

ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный Обзор

Внешний рынок долга:

- Risk aversion: рекордно низкие розничные продажи в США

Денежно-кредитный рынок:

- Рублевая ликвидность продолжает таять

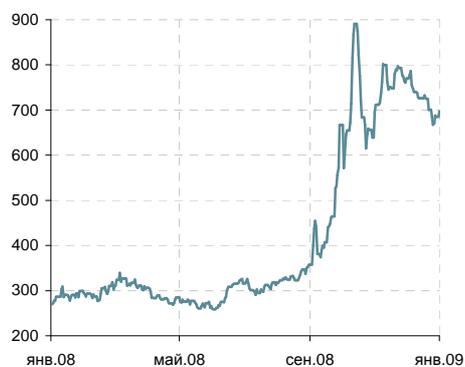
Российский долговой рынок:

- Относительно спокойный день на рублевом рынке
- Размещение Москва-59 – чуть больше, чем ничего

Оглавление:

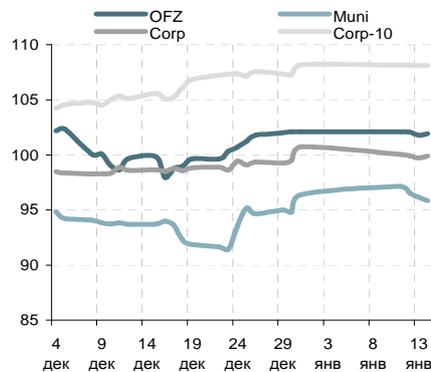
Внешний рынок долга	2
Денежно-кредитный рынок	3
Российский долговой рынок	3
Приложения	4

Динамика EMBIG Sovereign Spread



Источник: J.P. Morgan

Динамика ценовых индексов ZETBI



Источник: Банк ЗЕНИТ

Внешний рынок долга

Risk aversion: рекордно низкие розничные продажи в США

Глобальные фондовые индексы снижаются вслед за получением новых негативных данных по состоянию экономики США. Вчера американское Министерство торговли опубликовало цифры по динамике розничных продаж в декабре, которые оказались значительно слабее прогнозов. Объем продаж розничными сетями составил \$343 млрд, снизившись к ноябрю на 2.7% (прогноз - . Продажи падают уже шестой месяц подряд, что является самым затяжным снижением с 1992 г. В условиях сложного доступа к кредитным ресурсам и напряженной ситуации на рынке труда американские потребители сокращают расходы и увеличивают сбережения, что негативно отражается на состоянии экономики.

На рынке казначейских обязательств США наблюдалось снижение ставок на фоне падения фондовых индексов. Помимо слабых данных по розничным продажам, вчера была опубликована «бежевая книга ФРС». В ней говорится об ухудшении экономических перспектив большинства регионов и отмечается снижение в производстве и сфере услуг. Очередные признаки усиления рецессии американской экономики вновь привели к «бегству инвесторов» в защитные активы. Короткие доходности US-Treasuries снизились в пределах 3-5 б.п., более волатильный дальний сегмент опустился на 9-12 б.п.

На рынке Emerging Debt вчера наблюдалось снижение цен, поскольку слабые данные по розничным продажам бьют по самой уязвимой точке развивающихся стран – опасения резкого сокращения спроса на основное сырье. Индикативный кредитный спрэд EMBI+ вчера расширился до 688 б.п., в том числе за счет снижения ставок базовых активов. На российском рынке суверенных евробондов начались продажи: цена выпуска Russia'30 снизилась с 91 до 88 п.п.

Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Денежно-кредитный рынок

Рублевая ликвидность продолжает таять

Конъюнктура денежного рынка продолжает ухудшаться. Вчера ставка MIACR составила 9.77% против 8.97% накануне, а однодневные кредиты на рынке МБК обходились в среднем под 9-10% годовых. Объем операций репо с ЦБ вчера снизился на 100 млрд, составив 277.6 млрд руб.

На валютном рынке Центробанк вчера взял паузу в девальвации рубля, сохранив офер по бивалютной корзине на уровне 36.30 руб. Дилеры оценивают объем интервенций ЦБ на вчерашних торгах в размере \$2-2.5 млрд. Сегодня ЦБ вновь расширил границы валютного коридора, а новый уровень поддержки рубля поднялся еще на 50 коп. до 36.80 руб.

Объем ликвидности банковской системы продолжает сокращаться, составив сегодня 719.4(-79.3) млрд руб. Остатки на корсчетах в ЦБ снизились до 529.3(-19.6) млрд руб., депозиты до 190.1(-59.7) млрд руб. Вчера на счета банков поступили 193.5 млрд руб. от участия в беззалоговых аукционах в начале недели, при этом значительная часть пришлось на погашение ранее полученных кредитов (167.9 млрд руб.).

Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Динамика ценовых индексов ZETBI

	Индекс	день	неделя
Zetbi OFZ	101,94	0,16%	-0,15%
Zetbi Muni	95,84	-0,33%	-0,59%
Zetbi Corp	99,91	0,19%	-0,83%
Zetbi Corp10	108,11	0,02%	-0,07%

Источник: Банк ЗЕНИТ

Александр Ермак
a.ermak@zenit.ru

Торги и изменения в субфедеральном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
МГор46-об	75,07	0,01
ТулскОб 1	60,61	-0,65
МГор47-об	45,15	-
Чувашия-04	31,06	0,29
Казань06об	28,97	-4,50

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в корпоративном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
ТГК-6Инв-1	768,93	0,67
ТурАлемФ 1	523,52	-
СанИнтБрю2	329,62	2,01
ОГК-6 01об	214,12	8,67
РосселхБ 6	123,86	0,1

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Российский долговой рынок

Относительно спокойный день на рублевом рынке

По итогам вчерашних торгов котировки российских облигаций несколько прервал падение, идущее с начала недели. Ценовые движения были разнонаправленными, первый эшелон торговался вяло, изменения цен лежат в пределах 10-20 б.п., объемы торгов незначительны. Основная активность переместилась в бумаги второго-третьего эшелонов, где волатильность выше. Мы не ожидаем серьезной стабилизации рынка в настоящий момент. Несмотря на наличие отдельных выпусков приемлемого кредитного качества, дающих доходность выше, чем на валютных операциях, значимых факторов, формирующих устойчивый спрос на рублевые активы мы не видим.

Размещение Москва-59 – чуть больше, чем ничего

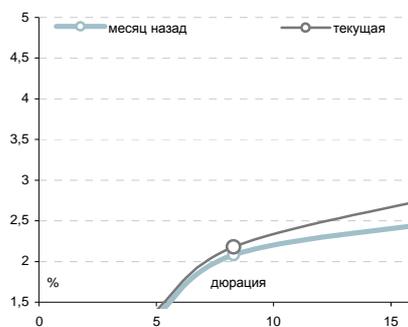
Вчера прошло размещение выпуска Москва-59, номинальным объемом 15 млрд руб. Москомзайм планировал продать инвесторам облигаций хотя бы на 3-4 млрд руб. Однако доходности в 15% годовых для бумаги чуть длиннее года оказалось недостаточно, чтобы заинтересовать рынок, несмотря на то что на уровне 13-14% годовых в настоящий момент торгуются трех-четырёх летние облигации Москвы. Объем размещения составил всего 1.47 млрд руб. Мы обращаем внимание на то, что в аукционе, по-видимому не участвовали крупнейшие банки (или объем их заявок был минимальным) – слишком широким оказался круг участников аукциона. Изначально было подано 22 заявки на чуть менее чем 2 млрд руб., по словам представителей Москомзайма в размещении участвовало 11 банков и 1 инвестиционная компания.

Приложение 1. Индикаторы мировых рынков

Инструмент	Дата	Значение	Изменение, б.п.		
			день	месяц	ГОД
UST 2 yr	1/14/2009	0,71	-3	-3	-177
UST 10 yr	1/14/2009	2,20	-9	-31	-148
UST 30 yr	1/14/2009	2,89	-12	-7	-139
Bund 2 yr	1/14/2009	1,49	-1	-62	-216
Bund 10 yr	1/14/2009	2,93	-6	-26	-109
Bund 30 yr	1/14/2009	3,80	0	2	-66
Fed Fund	1/13/2009	0,25	0	-75	-400
Libor 1 mo	1/13/2009	0,33	0	-71,1	-375
Libor 6 mo	1/13/2009	1,47	1	-74,9	-238
Libor 12 mo	1/13/2009	1,74	1	-67	-175
S&P 500	1/15/2009	842,62	-3,35%	-2,99%	-38,98%
Nasdaq Composite	1/15/2009	1489,64	-3,67%	-1,24%	-38,38%
RTS	1/14/2009	591,34	-4,78%	-14,20%	-74,63%
EURUSD	1/15/2009	1,3160	-0,24%	-3,86%	-11,11%
USDJPY	1/15/2009	89,07	0,01%	-1,75%	-16,59%
USDRUB	1/15/2009	32,35	1,93%	17,12%	32,87%
EURRUB	1/15/2009	42,38	1,23%	12,09%	17,56%
Brent 1m Future	1/15/2009	44,44	-1,42%	-0,36%	-51,15%
Gold	1/15/2009	809,40	-0,28%	-3,46%	-8,86%

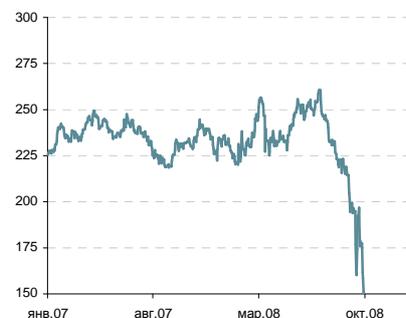
Источник: Bloomberg

Кривая доходности US Treasuries



Источник: Bloomberg

Спрэд между UST10 и UST10 с защитой от инфляции



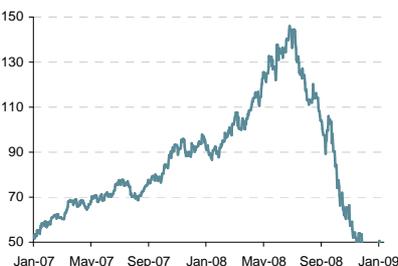
Источник: Bloomberg

Bond	Date	Current Spread	Change, bp				YTM	ВМК UST	Spread, bp
			day	week	month	year			
Russia-30*	1/14/2009	88,33%	-246	-287	659	-2689	9,71	UST10	751
UMS-31*	1/13/2009	117,41%	-39	-604	537	-1130	6,78	UST30	390
Turkey-30*	1/14/2009	142,35%	-127	-236	673	-1494	7,76	UST10	556
Venezuela-27*	1/13/2009	58,79%	-58	-239	264	-4458	16,37	UST10	1343
EMBIG	1/14/2009	716	16	46	-8	-8	-	-	-
EMBIG Russia	1/14/2009	776	41	80	-29	-29	-	-	-
EMBIG Brazil	1/14/2009	460	13	58	31	31	-	-	-
EMBIG Mexico	1/14/2009	437	15	43	3	3	-	-	-
EMBIG Turkey	1/14/2009	537	16	53	3	3	-	-	-
EMBIG Venezuela	1/14/2009	1661	12	37	-203	-203	-	-	-

* - Quotes

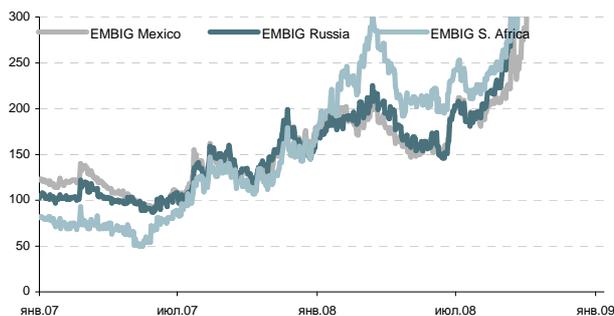
Source: J.P. Morgan, Bloomberg

Динамика цен на нефть сорта Brent



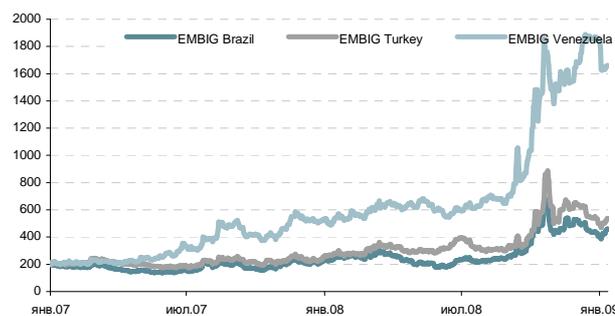
Источник: Bloomberg

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan



Котировки российских еврооблигаций

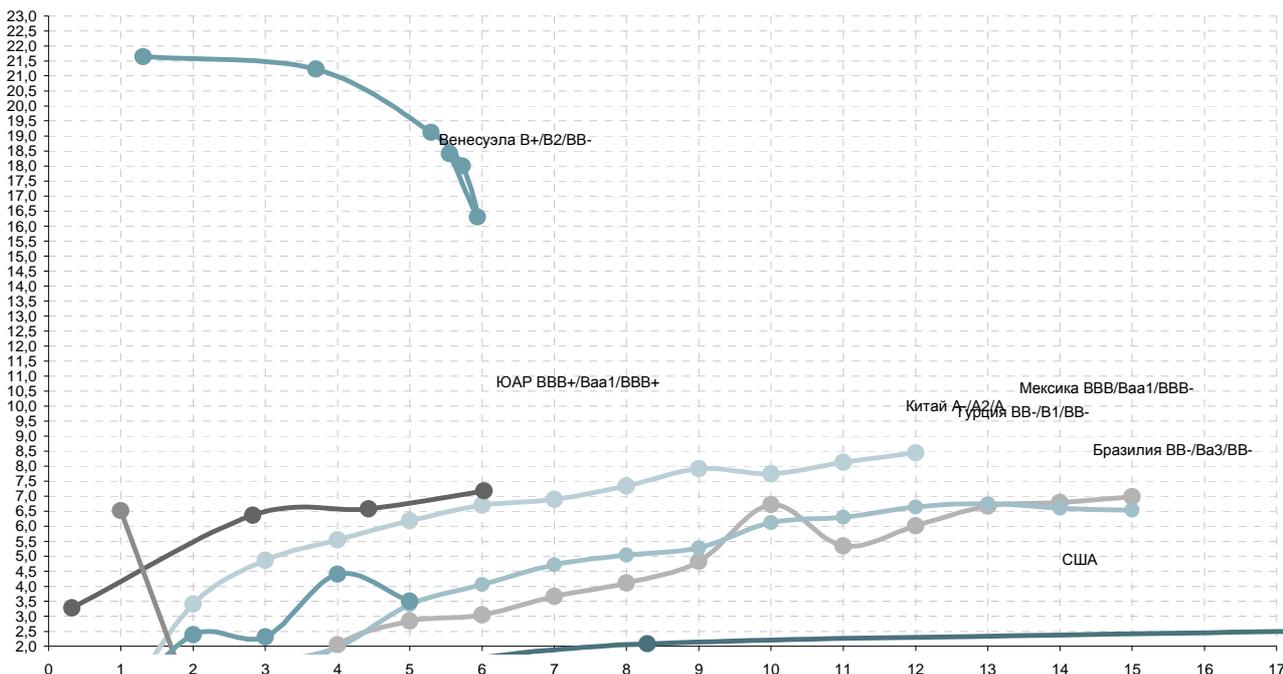
	Maturity	Size, mln	Coupon, %	Rating	Bid	Offer	YTM, %	Modified Duration	Spread to Treasury, bp
Sovereign									
Russia-10 \$	3/31/2010	2 767	8,25	Baa1/BBB/BBB+	104,27	104,56	1,58	0,67	393
Russia-18 \$	7/24/2018	3 467	11	Baa1/BBB/BBB+	119,75	120,25	7,96	5,93	584
Russia-28 \$	6/24/2028	2 500	12,75	Baa1/BBB/BBB+	123,15	123,65	10,00	8,11	748
Russia-30 \$	3/31/2030	20 310	7,5	Baa1/BBB/BBB+	88,14	88,52	9,71	5,26	713
Aries-09 EUR	10/25/2009	1 000	7,75	Aaa/AAA	103,91	103,99	2,42	0,75	101
Regional									
Moscow-11 EUR	10/12/2011	374	6,45	Baa1-/BBB+	89,85	90,10	10,86	2,29	925
Oil & Gas									
Gazprom-09 \$	10/21/2009	700	10,5	BBB	102,84	103,02	6,41	0,70	606
Gazprom-10 EUR	9/27/2010	1 000	7,8	BBB/BBB	98,71	99,08	8,48	1,49	702
Gazprom-13 \$	3/1/2013	1 750	9,625	BBB	92,39	92,89	11,94	3,14	1074
Gazprom-13-2 \$	4/11/2013	400	7,343	A3/BBB/BBB	84,72	84,97	12,02	3,37	1080
Gazprom-15 EUR	6/1/2015	1 000	5,875	A3	67,55	67,93	13,79	4,40	1126
Gazprom-17 EUR	11/2/2017	500	5,44	BBB/BBB	60,96	61,46	13,13	5,82	1032
Gazprom 18 EUR	2/13/2018	1 200	6,605	B- /*-/-	61,66	61,91	14,41	5,17	1159
Gazprom 18 \$	4/11/2018	1 100	8,146	A3/BBB/BBB	75,43	75,68	12,72	5,68	1064
Gazprom-20 \$	2/1/2020	1 250	7,201	BBB+/BBB+	77,83	78,08	10,64	6,65	842
Gazprom-22 \$	3/7/2022	1 300	6,51	BBB/BBB	61,45	61,70	12,55	7,03	1026
Gazprom-34 \$	4/28/2034	1 200	8,625	A3/BBB/BBB	82,54	82,79	10,61	3,88	1190
Lukoil-17 \$	6/7/2017	500	6,356	Baa2/BBB-/BBB-	68,28	68,78	12,52	5,76	1059
Lukoil-22 \$	6/7/2022	500	6,656	Baa2/BBB-/BBB-	63,66	64,16	12,19	7,32	989
Sibneft-09 \$	1/15/2009	500	10,75	WR/BBB-	100,00	100,00	10,21	0,00	1015
TNK-11 \$	7/18/2011	500	6,875	Baa2/BB/BBB- /*-	82,83	83,06	15,37	2,15	1450
TNK-12 \$	3/20/2012	500	6,125	Baa2/BB/BBB- /*-	69,91	70,16	19,18	2,55	1814
TNK-13 \$	3/13/2013	600	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	68,41	68,66	18,74	3,09	1754
TNK-16 \$	7/18/2016	1 000	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	56,56	56,81	18,37	4,79	1660
TNK-17 \$	3/20/2017	800	6,625	Baa2/BB/BBB- /*-	53,43	53,68	17,53	5,01	1563
TNK-18 \$	3/13/2018	1 100	7,875	Baa2/BB/BBB- /*-	56,35	56,60	17,62	5,04	1556
Transneft-12 EUR	6/27/2012	700	5,381	A3 /*-/BBB/-	78,45	78,95	13,51	2,72	1161
Transneft-12 \$	6/27/2012	500	6,103	A3 /*-/BBB/-	77,83	81,64	12,94	2,91	1185
Transneft-14 \$	3/5/2014	1 300	5,67	A3 /*-/BBB/-	70,21	70,46	13,96	3,97	1260
Telecommunications									
MegaFon-09 \$	12/10/2009	375	8	Ba2/BB+	98,85	98,97	9,30	0,83	891
MTS-10 \$	10/14/2010	400	8,375	Ba2/BB	94,03	94,25	12,21	1,52	1157
MTS-12 \$	1/28/2012	400	8	Ba2/BB	83,02	83,27	15,16	2,41	1415
Sistema-11 \$	1/28/2011	350	8,875	Ba3 /*-/BB/BB-	75,40	75,71	25,02	1,58	2428
Vimpelcom-09 \$	6/16/2009	450	10	Ba2/BB+	99,73	99,78	10,53	0,39	1031
Vimpelcom-10 \$	2/11/2010	300	8	Ba2/BB+	94,32	94,45	13,89	0,93	1346
Vimpelcom-11 \$	10/22/2011	300	8,375	Ba2/BB+	84,80	85,05	15,27	2,26	1433
Vimpelcom-13 \$	4/30/2013	1 000	8,375	(P)Ba2/BB+	72,23	72,48	17,88	3,19	1666
Vimpelcom-16 \$	5/23/2016	600	8,25	Ba2/BB+	60,72	60,97	18,09	4,57	1634
Vimpelcom-18 \$	4/30/2018	1 000	9,125	(P)Ba2/BB+	60,49	60,74	18,00	4,94	1592
Industrials									
Alrosa-14 \$	11/17/2014	500	8,875	Ba2/BB- /*-	66,79	67,04	18,34	3,92	1685
Eurochem-12 \$	3/21/2012	300	7,875	-/BB/BB	57,32	57,51	29,42	2,30	2838
Evrazholding-09 \$	8/3/2009	325	10,875	Ba2/BB	97,09	97,17	16,69	0,47	1641
Evrazholding-15 \$	11/10/2015	750	8,25	B1/BB	50,51	50,76	22,89	4,04	2123
Evrazholding-13 \$	4/24/2013	1 300	8,875	B1/BB	53,55	53,78	28,21	2,84	2699
Evrazholding-18 \$	4/24/2018	700	9,5	B1/BB	50,56	50,81	22,28	4,38	2020
Normickel-09 \$	9/30/2009	500	7,125	Baa2/BBB-	98,48	98,58	9,34	0,64	901
Raspadskaya-12 \$	5/22/2012	300	7,5	Ba3/B+e/B+	57,60	57,97	27,65	2,49	2659
Severstal-09 \$	2/24/2009	325	8,625	Ba2/BB	99,99	100,01	8,33	0,09	824
Severstal-14 \$	4/19/2014	375	9,25	Ba2/BB/BB	55,38	55,63	24,87	3,31	2348
Severstal-13 \$	7/29/2013	1 250	9,75	Ba2/BB/BB	55,50	55,75	27,47	2,80	2620
SINEK-15	8/3/2015	250	7,7	Ba1/BBB-	98,47	98,47	8,00	2,93	711
TMK-08 \$	9/29/2009	300	8,5	Ba3/B+/-	87,96	88,04	28,81	0,58	2848

	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	98,02	18,13	0,20	1803
Ak Bars-10 \$	6/28/2010	250	8,25	Ba2/BB-e/-	84,96	85,12	20,81	1,24	2026
Alfa Bank-09 \$	10/10/2009	400	7,875	Ba1/-/BB	96,07	96,22	13,64	0,66	1330
Alfa Bank-12 \$	6/25/2012	500	8,2	Ba1/BB-/-	62,66	63,05	24,92	2,60	2382
Bank of Moscow-09 \$	9/28/2009	250	8	A3/-/BBB	97,24	97,33	12,20	0,63	1187
Bank of Moscow-10 \$	9/21/2005	300	7,375	A3/-/BBB	86,89	87,09	15,75	1,61	1507
Bank of Moscow-13 \$	5/13/2013	500	7,335	A3/-/BBB	64,24	64,49	20,05	3,22	1882
Credit Europe Bank 10 \$	4/13/2010	250	7,5	Ba1/-/-	99,05	99,05	8,31	1,13	783
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/BB+	58,40	58,65	17,17	4,52	1553
MDM-11 \$	7/21/2011	200	9,75	Ba2/B+ /*-/BB-	57,24	57,49	37,47	1,85	3661
Promsviazbank-10 \$	10/4/2010	200	8,75	Ba2/BB-	52,10	52,20	55,61	1,19	5498
Promsviazbank-11 \$	10/20/2011	225	8,75	Ba2/BB-	62,44	62,59	29,58	2,05	2864
Promsviazbank-12 \$	5/23/2012	200	9,625	Ba3/B	39,58	39,70	47,18	2,07	4611
Rusagrobank-10 \$	11/29/2010	350	6,875	A3/BBB+	95,54	95,78	9,47	1,68	879
Rusagrobank-13 \$	5/16/2013	700	7,175	A3/BBB+	76,43	76,68	14,69	3,39	1346
Rusagrobank-14 \$	1/14/2014	750	7,125	A3/-/-	76,35	76,60	13,81	3,88	1247
Rusagrobank-18 \$	5/29/2018	1 000	7,75	A3/-/-	68,60	68,85	13,80	5,74	1170
Rusagrobank-17 \$	5/15/2017	1 250	6,299	A3/-/BBB+	64,13	64,38	13,60	5,61	1169
Russian Standard-9 E	9/16/2009	400	6,825	Ba2/B+	77,45	77,55	51,58	0,49	5018
Russian Standard-10 \$	10/7/2010	500	7,5	Ba2/B+	43,46	43,54	68,14	1,14	6751
Rosbank-09 \$	9/24/2009	300	9,75	Baa3/A-	94,48	94,57	18,55	0,63	1865
Sberbank-15	2/11/2015	1 000	6,23	A2/BBB	66,70	66,86	15,87	4,25	-
TranscapitalBank 10 \$	5/10/2010	175	9,125	B1/-/-	71,96	72,04	38,28	1,03	3777
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+	87,56	87,81	13,00	2,30	1206
VTB-12 \$	10/31/2012	1 200	6,609	A2/BBB/BBB+	79,75	80,00	13,58	3,08	1242
VTB-15 \$	2/4/2015	750	6,315	A2/BBB	71,00	71,15	14,88	4,27	1335
VTB-18 \$	5/29/2018	2 000	6,875	A2/BBB/BBB+	70,11	70,36	12,32	3,38	1551
VTB-35 \$	6/30/2035	1 000	6,25	A2/BBB+	60,27	60,52	10,81	4,63	1485

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/-	108,29	108,49	6,73	3,86
Brazil-40	8/17/2040	5 157	11,00	BBB-/Ba1/BBB-	126,68	126,78	6,01	4,74
Turkey								
Turkey-30	1/15/2030	1 500	11,88	BB-/Ba3/BB-	142,22	142,47	7,75	9,52

Источник: Bloomberg

Приложение 4. Еврооблигации стран СНГ

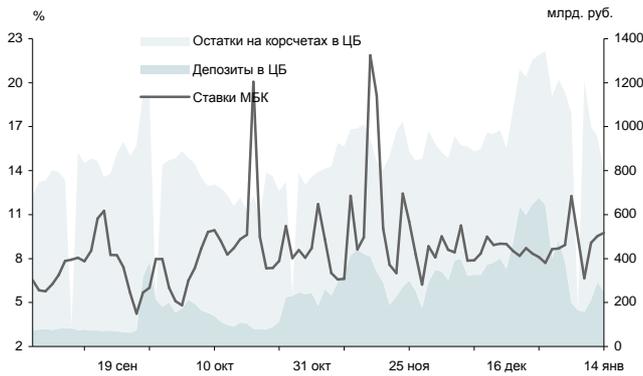
Кривая доходности еврооблигаций стран СНГ



Источник: Bloomberg

Приложение 5. Индикаторы российского рынка облигаций

Показатели рублевой ликвидности



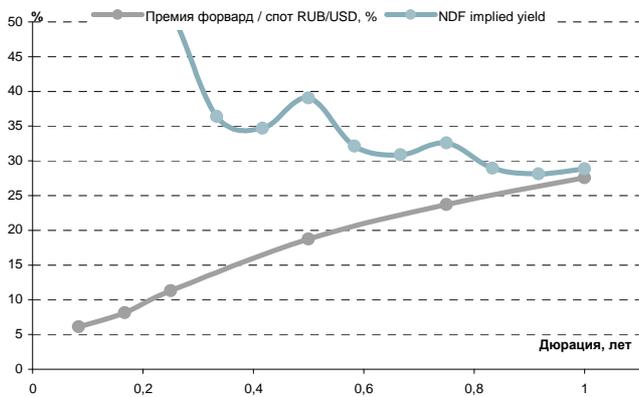
Источник: Reuters, ЦБ РФ

Динамика валютного рынка



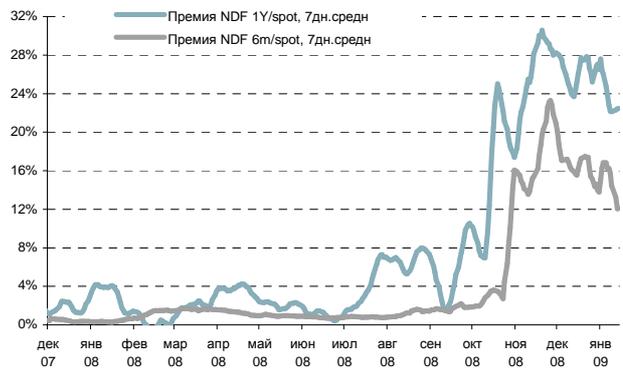
Источник: Reuters

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



Источник: Bloomberg

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



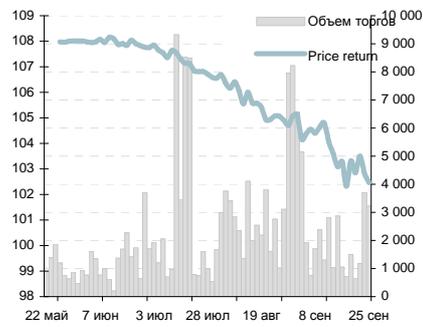
Источник: Reuters

Динамика ценового индекса ZETBI OFZ и объема торгов в сегменте



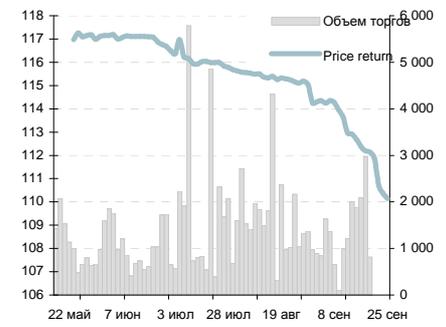
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика ценового индекса ZETBI Muni и объема торгов в сегменте



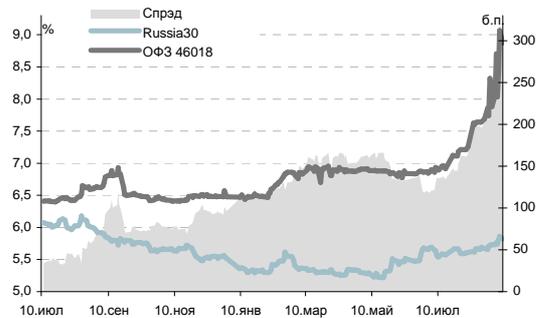
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индекса ZETBI Corp 10 и объема торгов в сегменте *



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика спреда OFZ 46018 и Russia 30

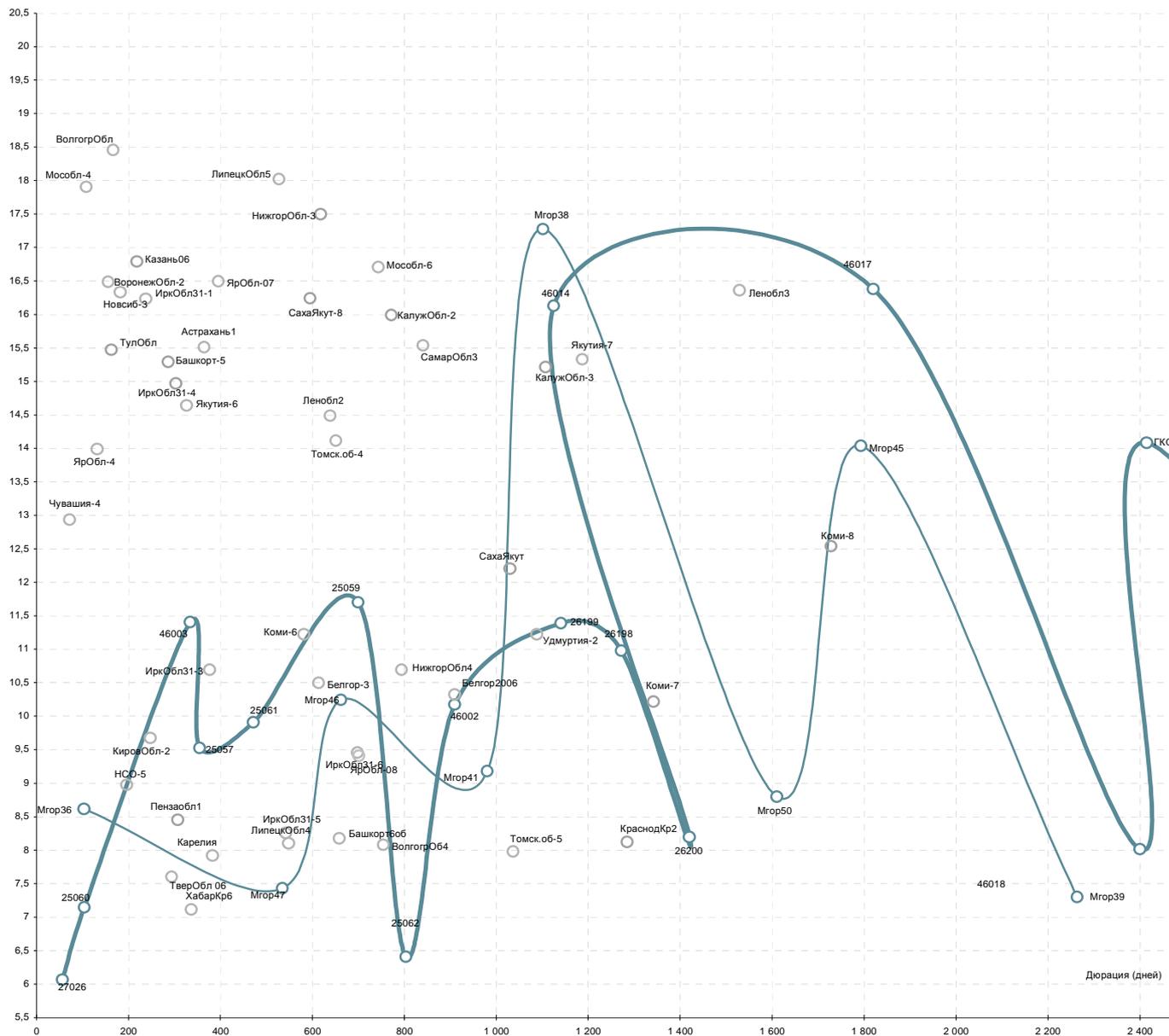


Источник: ММВБ, Bloomberg, расчеты Банка ЗЕНИТ

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



Кривая доходности субфедеральных облигаций



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Котировки российских облигаций



Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена		НКД (%)	Изм срвзв цены		Доходность по срвзв цене, % год		Дюрация лет
			погашения	оферты			посл	ср взв		день	неделя	погашения	оферта	
Государственные облигации														
SU27026RMFS2	11.03.2009	6,00	56		3	8,20	100,00	99,99	0,575	-	-0,01	6,06		0,15
SU25060RMFS3	28.01.2009	5,80	105		2	0,00	99,69	99,67	1,224	0,04	0,09	7,15		0,28
SU46003RMFS8	15.07.2009	10,00	546		0	0,00	99,00	99,00	0,000	-	-0,72	11,40		0,92
SU25057RMFS9	21.01.2009	7,40	371		1	0,00	98,27	98,27	1,703	0,57	0,38	9,52		0,97
SU25061RMFS1	04.02.2009	5,80	476		0	0,00	95,40	95,30	1,112	-	0,00	9,91		1,29
SU25062RMFS9	04.02.2009	5,80	840		0	0,00	99,00	99,00	1,112	-	0,00	6,41		2,20
SU25059RMFS5	21.01.2009	6,10	735		0	0,00	90,75	90,72	1,404	-	0,00	11,70		1,92
SU46002RMFS0	11.02.2009	9,00	1302		0	0,00	96,20	95,89	3,798	-	0,00	10,17		2,49
SU26199RMFS8	15.04.2009	6,10	1274		0	0,00	86,00	86,00	0,000	-	0,00	11,39		3,13
SU26198RMFS0	03.11.2009	6,00	1388		0	0,00	85,00	85,00	1,184	-	0,00	10,98		3,48
SU26200RMFS4	21.01.2009	6,10	1645		1	0,00	93,04	93,04	1,404	-	0,54	8,19		3,89
SU46014RMFS5	11.03.2009	9,00	3514		0	0,00	76,00	76,00	3,107	-	-17,00	16,13		3,08
SU46017RMFS8	11.02.2009	8,00	2758		0	0,00	64,25	64,25	1,381	-	-27,85	16,38		4,99
SU46021RMFS0	18.02.2009	7,50	3493		1	0,00	88,70	88,70	3,021	-	15,43	8,02		6,58
SU46022RMFS8	21.01.2009	7,50	5299		0	0,00	96,00	96,00	3,596	-	0,00	6,87		8,90
SU46018RMFS6	11.03.2009	8,50	4697		12	0,72	65,11	65,06	0,815	8,10	-28,02	14,08		6,62
SU46020RMFS2	11.02.2009	6,90	9884		0	0,00	81,86	81,86	2,912	-	0,00	8,85		10,83
Субфедеральные облигации														
МГор41-об	30.01.2009	8,00	562		0	0,00	102,00	101,02	3,682	-	0,00	7,43		1,47
МГор38-об	26.06.2009	10,00	711		0	0,00	100,00	100,00	0,521	-	-1,40	10,24		1,82
МГор39-об	21.01.2009	8,00	2014		0	0,00	96,00	96,00	3,880	-	0,00	8,80		4,41
МГор44-об	24.06.2009	8,00	2352		0	0,00	75,00	75,00	0,460	-	-7,48	14,04		4,91
МГор45-об	27.06.2009	8,00	1260		0	0,00	80,00	78,06	0,395	-	-2,13	17,27		3,02
МГор46-об	25.01.2009	8,00	192		9	75,07	98,15	98,16	1,775	0,01	0,16	12,17		0,51
Башкорт5об	06.05.2009	8,02	294		7	2,91	95,00	95,03	1,538	-0,81	-4,95	15,29		0,79
БелГОб 3об	11.02.2009	8,38	665		1	0,49	97,15	97,15	1,446	0,15	6,09	10,50		1,68
ИркОбл31-1	19.03.2009	8,50	337		2	0,01	95,50	95,50	0,627	-	0,01	16,23		0,65
ИркОбл31-3	25.03.2009	7,25	679		0	0,00	100,00	96,66	0,974	-	0,00	10,69		1,03
Казань 3	28.03.2009	8,04	437		0	0,00	100,00	100,00	2,401	-	-	8,18		1,14
КазаньОбоб	25.02.2009	8,00	227		1	28,97	95,50	95,50	1,074	-	-4,50	16,79		0,60
КОМИ 6в об	14.04.2009	11,50	638		1	10,29	100,00	100,00	2,899	-	14,99	11,22		1,59
КОМИ 7в об	23.05.2009	9,00	1773		0	0,00	95,00	94,81	1,282	-	0,00	10,22		3,68
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	916		0	0,00	100,00	100,00	3,833	-	0,00	8,10		1,50
ЛипецкОбл5	15.01.2009	7,10	547		0	0,00	86,60	86,60	3,521	-	0,00	18,02		1,45
ЛипецкОбл6	10.06.2009	8,98	1603		1	14,17	70,00	70,00	0,861	-	5,00	26,11		2,35
Мос. обл. 4в	20.01.2009	11,00	97		0	0,00	98,30	98,30	2,562	-	0,00	17,90		0,30
Мос. обл. 5в	31.03.2009	10,00	440		4	0,19	85,00	83,04	2,904	0,48	-8,45	29,25		1,13
Мос. обл. 6в	21.04.2009	9,00	825		1	6,68	87,00	87,00	2,096	-	-1,90	16,71		2,04
Мос. обл. 7в	22.04.2009	8,00	1918		8	3,08	46,50	44,48	1,841	-3,39	-15,61	31,48		3,72
СамарОбл 5	26.03.2009	9,30	1800		6	11,47	72,40	72,49	0,510	-	-5,94	25,25		2,33
Мос. обл. 8в	16.06.2009	9,00	1609		17	1,58	60,00	60,07	0,715	0,06	0,98	34,21		2,26
Томск.об-3	09.05.2009	6,00	299		0	0,00	89,00	89,00	1,084	-	-1,00	22,31		0,81
Томск.об-4	26.06.2009	7,00	1076		1	0,67	89,16	89,16	0,364	-	-0,61	14,12		1,78
Томск.об-5	17.06.2009	8,00	1433		0	0,00	98,60	98,60	0,614	-	0,10	7,98		2,84
Чувашия-04	27.03.2009	12,33	72		2	31,06	99,80	99,79	3,750	0,29	-0,01	12,94		0,20
Чувашия-05	05.06.2009	7,85	872		0	0,00	77,98	77,98	0,882	-	-2,52	20,82		2,18
Чувашия-06	20.01.2009	7,74	1189		0	0,00	70,40	70,40	1,802	-	0,00	21,48		2,80
Чувашия-07	10.03.2009	9,66	1602		0	0,00	60,00	60,00	0,953	-	0,00	28,45		3,06
Якут-06 об	12.02.2009	10,00	484		0	0,00	96,60	96,60	1,699	-	-1,40	14,64		0,89
Якут-07 об	22.01.2009	7,80	1919		0	0,00	80,00	80,00	1,774	-	6,16	15,33		3,25
ЯрОбл-05	#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
ЯрОбл-04	26.05.2009	10,00	132		4	7,00	98,57	98,56	1,397	-1,44	-1,44	13,99		0,36
ЯрОбл-06	21.04.2009	7,50	825		1	0,90	78,00	78,00	1,747	-	-17,50	24,06		1,62
ЯрОбл-07	31.03.2009	7,50	440		0	0,00	91,00	91,45	0,308	-	-7,35	16,49		1,08
Корпоративные облигации														
Машиностроение														
АВТОВА3об3	23.06.2009	9,60	524		0	0,00	85,00	85,00	0,579	-	0,00	23,12		1,42
АВТОВА3об4	26.05.2009	7,80	1952	132	0	0,00	93,55	93,55	1,068	-	-	-	27,09	0,44
АВТОВА3об1	25.03.2009	9,23	70		0	0,00	99,96	99,97	7,435	-	-	8,91		0,53
АВТОВА3об2	25.03.2009	9,80	70		4	0,21	97,00	97,01	7,894	0,04	-0,10	24,20		0,19
АВТОВА3об3	27.05.2009	9,20	133		0	0,00	96,00	96,00	5,822	-	0,00	18,44		0,42
АВТОВА3об4	04.06.2009	9,20	141		2	0,01	97,50	97,50	5,621	-	-5,01	15,20		0,39
Автоприбор	29.04.2009	13,20	105		0	0,00	74,20	74,20	2,785	-	0,00	115,37		0,35
Вагонмаш 2	17.06.2009	15,50	700	154	2	4,01	79,00	79,00	1,162	-0,11	2,00	-	81,51	0,42
ГАЗФин 01	10.02.2009	9,30	755	27	55	3,94	76,00	75,82	3,949	-1,94	3,44	-	417,45	0,07
ГИДРОМАШС1	26.05.2009	9,90	314		0	0,00	75,00	75,00	1,356	-	12,73	54,13		0,84
ГСС 01	26.03.2009	7,85	2993	253	0	0,00	94,90	94,90	2,387	-	0,00	-	16,48	0,71
ГТ-ТЭЦ 4об	04.03.2009	10,71	231		12	0,09	28,25	25,63	3,903	-3,79	-5,51	836,10		0,57
ИжАвто 02	11.06.2009	18,00	876		0	0,00	50,34	78,83	1,677	-	0,00	33,36		2,01
ИРКУТ-03об	19.03.2009	8,74	610		1	30,74	85,00	85,00	2,826	-	0,00	20,64		1,54
Камаз-Фин2	20.03.2009	11,25	611		0	0,00	99,97	99,98	3,606	-	-	11,58		1,82
Киров.зд1	25.03.2009	14,90	434	69	0	0,00	94,00	94,00	4,572	-	-	-	47,32	0,36
КМЗ-Фин 01	11.06.2009	11,25	512	148	0	0,00	95,00	97,37	1,048	-	-2,13	-	24,55	0,41
КМПО-Фин01	17.03.2009	11,30	426		0	0,00	102,00	102,00	3,715	-	-3,50	9,65		1,09
КриогенФ 1	16.06.2009	13,00	335		0	0,00	102,00	92,10	1,033	-	0,00	23,89		0,92
ЛОМО 03	09.03.2009	15,50	234	54	1	0,00	72,00	72,00	5,351	-2,71	2,00	-	264,71	0,15
МетарФ 01	11.06.2009	16,00	512	152	0	0,00	89,99	89,99	1,490	-	0,00	-	49,02	0,45
МиГ-Ф 02	10.03.2009	12,00	965	237	0	0,00	78,00	78,00	4,175	-	-12,00	-	64,80	0,62
МиГ-Ф обл.	03.06.2009	7,85	140		0	0,00	85,05	85,05	0,903	-	0,15	53,57		0,39

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена			Изм срвзв		Доходность по		Дюрация, лет
			погашения	оферты			посл	ср взв	НКД (%)	день	неделя	погашения	оферта	
МоторФин-1	19.03.2009	10,00	64		0	0,00	90,00	90,00	3,233	-	0,00	61,17		0,21
МоторФин-2	15.01.2009	10,00	547	1	0	0,00	91,00	91,51	4,959	-	0,00	-	3433,61	0,05
ОЗНА-Фин01	09.06.2009	10,50	328		0	0,00	99,80	99,80	1,036	-	-	-	-	0,00
ОМЗ-5 об	03.03.2009	8,80	958	230	0	0,00	90,00	90,13	3,231	-	-5,81	-	28,83	0,61
ОМЗ-6 об	05.06.2009	10,25	1598	324	1	3,20	95,00	95,00	1,123	8,81	10,00	-	17,17	0,86
ПМЗ 01	20.01.2009	12,00	188		0	0,00	98,00	98,00	2,795	-	4,05	17,04	-	0,50
ПО УОМЗ	11.06.2009	16,50	512		0	0,00	100,00	100,00	1,537	-	0,00	16,65	-	1,37
ПромТр02об	21.04.2009	10,75	1007	279	2	1,52	84,40	82,20	2,503	-	-2,80	-	38,83	0,74
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	301		0	0,00	98,99	99,35	2,503	-	0,00	15,85	-	0,83
РОССКАТ-К1	21.01.2009	10,30	553	7	0	0,00	100,02	93,70	4,938	-	-4,25	-	8,84	0,02
Ростверт1	26.05.2009	9,30	132		0	0,00	95,00	95,00	1,274	-	0,00	22,25	-	0,42
Рыбкаб-1	03.03.2009	10,75	1140	48	0	0,00	98,00	98,00	1,266	-	0,00	-	26,15	0,18
СатурнНПО2	21.03.2009	12,50	979	66	0	0,00	99,00	99,00	3,973	-	0,00	-	17,51	0,22
СатурнНПО3	05.06.2009	16,25	1969	324	0	0,00	95,00	95,00	1,736	-	7,79	-	24,04	0,85
СевКаб 03	31.03.2009	16,00	1168	76	10	2,39	95,00	95,00	0,658	-	-0,82	-	41,83	0,21
СевКаб 04	24.02.2009	13,75	1588	132	11	1,39	60,00	60,48	1,884	-	-8,51	-	372,08	0,35
СОЛЛЕРС2	21.01.2009	7,70	1645	553	2	22,83	58,01	58,01	3,692	-13,49	-16,90	-	57,00	1,35
СРЗ-Фин 01	11.06.2009	18,00	330		0	0,00	79,00	79,00	1,677	-	-	50,94	-	0,90
ТВЗ 03	19.06.2009	10,00	520	156	6	1,22	75,00	75,01	0,712	-	-24,99	-	90,47	0,43
ТензорФ-01	19.05.2009	14,50	307		0	0,00	67,21	67,21	2,264	-	-37,77	85,73	-	0,80
Трансмаш-2	12.02.2009	8,60	757	29	4	1,01	97,10	97,50	3,605	0,00	-2,00	-	44,78	0,08
УЗПС 01	10.12.2009	0,00	512	148	0	0,00	92,50	92,50	0,932	-	-	-	17,34	0,00
УМПО 2	18.06.2009	12,25	337		0	0,00	97,99	98,69	0,906	-	4,39	14,25	-	0,90
УралВагЗФ2	01.04.2009	10,50	629	77	5	7,89	95,00	95,00	3,021	-	-2,00	-	34,89	0,21
ЭМальянс 1	10.07.2009	13,50	905	177	0	0,00	75,00	75,00	0,185	-	0,00	-	86,53	0,51
ЭнергмашФ1	26.05.2009	13,00	1042	314	0	0,00	96,80	96,80	1,781	-	0,00	-	17,82	0,87
Атомстройэкспорт	26.05.2009	7,75	860	132	0	0,00	100,00	100,00	1,062	-	0,00	-	7,67	0,40
Металлургия, горнодобывающая, трубная промышленность														
Амурмет-01	26.02.2009	9,80	43		37	1,80	52,00	52,92	3,732	1,49	3,62	722,72	-	0,12
Амурмет-02	26.02.2009	9,15	408		2	0,00	29,95	29,95	3,459	6,97	-7,85	233,66	-	0,96
Амурмет-03	17.04.2009	12,75	821	93	15	0,50	24,01	29,71	3,109	3,84	7,77	-	1146,77	0,25
Белон 01	03.06.2009	9,10	140		4	0,16	86,00	85,55	1,047	-	0,55	54,01	-	0,38
Белон 02	26.02.2009	9,25	1135	225	1	2,67	80,00	80,00	3,523	-	-17,15	-	57,22	0,59
ДиГОС 01	23.06.2009	13,10	1252	160	0	0,00	90,00	90,00	0,790	-	0,00	-	39,55	0,48
Инпром 02	15.01.2009	8,80	547	1	0	0,00	48,60	48,60	4,364	-	0,00	-	35438,71	0,05
Инпром 03	20.05.2009	13,00	854	308	1	0,59	50,00	50,00	1,995	-4,27	2,50	-	161,32	0,80
Кокс 01	15.01.2009	8,95	183		0	0,00	89,00	89,00	4,438	-	-3,70	37,19	-	0,49
Кокс 02	19.03.2009	8,70	1156	428	0	0,00	95,90	94,05	2,813	-	0,00	-	12,93	1,15
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	803	73	9	3,30	73,63	74,77	2,589	-1,73	-15,01	-	184,47	0,20
МаирИнв-03	01.04.2009	11,15	77		3	0,33	45,30	45,27	3,208	-5,73	-40,54	558,16	-	0,21
Максиг 01	12.03.2009	10,00	57		3	0,02	95,00	94,97	3,425	-	4,97	42,89	-	0,16
Метзавод	27.02.2009	8,75	44		20	0,59	93,50	93,68	3,308	2,58	-5,12	63,08	-	0,12
Метсерв-Ф1	27.05.2009	12,00	1225	133	0	0,00	98,50	98,50	1,611	-	0,00	-	16,10	0,42
Мечел Зоб	17.06.2009	8,40	1610	518	27	9,58	69,50	68,90	0,644	-0,45	1,40	-	41,76	1,35
НижЛенИнв2	18.06.2009	13,00	155		0	0,00	90,00	90,00	0,962	-	-14,98	40,03	-	0,43
НМЗ 1 обл.	14.02.2009	13,00	396	213	0	0,00	110,00	110,00	5,414	-	-	-	-	0,76
НОК-02	26.03.2009	15,00	981	617	0	0,00	71,86	97,34	4,714	-	0,00	-	42,79	1,53
РМК-ФИН 01	07.04.2009	8,75	447		0	0,00	100,00	97,75	2,373	-	0,00	10,96	-	1,20
СвобСокол3	26.05.2009	21,00	860	132	1	0,00	50,95	50,95	2,877	-	0,95	-	290,99	0,36
СПК об.01	26.05.2009	14,00	496		0	0,00	98,00	98,00	1,918	-	-	-	-	0,00
ТМК-02 обл	24.03.2009	7,60	69		8	35,79	98,40	98,40	2,353	-	-1,60	15,95	-	0,19
ТМК-03 обл	17.02.2009	9,60	762	398	7	3,03	85,00	84,47	3,893	-	-0,22	-	27,97	1,01
УГМК-УЭМ01	03.03.2009	8,25	1140	412	0	0,00	90,00	90,00	3,029	-	0,00	-	19,28	1,10
ЧТПЗ 01об	17.06.2009	9,50	518		3	53,21	79,00	68,55	0,729	-11,45	-7,10	44,92	-	1,34
ЧТПЗ 03об	28.04.2009	10,00	2288	286	0	0,00	84,20	84,10	2,137	-	-4,89	-	34,27	0,76
Нефтегазовая отрасль														
Альянс-01	18.03.2009	8,92	973	245	0	0,00	99,10	99,10	0,000	-	-	-	15,60	1,82
АСПЭК-01	01.04.2009	13,00	441	77	0	0,00	100,00	97,50	0,499	-	-	-	12,93	0,35
ГАЗПРОМ А4	11.02.2009	8,22	392	67	67	60,42	98,76	98,84	3,468	0,34	1,77	9,59	-	1,02
ГАЗПРОМ А6	05.02.2009	6,95	204		9	1,78	98,14	97,96	3,047	-0,03	-0,50	11,08	-	0,54
ГАЗПРОМ А7	30.04.2009	6,79	288		2	0,00	96,20	96,25	1,414	-0,15	-1,52	12,23	-	0,77
ГАЗПРОМ А8	30.04.2009	7,00	1016		0	0,00	91,00	91,00	1,458	-	0,00	11,06	-	2,57
ГАЗПРОМ А9	18.02.2009	7,23	1855		0	0,00	96,99	96,99	2,912	-	-1,78	8,12	-	4,21
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	701	155	1	0,00	80,00	80,00	0,888	-3,00	-5,00	-	73,06	0,42
ГЭС 01	24.06.2009	8,00	1253		0	0,00	54,12	54,12	0,460	-	-45,88	32,74	-	2,89
ГЭС 02	28.04.2009	10,75	1560	286	0	0,00	80,00	80,00	2,297	-	-11,14	-	47,98	0,76
ИнтеграФ-1	20.03.2009	10,50	65		18	1,05	87,00	87,41	3,366	1,73	12,12	89,45	-	0,18
ИнтеграФ-2	02.06.2009	10,70	1049	321	1	4,54	77,00	77,00	1,261	-5,00	-0,90	-	50,12	0,85
КмплФин 01	05.02.2009	15,50	386	22	0	0,00	70,01	70,01	6,795	-	0,00	-	668,00	0,13
ЛукойлЗобл	19.05.2009	7,25	307		0	0,00	96,60	96,60	1,132	-	0,33	11,89	-	0,83
ЛукойлЗобл	11.06.2009	7,10	1058		0	0,00	80,72	85,42	0,661	-	5,54	13,76	-	2,63
ЛукойлОбл	11.06.2009	7,40	1786		6	0,00	77,93	76,65	0,689	1,65	-7,13	14,67	-	4,04
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	701	155	2	0,00	70,00	70,00	0,962	-	-3,92	-	117,87	0,42
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	1257		3	36,26	40,02	40,01	0,532	-9,93	-46,32	68,99	-	1,91
Мособлгаз1	14.05.2009	12,00	853		1	0,00	80,00	80,00	2,005	-	-	25,06	-	2,02
НКАльянс1	18.03.2009	8,92	973	245	0	0,00	63,00	70,00	2,908	-	0,00	-	117,40	0,68
РуссНефть1	12.06.2009	12,00	695		0	0,00	70,00	70,00	1,085	-	0,00	-	-	0,00
Сахатрнф1	03.06.2009	12,50	322		0	0,00	94,50	94,50	1,438	-	-	19,57	-	0,92
СтрТрГаз02	16.01.2009	8,49	1276		0	0,00	62,00	61,86	4,187	-	0,00	27,11	-	2,82
ТОАП-Фин01	11.06.2009	16,00	330		0	0,00	55,00	81,44	1,490	-	0,00	-	224,78	0,46
Топпромин1	16.01.2009	16,50	457	93	0	0,00	100,00	99,98	4,023	-	0,00	-	17,55	0,29
УфайолОП-1	16.04.2009	13,00	456	92	0	0,00	100,00	100,00	3,205	-	-	-	12,60	0,48
ФазтонаФ 1	29.01.2009	13,50	197		3	0,02	98,00	99,19	6,177	-0,81	4,19	15,65	-	0,51

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена			Изм срвзв		Доходность по		Дюрация: лет
			погашения	оферты			посл	ср взв	НКД (%)	день	неделя	погашение	оферта	
Пищепром														
АгрикаПП 1	31.03.2009	13,50	258		2	0,00	11,60	11,68	3,921	-	-2,45	2086,26		0,59
Агроком 01	23.06.2009	20,00	888	160	1	0,12	90,00	90,00	1,205	-	25,00	-	46,94	0,44
Агрохолд 1	16.01.2009	16,00	191		0	0,00	6,00	6,34	3,901	-	-2,16	26306,11		0,31
Аладушкин2	27.05.2009	12,30	1043	315	1	0,01	83,90	83,90	1,651	23,90	13,80	-	38,54	0,83
Аркада-02	20.02.2009	13,31	37		10	0,02	44,85	36,72	5,323	1,63	6,72	1516,45		0,10
Аркада-03	02.04.2009	17,00	806	260	0	0,00	16,00	14,18	4,844	-	-0,83	-	1360,35	0,60
Аркада-04	27.05.2009	15,00	1225	133	1	0,00	42,60	42,60	2,014	-	2,68	-	386,70	0,36
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	337		1	0,00	32,18	32,18	1,863	9,18	6,16	374,61		0,77
БородинФ-1	17.06.2009	10,50	336		0	0,00	94,20	94,20	0,805	-	0,00	18,29		0,90
ВБД ПП 2об	17.06.2009	9,00	700		1	1,83	84,00	84,00	0,690	-	-16,00	20,30		1,78
ВБД ПП 3об	04.03.2009	9,30	1505	49	1	0,21	99,90	99,90	3,389	0,90	0,15	-	9,72	0,13
ВостСервФ1	12.03.2009	10,99	239		3	0,04	72,74	73,40	3,764	-	-10,54	78,57		0,62
ВТК 1	19.06.2009	0,00	338		0	0,00	25,60	25,77	1,068	-	-1,23	-		0,00
Держава-Ф	27.01.2009	16,50	559	16	0	0,00	19,67	19,54	7,640	-	5,49	-	#####	0,05
ДжейЭфСиг1	23.04.2009	13,00	1009		0	0,00	97,99	98,11	2,956	-	0,00	-		0,00
ДымКолБПр1	01.05.2009	0,10	289		0	0,00	100,00	100,00	0,021	-	-	0,10		0,97
ЗавГросс01	15.01.2009	13,75	463	92	0	0,00	50,50	50,25	3,390	-	0,00	-	1620,37	0,28
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	336	155	2	0,01	93,99	93,99	0,904	-	-5,01	-	31,13	0,42
ЛекФин 2об	17.02.2009	5,00	34		0	0,00	93,10	93,10	2,027	-	-	32,57		0,27
МельнКомб	26.02.2009	0,00	43		0	0,00	99,00	99,00	0,000	-	-	1,87		0,54
Митлэнд-01	17.02.2009	15,00	398	34	0	0,00	89,00	89,00	2,342	-	0,00	-	145,71	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	338		0	0,00	99,90	99,90	1,033	-	0,00	15,13		0,93
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	146		3	0,01	63,00	64,82	1,085	-	-26,13	231,48		0,39
ОбКондФ-01	20.05.2009	7,70	1218	490	0	0,00	52,00	52,00	1,181	-	0,00	-	78,55	1,30
ОбКондФ-02	22.04.2009	10,40	1554	98	0	0,00	95,00	95,00	2,393	-	-2,33	-	29,80	0,27
ОГО-агро-2	25.02.2009	12,95	42		34	0,72	80,00	79,94	5,003	3,54	23,45	220,48		0,12
ОГО-агро-3	03.07.2009	15,00	541	170	11	0,31	30,00	39,57	0,493	-	-0,43	-	542,07	0,47
ОХЗ-Инв 01	18.02.2009	14,50	308		0	0,00	96,00	95,87	2,225	-	0,00	21,19		0,83
ПАВА 02 об	03.02.2009	12,50	1010	110	0	0,00	84,00	80,37	2,397	-	-3,95	-	101,74	0,30
Парнас-М 2	19.02.2009	10,80	1037	309	0	0,00	31,95	36,45	1,627	-	-	-	353,18	0,91
ПИВДОМ 01	23.04.2009	16,00	463	281	0	0,00	99,98	99,98	3,638	-	-	-	16,56	0,94
РазгуляйФ2	31.03.2009	12,00	986	76	0	0,00	100,00	100,00	3,485	-	0,00	-	11,60	0,27
РазгуляйФ3	20.03.2009	10,99	1157	65	7	0,33	86,00	86,86	3,523	-0,14	-6,72	-	100,09	0,18
РазгуляйФ4	27.05.2009	11,70	1589	133	1	0,00	84,99	84,99	1,571	-	10,03	-	61,10	0,36
РЕСТОРАНС3	29.05.2009	12,00	681	135	0	0,00	55,00	55,00	1,545	-	0,00	-	236,39	0,41
Рост-Лайн1	09.07.2009	14,50	540	176	0	0,00	69,90	69,90	0,238	-	-9,10	-	109,67	0,49
РубПлсPer1	02.06.2009	20,00	503		0	0,00	95,00	95,00	2,356	-	-	25,67		1,34
РусМасла-2	02.04.2009	15,00	1170	442	1	0,00	16,80	16,80	4,274	-	2,60	-	449,45	0,91
РусМоре-01	19.03.2009	12,70	1247	155	2	0,01	73,90	73,90	0,939	13,52	-0,51	-	132,43	0,42
РусТекс 2	05.03.2009	12,75	50		4	1,07	36,99	32,00	4,610	3,55	-19,60	1390,76		0,14
РусТекс 3	21.04.2009	14,50	279		3	0,02	30,40	31,31	3,377	-	-7,20	428,35		0,70
Санвэй 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	211		6	329,62	89,90	80,01	3,353	-	14,34	59,06		0,56
СахарКо 01	12.05.2009	14,00	300		0	0,00	30,97	30,97	2,455	-	-14,03	382,72		0,76
Синергия-1	22.04.2009	12,50	98		0	0,00	113,94	113,92	2,877	-	0,00	-		0,00
Синергия-2	22.01.2009	10,70	554	8	0	0,00	95,00	95,00	5,101	-	0,00	-	238,56	0,06
СодружФ-1	23.04.2009	10,45	281		1	7,24	79,80	63,90	2,376	-	0,00	93,82		0,78
СОРУС КАП1	05.02.2009	16,00	295		0	0,00	12,98	12,98	3,025	-	-	1266,63		0,71
СОРУС КАП2	09.04.2009	13,00	1177	85	0	0,00	37,68	37,68	0,214	-	-	-	740,51	0,35
ТалостоФ-1	06.03.2009	10,00	51		14	0,45	75,00	75,00	3,589	-12,48	1,25	240,39		0,14
Черемушки	02.03.2009	13,30	47		0	0,00	95,00	95,00	4,919	-	0,00	38,05		0,21
Черкизово1	02.06.2009	8,85	867	139	0	0,00	86,50	86,95	1,043	-	0,00	-	50,60	0,42
Эрконпрод1	12.03.2009	17,00	239	57	0	0,00	91,50	91,50	5,822	-	0,00	-	73,40	0,16
ЭФКО-02 об	23.01.2009	12,00	373	9	0	0,00	83,98	83,98	5,688	-	5,15	41,54	737,95	0,03
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	965	237	0	0,00	76,00	75,75	3,392	-	-2,19	-	67,92	0,62
Потребительские товары, розничная торговля														
7Контин-02	18.06.2009	7,80	1247	155	54	38,09	73,02	72,15	0,577	0,13	2,15	-	96,92	0,42
АвтомирФ-1	03.03.2009	1,00	230		0	0,00	100,00	100,00	0,367	-	-	1,00		1,68
АвтомирФ-2	24.06.2009	0,10	525	161	0	0,00	99,73	99,74	0,006	-	0,00	-	0,71	0,48
АЛПИ-Инв-1	20.02.2009	18,00	219		2	0,00	0,01	0,01	7,151	0,00	0,00	56197,39		0,27
Алькор-01	09.06.2009	9,55	328		0	0,00	95,00	95,00	0,942	-	-0,89	16,29		0,88
АптЗбИ об	30.06.2009	9,89	167		32	0,81	50,00	50,39	0,406	0,11	0,50	232,93		0,46
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	282	100	6	3,58	0,53	0,53	2,696	-0,13	-0,31	-	11626,37	0,27
БАНАНА-М-2	12.02.2009	11,50	575	29	1	0,00	1,30	1,30	4,821	-0,32	-1,14	-	20482,76	0,08
Бахетле-1	20.05.2009	16,00	490	126	1	0,00	99,90	99,90	2,455	-	-0,05	-	15,91	0,35
Бразерск 1	20.03.2009	15,00	345		0	0,00	90,00	90,00	1,068	-	0,00	29,56		0,94
Вежа-Инв-1	03.03.2009	14,00	412	48	0	0,00	67,20	67,20	5,140	-	11,20	-	437,52	0,13
Виват-фин1	21.04.2009	12,10	461		1	0,01	95,30	95,30	2,818	-	0,30	-		0,00
ВикторияФ	29.01.2009	10,40	15		25	48,14	98,50	98,50	4,758	0,50	-0,21	45,43		0,04
ВикторияФ2	17.02.2009	10,89	398		2	0,00	53,50	54,43	4,416	3,42	9,43	97,77		0,97
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	701	155	1	0,00	80,00	80,00	0,888	-3,00	-5,00	-	73,06	0,42
ГорСупер-1	20.01.2009	11,50	188		0	0,00	80,00	90,00	2,678	-	0,00	35,90		0,53
ДиксиФин-1	19.03.2009	9,25	792		2	0,62								

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена		НКД (%)	Изм срвзв цены		Доходность по срвзв цене, % год		Дюрация: лет
			погашения	оферты			посл	ср взв		день	неделя	погашения	оферта	
ИнкомЛада2	13.02.2009	12,50	394	30	2	0,00	3,06	3,00	2,089	-0,98	0,43	-	23148,80	0,08
ИнкомЛада3	13.03.2009	11,00	877	149	2	0,00	3,90	3,90	0,995	0,63	1,40	-	#####	0,37
Карус.Ф 01	19.03.2009	12,00	1702		0	0,00	106,10	106,10	3,879	-	0,00	10,60	-	3,68
КОПЕЙКА 02	18.02.2009	8,70	1127	35	5	0,18	96,20	95,34	1,335	0,22	0,26	-	49,55	0,10
КОПЕЙКА 03	18.02.2009	9,80	1127	217	0	0,00	95,00	95,00	1,504	-	0,00	12,25	28,09	0,62
КОРА УК 01	14.04.2009	11,00	181		0	0,00	99,99	99,99	0,030	-	-	11,46	-	0,77
Лаверна 01	09.04.2009	16,00	449		0	0,00	100,00	100,00	4,252	-	-	-	-	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	1164	436	1	0,00	54,00	54,00	2,471	-0,62	-0,70	34,94	84,21	2,62
Магнолия-1	22.01.2009	15,00	554	8	0	0,00	98,00	98,00	3,411	-	1,00	-	104,78	0,03
МартаФин 2	06.06.2009	12,00	326		0	0,00	96,31	96,31	1,282	-	-	16,23	-	1,05
МартаФин 3	31.01.2009	15,50	930		1	0,00	0,01	0,01	7,007	-	0,00	8776,25	-	0,11
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	308		0	0,00	100,10	100,10	1,918	-	-	-	-	0,00
МонеткаФ-1	14.05.2009	12,50	120		1	0,00	80,00	80,00	2,123	-	13,00	89,30	-	0,33
МОСМАРТФ 1	16.04.2009	17,00	1184	274	0	0,00	75,00	75,00	4,192	-	-	-	73,24	0,71
НатурПрод2	16.06.2009	14,50	153		2	2,99	65,00	65,00	1,152	-	13,84	148,14	-	0,42
НТС-01	28.04.2009	15,00	832	104	0	0,00	32,20	32,20	3,205	-	9,20	-	714,45	0,29
Орхидея 01	09.04.2009	13,00	85		37	0,67	21,49	22,09	0,214	-3,06	-12,15	1558,25	-	0,23
Патэрсон 1	19.03.2009	12,50	337		0	0,00	95,99	95,99	0,925	-	0,00	18,23	-	0,92
ПРОВИАНТ-1														
ПротекФин1	06.05.2009	8,90	1022	294	2	0,05	70,16	70,16	1,707	-0,41	-6,98	-	70,06	0,78
ПятерочкаФ	13.05.2009	11,45	483		0	0,00	109,30	109,30	1,976	-	-	7,88	-	2,49
ПятерочкаФ 2	16.06.2009	9,30	699		0	0,00	103,70	103,70	0,739	-	-	8,15	-	2,88
САМОХВАЛ-1	22.04.2009	14,50	280		0	0,00	41,16	41,16	3,337	-	0,00	249,60	-	0,75
СпартакД2	24.03.2009	16,00	797	251	0	0,00	100,00	100,00	4,953	-	0,00	-	16,52	0,69
СпортМ-Ф-1	22.05.2009	17,00	492	128	0	0,00	99,90	99,90	2,515	-	-	-	16,88	0,50
ТехИнвст-1	28.05.2009	12,50	862	134	0	0,00	98,65	98,65	1,644	-	-	-	16,13	0,68
Топкнига-1	05.02.2009	0,00	22		0	0,00	91,00	91,00	0,000	-	0,00	95,00	-	0,10
Топкнига-2	11.06.2009	20,00	694		0	0,00	74,99	75,00	1,863	-	0,00	43,50	-	1,64
УНИКУМ-Ф 1	16.06.2009	18,00	335		0	0,00	99,00	99,00	1,430	-	-	-	-	0,00
ХолидФин1	02.04.2009	13,00	442		0	0,00	94,68	94,68	3,704	-	-	18,01	-	1,37
Строительство, стройматериалы														
АдаманФ2об	19.02.2009	16,00	491	127	0	0,00	100,00	100,00	2,411	-	-	-	16,92	0,45
Востокцем1	21.05.2009	11,00	309		0	0,00	94,00	94,00	1,658	-	0,00	19,36	-	0,87
ДКС ФЖС-1	26.05.2009	12,00	314		0	0,00	99,95	99,93	1,644	-	-	12,40	-	1,33
Железобет1	20.02.2009	14,00	863	128	10	0,60	54,55	54,79	2,071	4,57	-13,77	-	548,20	0,34
ЖК-Финанс1	19.03.2009	20,00	344		2	0,24	70,00	70,00	1,479	-	0,00	83,83	-	0,84
ИнкомФин01	28.03.2009	13,50	73		6	0,03	48,00	45,71	4,068	5,71	18,06	572,45	-	0,20
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	141		1	0,00	35,00	35,00	1,507	-	0,00	1659,53	-	0,37
КосмосФин1	18.06.2009	13,50	883	155	0	0,00	100,00	100,00	0,999	-	0,00	-	13,37	0,48
ЛСР-Инв 01	02.06.2009	10,70	328		2	0,45	46,00	46,00	1,261	-0,07	-49,00	172,51	-	0,84
ЛСР-Инв 02	15.01.2009	8,35	911	183	0	0,00	85,00	84,10	4,141	-	0,00	-	50,07	0,52
ЛСР 02 обл	05.02.2009	13,25	1660	386	0	0,00	55,02	55,02	5,808	-	-20,41	-	104,35	0,92
Метрострой	27.03.2009	11,70	982	72	4	17,82	91,00	91,08	3,526	0,58	1,05	-	60,64	0,20
МИАН-Дев-1	03.03.2009	13,00	412	48	0	0,00	70,00	70,00	4,773	-	-	-	322,47	0,25
М-ИНДУСТР	17.02.2009	12,25	944		22	1,08	22,15	22,00	4,967	3,53	8,52	129,39	-	1,57
МинплитаФ1	24.04.2009	16,00	828	282	1	0,00	45,00	45,00	3,595	-	10,56	-	230,80	0,71
Миракс 02	19.03.2009	10,99	246		7	0,68	35,20	35,98	3,553	-1,46	-2,60	405,12	-	0,62
МИЭЛЬ-Ф 01	14.07.2009	16,50	545	181	1	0,00	80,00	80,00	0,045	-	-	-	71,00	0,50
ММ-Фин 02	07.07.2009	16,50	1266	174	0	0,00	80,00	80,00	0,362	-	-	-	72,74	0,62
МОИА 01	21.06.2009	9,00	706		0	0,00	78,20	78,10	0,592	-	-	28,61	-	1,39
МОИА 02	08.03.2009	7,99	966		0	0,00	82,00	81,95	2,824	-	-	18,47	-	2,10
МОИТК-01	27.03.2009	9,00	255		0	0,00	24,82	24,82	2,713	-	-5,48	689,34	-	0,65
МОРЕ-П 01	03.02.2009	15,50	566		0	0,00	89,10	89,05	6,879	-	0,00	-	42,95	0,56
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	301		0	0,00	98,99	99,35	2,503	-	0,00	15,85	-	0,83
РУБИН-01	14.04.2009	12,00	272		0	0,00	99,06	99,02	3,025	-	0,00	13,70	-	0,78
Сенат.УК-1	22.05.2009	15,25	1220	128	0	0,00	50,01	50,01	2,256	-	-7,56	-	301,92	0,35
СибАкИнв-1	30.01.2009	12,30	562	16	3	0,02	80,00	80,46	5,594	2,96	-1,61	-	547,41	0,04
СибакСтр01	12.05.2009	14,50	118		1	0,00	70,00	70,00	2,542	-	-2,50	147,91	-	0,32
СпецСтр2 1	21.05.2009	19,00	491		0	0,00	99,00	99,00	2,863	-	-	-	-	0,00
СтрТрГаз02	16.01.2009	8,49	1276		0	0,00	62,00	61,86	4,187	-	0,00	27,11	-	2,82
СтрТрГаз03	16.04.2009	11,25	1548	92	6	2,80	95,00	95,75	2,774	3,60	-0,40	-	31,80	0,25
СУ-155 Зоб	18.02.2009	13,00	1127	35	45	2,49	92,05	92,03	5,236	-0,97	1,19	-	98,58	0,10
СуварКаз-1	31.03.2009	15,25	76		1	0,01	97,50	97,50	4,429	-	-2,44	26,74	-	0,21
Сэтл Групп1	19.05.2009	11,70	1217	125	10	0,33	52,00	51,82	1,827	-	-12,16	42,19	292,98	0,34
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	1024		0	0,00	97,78	97,77	2,236	-	-	-	-	0,00
ТехНикольФ	12.03.2009	9,70	1148	239	5	1,03	63,00	63,00	3,322	1,00	0,46	-	122,75	0,62
ТНИКОЛЬ-Ф1	13.05.2009	15,10	301	121	0	0,00	99,95	99,95	2,606	-	-	-	15,37	0,00
ЦУН 02 обл	21.01.2009	11,75	371		0	0,00	97,50	95,79	5,634	-	-	16,50	-	1,06

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена		НКД (%)	Изм срвзв цены		Доходность по срвзв цене, % год		Дюрация: лет
			погашения	оферты			посл	ср взв		день	неделя	погашение	оферта	
Телекоммуникации														
Арктели 01	16.01.2009	12,00	184		0	0,00	99,80	99,80	5,918	-	-	12,58		0,85
Арктели 02	13.04.2009	13,75	1181	453	0	0,00	100,03	100,03	3,503	-	-	-	14,14	1,40
ВлгТлкВТ-2	02.06.2009	13,00	685		0	0,00	99,70	99,70	1,531	-	0,00	-		0,00
ВлгТлкВТ-3	02.06.2009	8,50	685		0	0,00	100,00	100,00	1,001	-	13,97	8,67		1,08
ВлгТлкВТ-4	10.03.2009	7,99	1693	237	2	8,34	95,70	95,60	0,788	-	-0,35	-	15,92	0,63
ДальСвз2об	03.06.2009	8,85	1232	504	4	2,16	90,00	90,00	1,018	-	-4,90	-	18,54	1,24
ДальСвз3об	03.06.2009	8,60	140		0	0,00	100,00	100,00	0,990	-	-0,98	8,51		0,39
МГТС-04 об	22.04.2009	7,10	98		0	0,00	98,00	98,00	1,634	-	0,00	13,34		0,33
МГТС-05 об	26.05.2009	7,10	496	132	0	0,00	99,01	99,01	0,973	-	-	-	102,02	0,85
МТС 03	23.06.2009	8,70	3436	524	4	4,10	88,00	88,00	0,524	-	-3,18	-	19,45	1,37
РАДИОНЕТ-2	25.03.2009	16,50	798	252	0	0,00	70,00	70,00	5,063	-	0,00	-	96,71	0,70
СЗТелек3об	26.02.2009	8,60	771		0	0,00	85,00	89,50	1,131	-	0,00	16,75		1,57
СЗТелек4об	12.03.2009	8,10	1058		1	17,36	86,05	86,05	0,755	-	-13,95	17,06		1,90
СЗТелек5об	24.02.2009	15,00	1588	496	0	0,00	85,01	85,03	2,055	-	-8,07	-		0,00
СибТлк-6об	19.03.2009	9,75	610		0	0,00	79,40	82,47	3,152	-	0,00	23,74		1,58
СибТлк-7об	20.05.2009	8,65	126		4	8,93	98,70	98,07	1,327	-0,59	-0,50	14,33		0,35
Синтерра 1	05.02.2009	11,00	1660	204	11	16,91	88,10	88,10	4,822	-1,10	-3,64	-	39,59	0,53
Система-01	12.03.2009	9,45	1513	57	4	5,85	98,75	98,59	3,236	-0,38	-0,60	-	17,12	0,16
СМАРС 03	31.03.2009	14,10	258		1	0,02	90,00	90,00	4,095	0,00	5,00	33,05		0,67
УрСИ сер06	21.05.2009	13,00	1037	309	0	0,00	100,00	100,00	1,959	-	-	-	38,22	0,96
УрСИ сер07	17.03.2009	8,40	1154	62	3	75,29	99,50	99,50	2,762	0,00	-0,50	-	11,09	0,17
УрСИ сер08	08.04.2009	9,60	1540	448	0	0,00	86,00	86,00	2,578	-	-13,80	-	24,66	1,16
ЦентрТел-4	19.02.2009	13,80	219		3	0,17	99,50	99,48	5,558	-0,10	-0,26	15,20		0,57
ЦентрТел-5	03.03.2009	9,30	958		0	0,00	89,00	89,03	3,414	-	0,00	16,02		1,94
ЦНТ-03 обл	01.04.2009	9,75	77		5	0,07	99,00	99,00	0,374	0,00	-0,40	14,58		0,21
ЮТК-03 об.	10.04.2009	8,50	269		0	0,00	91,66	91,73	2,259	-	-0,27	21,79		0,72
ЮТК-04 об.	11.03.2009	10,00	329		10	1,12	92,50	91,99	0,958	0,28	-1,40	25,93		0,62
ЮТК-05 об.	03.06.2009	7,55	1232	504	0	0,00	84,00	84,00	0,869	-	0,98	-	22,68	1,33
Транспорт														
ДВТГ-Ф 01	03.02.2009	10,75	566	20	0	0,00	76,68	76,68	4,771	-	-19,32	-	535,71	0,06
ДВТГ-Ф 02														
КДавиаФин1	22.04.2009	18,00	462	98	6	0,83	58,95	58,70	4,142	9,70	28,70	-	270,86	0,27
РЖД-03обл	03.06.2009	8,33	322		0	0,00	99,55	99,55	0,959	-	2,56	9,05		0,87
РЖД-05обл	22.01.2009	6,67	8		0	0,00	99,94	99,94	3,180	-	-0,11	8,85		0,02
РЖД-06обл	13.05.2009	7,35	665		1	0,00	95,47	95,47	1,269	-	1,97	10,38		1,72
РЖД-07обл	13.05.2009	7,55	1393		0	0,00	100,00	100,00	1,303	-	0,00	7,69		3,40
Сибирь-01	20.01.2009	10,70	1280	6	37	94,84	74,89	69,62	5,159	2,60	-8,17	-	1921,61	0,02
ТрансаэрФ	05.02.2009	10,66	22		14	0,91	97,85	98,05	4,673	0,01	0,50	41,86		0,06
ТрансКонт1	03.03.2009	9,50	1504	48	1	0,12	98,25	98,25	3,488	-0,20	-0,45	-	22,42	0,13
Усть-Луга1	12.02.2009	9,90	393		1	0,00	83,99	83,99	1,682	-	-16,01	30,55		1,01
ЭйрЮнион01	10.02.2009	11,00	300		16	0,01	0,51	0,49	1,929	-0,07	-0,28	#####		0,07
ЮТэйр-Ф 03	16.06.2009	16,00	699	335	0	0,00	95,00	95,00	1,271	-	0,00	-	23,49	0,93
Финансовый сектор														
АВТОВАЗБ-1	03.04.2009	13,70	443	170	0	0,00	87,00	84,15	0,450	-	0,00	-	54,92	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	383		0	0,00	96,25	96,25	5,003	-	0,00	15,38		1,01
АИЖК 3об	15.01.2009	9,40	639		0	0,00	93,75	94,51	2,343	-	0,00	15,69		1,03
АИЖК 4об	01.02.2009	8,70	1113		0	0,00	95,00	95,00	1,764	-	0,00	11,05		2,69
АИЖК 5об	15.01.2009	7,35	1370		0	0,00	83,30	80,59	1,832	-	0,00	15,83		2,82
АИЖК 6об	15.01.2009	7,40	2008		0	0,00	65,00	64,98	1,845	-	0,00	20,81		3,49
АИЖК 7об	15.01.2009	7,68	2739		0	0,00	60,00	61,23	1,915	-	0,00	20,17		4,22
АИЖК 8об	15.03.2009	7,63	3439	1886	0	0,00	57,31	57,60	0,627	-	-10,39	23,31	25,63	3,74
АИЖК 9об	15.02.2009	7,49	2954	2223	0	0,00	58,61	58,61	1,231	-	2,96	21,35	22,33	4,11
АИЖК 10об	15.02.2009	8,05	3592		7	7,00	55,10	55,10	1,323	-1,40	-2,91	21,61		4,61
АК БАРС-02	22.01.2009	8,00	8		0	0,00	99,80	99,47	3,814	-	-0,53	28,55		0,02
АКИБАНК-1	23.04.2009	14,00	99		0	0,00	95,00	95,00	3,184	-	0,00	30,24		0,32
АльянсФин1	24.06.2009	8,76	1253		0	0,00	99,93	99,92	0,503	-	-	-	9,00	1,43
БалтИнвБ-1	27.01.2009	13,50	832	104	1	0,00	92,00	92,00	2,885	11,00	-2,30	-	53,00	0,28
БанкСОЮ302	05.04.2009	8,37	264		0	0,00	100,95	100,95	2,339	-	0,00	7,19		0,76
БанкСОЮ303	27.04.2009	10,10	838	103	0	0,00	100,00	100,00	2,186	-	-1,72	-	9,88	0,29
БПФ-01	12.02.2009	11,50	29		4	0,00	98,80	99,13	1,953	0,33	2,13	22,21		0,08
ВБРР Обл.	10.04.2009	10,00	270		0	0,00	100,50	100,25	0,164	-	-	10,04		0,82
ВТБ - 4 об	19.03.2009	8,80	64		12	0,85	99,80	99,82	2,845	0,02	-0,09	9,57		0,18
ВТБ - 5 об	22.01.2009	8,60	1737	99	6	42,50	98,89	98,81	1,956	-0,08	-0,06	-	13,45	0,27
ВТБ - 6 об	15.04.2009	8,60	2730	182	9	118,80	97,75	97,44	0,000	-	-0,11	-	14,02	0,49
ВТБ24 01	08.04.2009	9,75	994	266	0	0,00	95,50	95,50	2,618	-	-9,86	-	17,16	0,71
ВТБ24 02	10.02.2009	7,70	1483		0	0,00	99,91	99,91	3,270	-	-	-	8,63	0,18
ВТБ24 03	03.06.2009	8,18	1596	140	0	0,00	97,60	97,62	0,941	-	-1,08	-	14,65	0,39
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	743		2	24,90	81,81	85,71	3,248	-	-14,27	16,16		1,85
ГазпромБ 2	27.05.2009	6,54	1771		0	0,00	99,97	99,97	0,878	-	-	-		0,00
ГЛОБЭКС 01	10.03.2009	10,00	425	55	0	0,00	101,75	101,75	3,397	-	0,00	7,80		1,12
ДельтаКр-1	02.06.2009	7,09	321		0	0,00	96,00	96,00	0,835	-	0,00	12,15		0,90
ЕврокомФК1	19.06.2009	16,00	338		0	0,00	6,61	6,61	1,140	-	-4,39	2279,22		0,80
ЕврокомФК3	19.06.2009	16,00	520		1	0,00	12,79	12,79	1,140	-3,20	-6,93	488,49		1,10
Европлан-1	12.02.2009	14,50	939	575	0	0,00	36,00	35,00	6,078	-	-4,99	-	214,98	0,92
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	33		8	110,01	99,50	99,50	3,448	0,08	-0,20	13,52		0,09
Зенит 3обл	13.05.2009	9,90	1029	119	1	2,61	96,50	96,50	1,709	-0,05	-2,40	-	21,01	0,33
Зенит 4обл	05.04.2009	12,50	447	79										

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена		НКД (%)	Изм срвзв цены		Доходность по срвзв цене,% год		Дюрация, лет	
			погашения	оферты			посл	ср взв		день	неделя	погашение	оферта	день	
КрайИнвБ-1	06.02.2009	12,30	933	205	0	0,00	100,00	100,00	5,358	-	-	-	12,64	0,64	
КрЕврБ-02	30.06.2009	9,00	895	349	0	0,00	100,00	100,00	0,370	-	-	-	9,20	0,93	
МастерБ-3	03.06.2009	13,75	1050	140	1	0,00	90,00	90,00	1,582	-	-	-	43,48	0,38	
МБРР 02обл	02.04.2009	11,50	1534	78	4	15,02	98,52	98,39	0,410	-	0,39	-	18,62	0,21	
МБРР 03обл	27.01.2009	10,00	1560	104	0	0,00	97,30	97,30	2,137	-	0,00	-	21,50	0,34	
МДМ-Банк03	02.04.2009	12,00	260	0	0	0,00	100,15	100,15	3,419	-	0,00	12,08	0,74		
МЗБанк1	18.05.2009	11,65	307	0	0	0,00	98,03	98,02	1,883	-	-	-	14,13	0,99	
МИА-3об	26.02.2009	7,95	1135	43	2	2,02	95,00	95,00	1,045	1,02	-5,00	-	52,47	0,12	
МИА-5об	22.01.2009	10,30	2010	190	0	0,00	105,00	105,00	2,342	-	0,00	-	0,67	0,54	
МКБ 02обл	04.06.2009	11,50	141	0	0	0,00	92,00	92,00	1,292	-	-5,73	34,24	0,39	0,39	
МКБ 03обл	17.06.2009	15,00	518	154	0	0,00	99,75	99,75	1,151	-	0,00	15,76	15,45	0,47	
МКБ 04обл	17.03.2009	11,50	790	62	0	0,00	95,75	95,75	3,781	-	0,00	-	36,69	0,21	
МОИА 01	21.06.2009	9,00	706	0	0	0,00	78,20	78,10	0,592	-	-	28,61	1,39	0,39	
МОИА 02	08.03.2009	7,99	966	0	0	0,00	82,00	81,95	2,824	-	-	18,47	2,10	0,39	
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	762	34	0	0,00	100,00	99,98	5,068	-	-	-	11,90	0,00	
НацКап-01	31.03.2009	11,50	1350	76	0	0,00	100,00	100,00	3,340	-	-	-	11,13	0,34	
НОМОС 7в	16.06.2009	9,25	153	1	1	0,00	95,00	95,00	0,735	-	-1,67	22,12	0,42	0,42	
НОМОС-Лиз1	10.07.2009	12,00	905	0	0	0,00	97,82	97,81	0,164	-	0,00	13,46	2,14	0,41	
НС-фин. 01	23.05.2009	12,75	861	129	0	0,00	102,00	102,00	1,886	-	0,00	-	6,83	0,41	
НФК-2	09.02.2009	1,00	118	0	0	0,00	94,20	94,20	0,181	-	-	14,03	0,49	0,49	
НФК-3	28.04.2009	13,00	839	104	1	0,06	87,50	87,50	2,778	0,02	-2,50	-	62,99	0,28	
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	105	9	9	46,35	92,50	92,11	1,833	-	12,09	38,45	0,29	0,29	
Промсвб-05	21.05.2009	7,99	1219	127	0	0,00	99,50	99,45	1,204	-	0,00	-	9,36	0,39	
ПЧРБ-Фин1	11.03.2009	12,50	784	56	1	0,20	97,00	97,00	1,199	-	5,25	-	32,64	0,15	
РИАТО-01	09.03.2009	13,75	1601	1	1	0,62	99,75	99,75	1,394	-	-0,05	14,56	3,14	0,15	
РИГ групп 02	21.01.2009	15,00	920	190	0	0,00	100,00	99,97	7,192	-	-	-	15,54	0,64	
РМБ	27.04.2009	12,00	103	0	0	0,00	99,17	99,12	2,630	-	0,00	14,52	0,33	0,33	
РОСБАНК-1	15.02.2009	7,70	32	15	15	5,88	99,50	99,81	3,185	-	0,11	9,59	0,09	0,09	
РосселхБ 2	18.02.2009	7,85	763	0	0	0,00	94,00	93,33	1,204	-	0,00	11,92	1,96	1,96	
РосселхБ 3	19.02.2009	7,34	2948	400	3	38,43	91,00	93,01	2,936	4,47	0,01	-	17,33	1,04	
РосселхБ 4	08.04.2009	9,75	3178	266	0	0,00	101,53	101,53	2,618	-	0,00	-	7,66	0,75	
РосселхБ 6	20.02.2009	8,75	3313	37	4	123,86	99,77	99,77	3,476	0,10	-0,08	-	10,67	0,10	
РосселхБ 7	16.06.2009	8,30	3429	153	0	0,00	99,00	99,00	0,659	-	0,00	-	10,72	0,46	
РТК-ЛИЗ 5с	12.02.2009	8,35	575	0	0	0,00	88,88	88,88	3,500	-	0,00	21,06	1,02	1,02	
РусСтанд-5	12.03.2009	13,00	603	239	0	0,00	90,00	90,00	4,452	-	0,00	-	33,21	0,66	
РусСтанд-6	11.02.2009	8,15	756	28	11	14,58	97,30	97,01	3,439	0,14	-0,07	-	43,03	0,08	
РусСтанд-7	24.03.2009	12,20	979	69	0	0,00	93,70	92,29	3,777	-	-6,12	-	46,70	0,19	
РусСтанд-8	17.04.2009	15,00	1185	0	0	0,00	50,00	50,00	3,658	-	0,00	-	0,00	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	119	3	3	23,53	95,75	95,75	1,303	0,75	-0,25	21,21	0,33	0,33	
Русфинанс4	13.02.2009	7,74	394	0	0	0,00	72,00	72,00	3,223	-	-9,00	47,01	1,02	1,02	
РусьБанк-1	19.03.2009	10,00	64	5	5	0,68	98,80	96,52	3,233	0,99	-0,56	29,92	0,18	0,18	
РусьБанк-2	21.02.2009	12,50	404	221	0	0,00	85,00	85,00	4,966	-	0,00	-	47,61	0,63	
СвязьБанк1	22.01.2009	8,90	827	99	0	0,00	94,00	96,83	2,024	-	2,87	-	37,18	0,27	
СевКазна-1	02.04.2009	9,50	260	0	0	0,00	100,18	100,18	0,338	-	-	9,39	0,81	0,81	
СевКазна-2	27.01.2009	12,50	929	195	0	0,00	94,86	93,99	2,671	-	0,00	-	25,03	0,55	
СКБ-банк 1	19.03.2009	12,80	526	155	9	1,37	84,00	86,37	0,932	1,37	6,37	-	71,68	0,42	
Солидарн-1	03.03.2009	12,50	321	0	0	0,00	100,00	100,00	1,473	-	0,00	13,08	0,88	0,88	
Солидарн-2	20.01.2009	14,00	461	97	0	0,00	100,00	100,00	3,260	-	0,00	-	14,73	0,30	
СоцГорБ-01	24.03.2009	13,00	71	1	1	2,04	98,10	98,10	3,989	0,10	-1,28	22,12	0,19	0,19	
СтрКредит1	27.01.2009	13,25	929	195	0	0,00	100,00	99,99	6,135	-	0,00	-	13,66	0,54	
СудострБ-1	02.07.2009	9,85	169	6	6	2,75	84,00	84,23	0,351	-6,74	-0,76	51,91	0,46	0,46	
ТатфондБ 3	17.02.2009	11,75	125	5	5	0,68	92,00	92,02	1,835	0,42	1,44	43,19	0,33	0,33	
ТатфондБ 4	03.06.2009	11,40	868	322	0	0,00	88,50	88,50	1,312	-	1,00	-	28,60	0,86	
ТрансКред3	09.07.2009	9,99	904	358	0	0,00	89,00	89,00	0,164	-	-5,86	-	24,49	0,96	
ТурАлепФ 1	07.04.2009	7,75	265	1	1	523,52	100,00	100,13	2,102	-	-	7,84	2,38	2,38	
УБРиР-Ф 02	02.04.2009	12,50	169	1	1	0,03	82,99	82,99	0,445	4,97	10,99	70,00	0,45	0,45	
УралЛЦ-01	22.04.2009	10,00	287	0	0	0,00	96,15	96,22	2,301	-	-	15,05	0,89	0,89	
УралсиБЛК1	24.06.2009	11,60	714	161	10	3,57	79,56	79,59	0,667	-1,13	-11,33	-	72,22	0,44	
УралсиБЛК2	22.01.2009	12,99	918	372	16	4,86	54,30	53,26	6,192	-0,74	0,98	-	111,07	0,88	
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	141	5	5	0,62	94,40	94,00	1,078	0,90	-3,68	26,43	0,39	0,39	
УРСАБанк 5	21.04.2009	10,05	1007	3	3	0,01	55,05	55,46	2,340	-	-8,73	40,58	2,28	2,28	
УРСАБанк 7	22.01.2009	8,40	1282	372	0	0,00	75,02	80,24	4,004	-	-9,26	-	44,85	0,96	
УРСАБанк 8	16.04.2009	11,19	2276	92	1	0,00	97,10	97,10	2,759	-	-0,90	-	22,73	0,25	
ХКФ Банк-2	12.05.2009	9,25	482	118	5	2,90	92,00	92,84	1,622	0,09	-5,21	-	36,31	0,32	
ХКФ Банк-3	19.03.2009	13,00	610	64	0	0,00	102,70	105,96	0,962	-	0,00	-	0,00	0,00	
ХКФ Банк-4	15.04.2009	13,00	1001	273	4	66,19	95,05	94,88	0,000	-	12,48	-	21,90	0,72	
Центр-инв1	12.05.2009	16,00	301	147	0	0,00	97,70	91,23	2,849	-	0,00	29,90	20,56	0,44	
Экспобанк1	24.03.2009	9,00	349	69	0	0,00	99,50	99,37	0,482	-	-	-	11,97	0,00	
Юниаструм	17.02.2009	11,00	34	4	4	0,01	99,50	99,50	4,460	-0,50	-0,40	15,75	0,09	0,09	
ЮнкрБанк-2	11.02.2009	7,55	28	0	0	0,00	100,00	100,00	3,185	-	-	-	0,00	0,00	
Химия, ЛПК															
АрнеФ-01	29.04.2009	11,00	105	0	0	0,00	98,80	98,80	2,532	-	-	13,76	0,44	0,44	
АЦБК-Инв 3	15.01.2009	9,70	820	92	0	0,00	100,05	100,05	2,404	-	-	-	9,78	0,80	
ВМУ-Фин 01	23.06.2009	16,00	342	0	0	0,00	94,90	94,90	0,964	-	-	-	0,00	0,00	
ГОТЭК-2	18.06.2009	13,00	155	0	0	0,00	73,00	71,50	0,962	-	-1,51	110,02	0,43	0,43	
КуйбАзот-2	06.03.2009	8,80	784	0	0	0,00	73,10	73,10	3,158	-	-6,90	27,61	1,89	1,89	
Миннеско-1	11.06.2009	13,75	330	3	3	0,00	2,50	2,50	1,281	-	-0,19	6245,99	0,74	0,74	
НИКОСХИМ 2	12.02.2009	11,25	218	16	16	1,59	28,00	29,25	1,911	-0,75	-0,78	815,36	0,55	0,55	
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	335	62	2	2,70	29,02	29,02	0,934	-	-10,58	346,27	1424,41	0,17	
НКНХ-04 об	30.03.2009	9,99	1167	75	1	0,10	98,25	98,25	2,929	-	-0,25	-	18,29	0,21	
НЭФ															

Инструмент	Дата купона	Ставка купона, год.	Дней до		Кол-во сделок	Сумма сделок, млн. руб.	Цена		НКД (%)	Изм срвзв цены		Доходность по срвзв цене, % год		Дюрация: лет
			погашения	оферты			посл	ср взв		день	неделя	погашение	оферта	
Энергетика														
БашкирэнЗв	19.03.2009	8,30	784	64	0	0,00	99,50	99,50	0,591	-	0,00	-	11,15	0,21
ГенерКомп1	23.06.2009	9,25	888	160	0	0,00	99,50	99,50	0,558	-	-	-	10,38	0,44
ГидроОГК-1	01.07.2009	8,10	896		15	0,38	72,50	72,83	0,311	-0,36	-1,62	24,58		2,23
ДГК-01	13.03.2009	10,50	1514	58	5	2,00	96,30	96,19	3,567	-	4,56	-	33,83	0,16
ЕЭСК-02	09.04.2009	8,74	1177	89	7	34,13	95,50	95,18	2,323	-	1,18	-	30,93	0,24
Кубаньэн-1	21.01.2009	7,85	553		0	0,00	102,90	102,95	3,764	-	-	4,37		0,84
Ленэнерго2	30.01.2009	8,54	1108		4	1,21	56,01	56,71	3,884	-	-2,77	34,31		2,45
Ленэнерго3	22.04.2009	8,02	1190		2	0,01	56,99	56,99	1,846	0,51	3,98	31,53		2,72
Мосэнерго1	17.03.2009	7,54	972	244	0	0,00	98,00	98,00	2,479	-	0,72	-	10,97	0,65
Мосэнерго2	26.02.2009	7,65	2591	1135	0	0,00	82,00	80,66	2,913	-	0,00	-	15,68	2,73
МОЭСК-01	10.03.2009	8,05	965		7	0,01	74,70	74,70	2,801	-	0,70	22,08		2,31
ОГК-2 01об	02.07.2009	7,70	537		6	66,05	78,06	78,05	0,274	0,86	-0,99	28,63		1,40
ОГК-3 об-1	12.06.2009	8,20	1059		0	0,00	100,00	100,00	0,741	-	-	-		0,00
ОГК-5 об-1	02.04.2009	7,50	988	260	4	0,36	93,65	93,78	2,137	-0,22	-5,22	-	18,05	0,69
ОГК-6 01об	23.04.2009	7,55	1191	463	4	214,12	81,00	81,00	1,717	-	8,67	-	27,72	1,21
ТГК-1 01	17.03.2009	7,75	1882	426	0	0,00	75,00	75,00	2,548	-	-9,80	-	38,88	1,10
ТГК-2 1об	03.03.2009	10,95	930	230	0	0,00	100,00	100,00	4,020	-	-	-	11,20	0,60
ТГК-10 об1	18.06.2009	7,60	519	155	46	25,02	94,25	94,43	0,562	0,41	1,62	-	22,30	0,42
ТГК-4 об.1	04.06.2009	7,60	1233	141	2	27,41	94,98	94,99	0,854	-1,26	-0,21	-	21,49	0,39
ТГК-6Инв-1	24.02.2009	10,00	1133	41	14	768,93	98,50	98,17	1,370	0,67	0,33	-	23,38	0,11
ТГК-8 01	14.05.2009	8,00	1212	120	0	0,00	94,00	92,75	1,359	-	0,00	-	27,53	0,39
Тюменэнрг2	02.04.2009	7,70	1170	442	0	0,00	75,00	75,00	2,194	-	0,00	-	37,60	1,18
ФСК ЕЭС-02	23.06.2009	8,25	524		0	0,00	92,00	92,01	0,497	-	-4,49	15,13		1,38
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	995		0	0,00	80,90	80,90	1,940	-	-2,10	16,88		2,44
ФСК ЕЭС-05	02.06.2009	7,20	321		2	0,02	95,50	97,59	0,848	-	1,10	10,37		0,86
ЭнергоСт-1	22.05.2009	14,75	856	310	0	0,00	100,00	100,00	2,182	-	-	-	15,22	0,00
ЭнергЦент1	09.07.2009	22,00	543		0	0,00	97,00	96,97	0,301	-	0,00	-		0,00
Якутскэн02	12.03.2009	8,59	1149	57	0	0,00	98,59	98,54	2,942	-	0,00	-	17,35	0,21
Прочие														
РКС-01	15.04.2009	1,00	91		0	0,00	102,90	102,95	0,249	-	-	-		0,00
АиФМПфин 1	17.06.2009	14,00	154		1	0,00	85,00	85,00	1,074	3,79	-5,09	57,57		0,42
КАРО 01	23.06.2009	14,30	342	160	1	0,02	80,00	80,00	0,862	-	-18,61	-	74,11	0,44
Интурист-1	22.04.2009	9,00	462		0	0,00	95,80	95,80	2,071	-	0,00	12,96		1,24
ТАИФ-Фин01	12.03.2009	8,42	603		0	0,00	99,80	99,81	2,884	-	-	-		0,00
РБК ИС БО4	24.03.2009	12,25	69		28	0,96	38,75	39,66	9,901	0,22	1,02	668,74		0,19

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	-65,39%	-90,19%	1,89%	-4,99%	-84,91%	-90,21%	41,03	-0,48
Универсальный	Умеренная	10,35%	-32,05%	1,01%	2,57%	-30,00%	-32,59%	14,85	-0,33
Перспективный	Фонд производных инструментов	-92,54%	-92,23%	1,85%	-14,03%	-90,10%	-92,29%	32,87	-1,23
Валютный	Агрессивная	-63,11%	-72,73%	0,64%	-0,49%	-69,89%	-73,58%	23,43	-1,28
Доходный II	Агрессивная	-91,88%	-93,83%	1,96%	-15,67%	-90,70%	-93,85%	35,64	-1,04
Вечные ценности	Индексный фонд золота и серебра	4,04%	-7,33%	2,20%	16,89%	-16,20%	-12,19%	11,23	0,19
RTS USD ***	Индекс РТС	16,19%	-72,63%	-0,80%	3,90%	-71,33%	-72,83%	46,52	-0,08
RTS RUR ***	Индекс РТС рубли	15,24%	-67,22%	-0,76%	9,00%	-64,01%	-67,32%	41,37	-0,10
ZETBI-Corp	Индекс облигаций	50,25%	-0,41%	-0,33%	1,72%	-4,47%	-0,51%	12,62	0,23
Золото	Котировка в ЦБ РФ	50,00%	27,04%	1,75%	19,78%	18,59%	21,48%	11,20	1,70
Серебро	Котировка в ЦБ РФ	-1,96%	-3,51%	7,62%	30,30%	-18,02%	-10,78%	14,01	-0,07

(*) 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

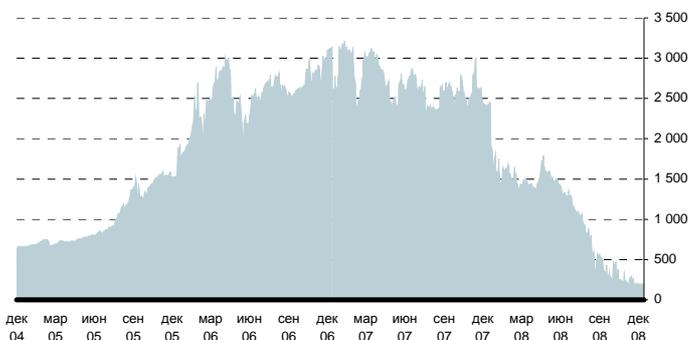
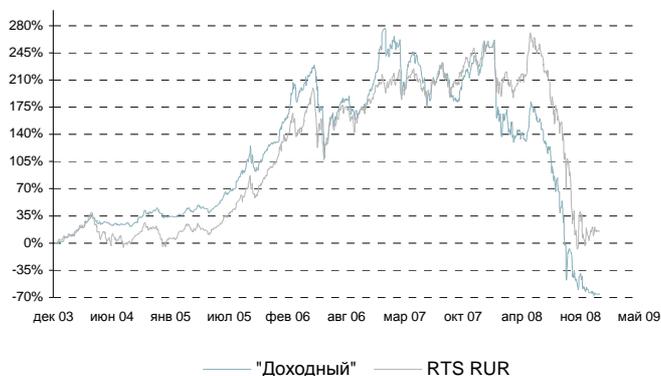
Начало работы ОФБУ "Вечные ценности" - 09.02.2007

(**) 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"

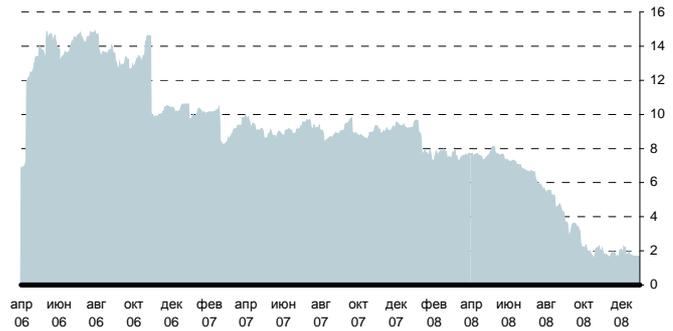
Стоимость чистых активов фонда "Универсальный" млн. руб.



ОФБУ "Валютный"



Стоимость чистых активов фонда "Валютный" млн. дол.



ОФБУ "Перспективный"



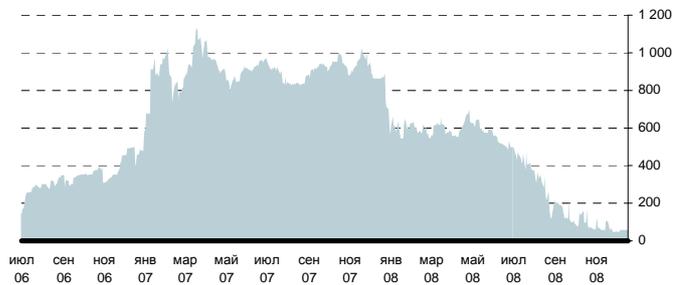
Стоимость чистых активов фонда "Перспективный" млн. руб.



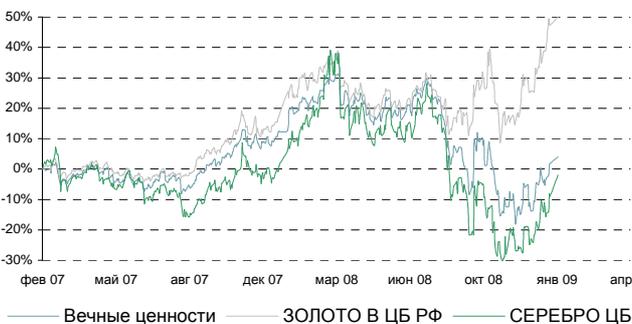
ОФБУ "Доходный II"



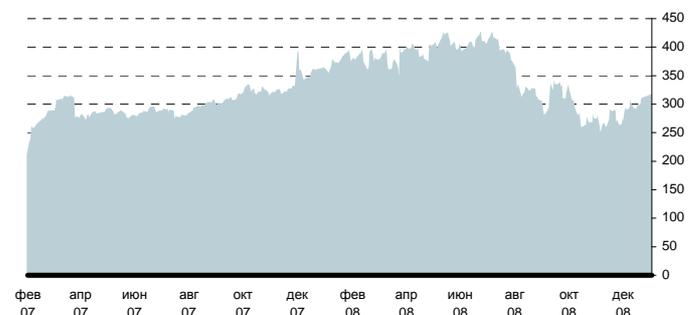
Стоимость чистых активов фонда "Доходный II" млн. руб.



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	Наталья 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

Рублевые облигации	Алексей Балашов	a.balashov@zenit.ru
Рублевые облигации	Степан Ермолкин	stepan.ermolkin@zenit.ru

ibcm@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.