ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный Обзор

Денежно-кредитный рынок:

- Уплата налогов прошла спокойно

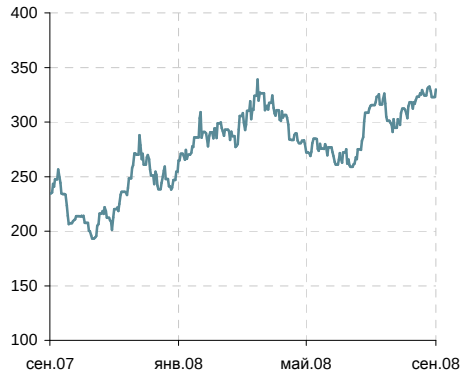
Российский долговой рынок:

- Рост котировок не получил продолжения

Оглавление:

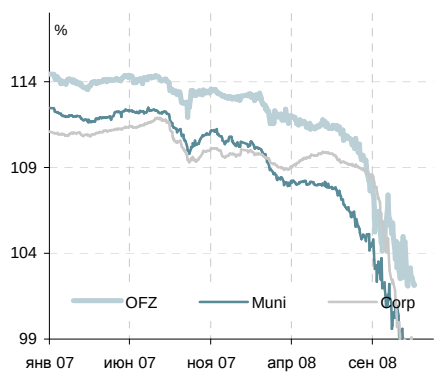
Новости одной строкой	2
Денежно-кредитный рынок	3
Российский долговой рынок	3
Приложения	4

Динамика EMBIG Sovereign Spread



Источник: J.P. Morgan

Динамика ценовых индексов ZETBI



Источник: Банк ЗЕНИТ

БАНК ЗЕНИТ
БАНКОВСКАЯ ГРУППА ЗЕНИТ

Новости одной строкой

Компания «ВМУ-Финанс» выкупила по оферте облигации первого выпуска на 247.7 млн руб. /Cbonds/

Группа «РАЗГУЛЯЙ» досрочно погасила биржевые облигации серии БО-01 на 2 млрд руб. /Finam/

«Мой Банк» выкупил по оферте облигации второго выпуска на 124.277 млн руб. /Cbonds/

Компания «Русские инвесторы» подала иск к Инком-Авто на сумму 52.66 млн руб. /Cbonds/

Денежно-кредитный рынок

Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Уплата налогов прошла спокойно

В четверг конъюнктура рынка оставалась стабильной, а уплата акцизов и НДПИ не повлияла на стоимость коротких кредитов. Ставка MIACR составила 8.86% против 8.00% в среду. На рынке МБК стоимость однодневных кредитов оставалась в диапазоне 8-9% годовых. Объем операций репо с ЦБ сохранился на уровне предыдущего дня, составив 72.3(-9.5) млрд руб.

На валютном рынке давление на рубль не угасало. Котировки бивалютной корзины практически на протяжении всего дня держались вблизи предполагаемого офера ЦБ (33.85 руб.), а объем продаж валюты Центробанком оценивается в 4-4.5 млрд долл. Дилеры предполагают, что весь вчерашний объем торгов валютной секции ММВБ пришелся на сделки с ЦБ. Между тем, за минувшую неделю международные резервы РФ увеличились на 15.4 млрд до 450.8 млрд долл. На прошлой неделе ЦБ потратил на поддержание рубля около 12 млрд долл. В то же время рост резервов произошел в основном за счет укрепления евро и фунта на рынке Forex, а также роста цен в казначейских облигациях США. Кроме того, по словам первого зампреда ЦБ Улюкаева, увеличению ЗВР способствовало открытие банками валютных счетов в Банке России в размере нескольких миллиардов долларов, которые также учитываются при расчете резервов.

ЦБ сегодня продолжает девальвировать рубль, вновь отодвинув офер по бивалютной корзине еще на 40-50 коп. Новый предполагаемый уровень поддержки ЦБ составляет 34.30-34.40 руб. Вероятно, Центробанк руководствуется динамикой нефти при более резком темпе ослабления рубля. ЦБ за текущую неделю допустил трехкратное ослабление рубля на 1%.

Вчера Фонд ЖКХ провел аукцион по размещению средств на депозиты банков сроком на 6 месяцев. Предложение составило 10 млрд руб. при объеме заявок 22 млрд руб. Средневзвешенная ставка 13.79% при ставке отсечения 13.10%.

Сегодня утром показатель банковской ликвидности составил 1214.7(+76.4) млрд руб. Средства на корсчетах банков в ЦБ снизились до 732.9(-4.7) млрд руб., на депозитах выросли до 481.8(+76.4) млрд руб.

События на денежно-кредитном рынке на текущей неделе:

Понедельник	Вторник	Среда	Четверг	Пятница
Аукцион ЦБ 3 месяца 350 млрд руб. ставка 12.75% Размещено 166.8 млрд руб. ставка 12.85%	Аукцион ЦБ 5 дней 120 млрд руб. ставка 12.50% Размещено 51.4 млрд руб. ставка 12.68%	Возврат средств Минфину: 330.3 млрд руб. Возврат средств ЦБ: 181.8 млрд руб.	Уплата НДПИ и половины акцизов за ноябрь.	Аукцион ЦБ 2 недели 150 млрд руб. ставка 12.50%
		Поступление средств от аукционов ЦБ 218.2 млрд руб.	Аукцион ЖКХ 6 месяцев 10 млрд руб. Размещено 10 млрд руб. ставка 13.79%	

сточник: ЦБ РФ, Банк ЗЕНИТ

Динамика ценовых индексов ZETBI

	Индекс	день	неделя
Zetbi OFZ	101,25	0,53%	2,28%
Zetbi Muni	95,18	1,80%	3,19%
Zetbi Corp	99,10	-0,32%	0,54%
Zetbi Corp10	107,17	-0,19%	0,96%

Источник: Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в субфедеральном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
СамарОбл 5	227,89	0,05
КОМИ 8в об	189,18	0,18
Мос.обл.8в	117,86	-4,71
Чувашия-04	70,54	0,14
Ярославль1	44,45	-1,32

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в корпоративном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
РуссНефть1	954,29	-
Промсвб-06	668,79	-1,6
АвтомирФ-2	624,74	-
ХКФ Банк-3	499,86	4,67
ВТБ - 6 об	435,94	0,05

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Российский долговой рынок

Александр Ермак
a.ermak@zenit.ru

Рост котировок не получил продолжения

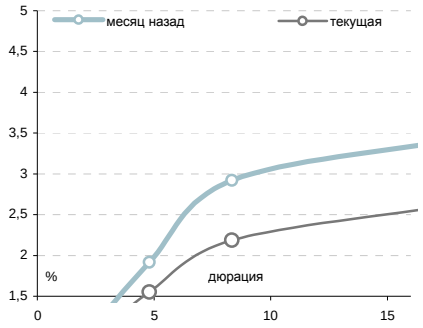
В четверг инвесторы не поддержали рост котировок облигаций, которые мы наблюдали с начала недели. Торги прошли, скорее с разнонаправленной динамикой, волатильность была на среднем уровне. Лучше других чувствовали себя короткие голубые фишки: Газпром-6 (+44 б.п., 11.21%), Газпром-4 (+45 б.п., 11.04%). Прошедшие в четверг оферты не добавили новых имен к дефолтному списку, **Уникум-Финанс, ВМУ-Финанс** и **Мой Банк** полностью выкупили предъявленные к погашению бумаги.

Приложение 1. Индикаторы мировых рынков

Инструмент	Дата	Значение	Изменение, б.п.		
			день	месяц	год
UST 2 yr	12/25/2008	0,91	0	-18	-240
UST 10 yr	12/25/2008	2,18	0	-80	-209
UST 30 yr	12/25/2008	2,63	0	-89	-204
Bund 2 yr	12/23/2008	1,75	-4	-46	-222
Bund 10 yr	12/23/2008	2,95	1	-34	-136
Bund 30 yr	12/23/2008	3,53	3	-25	-108
Fed Fund	12/23/2008	0,25	0	-75	-400
Libor 1 mo	12/23/2008	0,47	0	-94,0	-438
Libor 6 mo	12/23/2008	1,85	-2	-74,5	-289
Libor 12 mo	12/23/2008	2,11	-2	-67	-225
S&P 500	12/25/2008	868,15	0,58%	1,25%	-41,99%
Nasdaq Composite	12/24/2008	1524,90	0,22%	4,11%	-43,80%
RTS	12/26/2008	653,70	-0,34%	-0,75%	-71,37%
EURUSD	12/26/2008	1,4072	0,34%	9,25%	-2,88%
USDJPY	12/26/2008	90,45	0,08%	-5,46%	-20,90%
USDRUB	12/26/2008	29,00	1,03%	5,67%	17,66%
EURRUB	12/26/2008	40,81	1,38%	15,46%	14,29%
Brent 1m Future	12/26/2008	37,73	3,06%	-30,03%	-59,84%
Gold	12/26/2008	846,65	-0,04%	4,15%	2,69%

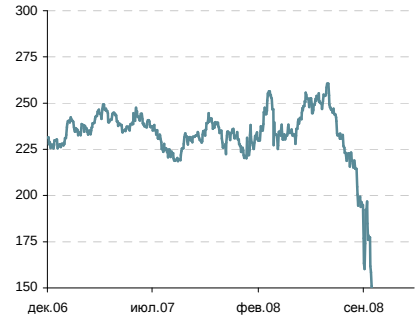
Источник: Bloomberg

Кривая доходности US Treasuries



Источник: Bloomberg

Спрэд между UST10 и UST10 с защитой от инфляции



Источник: Bloomberg

Bond	Date	Current Spread	Change, bp				YTM	BMK UST	Spread, bp
			day	week	month	year			
Russia-30*	12/25/2008	87,58%	3	55	521	-2615	9,86	UST10	767
UMS-31*	12/23/2008	122,37%	-15	73	1900	-733	6,41	UST30	378
Turkey-30*	12/25/2008	142,21%	0	37	868	-1523	7,77	UST10	559
Venezuela-27*	12/23/2008	54,68%	-28	-293	-1266	-4615	17,55	UST10	1461
EMBIG	12/24/2008	726	-2	-29	-22	471	-	-	-
EMBIG Russia	12/24/2008	806	-2	-86	4	649	-	-	-
EMBIG Brazil	12/24/2008	437	-1	-28	-53	217	-	-	-
EMBIG Mexico	12/24/2008	431	-1	-17	-51	259	-	-	-
EMBIG Turkey	12/24/2008	542	-1	-37	-69	303	-	-	-
EMBIG Venezuela	12/24/2008	1860	-1	23	316	1337	-	-	-

* - Quotes

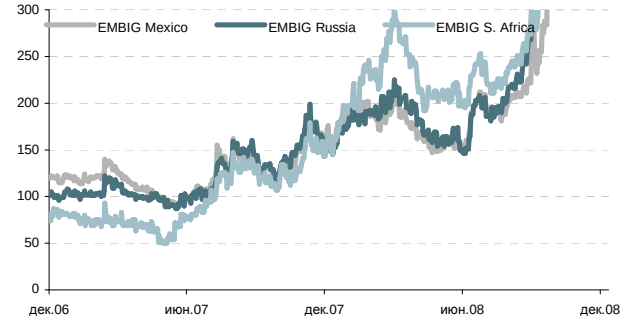
Source: J.P. Morgan, Bloomberg

Динамика цен на нефть сорта Brent



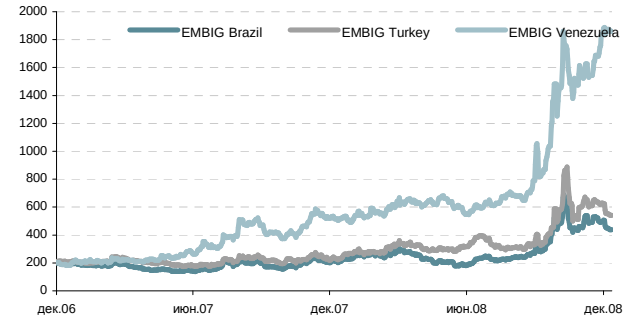
И сточник: Bloomberg

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

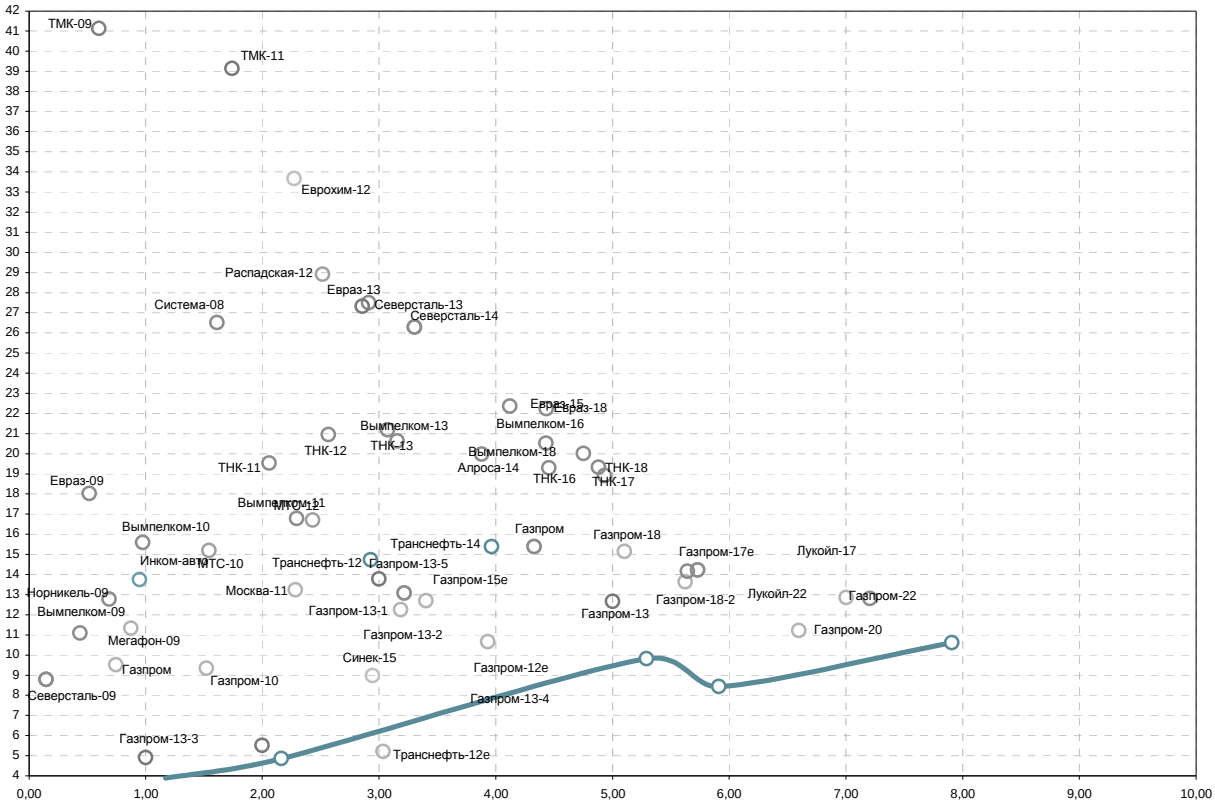
Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

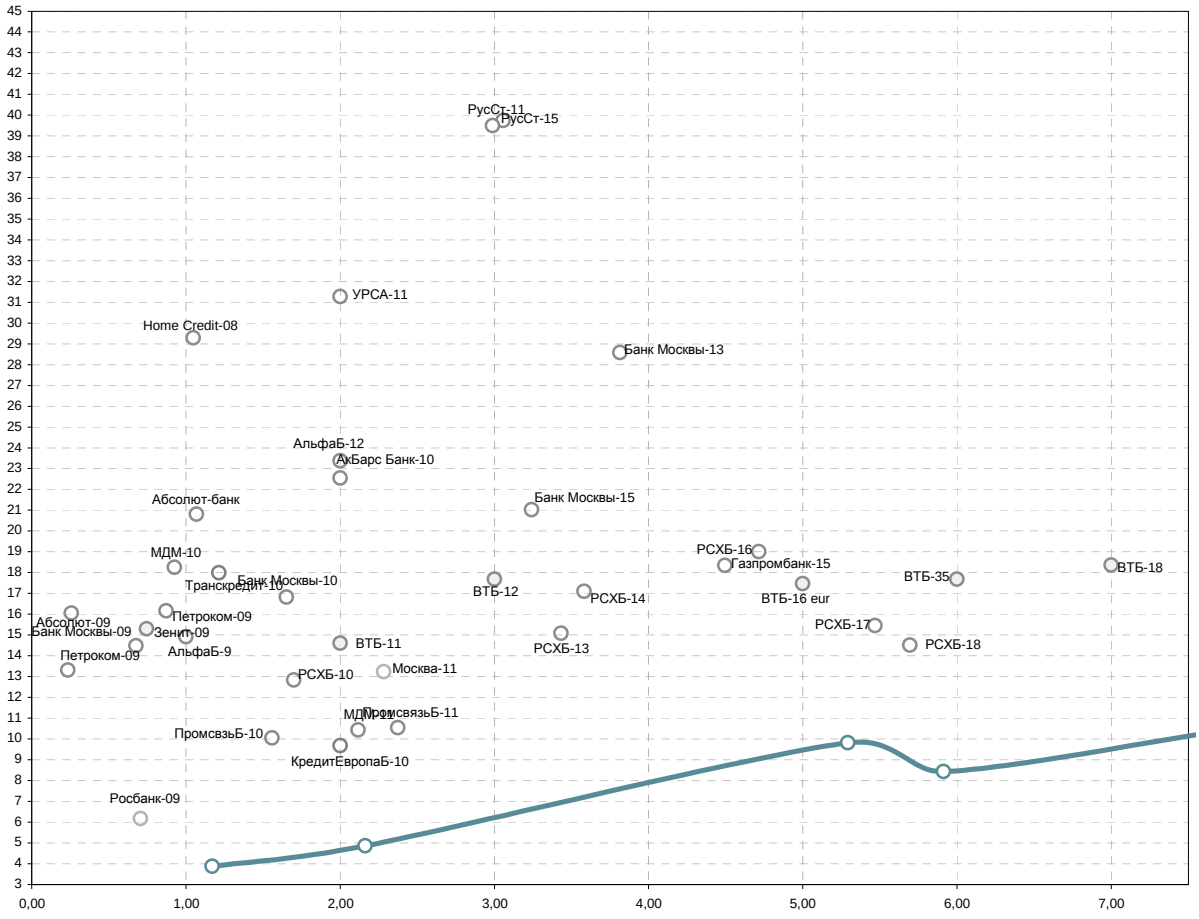
Приложение 2. Российский рынок еврооблигаций

Кривая доходности российских еврооблигаций: Нефинансовый сектор



Источник: Bloomberg

Кривая доходности российских еврооблигаций: Банки



Источник: Bloomberg

Котировки российских еврооблигаций

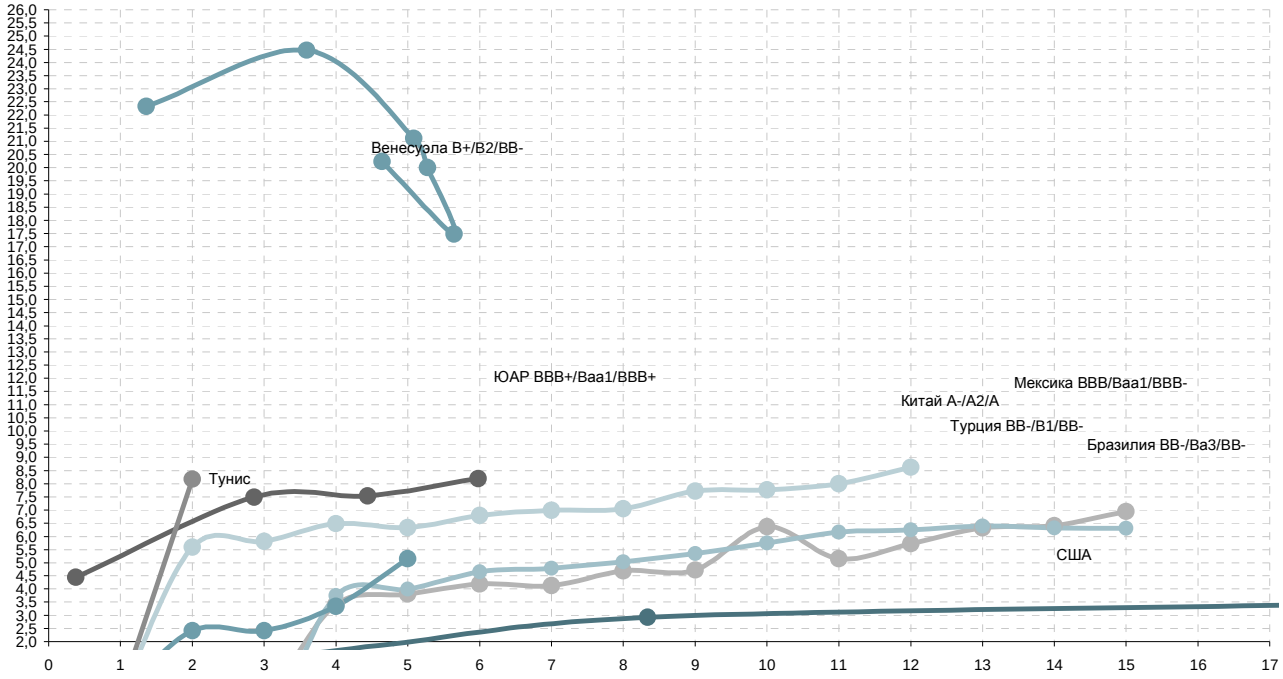
	Maturity	Size, mln	Coupon, %	Rating	Bid	Offer	YTM,%	Modified Duration	Spread to Treasury, bp
Sovereign									
Russia-10 $	3/31/2010	2 767	8,25	Baa1/BBB/BBB+	104,96	105,27	1,16	0,73	348
Russia-18 $	7/24/2018	3 467	11	Baa1/BBB/BBB+	116,14	116,60	8,47	5,91	632
Russia-28 $	6/24/2028	2 500	12,75	Baa1/BBB/BBB+	117,00	117,46	10,64	7,91	823
Russia-30 $	3/31/2030	20 310	7,5	Baa1/BBB/BBB+	87,40	87,75	9,86	5,29	741
Aries-09 EUR	10/25/2009	1 000	7,75	Aaa/AAA	103,90	103,98	2,78	0,80	108
Regional									
Moscow-11 EUR	10/12/2011	374	6,45	Baa1/-/BBB+	84,95	84,95	13,24	2,28	1138
Oil & Gas									
Gazprom-09 $	10/21/2009	700	10,5	BBB	100,53	100,72	9,65	0,75	932
Gazprom-10 EUR	9/27/2010	1 000	7,8	BBB/BBB	97,19	97,56	9,46	1,52	772
Gazprom-13 $	3/1/2013	1 750	9,625	BBB	91,09	91,59	12,34	3,19	1096
Gazprom-13-2 $	4/11/2013	400	7,343	A3/BBB/BBB	82,44	82,69	12,75	3,40	1135
Gazprom-15 EUR	6/1/2015	1 000	5,875	A3	62,25	62,75	15,48	4,33	1283
Gazprom-17 EUR	11/2/2017	500	5,44	BBB/BBB	56,75	57,25	14,30	5,73	1140
Gazprom 18 EUR	2/13/2018	1 200	6,605	B-/-/-	58,63	59,13	15,23	5,10	1232
Gazprom 18 $	4/11/2018	1 100	8,146	A3/BBB/BBB	71,56	71,56	13,63	5,62	1152
Gazprom-20 $	2/1/2020	1 250	7,201	BBB+/BBB+	74,61	74,86	11,24	6,60	903
Gazprom-22 $	3/7/2022	1 300	6,51	BBB/BBB	59,89	60,14	12,89	7,00	1063
Gazprom-34 $	4/28/2034	1 200	8,625	A3/BBB/BBB	82,04	82,29	10,67	3,93	1181
Lukoil-17 $	6/7/2017	500	6,356	Baa2/BBB-/BBB-	61,73	62,23	14,24	5,64	1224
Lukoil-22 $	6/7/2022	500	6,656	Baa2/BBB-/BBB-	60,49	60,99	12,87	7,21	1060
Sibneft-09 $	1/15/2009	500	10,75	Baa3/BBB-	100,01	100,01	10,02	0,04	1001
TNK-11 $	7/18/2011	500	6,875	Baa2/BB/BBB- /*-	75,24	75,46	19,61	2,06	1858
TNK-12 $	3/20/2012	500	6,125	Baa2/BB/BBB- /*-	66,19	66,44	21,02	2,57	1984
TNK-13 $	3/13/2013	600	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	62,80	63,05	21,26	3,08	1988
TNK-16 $	7/18/2016	1 000	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	53,82	54,07	19,35	4,46	1746
TNK-17 $	3/20/2017	800	6,625	Baa2/BB/BBB- /*-	48,39	48,64	19,38	4,88	1741
TNK-18 $	3/13/2018	1 100	7,875	Baa2/BB/BBB- /*-	52,39	52,64	18,97	4,93	1687
Transneft-12 EUR	6/27/2012	700	5,381	A3 /*-/BBB/-	100,51	100,51	5,21	3,04	308
Transneft-12 $	6/27/2012	500	6,103	A3 /*-/BBB/-	74,61	77,09	14,79	2,93	1355
Transneft-14 $	3/5/2014	1 300	5,67	A3 /*-/BBB/-	65,87	66,12	15,44	3,97	1386
Telecommunications									
Megafon-09 $	12/10/2009	375	8	Ba2/BB+	96,96	97,09	11,40	0,88	1103
MTS-10 $	10/14/2010	400	8,375	Ba2/BB	89,41	89,62	15,27	1,55	1447
MTS-12 $	1/28/2012	400	8	Ba2/BB	79,41	79,66	16,77	2,43	1563
Sistema-11 $	1/28/2011	350	8,875	Ba3 /*-/BB/BB-	72,79	73,10	26,63	1,61	2571
Vimpelcom-09 $	6/16/2009	450	10	Ba2/BB+	99,44	99,50	11,17	0,44	1096
Vimpelcom-10 $	2/11/2010	300	8	Ba2/BB+	92,33	92,47	15,67	0,98	1522
Vimpelcom-11 $	10/22/2011	300	8,375	Ba2/BB+	81,47	81,72	16,85	2,29	1576
Vimpelcom-13 $	4/30/2013	1 000	8,375	(P)Ba2/BB+	65,68	65,93	20,69	3,16	1928
Vimpelcom-16 $	5/23/2016	600	8,25	Ba2/BB+	54,04	54,29	20,56	4,43	1870
Vimpelcom-18 $	4/30/2018	1 000	9,125	(P)Ba2/BB+	54,49	54,74	20,05	4,75	1794
Industrials									
Alrosa-14 $	11/17/2014	500	8,875	Ba2/BB- /*-	62,27	62,52	20,03	3,88	1836
Eurochem-12 $	3/21/2012	300	7,875	-/BB/"BB	51,23	51,40	33,74	2,27	3256
Evrazholding-09 $	8/3/2009	325	10,875	Ba2/BB	96,04	96,11	18,10	0,52	1784
Evrazholding-15 $	11/10/2015	750	8,25	B1/BB	51,34	51,59	22,42	4,12	2062
Evrazholding-13 $	4/24/2013	1 300	8,875	B1/BB	54,23	54,47	27,58	2,91	2617
Evrazholding-18 $	4/24/2018	700	9,5	B1/BB	50,44	50,69	22,29	4,43	2018
Nornickel-09 $	9/30/2009	500	7,125	Baa2/BBB-	95,95	96,05	12,85	0,69	1254
Raspadskaya-12 $	5/22/2012	300	7,5	Ba3/B+e/B+	55,15	55,50	29,05	2,52	2783
Severstal-09 $	2/24/2009	325	8,625	Ba2/BB	99,94	99,94	8,79	0,15	878
Severstal-14 $	4/19/2014	375	9,25	Ba2/BB/BB	52,36	52,61	26,36	3,30	2477
Severstal-13 $	7/29/2013	1 250	9,75	Ba2/BB/BB	55,28	55,53	27,40	2,86	2594
SINEK-15	8/3/2015	250	7,7	Ba1/BBB-	93,77	93,77	8,97	2,95	854
TMK-08 $	9/29/2009	300	8,5	Ba3/B+/-	80,48	80,56	41,20	0,60	4089

	Maturity	Size, mln	Coupon, %	Rating	Bid	Offer	YTM,%	Modified Duration	Spread to Treasury, bp
Banks									
Absolut-09 $	4/7/2009	200	8,75	Baa3/-/A-	97,99	98,03	16,13	0,26	1609
Ak Bars-10 $	6/28/2010	250	8,25	Ba2/BB-e/-	82,50	82,66	22,63	1,28	2198
Alfa Bank-09 $	10/10/2009	400	7,875	Ba1/-/BB	94,80	94,97	15,04	0,71	1472
Alfa Bank-12 $	6/25/2012	500	8,2	Ba1/BB-/-	64,83	65,20	23,48	2,66	2225
Bank of Moscow-09 $	9/28/2009	250	8	A3/-/BBB	95,46	95,54	14,54	0,68	1423
Bank of Moscow-10 $	9/21/2005	300	7,375	A3/-/BBB	84,90	85,10	16,89	1,65	1603
Bank of Moscow-13 $	5/13/2013	500	7,335	A3/-/BBB	61,79	62,04	21,08	3,24	1966
Credit Europe Bank 10 $	4/13/2010	250	7,5	Ba1/-/-	97,40	97,40	9,68	1,18	914
Gazprombank-08 $	10/30/2008	1 050	7,25	WR/NR	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	Field Not Applic
Gazprombank-15 $	9/23/2015	1 000	6,5	A3/BBB-	54,98	55,23	18,39	4,50	1661
MDM-11 $	7/21/2011	200	9,75	Ba2/B+ /*-/BB-	98,48	98,48	10,44	2,12	940
Promsviazbank-10 $	10/4/2010	200	8,75	Ba2/BB-	97,93	97,93	10,05	1,56	926
Promsviazbank-11 $	10/20/2011	225	8,75	Ba2/BB-	95,73	95,73	10,54	2,38	945
Promsviazbank-12 $	5/23/2012	200	9,625	Ba3/B	38,93	39,05	47,42	2,11	4621
Rusagrobank-10 $	11/29/2010	350	6,875	A3/BBB+	89,91	90,14	12,91	1,70	1205
Rusagrobank-13 $	5/16/2013	700	7,175	A3/BBB+	75,03	75,28	15,13	3,43	1372
Rusagrobank-14 $	1/14/2014	750	7,125	A3/-/-	66,92	67,17	17,15	3,58	1559
Rusagrobank-18 $	5/29/2018	1 000	7,75	A3/-/-	65,61	65,86	14,54	5,70	1242
Rusagrobank-17 $	5/15/2017	1 250	6,299	A3/-/BBB+	57,54	57,79	15,49	5,47	1350
Russian Standard-9 E	9/16/2009	400	6,825	Ba2/B+	74,13	74,13	56,87	0,51	5517
Russian Standard-10 $	10/7/2010	500	7,5	Ba2/B+	42,53	42,61	67,82	1,19	6703
Rosbank-09 $	9/24/2009	300	9,75	Baa3/A-	102,54	102,54	6,18	0,71	592
Sberbank-15	2/11/2015	1 000	6,23	A2/BBB	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	-
TranscapitalBank 10 $	5/10/2010	175	9,125	B1/-/-	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	Field Not Applic
VTB-08 $	12/11/2008	550	6,875	WR/NR	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	Field Not Applic
VTB-11 $	10/12/2011	450	7,5	A2/BBB+	84,07	84,20	14,63	2,33	1354
VTB-12 $	10/31/2012	1 200	6,609	A2/BBB/BBB+	69,81	70,06	17,74	3,04	1643
VTB-15 $	2/4/2015	750	6,315	A2/BBB	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	#N/A N/A	Field Not Applic
VTB-18 $	5/29/2018	2 000	6,875	A2/BBB/BBB+	66,08	66,33	13,27	3,37	1698
VTB-35 $	6/30/2035	1 000	6,25	A2/BBB+	56,58	56,83	11,50	4,60	1599

Источник: Bloomberg

Приложение 3. Еврооблигации развивающихся рынков

Кривые доходностей еврооблигаций развивающихся рынков



Источник: Bloomberg

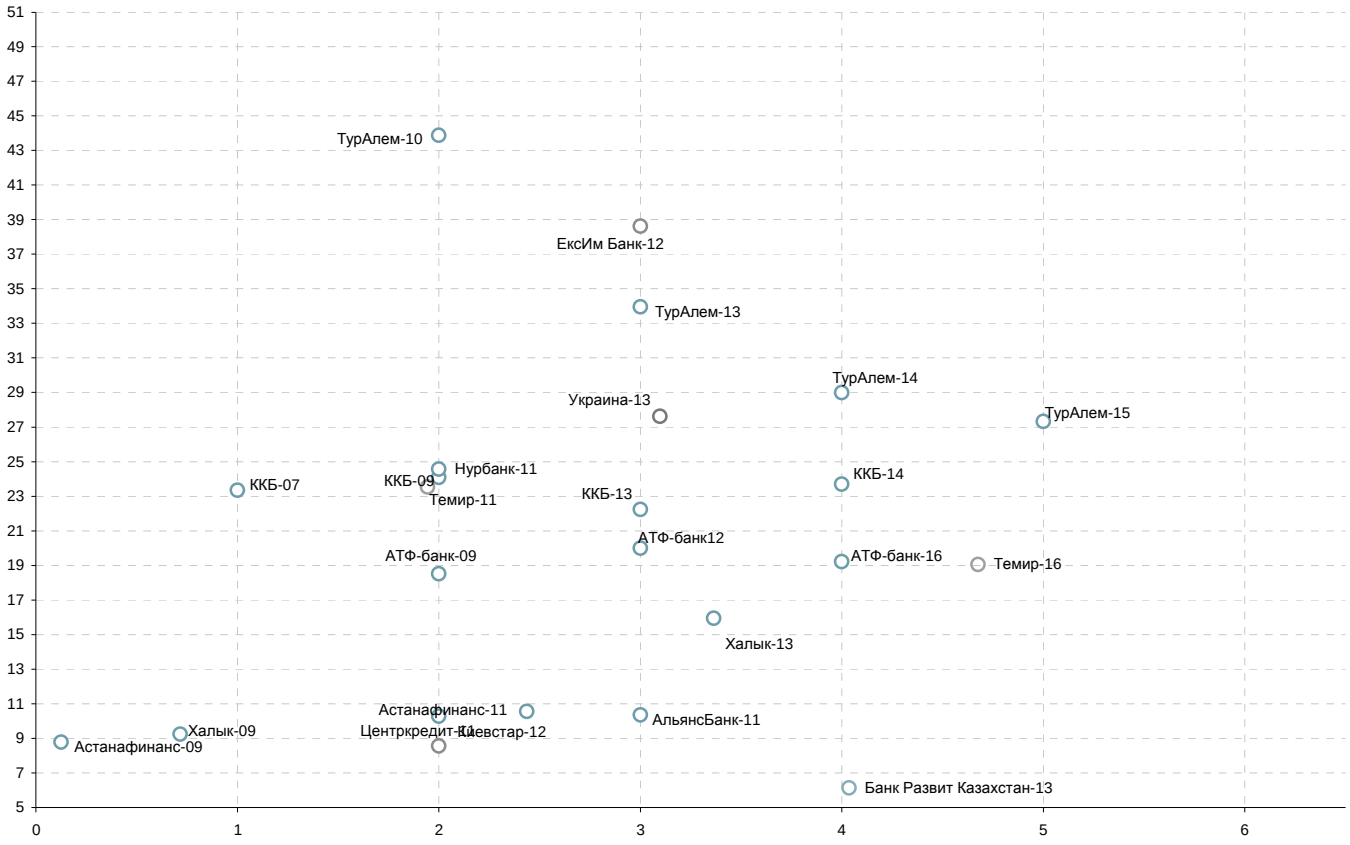
Котировки еврооблигаций развивающихся рынков

	Maturity	Size, mln	Coupon, %	Rating	Bid Price	Ask Price	YTM,%	Modified Duration
Brazil								
A-Bond	1/15/2018	4 509	8,00	BBB-/Ba1/-	110,90	111,10	6,37	3,82
Brazil-40	8/17/2040	5 157	11,00	BBB-/Ba1/BBB-	128,70	128,80	5,72	4,82
Turkey								
Turkey-30	1/15/2030	1 500	11,88	BB-/Ba3/BB-	142,08	142,33	7,76	9,19

Источник: Bloomberg

Приложение 4. Еврооблигации стран СНГ

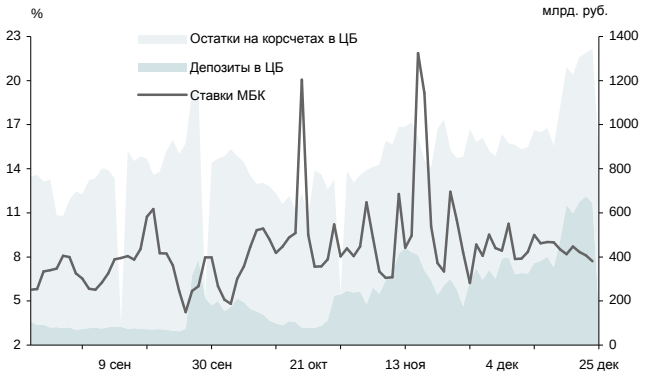
Кривая доходности еврооблигаций стран СНГ



Источник: Bloomberg

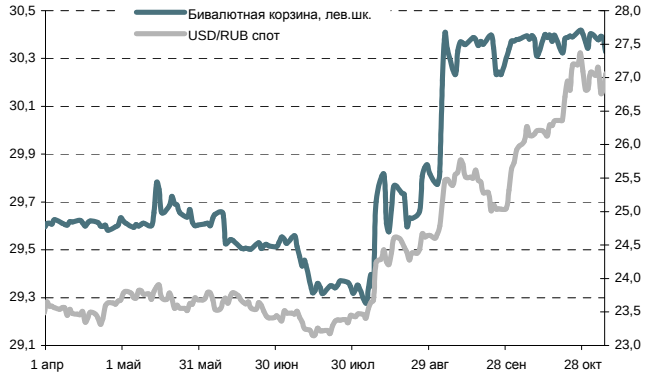
Приложение 5. Индикаторы российского рынка облигаций

Показатели рублевой ликвидности



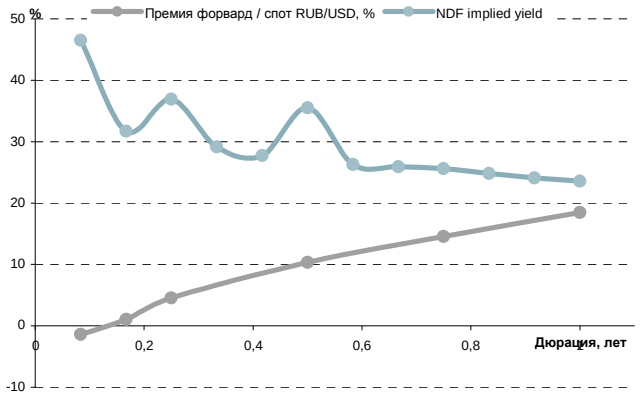
Источник: Reuters, ЦБ РФ

Динамика валютного рынка



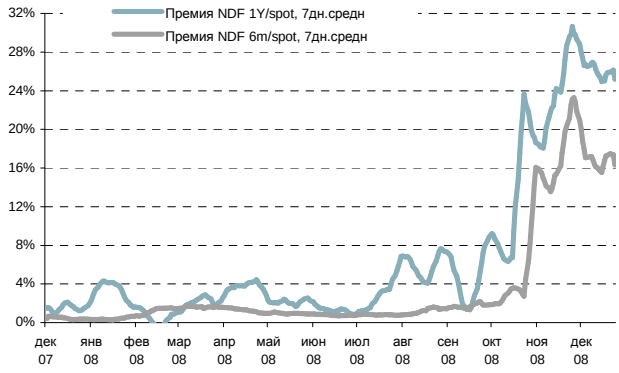
Источник: Reuters

Кривая доходности NDF и премия форвард / спот RUB/USD:



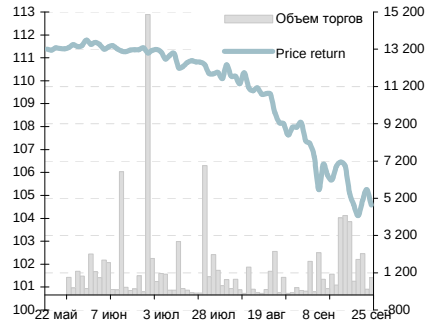
Источник: Bloomberg

Премии 1Y NDF и 6m NDF к спот курсу RUB/USD:



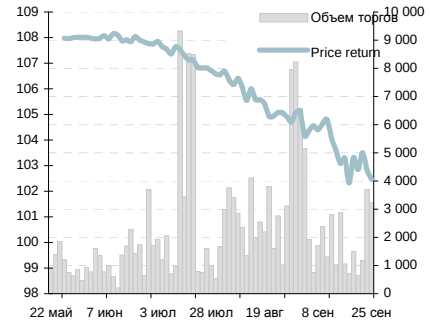
Источник: Reuters

Динамика ценового индекса ZETBI OFZ и объема торгов в сегменте



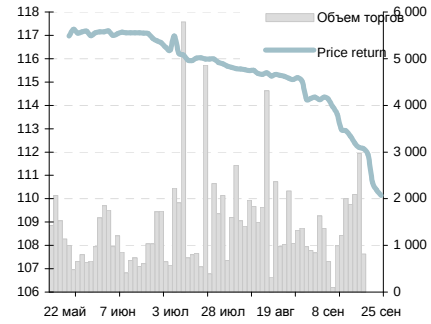
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика ценового индекса ZETBI Muni и объема торгов в сегменте



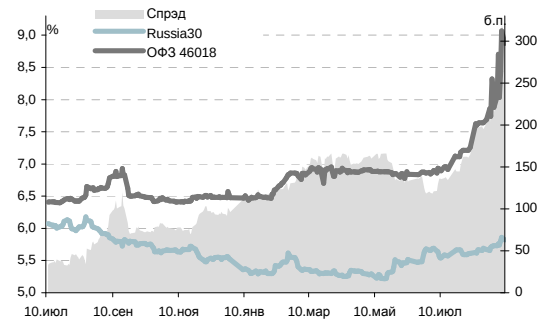
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индекса ZETBI Corp 10 и объема торгов в сегменте *



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика спрэда ОФЗ 46018 и Russia 30

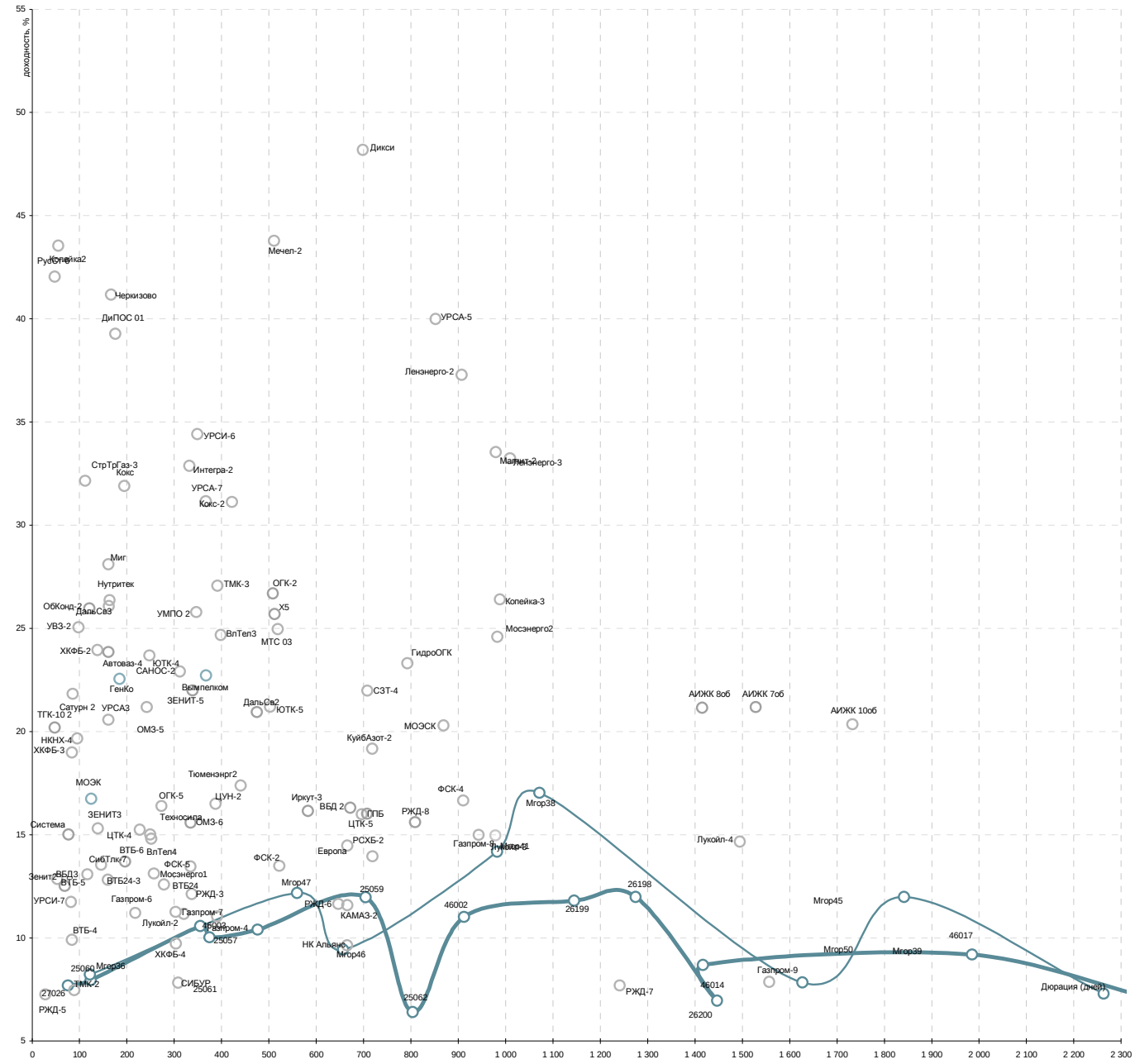


Источник: ММВБ,Bloomberg, расчеты Банка ЗЕНИТ

**Объем торгов для ZETBI Corp 10 соответствует только входящим в индекс бумагам*

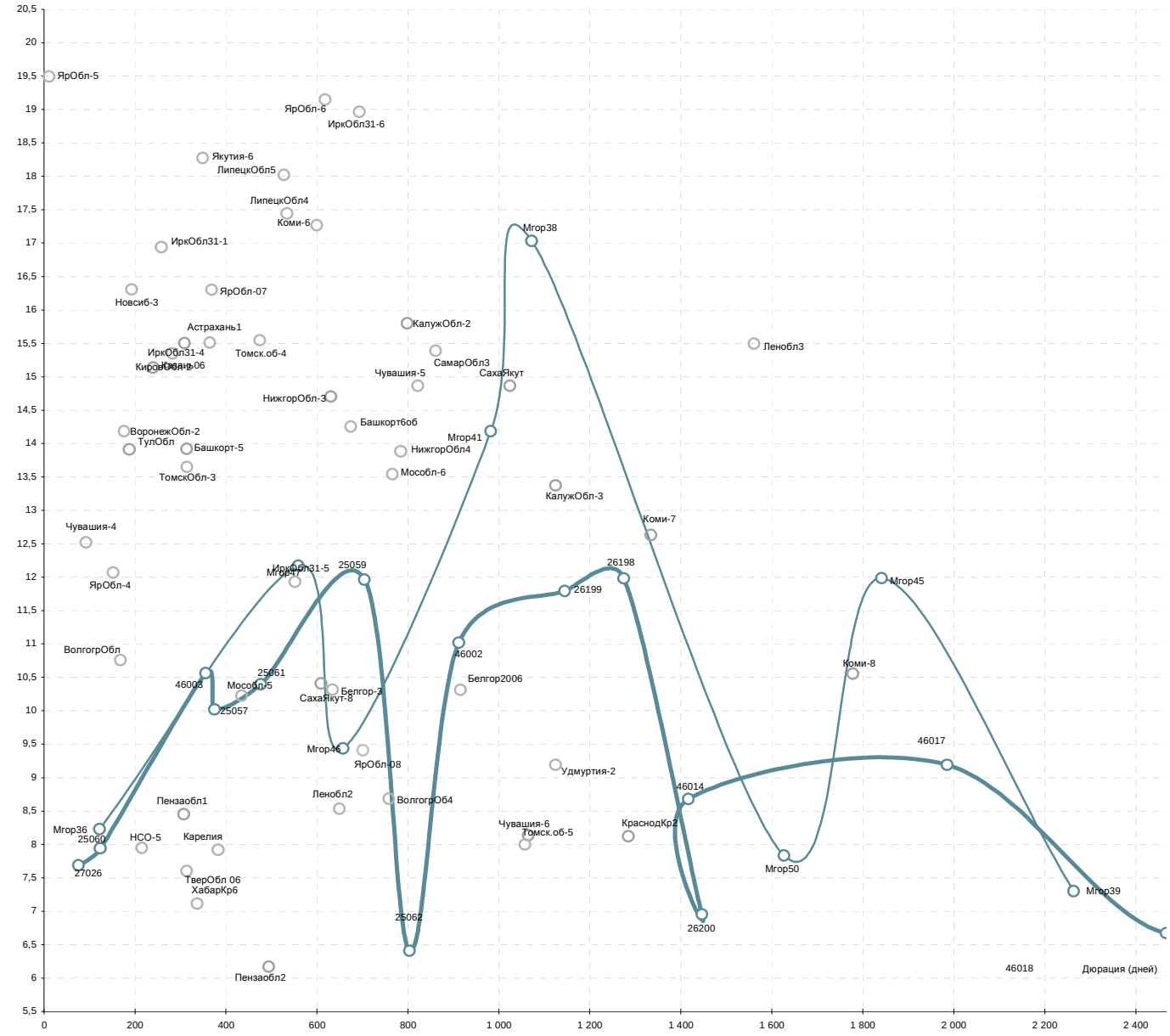
Приложение 6. Российский долговой рынок

Кривая доходности корпоративных облигаций



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Кривая доходности субфедеральных облигаций



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Котировки российских облигаций

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв цены день	Изм срвзв цены неделя	Доходность по срвзв цене,% год погашение	Доходность по срвзв цене,% год оферта	Дюрация лет
Государственные облигации														
SU27026RMFS2	11.03.2009	6,00	76		1	3,70	99,65	99,65	0,247	-	-	7,69		0,21
SU25060RMFS3	28.01.2009	5,80	125		9	40,50	99,36	99,36	0,906	-0,04	0,53	7,94		0,34
SU46003RMFS8	14.01.2009	10,00	566		0	0,00	99,00	99,70	4,438	-	1,33	10,56		0,97
SU25057RMFS9	21.01.2009	7,40	391		13	59,41	97,75	97,72	1,298	0,35	1,91	10,02		1,03
SU25061RMFS1	04.02.2009	5,80	496		2	4,77	94,70	94,70	0,795	0,46	2,03	10,40		1,30
SU25062RMFS9	04.02.2009	5,80	860		1	0,00	99,00	99,00	0,795	-	-	6,41		2,20
SU25059RMFS5	21.01.2009	6,10	755		18	123,28	90,20	90,25	1,070	0,01	2,81	11,96		1,93
SU46002RMFS0	11.02.2009	9,00	1322		1	4,87	94,00	94,00	3,304	1,13	3,34	11,02		2,50
SU26199RMFS8	14.01.2009	6,10	1294		12	49,97	85,00	84,97	1,187	1,48	1,97	11,79		3,14
SU26198RMFS0	03.11.2009	6,00	1408		14	35,93	82,75	82,30	0,855	1,01	1,80	11,98		3,49
SU26200RMFS4	21.01.2009	6,10	1665		1	0,00	97,35	97,35	1,070	7,95	-	6,95		3,96
SU46014RMFS5	11.03.2009	9,00	3534		0	0,00	94,00	96,30	2,614	-	16,36	8,68		3,88
SU46017RMFS8	11.02.2009	8,00	2778		0	0,00	89,75	89,97	0,943	-	-3,18	9,19		5,44
SU46021RMFS0	18.02.2009	7,50	3513		1	0,00	96,70	96,70	2,610	12,70	-	6,67		6,76
SU46022RMFS8	21.01.2009	7,50	5319		0	0,00	96,00	96,00	3,185	-	-	6,87		8,90
SU46018RMFS6	11.03.2009	8,50	4717		10	0,30	96,50	95,79	0,349	6,97	5,83	8,14		7,74
SU46020RMFS2	11.02.2009	6,90	9904		2	4,52	79,60	79,60	2,533	2,21	-2,30	9,12		10,65
Субфедеральные облигации														
МГор41-об	30.01.2009	8,00	582		0	0,00	100,00	94,40	3,244	-	0,00	12,17		1,53
МГор38-об	26.12.2008	10,00	731		0	0,00	101,40	101,40	4,987	-	0,00	9,44		1,80
МГор39-об	21.01.2009	8,00	2034		1	0,00	100,00	100,00	3,441	0,00	9,00	7,83		4,46
МГор44-об	24.06.2009	8,00	2372		12	2,66	82,47	82,03	0,022	-	15,01	11,99		5,05
МГор45-об	27.12.2008	8,00	1280		0	0,00	75,00	78,25	3,967	-	-3,25	17,03		2,94
МГор46-об	25.01.2009	8,00	212		2	1,01	98,25	98,25	1,337	0,07	0,09	11,62		0,57
Башкорт5об	06.05.2009	8,02	314		0	0,00	95,60	95,60	1,099	-	0,00	13,92		0,86
БелгОб 3об	11.02.2009	8,38	685		1	0,00	97,35	97,35	0,987	6,72	7,54	10,32		1,74
ИркОбл31-1	19.03.2009	8,50	357		0	0,00	94,75	94,75	0,162	-	-2,83	16,94		0,71
ИркОбл31-3	25.03.2009	7,25	699		0	0,00	89,00	88,00	0,576	-	0,00	20,81		1,04
Казань 3	28.03.2009	8,04	457		0	0,00	100,00	100,00	1,960	-	-	8,19		1,20
Казань06об	25.02.2009	8,00	247		0	0,00	96,00	96,00	0,636	-	-0,50	15,14		0,66
КОМИ 6в об	14.04.2009	11,50	658		0	0,00	91,50	91,50	2,268	-	-8,50	17,27		1,64
КОМИ 7в об	23.05.2009	9,00	1793		2	0,35	80,00	87,50	0,789	-0,50	8,33	12,63		3,65
КировОбл 1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д		#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
ЛипецкОбл4	20.01.2009	7,95	936		0	0,00	88,00	87,96	3,398	-	-	17,44		1,46
ЛипецкОбл5	15.01.2009	7,10	567		0	0,00	86,60	86,60	3,132	-	-	18,02		1,45
ЛипецкОбл6	10.06.2009	8,98	1623		1	0,00	75,00	75,00	0,369	15,00	-9,01	22,30		2,45
Мос.обл.4в	20.01.2009	11,00	117		20	14,87	97,00	96,91	1,959	-0,15	-1,13	22,91		0,31
Мос.обл.5в	31.03.2009	10,00	460		1	0,00	100,00	100,00	2,356	0,00	8,95	10,22		1,19
Мос.обл.6в	21.04.2009	9,00	845		5	28,09	91,99	91,98	1,603	9,46	11,98	13,54		2,10
Мос.обл.7в	22.04.2009	8,00	1938		10	0,01	57,00	56,77	1,403	3,62	1,82	23,51		3,99
СамарОбл 5	26.03.2009	9,30	1820		3	227,89	74,95	74,95	0,000	-	2,95	23,24		2,40
Мос.обл.8в	16.06.2009	9,00	1629		14	117,86	59,99	60,28	0,222	-4,71	-9,18	33,55		2,32
Томск.об-3	09.05.2009	6,00	319		0	0,00	90,01	94,19	0,756	-	-0,76	13,65		0,86
Томск.об-4	26.12.2008	7,00	1096		0	0,00	90,00	90,00	3,490	-	0,00	15,55		1,30
Томск.об-5	17.06.2009	8,00	1453		0	0,00	98,59	98,59	0,175	-	-	8,00		2,90
Чувашия-04	27.03.2009	12,33	92		12	70,54	99,80	99,86	3,074	0,14	0,46	12,52		0,25
Чувашия-05	05.06.2009	7,85	892		0	0,00	84,00	86,95	0,452	-	-3,05	14,86		2,25
Чувашия-06	20.01.2009	7,74	1209		6	0,90	98,72	98,71	1,378	-	12,51	8,14		2,92
Чувашия-07	10.03.2009	9,66	1622		2	0,03	52,00	52,00	0,423	0,00	-12,99	34,54		2,99
Якут-06 об	12.02.2009	10,00	504		0	0,00	93,50	93,50	1,151	-	-3,00	18,27		0,96
Якут-07 об	22.01.2009	7,80	1939		2	0,01	67,42	67,41	1,346	-	1,55	21,41		3,15
ЯрОбл-05	30.12.2008	7,50	5		0	0,00	99,80	99,62	3,658	-	-0,28	19,49		0,03
ЯрОбл-04	26.05.2009	10,00	152		3	0,75	99,20	99,14	0,849	-	0,54	12,07		0,42
ЯрОбл-06	21.04.2009	7,50	845		0	0,00	83,00	83,00	1,336	-	-2,00	19,15		1,69
ЯрОбл-07	30.12.2008	7,75	460		0	0,00	90,10	92,04	1,826	-	2,55	16,30		1,01
Корпоративные облигации														
Машиностроение														
АВТОВАЗоб3	23.06.2009	9,60	544		0	0,00	85,00	85,00	0,053	-	-	23,12		1,42
АВТОВАЗоб4	26.05.2009	7,80	1972	152	0	0,00	93,55	93,55	0,641	-	0,00	-	24,72	0,44
АВТОВАЗбо1	25.03.2009	9,23	90		0	0,00	99,96	99,97	6,929	-	-	8,91		0,53
АВТОВАЗбо2	25.03.2009	9,80	90		10	6,17	96,50	96,62	7,357	-0,38	0,60	22,61		0,25
АВТОВАЗбо3	27.05.2009	9,20	153		0	0,00	96,00	96,00	5,318	-	4,00	18,44		0,42
АВТОВАЗбо4	04.06.2009	9,20	161		0	0,00	97,19	97,19	5,117	-	2,19	15,18		0,44
Автоприбор	29.04.2009	13,20	125		0	0,00	74,20	74,20	2,061	-	21,20	115,37		0,35
Вагонмаш 2	17.06.2009	15,50	720	174	10	1,71	88,99	81,17	0,332	-3,15	-9,27	-	43,23	0,48
ГАЗФин 01	10.02.2009	9,30	775	47	85	19,65	81,30	80,49	3,440	-2,61	3,98	-	182,35	0,13
ГИДРОМАШС1	26.05.2009	9,90	334		0	0,00	69,00	69,00	0,814	-	4,00	66,10		0,89
ГСС 01	26.03.2009	7,85	3013	273	3	8,90	87,00	87,00	1,957	-	-3,50	-	30,22	0,73
ГТ-ТЭЦ 4об	04.03.2009	10,71	251		5	0,08	32,42	32,37	3,316	5,92	0,26	469,60		0,63
ИжАвто 02	11.06.2009	18,00	896		7	22,12	72,00	71,15	0,690	-0,85	9,15	40,20		2,00
ИРКУТ-03об	19.03.2009	8,74	630		1	0,00	90,00	90,00	2,347	-	5,00	16,14		1,60
Камаз-Фин2	20.03.2009	11,25	631		0	0,00	99,97	99,98	2,990	-	-	11,58		1,82
Киров.зд1	25.03.2009	14,90	454	89	0	0,00	94,00	94,00	3,756	-	-	-	40,41	0,36
КМЗ-Фин 01	11.06.2009	11,25	532	168	0	0,00	99,50	99,50	0,432	-	0,00	-	12,34	0,48
КМПО-Фин01	17.03.2009	11,30	446		0	0,00	105,50	105,50	3,096	-	0,00	6,70		1,17
КриогенФ 1	16.06.2009	13,00	355		5	305,09	100,00	100,00	0,321	12,45	19,00	13,41		0,94
ЛОМО 03	09.03.2009	15,50	254	74	0	0,00	54,00	54,00	4,501	-	2,00	-	414,34	0,22
МетарФ 01	11.06.2009	16,00	532	172	1	0,01	80,00	80,00	0,614	-	-	-	86,13	0,47
МиГ-Ф 02	10.03.2009	12,00	985	257	0	0,00	90,00	90,00	3,518	-	0,00	-	30,54	0,69
МиГ-Ф обл.	03.06.2009	7,85	160		0	0,00	92,00	92,00	0,473	-	0,00	28,11		0,44

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв день	Изм срвзв неделя	Доходность по погашение	Доходность по оферта	Дюрация, лет
МоторФин-1	19.03.2009	10,00	84		1	0,01	85,00	85,00	2,685	-4,91	25,24	85,74		0,23
МоторФин-2	15.01.2009	10,00	567	21	1	6,99	90,00	90,00	4,411	0,77	-1,49	-	194,68	0,06
ОЗНА-Фин01	09.06.2009	10,50	348		0	0,00	99,80	99,80	0,460	-	-	-		0,00
ОМЗ-5 об	03.03.2009	8,80	978	250	1	0,93	93,00	93,00	2,748	-	2,00	-	21,19	0,66
ОМЗ - 6 об	05.06.2009	10,25	1618	344	14	397,58	94,99	95,93	0,562	-	3,71	-	16,82	0,92
ПМЗ 01	20.01.2009	12,00	208		0	0,00	85,01	87,32	2,137	-	5,28	42,90		0,55
ПО УОМЗ	11.06.2009	16,50	532		0	0,00	100,00	100,00	0,633	-	0,00	16,65		1,37
ПромТр02об	21.04.2009	10,75	1027	299	0	0,00	75,00	75,00	1,914	-	0,00	-	58,39	0,81
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	321		0	0,00	99,98	99,43	1,708	-	0,43	15,73		0,85
РОССКАТ-К1	21.01.2009	10,30	573	27	1	0,37	70,00	70,00	4,374	-7,94	-8,00	-	559,14	0,07
Ростверт1	26.05.2009	9,30	152		1	0,00	95,00	95,00	0,764	-	14,97	22,25		0,42
Рыбкаб-1	03.03.2009	10,75	1160	68	0	0,00	98,00	98,00	0,677	-	-1,85	-	21,77	0,19
СатурнНПО2	21.03.2009	12,50	999	86	3	3,25	97,75	97,75	3,288	0,28	1,75	-	21,82	0,24
СатурнНПО3	05.06.2009	16,25	1989	344	0	0,00	95,00	87,21	0,846	-	-11,79	-	23,69	0,91
СевКаб 03	30.12.2008	16,00	1188	96	0	0,00	96,00	96,00	3,770	-	0,00	-	36,61	0,27
СевКаб 04	24.02.2009	13,75	1608	152	10	0,08	53,24	53,24	1,130	15,21	-7,77	-	426,83	0,40
СОЛЛЕРС2	21.01.2009	7,70	1665	573	10	0,60	70,90	67,12	3,270	8,15	8,12	-	35,54	1,43
СРЗ-Фин 01	11.06.2009	18,00	350		0	0,00	79,00	79,00	0,690	-	-	50,94		0,90
ТВЗ 03	19.06.2009	10,00	540	176	1	2,10	70,00	70,00	0,164	20,00	-	-	102,92	0,48
ТензорФ-01	19.05.2009	14,50	327		2	15,01	79,99	79,99	1,470	-	9,53	48,42		0,86
Трансмаш-2	12.02.2009	8,60	777	49	7	6,61	97,00	96,72	3,134	0,27	-0,21	-	30,90	0,13
УЗПС 01	10.12.2009	0,00	532	168	0	0,00	92,50	92,50	0,384	-	-	-	16,64	0,00
УМПО 2	18.06.2009	12,25	357		0	0,00	90,00	90,00	0,235	-	-2,03	25,78		0,95
УралВагЗФ2	01.04.2009	10,50	649	97	0	0,00	96,19	96,19	2,445	-	1,34	-	25,18	0,27
ЭМАльянс 1	09.01.2009	13,50	925	197	0	0,00	75,00	75,00	6,177	-	-	-	94,06	0,51
ЭнергмашФ1	26.05.2009	13,00	1062	334	3	5,24	100,00	88,10	1,068	11,11	10,32	-	13,39	0,88
Атомстройэкспорт	26.05.2009	7,75	880	152	0	0,00	90,80	90,80	0,637	-	-	-	32,64	0,00
Металлургия, горнодобывающая, трубная промышленность														
Амурмет-01	26.02.2009	9,80	63		35	8,74	30,10	37,00	3,195	0,18	-6,28	932,46		0,17
Амурмет-02	26.02.2009	9,15	428		4	0,00	24,99	23,00	2,958	5,00	4,89	301,36		1,00
Амурмет-03	17.04.2009	12,75	841	113	13	16,48	22,00	24,62	2,410	0,62	-5,28	-	1084,39	0,31
Белон 01	03.06.2009	9,10	160		2	15,49	75,50	73,23	0,548	-0,58	2,55	95,11		0,44
Белон 02	26.02.2009	9,25	1155	245	3	6,61	63,12	63,12	3,016	0,12	5,10	-	117,47	0,64
ДиПОС 01	23.06.2009	13,10	1272	180	0	0,00	90,00	90,00	0,072	-	0,00	-	37,06	0,48
Инпром 02	15.01.2009	8,80	567	21	3	0,03	49,00	50,94	3,882	-8,16	1,08	-	1692,87	0,06
Инпром 03	20.05.2009	13,00	874	328	4	0,18	49,00	56,34	1,282	6,34	5,84	-	155,53	0,86
Кокс 01	15.01.2009	8,95	203		2	0,09	90,00	90,00	3,948	0,00	-1,82	31,90		0,53
Кокс 02	19.03.2009	8,70	1176	448	1	20,61	80,12	80,12	2,336	0,12	-4,87	-	31,12	1,16
Магнезит 1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Магнезит 2	28.03.2009	8,75	823	93	5	0,79	59,00	60,95	2,110	1,60	3,38	-	277,63	0,25
МаирИнв-03	01.04.2009	11,15	97		5	0,01	50,00	50,69	2,596	-4,69	-41,31	369,14		0,27
МаксиГ 01	12.03.2009	10,00	77		19	1,91	85,00	85,00	2,877	-2,25	0,00	92,29		0,21
Метзавод	27.02.2009	8,75	64		3	0,09	93,30	93,38	2,829	-	2,38	48,34		0,18
Метсерв-Ф1	27.05.2009	12,00	1245	153	4	0,17	98,50	98,50	0,953	-	-0,40	-	15,67	0,42
Мечел 2об	17.06.2009	8,40	1630	538	18	12,61	67,00	67,28	0,184	0,28	-0,95	-	44,21	1,40
НижЛенИнв2	18.06.2009	13,00	175		1	0,00	80,00	80,00	0,249	10,00	19,96	68,18		0,48
НМЗ 1 обл.	14.02.2009	13,00	416	233	0	0,00	110,00	110,00	4,701	-	-	-	-	0,76
НОК-02	26.03.2009	15,00	1001	637	11	0,54	66,00	64,23	3,864	12,96	32,23	-	49,85	1,49
РМК-ФИН 01	07.04.2009	8,75	467		0	0,00	65,00	70,77	1,894	-	-14,23	43,93		1,21
СвобСокол3	26.05.2009	21,00	880	152	3	10,35	49,99	50,00	1,726	0,48	1,61	-	272,82	0,42
СПК об.01	26.05.2009	14,00	516		0	0,00	98,00	98,00	1,151	-	-	-		0,00
ТМК-02 обл	24.03.2009	7,60	89		2	2,04	100,00	100,00	1,936	0,30	2,62	7,46		0,24
ТМК-03 обл	17.02.2009	9,60	782	418	0	0,00	85,00	84,97	3,367	-	1,12	-	27,07	1,07
УГМК-УЭМ01	03.03.2009	8,25	1160	432	1	30,69	85,12	85,12	2,577	0,12	0,12	-	24,65	1,12
ЧТПЗ 01об	17.06.2009	9,50	538		2	0,09	73,00	73,15	0,208	-1,83	2,88	37,08		1,39
ЧТПЗ 03об	28.04.2009	10,00	2308	306	0	0,00	81,00	81,00	1,589	-	0,44	-	39,02	0,81
Нефтегазовая отрасль														
Альянс-01	18.03.2009	8,92	993	265	0	0,00	99,10	99,10	0,000	-	-	-	14,31	1,82
АСПЭК-01	31.12.2008	13,00	461	97	0	0,00	100,00	97,50	3,027	-	-	-	13,64	0,35
ГАЗПРОМ А4	11.02.2009	8,22	412		83	60,84	97,31	97,36	3,018	0,45	2,24	11,04		1,07
ГАЗПРОМ А6	05.02.2009	6,95	224		11	344,13	97,71	97,69	2,666	0,44	-0,69	11,21		0,60
ГАЗПРОМ А7	30.04.2009	6,79	308		0	0,00	96,70	96,70	1,042	-	1,99	11,25		0,83
ГАЗПРОМ А8	30.04.2009	7,00	1036		0	0,00	83,01	83,01	1,074	-	0,00	14,99		2,58
ГАЗПРОМ А9	18.02.2009	7,23	1875		1	0,00	97,99	97,99	2,516	17,99	24,51	7,86		4,26
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	721	175	2	2,22	70,00	73,07	0,230	0,07	1,17	-	106,18	0,48
ГЭС 01	24.06.2009	8,00	1273		0	0,00	100,01	100,01	0,022	-	-	8,15		3,07
ГЭС 02	28.04.2009	10,75	1580	306	0	0,00	83,10	79,78	1,708	-	-0,47	-	38,85	0,81
ИнтеграФ-1	20.03.2009	10,50	85		0	0,00	74,00	73,99	2,790	-	1,45	157,51		0,24
ИнтеграФ-2	02.06.2009	10,70	1069	341	0	0,00	84,77	84,77	0,674	-	18,79	-	32,94	0,91
КмплФин 01	05.02.2009	15,50	406	42	0	0,00	70,01	70,01	5,945	-	-	-	363,55	0,13
Лукойл2обл	19.05.2009	7,25	327		5	3,44	96,90	96,98	0,735	0,97	0,98	11,15		0,88
Лукойл3обл	11.06.2009	7,10	1078		6	16,62	83,65	82,82	0,272	-12,16	0,11	14,97		2,68
Лукойл4обл	11.06.2009	7,40	1806		10	2,08	76,60	76,51	0,284	-0,74	0,11	14,66		4,09
МарийНПЗ	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
МарийНПЗ 2	18.06.2009	13,00	721	175	4	4,10	69,98	69,97	0,249	-0,51	-0,17	-	107,67	0,48
МособгазФ1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
МособгазФ2	23.06.2009	9,25	1277		14	36,62	59,50	59,64	0,025	9,62	17,14	37,97		2,13
Мособлгаз1	14.05.2009	12,00	873		0	0,00	80,00	80,00	1,348	-	0,00	24,64		2,11
НКАльянс1	18.03.2009	8,92	993	265	5	8,50	60,00	66,95	2,419	-0,05	6,48	-	121,13	0,70
РуссНефть1	12.06.2009	12,00	715		3	954,29	70,00	70,00	0,427	0,00	0,00	-		0,00
Сахатрнфг1	03.06.2009	12,50	342		0	0,00	94,50	94,50	0,753	-	-	19,57		0,92
СтрТрГаз02	16.01.2009	8,49	1296		2	0,00	47,01	51,01	3,722	-3,99	-4,50	35,53		2,74
ТОАП-Фин01	11.06.2009	16,00	350	168	0	0,00	86,84	86,84	0,614	-	-	-	50,99	0,52
ТоппромИн1	16.01.2009	16,50	477	113	1	0,00	97,99	97,99	3,119	0,06	-0,86	-	25,47	0,30
УфаойлОП-1	16.04.2009	13,00	476	112	0	0,00	100,00	100,00	2,493	-	-	-	12,68	0,48
ФаэтонАФ 1	29.01.2009	13,50	217		0	0,00	95,00	95,00	5,437	-	-3,53	23,88		0,58

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв день	Изм срвзв неделя	Доходность по погашение	Доходность по оферта	Дюрация лет
Пищепром														
АгрикаПП 1	31.03.2009	13,50	278		1	0,00	10,11	10,11	3,181	-6,70	-3,89	2056,87		0,65
Агроком 01	23.06.2009	20,00	908	180	0	0,00	65,00	65,00	0,110	-	-25,00	-	139,72	0,50
Агрохолд 1	16.01.2009	16,00	211		7	0,47	15,00	14,53	3,025	-0,79	-2,04	3550,85		0,46
Аладушкин2	27.05.2009	12,30	1063	335	5	0,72	70,10	70,10	0,977	0,00	0,10	-	67,42	0,88
Аркада-02	20.02.2009	13,31	57		5	0,63	14,99	15,92	4,595	0,03	-3,08	2689,33		0,16
Аркада-03	02.04.2009	17,00	826	280	11	0,62	16,01	16,00	3,912	-0,73	-11,88	-	1150,71	0,66
Аркада-04	27.05.2009	15,00	1245	153	2	0,41	39,93	39,92	1,192	-	-	-	384,96	0,42
Белгркор-1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
БелФрегат1	12.03.2009	20,00	357		3	0,00	35,00	35,00	0,767	9,00	15,00	303,21		0,83
БородинФ-1	17.06.2009	10,50	356		0	0,00	94,90	94,90	0,230	-	-	16,25		1,04
ВБД ПП 2об	17.06.2009	9,00	720		0	0,00	90,00	89,00	0,197	-	0,00	16,30		1,84
ВБД ПП 3об	04.03.2009	9,30	1525	69	17	10,84	99,34	99,34	2,879	0,00	0,19	-	12,51	0,19
ВостСервФ1	12.03.2009	10,99	259		0	0,00	76,00	76,00	3,162	-	0,00	62,27		0,70
ВТК 1	19.06.2009	0,00	358		1	0,00	32,00	32,00	0,247	-0,40	6,50	-		0,00
Держава-Ф	27.01.2009	16,50	579	36	5	0,03	14,05	14,05	6,736	-9,36	-24,96	-	########	0,10
ДжейЭфСиГ1	23.04.2009	13,00	1029		0	0,00	97,99	98,11	2,244	-	0,00	-		0,00
ДымКолбПр1	01.05.2009	0,10	309		0	0,00	100,00	100,00	0,015	-	-	0,10		0,97
ЗавГросс01	15.01.2009	13,75	483	112	0	0,00	55,00	55,28	2,637	-	-12,22	-	702,19	0,30
Инмарко 1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
КАРАТ 02	18.06.2009	15,00	356	175	1	0,00	80,00	80,00	0,082	-	-7,00	-	71,25	0,48
ЛекФин 2об	17.02.2009	5,00	54		0	0,00	93,10	93,10	1,753	-	-	32,57		0,27
МельнКомб	26.02.2009	0,00	63		0	0,00	99,00	99,00	0,000	-	-	1,87		0,54
Митлэнд-01	17.02.2009	15,00	418	54	1	0,00	89,00	89,00	1,521	-	-	-	98,71	0,15
МСельПром1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
НастюшаЗК1	19.06.2009	14,50	358		5	299,47	98,50	95,40	0,238	8,11	-4,12	20,87		0,95
Нордтекс-1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
НутрИнв1об	10.03.2009	11,00	166		11	0,57	94,50	94,50	0,482	15,97	34,47	26,37		0,45
ОбКондФ-01	20.05.2009	7,70	1238	510	0	0,00	70,50	70,50	0,759	-	0,00	-	39,74	1,36
ОбКондФ-02	22.04.2009	10,40	1574	118	0	0,00	95,11	95,11	1,824	-	-2,04	-	26,33	0,33
ОГО-агро-2	25.02.2009	12,95	62		22	0,56	51,50	48,23	4,293	-3,76	6,52	604,93		0,17
ОГО-агро-3	02.01.2009	15,00	561	190	0	0,00	32,40	35,09	7,151	-	-19,91	-	898,66	0,44
ОХЗ-Инв 01	18.02.2009	14,50	328		0	0,00	80,00	80,00	1,430	-	-	43,69		0,98
ПАВА 02 об	03.02.2009	12,50	1030	130	1	0,23	79,10	79,10	1,712	-7,70	8,09	-	118,89	0,35
Парнас-М 2	19.02.2009	10,80	1057	329	0	0,00	31,95	36,45	1,036	-	-	-	318,61	0,91
ПИВДОМ 01	23.04.2009	16,00	483	301	0	0,00	99,98	99,98	2,762	-	-	-	16,57	0,94
РазгуляйФ2	31.03.2009	12,00	1006	96	0	0,00	100,00	100,00	2,827	-	14,96	-	11,67	0,27
РазгуляйФ3	20.03.2009	10,99	1177	85	4	0,69	84,00	83,85	2,921	0,37	2,72	-	91,69	0,23
РазгуляйФ4	27.05.2009	11,70	1609	153	1	0,07	73,00	73,00	0,930	-	-1,00	-	102,95	0,42
РЕСТОРАНС3	29.05.2009	12,00	701	155	3	0,55	60,00	60,00	0,888	-14,92	-16,50	-	174,41	0,42
РосТ-Лайн1	08.01.2009	14,50	560	196	1	0,43	79,00	79,00	6,674	-	7,19	-	78,31	0,50
РубПлсРег1	02.06.2009	20,00	523		0	0,00	95,00	95,00	1,260	-	0,00	25,67		1,34
РусМасла-2	02.04.2009	15,00	1190	462	6	30,72	22,10	25,73	3,452	-15,06	-24,54	-	311,89	1,04
РусМоре-01	19.03.2009	12,70	1267	175	0	0,00	75,00	75,00	0,244	-	-	-	108,28	0,47
РусТекс 2	05.03.2009	12,75	70		2	0,01	38,00	38,00	3,913	0,50	5,07	801,75		0,19
РусТекс 3	21.04.2009	14,50	299		1	10,11	47,99	47,99	2,582	12,98	7,99	185,48		0,77
СанвэйГ 01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
СанИнтБрю2	12.02.2009	8,00	231		0	0,00	85,00	87,41	2,915	-	-1,26	33,68		0,61
СахарКо 01	12.05.2009	14,00	320		1	0,00	45,00	45,00	1,688	-	-	190,33		0,83
Синергия-1	22.04.2009	12,50	118		0	0,00	84,81	84,80	2,192	-	0,00	67,57		0,33
Синергия-2	22.01.2009	10,70	574	28	0	0,00	95,00	95,00	4,515	-	9,50	-	76,24	0,08
СодружФ-1	23.04.2009	10,45	301		1	3,19	62,00	62,00	1,804	1,73	-16,00	99,04		0,79
СОРУС КАП1	05.02.2009	16,00	315		0	0,00	12,98	12,98	2,148	-	0,00	1266,63		0,71
СОРУС КАП2	08.01.2009	13,00	1197	105	0	0,00	37,68	37,68	2,742	-	-	-	3252,00	0,35
ТалостоФ-1	06.03.2009	10,00	71		4	1,51	60,00	60,01	3,041	3,49	11,86	341,92		0,19
Черемушки	02.03.2009	13,30	67		0	0,00	95,00	95,00	4,190	-	0,00	38,05		0,21
Черкизово1	02.06.2009	8,85	887	159	0	0,00	87,50	87,50	0,558	-	0,00	-	42,64	0,46
Эрконпрод1	12.03.2009	17,00	259	77	1	4,98	96,65	96,65	4,890	-	5,15	-	32,38	0,21
ЭФКО-02 об	23.01.2009	12,00	393	29	0	0,00	98,00	98,00	5,030	-	-0,90	-	36,09	0,08
Югтранзит2	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Юнимилк 01	10.03.2009	9,75	985	257	0	0,00	66,50	64,30	2,858	-	6,63	-	96,69	0,68
Потребительские товары, розничная торговля														
7Контин-02	18.06.2009	7,80	1267	175	2	1,90	72,14	72,14	0,150	0,19	-1,00	-	91,17	0,48
АвтомирФ-1	03.03.2009	1,00	250		0	0,00	100,00	100,00	0,312	-	-	1,00		1,68
АвтомирФ-2	24.06.2009	0,10	545	181	4	624,74	99,00	99,00	0,000	-	0,00	-	2,14	0,50
АЛПИ-Инв-1	20.02.2009	18,00	239		26	0,41	0,06	0,02	6,164	-0,02	-0,18	31276,53		0,36
Алькор-01	09.06.2009	9,55	348		0	0,00	95,89	95,89	0,419	-	0,00	14,68		0,96
Апт36и6 об	30.12.2008	9,89	187		0	0,00	54,01	59,96	4,796	-	6,50	197,11		0,48
Атлант-М 1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
БАНАНА-М-1	24.04.2009	12,00	302	120	5	0,00	1,03	1,03	2,038	-0,26	-1,48	-	10203,26	0,33
БАНАНА-М-2	12.02.2009	11,50	595	49	9	1,27	2,77	2,80	4,190	0,02	-1,09	-	10571,34	0,13
Бахетле-1	20.05.2009	16,00	510	146	0	0,00	99,93	99,93	1,578	-	-	-	15,93	0,42
БразерсК 1	20.03.2009	15,00	365		0	0,00	90,00	90,00	0,247	-	0,00	29,56		0,94
Веха-Инв-1	03.03.2009	14,00	432	68	0	0,00	56,00	56,00	4,373	-	-4,00	-	476,45	0,19
Виват-фин1	21.04.2009	12,10	481		0	0,00	95,00	95,00	2,155	-	0,00	-		0,00
ВикторияФ	29.01.2009	10,40	35		25	19,63	92,80	89,29	4,188	1,23	1,29	130,62		0,10
ВикторияФ2	17.02.2009	10,89	418		4	17,71	44,10	42,78	3,819	1,13	1,78	139,69		1,01
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	721	175	2	2,22	70,00	73,07	0,230	0,07	1,17	-	106,18	0,48
ГорСупер-1	20.01.2009	11,50	208		0	0,00	100,04	100,04	2,048	-	-	11,94		0,88
ДиксиФин-1	19.03.2009	9,25	812		1	0,00	53,99	53,99	2,484	-	3,99	48,18		1,91
Домоцентр1	08.01.2009	11,50	560	14	0	0,00	74,00	74,00	5,293	-	9,00	-	869,38	0,05
Европа-01	16.04.2009	11,00	658		0	0,00	95,00	95,00	2,110	-	-	14,47		1,82
ЕВРОПА-01	16.04.2009	11,00	658		0	0,00	95,00	95,00	2,110	-	-	14,47		1,82
Евросеть-2	02.06.2009	0,00	159		2	0,14	71,07	71,09	0,000	7,76	1,08	93,35		0,44
ИКС5Фин 01	06.01.2009	7,60	2014	558	9	33,07	80,00	79,75	3,540	6,00	8,98	-	25,42	1,40

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв цены день	Изм срвзв цены неделя	Доходность по срвзв цене,% год погашение	Доходность по срвзв цене,% год оферта	Дюрация лет день
ИнкомЛада2	13.02.2009	12,50	414	50	31	0,11	4,31	4,42	1,404	-	-5,10	-	12443,73	0,14
ИнкомЛада3	13.03.2009	11,00	897	169	0	0,00	1,26	1,26	0,392	-	-2,60	-	########	0,41
Карус.Ф 01	19.03.2009	12,00	1722		0	0,00	106,10	106,10	3,222	-	0,00	10,60		3,68
КОПЕЙКА 02	18.02.2009	8,70	1147	55	11	5,94	95,00	95,02	0,858	0,40	0,02	-	43,69	0,15
КОПЕЙКА 03	18.02.2009	9,80	1147	237	0	0,00	95,00	95,00	0,967	-	0,00	12,24	26,48	0,63
КОРА УК 01	13.01.2009	11,00	201		0	0,00	99,99	99,99	2,170	-	-	11,46		0,77
Лаверна 01	09.04.2009	16,00	469		0	0,00	100,00	100,00	3,375	-	-	-		0,00
МагнитФ 01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
МагнитФ 02	27.03.2009	8,20	1184	456	1	0,00	55,10	55,10	2,022	0,00	0,08	33,54	77,23	2,68
Магнолия-1	22.01.2009	15,00	574	28	0	0,00	97,49	97,66	2,589	-	0,66	-	47,69	0,09
МартаФин 2	06.06.2009	12,00	346		0	0,00	96,31	96,31	0,625	-	-	16,23		1,05
МартаФин 3	31.01.2009	15,50	950		5	0,02	0,05	0,05	6,158	-	-0,30	4295,80		0,19
МатрицаФ-1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
МвидеоФ-01	20.05.2009	12,00	328		0	0,00	100,10	100,10	1,233	-	-	-		0,00
МонеткаФ-1	14.05.2009	12,50	140		0	0,00	67,00	67,00	1,438	-	0,00	143,16		0,39
МОСМАРТФ 1	16.04.2009	17,00	1204	294	0	0,00	75,00	75,00	3,260	-	-	-	69,12	0,85
НатурПрод2	16.06.2009	14,50	173		1	0,00	63,00	63,00	0,358	-	12,98	146,09		0,47
НТС-01	28.04.2009	15,00	852	124	0	0,00	23,00	23,00	2,384	-	-2,00	-	951,98	0,35
Орхидея 01	08.01.2009	13,00	105		0	0,00	31,20	34,24	2,742	-	-2,87	4248,61		0,27
Патэрсон 1	19.03.2009	12,50	357		1	0,42	56,00	56,00	0,240	-36,90	-33,00	111,19		0,92
ПРОВИАНТ-1														
ПротекФин1	06.05.2009	8,90	1042	314	0	0,00	80,00	70,10	1,219	-	0,00	-	41,86	0,88
ПятерочкаФ	13.05.2009	11,45	503		0	0,00	109,30	109,30	1,349	-	-	7,88		2,49
ПятерочФ 2	16.06.2009	9,30	719		0	0,00	103,70	103,70	0,229	-	-	8,15		2,88
САМОХВАЛ-1	22.04.2009	14,50	300		2	1,81	57,93	57,92	2,542	-	-1,98	125,78		0,78
СпартакТД2	24.03.2009	16,00	817	271	1	0,04	100,00	100,00	4,077	0,00	0,03	-	16,52	0,71
СпортМ-Ф-1	22.05.2009	17,00	512	148	0	0,00	99,90	99,90	1,584	-	-	-	16,99	0,50
ТехИнвст-1	28.05.2009	12,50	882	154	0	0,00	98,65	98,65	0,959	-	-	-	15,76	0,68
Топкнига-1	05.02.2009	0,00	42		0	0,00	90,10	90,10	0,000	-	-2,90	83,55		0,13
Топкнига-2	11.06.2009	20,00	714		4	0,00	95,00	86,40	0,767	-	40,65	31,81		1,68
УНИКУМ-Ф 1	16.06.2009	18,00	355		12	110,59	99,00	99,00	0,444	-	-	-		0,00
ХолидФин1	02.04.2009	13,00	462		0	0,00	94,68	94,68	2,992	-	-	18,01		1,37
Строительство, стройматериалы														
АдаманФ2об	19.02.2009	16,00	511	147	0	0,00	100,00	100,00	1,534	-	0,00	-	16,93	0,45
Востокцем1	21.05.2009	11,00	329		0	0,00	86,00	86,00	1,055	-	-	31,90		0,88
ДКС ФЖС-1	26.05.2009	12,00	334		0	0,00	99,95	99,93	0,986	-	-	12,40		1,33
Железобет1	20.02.2009	14,00	883	148	0	0,00	84,90	84,74	1,304	-	8,19	-	72,32	0,40
ЖК-Финанс1	19.03.2009	20,00	364		0	0,00	70,00	70,00	0,384	-	-28,05	80,01		0,90
ИнкомФин01	28.03.2009	13,50	93		6	0,77	27,90	24,91	3,330	1,61	4,91	1091,36		0,25
Искитим-02	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
КамскДол 3	06.03.2009	14,10	161		3	0,09	35,00	35,49	0,734	-4,51	-36,51	1139,18		0,43
КосмосФин1	18.06.2009	13,50	903	175	1	5,01	100,00	100,00	0,259	-	10,00	-	13,47	0,48
ЛСР-Инв 01	02.06.2009	10,70	348		0	0,00	100,00	100,00	0,674	-	50,00	10,97		0,91
ЛСР-Инв 02	15.01.2009	8,35	931	203	0	0,00	70,00	79,23	3,683	-	4,50	-	106,00	0,54
ЛСР 02 обл	05.02.2009	13,25	1680	406	1	0,00	67,00	67,00	5,082	18,50	17,00	-	65,21	0,99
Метрострой	27.03.2009	11,70	1002	92	4	0,16	92,00	92,00	2,885	2,28	9,00	-	45,78	0,25
МИАН-Дев-1	03.03.2009	13,00	432	68	0	0,00	70,00	70,00	4,060	-	-	-	234,98	0,25
М-ИНДУСТР	17.02.2009	12,25	964		11	64,89	10,80	9,65	4,296	1,98	1,15	258,23		1,13
МинплитаФ1	24.04.2009	16,00	848	302	3	1,42	54,00	53,99	2,718	0,99	20,99	-	148,73	0,78
Миракс 02	19.03.2009	10,99	266		11	0,60	39,95	34,94	2,951	-5,29	-6,20	371,74		0,68
МИЭЛЬ-Ф 01	13.01.2009	16,50	565	201	0	0,00	89,00	89,00	7,368	-	0,00	-	44,71	0,57
ММ-Фин 02	06.01.2009	16,50	1286	194	0	0,00	80,00	80,00	7,685	-	-	-	78,20	0,62
МОИА 01	21.06.2009	9,00	726		0	0,00	78,20	78,10	0,123	-	0,00	28,61		1,39
МОИА 02	08.03.2009	7,99	986		0	0,00	82,00	81,95	2,408	-	-	18,47		2,10
МОИТК-01	27.03.2009	9,00	275		4	0,95	37,88	37,87	2,220	6,29	9,87	297,90		0,71
МОРЕ-П 01	03.02.2009	15,50	586	222	0	0,00	77,50	76,50	6,030	-	0,00	-	76,45	0,62
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	321		0	0,00	99,98	99,43	1,708	-	0,43	15,73		0,85
РУБИН-01	14.04.2009	12,00	292		0	0,00	99,06	99,02	2,367	-	-	13,70		0,78
Сенат.УК-1	22.05.2009	15,25	1240	148	0	0,00	57,50	57,50	1,421	-	4,47	-	203,77	0,41
СибАкИнв-1	30.01.2009	12,30	582	36	3	3,74	80,01	80,01	4,920	-3,92	-12,98	-	253,12	0,10
СибакСтр01	12.05.2009	14,50	138		0	0,00	70,00	70,00	1,748	-	4,99	129,37		0,38
СпецСтр2 1	21.05.2009	19,00	511		0	0,00	99,00	99,00	1,822	-	-	-		0,00
СтрТрГаз02	16.01.2009	8,49	1296		2	0,00	47,01	51,01	3,722	-3,99	-4,50	35,53		2,74
СтрТрГаз03	16.04.2009	11,25	1568	112	17	261,56	93,21	93,97	2,158	0,25	2,59	-	35,00	0,31
СУ-155 3об	18.02.2009	13,00	1147	55	39	6,25	85,00	85,52	4,523	3,06	12,90	-	125,72	0,15
СуварКаз-1	31.03.2009	15,25	96		0	0,00	96,99	96,99	3,593	-	0,10	26,23		0,27
СэтлГрупп1	19.05.2009	11,70	1237	145	2	0,03	51,99	50,04	1,186	-0,10	-4,23	43,67	258,74	0,40
Терна-Ф 01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Терна-Ф 02	08.05.2009	12,00	1044		0	0,00	97,78	97,77	1,578	-	0,00	-		0,00
ТехНикольФ	12.03.2009	9,70	1168	259	3	0,77	62,43	61,34	2,790	-0,53	8,98	-	114,01	0,68
ТНИКОЛЬ-Ф1	13.05.2009	15,10	321	141	0	0,00	99,95	99,95	1,779	-	-	-	15,45	0,00
ЦУН 02 обл	21.01.2009	11,75	391		0	0,00	97,50	95,79	4,990	-	-	16,50		1,06

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв цены день	Изм срвзв цены неделя	Доходность по срвзв цене,% год погашение	Доходность по срвзв цене,% год оферта	Дюрация лет день
Телекоммуникации														
АрктелИ 01	16.01.2009	12,00	204		0	0,00	99,80	99,80	5,260	-	-	12,58		0,85
АрктелИ 02	13.04.2009	13,75	1201	473	0	0,00	100,03	100,03	2,750	-	-	-	14,15	1,40
ВлгТлкВТ-2	02.06.2009	13,00	705		0	0,00	99,70	99,70	0,819	-	4,20	-		0,00
ВлгТлкВТ-3	02.06.2009	8,50	705		1	0,35	85,75	85,75	0,535	-8,26	-7,26	24,67		1,09
ВлгТлкВТ-4	10.03.2009	7,99	1713	257	1	0,96	96,00	96,00	0,350	-0,03	0,70	-	14,81	0,69
ДальСвз2об	03.06.2009	8,85	1252	524	0	0,00	91,10	87,30	0,533	-	-6,70	-	17,08	1,30
ДальСвз3об	03.06.2009	8,60	160		0	0,00	86,01	93,00	0,520	-	-3,01	26,07		0,44
МГТС-04 об	22.04.2009	7,10	118		0	0,00	98,00	98,00	1,245	-	7,85	13,34		0,33
МГТС-05 об	26.05.2009	7,10	516	152	0	0,00	99,01	99,01	0,583	-	-	-	89,89	0,85
МТС 03	23.06.2009	8,70	3456	544	4	231,57	82,00	82,17	0,048	-17,61	-5,92	-	25,14	1,42
РАДИОНЕТ-2	25.03.2009	16,50	818	272	1	0,01	70,00	70,00	4,159	-	-	-	89,80	0,70
СЗТелек3об	26.02.2009	8,60	791		2	0,36	85,00	90,50	0,660	1,85	5,00	15,88		1,58
СЗТелек4об	12.03.2009	8,10	1078		0	0,00	79,00	79,00	0,311	-	0,00	21,98		1,94
СЗТелек5об	24.02.2009	15,00	1608	516	4	1,95	93,99	92,56	1,233	-0,21	2,06	-	-	0,00
СибТлк-6об	19.03.2009	9,75	630		0	0,00	79,40	82,47	2,618	-	-	23,74		1,58
СибТлк-7об	20.05.2009	8,65	146		3	60,36	98,10	98,10	0,853	-0,60	1,36	13,54		0,40
Синтерра 1	05.02.2009	11,00	1680	224	3	0,63	87,00	87,01	4,219	-3,31	-0,99	-	39,64	0,58
Система-01	12.03.2009	9,45	1533	77	5	22,29	98,60	98,78	2,718	-0,12	0,48	-	15,88	0,21
СМАРТС 03	31.03.2009	14,10	278		11	0,46	90,00	89,82	3,322	10,95	14,82	32,05		0,73
УрСИ сер06	21.05.2009	13,00	1057	329	0	0,00	100,00	100,00	1,247	-	-	-	36,53	0,96
УрСИ сер07	17.03.2009	8,40	1174	82	3	2,37	99,21	99,21	2,301	-0,29	-0,12	-	11,74	0,22
УрСИ сер08	08.04.2009	9,60	1560	468	0	0,00	86,00	86,00	2,052	-	-9,01	-	24,03	1,21
ЦентрТел-4	19.02.2009	13,80	239		13	6,84	99,40	99,40	4,802	0,34	3,38	15,25		0,62
ЦентрТел-5	03.03.2009	9,30	978		0	0,00	89,00	89,03	2,905	-	-	16,02		1,94
ЦНТ-03 обл	31.12.2008	9,75	97		0	0,00	99,00	99,00	2,271	-	0,38	14,22		0,27
ЮТК-03 об.	10.04.2009	8,50	289		21	1,87	91,00	91,48	1,793	0,73	0,84	21,34		0,77
ЮТК-04 об.	11.03.2009	10,00	349		2	1,18	92,50	92,50	0,410	-0,25	0,12	23,68		0,68
ЮТК-05 об.	03.06.2009	7,55	1252	524	2	15,22	84,90	84,89	0,455	-	0,07	-	21,19	1,38
Транспорт														
ДВТГ-Ф 01	03.02.2009	10,75	586	40	3	0,00	75,00	62,34	4,182	-9,03	-22,66	-	301,68	0,11
ДВТГ-Ф 02														
КДавиаФин1	22.04.2009	18,00	482	118	3	0,84	24,03	23,90	3,156	-	6,40	-	930,59	0,32
РЖД-03обл	03.06.2009	8,33	342		0	0,00	97,00	96,99	0,502	-	1,34	12,12		0,93
РЖД-05обл	22.01.2009	6,67	28		15	151,59	99,97	99,94	2,814	0,03	0,07	7,26		0,08
РЖД-06обл	13.05.2009	7,35	685		0	0,00	93,40	93,43	0,866	-	3,53	11,64		1,77
РЖД-07обл	13.05.2009	7,55	1413		1	0,00	100,00	100,00	0,889	5,50	11,05	7,69		3,40
Сибирь-01	20.01.2009	10,70	1300	26	22	5,20	48,00	45,13	4,573	4,10	0,14	-	1408,89	0,07
ТрансаэроФ	05.02.2009	10,66	42		25	4,86	93,60	93,84	4,089	-0,67	-1,63	65,55		0,12
ТрансКонт1	03.03.2009	9,50	1524	68	5	4,05	98,30	98,33	2,967	-0,03	0,34	-	18,39	0,19
Усть-Луга1	12.02.2009	9,90	413		1	4,26	83,99	83,99	1,139	32,98	4,38	29,54		1,07
ЭйрЮнион01	10.02.2009	11,00	320		12	0,01	0,89	0,83	1,326	-0,05	-0,47	#########		0,13
ЮТэйр-Ф 03	16.06.2009	16,00	719	355	2	0,60	90,50	90,50	0,395	-9,00	-3,55	-	29,71	0,93
Финансовый сектор														
АВТОВАЗБ-1	02.01.2009	13,70	463	190	0	0,00	87,00	84,15	3,115	-	-3,84	-	50,23	0,50
АИЖК 1об	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
АИЖК 2об	01.02.2009	11,00	403		0	0,00	96,00	96,25	4,400	-	0,77	15,31		1,03
АИЖК 3об	15.01.2009	9,40	659		4	19,12	89,00	89,00	1,829	-	-4,52	22,46		1,01
АИЖК 4об	01.02.2009	8,70	1133		1	12,53	94,50	94,50	1,287	-	-0,50	11,25		2,71
АИЖК 5об	15.01.2009	7,35	1390		3	38,48	70,00	70,00	1,430	0,01	0,00	21,65		2,78
АИЖК 6об	15.01.2009	7,40	2028		1	6,56	64,12	64,12	1,439	0,12	0,14	21,23		3,49
АИЖК 7об	15.01.2009	7,68	2759		3	6,05	59,00	59,00	1,494	1,46	-1,23	21,19		4,19
АИЖК 8об	15.03.2009	7,63	3459	1906	2	0,62	67,99	61,42	0,209	-6,98	-6,88	21,15	19,58	3,88
АИЖК 9об	15.02.2009	7,49	2974	2243	10	39,37	59,00	58,88	0,821	-	2,56	21,12	22,00	4,17
АИЖК 10об	15.02.2009	8,05	3612		10	50,52	57,99	57,75	0,882	-0,25	0,09	20,35		4,75
АК БАРС-02	22.01.2009	8,00	28		2	0,03	100,00	100,00	3,375	-	0,80	7,74		0,08
АКИБАНК-1	23.04.2009	14,00	119		0	0,00	99,80	99,96	2,416	-	-	14,09		0,50
АльянсФин1	24.06.2009	8,76	1273	545	0	0,00	99,93	99,92	0,024	-	-	-	9,00	1,43
БалтИнвБ-1	27.01.2009	13,50	852	124	3	32,86	80,00	80,00	2,145	4,99	2,72	-	120,54	0,33
БанкСОЮ302	05.04.2009	8,37	284		2	0,10	100,99	100,99	1,880	0,04	-	7,14		0,76
БанкСОЮ303	27.04.2009	10,10	858	123	10	0,68	90,00	77,97	1,633	-	-	-	43,40	0,34
БПФ-01	12.02.2009	11,50	49		1	0,00	94,90	94,90	1,323	0,90	-3,99	51,43		0,13
ВБРР Обл.	08.01.2009	10,00	290		0	0,00	100,50	100,25	2,137	-	-	10,04		0,82
ВТБ - 4 об	19.03.2009	8,80	84		11	4,81	99,70	99,70	2,363	0,07	0,11	9,90		0,23
ВТБ - 5 об	22.01.2009	8,60	1757	119	24	133,04	98,80	98,77	1,484	-0,05	0,32	-	12,98	0,32
ВТБ - 6 об	14.01.2009	8,60	2750	202	5	435,94	97,65	97,66	1,673	0,05	0,32	-	13,71	0,54
ВТБ24 01	08.04.2009	9,75	1014	286	0	0,00	96,00	98,17	2,084	-	3,67	-	15,88	0,76
ВТБ24 02	10.02.2009	7,70	1503	47	0	0,00	99,91	99,91	2,848	-	0,00	-	8,17	0,18
ВТБ24 03	03.06.2009	8,18	1616	160	12	7,30	98,25	98,05	0,493	-0,14	0,05	-	12,33	0,44
Газбанк 01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
ГазпромБ 1	29.01.2009	7,10	763		3	13,27	85,60	85,62	2,859	-0,39	0,09	15,99		1,91
ГазпромБ 2	27.05.2009	6,54	1791		0	0,00	99,97	99,97	0,520	-	-	-		0,00
ГЛОБЭКС 01	10.03.2009	10,00	445	75	2	4,88	94,80	94,80	2,849	-0,20	-3,50	14,57	36,57	0,21
ДельтаКр-1	02.06.2009	7,09	341		2	7,74	96,00	95,94	0,447	-	-	12,13		0,92
ЕврокомФК1	19.06.2009	16,00	358		1	0,00	10,00	10,00	0,263	-3,70	-25,00	1313,28		0,87
ЕврокомФК3	19.06.2009	16,00	540		0	0,00	37,99	37,99	0,263	-	-9,97	139,19		1,30
Европлан-1	12.02.2009	14,50	959	595	2	3,84	49,75	49,61	5,284	-0,27	-1,46	-	128,80	1,09
ЖилФин об1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Зенит 2обл	16.02.2009	8,39	53		21	6,09	99,50	99,31	2,988	-0,17	0,31	12,84		0,15
Зенит 3обл	13.05.2009	9,90	1049	139	9	0,79	97,99	97,99	1,166	0,93	2,48	-	15,31	0,38
Зенит 4обл	05.04.2009	12,50	467	99	0	0,00	100,00	100,00	2,808	-	-	-	12,16	0,35
Зенит 5обл	09.06.2009	10,00	1622	348	12	90,91	89,00	90,98	0,438	0,73	0,29	-	24,90	0,93
КБРенКап-1	03.03.2009	14,50	432		4	0,14	50,00	49,99	4,529	-	7,21	112,57		1,03
КБРенКап-2	14.04.2009	11,66	1196	110	10	6,34	82,00	80,70	2,268	3,93	2,59	-	84,71	0,30
Кедр-02	17.03.2009	12,30	264		5	5,86	89,99	89,26	0,303	4,26	-4,87	32,68		0,70
Кедр-03	23.01.2009	12,80	939	222	0	0,00	100,00	100,13	2,174	-	-	-	13,42	0,81
КИТФинБанк	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
КМБ-Банк2	03.06.2009	15,00	1070	342	0	0,00	95,00	95,00	0,904	-	0,00	-	22,22	0,92

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв цены день	Изм срвзв цены неделя	Доходность по срвзв цене,% год погашение	Доходность по срвзв цене,% год оферта	Дюрация, лет день
КрайИнвБ-1	06.02.2009	12,30	953	225	0	0,00	100,00	100,00	4,684	-	0,00	-	12,62	0,64
КрЕврБ-02	30.12.2008	9,00	915	369	0	0,00	100,00	100,00	4,537	-	-	-	9,20	0,95
МастерБ-3	03.06.2009	13,75	1070	160	0	0,00	99,00	98,95	0,829	-	-	-	16,06	0,50
МБРР 02обл	01.01.2009	11,50	1554	98	0	0,00	98,00	98,00	2,647	-	0,78	-	20,74	0,27
МБРР 03обл	27.01.2009	10,00	1580	124	0	0,00	97,30	97,30	1,589	-	3,71	-	19,64	0,34
МДМ-Банк03	02.04.2009	12,00	280		0	0,00	99,70	99,70	2,762	-	-0,44	12,74		0,74
МЗБанк1	18.05.2009	11,65	327		0	0,00	98,03	98,02	1,245	-	-	14,13		0,99
МИА-3об	26.02.2009	7,95	1155	63	0	0,00	101,00	101,00	0,610	-	2,01	-	2,12	0,18
МИА-5об	22.01.2009	10,30	2030	210	3	0,54	87,50	87,52	1,778	2,86	1,66	-	40,12	0,55
МКБ 02обл	04.06.2009	11,50	161		2	0,05	88,05	88,03	0,662	1,52	0,29	43,56		0,44
МКБ 03обл	17.06.2009	15,00	538	174	0	0,00	100,00	100,00	0,329	-	0,00	15,56	14,95	0,50
МКБ 04обл	17.03.2009	11,50	810	82	7	0,80	95,50	93,96	3,151	0,36	3,46	-	31,96	0,22
МОИА 01	21.06.2009	9,00	726		0	0,00	78,20	78,10	0,123	-	0,00	28,61		1,39
МОИА 02	08.03.2009	7,99	986		0	0,00	82,00	81,95	2,408	-	-	18,47		2,10
МоскомцБ	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
МоскомцБ-2	17.02.2009	12,50	782	54	0	0,00	100,00	99,98	4,384	-	-	-	11,97	0,00
НацКап-01	31.03.2009	11,50	1370	96	0	0,00	100,00	100,00	2,710	-	-	-	11,19	0,34
НОМОС 7в	16.06.2009	9,25	173		12	7,36	97,00	96,68	0,228	0,14	1,69	16,77		0,47
НОМОС-Лиз1	09.01.2009	12,00	925		0	0,00	97,82	97,81	5,490	-	-	13,46		2,14
НС-фин. 01	23.05.2009	12,75	881	149	1	0,00	102,00	102,00	1,188	-	2,01	-	7,61	0,41
НФК-2	09.02.2009	1,00	138		0	0,00	94,20	94,20	0,126	-	-	14,03		0,49
НФК-3	28.04.2009	13,00	859	124	1	0,90	88,00	88,00	2,066	0,00	2,50	-	53,65	0,34
Открытие01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
ПРББ-5	29.04.2009	8,69	125		0	0,00	94,00	94,05	1,357	-	-0,05	27,18		0,35
Промсвб-05	21.05.2009	7,99	1239	147	2	131,09	96,80	96,80	0,766	0,20	1,10	-	16,33	0,40
ПЧРБ-Фин1	11.03.2009	12,50	804	76	0	0,00	92,00	92,00	0,514	-	0,00	-	55,04	0,23
РИАТО-01	09.03.2009	13,75	1621		0	0,00	99,90	99,85	0,640	-	0,00	14,53		3,23
РИГрупп 02	21.01.2009	15,00	940	210	0	0,00	100,00	99,97	6,370	-	-	-	15,49	0,64
РМБ	27.04.2009	12,00	123		0	0,00	98,90	98,84	1,973	-	0,00	15,13		0,36
РОСБАНК-1	15.02.2009	7,70	52		0	0,00	99,52	99,52	2,764	-	0,42	10,77		0,15
РосселхБ 2	18.02.2009	7,85	783		2	1,91	90,00	90,00	0,774	1,00	3,00	13,96		1,97
РосселхБ 3	19.02.2009	7,34	2968	420	11	9,84	94,00	93,98	2,534	-	1,68	-	13,53	1,10
РосселхБ 4	08.04.2009	9,75	3198	286	0	0,00	100,00	99,99	2,084	-	-	-	9,95	0,84
РосселхБ 6	20.02.2009	8,75	3333	57	8	52,68	99,75	99,64	2,997	0,03	0,02	-	10,07	0,16
РосселхБ 7	16.06.2009	8,30	3449	173	0	0,00	98,25	98,18	0,205	-	0,18	-	12,18	0,48
РТК-ЛИЗ 5с	12.02.2009	8,35	595		0	0,00	88,88	88,88	3,043	-	0,13	21,06		1,02
РусСтанд-5	12.03.2009	13,00	623	259	2	1,04	75,00	74,98	3,740	1,25	5,17	-	70,41	0,67
РусСтанд-6	11.02.2009	8,15	776	48	21	22,93	95,50	95,62	2,992	-0,48	2,16	-	43,02	0,13
РусСтанд-7	24.03.2009	12,20	999	89	1	0,00	96,95	96,95	3,108	4,45	7,44	-	24,69	0,24
РусСтанд-8	17.04.2009	15,00	1205		0	0,00	50,00	50,00	2,836	-	-15,00	-		0,00
Русфинанс1	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Русфинанс2	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
Русфинанс3	13.05.2009	7,55	139		15	102,28	95,32	95,34	0,889	0,33	4,04	20,56		0,38
Русфинанс4	13.02.2009	7,74	414		0	0,00	75,00	74,67	2,799	-	-5,37	40,32		1,07
РусьБанк-1	19.03.2009	10,00	84		1	0,47	95,00	95,00	2,685	0,79	5,42	32,48		0,23
РусьБанк-2	21.02.2009	12,50	424	241	0	0,00	85,00	85,00	4,281	-	-	-	44,42	0,63
СвязьБанк1	22.01.2009	8,90	847	119	13	1,72	90,00	89,91	1,536	0,42	0,76	-	50,91	0,32
СевКазна-1	01.01.2009	9,75	280		0	0,00	100,18	100,18	2,244	-	-	9,39		0,81
СевКазна-2	27.01.2009	12,50	949	215	3	0,00	79,99	87,33	1,986	7,29	9,33	-	66,45	0,56
СКБ-банк 1	19.03.2009	12,80	546	175	9	8,75	80,00	80,22	0,242	-2,31	-0,88	-	81,88	0,47
Солидарн-1	03.03.2009	12,50	341		0	0,00	100,00	100,00	0,788	-	21,10	13,09		0,90
Солидарн-2	20.01.2009	14,00	481	117	6	119,78	100,00	88,64	2,493	-6,37	-0,96	-	14,71	0,31
СоцГорБ-01	24.03.2009	13,00	91		0	0,00	98,00	98,00	3,277	-	16,00	20,18		0,26
СтрКредит1	27.01.2009	13,25	949	215	1	0,00	95,00	95,00	5,409	8,00	-	-	23,98	0,56
СудострБ-1	01.01.2009	9,85	189		0	0,00	85,00	84,99	4,723	-	-4,01	50,20		0,50
ТатфондБ 3	17.02.2009	11,75	145		6	1,09	91,00	88,06	1,188	-5,99	-0,92	54,91		0,39
ТатфондБ 4	03.06.2009	11,40	888	342	0	0,00	89,99	89,99	0,685	-	4,40	-	25,34	0,91
ТрансКред3	08.01.2009	9,99	924	378	0	0,00	90,00	94,86	4,598	-	1,40	-	22,36	0,97
ТурАлемФ 1	07.04.2009	7,75	285		0	0,00	100,00	100,13	1,677	-	-	7,84		2,38
УБРиР-ф 02	01.01.2009	12,50	189		0	0,00	72,00	72,00	2,877	-	2,11	114,18		0,49
УралЛЦ-01	22.04.2009	10,00	307		0	0,00	96,15	96,22	1,753	-	-	15,05		0,89
УралсибЛК1	24.06.2009	11,60	734	181	12	3,18	76,05	76,69	0,032	-0,48	-0,28	-	78,73	0,50
УралсибЛК2	22.01.2009	12,99	938	392	0	0,00	53,03	52,81	5,481	-	-0,94	-	109,35	0,94
УРСАБанк 2	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
УРСАБанк 3	04.06.2009	9,60	161		6	2,06	96,00	95,52	0,552	0,16	1,71	20,57		0,44
УРСАБанк 5	21.04.2009	10,05	1027		2	0,01	55,50	55,50	1,790	0,93	3,04	39,99		2,33
УРСАБанк 7	22.01.2009	8,40	1302	392	1	0,27	82,00	82,00	3,544	1,43	7,82	-	31,16	1,01
УРСАБанк 8	16.04.2009	11,19	2296	112	0	0,00	97,00	95,50	2,146	-	0,00	-	21,15	0,31
ХКФ Банк-2	12.05.2009	9,25	502	138	2	0,30	94,80	94,81	1,115	6,24	3,06	-	23,98	0,38
ХКФ Банк-3	19.03.2009	13,00	630	84	4	499,86	97,00	98,67	0,249	-	4,67	-	26,77	0,23
ХКФ Банк-4	14.01.2009	13,00	1021	293	0	0,00	103,00	103,00	2,529	-	-	-	9,39	0,83
Центр-инв1	12.05.2009	16,00	321	167	0	0,00	97,83	97,70	1,973	-	0,00	19,70	19,82	0,48
Экспобанк1	24.03.2009	9,00	369	89	0	0,00	99,50	99,37	0,044	-	-	-	11,12	0,00
Юниаструм	17.02.2009	11,00	54		5	0,09	98,00	97,77	3,858	-	-1,23	25,65		0,15
ЮнКрБанк-2	11.02.2009	7,55	48		0	0,00	100,00	100,00	2,772	-	-	-		0,00
Химия, ЛПК														
АрнестФ-01	29.04.2009	11,00	125		0	0,00	98,80	98,80	1,929	-	-	13,76		0,44
АЦБК-Инв 3	15.01.2009	9,70	840	112	0	0,00	100,05	100,05	1,870	-	-	-	9,82	0,80
ВМУ-Фин 01	23.06.2009	0,00	362		43	247,99	94,90	94,90	0,088	-	0,00	-		0,00
ГОТЭК-2	18.06.2009	13,00	175		0	0,00	54,99	30,27	0,249	-	-29,74	517,02		0,48
КуйбАзот-2	06.03.2009	8,80	804		0	0,00	81,80	83,35	2,676	-	-1,25	19,17		1,97
Миннеско-1	11.06.2009	13,75	350		0	0,00	2,03	2,12	0,527	-	-2,88	7427,40		0,79
НИКОСХИМ 2	12.02.2009	11,25	238		11	0,20	21,00	20,97	1,295	-1,05	-9,01	1211,52		0,59
НИТОЛ 01	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
НИТОЛ 02	16.06.2009	11,75	355	82	6	21,84	39,00	42,01	0,290	-1,69	2,31	181,32	715,31	0,22
НКНХ-04 об	30.03.2009	9,99	1187	95	11	1,00	97,49	97,49	2,381	-0,01	-0,01	-	19,66	0,26
НЭФИС-02	17.06.2009	12,50	356	174	0	0,00	98,00	98,00	0,274	-	0,00	-	16,99	0,50
ПЕНОПЛЭКС1	18.06.2009	1,00	357		0	0,00	59,99	59,99	0,019	-	0,00	68,85		0,99
РЕТАЛ-1	10.06.2009	15,00	349		0	0,00	94,00	94,00	0,616	-	0,00	23,33		0,95
САНОС-02об	12.05.2009	10,00	320		0	0,00	94,00	91,00	1,205	-	-0,50	22,91		0,85
СЗЛК-Фин-1	03.03.2009	11,50	432		5	0,00	0,01	0,01	3,592	0,00	-0,10	-		0,00
СИБУРХолд1	07.05.2009	7,70	1407	315	1	0,00	100,00	100,00	1,034	-	-	-	7,83	0,84
Слвстекло2	29.04.2009	10,50	307		1	0,00	73,00	73,00	1,640	-	-	61,83		0,81
СНХЗ Фин 1	31.03.2009	12,00	278		1	0,00	75,00	75,00	2,827	12,00	9,00	64,40		0,73

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до погашения	Дней до оферты	Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена посл	Цена ср взв	НКД (%)	Изм срвзв цены день	Изм срвзв цены неделя	Доходность по срвзв цене,% год погашение	Доходность по срвзв цене,% год оферта	Дюрация лет день
Энергетика														
БашкирэнЗв	19.03.2009	8,30	804	84	0	0,00	97,00	97,00	0,136	-	-	-	21,97	0,23
ГенерКомп1	23.06.2009	9,25	908	180	0	0,00	94,20	94,20	0,051	-	0,00	-	22,29	0,51
ГидроОГК-1	31.12.2008	8,10	916		14	2,26	74,25	74,09	3,906	-0,31	1,72	23,31		2,17
ДГК-01	13.03.2009	10,50	1534	78	12	3,76	83,00	81,56	2,992	-1,44	-2,25	-	104,72	0,21
ЕЭСК-02	09.04.2009	8,74	1197	109	10	0,97	95,50	95,50	1,844	1,50	1,50	-	26,67	0,30
Кубаньэн-1	21.01.2009	7,85	573		0	0,00	102,90	102,95	3,334	-	0,00	4,37		0,84
Ленэнерг02	30.01.2009	8,54	1128		6	0,08	59,98	53,04	3,416	-	-6,97	37,28		2,49
Ленэнерго3	22.04.2009	8,02	1210		11	7,13	50,05	54,51	1,406	-1,28	-2,09	33,24		2,77
Мосэнерго1	17.03.2009	7,54	992	264	4	4,86	96,50	96,50	2,066	-0,50	-1,00	-	13,12	0,70
Мосэнерго2	26.02.2009	7,65	2611	1155	9	10,94	66,50	66,33	2,494	1,66	-13,67	-	24,48	2,69
МОЭСК-01	10.03.2009	8,05	985		0	0,00	77,00	77,00	2,360	-	2,00	20,28		2,38
ОГК-2 01об	01.01.2009	7,70	557		0	0,00	80,00	79,04	3,692	-	-1,38	26,69		1,39
ОГК-3 об-1	12.06.2009	8,20	1079		0	0,00	100,00	100,00	0,292	-	-	-		0,00
ОГК-5 об-1	02.04.2009	7,50	1008	280	5	6,10	94,20	94,20	1,726	-0,48	1,68	-	16,39	0,75
ОГК-6 01об	23.04.2009	7,55	1211	483	2	0,85	83,00	82,99	1,303	-	-0,01	-	24,49	1,26
ТГК-1 01	17.03.2009	7,75	1902	446	0	0,00	79,00	79,66	2,123	-	0,66	-	31,51	1,16
ТГК-2 1об	03.03.2009	10,95	950	250	0	0,00	100,00	100,00	3,420	-	-	-	11,20	0,66
ТГК-10 об1	18.06.2009	7,60	539	175	4	4,88	93,55	93,57	0,146	-0,33	-0,18	-	22,47	0,48
ТГК-4 об.1	04.06.2009	7,60	1253	161	2	0,47	94,70	94,75	0,437	3,11	-0,25	-	20,62	0,44
ТГК-6Инв-1	24.02.2009	10,00	1153	61	10	0,71	97,00	97,00	0,822	-	1,32	-	28,57	0,17
ТГК-8 01	14.05.2009	8,00	1232	140	0	0,00	94,00	92,75	0,921	-	-2,70	-	24,91	0,39
Тюменэнрг2	02.04.2009	7,70	1190	462	13	18,37	90,15	90,08	1,772	1,58	8,38	-	17,30	1,21
ФСК ЕЭС-02	23.06.2009	8,25	544		3	0,00	92,00	93,67	0,045	2,17	2,90	13,49		1,43
ФСК ЕЭС-03	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д	#Н/Д
ФСК ЕЭС-04	09.04.2009	7,30	1015		1	0,02	81,00	81,00	1,540	-1,23	-0,14	16,66		2,49
ФСК ЕЭС-05	02.06.2009	7,20	341		1	0,57	95,01	95,01	0,454	-0,40	0,01	13,45		0,92
ЭнергоСт-1	22.05.2009	14,75	876	330	0	0,00	100,00	100,00	1,374	-	-	-	15,24	0,00
ЭнергЦент1	08.01.2009	9,30	563	14	0	0,00	97,00	96,97	4,255	-	9,39	-	87,08	0,04
Якутскэн02	12.03.2009	8,59	1169	77	0	0,00	98,59	98,54	2,471	-	0,04	-	15,11	0,21
Прочие														
РКС-01	15.04.2009	1,00	111		0	0,00	102,90	102,95	0,195	-	0,00	-		0,00
АиФМПфин 1	17.06.2009	14,00	174		3	0,01	82,00	82,63	0,307	3,63	3,68	60,81		0,48
КАРО 01	23.06.2009	14,30	362	180	0	0,00	84,00	84,00	0,078	-	0,00	-	55,60	0,50
Интурист-1	22.04.2009	9,00	482		0	0,00	90,00	90,00	1,578	-	-1,13	18,56		1,26
ТАИФ-Фин01	12.03.2009	8,42	623		0	0,00	99,80	99,81	2,422	-	-	-		0,00
РБК ИС БО4	24.03.2009	12,25	89		29	0,90	40,00	41,52	9,229	4,77	-3,14	496,73		0,24

Источник: ММВБ, расчеты Банка ЗЕНИТ

Приложение 7. ОФБУ Банка ЗЕНИТ

Изменение стоимости пая

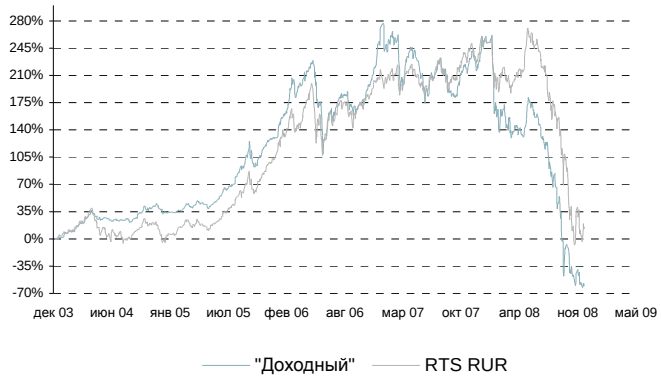
Фонд (ОФБУ)	Стратегия	С начала работы Фонда*	С начала года**	1 день	1 мес.	6 мес.**	1 год.**	Доля риска в цене, %	Коэффициент Шарпа **
Доходный	Агрессивная	-58,84%	-88,33%	3,72%	-0,77%	-84,47%	-87,18%	39,11	-0,48
Универсальный	Умеренная	9,70%	-32,46%	1,65%	3,73%	-32,44%	-30,96%	14,65	-0,34
Перспективный	Фонд производных инструментов	-90,13%	-89,71%	4,91%	-3,35%	-88,53%	-88,60%	27,71	-1,49
Валютный	Агрессивная	-59,80%	-70,28%	3,45%	17,96%	-69,91%	-68,84%	19,98	-1,49
Доходный II	Агрессивная	-89,04%	-91,67%	4,07%	-14,24%	-89,19%	-90,57%	30,11	-1,26
Вечные ценности	Индексный фонд золота и серебра	-5,73%	-16,04%	0,27%	10,03%	-20,15%	-13,34%	11,09	-0,29
RTS USD ***	Индекс РТС	21,99%	-71,27%	-2,37%	2,20%	-72,02%	-69,82%	45,97	-0,06
RTS RUR ***	Индекс РТС рубли	12,89%	-67,89%	-2,14%	2,64%	-67,76%	-66,03%	40,87	-0,11
ZETBI-Corp	Индекс облигаций	48,82%	-1,36%	1,81%	2,18%	-4,98%	-0,32%	12,66	0,22
Золото	Котировка в ЦБ РФ	30,22%	10,28%	0,67%	10,61%	8,58%	14,82%	10,70	0,91
Серебро	Котировка в ЦБ РФ	-18,88%	-20,16%	0,33%	15,03%	-27,18%	-16,80%	13,64	-0,77

(*) Начало работы ОФБУ "Доходный" и "Универсальный" - 08.12.2003
Начало работы ОФБУ "Валютный" и "Перспективный" - 11.04.2006
Начало работы ОФБУ "Доходный II" - 24.07.2006
Начало работы ОФБУ "Вечные ценности" - 09.02.2007

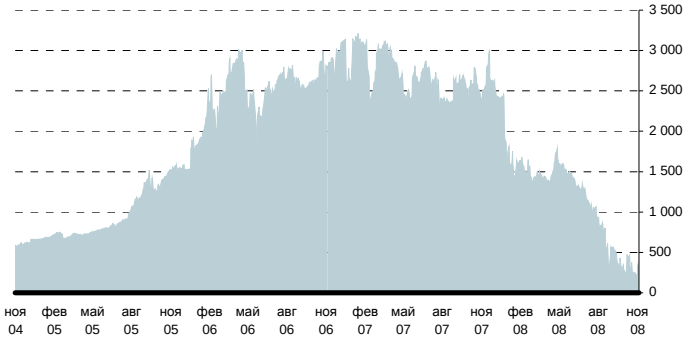
(**) Если в ячейке стоит "-", значит недостаточно статистических данных

(***) Для сравнения с рублевыми фондами используется индекс RTS RUR, для сравнения с валютным фондом - RTS USD

ОФБУ "Доходный"



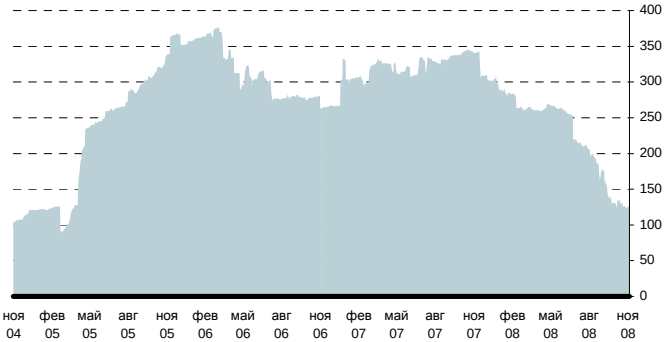
Стоимость чистых активов фонда "Доходный" млн. руб.



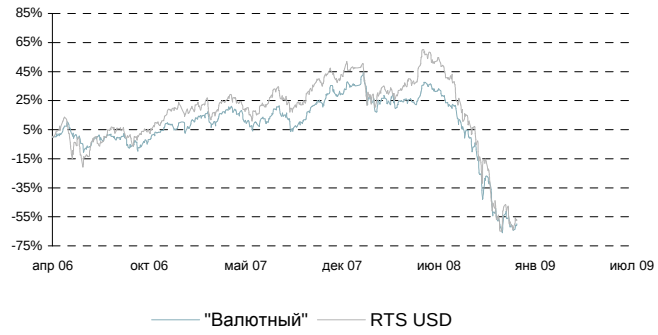
ОФБУ "Универсальный"



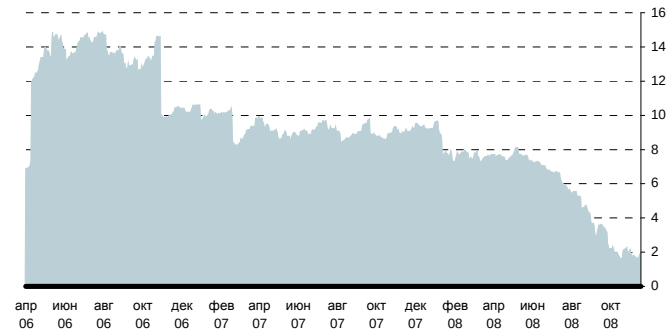
Стоимость чистых активов фонда "Универсальный" млн. руб.



ОФБУ "Валютный"



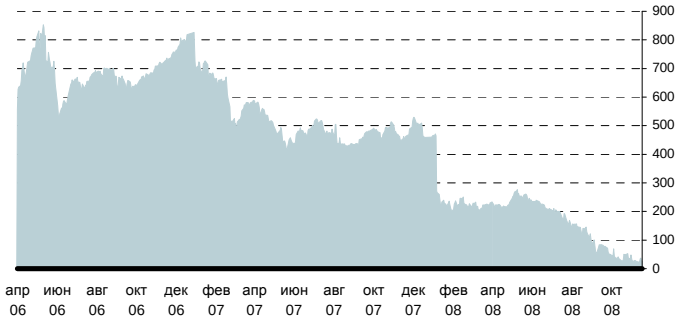
Стоимость чистых активов фонда "Валютный" млн. дол.



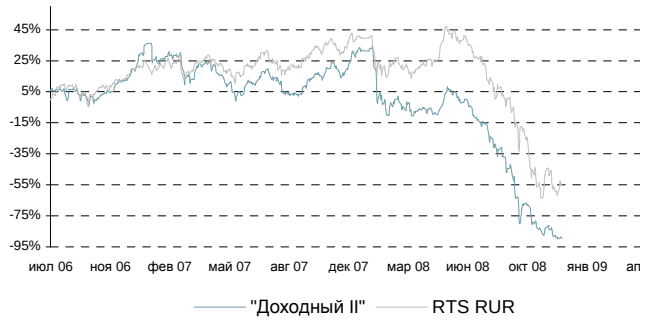
ОФБУ "Перспективный"



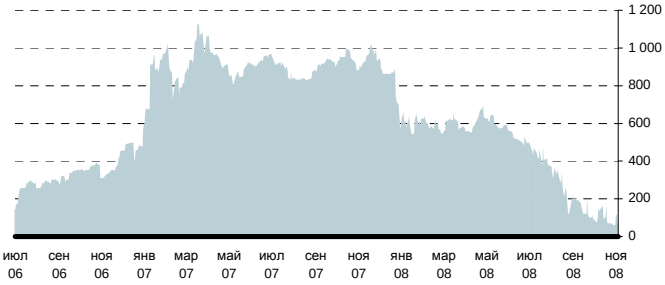
Стоимость чистых активов фонда "Перспективный" млн. руб.



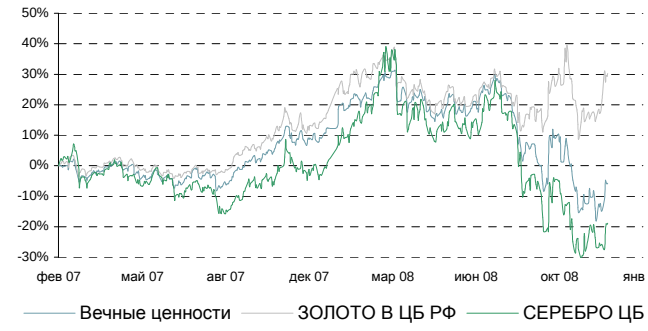
ОФБУ "Доходный II"



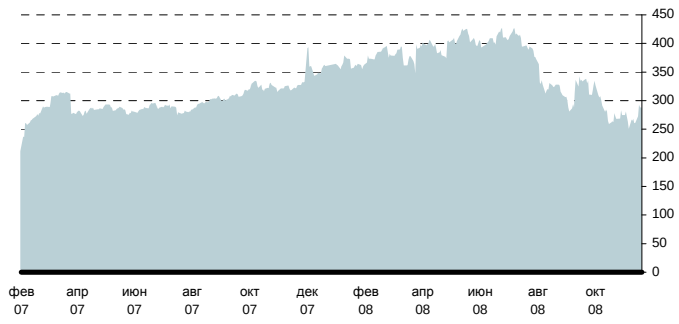
Стоимость чистых активов фонда "Доходный II" млн. руб.



ОФБУ "Вечные ценности"



Стоимость чистых активов фонда "Вечные ценности" млн. руб.



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	Кирилл Копелович	kopelovich@zenit.ru
Зам.начальника Департамента	Константин Поспелов	konstantin.pospelov@zenit.ru
Управление продаж		
Валютные облигации	Светлана Агиевец	s.agievets@zenit.ru
Рублевые облигации	Виталий Киселев	v.kiselev@zenit.ru
Рублевые облигации	Алексей Криволап	a.krivolap@zenit.ru
Аналитическое управление	Акции	research@zenit.ru
	Облигации	firesearch@zenit.ru
Стратегия/кредитный анализ	Александр Ермак	a.ermak@zenit.ru
Макроэкономика	Владимир Евстифеев	v.evstifeev@zenit.ru
Кредитный анализ	Наталия Толстошеина	n.tolstosheina@zenit.ru
Кредитный анализ	Кирилл Сычев	k.sychev@zenit.ru
Акции	Игорь Нуждин	i.nujdin@zenit.ru
Управление доверительного управления активами		
Доверительное управление активами	Сергей Матюшин	s.matyushin@zenit.ru
Брокерское обслуживание	Ирина Киреева	i.kireeva@zenit.ru
Брокерское обслуживание	Тимур Мухаметшин	t.mukhametshin@zenit.ru
Управление организации долгового финансирования		ibcm@zenit.ru
Рублевые облигации	Алексей Балашов	a.balashov@zenit.ru
Рублевые облигации	Степан Ермолкин	stepan.ermolkin@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. © 2004 Банк ЗЕНИТ.