 01 | 13/04/13 | 15/04/15 | 100.15 | 101.50 | | | | | 8.47 | 0.16 | | нет | 2 000 |
| Меткомбанк БО5 | 08/10/13 | 06/10/15 | 100.50 | 102.00 | | | | | 10.86 | 0.62 | | да | 2 000 |
| Металлинвестбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Металлинвестбанк 01 | 20/12/13 | 22/06/15 | 100.00 | 100.45 | | | | | 10.11 | 0.82 | | да | 2 000 |
| Абсолют банк | | | | | | | | | | | | | |
| Абсолют банк БО1 | 20/06/14 | 20/12/15 | | | 100.00 | -0.02 | 1 | 12 100 | 10.75 | 1.27 | 506 | нет | 5 000 |
| Абсолют банк 5 | 30/07/14 | 27/07/16 | 86.00 | 100.02 | | | | | 10.53 | 1.39 | 480 | да | 2 000 |
| ПЕРВОБАНК | | | | | | | | | | | | | |
| Первобанк БО2 | 11/04/13 | 10/04/14 | 86.00 | 100.30 | | | | | 8.28 | 0.15 | | да | 2 000 |
| Первобанк БО1 | 25/04/12 | 24/04/13 | | 100.33 | | | | | 8.98 | 0.19 | | да | 2 000 |
| Первобанк БО3 | 24/09/13 | 22/09/15 | 100.05 | 102.00 | | | | | 10.73 | 0.58 | | нет | 2 000 |
| СМП Банк | | | | | | | | | | | | | |
| СМП Банк 01 | 26/11/13 | 23/05/17 | 99.80 | | | | | | 10.14 | 0.75 | | да | 3 000 |
| ПРОБИЗНЕСБАНК | | | | | | | | | | | | | |
| Пробизнесбанк 7 | 03/09/13 | 05/09/15 | 99.70 | 100.50 | 100.50 | 0.50 | 3 | 420 | 11.05 | 0.52 | | нет | 2 000 |
| ЛОКО-Банк | | | | | | | | | | | | | |
| ЛОКО-Банк БО1 | 07/02/13 | 06/02/14 | 85.10 | 100.50 | 100.48 | 0.47 | 2 | 15 099 | 9.59 | 0.95 | | да | 3 000 |
| ЛОКО-Банк 05 | 25/07/13 | 23/07/13 | 98.00 | 100.40 | 100.37 | -0.03 | 1 | 8 700 | 9.40 | 0.44 | | да | 3 000 |
| ЛОКО-Банк БО3 | 13/08/13 | 11/08/15 | 100.11 | 100.73 | 100.65 | 0.03 | 3 | 2 632 | 9.58 | 0.49 | | да | 3 000 |
| НОВИКОМ Банк | | | | | | | | | | | | | |
| Новиком Банк 1 | 26/05/13 | 25/11/13 | 86.00 | | | | | | 6.54 | 0.27 | | да | 2 000 |
| Новиком Банк БО1 | 07/07/13 | 07/07/14 | 85.01 | 100.00 | 99.85 | -0.14 | 1 | 1 | 9.06 | 0.39 | | да | 3 000 |
| Новиком Банк БО4 | 11/10/13 | 11/10/15 | 86.00 | 100.90 | | | | | 9.09 | 0.63 | | да | 2 000 |
| Внешпромбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Внешпромбанк 2 | 19/06/13 | 13/12/17 | 96.00 | | 101.05 | 0.02 | 4 | 9 050 | 7.89 | 0.34 | | нет | 2 000 |
| Внешпромбанк БО2 | 26/10/13 | 26/10/15 | 100.00 | 102.49 | | | | | 11.24 | 0.67 | | да | 3 000 |
| Внешпромбанк БО1 | 30/11/12 | 30/11/13 | 100.00 | 100.93 | 100.95 | 1.37 | 3 | 300 009 | 10.69 | 0.76 | | да | 3 000 |
| АК Барс Банк | | | | | | | | | | | | | |
| АК Барс Банк 4 | 17/04/12 | 15/10/13 | 100.11 | 100.30 | 100.20 | | 2 | 10 000 | 8.84 | 0.64 | | да | 5 000 |
| АК Барс Банк БО1 | 17/10/13 | 15/10/15 | 100.50 | 100.70 | 100.50 | -0.14 | 4 | 4 | 9.02 | 0.65 | | да | 5 000 |
| УБРиР | | | | | | | | | | | | | |
| УБРР 2 | 30/04/13 | 01/05/14 | 100.01 | 100.30 | | | | | 10.15 | 0.20 | | да | 2 000 |
| УБРР БО1 | 01/10/13 | 29/09/15 | 100.01 | 101.29 | | | | | 11.39 | 0.59 | | да | 2 000 |
| Запсибкомбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Запсибкомбанк БО1 | 21/12/12 | 20/06/14 | 100.00 | | | | | | 0.01 | 1.34 | | нет | 2 000 |
| Запсибкомбанк БО2 | 16/08/13 | 14/08/15 | 100.60 | 101.60 | 101.41 | 0.23 | 1 | 2 500 | 9.77 | 0.50 | | да | 2 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Сред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|----------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Российский Капитал | | | | | | | | | | | | | |
| РосКапитал 03 | 26/10/13 | 28/10/15 | 100.40 | 100.80 | | | | | 10.40 | 0.67 | | да | 3 000 |
| Банк Авангард | | | | | | | | | | | | | |
| Авангард 03 | 11/05/12 | 10/05/13 | 100.05 | 100.25 | | | | | 9.11 | 0.23 | | да | 2 000 |
| Авангард БО1 | 03/02/14 | 01/02/16 | 100.00 | 100.09 | | | | | 9.98 | 0.95 | | нет | 2 000 |
| Татфондбанк | | | | | | | | | | | | | |
| Татфондбанк БО-3 | 28/11/13 | 27/11/14 | 100.24 | 100.33 | | | | | 12.21 | 0.76 | | да | 2 000 |
| Татфондбанк БО-4 | 19/02/13 | 17/02/15 | | | | | | | 2.10 | 0.01 | | да | 3 000 |
| Татфондбанк 6 | 28/02/12 | 26/02/13 | 100.00 | 100.10 | 100.00 | -0.02 | 3 | 3 518 | 10.26 | 0.03 | | да | 2 000 |
| Татфондбанк БО-5 | 09/04/13 | 07/04/15 | 100.07 | 100.14 | 100.14 | 0.09 | 2 | 5 600 | 10.05 | 0.15 | | да | 2 000 |
| Татфондбанк БО-6 | 15/10/13 | 13/10/15 | 100.71 | 100.84 | 100.85 | 0.25 | 3 | 72 | 11.90 | 0.63 | | да | 2 000 |
| Татфондбанк БО-1 | 28/06/12 | 26/12/13 | 99.32 | 99.95 | 99.95 | -0.15 | 7 | 40 772 | 11.07 | 0.84 | | да | 2 000 |
| Татфондбанк БО-2 | 18/10/12 | 17/04/14 | 100.05 | 100.44 | 100.20 | 0.15 | 5 | 1 512 | 12.39 | 1.08 | 676 | да | 2 000 |
| Европлан | | | | | | | | | | | | | |
| Европлан 03 | 04/11/14 | 31/10/17 | 101.50 | 102.25 | 101.63 | -0.01 | 2 | 8 | 10.43 | 1.57 | 464 | нет | 4 000 |
| Банк Открытие | | | | | | | | | | | | | |
| Открытие 01 | 18/12/13 | 13/12/17 | | | | | | | 10.60 | 0.81 | | нет | 3 000 |
| ФК Открытие | | | | | | | | | | | | | |
| ФК Открытие 03 | 04/10/13 | 29/09/17 | 86.00 | | | | | | 10.64 | 0.61 | | нет | 7 000 |
| ФК Открытие 02 | 26/12/13 | 22/12/16 | 100.00 | 101.49 | 100.00 | | 1 | 4 | 11.00 | 0.84 | | нет | 5 000 |
| ФК Открытие 04 | 25/06/14 | 20/12/17 | | | | | | | 11.46 | 1.40 | 572 | нет | 5 000 |
| ФК Открытие 01 | | 14/10/14 | 96.00 | | | | | | 9.19 | 1.54 | 341 | нет | 5 000 |
| РЕГИОНАЛЬНЫЕ | | | | | | | | | | | | | |
| МОСКВА | | | | | | | | | | | | | |
| Москва 61 | 03/06/13 | | 102.20 | 102.80 | | | | | 7.96 | 0.29 | | да | 30 000 |
| Москва 53 | 01/09/13 | | 100.00 | 100.65 | | | | | 5.61 | 0.53 | | да | 15 000 |
| Москва 63 | 10/12/13 | | 106.80 | 107.25 | 106.80 | -0.50 | 2 | 71 | 6.53 | 0.77 | | да | 15 000 |
| Москва 62 | 08/06/14 | | 106.00 | 107.29 | | | | | 6.78 | 1.21 | 111 | да | 35 000 |
| Москва 39 | 21/07/14 | | 96.98 | 100.50 | | | | | 7.04 | 1.38 | 131 | да | 10 000 |
| Москва 64 | 24/06/15 | | 99.00 | 99.95 | 99.25 | -0.69 | 4 | 34 516 | 7.48 | 2.19 | 149 | да | 20 000 |
| Москва 44 | 16/11/15 | | | | | | | | 6.90 | 2.37 | 89 | да | 40 000 |
| Москва 56 | 22/09/16 | | 98.60 | 99.69 | | | | | 7.32 | 3.16 | 123 | да | 20 000 |
| Москва 49 | 14/06/17 | | 98.12 | | | | | | 7.42 | 3.76 | 127 | да | 25 000 |
| Москва 66 | 23/11/18 | | 106.00 | 106.55 | 106.00 | -0.25 | 1 | 15 000 | 7.54 | 4.56 | 123 | да | 30 000 |
| Москва 48 | 11/06/22 | | 92.01 | 95.30 | | | | | 7.64 | 6.88 | 93 | да | 30 000 |
| САНКТ-ПЕТЕРБУРГ | | | | | | | | | | | | | |
| СПб 38 | 19/11/15 | | | | | | | | 7.61 | 2.49 | 159 | да | 10 000 |
| СПб 39 | 01/06/17 | | 86.50 | | | | | | 7.66 | 3.67 | 152 | да | 7 000 |
| МОСКОВСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Московская Обл 8 | 11/06/13 | | 100.21 | 104.99 | | | | | 7.45 | 0.32 | | да | 19 000 |
| Московская Обл 7 | 16/04/14 | | 99.50 | 100.49 | 100.49 | 0.29 | 2 | 2 | 7.68 | 1.11 | 204 | да | 16 000 |
| ЛЕНИНГРАДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Ленинградская Обл 3 | 05/12/14 | | 105.03 | 107.45 | | | | | 8.24 | 1.65 | 242 | да | 1 000 |
| НИЖЕГОРОДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Нижегородская Обл 6 | 07/10/15 | | | | | | | | 8.20 | 1.49 | 243 | да | 5 000 |
| Нижегородская Обл 7 | 16/11/16 | | 103.00 | 103.90 | | | | | 8.27 | 1.99 | 234 | да | 8 000 |
| Нижегородская Обл 8 | 29/08/17 | | 104.90 | 105.25 | 105.20 | | 4 | 35 130 | 8.29 | 3.07 | 221 | да | 8 000 |
| САМАРСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Самарская Обл 6 | 10/05/13 | | 101.75 | 101.85 | | | | | 6.91 | 0.23 | | да | 2 000 |
| Самарская Обл 5 | 19/12/13 | | 101.50 | 101.64 | 101.64 | 0.39 | 1 | 8 | 7.46 | 0.81 | | да | 8 000 |
| Самарская Обл 8 | 13/12/17 | | 100.30 | 102.20 | | | | | 7.67 | 1.47 | 191 | да | 15 000 |
| Самарская Обл 7 | 30/11/16 | | 99.58 | 99.70 | 99.58 | 0.28 | 1 | 612 | 7.95 | 1.81 | 208 | да | 12 000 |
| ЯКУТИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Якутия 35001 | 11/04/13 | | 100.01 | | | | | | 7.50 | 0.15 | | да | 3 000 |
| Якутия 34004 | 19/09/13 | | 99.95 | 101.00 | | | | | 7.18 | 0.34 | | да | 2 000 |
| Якутия 35002 | 17/04/14 | | 93.51 | 100.80 | | | | | 7.41 | 1.04 | 179 | да | 3 000 |
| Якутия 35003 | 20/05/16 | | | | | | | | 7.95 | 2.24 | 196 | да | 3 000 |
| Якутия 35004 | 17/05/17 | | 88.00 | 102.70 | | | | | 7.99 | 2.68 | 195 | да | 3 000 |
| КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ | | | | | | | | | | | | | |
| Краснодарский край 3 | 27/09/14 | | 97.00 | 100.80 | | | | | 7.50 | 1.05 | 188 | да | 4 000 |
| Краснодарский край 4 | 09/11/17 | | 102.60 | 102.70 | 102.60 | -0.05 | 1 | 5 000 | 8.00 | 2.23 | 201 | да | 12 000 |
| СТАВРОПОЛЬСКИЙ КРАЙ | | | | | | | | | | | | | |
| Ставропольск кр 34001 | 12/12/17 | | 103.90 | 104.50 | 104.00 | 0.25 | 2 | 50 000 | 8.41 | 2.31 | 241 | нет | 5 000 |
| КРАСНОЯРСКИЙ КРАЙ | | | | | | | | | | | | | |
| Красноярский край 5 | 29/11/16 | | 101.55 | 101.85 | | | | | 8.02 | 1.24 | 234 | да | 9 000 |
| Красноярский край 6 | 19/10/17 | | 101.99 | 102.05 | | | | | 8.15 | 2.59 | 212 | да | 17 000 |
| ВОЛГОГРАДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Волгогр обл 34004 | 04/06/14 | | 99.30 | 100.20 | 99.75 | | 3 | 9 406 | 7.86 | 0.84 | | да | 2 000 |
| Волгогр обл 34005 | 04/05/16 | | 98.20 | 99.00 | | | | | 8.52 | 1.88 | 262 | да | 3 000 |
| Волгогр обл 35002 | 28/05/17 | | | 101.25 | | | | | 8.44 | 2.05 | 249 | да | 5 000 |
| КОМИ | | | | | | | | | | | | | |
| Коми Респ 35007 | 22/11/13 | | 100.45 | 100.65 | 100.60 | 0.20 | 3 | 10 020 | 7.29 | 0.75 | | да | 1 000 |

| Выпуск | Дата | | Котировки | | Цена | | Кол-во сделок | Оборот, шт | УТМ/УТР | Дюрация | Спред к репо ОФЗ (бп) | репо ЦБ | Объем млн руб. |
|-----------------------------|----------|-----------|-----------|---------|--------|---------|---------------|------------|---------|---------|-----------------------|---------|----------------|
| | Оферты | Погашения | Покупка | Продажа | Посл | Изм. пп | | | | | | | |
| Коми Респ 34009 | 18/10/14 | | 97.50 | 100.00 | | | | | 7.26 | 1.11 | 162 | да | 2 000 |
| Коми Респ 35008 | 03/12/15 | | 94.25 | | | | | | 8.70 | 1.98 | 277 | да | 1 000 |
| Коми Респ 32010 | 15/12/16 | | | | | | | | 8.55 | 2.13 | 257 | да | 2 000 |
| ТУЛЬСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Тульская обл 34002 | 25/09/15 | | 100.70 | 101.00 | 100.85 | | 1 | 5 000 | 8.30 | 1.56 | 251 | да | 5 000 |
| ЛИПЕЦКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Липецкая обл 34006 | 05/06/13 | | 100.40 | | 100.45 | -0.05 | 1 | 2 749 | 7.51 | 0.30 | | да | 2 000 |
| Липецкая обл 34007 | 26/05/17 | | 87.00 | 101.50 | 101.36 | 0.01 | 1 | 1 | 8.47 | 2.02 | 253 | нет | 3 000 |
| ВОРОНЕЖСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Воронежск обл 34005 | 17/12/17 | | 87.00 | | | | | | 8.63 | 2.39 | 262 | нет | 5 000 |
| КАЛУЖСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Калужская обл 34004 | 26/06/13 | | 100.00 | | | | | | 6.79 | 0.35 | | да | 2 000 |
| Калужская обл 34005 | 19/05/16 | | | | | | | | 8.40 | 2.44 | 239 | да | 3 000 |
| УДМУРТИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Удмуртия 25003 | 14/07/13 | | 100.00 | 101.95 | | | | | 5.93 | 0.41 | | да | 1 000 |
| Удмуртия 34004 | 25/11/15 | | 88.00 | | | | | | 7.02 | 1.84 | 114 | да | 2 000 |
| Удмуртия 34005 | 24/11/16 | | 103.80 | 105.63 | | | | | 8.70 | 2.27 | 271 | да | 2 000 |
| Удмуртия 34006 | 05/12/17 | | 104.20 | 105.25 | | | | | 8.29 | 2.80 | 224 | нет | 3 000 |
| КОСТРОМСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Костромск обл 34006 | 17/11/16 | | | | | | | | 8.72 | 1.58 | 293 | да | 4 000 |
| ОРЕНБУРГСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Оренбургск обл 34001 | 14/12/17 | | 104.70 | 104.80 | 104.80 | 0.10 | 1 | 1 150 | 8.43 | 2.96 | 236 | нет | 4 000 |
| ВОЛОГОДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Вологодская обл. 34002 | 14/12/16 | | 104.15 | 104.30 | 104.25 | 0.05 | 7 | 15 000 | 8.86 | 2.04 | 291 | да | 3 000 |
| Вологодская обл. 34003 | 05/12/17 | | 99.85 | 102.85 | 102.85 | | 2 | 5 900 | 8.87 | 2.44 | 286 | нет | 5 000 |
| БЕЛГОРОДСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Белгородск обл 24003 | 14/05/13 | | | 100.20 | | | | | 7.40 | 0.24 | | да | 2 000 |
| Белгородск обл 34006 | 08/08/17 | | | | | | | | 8.07 | 2.06 | 212 | да | 5 000 |
| РЕСП КАРЕЛИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Карелия 34013 | 18/06/15 | | | 102.20 | | | | | 8.22 | 1.14 | 257 | да | 2 000 |
| Карелия 34014 | 30/11/16 | | 99.90 | 102.90 | 102.85 | | 1 | 3 691 | 8.00 | 1.47 | 224 | да | 1 000 |
| Карелия 34015 | 22/10/17 | | 87.00 | 102.30 | 101.50 | 0.10 | 10 | 534 | 8.60 | 2.18 | 262 | нет | 2 000 |
| ЯРОСЛАВСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Ярослав Обл 34009 | 16/05/13 | | 100.25 | 100.30 | 100.25 | | 1 | 7 170 | 7.15 | 0.25 | | да | 3 000 |
| Ярослав Обл 34010 | 15/04/14 | | 99.95 | 100.10 | | | | | 7.65 | 0.87 | | да | 3 000 |
| Ярослав Обл 34011 | 21/08/15 | | 101.90 | 102.40 | | | | | 7.94 | 1.93 | 203 | нет | 3 000 |
| РЯЗАНСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Рязанская Обл 34001 | 27/11/14 | | 99.80 | 100.20 | 99.80 | -0.20 | 1 | 4 | 8.52 | 1.28 | 282 | да | 2 000 |
| ТОМСКАЯ ОБЛ | | | | | | | | | | | | | |
| Томская обл 34037 | 27/11/13 | | 102.20 | 103.05 | | | | | 7.62 | 0.74 | | да | 3 000 |
| Томская обл 35045 | 19/12/17 | | | 102.50 | | | | | 8.10 | 2.73 | 206 | нет | 5 000 |
| БАШКОРТОСТАН | | | | | | | | | | | | | |
| Башкортостан 34007 | 29/11/16 | | 102.20 | | | | | | 7.98 | 2.15 | 200 | нет | 3 000 |
| ЧУВАШИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Чувашия 34007 | 04/06/13 | | 100.05 | 100.80 | | | | | 7.21 | 0.29 | | да | 1 000 |
| Чувашия 31008 | 15/06/14 | | | 99.80 | | | | | 8.63 | 1.26 | 294 | да | 1 000 |
| Чувашия 34009 | 19/07/15 | | 100.50 | 101.25 | | | | | 8.18 | 1.32 | 247 | да | 2 000 |
| МАРИЙ ЭЛ РЕСП | | | | | | | | | | | | | |
| Марий Эл 34006 | 04/10/15 | | 99.50 | 101.50 | | | | | 8.92 | 1.67 | 309 | нет | 2 000 |
| ХМАО | | | | | | | | | | | | | |
| ХМАО-Югра 25008 | 19/12/13 | | 103.10 | 103.50 | | | | | 7.35 | 0.82 | | да | 2 000 |
| ХАКАСИЯ | | | | | | | | | | | | | |
| Хакасия 34001 | 25/08/13 | | | | | | | | 7.42 | 0.51 | | нет | 1 000 |
| Хакасия 34002 | 09/08/15 | | 101.25 | 102.00 | | | | | 8.30 | 1.64 | 249 | да | 2 000 |
| СВЕРДЛОВСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Свердловск обл 34001 | 11/12/16 | | 87.00 | 102.30 | | | | | 8.06 | 1.54 | 228 | да | 3 000 |
| Свердловск обл 34002 | 04/12/17 | | 87.60 | 102.90 | | | | | 8.15 | 2.29 | 215 | нет | 3 000 |
| ТВЕРСКАЯ ОБЛАСТЬ | | | | | | | | | | | | | |
| Тверская Обл 34006 | 12/06/14 | | 102.00 | 104.20 | | | | | 8.27 | 0.93 | | да | 3 000 |
| Тверская Обл 34005 | 26/12/13 | | 106.00 | 106.51 | 106.51 | 0.31 | 1 | 2 | 7.37 | 0.81 | | да | 4 000 |
| Тверская Обл 34007 | 15/12/15 | | 99.80 | 100.09 | 100.00 | 0.10 | 3 | 10 002 | 8.77 | 2.22 | 278 | да | 3 000 |
| Тверская Обл 34008 | 18/12/17 | | 102.50 | 102.70 | 102.70 | 0.40 | 2 | 3 470 | 8.96 | 2.63 | 293 | нет | 3 000 |

Источник: REUTERS, расчеты: Банк ЗЕНИТ

ОФЗ



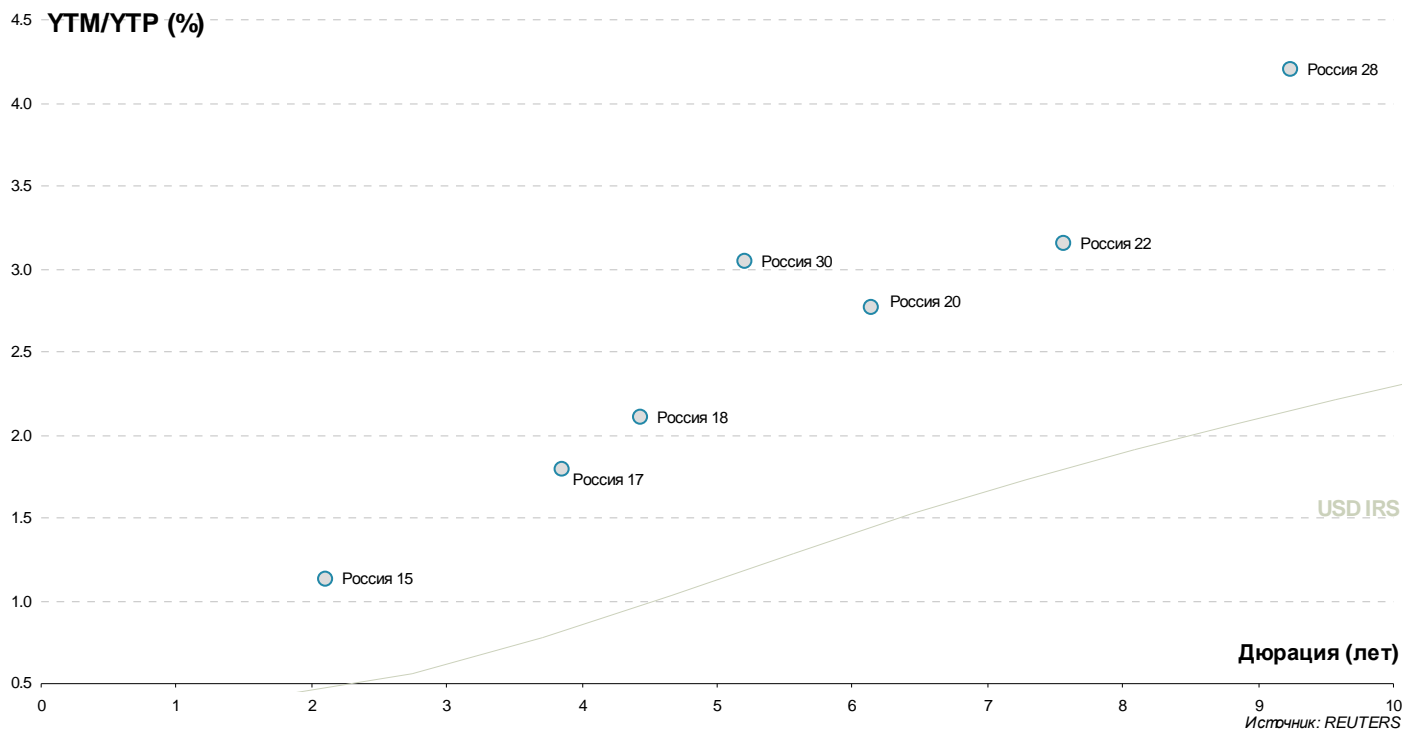
Результаты торгов евробондами

| 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 | | 105.218 | 105.597 | 1.21 | 1.04 | 2.11 | 0.16 | 76 |
| RUSSIA'17 3.25% | USD | 04/04/17 | | 105.625 | 105.905 | 1.83 | 1.76 | 3.86 | 0.02 | 103 |
| RUSSIA'18 11% | USD | 24/07/18 | | 144.842 | 146.105 | 2.20 | 2.00 | 4.44 | 0.25 | 113 |
| RUSSIA'30 7.5% | USD | 31/03/30 | | 124.100 | 124.750 | 3.10 | 3.00 | 5.21 | -0.93 | 148 |
| RUSSIA'20 5% | USD | 29/04/20 | | 114.331 | 114.719 | 2.79 | 2.73 | 6.14 | -0.63 | 129 |
| RUSSIA'22 4.5% | USD | 04/04/22 | | 110.438 | 110.800 | 3.17 | 3.13 | 7.56 | -0.69 | 130 |
| RUSSIA'28 12.75% | USD | 24/06/28 | | 195.350 | 196.600 | 4.24 | 4.17 | 9.25 | -1.09 | 191 |
| RUSSIA'42 5.625% | USD | 04/04/42 | | 116.900 | 117.300 | 4.57 | 4.55 | 15.44 | -0.85 | 172 |
| ГОСКОМПАНИИ | | | | | | | | | | |
| Газпром | | | | | | | | | | |
| GAZPR'13 4.505% | USD | 22/07/13 | | 101.207 | 101.229 | 1.66 | 1.61 | 0.43 | -0.02 | 139 |
| GAZST'13 5.625% | USD | 22/07/13 | | 101.074 | 101.289 | 3.07 | 2.57 | 0.43 | -0.03 | 283 |
| GAZPR'13 7.343% | USD | 11/04/13 | | 101.130 | 101.138 | -0.32 | -0.37 | 0.15 | | -57 |
| GAZPR'13 7.51% | USD | 31/07/13 | | 102.460 | 102.600 | 1.98 | 1.67 | 0.45 | 0.11 | 171 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 25/03/14 | | 109.083 | 109.763 | 2.14 | 1.55 | 1.04 | | 184 |
| GAZPR'14 10.5% | USD | 06/03/14 | | 108.879 | 109.539 | 1.98 | 1.38 | 1.00 | | 167 |
| GAZPR'14 8.125% | USD | 31/07/14 | | 108.807 | 108.883 | 1.93 | 1.88 | 1.40 | | 158 |
| GAZPR'15 5.092% | USD | 29/11/15 | | 106.290 | 106.490 | 2.73 | 2.65 | 2.61 | -0.02 | 222 |
| GAZPR'16 4.95% | USD | 21/05/16 | | 106.230 | 106.530 | 2.93 | 2.84 | 3.03 | -0.15 | 235 |
| GAZPR'16 6.212% | USD | 22/11/16 | | 111.250 | 112.250 | 3.02 | 2.76 | 3.39 | -0.17 | 234 |
| GAZPR'18 8.146% | USD | 11/04/18 | | 121.383 | 122.383 | 3.56 | 3.37 | 4.30 | -0.13 | 257 |
| GAZPR'19 9.25% | USD | 23/04/19 | | 129.500 | 130.000 | 3.84 | 3.76 | 4.92 | -0.25 | 263 |
| GAZPR'22 6.51% | USD | 07/03/22 | | 116.250 | 117.250 | 4.32 | 4.20 | 6.99 | | 255 |
| GAZPR'22 4.95% | USD | 19/07/22 | | 104.900 | 105.650 | 4.31 | 4.22 | 7.67 | 0.15 | 245 |
| GAZPR'34 8.625% | USD | 28/04/34 | | 139.250 | 140.250 | 5.47 | 5.41 | 11.49 | 1.38 | 291 |
| GAZPR'37 7.288% | USD | 16/08/37 | | 125.000 | 126.500 | 5.43 | 5.34 | 13.07 | 1.50 | 276 |
| Газпром нефть | | | | | | | | | | |
| GNP CAPITAL '22 4.375% | USD | 19/09/22 | | 99.316 | 99.702 | 4.46 | 4.41 | 7.79 | -0.31 | 255 |
| Транснефть | | | | | | | | | | |
| TRANSN'13 7.7% | USD | 17/08/13 | | 102.789 | 104.789 | 1.71 | -2.38 | | -0.06 | |
| TRANSN'14 5.67% | USD | 05/03/14 | | 104.147 | 105.147 | 1.66 | 0.73 | 1.01 | | 134 |
| TRANSN'18 8.7% | USD | 17/08/18 | | 127.027 | 127.315 | 3.26 | 3.21 | 4.59 | 0.02 | 219 |
| РЖД | | | | | | | | | | |
| RZD'17 5.739% | USD | 03/04/17 | | 110.236 | 110.440 | 3.08 | 3.03 | 3.68 | 0.02 | 230 |
| RZD'22 5.7% | USD | 05/04/22 | | 112.336 | 112.742 | 4.07 | 4.02 | 7.24 | 0.09 | 225 |
| Совкомфлот | | | | | | | | | | |
| SOVKOM'17 5.375% | USD | 27/10/17 | | 105.380 | 105.817 | 4.10 | 4.00 | 4.16 | | 321 |
| ГОСБАНКИ | | | | | | | | | | |
| ВТБ | | | | | | | | | | |
| VTB'15 6.465% | USD | 04/03/15 | | 107.109 | 107.213 | 2.86 | 2.81 | 1.90 | -0.01 | 246 |
| VTB'17 6% | USD | 12/04/17 | | 107.325 | 107.522 | 4.06 | 4.01 | 3.68 | 0.08 | 330 |
| VTB'18 6.315% | USD | 22/02/18 | | 108.303 | 108.537 | 4.45 | 4.40 | 4.28 | -0.20 | 349 |
| VTB'18 6.875% | USD | 29/05/18 | | 110.850 | 111.225 | 4.54 | 4.46 | 4.50 | 0.10 | 353 |
| VTB'20 6.551% | USD | 13/10/20 | | 110.125 | 110.625 | 4.94 | 4.87 | 6.10 | -0.47 | 343 |
| VTB'22 6.95% | USD | 17/10/22 | | 106.547 | 106.925 | 6.04 | 5.99 | 7.13 | -0.05 | 424 |
| VTB'35 6.25% | USD | 30/06/35 | | 108.399 | 108.899 | 5.59 | 5.55 | 12.65 | | 293 |
| VTB' 9.5% | USD | | | 108.744 | 109.371 | 8.18 | 8.09 | 6.62 | 0.48 | 651 |
| Банк Москвы | | | | | | | | | | |
| BANK OF MOS'13 7.335% | USD | 13/05/13 | | 101.380 | 101.405 | 1.44 | 1.34 | 0.24 | | 122 |
| BANK OF MOS'15 6.699% | USD | 11/03/15 | | 105.756 | 105.960 | 3.77 | 3.67 | 1.91 | 0.01 | 339 |
| BANK OF MOS'15 5.967% | USD | 25/11/15 | | 104.975 | 105.475 | 4.05 | 3.86 | 2.57 | -0.03 | 357 |
| BANK OF MOS'17 6.02% | USD | 10/05/17 | | 102.980 | 103.980 | 5.22 | 4.96 | 3.75 | -0.02 | 448 |
| ВЭБ | | | | | | | | | | |
| VEB'17 5.375% | USD | 13/02/17 | | 109.622 | 109.820 | 2.81 | 2.76 | 3.66 | 1.25 | 206 |
| VEB'17 5.45% | USD | 22/11/17 | | 109.900 | 110.300 | 3.19 | 3.11 | 4.24 | 0.40 | 228 |
| VEB'20 6.902% | USD | 09/07/20 | | 119.035 | 119.390 | 3.91 | 3.86 | 6.02 | -0.01 | 242 |
| VEB'22 6.025% | USD | 05/07/22 | | 113.500 | 113.875 | 4.26 | 4.22 | 7.41 | 0.25 | 243 |
| VEB'25 6.8% | USD | 22/11/25 | | 121.000 | 121.500 | 4.60 | 4.56 | 9.02 | 0.50 | 238 |
| Газпромбанк | | | | | | | | | | |
| GAZPROMB'13 7.933% | USD | 28/06/13 | | 102.000 | 102.018 | 2.32 | 2.28 | 0.36 | | 209 |
| GAZPROMB'14 6.25% | USD | 15/12/14 | | 105.928 | 106.019 | 2.89 | 2.84 | 1.74 | -0.07 | 251 |
| GAZPROMB'15 6.5% | USD | 23/09/15 | | 107.738 | 107.867 | 3.36 | 3.31 | 2.38 | -0.01 | 290 |
| GAZPROMB'16 7.35% | USD | 08/05/16 | | 111.330 | 111.492 | 3.56 | 3.51 | 2.86 | | 296 |
| GAZPROMB'17 5.625% | USD | 17/05/17 | | 106.783 | 106.985 | 3.88 | 3.83 | 3.80 | 0.03 | 309 |
| GAZPROMB'19 7.25% | USD | 03/05/19 | | 108.750 | 109.750 | 5.56 | 5.38 | 5.07 | 0.25 | 437 |
| GPB EURO' 7.875% | USD | | | 103.138 | 103.818 | 7.14 | 6.98 | 4.27 | 0.12 | 624 |
| РСХБ | | | | | | | | | | |
| ROSSELKH'13 7.175% | USD | 16/05/13 | | 101.065 | 102.111 | 2.77 | -1.42 | | -0.25 | |
| ROSSELKH'14 7.125% | USD | 14/01/14 | | 104.501 | 104.547 | 2.08 | 2.03 | 0.89 | | 177 |

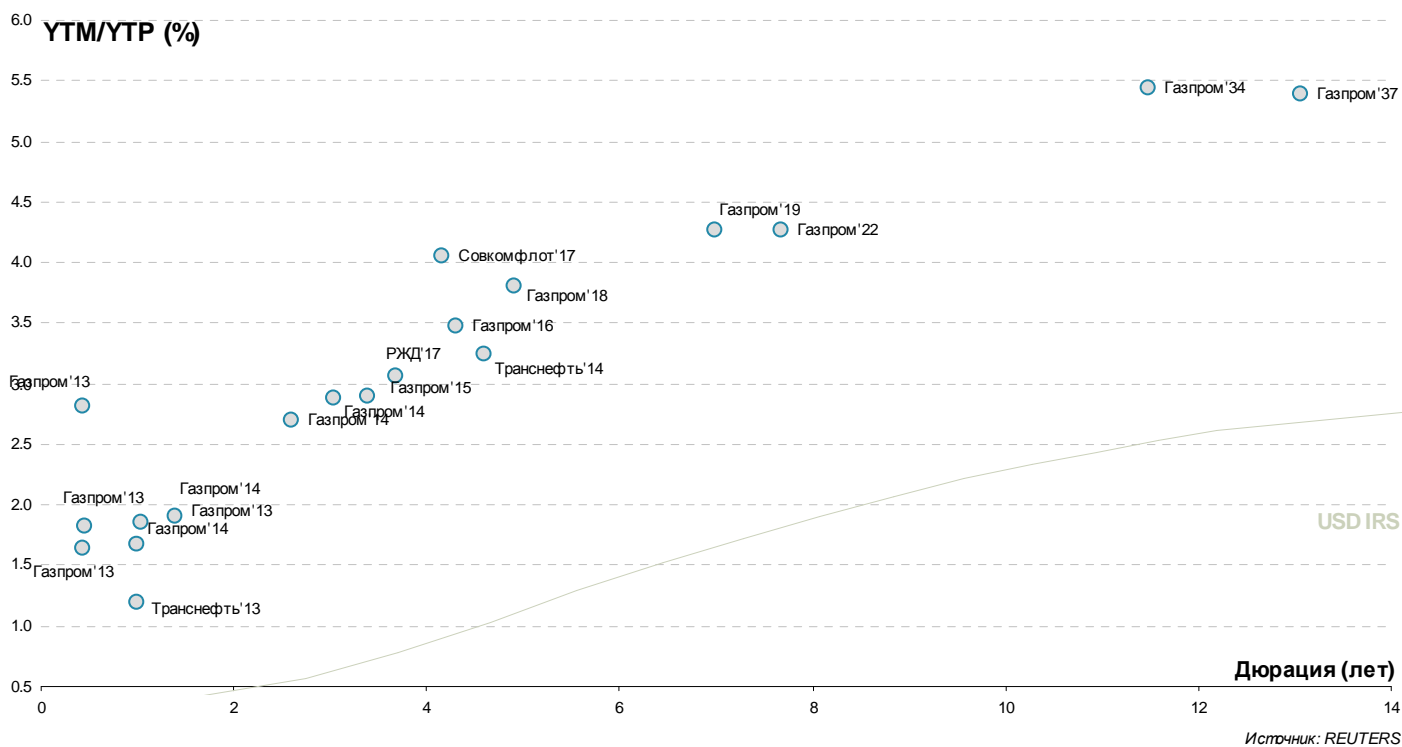
| Выпуск | Валюта | Дата Погашения | Цена | | Доходность | | Дюрация | Изм-е, % (по покупке) | Z-спрэд |
|-------------------------|--------|----------------|---------|---------|------------|---------|---------|--------------------------|---------|
| | | | Покупка | Продажа | Покупка | Продажа | | | |
| ROSSELKH'14 9% | USD | 11/06/14 | 108.503 | 108.571 | 2.38 | 2.33 | 1.25 | | 205 |
| ROSSELKH'17 6.299% | USD | 15/05/17 | 110.580 | 111.085 | 3.59 | 3.47 | 3.76 | 0.11 | 281 |
| ROSSELKH'17 5.298% | USD | 27/12/17 | 106.260 | 106.488 | 3.87 | 3.82 | 4.34 | -0.24 | 293 |
| ROSSELKH'18 7.75% | USD | 29/05/18 | 118.766 | 119.030 | 3.79 | 3.74 | 4.45 | -0.02 | 277 |
| ROSSELKH'21 6% | USD | 03/06/21 | 104.882 | 105.038 | 4.39 | 4.34 | 3.01 | -0.12 | 382 |
| Сбербанк | | | | | | | | | |
| SBER'13 6.48% | USD | 05/05/13 | 101.250 | 101.750 | 1.27 | -0.74 | 0.24 | 0.14 | 104 |
| SBER'13 6.468% | USD | 02/07/13 | 101.875 | 102.625 | 1.39 | -0.57 | 0.37 | 0.06 | 113 |
| SBER'15 5.499% | USD | 07/07/15 | 107.262 | 107.382 | 2.35 | 2.30 | 2.26 | -0.08 | 190 |
| SBER'17 5.4% | USD | 24/03/17 | 108.875 | 109.175 | 3.08 | 3.00 | 3.68 | 0.11 | 232 |
| Sber'17 4.95% | USD | 07/02/17 | 106.875 | 107.125 | 3.10 | 3.03 | 3.66 | | 236 |
| SBER'19 5.18% | USD | 28/06/19 | 107.886 | 108.180 | 3.77 | 3.72 | 5.50 | -0.11 | 247 |
| SBER'21 5.717% | USD | 16/06/21 | 110.310 | 110.680 | 4.23 | 4.18 | 6.77 | -0.06 | 255 |
| Sber'22 6.125% | USD | 07/02/22 | 113.277 | 113.675 | 4.32 | 4.27 | 7.16 | 0.03 | 254 |
| SBER'22 5.125% | USD | 29/10/22 | 100.624 | 101.006 | 5.04 | 4.99 | 7.66 | 0.12 | 315 |
| ЧАСТНЫЕ КОМПАНИИ | | | | | | | | | |
| Евраз | | | | | | | | | |
| EVRAZ'13 8.875% | USD | 24/04/13 | 101.499 | 101.999 | 0.67 | -1.94 | | | |
| EVRAZ'15 8.25% | USD | 10/11/15 | 110.625 | 111.075 | 4.09 | 3.93 | 2.46 | 0.25 | 363 |
| EVRAZ'17 7.4% | USD | 24/04/17 | 106.750 | 106.975 | 5.57 | 5.51 | 3.62 | 0.02 | 485 |
| EVRAZ'18 9.5% | USD | 24/04/18 | 115.375 | 115.975 | 6.00 | 5.88 | 4.18 | | 511 |
| EVRAZ'18 6.75% | USD | 27/04/18 | 104.175 | 104.630 | 5.81 | 5.71 | 4.40 | -0.20 | 485 |
| Металлоинвест | | | | | | | | | |
| METALLOINV'16 6.5% | USD | 21/07/16 | 104.875 | 105.375 | 4.93 | 4.78 | 3.12 | | 436 |
| НЛМК | | | | | | | | | |
| NLMK '19 4.95% | USD | 26/09/19 | 101.368 | 101.651 | 4.71 | 4.66 | 5.62 | -0.27 | 337 |
| Альянс Ойл | | | | | | | | | |
| Alliance '15 9.875% | USD | 11/03/15 | 109.006 | 109.211 | 5.21 | 5.11 | 1.85 | | 487 |
| Алроса | | | | | | | | | |
| ALROSA'14 8.875% | USD | 17/11/14 | 110.709 | 110.957 | 2.56 | 2.43 | 1.63 | -0.05 | 219 |
| ALROSA'20 7.75% | USD | 03/11/20 | 117.125 | 117.825 | 5.04 | 4.94 | 5.99 | 0.13 | 353 |
| Вимпелком | | | | | | | | | |
| VIMPELC'13 8.375% | USD | 30/04/13 | 101.200 | 101.325 | 2.29 | 1.69 | 0.20 | 0.10 | 210 |
| VIMPELC'14 4.31% | USD | 29/06/14 | 100.700 | 103.200 | 3.83 | 1.98 | 1.33 | | |
| VIP FIN'16 6.493% | USD | 02/02/16 | 106.530 | 106.530 | 4.12 | 4.12 | 2.74 | -0.05 | 360 |
| VIMPELC'16 8.25% | USD | 23/05/16 | 112.640 | 112.966 | 4.07 | 3.97 | 2.90 | -0.01 | 351 |
| VIMPELC'17 6.255% | USD | 01/03/17 | 106.750 | 107.750 | 4.41 | 4.15 | 3.55 | 0.25 | 369 |
| VIMPELC'18 9.125% | USD | 30/04/18 | 118.500 | 118.850 | 5.03 | 4.96 | 4.25 | -0.12 | 407 |
| VIP FIN'21 7.748% | USD | 02/02/21 | 112.500 | 113.500 | 5.77 | 5.62 | 6.19 | -0.32 | 423 |
| VIMPELC'22 7.504% | USD | 01/03/22 | 112.000 | 112.375 | 5.78 | 5.73 | 6.66 | -0.20 | 407 |
| Лукойл | | | | | | | | | |
| LUKOIL'14 6.375% | USD | 05/11/14 | 107.746 | 107.834 | 1.77 | 1.72 | 1.63 | | 139 |
| LUKOIL'17 6.356% | USD | 07/06/17 | 113.755 | 113.972 | 2.93 | 2.88 | 3.83 | | 211 |
| LUKOIL'19 7.25% | USD | 05/11/19 | 120.309 | 120.638 | 3.79 | 3.74 | 5.47 | -0.26 | 244 |
| LUKOIL'20 6.125% | USD | 09/11/20 | 114.125 | 114.625 | 3.98 | 3.91 | 6.29 | -0.19 | 242 |
| LUKOIL'22 6.656% | USD | 07/06/22 | 120.063 | 120.493 | 4.05 | 4.00 | 7.23 | -0.22 | 222 |
| МТС | | | | | | | | | |
| MTS'20 8.625% | USD | 22/06/20 | 125.542 | 126.258 | 4.50 | 4.40 | 5.75 | -0.30 | 306 |
| НОВАТЭК | | | | | | | | | |
| NOVATEK'16 5.326% | USD | 03/02/16 | 107.476 | 107.624 | 2.68 | 2.63 | 2.78 | -0.11 | 214 |
| NOVATEK'21 6.604% | USD | 03/02/21 | 116.750 | 117.350 | 4.11 | 4.03 | 6.45 | -0.31 | 251 |
| Северсталь | | | | | | | | | |
| SEVERSTAL'13 9.75% | USD | 29/07/13 | 103.250 | 103.500 | 2.39 | 1.85 | 0.45 | -0.15 | 213 |
| SEVERSTAL'14 9.25% | USD | 19/04/14 | 107.998 | 108.120 | 2.28 | 2.18 | 1.11 | | 196 |
| SEVERSTAL'16 6.25% | USD | 26/07/16 | 106.916 | 107.248 | 4.07 | 3.97 | 3.15 | 0.18 | 347 |
| SEVERSTAL'17 6.7% | USD | 25/10/17 | 109.238 | 109.680 | 4.49 | 4.39 | 4.05 | -0.01 | 362 |
| Sev Stal '22 5.9% | USD | 17/10/22 | 102.477 | 103.042 | 5.56 | 5.49 | 7.40 | -0.09 | 372 |
| ТМК | | | | | | | | | |
| TMK'18 7.75% | USD | 27/01/18 | 106.000 | 106.750 | 6.32 | 6.14 | 4.21 | | 547 |
| Распадская | | | | | | | | | |
| RASPAD'17 7.75% | USD | 27/04/17 | 106.912 | 107.296 | 5.86 | 5.76 | 3.60 | -0.02 | 515 |
| ТНК-ВР | | | | | | | | | |
| TNK '13 7.5% | USD | 13/03/13 | 100.660 | 103.660 | -1.92 | -42.29 | | | |
| TNK-BP'15 6.25% | USD | 02/02/15 | 107.040 | 107.140 | 2.54 | 2.49 | 1.87 | -0.01 | 213 |
| TNK-BP'16 7.5% | USD | 18/07/16 | 114.500 | 114.800 | 3.00 | 2.92 | 3.09 | 0.19 | 240 |
| TNK-BP'17 6.625% | USD | 20/03/17 | 112.748 | 112.952 | 3.27 | 3.22 | 3.59 | -0.03 | 251 |
| TNK-BP'18 7.875% | USD | 13/03/18 | 121.708 | 121.970 | 3.20 | 3.15 | 4.25 | 0.03 | 222 |
| TNK-BP'20 7.25% | USD | 02/02/20 | 120.750 | 121.750 | 3.82 | 3.68 | 5.72 | -0.25 | 245 |
| ЧАСТНЫЕ БАНКИ | | | | | | | | | |
| Альфа-Банк | | | | | | | | | |
| ALFA BANK'13 9.25% | USD | 24/06/13 | 102.999 | 103.035 | 0.65 | 0.55 | 0.35 | | 38 |
| ALFA BANK'15 8% | USD | 18/03/15 | 108.008 | 108.216 | 3.96 | 3.86 | 1.91 | 0.01 | 358 |
| ALFA BANK'17 6.3% | USD | 22/02/17 | 104.599 | 104.969 | 5.02 | 4.92 | 3.51 | -0.01 | 431 |
| ALFA BANK'17 7.875% | USD | 25/09/17 | 112.644 | 113.085 | 4.78 | 4.68 | 3.89 | 0.14 | 394 |
| ALFA BANK'21 7.75% | USD | 28/04/21 | 114.068 | 114.777 | 5.59 | 5.49 | 6.24 | 0.01 | 401 |

| 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 |

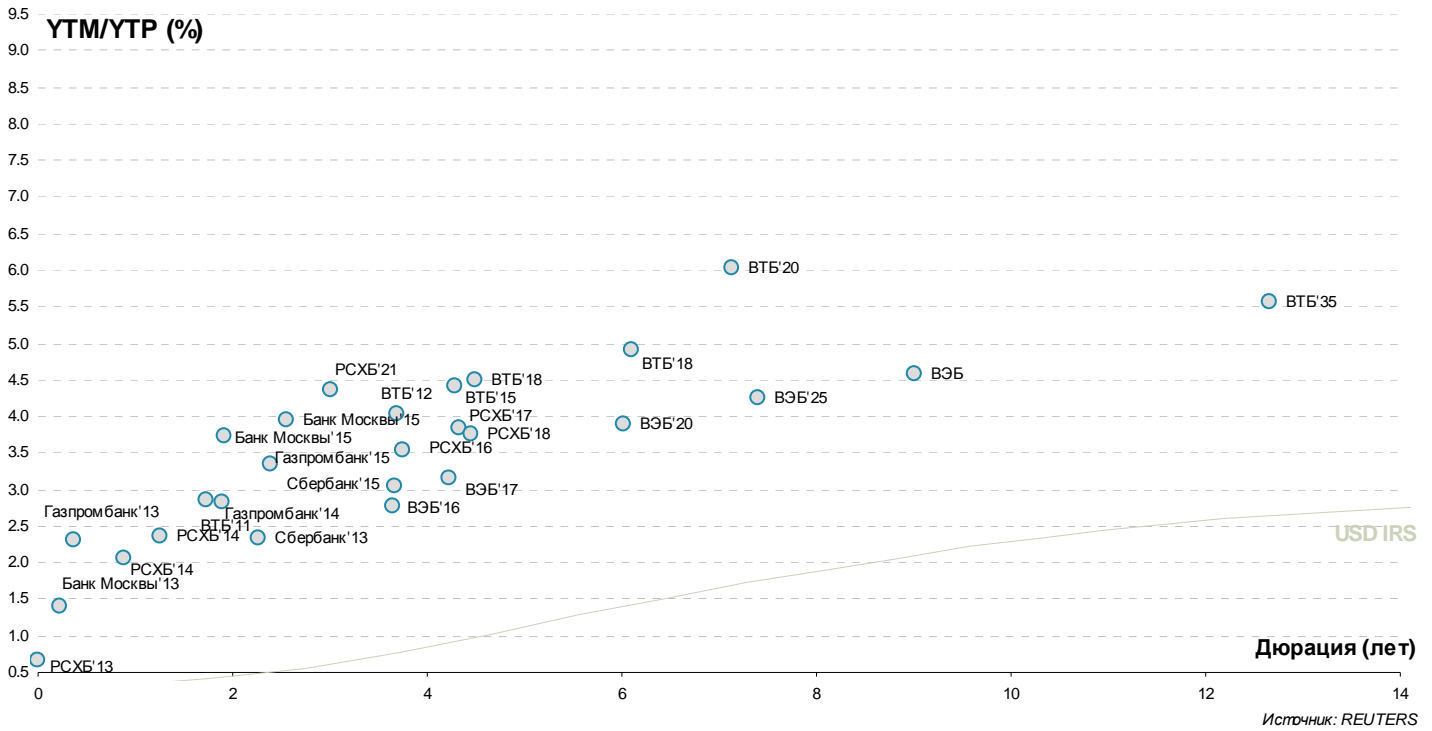
Россия



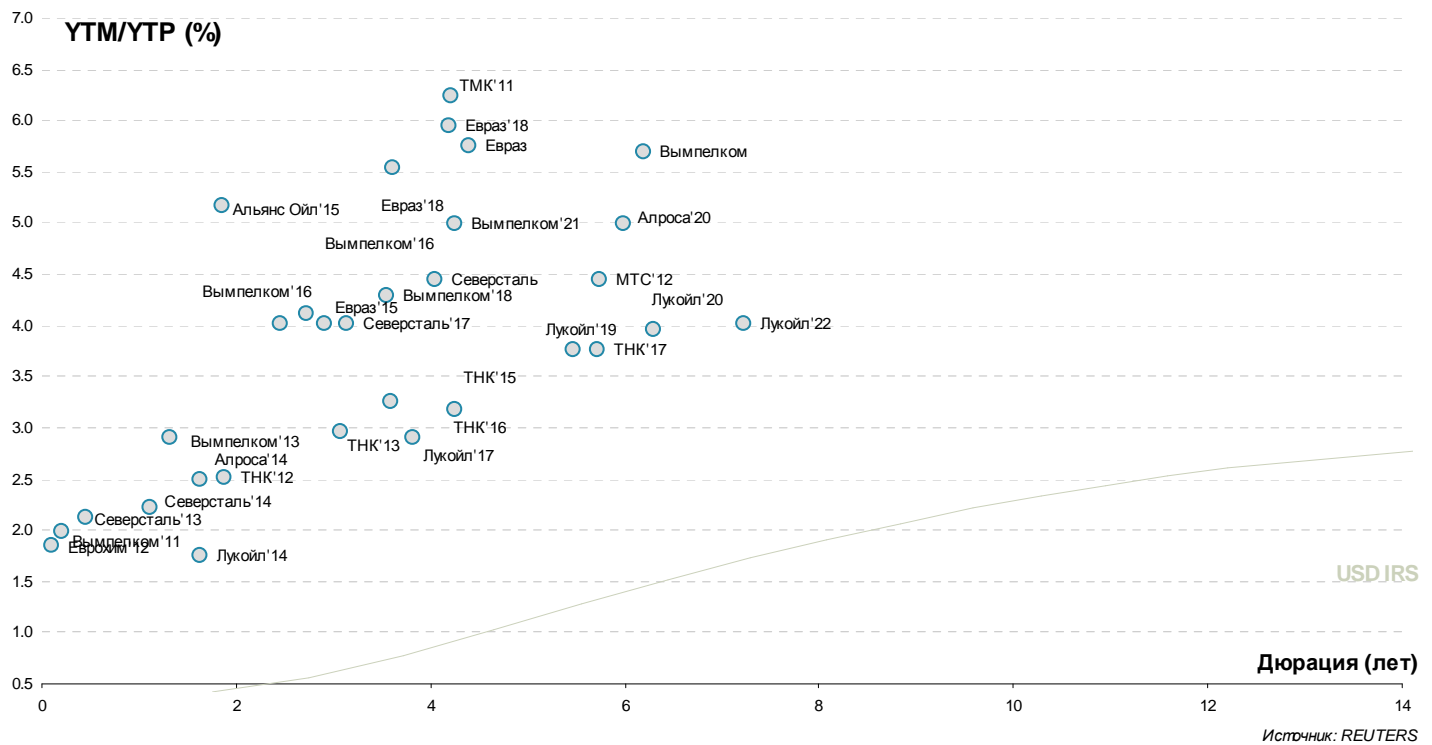
Госкомпании



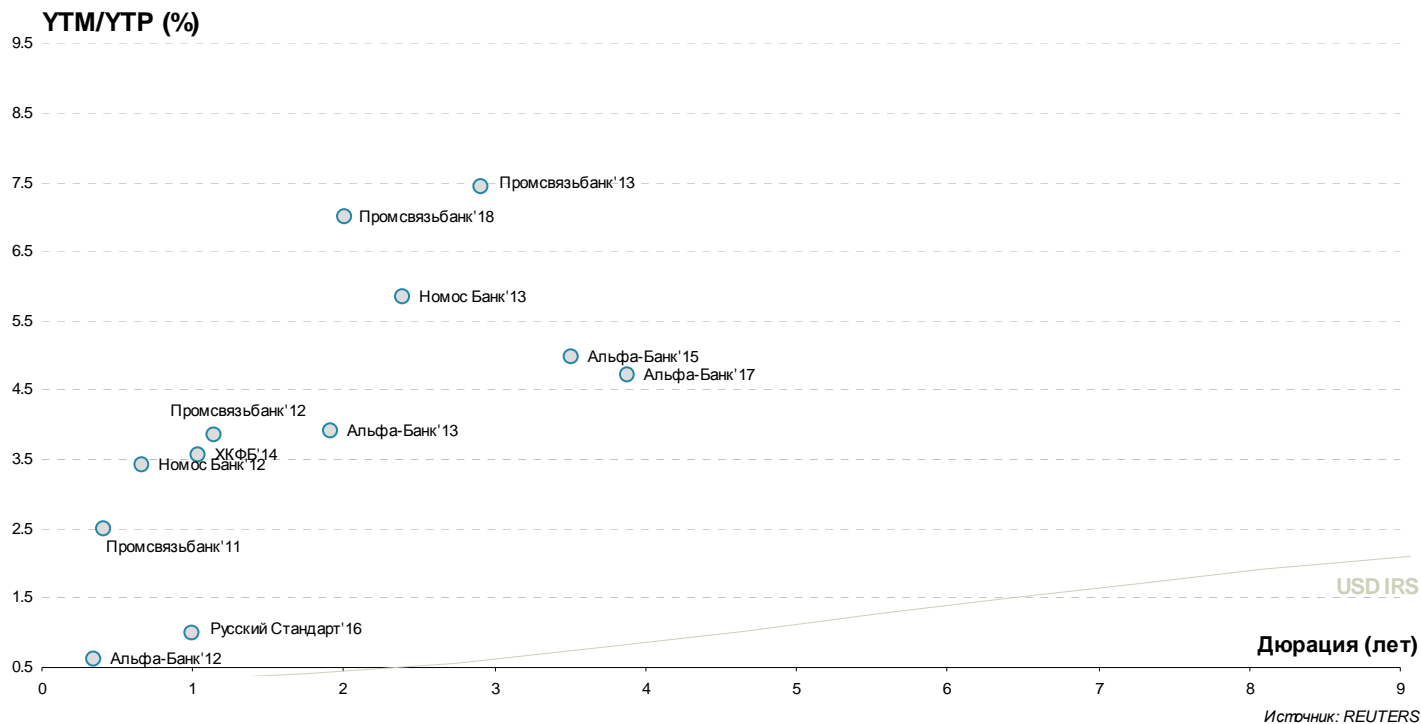
Госбанки



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

research@zenit.ru
firesearch@zenit.ru

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. © 2013 Банк ЗЕНИТ.