ДОЛГОВОЙ РЫНОК

Ежедневный Обзор

Внешний рынок долга:

- Отскок на фондовом рынке США, рынок US-Treasuries ждет плана Обамы

Денежно-кредитный рынок:

- Рублей по-прежнему не хватает, ЦБ покупает валюту

Оглавление:

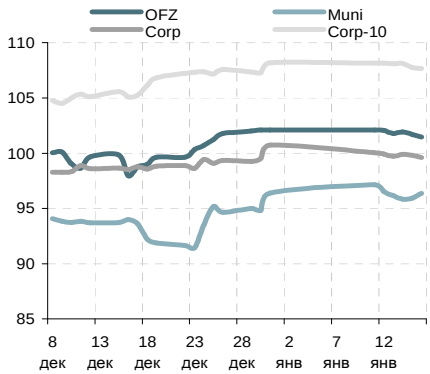
Новости одной строкой	2
Внешний рынок долга	3
Денежно-кредитный рынок	4
Приложения	5

Динамика EMBIG Sovereign Spread



Источник: J.P. Morgan

Динамика ценовых индексов ZETBI



Источник: Банк ЗЕНИТ

БАНК ЗЕНИТ
БАНКОВСКАЯ ГРУППА ЗЕНИТ

Новости одной строкой

Минфин в ходе аукциона по выпуску ОФЗ-ПД серии 25064 на сумму 7 млрд руб. разместил 1.8 млрд руб. Спрос по номиналу составил 7.995 млрд руб. Цена отсечения установлена на уровне 99.01% к номиналу, средневзвешенная цена – 99.4% к номиналу. Доходность по цене отсечения составила 12.88% годовых, доходность по средневзвешенной цене – 12.7% годовых. /Cbonds/

Международное рейтинговое агентство Moody's включило рейтинг ОАО «РЖД» («А3») на пересмотр с возможностью снижения. /Reuters/

Ставка купона по облигациям ЕБРР второй серии установлена в размере 28.5% годовых. /Cbonds/

Ставка 5-6-го купонов по облигациям ООО «Комплекс Финанс» серии 01 установлена в размере 15.5% годовых. /Финам/

Внешний рынок долга

Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Отскок на фондовом рынке США, рынок US-Treasuries ждет плана Обамы

В среду американские фондовые индексы выросли вслед за ростом спроса на изрядно подешевевшие акции финансового сектора. Наибольший рост показали акции Bank of America на фоне сообщений о покупке бумаг топ-менеджментом. Инвесторы также возлагают надежды на новый план Обамы, который, как ожидается, в первую очередь будет направлен на поддержку ипотечных заемщиков. Предварительная стоимость новой стимулирующей программы составляет $825 млрд. Для рынка казначейских обязательств США интрига сохраняется. Если новый президент слишком амбициозно подойдет к вопросу поддержки экономики, то возможное увеличение дефицита бюджета США может привести к снижению привлекательности долларовых активов. Наибольшее давление вчера оказывалось на дальний сегмент кривой US-Treasuries: ставки выросли в среднем на 16-18 б.п.

На рынке Emerging Debt наблюдался сдержанный оптимизм по поводу нового плана поддержки американской экономики. За счет роста доходностей базовых активов индикативный спрэд EMBI+ сократился на 11 б.п. до 678 б.п. В российских суверенных евробондах, однако, вчера доминировали продажи. Цена выпуска Russia'30 снизилась на полфигуры до 80 п.п. Сегодня картину в рисковых долгах могут подпортить данные из Китая: экономика страны в IV квартале 2008 г. сбавила темпы роста с 9% до 6.8% в годовом исчислении. Снижение темпов роста экономики Китая, одного их главных потребителей сырья, может усилить опасения в отношении развивающихся стран.

Денежно-кредитный рынок

Рублей по-прежнему не хватает, ЦБ покупает валюту

Владимир Евстифеев
v.evstifeev@zenit.ru

Ситуация на денежном рынке остается неспокойной: спрос на рубли высок, Центробанк продолжает активно насыщать банки ликвидностью. Вчера ставка MIACR составила 27.6% против 26.3% накануне, однодневные рублевые кредиты на рынке МБК стоили в среднем 20-25% годовых. Объем операций прямого репо с ЦБ снизился на 54 млрд до 610.5 млрд руб.

На валютном рынке продолжилось небольшое укрепление рубля на фоне дефицита ликвидности. На следующей неделе состоится уплата налога на прибыль и НДПИ, для которой банкам потребуется около 250-300 млрд руб. За прошедшие два дня ЦБ впервые за несколько месяцев покупал валюту: около $2 млрд во вторник и $4-5 млрд в среду. Одновременно Центробанк сообщил, что продолжил расширять границы валютного коридора. Новый уровень поддержки ЦБ, вероятно, находится на уровне 38.80 руб., однако, с учетом высокого спроса на рубли, он вряд ли будет достигнут до конца января.

Сегодня утром объем рублевой ликвидности снизился до 542.3(-1.4) млрд руб. Остатки на корсчетах прибавили до 449.7(+10.3) млрд руб., на депозитах снизились до 92.6(-11.7) млрд руб.

Денежно-кредитный рынок – основные события на неделе

Дата	Аукционы ЦБ и Фонда ЖКХ, поступление и возврат средств на счета комбанков, уплата налогов		РЕПО с ЦБ, млрд руб.	
			Лимит*	Спрос
Понедельник	Аукцион ЦБ	30 млрд руб., 3 мес. Размещено 22.7 млрд руб., ставка 13.41%	400	486.2
Вторник	Аукцион ЦБ	50 млрд руб., 5 нед., Размещено 40.3 млрд руб., ставка 14.45%	700	664.7
	Уплата налогов	НДС – 1/3 за IV кв., оценка – 90 млрд руб.		-
Среда	Возврат средств ЦБ	28.9 млрд руб.	600	610.5
	Возврат средств ЖКХ	9 млрд руб.		
Четверг			600	-
Пятница			-	-

Источник: ЦБ, Фонд ЖКХ ** Лимит первого аукциона*

Динамика ценовых индексов ZETBI

	Индекс	день	неделя
Zetbi OFZ	101,16	-0,38%	-0,60%
Zetbi Muni	95,97	-0,38%	-0,20%
Zetbi Corp	99,32	-0,01%	-0,40%
Zetbi Corp10	107,81	0,13%	-0,25%

Источник: Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в субфедеральном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
Мос.обл.9в	20,39	-0,02
ВоронежОб4	14,60	-6,99
Томск.об-7	5,10	0,22
ВоронежОб2	3,01	-0,34
КалужОбл-3	0,73	-12,46

Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Торги и изменения в корпоративном сегменте

Инструмент	Объем, млн. руб.	Изменение цены, б.п.
ТрансКред1	168,20	-1,49
ТГК-10 об2	139,53	0,06
МойБанк 2	98,68	-
ВТБ24 03	84,89	0,2
ГАЗПРОМ А4	76,19	-0,8

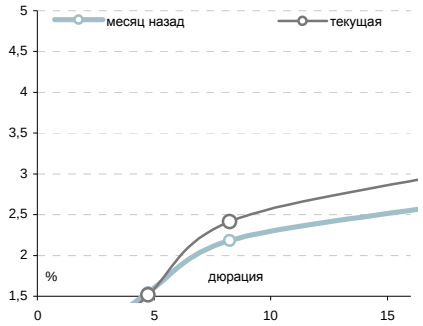
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Приложение 1. Индикаторы мировых рынков

Инструмент	Дата	Значение	Изменение, б.п.		
			день	месяц	год
UST 2 yr	1/20/2009	0,71	-2	-3	-164
UST 10 yr	1/20/2009	2,38	6	25	-125
UST 30 yr	1/20/2009	2,98	11	43	-130
Bund 2 yr	1/20/2009	1,49	-3	-34	-186
Bund 10 yr	1/20/2009	3,02	2	2	-89
Bund 30 yr	1/20/2009	3,83	2	28	-58
Fed Fund	1/16/2009	0,25	0	0	-400
Libor 1 mo	1/19/2009	0,36	0	-12,1	-358
Libor 6 mo	1/19/2009	1,56	-1	-30,0	-221
Libor 12 mo	1/19/2009	1,85	-2	-26	-157
S&P 500	1/21/2009	805,22	-5,28%	-9,31%	-39,24%
Nasdaq Composite	1/21/2009	1440,86	-5,78%	-7,89%	-38,43%
RTS	1/20/2009	514,29	-3,27%	-18,91%	-74,28%
EURUSD	1/21/2009	1,2923	0,15%	-7,32%	-10,59%
USDJPY	1/21/2009	89,77	0,01%	-0,54%	-15,30%
USDRUB	1/21/2009	32,99	-0,01%	15,86%	33,34%
EURRUB	1/21/2009	42,64	0,12%	7,58%	19,21%
Brent 1m Future	1/21/2009	43,42	-0,46%	-1,32%	-50,38%
Gold	1/21/2009	850,90	-0,74%	1,51%	-1,63%

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*	1/20/2009	89,39%	-55	106	255	-2576	9,49	UST10	711
UMS-31*	1/19/2009	115,33%	4	-313	-635	-1363	6,94	UST30	396
Turkey-30*	1/20/2009	142,75%	-124	40	104	-1277	7,73	UST10	535
Venezuela-27*	1/19/2009	57,63%	-8	-167	266	-4286	16,69	UST10	1367
EMBIG	1/20/2009	717	8	17	-8	-8	-	-	-
EMBIG Russia	1/20/2009	752	7	17	-53	-53	-	-	-
EMBIG Brazil	1/20/2009	461	10	14	32	32	-	-	-
EMBIG Mexico	1/20/2009	454	13	32	20	20	-	-	-
EMBIG Turkey	1/20/2009	533	7	12	-1	-1	-	-	-
EMBIG Venezuela	1/20/2009	1750	62	101	-114	-114	-	-	-

* - Quotes

Source: J.P. Morgan, Bloomberg

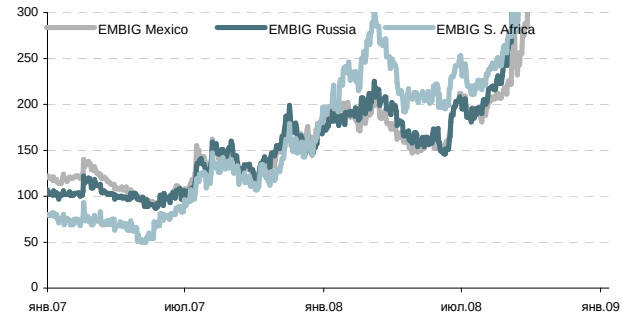
Динамика цен на нефть сорта Brent



И

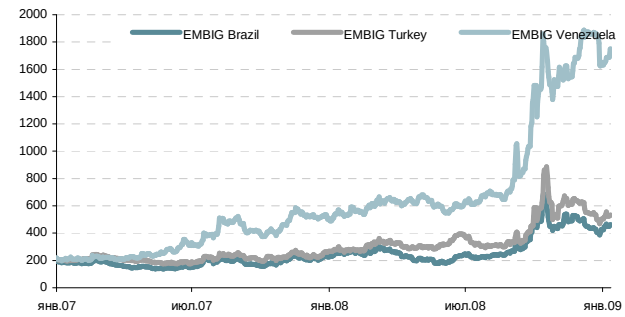
сточник: Bloomberg

Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

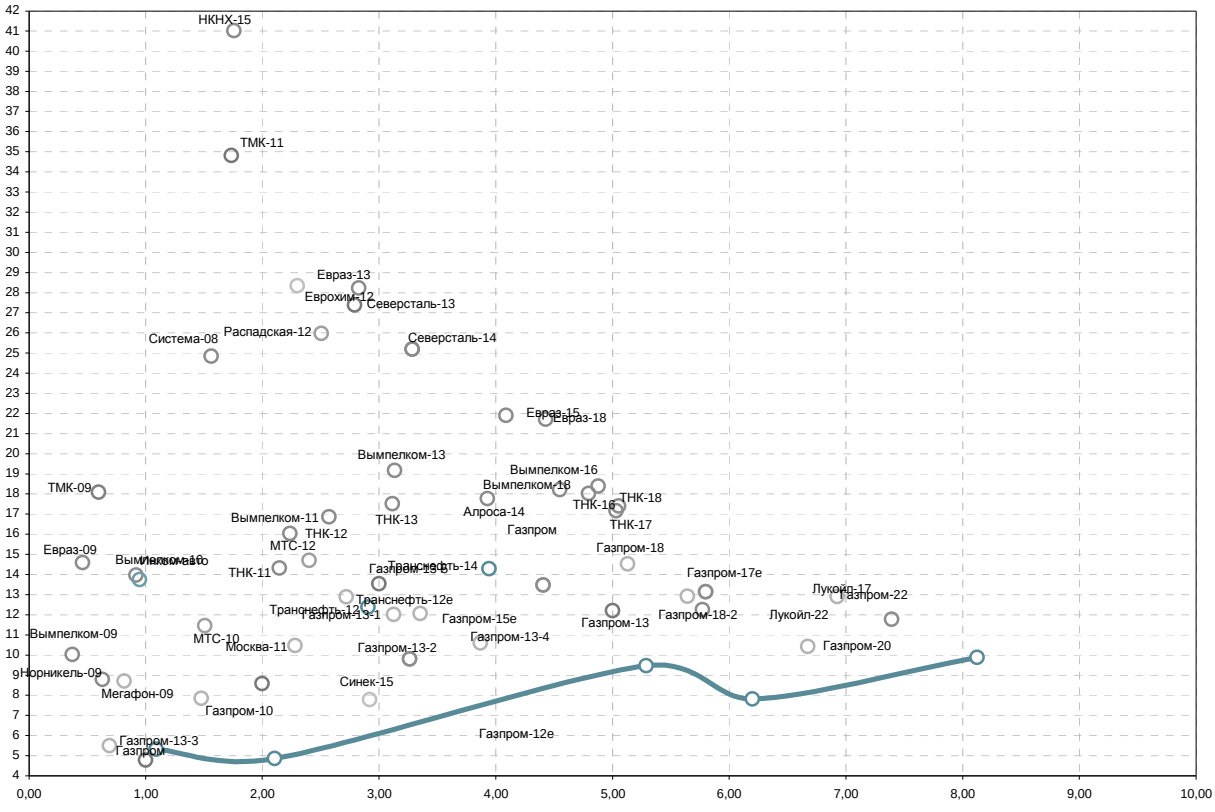
Динамика EMBIG Spread для отдельных сегментов



Источник: J.P. Morgan

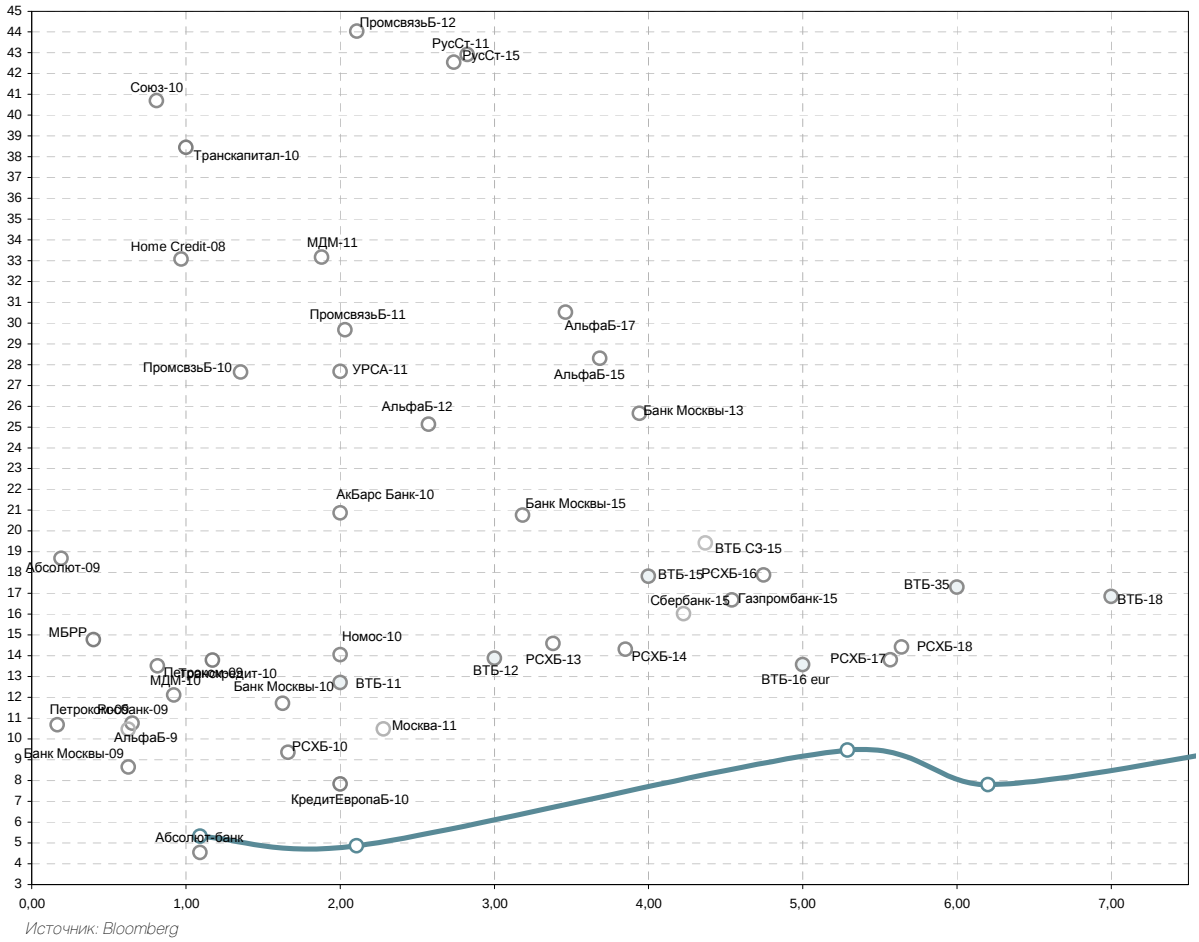
Приложение 2. Российский рынок еврооблигаций

Кривая доходности российских еврооблигаций: Нефинансовый сектор



Источник: Bloomberg

Кривая доходности российских еврооблигаций: Банки



Источник: Bloomberg

Котировки российских еврооблигаций

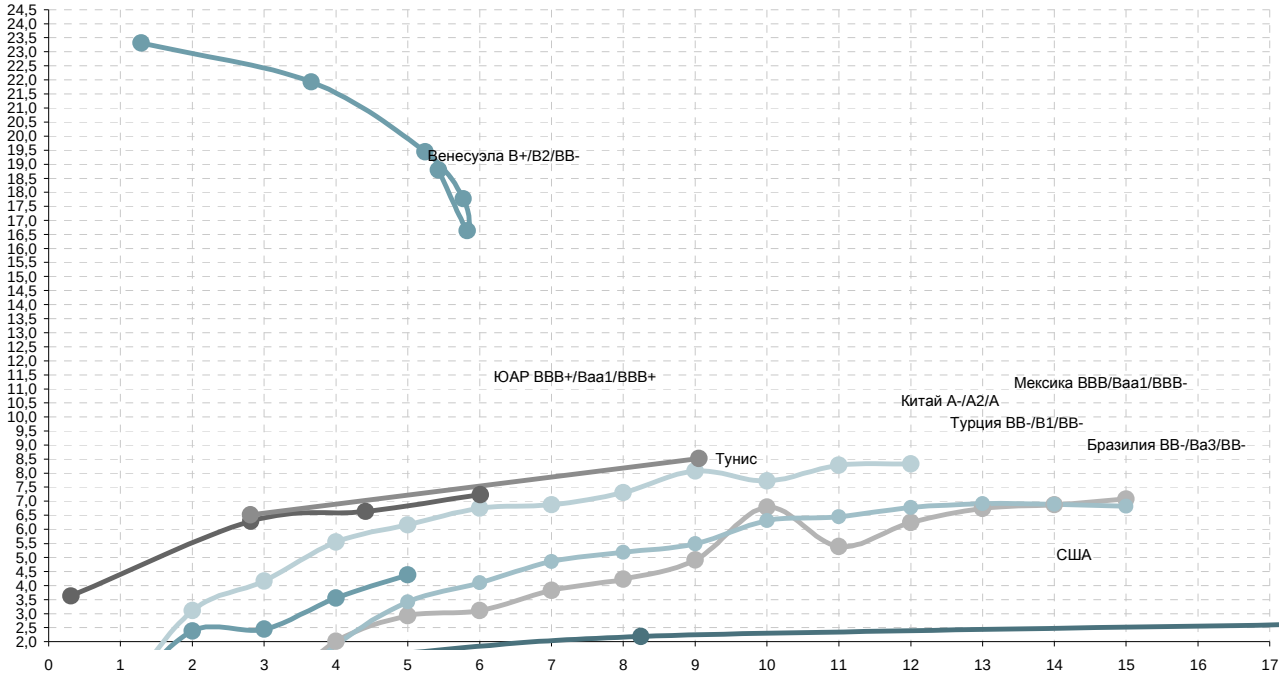
	Maturity	Size, mln	Coupon, %	Rating	Bid	Offer	YTM,%	Modified Duration	Spread to Treasury, bp
Sovereign									
Russia-10 $	3/31/2010	2 767	8,25	Baa1/BBB/BBB+	103,04	103,29	3,28	0,65	496
Russia-18 $	7/24/2018	3 467	11	Baa1/BBB/BBB+	120,62	121,12	7,84	6,20	548
Russia-28 $	6/24/2028	2 500	12,75	Baa1/BBB/BBB+	124,00	124,50	9,91	8,13	720
Russia-30 $	3/31/2030	20 310	7,5	Baa1/BBB/BBB+	89,27	89,52	9,49	5,29	673
Aries-09 EUR	10/25/2009	1 000	7,75	Aaa/AAA	103,90	103,98	2,33	0,73	105
Regional									
Moscow-11 EUR	10/12/2011	374	6,45	Baa1/-/BBB+	90,59	90,84	10,54	2,28	877
Oil & Gas									
Gazprom-09 $	10/21/2009	700	10,5	BBB	103,37	103,55	5,61	0,69	526
Gazprom-10 EUR	9/27/2010	1 000	7,8	BBB/BBB	99,61	99,86	7,93	1,48	648
Gazprom-13 $	3/1/2013	1 750	9,625	BBB	91,92	92,42	12,10	3,13	1077
Gazprom-13-2 $	4/11/2013	400	7,343	A3/BBB/BBB	84,49	84,74	12,11	3,35	1075
Gazprom-15 EUR	6/1/2015	1 000	5,875	A3	68,44	68,82	13,53	4,41	1093
Gazprom-17 EUR	11/2/2017	500	5,44	BBB/BBB	60,93	61,18	13,18	5,80	1028
Gazprom 18 EUR	2/13/2018	1 200	6,605	B- /*/-/-	61,16	61,41	14,57	5,13	1165
Gazprom 18 $	4/11/2018	1 100	8,146	A3/BBB/BBB	74,46	74,71	12,94	5,64	1064
Gazprom-20 $	2/1/2020	1 250	7,201	BBB+/BBB+	78,97	79,22	10,44	6,67	798
Gazprom-22 $	3/7/2022	1 300	6,51	BBB/BBB	59,80	60,05	12,93	6,93	1041
Gazprom-34 $	4/28/2034	1 200	8,625	A3/BBB/BBB	82,45	82,70	10,62	3,87	1176
Lukoil-17 $	6/7/2017	500	6,356	Baa2/BBB-/BBB-	69,41	69,66	12,28	5,77	1013
Lukoil-22 $	6/7/2022	500	6,656	Baa2/BBB-/BBB-	65,40	65,90	11,83	7,39	931
Sibneft-09 $	1/15/2009	500	10,75	WR/NR	100,00	100,00	#N/A N/A	#N/A N/A	Field Not Applic
TNK-11 $	7/18/2011	500	6,875	Baa2/BB/BBB- /*-	84,68	84,93	14,38	2,15	1348
TNK-12 $	3/20/2012	500	6,125	Baa2/BB/BBB- /*-	74,28	74,53	16,93	2,57	1581
TNK-13 $	3/13/2013	600	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	71,12	71,37	17,57	3,11	1623
TNK-16 $	7/18/2016	1 000	7,5	Baa2/BB/BBB- /*-	57,41	57,66	18,07	4,80	1609
TNK-17 $	3/20/2017	800	6,625	Baa2/BB/BBB- /*-	54,37	54,62	17,20	5,03	1509
TNK-18 $	3/13/2018	1 100	7,875	Baa2/BB/BBB- /*-	56,91	57,16	17,44	5,05	1515
Transneft-12 EUR	6/27/2012	700	5,381	A3 /*-/BBB/-	79,67	80,17	13,00	2,72	1101
Transneft-12 $	6/27/2012	500	6,103	A3 /*-/BBB/-	78,97	82,93	12,42	2,91	1125
Transneft-14 $	3/5/2014	1 300	5,67	A3 /*-/BBB/-	69,21	69,46	14,34	3,94	1279
Telecommunications									
Megafon-09 $	12/10/2009	375	8	Ba2/BB+	99,28	99,40	8,78	0,82	840
MTS-10 $	10/14/2010	400	8,375	Ba2/BB	95,06	95,28	11,54	1,51	1090
MTS-12 $	1/28/2012	400	8	Ba2/BB	83,91	84,16	14,77	2,40	1368
Sistema-11 $	1/28/2011	350	8,875	Ba3 /*-/BB/BB-	75,59	75,90	24,97	1,56	2424
Vimpelcom-09 $	6/16/2009	450	10	Ba2/BB+	99,89	99,95	10,11	0,37	988
Vimpelcom-10 $	2/11/2010	300	8	Ba2/BB+	94,25	94,38	14,04	0,92	1361
Vimpelcom-11 $	10/22/2011	300	8,375	Ba2/BB+	83,25	83,50	16,10	2,24	1511
Vimpelcom-13 $	4/30/2013	1 000	8,375	(P)Ba2/BB+	69,20	69,45	19,23	3,13	1786
Vimpelcom-16 $	5/23/2016	600	8,25	Ba2/BB+	60,27	60,52	18,25	4,55	1630
Vimpelcom-18 $	4/30/2018	1 000	9,125	(P)Ba2/BB+	59,19	59,44	18,44	4,88	1612
Industrials									
Alrosa-14 $	11/17/2014	500	8,875	Ba2/BB- /*-	68,27	68,52	17,81	3,93	1614
Eurochem-12 $	3/21/2012	300	7,875	-/BB/"BB	58,84	59,05	28,41	2,30	2729
Evrazholding-09 $	8/3/2009	325	10,875	Ba2/BB	98,13	98,20	14,66	0,46	1436
Evrazholding-15 $	11/10/2015	750	8,25	B1/BB	52,58	52,83	21,95	4,09	2009
Evrazholding-13 $	4/24/2013	1 300	8,875	B1/BB	53,48	53,71	28,31	2,83	2695
Evrazholding-18 $	4/24/2018	700	9,5	B1/BB	51,81	52,06	21,76	4,43	1945
Nornickel-09 $	9/30/2009	500	7,125	Baa2/BBB-	98,82	98,92	8,86	0,63	852
Raspadskaya-12 $	5/22/2012	300	7,5	Ba3/B+e/B+	60,04	60,42	26,10	2,51	2494
Severstal-09 $	2/24/2009	325	8,625	Ba2/BB	100,37	100,38	3,66	0,08	353
Severstal-14 $	4/19/2014	375	9,25	Ba2/BB/BB	54,68	54,93	25,27	3,29	2370
Severstal-13 $	7/29/2013	1 250	9,75	Ba2/BB/BB	55,59	55,84	27,46	2,79	2604
SINEK-15	8/3/2015	250	7,7	Ba1/BBB-	99,55	99,55	7,79	2,92	665
TMK-08 $	9/29/2009	300	8,5	Ba3/B+/-	94,03	94,11	18,16	0,60	1782

	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	18,77	0,19	1865
Ak Bars-10 $	6/28/2010	250	8,25	Ba2/BB-e/-	84,95	85,11	20,94	1,23	2039
Alfa Bank-09 $	10/10/2009	400	7,875	Ba1/-/BB	97,91	98,06	10,88	0,65	1053
Alfa Bank-12 $	6/25/2012	500	8,2	Ba1/BB-/-	62,22	62,62	25,26	2,57	2408
Bank of Moscow-09 $	9/28/2009	250	8	A3/-/BBB	99,47	99,57	8,72	0,63	838
Bank of Moscow-10 $	9/21/2005	300	7,375	A3/-/BBB	92,78	93,00	11,78	1,63	1111
Bank of Moscow-13 $	5/13/2013	500	7,335	A3/-/BBB	62,70	62,95	20,83	3,18	1945
Credit Europe Bank 10 $	4/13/2010	250	7,5	Ba1/-/-	99,61	99,61	7,83	1,12	735
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+	59,71	59,96	16,72	4,54	1489
MDM-11 $	7/21/2011	200	9,75	Ba2/B+ /*-/BB-	62,06	62,32	33,27	1,88	3237
Promsviazbank-10 $	10/4/2010	200	8,75	Ba2/BB-	75,63	75,73	27,69	1,36	2705
Promsviazbank-11 $	10/20/2011	225	8,75	Ba2/BB-	62,38	62,52	29,72	2,03	2873
Promsviazbank-12 $	5/23/2012	200	9,625	Ba3/B	42,44	42,56	44,09	2,11	4294
Rusagrobank-10 $	11/29/2010	350	6,875	A3/BBB+	95,64	95,88	9,43	1,66	875
Rusagrobank-13 $	5/16/2013	700	7,175	A3/BBB+	76,63	76,88	14,63	3,38	1326
Rusagrobank-14 $	1/14/2014	750	7,125	A3/-/-	74,81	75,06	14,35	3,85	1283
Rusagrobank-18 $	5/29/2018	1 000	7,75	A3/-/-	66,07	66,32	14,45	5,64	1212
Rusagrobank-17 $	5/15/2017	1 250	6,299	A3/-/BBB+	63,32	63,57	13,83	5,57	1170
Russian Standard-9 E	9/16/2009	400	6,825	Ba2/B+	78,12	78,12	51,00	0,48	4974
Russian Standard-10 $	10/7/2010	500	7,5	Ba2/B+	43,96	44,04	67,70	1,13	6706
Rosbank-09 $	9/24/2009	300	9,75	Baa3/A-	99,46	99,55	10,53	0,63	1033
Sberbank-15	2/11/2015	1 000	6,23	A2/BBB	66,22	66,37	16,05	4,23	-
TranscapitalBank 10 $	5/10/2010	175	9,125	B1/-/-	72,03	72,11	38,50	1,02	3799
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+	88,07	88,32	12,77	2,29	1179
VTB-12 $	10/31/2012	1 200	6,609	A2/BBB/BBB+	78,97	79,22	13,93	3,06	1267
VTB-15 $	2/4/2015	750	6,315	A2/BBB	62,43	62,57	17,85	4,09	1613
VTB-18 $	5/29/2018	2 000	6,875	A2/BBB/BBB+	69,86	70,11	12,38	3,36	1552
VTB-35 $	6/30/2035	1 000	6,25	A2/BBB+	57,86	58,11	11,26	4,56	1555

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/-	107,83	108,03	6,79	3,84
Brazil-40	8/17/2040	5 157	11,00	BBB-/Ba1/BBB-	125,16	125,26	6,25	4,71
Turkey								
Turkey-30	1/15/2030	1 500	11,88	BB-/Ba3/BB-	142,62	142,87	7,72	9,53

Источник: Bloomberg

Приложение 4. Еврооблигации стран СНГ

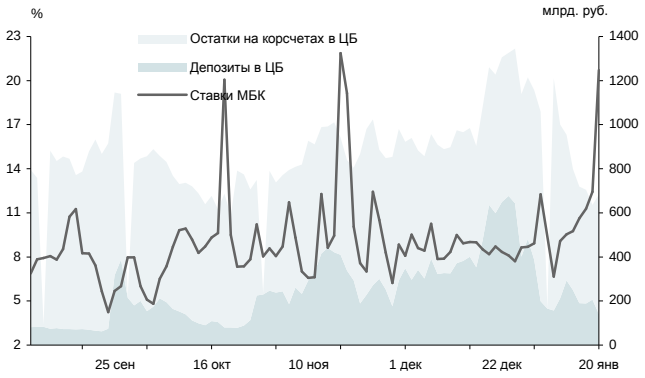
Кривая доходности еврооблигаций стран СНГ



Источник: Bloomberg

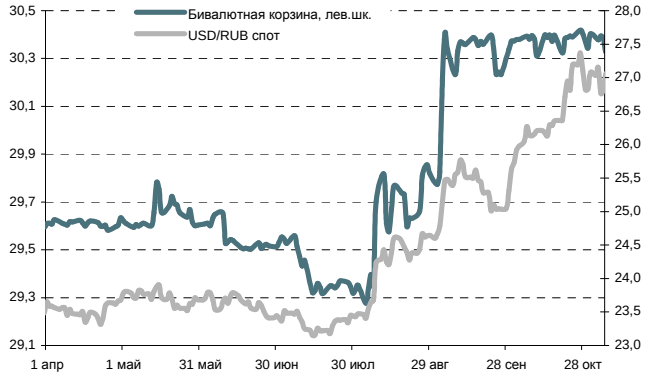
Приложение 5. Индикаторы российского рынка облигаций

Показатели рублевой ликвидности



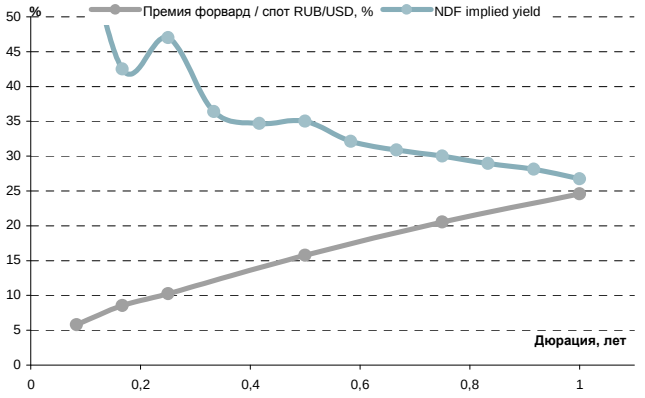
Источник: Reuters, ЦБ РФ

Динамика валютного рынка



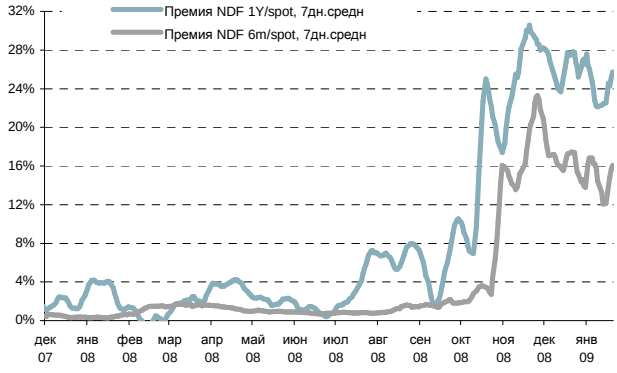
Источник: Reuters

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



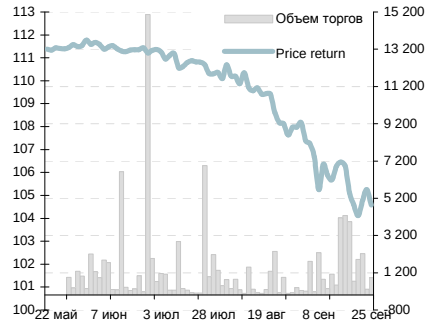
Источник: Bloomberg

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



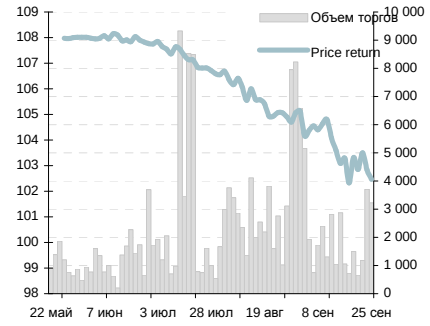
Источник: Reuters

Динамика ценового индекса ZETBI OFZ и объема торгов в сегменте



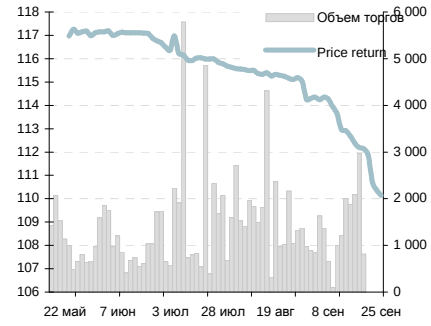
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика ценового индекса ZETBI Muni и объема торгов в сегменте



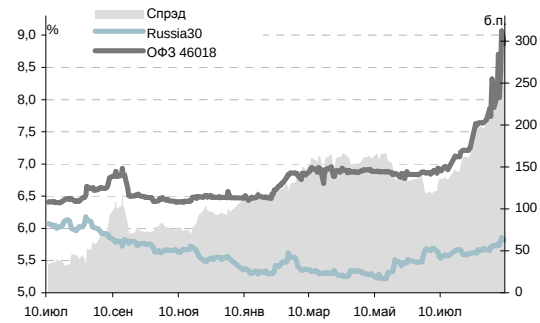
Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика индекса ZETBI Corp 10 и объема торгов в сегменте *



Источник: ММВБ, Банк ЗЕНИТ

Динамика спрэда ОФЗ 46018 и Russia 30

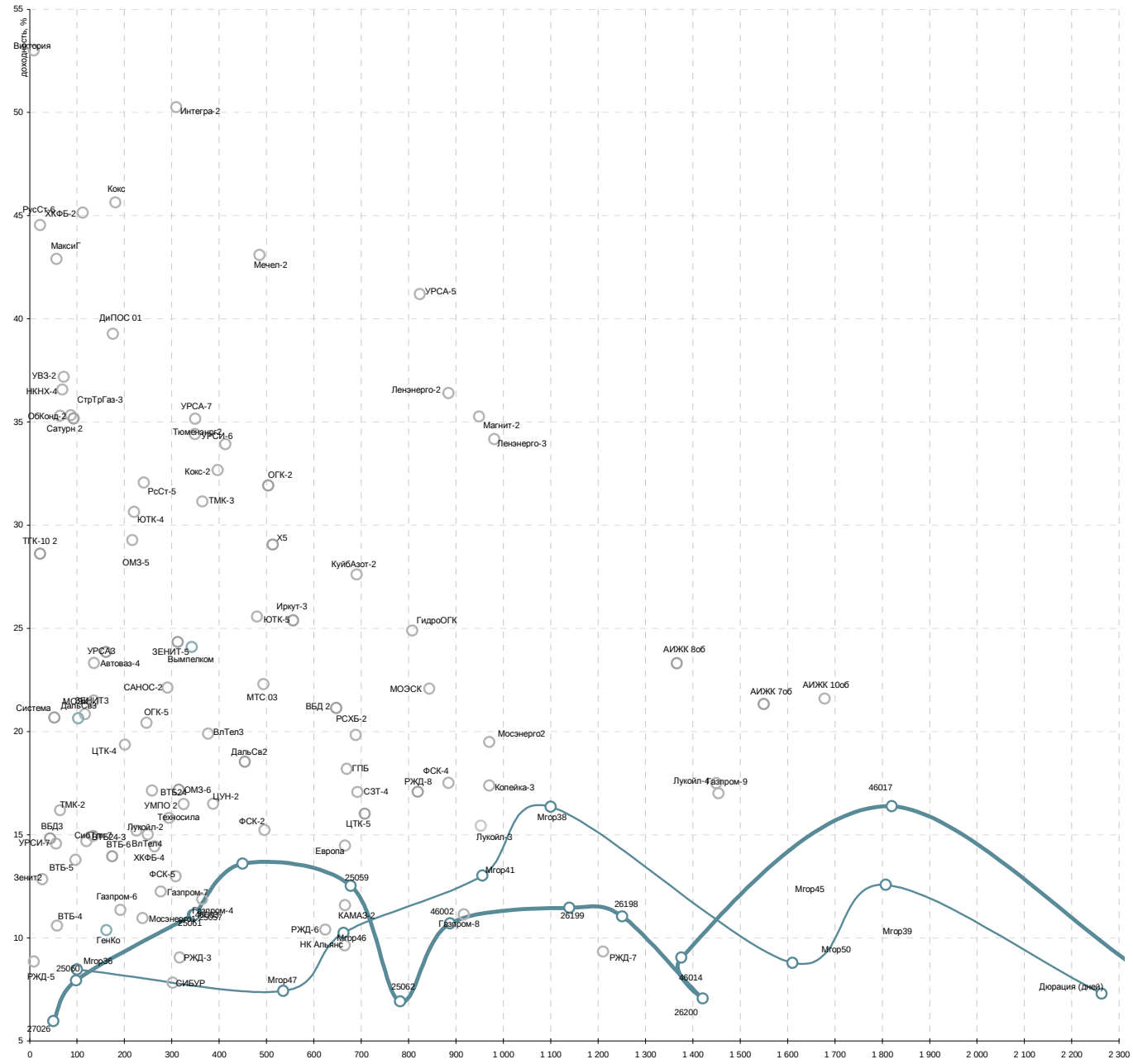


Источник: ММВБ,Bloomberg, расчеты Банка ЗЕНИТ

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

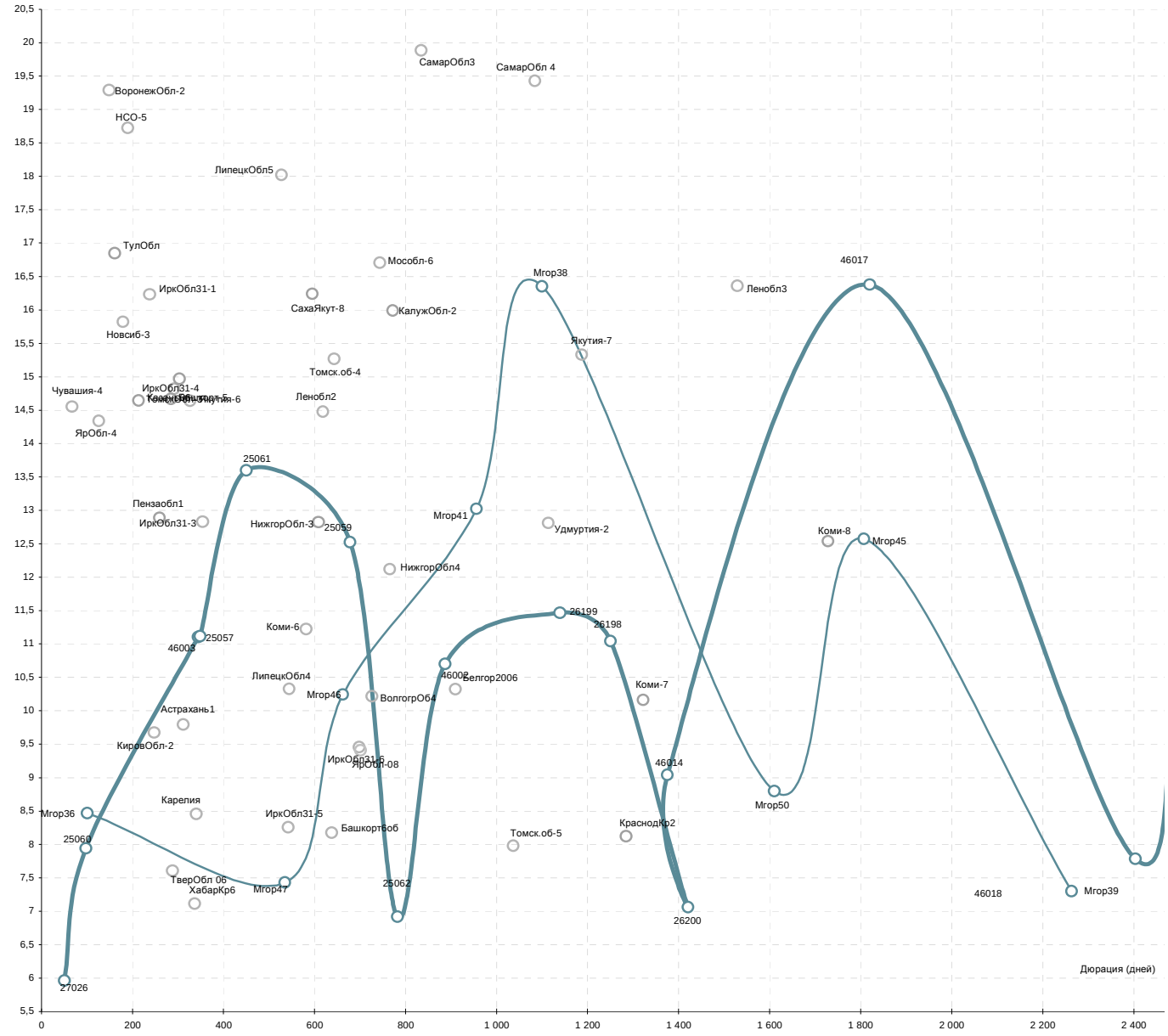
Приложение 6. Российский долговой рынок

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	50		1	0,30	100,00	100,00	0,674	-	0,00	5,96		0,14
SU25060RMFS3	28.01.2009	5,80	99		2	0,30	99,47	99,49	1,319	-0,01	-0,14	7,94		0,27
SU46003RMFS8	15.07.2009	10,00	540		10	66,68	99,20	99,27	0,164	-0,03	0,27	11,11		0,94
SU25057RMFS9	21.01.2009	7,40	365		12	91,37	96,30	96,93	1,825	-0,58	-0,77	11,12		0,95
SU25061RMFS1	04.02.2009	5,80	470		24	374,15	93,00	91,63	1,208	-	-3,67	13,60		1,23
SU25062RMFS9	04.02.2009	5,80	834		0	0,00	98,00	98,00	1,208	-	-	6,92		2,14
SU25059RMFS5	21.01.2009	6,10	729		1	7,30	89,70	89,70	1,504	-	-1,02	12,52		1,86
SU46002RMFS0	11.02.2009	9,00	1296		9	96,75	94,69	94,78	3,945	-	-1,11	10,70		2,43
SU26199RMFS8	15.04.2009	6,10	1268		1	6,89	86,00	86,00	0,100	-	0,00	11,47		3,12
SU26198RMFS0	03.11.2009	6,00	1382		1	6,90	85,00	85,00	1,282	-	0,00	11,04		3,43
SU26200RMFS4	21.01.2009	6,10	1639		0	0,00	97,00	97,00	1,504	-	4,00	7,06		3,89
SU46014RMFS5	11.03.2009	9,00	3508		0	0,00	95,00	95,00	3,255	-	19,00	9,04		3,77
SU46017RMFS8	11.02.2009	8,00	2752		0	0,00	64,25	64,25	1,513	-	0,00	16,38		4,99
SU46021RMFS0	18.02.2009	7,50	3487		0	0,00	90,00	90,00	3,144	-	-8,30	7,78		6,58
SU46022RMFS8	21.01.2009	7,50	5293		0	0,00	96,00	96,00	3,719	-	-	6,87		8,84
SU46018RMFS6	11.03.2009	8,50	4691		11	0,31	75,00	74,98	0,955	-	18,03	11,76		7,01
SU46020RMFS2	11.02.2009	6,90	9878		0	0,00	64,00	64,00	3,025	-	-17,86	11,47		9,09
Субфедеральные облигации														
МГор41-об	30.01.2009	8,00	556		0	0,00	102,00	101,02	3,814	-	0,00	7,43		1,47
МГор38-об	26.06.2009	10,00	705		0	0,00	100,00	100,00	0,685	-	0,00	10,24		1,82
МГор39-об	21.01.2009	8,00	2008		0	0,00	96,00	96,00	4,011	-	0,00	8,80		4,41
МГор44-об	24.06.2009	8,00	2346		2	0,55	80,00	80,00	0,592	0,00	5,00	12,57		4,95
МГор45-об	27.06.2009	8,00	1254		0	0,00	80,00	80,00	0,526	-	1,94	16,35		3,01
МГор46-об	25.01.2009	8,00	186		0	0,00	98,70	98,25	1,906	-	0,10	12,01		0,51
Башкорт5об	06.05.2009	8,02	288		0	0,00	95,50	95,47	1,670	-	-0,37	14,67		0,78
БелгОб 3об	11.02.2009	8,38	659		2	0,00	80,00	80,00	1,584	-	-17,00	24,01		1,65
ИркОбл31-1	19.03.2009	8,50	331		0	0,00	95,50	95,50	0,769	-	0,01	16,23		0,65
ИркОбл31-3	25.03.2009	7,25	673		1	0,00	95,00	95,00	1,092	-	-1,66	12,83		0,97
Казань 3	28.03.2009	8,04	431		0	0,00	100,00	100,00	2,533	-	-	8,18		1,12
Казань06об	25.02.2009	8,00	221		0	0,00	97,94	96,65	1,205	-	-3,35	14,65		0,59
КОМИ 6в об	14.04.2009	11,50	632		0	0,00	100,00	100,00	3,088	-	-	11,22		1,59
КОМИ 7в об	23.05.2009	9,00	1767		1	0,00	95,00	95,00	1,430	-	0,19	10,16		3,62
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	21.07.2009	7,95	910		1	0,00	97,00	97,00	0,000	-	-3,00	10,33		1,49
ЛипецкОбл5	16.07.2009	7,10	541		0	0,00	86,60	86,60	0,097	-	-	18,02		1,45
ЛипецкОбл6	10.06.2009	8,98	1597		0	0,00	75,00	75,00	1,009	-	-9,05	22,55		2,38
Мос.обл.4в	21.04.2009	11,00	91		6	0,58	98,30	97,03	0,000	-	-1,27	23,61		0,25
Мос.обл.5в	31.03.2009	10,00	434		0	0,00	85,00	85,00	3,068	-	2,44	26,88		1,11
Мос.обл.6в	21.04.2009	9,00	819		0	0,00	87,00	87,00	2,244	-	-1,75	16,71		2,04
Мос.обл.7в	22.04.2009	8,00	1912		6	0,10	46,00	45,81	1,973	-0,94	-2,06	30,54		3,73
СамарОбл 5	26.03.2009	9,30	1794		0	0,00	65,00	65,00	0,662	-	1,99	31,37		2,27
Мос.обл.8в	16.06.2009	9,00	1603		1	0,01	60,00	60,00	0,863	-1,07	-0,01	34,43		2,24
Томск.об-3	09.05.2009	6,00	293		0	0,00	93,80	93,80	1,184	-	4,80	14,82		0,80
Томск.об-4	26.06.2009	7,00	1070		2	0,66	87,66	87,66	0,480	-0,40	-1,75	15,27		1,76
Томск.об-5	17.06.2009	8,00	1427		0	0,00	98,60	98,60	0,745	-	0,00	7,98		2,84
Чувашия-04	27.03.2009	12,33	66		0	0,00	99,50	99,50	3,952	-	0,00	14,55		0,18
Чувашия-05	05.06.2009	7,85	866		0	0,00	77,98	77,98	1,011	-	0,00	20,82		2,18
Чувашия-06	21.04.2009	7,74	1183		2	0,57	71,00	71,00	0,000	-	0,60	21,32		2,82
Чувашия-07	10.03.2009	9,66	1596		0	0,00	60,00	60,00	1,112	-	0,00	28,45		3,06
Якут-06 об	12.02.2009	10,00	478		0	0,00	96,60	96,60	1,863	-	0,00	14,64		0,89
Якут-07 об	22.01.2009	7,80	1913		0	0,00	80,00	80,00	1,902	-	0,00	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	126		1	0,36	98,50	98,50	1,562	-	-1,50	14,34		0,35
ЯрОбл-06	21.04.2009	7,50	819		1	0,68	77,25	77,25	1,869	-	-0,75	24,95		1,60
ЯрОбл-07	31.03.2009	7,50	434		0	0,00	87,80	87,80	0,431	-	-3,65	21,14		1,07
Корпоративные облигации														
Машиностроение														
АВТОВАЗоб3	23.06.2009	9,60	518		0	0,00	85,00	85,00	0,736	-	-	23,12		1,42
АВТОВАЗоб4	26.05.2009	7,80	1946	126	0	0,00	93,55	93,55	1,197	-	-	-	27,95	0,44
АВТОВАЗбо1	25.03.2009	9,23	64		0	0,00	99,96	99,97	7,586	-	-	8,91		0,53
АВТОВАЗбо2	25.03.2009	9,80	64		0	0,00	96,80	96,80	8,055	-	-0,17	26,49		0,18
АВТОВАЗбо3	27.05.2009	9,20	127		0	0,00	96,00	96,00	5,974	-	-	18,44		0,42
АВТОВАЗбо4	04.06.2009	9,20	135		0	0,00	97,00	97,00	5,772	-	-5,51	16,58		0,38
Автоприбор	29.04.2009	13,20	99		0	0,00	99,99	97,47	3,002	-	-	22,01		0,28
Вагонмаш 2	17.06.2009	15,50	694	148	2	27,50	79,50	79,53	1,411	-	0,42	-	81,74	0,42
ГАЗФин 01	10.02.2009	9,30	749	21	67	7,78	55,00	56,37	4,102	-5,85	-21,39	-	1339,11	0,06
ГИДРОМАШС1	26.05.2009	9,90	308		0	0,00	75,00	75,00	1,519	-	0,00	54,13		0,84
ГСС 01	26.03.2009	7,85	2987	247	0	0,00	94,90	94,90	2,516	-	0,00	-	16,69	0,71
ГТ-ТЭЦ 4об	04.03.2009	10,71	225		3	0,00	29,89	28,99	4,079	3,70	-0,43	715,14		0,55
ИжАвто 02	11.06.2009	18,00	870		0	0,00	50,00	50,00	1,973	-	-28,83	68,69		1,83
ИРКУТ-03об	19.03.2009	8,74	604		0	0,00	80,00	80,00	2,969	-	-	25,39		1,52
Камаз-Фин2	20.03.2009	11,25	605		0	0,00	99,97	99,98	3,791	-	-	11,58		1,82
Киров.зд1	25.03.2009	14,90	428	63	1	0,00	97,50	97,50	4,817	-	-	-	28,72	0,17
КМЗ-Фин 01	11.06.2009	11,25	506	142	0	0,00	95,00	97,37	1,233	-	0,00	-	25,05	0,41
КМПО-Фин01	17.03.2009	11,30	420		0	0,00	102,00	102,00	3,901	-	0,00	9,65		1,09
КриогенФ 1	16.06.2009	13,00	329		2	11,18	82,95	80,44	1,247	0,44	-11,66	45,15		0,87
ЛОМО 03	09.03.2009	15,50	228	48	1	0,05	79,00	79,00	5,605	-	4,29	-	207,07	0,13
МетарФ 01	11.06.2009	16,00	506	146	1	0,01	89,98	89,98	1,753	-	-0,01	-	50,45	0,40
МиГ-Ф 02	10.03.2009	12,00	959	231	0	0,00	78,00	78,00	4,373	-	0,00	-	66,40	0,62
МиГ-Ф обл.	03.06.2009	7,85	134		0	0,00	85,00	85,00	1,032	-	-0,05	56,28		0,37

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	58		8	0,15	91,01	93,97	3,397	1,97	3,97	49,24		0,16
МоторФин-2	16.07.2009	0,10	541		1	1,20	91,00	91,51	0,001	-	-	-		0,00
ОЗНА-Фин01	09.06.2009	10,50	322		0	0,00	99,80	99,80	1,208	-	-	-		0,00
ОМЗ-5 об	03.03.2009	8,80	952	224	0	0,00	90,00	90,01	3,375	-	-0,12	-	29,40	0,59
ОМЗ - 6 об	05.06.2009	10,25	1592	318	0	0,00	95,00	95,00	1,292	-	8,81	-	17,29	0,86
ПМЗ 01	21.04.2009	12,00	182		0	0,00	98,00	98,00	0,000	-	0,00	17,04		0,50
ПО УОМЗ	11.06.2009	16,50	506		0	0,00	100,00	100,00	1,808	-	-	16,65		1,37
ПромТр02об	21.04.2009	10,75	1001	273	0	0,00	84,40	82,20	2,680	-	-2,80	-	39,48	0,74
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	295		0	0,00	98,99	99,35	2,741	-	0,00	15,85		0,83
РОССКАТ-К1	21.01.2009	10,30	547	1	0	0,00	100,02	93,70	5,108	-	0,00	-	2,78	0,02
Ростверт1	26.05.2009	9,30	126		0	0,00	96,00	96,00	1,427	-	-	21,01		0,36
Рыбкаб-1	03.03.2009	10,75	1134	42	0	0,00	98,00	98,00	1,443	-	-	-	28,29	0,18
СатурнНПО2	21.03.2009	12,50	973	60	0	0,00	96,00	96,00	4,178	-	-3,00	-	36,77	0,18
СатурнНПО3	05.06.2009	16,25	1963	318	0	0,00	95,00	95,00	2,003	-	0,00	-	24,16	0,85
СевКаб 03	31.03.2009	16,00	1162	70	7	2,85	95,00	95,00	0,921	-	0,00	-	43,86	0,21
СевКаб 04	24.02.2009	13,75	1582	126	6	0,62	55,00	53,48	2,110	-6,72	-6,52	-	548,53	0,33
СОЛЛЕРС2	21.01.2009	7,70	1639	547	0	0,00	58,00	58,00	3,818	-	-13,50	-	57,65	1,35
СРЗ-Фин 01	11.06.2009	18,00	324		0	0,00	79,00	79,00	1,973	-	-	50,94		0,90
ТВЗ 03	19.06.2009	10,00	514	150	0	0,00	75,00	75,01	0,877	-	-24,99	-	93,35	0,43
ТензорФ-01	19.05.2009	14,50	301		0	0,00	67,21	67,21	2,503	-	0,00	85,73		0,80
Трансмаш-2	12.02.2009	8,60	751	23	0	0,00	97,00	97,00	3,746	-	-0,50	-	55,79	0,07
УЗПС 01	10.12.2009	0,00	506	142	0	0,00	92,50	92,50	1,096	-	-	-	17,59	0,00
УМПО 2	18.06.2009	12,25	331		0	0,00	96,99	96,99	1,108	-	-1,70	16,48		0,89
УралВагЗФ2	01.04.2009	10,50	623	71	0	0,00	95,01	94,88	3,193	-	0,38	-	36,82	0,20
ЭМАльянс 1	10.07.2009	13,50	899	171	0	0,00	75,00	75,00	0,407	-	-	-	88,67	0,51
ЭнергмашФ1	26.05.2009	13,00	1036	308	0	0,00	96,80	96,80	1,995	-	0,00	-	17,90	0,87
Атомстройэкспорт	26.05.2009	7,75	854	126	0	0,00	100,00	100,00	1,189	-	0,00	-	7,66	0,40
Металлургия, горнодобывающая, трубная промышленность														
Амурмет-01	26.02.2009	9,80	37		7	0,21	49,50	50,24	3,893	-0,60	-1,19	924,91		0,10
Амурмет-02	26.02.2009	9,15	402		6	0,28	18,80	15,02	3,610	-2,12	-7,96	550,09		0,86
Амурмет-03	17.04.2009	12,75	815	87	0	0,00	24,10	24,10	3,318	-	-1,77	-	1207,91	0,24
Белон 01	03.06.2009	9,10	134		10	1,29	79,50	80,52	1,197	0,34	-2,98	76,07		0,37
Белон 02	26.02.2009	9,25	1129	219	2	0,02	65,00	65,00	3,675	2,99	-32,15	-	124,32	0,57
ДиПОС 01	23.06.2009	13,10	1246	154	0	0,00	90,00	90,00	1,005	-	-	-	40,44	0,48
Инпром 02	16.07.2009	13,00	541		0	0,00	50,00	50,00	0,178	-	-	86,90		1,37
Инпром 03	20.05.2009	13,00	848	302	0	0,00	50,00	50,00	2,208	-	-4,27	-	165,26	0,79
Кокс 01	16.07.2009	8,95	177		0	0,00	84,00	85,16	0,123	-	-3,84	45,64		0,50
Кокс 02	19.03.2009	8,70	1150	422	0	0,00	80,00	80,00	2,956	-	-14,05	-	32,73	1,09
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	797	67	2	0,03	73,00	73,00	2,733	-	-3,50	-	205,77	0,18
МаирИнв-03	01.04.2009	11,15	71		0	0,00	49,99	49,99	3,390	-	-1,01	477,93		0,21
МаксиГ 01	12.03.2009	10,00	51		0	0,00	95,00	94,97	3,589	-	4,97	42,89		0,16
Метзавод	27.02.2009	8,75	38		5	0,03	89,81	89,92	3,452	0,15	-1,18	113,07		0,10
Метсерв-Ф1	27.05.2009	12,00	1219	127	0	0,00	98,50	98,50	1,808	-	-	-	16,26	0,42
Мечел 2об	17.06.2009	8,40	1604	512	35	21,12	67,00	68,90	0,782	0,79	-0,45	-	46,09	1,33
НижЛенИнв2	18.06.2009	13,00	149		2	0,05	94,94	94,32	1,175	-	4,32	28,18		0,41
НМЗ 1 обл.	14.02.2009	13,00	390	207	0	0,00	110,00	110,00	5,627	-	-	-	-	0,76
НОК-02	26.03.2009	15,00	975	611	0	0,00	71,86	97,34	4,968	-	0,00	-	43,04	1,53
РМК-ФИН 01	07.04.2009	8,75	441		0	0,00	100,00	97,75	2,517	-	0,00	10,96		1,20
СвобСокол3	26.05.2009	21,00	854	126	0	0,00	50,95	50,95	3,222	-	0,95	-	301,06	0,36
СПК об.01	26.05.2009	14,00	490		0	0,00	98,00	98,00	2,148	-	-	-		0,00
ТМК-02 обл	24.03.2009	7,60	63		0	0,00	98,50	98,47	2,478	-	0,28	16,18		0,18
ТМК-03 обл	17.02.2009	9,60	756	392	0	0,00	83,49	83,01	4,050	-	-0,49	-	30,48	1,00
УГМК-УЭМ01	03.03.2009	8,25	1134	406	0	0,00	90,00	90,00	3,164	-	0,00	-	19,44	1,05
ЧТПЗ 01об	17.06.2009	9,50	512		0	0,00	78,00	78,00	0,885	-	-2,00	31,77		1,34
ЧТПЗ 03об	28.04.2009	10,00	2282	280	0	0,00	84,20	84,10	2,301	-	0,00	-	34,80	0,76
Нефтегазовая отрасль														
Альянс-01	18.03.2009	8,92	967	239	0	0,00	99,10	99,10	0,000	-	-	-	16,04	1,82
АСПЭК-01	01.04.2009	13,00	435	71	0	0,00	100,00	97,50	0,712	-	-	-	12,91	0,35
ГАЗПРОМ А4	11.02.2009	8,22	386		102	76,19	96,82	96,77	3,603	-0,80	-1,73	11,87		1,00
ГАЗПРОМ А6	05.02.2009	6,95	198		2	0,20	97,89	97,89	3,161	0,16	-0,10	11,35		0,53
ГАЗПРОМ А7	30.04.2009	6,79	282		0	0,00	96,00	96,30	1,525	-	-0,10	12,25		0,76
ГАЗПРОМ А8	30.04.2009	7,00	1010		1	0,00	91,00	91,00	1,573	-	-	11,13		2,51
ГАЗПРОМ А9	18.02.2009	7,23	1849		0	0,00	69,40	69,40	3,031	-	-27,59	17,00		3,98
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	695	149	0	0,00	80,00	80,00	1,085	-	-3,00	-	75,22	0,42
ГЭС 01	24.06.2009	8,00	1247		0	0,00	54,12	54,12	0,592	-	0,00	32,74		2,89
ГЭС 02	28.04.2009	10,75	1554	280	0	0,00	80,00	80,00	2,474	-	0,00	-	48,84	0,74
ИнтеграФ-1	20.03.2009	10,50	59		7	1,50	92,00	87,29	3,538	0,29	1,61	98,14		0,16
ИнтеграФ-2	02.06.2009	10,70	1043	315	0	0,00	77,00	77,00	1,436	-	-5,00	-	50,92	0,85
КмплФин 01	05.02.2009	15,50	380	16	0	0,00	84,00	84,00	7,049	-	-	-	417,92	0,05
Лукойл2обл	19.05.2009	7,25	301		1	0,43	94,00	94,00	1,251	-2,70	-2,60	15,81		0,81
Лукойл3обл	11.06.2009	7,10	1052		0	0,00	82,25	82,25	0,778	-	-3,17	15,43		2,61
Лукойл4обл	11.06.2009	7,40	1780		8	0,57	69,51	69,52	0,811	1,19	-5,48	17,50		3,97
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	695	149	0	0,00	84,00	84,00	1,175	-	14,00	-	61,28	0,41
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	1251		1	0,00	40,00	40,00	0,684	-	-9,94	69,44		1,89
Мособлгаз1	14.05.2009	12,00	847		0	0,00	80,00	80,00	2,203	-	-	25,06		2,02
НКАльянс1	18.03.2009	8,92	967	239	0	0,00	63,00	70,00	3,055	-	0,00	-	121,10	0,68
РуссНефть1	12.06.2009	12,00	689		1	0,00	65,11	65,11	1,282	-	-	-		0,00
Сахатрнфг1	03.06.2009	12,50	316		0	0,00	94,50	94,50	1,644	-	-	19,57		0,92
СтрТрГаз02	17.07.2009	8,49	1270		0	0,00	62,00	61,86	0,093	-	0,00	27,11		2,82
ТОАП-Фин01	11.06.2009	16,00	324	142	0	0,00	55,00	81,44	1,753	-	-	-	232,01	0,46
ТоппромИн1	17.04.2009	16,50	451	87	1	1,80	100,00	100,00	0,181	0,04	0,02	-	16,47	0,24
УфаойлОП-1	16.04.2009	13,00	450	86	0	0,00	100,00	100,00	3,419	-	-	-	12,57	0,48
ФаэтонАФ 1	29.01.2009	13,50	191		0	0,00	98,00	99,19	6,399	-	-0,81	15,65		0,51

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	252		0	0,00	11,55	11,55	4,142	-	-2,32	2140,35		0,59
Агроком 01	23.06.2009	20,00	882	154	0	0,00	90,00	90,00	1,534	-	-	-	47,74	0,44
Агрохолд 1	17.04.2009	16,00	185		0	0,00	5,00	6,00	0,175	-	-0,34	36255,96		0,47
Аладушкин2	27.05.2009	12,30	1037	309	11	2,34	70,01	70,80	1,853	0,72	10,80	-	72,81	0,81
Аркада-02	20.02.2009	13,31	31		2	0,00	35,00	37,74	5,543	-0,26	2,65	1724,37		0,08
Аркада-03	02.04.2009	17,00	800	254	2	0,00	11,01	11,01	5,123	-0,78	-3,17	-	2374,42	0,56
Аркада-04	27.05.2009	15,00	1219	127	0	0,00	26,00	26,00	2,260	-	-	-	805,65	0,35
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	331		2	0,55	41,00	30,02	2,192	0,02	7,02	428,96		0,74
БородинФ-1	17.06.2009	10,50	330		0	0,00	94,20	94,20	0,978	-	0,00	18,29		0,90
ВБД ПП 2об	17.06.2009	9,00	694		0	0,00	83,00	83,00	0,838	-	-17,00	21,14		1,77
ВБД ПП 3об	04.03.2009	9,30	1499	43	1	1,94	99,30	99,30	3,542	-	0,30	-	14,82	0,12
ВостСервФ1	12.03.2009	10,99	233		0	0,00	72,74	73,40	3,944	-	-10,54	78,57		0,62
ВТК 1	19.06.2009	15,00	332		0	0,00	25,60	25,77	1,315	-	0,00	-		0,00
Держава-Ф	27.01.2009	16,50	553	10	0	0,00	12,00	13,82	7,911	-	-5,72	-	########	0,04
ДжейЭфСиГ1	23.04.2009	13,00	1003		0	0,00	97,99	98,11	3,170	-	-	-		0,00
ДымКолбПр1	01.05.2009	0,10	283		0	0,00	100,00	100,00	0,022	-	-	0,10		0,97
ЗавГросс01	16.04.2009	13,75	457	86	2	0,00	18,09	18,09	0,188	-	-32,16	-	1977,20	0,24
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	330	149	1	0,02	80,00	80,00	1,151	-	-19,00	-	79,35	0,41
ЛекФин 2об	17.02.2009	5,00	28		0	0,00	93,10	93,10	2,110	-	-	32,57		0,27
МельнКомб	26.02.2009	0,00	37		0	0,00	99,00	99,00	0,000	-	-	1,87		0,54
Митлэнд-01	17.02.2009	15,00	392	28	0	0,00	89,00	89,00	2,589	-	-	-	172,94	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	332		0	0,00	104,50	104,50	1,271	-	4,60	9,43		0,88
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	140		0	0,00	62,00	62,23	1,266	-	-28,72	273,18		0,39
ОбКондФ-01	20.05.2009	7,70	1212	484	0	0,00	52,00	52,00	1,308	-	0,00	-	79,58	1,30
ОбКондФ-02	22.04.2009	10,40	1548	92	0	0,00	94,00	94,00	2,564	-	-1,00	-	35,42	0,25
ОГО-агро-2	25.02.2009	12,95	36		2	0,01	79,99	78,66	5,216	-	2,26	273,40		0,10
ОГО-агро-3	03.07.2009	15,00	535	164	1	0,00	30,00	30,00	0,740	-	-1,60	-	555,60	0,45
ОХЗ-Инв 01	18.02.2009	14,50	302		0	0,00	96,00	95,87	2,463	-	0,00	21,19		0,83
ПАВА 02 об	03.02.2009	12,50	1004	104	0	0,00	80,10	80,10	2,603	-	-0,27	-	146,39	0,29
Парнас-М 2	19.02.2009	10,80	1031	303	0	0,00	31,95	36,45	1,805	-	-	-	365,22	0,91
ПИВДОМ 01	23.04.2009	16,00	457	275	0	0,00	99,98	99,98	3,901	-	-	-	16,55	0,94
РазгуляйФ2	31.03.2009	12,00	980	70	0	0,00	100,00	100,00	3,682	-	-	-	11,58	0,27
РазгуляйФ3	20.03.2009	10,99	1151	59	6	4,72	86,04	89,18	3,703	2,96	2,18	-	108,48	0,16
РазгуляйФ4	27.05.2009	11,70	1583	127	0	0,00	72,00	72,00	1,763	-	-2,96	-	124,96	0,35
РЕСТОРАНС3	29.05.2009	12,00	675	129	1	0,05	45,00	45,00	1,742	-5,15	-10,00	-	358,61	0,35
РосТ-Лайн1	09.07.2009	14,50	534	170	0	0,00	69,90	69,90	0,477	-	0,00	-	112,43	0,49
РубПлсРег1	02.06.2009	20,00	497		0	0,00	95,00	95,00	2,685	-	-	25,67		1,34
РусМасла-2	02.04.2009	15,00	1164	436	1	0,13	16,50	16,50	4,521	0,50	2,30	-	468,56	0,89
РусМоре-01	19.03.2009	12,70	1241	149	0	0,00	73,90	73,90	1,148	-	13,52	-	138,97	0,42
РусТекс 2	05.03.2009	12,75	44		3	0,00	26,33	26,92	4,820	-	-1,53	1950,18		0,12
РусТекс 3	21.04.2009	14,50	273		0	0,00	30,40	31,31	3,615	-	-6,69	428,35		0,70
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	205		0	0,00	82,00	82,00	3,485	-	4,00	53,71		0,54
СахарКо 01	12.05.2009	14,00	294		0	0,00	21,00	21,00	2,685	-	-9,97	684,45		0,74
Синергия-1	22.04.2009	12,50	92		0	0,00	113,94	113,92	3,082	-	0,00	-		0,00
Синергия-2	22.01.2009	10,70	548	2	0	0,00	95,00	95,00	5,277	-	0,00	-	920,54	0,06
СодружФ-1	23.04.2009	10,45	275		0	0,00	79,80	63,90	2,548	-	0,00	93,82		0,78
СОРУС КАП1	05.02.2009	16,00	289		0	0,00	12,98	12,98	3,288	-	-	1266,63		0,71
СОРУС КАП2	09.04.2009	13,00	1171	79	0	0,00	37,68	37,68	0,427	-	-	-	789,71	0,35
ТалостоФ-1	06.03.2009	10,00	45		7	0,19	69,00	69,35	3,753	-1,33	-18,13	353,76		0,12
Черемушки	02.03.2009	13,30	41		0	0,00	95,00	95,00	5,138	-	-	38,05		0,21
Черкизово1	02.06.2009	8,85	861	133	0	0,00	80,06	80,06	1,188	-	-6,89	-	78,25	0,38
Эрконпрод1	12.03.2009	17,00	233	51	0	0,00	91,50	91,50	6,101	-	0,00	-	79,75	0,16
ЭФКО-02 об	23.01.2009	12,00	367	3	0	0,00	83,98	83,98	5,885	-	0,00	41,54	2182,32	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	959	231	1	0,00	68,00	68,00	3,553	-	-7,75	-	102,33	0,60
Потребительские товары, розничная торговля														
7Контин-02	18.06.2009	7,80	1241	149	2	0,01	70,00	70,00	0,705	-0,08	-2,02	-	114,97	0,41
АвтомирФ-1	03.03.2009	1,00	224		0	0,00	100,00	100,00	0,384	-	-	1,00		1,68
АвтомирФ-2	24.06.2009	0,10	519	155	0	0,00	99,73	99,74	0,007	-	-	-	0,74	0,48
АЛПИ-Инв-1	20.02.2009	18,00	213		0	0,00	0,01	0,01	7,447	-	0,00	60894,63		0,26
Алькор-01	09.06.2009	9,55	322		0	0,00	95,00	95,00	1,099	-	0,00	16,29		0,88
Апт36и6 об	30.06.2009	9,89	161		0	0,00	49,99	50,27	0,569	-	-0,01	239,97		0,44
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	276	94	4	0,00	0,77	0,77	2,893	-0,06	0,11	-	10846,58	0,26
БАНАНА-М-2	12.02.2009	11,50	569	23	2	0,01	0,66	0,66	5,010	-	-0,96	-	28006,56	0,06
Бахетле-1	20.05.2009	16,00	484	120	0	0,00	99,90	99,90	2,718	-	-0,05	-	15,89	0,35
БразерсК 1	20.03.2009	15,00	339		0	0,00	90,00	90,00	1,315	-	-	29,56		0,94
Веха-Инв-1	03.03.2009	14,00	406	42	0	0,00	67,20	67,20	5,370	-	0,00	-	495,68	0,13
Виват-фин1	21.04.2009	12,10	455		0	0,00	93,00	93,00	3,017	-	-	-		0,00
ВикторияФ	29.01.2009	10,40	9		5	23,09	98,90	98,90	4,929	0,18	0,90	53,00		0,02
ВикторияФ2	17.02.2009	10,89	392		2	12,01	50,00	50,00	4,595	-2,00	-1,01	116,49		0,95
ГАЗЭКСФ 1	18.06.2009	12,00	695	149	0	0,00	80,00	80,00	1,085	-	-3,00	-	75,22	0,42
ГорСупер-1	21.04.2009	11,50	182		0	0,00	80,00	90,00	0,000	-	0,00	35,90		0,53
ДиксиФин-1	19.03.2009	9,25	786		1	0,00	50,08	50,08	3,142	0,05	-1,10	55,42		1,82
Домоцентр1	09.07.2009	20,00	534		0	0,00	99,00	98,95	0,658	-	-	21,94		1,34
Европа-01	16.04.2009	11,00	632		0	0,00	95,00	95,00	2,893	-	-	14,47		1,82
ЕВРОПА-01	16.04.2009	11,00	632		0	0,00	95,00	95,00	2,893	-	-	14,47		1,82
Евросеть-2	02.06.2009	0,00	133		2	0,00	91,00	91,67	0,000	-	9,67	24,94		0,36
ИКС5Фин 01	07.07.2009	7,60	1988	532	0	0,00	77,43	77,47	0,292	-	7,47	-	29,27	1,41

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	388	24	8	0,92	3,10	3,05	2,295	-	-0,93	-	27547,24	0,07
ИнкомЛада3	13.03.2009	11,00	871	143	5	0,00	2,50	2,54	1,175	-	-0,73	-	########	0,34
Карус.Ф 01	19.03.2009	12,00	1696		0	0,00	106,10	106,10	4,077	-	-	10,60		3,68
КОПЕЙКА 02	18.02.2009	8,70	1121	29	5	39,58	95,11	95,52	1,478	-0,67	0,40	-	72,72	0,08
КОПЕЙКА 03	18.02.2009	9,80	1121	211	0	0,00	100,00	100,00	1,665	-	-	10,16	17,57	0,57
КОРА УК 01	14.04.2009	11,00	175		0	0,00	99,99	99,99	0,211	-	-	11,46		0,77
Лаверна 01	09.04.2009	16,00	443		0	0,00	100,00	100,00	4,515	-	-	-		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	1158	430	3	1,98	53,50	53,79	2,606	-0,71	-0,83	35,26	87,03	2,60
Магнолия-1	22.01.2009	15,00	548	2	0	0,00	98,00	98,00	3,658	-	0,00	-	373,77	0,03
МартаФин 2	06.06.2009	12,00	320		0	0,00	96,31	96,31	1,479	-	-	16,23		1,05
МартаФин 3	31.01.2009	15,50	924		0	0,00	0,01	0,01	7,262	-	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	302		0	0,00	100,10	100,10	2,123	-	-	-		0,00
МонеткаФ-1	14.05.2009	12,50	114		0	0,00	67,00	67,00	2,329	-	-	165,59		0,32
МОСМАРТФ 1	16.04.2009	17,00	1178	268	0	0,00	75,00	75,00	4,471	-	0,00	-	74,63	0,71
НатурПрод2	16.06.2009	14,50	147		9	4,36	64,99	64,99	1,390	-	13,83	149,69		0,41
НТС-01	28.04.2009	15,00	826	98	0	0,00	32,20	32,20	3,452	-	0,00	-	750,36	0,29
Орхидея 01	09.04.2009	13,00	79		7	0,00	15,92	15,95	0,427	-4,64	-9,20	2450,59		0,22
Патэрсон 1	19.03.2009	12,50	331		1	0,00	65,00	65,00	1,130	-	-30,99	85,74		0,85
ПРОВИАНТ-1														
ПротекФин1	06.05.2009	8,90	1016	288	0	0,00	70,16	70,16	1,853	-	-0,41	-	71,56	0,78
ПятерочкаФ	13.05.2009	11,45	477		0	0,00	109,30	109,30	2,165	-	-	7,88		2,49
ПятерочФ 2	16.06.2009	9,30	693		0	0,00	103,70	103,70	0,892	-	-	8,15		2,88
САМОХВАЛ-1	22.04.2009	14,50	274		0	0,00	39,93	39,92	3,575	-	-1,24	291,47		0,69
СпартакТД2	24.03.2009	16,00	791	245	0	0,00	100,00	96,04	5,216	-	-	-	16,52	0,64
СпортМ-Ф-1	22.05.2009	17,00	486	122	0	0,00	99,90	99,90	2,795	-	-	-	16,84	0,50
ТехИнвст-1	28.05.2009	12,50	856	128	0	0,00	98,65	98,65	1,849	-	-	-	16,27	0,68
Топкнига-1	05.02.2009	0,00	16		0	0,00	98,00	97,35	0,000	-	-	49,68		0,05
Топкнига-2	11.06.2009	20,00	688		0	0,00	74,99	75,00	2,192	-	0,00	43,50		1,64
УНИКУМ-Ф 1	16.06.2009	18,00	329		0	0,00	99,00	99,00	1,726	-	-	-		0,00
ХолидФин1	02.04.2009	13,00	436		0	0,00	94,68	94,68	3,918	-	-	18,01		1,37
Строительство, стройматериалы														
АдаманФ2об	19.02.2009	16,00	485	121	0	0,00	100,00	100,00	2,674	-	-	-	16,93	0,45
Востокцем1	21.05.2009	11,00	303		2	0,00	88,00	88,75	1,838	-	-	28,71		0,80
ДКС ФЖС-1	26.05.2009	12,00	308		0	0,00	99,95	99,93	1,841	-	-	12,40		1,33
Железобет1	20.02.2009	14,00	857	122	4	1,76	58,00	52,38	2,301	-8,64	2,16	-	486,38	0,32
ЖК-Финанс1	19.03.2009	20,00	338		11	0,52	55,00	55,00	1,808	-5,00	-	146,72		0,81
ИнкомФин01	28.03.2009	13,50	67		2	0,02	55,00	55,00	4,290	-2,00	15,00	436,24		0,18
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	135		1	0,15	72,58	72,58	1,738	12,10	37,58	174,28		0,36
КосмосФин1	18.06.2009	13,50	877	149	0	0,00	100,00	100,00	1,221	-	-	-	13,34	0,48
ЛСР-Инв 01	02.06.2009	10,70	322		6	0,24	43,00	43,00	1,436	-0,52	-3,07	199,62		0,82
ЛСР-Инв 02	16.07.2009	8,35	905	177	0	0,00	71,20	71,10	0,114	-	-13,00	-	94,99	0,50
ЛСР 02 обл	05.02.2009	13,25	1654	380	2	0,58	50,00	50,00	6,026	-	-5,02	-	126,96	0,89
Метрострой	27.03.2009	11,70	976	66	0	0,00	89,60	89,79	3,718	-	-0,71	-	74,17	0,18
МИАН-Дев-1	03.03.2009	13,00	406	42	0	0,00	42,00	42,00	4,986	-	-	-	1100,43	0,13
М-ИНДУСТР	17.02.2009	12,25	938		9	0,62	32,00	33,23	5,168	1,84	14,76	86,99		1,77
МинплитаФ1	24.04.2009	16,00	822	276	0	0,00	45,00	45,00	3,858	-	10,56	-	237,64	0,71
Миракс 02	19.03.2009	10,99	240		2	0,00	35,00	35,00	3,734	0,00	-2,44	446,00		0,60
МИЭЛЬ-Ф 01	14.07.2009	16,50	539	175	0	0,00	80,00	80,00	0,316	-	-	-	72,48	0,50
ММ-Фин 02	07.07.2009	16,50	1260	168	0	0,00	80,00	80,00	0,633	-	-	-	74,35	0,62
МОИА 01	21.06.2009	9,00	700		0	0,00	78,20	78,10	0,740	-	-	28,61		1,39
МОИА 02	08.03.2009	7,99	960		0	0,00	82,00	81,95	2,955	-	-	18,47		2,10
МОИТК-01	27.03.2009	9,00	249		2	0,04	14,40	14,51	2,860	-3,49	-10,31	1672,64		0,61
МОРЕ-П 01	03.02.2009	15,50	560	196	0	0,00	89,10	89,05	7,134	-	-	-	43,88	0,56
ПТПА-Ф1	13.05.2009	14,50	295		0	0,00	98,99	99,35	2,741	-	0,00	15,85		0,83
РУБИН-01	14.04.2009	12,00	266		0	0,00	99,06	99,02	3,222	-	-	13,70		0,78
Сенат.УК-1	22.05.2009	15,25	1214	122	0	0,00	62,62	62,62	2,507	-	12,61	-	195,13	0,34
СибАкИнв-1	30.01.2009	12,30	556	10	11	1,90	85,00	84,90	5,796	-2,86	7,40	28,42	616,55	0,03
СибакСтр01	12.05.2009	14,50	112		0	0,00	70,00	70,00	2,781	-	-2,50	147,91		0,32
СпецСтр2 1	21.05.2009	19,00	485		0	0,00	99,00	99,00	3,175	-	-	-		0,00
СтрТрГаз02	17.07.2009	8,49	1270		0	0,00	62,00	61,86	0,093	-	0,00	27,11		2,82
СтрТрГаз03	16.04.2009	11,25	1542	86	0	0,00	94,95	94,48	2,959	-	2,33	-	33,38	0,24
СУ-155 3об	18.02.2009	13,00	1121	29	31	3,17	88,99	89,57	5,449	1,42	-3,43	-	160,50	0,08
СуварКаз-1	31.03.2009	15,25	70		2	0,04	95,00	96,59	4,679	-	-0,41	32,62		0,19
СэтлГрупп1	19.05.2009	11,70	1211	119	1	0,00	40,00	40,00	2,019	-	-11,23	57,30	480,42	0,33
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	1018		0	0,00	97,78	97,77	2,433	-	-	-		0,00
ТехНикольФ	12.03.2009	9,70	1142	233	8	1,21	60,00	61,00	3,481	-2,92	-1,00	-	144,71	0,61
ТНИКОЛЬ-Ф1	13.05.2009	15,10	295	115	0	0,00	99,95	99,95	2,855	-	-	-	15,35	0,00
ЦУН 02 обл	21.01.2009	11,75	365		0	0,00	97,50	95,79	5,827	-	-	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	17.07.2009	12,00	178		0	0,00	99,80	99,80	0,133	-	-	12,58		0,85
АрктелИ 02	13.04.2009	13,75	1175	447	0	0,00	100,03	100,03	3,729	-	-	-	14,14	1,40
ВлгТлкВТ-2	02.06.2009	13,00	679		0	0,00	95,00	95,00	1,745	-	-	-		0,00
ВлгТлкВТ-3	02.06.2009	8,50	679		1	0,36	90,10	90,10	1,141	-	-9,90	19,89		1,03
ВлгТлкВТ-4	10.03.2009	7,99	1687	231	7	6,80	96,18	96,18	0,919	0,16	0,63	-	15,20	0,62
ДальСвз2об	03.06.2009	8,85	1226	498	0	0,00	90,00	90,00	1,164	-	-4,90	-	18,65	1,24
ДальСвз3об	03.06.2009	8,60	134		0	0,00	95,50	95,50	1,130	-	-4,50	21,49		0,37
МГТС-04 об	22.04.2009	7,10	92		1	0,00	99,90	99,90	1,751	-	-	7,37		0,25
МГТС-05 об	26.05.2009	7,10	490	126	2	0,87	96,00	96,00	1,090	-	-	-	118,70	0,35
МТС 03	23.06.2009	8,70	3430	518	4	55,05	84,50	85,34	0,667	0,59	-2,65	-	23,18	1,35
РАДИОНЕТ-2	25.03.2009	16,50	792	246	0	0,00	70,00	70,00	5,334	-	-	-	99,09	0,70
СЗТелек3об	26.02.2009	8,60	765		0	0,00	85,00	89,50	1,272	-	0,00	16,75		1,57
СЗТелек4об	12.03.2009	8,10	1052		0	0,00	86,05	86,05	0,888	-	-13,95	17,06		1,90
СЗТелек5об	24.02.2009	15,00	1582	490	2	4,67	91,10	91,10	2,301	1,10	6,07	-	-	0,00
СибТлк-6об	19.03.2009	9,75	604		0	0,00	79,40	82,47	3,312	-	-	23,74		1,58
СибТлк-7об	20.05.2009	8,65	120		2	0,90	98,15	98,04	1,469	-0,24	-0,62	14,68		0,33
Синтерра 1	05.02.2009	11,00	1654	198	0	0,00	88,10	88,10	5,003	-	-1,10	-	40,55	0,53
Система-01	12.03.2009	9,45	1507	51	0	0,00	98,30	98,35	3,392	-	-0,62	-	21,25	0,14
СМАРТС 03	31.03.2009	14,10	252		0	0,00	91,00	90,98	4,327	-	0,98	31,14		0,67
УрСИ сер06	21.05.2009	13,00	1031	303	0	0,00	100,00	100,00	2,173	-	-	-	38,78	0,96
УрСИ сер07	17.03.2009	8,40	1148	56	5	5,10	99,00	99,01	2,900	-	-0,49	-	14,63	0,15
УрСИ сер08	08.04.2009	9,60	1534	442	0	0,00	86,00	86,00	2,735	-	0,00	-	24,86	1,16
ЦентрТел-4	19.02.2009	13,80	213		5	0,22	97,99	97,46	5,785	-0,12	-2,12	19,36		0,55
ЦентрТел-5	03.03.2009	9,30	952		0	0,00	89,00	89,03	3,567	-	-	16,02		1,94
ЦНТ-03 обл	01.04.2009	9,75	71		2	0,10	98,90	98,90	0,534	-	-0,10	15,49		0,19
ЮТК-03 об.	10.04.2009	8,50	263		3	5,73	93,00	93,00	2,399	2,83	1,27	19,82		0,70
ЮТК-04 об.	11.03.2009	10,00	323		12	0,10	91,50	90,13	1,124	-2,42	-1,58	30,64		0,60
ЮТК-05 об.	03.06.2009	7,55	1226	498	0	0,00	81,50	81,50	0,993	-	-2,50	-	25,71	1,31
Транспорт														
ДВТГ-Ф 01	03.02.2009	10,75	560	14	0	0,00	76,68	76,68	4,948	-	0,00	-	757,98	0,06
ДВТГ-Ф 02														
КДавиаФин1	22.04.2009	18,00	456	92	0	0,00	48,03	48,02	4,438	-	-0,98	-	427,28	0,25
РЖД-03обл	03.06.2009	8,33	316		0	0,00	99,55	99,55	1,095	-	0,00	9,05		0,87
РЖД-05обл	22.01.2009	6,67	2		0	0,00	99,94	99,94	3,289	-	0,00	8,85		0,02
РЖД-06обл	13.05.2009	7,35	659		0	0,00	95,45	95,45	1,389	-	1,55	10,40		1,71
РЖД-07обл	13.05.2009	7,55	1387		0	0,00	95,00	95,00	1,427	-	-	9,34		3,32
Сибирь-01	21.07.2009	18,00	1274	182	13	0,22	79,99	75,79	0,000	-	8,77	-	72,67	0,50
ТрансаэроФ	05.02.2009	10,66	16		11	0,34	97,05	97,08	4,848	-0,15	-0,96	75,80		0,04
ТрансКонт1	03.03.2009	9,50	1498	42	6	2,63	98,60	98,59	3,644	0,24	0,14	-	21,19	0,12
Усть-Луга1	12.02.2009	9,90	387		0	0,00	93,00	93,00	1,844	-	32,98	18,30		1,01
ЭйрЮнион01	10.02.2009	11,00	294		2	0,00	0,65	0,65	2,110	0,10	0,09	#########		0,06
ЮТэйр-Ф 03	16.06.2009	16,00	693	329	0	0,00	95,00	95,00	1,534	-	-	-	23,60	0,93
Финансовый сектор														
АВТОВАЗБ-1	03.04.2009	13,70	437	164	0	0,00	87,00	84,15	0,676	-	-	-	56,55	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	377		0	0,00	96,95	96,95	5,184	-	0,70	14,77		0,96
АИЖК 3об	15.04.2009	9,40	633		0	0,00	93,75	94,51	0,129	-	-	15,69		1,03
АИЖК 4об	01.02.2009	8,70	1107		0	0,00	95,00	95,00	1,907	-	0,00	11,05		2,69
АИЖК 5об	15.04.2009	7,35	1364		0	0,00	75,50	74,42	0,101	-	-	19,29		2,80
АИЖК 6об	15.04.2009	7,40	2002		0	0,00	58,00	58,00	0,101	-	-	24,97		3,45
АИЖК 7об	15.04.2009	7,68	2733		1	0,02	59,00	59,00	0,105	-	-	21,33		4,25
АИЖК 8об	15.03.2009	7,63	3433	1880	0	0,00	57,31	57,60	0,753	-	0,00	23,31	25,69	3,74
АИЖК 9об	15.02.2009	7,49	2948	2217	2	1,21	59,00	59,00	1,354	-	0,39	21,20	22,17	4,10
АИЖК 10об	15.02.2009	8,05	3586		7	2,34	55,50	55,18	1,456	0,81	-1,32	21,59		4,60
АК БАРС-02	22.01.2009	8,00	2		0	0,00	99,80	99,47	3,945	-	0,00	28,55		0,02
АКИБАНК-1	23.04.2009	14,00	93		0	0,00	95,00	95,00	3,414	-	-	30,24		0,32
АльянсФин1	24.06.2009	8,76	1247	519	0	0,00	99,93	99,92	0,647	-	-	-	9,00	1,43
БалтИнвБ-1	27.01.2009	13,50	826	98	0	0,00	85,00	85,00	3,107	-	4,00	-	109,15	0,27
БанкСОЮ302	05.04.2009	8,37	258		0	0,00	101,00	101,00	2,477	-	-	7,01		0,70
БанкСОЮ303	27.04.2009	10,10	832	97	0	0,00	100,00	100,00	2,352	-	0,00	-	9,87	0,29
БПФ-01	12.02.2009	11,50	23		8	0,72	97,00	96,54	2,142	-	-2,26	67,30		0,06
ВБРР Обл.	10.04.2009	10,00	264		0	0,00	100,50	100,25	0,329	-	-	10,04		0,82
ВТБ - 4 об	19.03.2009	8,80	58		9	6,15	99,70	99,67	2,990	-0,03	-0,13	10,59		0,16
ВТБ - 5 об	22.01.2009	8,60	1731	93	0	0,00	98,89	98,81	2,097	-	-0,08	-	13,75	0,27
ВТБ - 6 об	15.04.2009	8,60	2724	176	24	42,39	97,85	97,85	0,141	0,44	-	-	13,95	0,48
ВТБ24 01	08.04.2009	9,75	988	260	0	0,00	95,50	95,50	2,778	-	0,00	-	17,33	0,71
ВТБ24 02	10.02.2009	7,70	1477	21	0	0,00	99,91	99,91	3,396	-	-	-	8,97	0,18
ВТБ24 03	03.06.2009	8,18	1590	134	14	84,89	97,70	97,59	1,076	0,20	-0,03	-	14,62	0,37
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	737		0	0,00	83,00	83,00	3,365	-	-3,02	18,19		1,83
ГазпромБ 2	27.05.2009	6,54	1765		0	0,00	99,97	99,97	0,985	-	-	-		0,00
ГЛОБЭКС 01	10.03.2009	10,00	419	49	1	3,04	95,50	95,50	3,562	-	-6,25	14,06	44,55	0,13
ДельтаКр-1	02.06.2009	7,09	315		0	0,00	96,00	96,00	0,952	-	0,00	12,15		0,90
ЕврокомФК1	19.06.2009	16,00	332		1	0,00	12,60	12,60	1,403	-	5,99	1114,36		0,81
ЕврокомФК3	19.06.2009	16,00	514		14	0,72	7,40	6,50	1,403	-1,51	-9,49	951,41		0,97
Европлан-1	12.02.2009	14,50	933	569	2	3,24	40,00	40,00	6,316	-	5,00	-	189,81	0,94
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	27		3	8,26	99,79	99,64	3,586	0,18	0,22	12,83		0,07
Зенит 3обл	13.05.2009	9,90	1023	113	0	0,00	96,70	96,60	1,872	-	0,05	-	20,85	0,32
Зенит 4обл	05.04.2009	12,50	441	73	0	0,00	98,00	98,00	3,699	-	0,00	-	22,12	0,22
Зенит 5обл	09.06.2009	10,00	1596	322	1	3,65	90,07	90,07	1,151	2,07	-5,10	-	24,33	0,86
КБРенКап-1	03.03.2009	14,50	406		0	0,00	66,00	66,00	5,562	-	5,88	69,12		0,99
КБРенКап-2	14.04.2009	11,66	1170	84	10	2,38	84,94	84,50	3,099	-	2,11	-	87,57	0,23
Кедр-02	17.03.2009	12,30	238		4	0,18	87,02	86,24	1,179	3,04	1,24	42,39		0,63
Кедр-03	23.01.2009	12,80	913	196	0	0,00	99,73	99,72	3,086	-	-	-	14,02	0,58
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	1044	316	0	0,00	95,00	95,00	1,973	-	-	-	22,70	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	927	199	0	0,00	100,00	100,00	5,560	-	-	-	12,65	0,64
КрЕврБ-02	30.06.2009	9,00	889	343	0	0,00	100,00	100,00	0,518	-	-	-	9,19	0,92
МастерБ-3	03.06.2009	13,75	1044	134	0	0,00	90,00	90,00	1,808	-	-	-	44,65	0,38
МБРР 02обл	02.04.2009	11,50	1528	72	1	3,81	97,10	97,10	0,599	-	0,35	-	26,82	0,20
МБРР 03обл	27.01.2009	10,00	1554	98	0	0,00	97,30	97,30	2,301	-	-	-	22,22	0,34
МДМ-Банк03	02.04.2009	12,00	254		0	0,00	100,15	100,15	3,616	-	-	12,08		0,74
МЗБанк1	18.05.2009	11,65	301		0	0,00	98,03	98,02	2,075	-	-	14,13		0,99
МИА-3об	26.02.2009	7,95	1129	37	0	0,00	94,50	94,50	1,176	-	0,52	-	65,02	0,12
МИА-5об	22.01.2009	10,30	2004	184	0	0,00	105,00	105,00	2,512	-	0,00	-	0,37	0,54
МКБ 02обл	04.06.2009	11,50	135		0	0,00	94,00	94,00	1,481	-	2,00	28,92		0,37
МКБ 03обл	17.06.2009	15,00	512	148	0	0,00	99,75	99,75	1,397	-	-	15,76	15,44	0,47
МКБ 04обл	17.03.2009	11,50	784	56	0	0,00	93,50	93,51	3,970	-	-2,24	-	55,26	0,16
МОИА 01	21.06.2009	9,00	700		0	0,00	78,20	78,10	0,740	-	-	28,61		1,39
МОИА 02	08.03.2009	7,99	960		0	0,00	82,00	81,95	2,955	-	-	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	756	28	0	0,00	100,00	99,98	5,274	-	-	-	11,87	0,00
НацКап-01	31.03.2009	11,50	1344	70	0	0,00	100,00	100,00	3,529	-	-	-	11,11	0,34
НОМОС 7в	16.06.2009	9,25	147		0	0,00	95,01	95,76	0,887	-	0,75	20,39		0,41
НОМОС-Лиз1	10.07.2009	12,00	899		0	0,00	97,82	97,81	0,362	-	-	13,46		2,14
НС-фин. 01	23.05.2009	12,75	855	123	0	0,00	102,00	102,00	2,096	-	-	-	6,55	0,41
НФК-2	09.02.2009	1,00	112		0	0,00	94,20	94,20	0,197	-	-	14,03		0,49
НФК-3	28.04.2009	13,00	833	98	3	1,08	88,99	85,79	2,992	-	-1,69	-	58,71	0,27
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	99		0	0,00	92,50	92,11	1,976	-	1,88	38,45		0,29
Промсвб-05	21.05.2009	7,99	1213	121	0	0,00	99,50	99,45	1,335	-	0,00	-	9,42	0,39
ПЧРБ-Фин1	11.03.2009	12,50	778	50	0	0,00	97,20	97,20	1,404	-	5,45	-	33,40	0,14
РИАТО-01	09.03.2009	13,75	1595		0	0,00	99,85	99,85	1,620	-	0,05	14,52		3,14
РИГрупп 02	21.01.2009	15,00	914	184	0	0,00	100,00	99,97	7,438	-	-	-	15,56	0,64
РМБ	27.04.2009	12,00	97		0	0,00	99,17	99,12	2,827	-	-	14,52		0,33
РОСБАНК-1	15.02.2009	7,70	26		1	0,02	99,55	99,55	3,312	-	-0,15	13,63		0,07
РосселхБ 2	18.02.2009	7,85	757		3	15,17	82,00	81,98	1,333	-7,02	-11,35	19,83		1,89
РосселхБ 3	19.02.2009	7,34	2942	394	0	0,00	92,50	92,50	3,057	-	3,96	-	15,68	1,04
РосселхБ 4	08.04.2009	9,75	3172	260	0	0,00	101,53	101,53	2,778	-	0,00	-	7,61	0,75
РосселхБ 6	20.02.2009	8,75	3307	31	1	0,13	99,80	99,80	3,620	-	0,13	-	10,74	0,08
РосселхБ 7	16.06.2009	8,30	3423	147	0	0,00	99,00	99,00	0,796	-	0,00	-	10,81	0,46
РТК-ЛИЗ 5с	12.02.2009	8,35	569		1	0,00	88,70	88,70	3,637	-	-	22,26		0,95
РусСтанд-5	12.03.2009	13,00	597	233	0	0,00	90,00	90,00	4,666	-	0,00	-	33,75	0,66
РусСтанд-6	11.02.2009	8,15	750	22	9	7,07	97,25	97,77	3,573	0,05	0,90	-	53,33	0,06
РусСтанд-7	24.03.2009	12,20	973	63	0	0,00	93,75	94,25	3,978	-	1,96	-	49,53	0,18
РусСтанд-8	17.04.2009	15,00	1179		0	0,00	50,00	50,00	3,904	-	-	-		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	113		4	11,03	95,50	95,36	1,427	-0,61	0,36	23,29		0,31
Русфинанс4	13.02.2009	7,74	388		0	0,00	74,50	72,17	3,350	-	0,17	47,48		1,00
РусьБанк-1	19.03.2009	10,00	58		12	40,53	97,00	96,88	3,397	-0,12	1,35	29,55		0,16
РусьБанк-2	21.02.2009	12,50	398	215	1	0,01	85,00	85,00	5,171	-4,50	-	-	48,71	0,56
СвязьБанк1	22.01.2009	8,90	821	93	0	0,00	94,00	96,83	2,170	-	0,00	-	39,22	0,27
СевКазна-1	02.04.2009	9,50	254		0	0,00	100,18	100,18	0,495	-	-	9,39		0,81
СевКазна-2	27.01.2009	12,50	923	189	0	0,00	94,90	93,69	2,877	-	-0,30	-	25,32	0,51
СКБ-банк 1	19.03.2009	12,80	520	149	0	0,00	84,01	85,50	1,139	-	0,50	-	74,42	0,41
Солидарн-1	03.03.2009	12,50	315		0	0,00	100,00	100,00	1,678	-	0,00	13,08		0,88
Солидарн-2	21.04.2009	14,00	455	91	0	0,00	100,00	100,00	0,000	-	0,00	-	14,00	0,30
СоцГорБ-01	24.03.2009	13,00	65		0	0,00	98,10	98,10	4,203	-	0,10	22,79		0,18
СтрКредит1	27.01.2009	13,25	923	189	0	0,00	60,01	60,01	6,353	-	-39,98	-	204,48	0,47
СудострБ-1	02.07.2009	9,85	163		0	0,00	87,00	86,99	0,513	-	-3,98	44,36		0,45
ТатфондБ 3	17.02.2009	11,75	119		5	0,37	91,85	91,87	2,028	0,68	0,27	45,65		0,32
ТатфондБ 4	03.06.2009	11,40	862	316	0	0,00	88,50	88,50	1,499	-	0,00	-	28,92	0,86
ТрансКред3	09.07.2009	9,99	898	352	4	4,01	87,00	87,04	0,328	-	-1,96	-	27,77	0,94
ТурАлемФ 1	07.04.2009	7,75	259		0	0,00	100,00	100,13	2,229	-	-	7,84		2,38
УБРиР-ф 02	02.04.2009	12,50	163		3	2,45	89,10	81,01	0,651	4,50	2,99	82,14		0,44
УралЛЦ-01	22.04.2009	10,00	281		0	0,00	96,15	96,22	2,466	-	-	15,05		0,89
УралсибЛК1	24.06.2009	11,60	708	155	6	3,22	78,98	74,01	0,858	-1,99	-6,71	-	76,53	0,42
УралсибЛК2	22.01.2009	12,99	912	366	0	0,00	52,00	52,01	6,406	-	-1,99	-	123,04	0,87
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	135		0	0,00	95,20	95,20	1,236	-	2,10	23,32		0,37
УРСАБанк 5	21.04.2009	10,05	1001		13	1,30	55,00	55,05	2,506	-1,95	-9,14	41,20		2,26
УРСАБанк 7	22.01.2009	8,40	1276	366	0	0,00	75,02	80,24	4,142	-	0,00	-	45,53	0,96
УРСАБанк 8	16.04.2009	11,19	2270	86	0	0,00	97,10	97,10	2,943	-	0,10	-	23,49	0,25
ХКФ Банк-2	12.05.2009	9,25	476	112	1	0,74	90,11	90,11	1,774	0,10	-2,64	-	45,14	0,31
ХКФ Банк-3	19.03.2009	13,00	604	58	0	0,00	102,70	105,96	1,175	-	0,00	-	-	0,00
ХКФ Банк-4	15.04.2009	13,00	995	267	0	0,00	99,00	99,50	0,214	-	-	-	15,26	0,72
Центр-инв1	12.05.2009	16,00	295	141	0	0,00	97,70	91,23	3,112	-	0,00	29,90	20,71	0,44
Экспобанк1	24.03.2009	9,00	343	63	0	0,00	99,50	99,37	0,614	-	-	-	12,33	0,00
Юниаструм	17.02.2009	11,00	28		1	0,00	99,50	99,50	4,641	0,00	-0,50	16,82		0,08
ЮнКрБанк-2	11.02.2009	7,55	22		0	0,00	100,00	100,00	3,310	-	-	-		0,00
Химия, ЛПК														
АрнестФ-01	29.04.2009	11,00	99		0	0,00	98,80	98,80	2,712	-	-	13,76		0,44
АЦБК-Инв 3	16.04.2009	9,70	814	86	0	0,00	100,05	100,05	0,134	-	-	-	9,46	0,80
ВМУ-Фин 01	23.06.2009	16,00	336		0	0,00	94,90	94,90	1,227	-	-	-		0,00
ГОТЭК-2	18.06.2009	13,00	149		0	0,00	73,00	73,20	1,175	-	1,70	105,21		0,41
КуйбАзот-2	06.03.2009	8,80	778		0	0,00	73,10	73,10	3,303	-	0,00	27,61		1,89
Миннеско-1	11.06.2009	13,75	324		2	0,00	1,55	1,55	1,507	-0,45	-1,14	9332,61		0,70
НИКОСХИМ 2	12.02.2009	11,25	212		2	0,01	23,00	23,00	2,096	-	-7,00	1382,08		0,52
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	329	56	8	0,23	44,90	41,75	1,127	4,33	6,29	201,73	798,71	0,15
НКНХ-04 об	30.03.2009	9,99	1161	69	1	0,05	95,10	95,10	3,093	-	-3,40	-	36,57	0,19
НЭФИС-02	17.06.2009	12,50	330	148	4	0,57	75,00	75,28	1,164	-22,71	-20,30	-	97,36	0,41
ПЕНОПЛЭКС1	18.06.2009	1,00	331		1	0,01	70,00	70,00	0,090	-	0,00	49,79		0,90
РЕТАЛ-1	10.06.2009	15,00	323		0	0,00	94,00	94,00	1,685	-	-	23,33		0,95
САНОС-02об	12.05.2009	10,00	294		0	0,00	91,00	92,00	1,918	-	1,00	22,13		0,80
СЗЛК-Фин-1	03.03.2009	11,50	406		4	0,00	0,01	0,01	4,411	-	0,00	-		0,00
СИБУРХолд1	07.05.2009	7,70	1381	289	0	0,00	100,00	100,00	1,582	-	0,00	-	7,82	0,83
Слвстекло2	29.04.2009	10,50	281		1	1,25	70,00	70,00	2,388	-	0,00	74,79		0,76
СНХЗ Фин 1	31.03.2009	12,00	252		0	0,00	64,02	64,02	3,682	-	0,00	111,15		0,67

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	778	58	3	0,24	95,00	95,00	0,728	-3,00	-4,50	-	41,54	0,16
ГенерКомп1	23.06.2009	9,25	882	154	0	0,00	99,50	99,50	0,710	-	0,00	-	10,41	0,44
ГидроОГК-1	01.07.2009	8,10	890		12	1,03	72,92	72,55	0,444	0,44	-0,64	24,90		2,21
ДГК-01	13.03.2009	10,50	1508	52	8	10,63	83,50	83,41	3,740	1,73	2,91	-	144,79	0,14
ЕЭСК-02	09.04.2009	8,74	1171	83	2	2,28	95,50	95,50	2,466	0,06	0,58	-	32,65	0,23
Кубаньэн-1	21.01.2009	7,85	547		0	0,00	102,90	102,95	3,893	-	-	4,37		0,84
Ленэнерг02	30.01.2009	8,54	1102		4	0,13	54,60	54,63	4,024	-0,37	-2,15	36,40		2,42
Ленэнерго3	22.04.2009	8,02	1184		7	5,61	55,00	54,04	1,978	2,49	-2,44	34,17		2,69
Мосэнерго1	17.03.2009	7,54	966	238	0	0,00	98,00	98,00	2,603	-	0,00	-	11,05	0,65
Мосэнерго2	26.02.2009	7,65	2585	1129	0	0,00	75,00	75,00	3,039	-	-5,66	-	19,50	2,66
МОЭСК-01	10.03.2009	8,05	959		0	0,00	74,70	74,70	2,933	-	0,70	22,08		2,31
ОГК-2 01об	02.07.2009	7,70	531		36	59,72	76,00	75,55	0,401	-2,44	-1,64	31,92		1,38
ОГК-3 об-1	12.06.2009	8,20	1053		0	0,00	100,00	100,00	0,876	-	-	-		0,00
ОГК-5 об-1	02.04.2009	7,50	982	254	1	0,76	92,50	92,50	2,260	-0,70	-1,50	-	20,42	0,68
ОГК-6 01об	23.04.2009	7,55	1185	457	5	2,92	80,50	79,96	1,841	0,74	7,63	-	28,65	1,19
ТГК-1 01	17.03.2009	7,75	1876	420	0	0,00	80,00	80,00	2,675	-	5,00	-	31,58	1,10
ТГК-2 1об	03.03.2009	10,95	924	224	0	0,00	100,00	100,00	4,200	-	-	-	11,20	0,59
ТГК-10 об1	18.06.2009	7,60	513	149	3	0,09	94,00	94,00	0,687	-0,10	-0,02	-	23,55	0,41
ТГК-4 об.1	04.06.2009	7,60	1227	135	19	6,81	94,00	93,30	0,979	-1,59	-2,95	-	25,08	0,37
ТГК-6Инв-1	24.02.2009	10,00	1127	35	0	0,00	98,29	98,29	1,534	-	0,79	-	27,88	0,11
ТГК-8 01	14.05.2009	8,00	1206	114	1	49,23	94,00	92,75	1,490	-	-	-	28,50	0,39
Тюменэнрг2	02.04.2009	7,70	1164	436	0	0,00	77,80	77,65	2,321	-	2,65	-	33,76	1,13
ФСК ЕЭС-02	23.06.2009	8,25	518		3	0,60	92,00	92,00	0,633	-0,20	-0,01	15,22		1,36
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	989		0	0,00	80,00	79,92	2,060	-	-0,98	17,51		2,42
ФСК ЕЭС-05	02.06.2009	7,20	315		2	0,10	95,70	95,70	0,967	0,70	-0,80	12,98		0,85
ЭнергоСт-1	22.05.2009	14,75	850	304	0	0,00	100,00	100,00	2,425	-	-	-	15,21	0,00
ЭнергЦент1	09.07.2009	22,00	537		0	0,00	88,99	88,99	0,663	-	-	36,88		1,32
Якутскэн02	12.03.2009	8,59	1143	51	0	0,00	98,59	98,54	3,083	-	-	-	18,37	0,21
Прочие														
РКС-01	15.04.2009	1,00	85		0	0,00	102,90	102,95	0,266	-	-	-		0,00
АиФМПфин 1	17.06.2009	14,00	148		0	0,00	85,00	85,00	1,304	-	3,79	57,57		0,42
КАРО 01	23.06.2009	14,30	336	154	0	0,00	80,00	80,00	1,097	-	-18,61	-	76,08	0,44
Интурист-1	22.04.2009	9,00	456		0	0,00	95,80	95,80	2,219	-	0,00	12,96		1,24
ТАИФ-Фин01	12.03.2009	8,42	597		0	0,00	99,80	99,81	3,022	-	-	-		0,00
РБК ИС БО4	24.03.2009	12,25	63		38	1,07	7,70	9,07	10,102	0,36	-30,37	2811,73		0,17

Источник: ММВБ, расчеты Банка ЗЕНИТ

Приложение 7. ОФБУ Банка ЗЕНИТ

Изменение стоимости пая

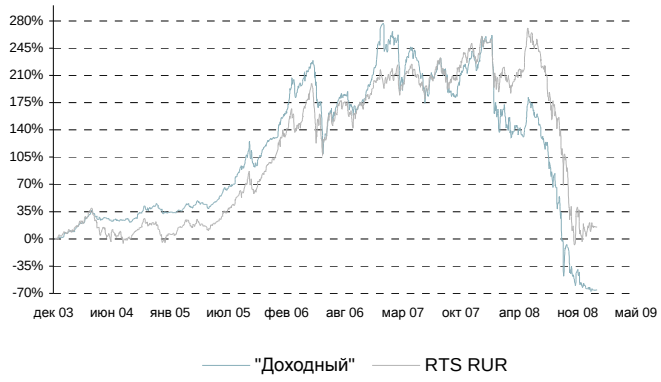
Фонд (ОФБУ)	Стратегия	С начала работы Фонда*	С начала года**	1 день	1 мес.	6 мес.**	1 год.**	Доля риска в цене, %	Коэффициент Шарпа **
Доходный	Агрессивная	-65,39%	-90,19%	1,89%	-4,99%	-84,91%	-90,21%	41,03	-0,48
Универсальный	Умеренная	10,35%	-32,05%	1,01%	2,57%	-30,00%	-32,59%	14,85	-0,33
Перспективный	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

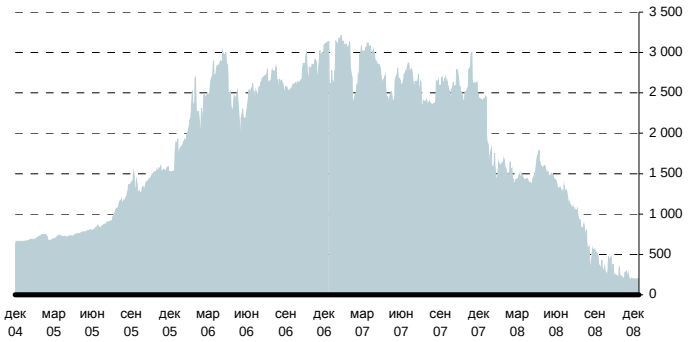
(**) Если в ячейке стоит "-", значит недостаточно статистических данных

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

ОФБУ "Доходный"



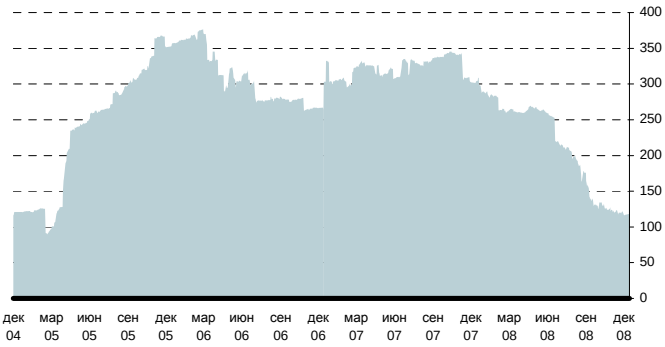
Стоимость чистых активов фонда "Доходный" млн. руб.



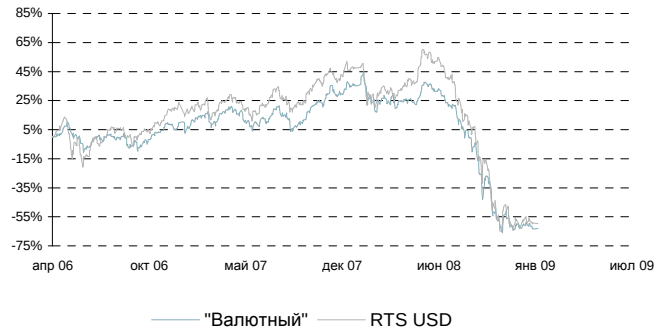
ОФБУ "Универсальный"



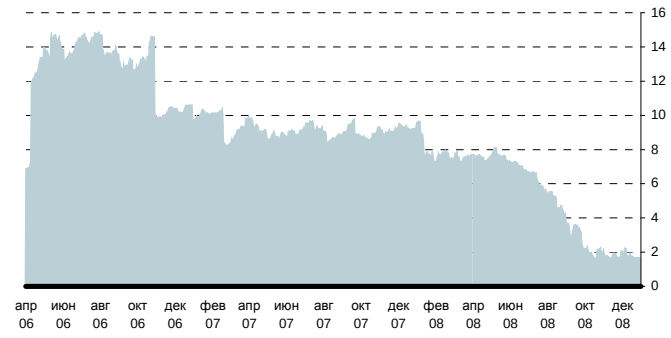
Стоимость чистых активов фонда "Универсальный" млн. руб.



ОФБУ "Валютный"



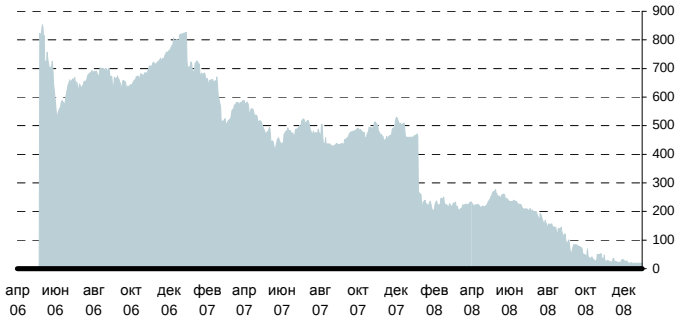
Стоимость чистых активов фонда "Валютный" млн. дол.



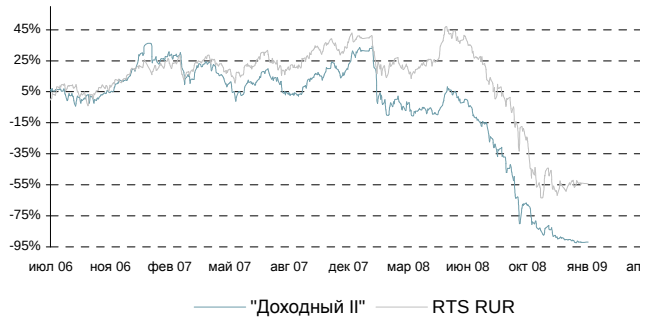
ОФБУ "Перспективный"



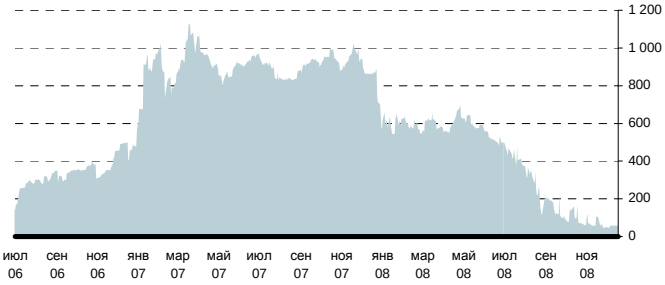
Стоимость чистых активов фонда "Перспективный" млн. руб.



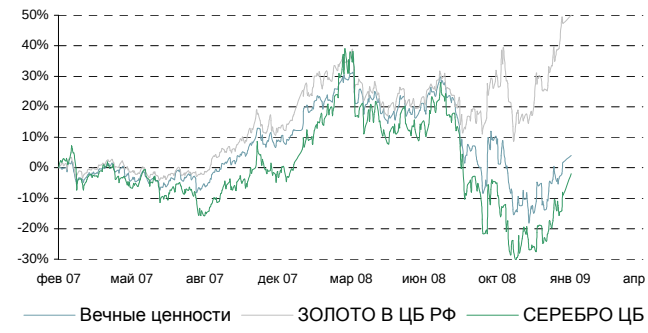
ОФБУ "Доходный II"



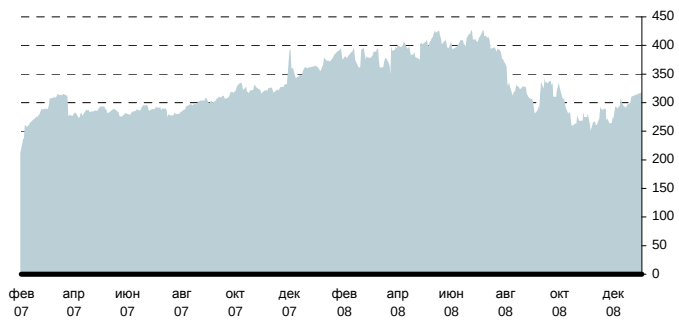
Стоимость чистых активов фонда "Доходный II" млн. руб.



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	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.