

Ежедневный информационно-аналитический обзор за 24 сентября 2015 года

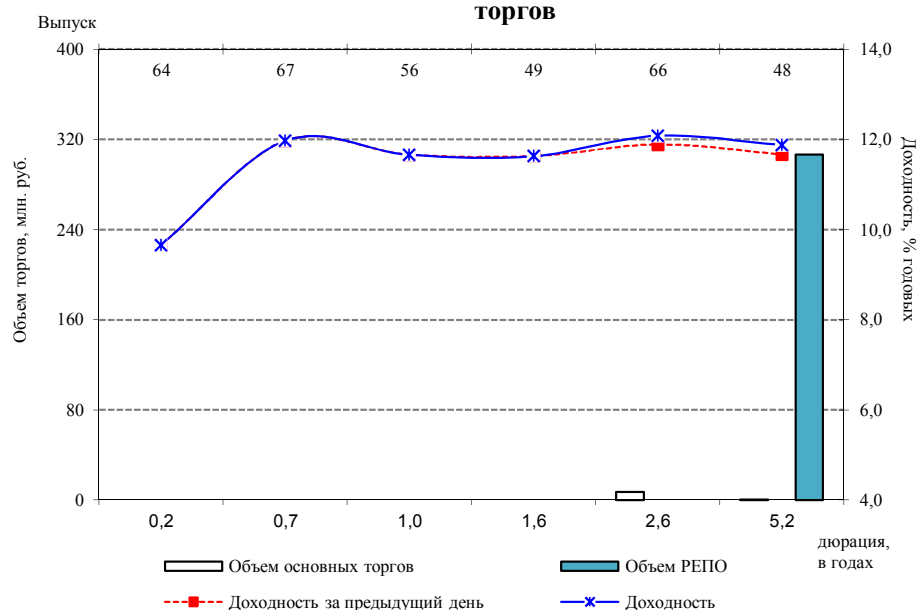
<i>Рынок ОГО(В)З Москвы (в сопоставлении с ключевыми инструментами внутреннего рынка облигаций).....</i>	<i>2</i>
<i>Ключевые рыночные факторы ОГО(В)З Москвы (денежный, валютный, фондовый, товарные рынки, а также рынок внешнего долга).....</i>	<i>4</i>
<i>Первичный рынок (итоги размещений и планируемые выпуски облигации на внутреннем рынке).....</i>	<i>5</i>
 Приложение:	
<i>Итоги торгов на рынке облигаций, номинированных в рублях.....</i>	<i>6</i>
<i>Индексы рынка субфедеральных облигаций.....</i>	<i>17</i>
<i>Итоги торгов на рынке российских облигаций, номинированных в иностранной валюте.....</i>	<i>18</i>
<i>Оценка кредитных спрэдов на внутреннем рынке облигаций.....</i>	<i>23</i>

25 сентября 2015 года

Итоги торгов на рынке ОГО(В)З Москвы и облигаций федеральных займов

Выпуски ОГО(В)З Москвы	Дата погашения	Дюрация, в годах	Средневзвешенная доходность, % год.*	Изменение доходности	Выпуски ОФЗ	Дата погашения	Дюрация, в годах	Средневзвешенная доходность, % год.*	Изменение доходности	Спрэд ОГО(В)З к ОФЗ, б.п.
RU32064MOS0	16.11.15	0,2	9,66	0,00	25077RMFS	20.01.16	0,3	10,15	0,15	-49
RU25067MOS0	01.06.16	0,7	11,97	0,00	25082RMFS	11.05.16	0,6	10,90	0,43	107
RU32056MOS0	22.09.16	1,0	11,66	0,00	26203RMFS	03.08.16	0,8	10,73	-0,01	93
RU32049MOS0	14.06.17	1,6	11,63	0,00	26206RMFS	14.06.17	1,6	11,27	-0,01	36
RU27066MOS0	23.11.18	2,6	12,08	0,19	24018RMFS	27.12.17	1,9	14,83	-0,01	-275
RU32048MOS0	11.06.22	5,2	11,88	0,21	26209RMFS	20.07.22	5,2	11,10	-0,09	78
					26211RMFS	25.01.23	5,6	11,36	0,12	52

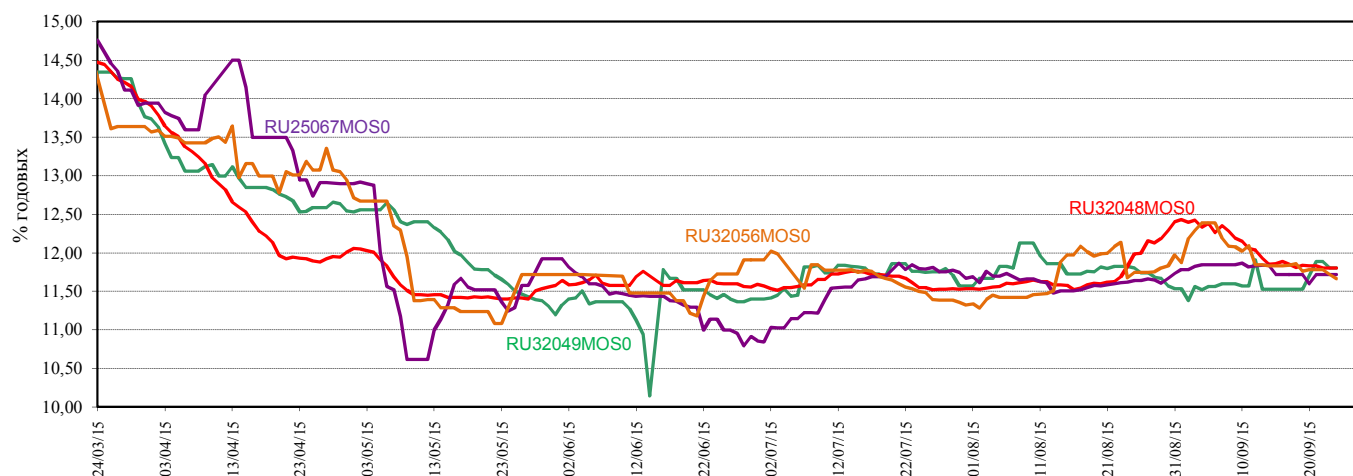
График 1. Кривые доходности ОГО(В)З Москвы и объемы торгов



Объем торгов на ММВБ, млн. руб.	ОГО(В)З Москвы	ОФЗ
режим основных торгов	7	3 699
РПС	0	5 179
РЕПО	306	13 586

Дата	Средневзвешенная доходность рынка ОГО(В)З, % годовых
22 сен 15	11,75
23 сен 15	11,70
24 сен 15	11,85

График 2. Динамика доходности отдельных выпусков ОГО(В)З Москвы



На графике построены линии тренда

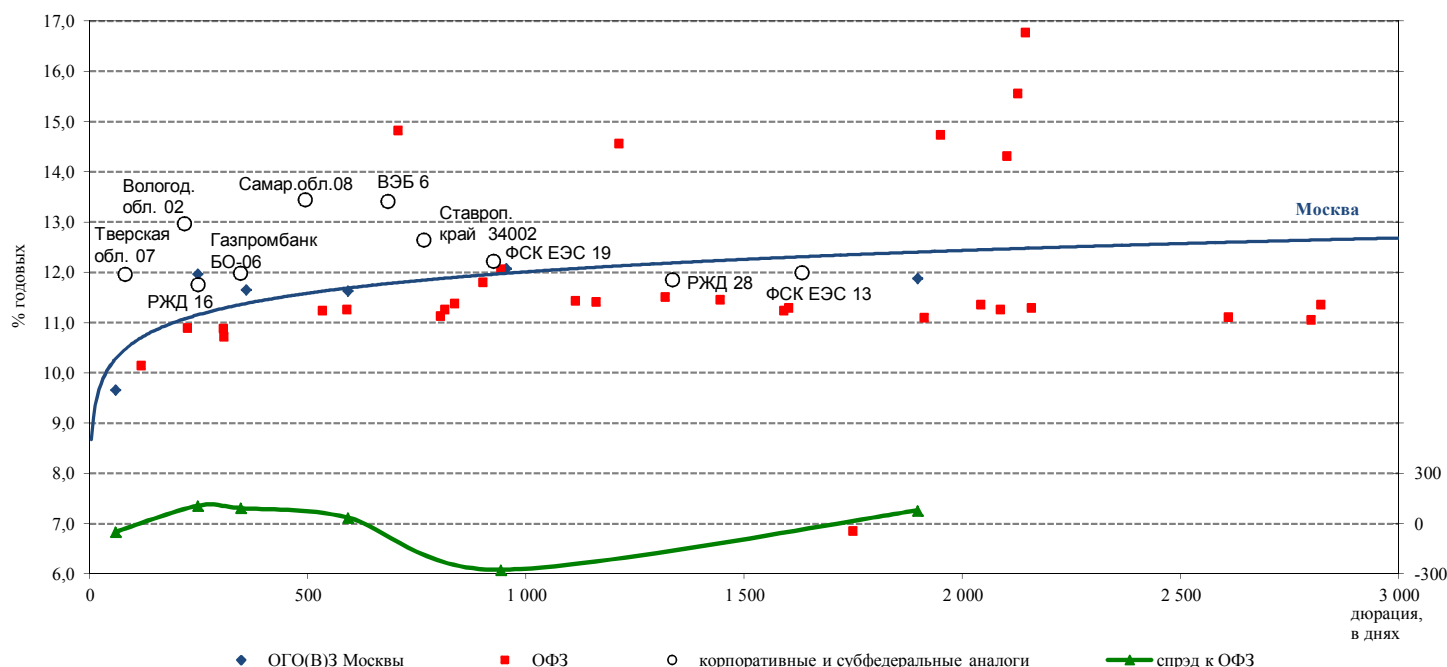
* В случае отсутствия торгов за отчетную дату, средневзвешенная доходность принимается равной последней установленной по данному выпуску

Итоги торгов на рынке корпоративных и субфедеральных облигаций

Выпуски	Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	Дата погашения	Дюрация, в годах	Средневзвешенная доходность, % год.*	Изменение доходности	Объем торгов за день, млн. руб.	
						основной режим	РПС
МФ Тверской обл. 34007	Suspended-/BB-	15.12.15	0,2	11,96	1,02	0,08	-
Вологодская область, 34002	Withdrawn/B2/Withdrawn	14.12.16	0,6	12,97	-0,26	0,00	-
РЖД, 16	BB+/Ba1/BBB-	05.06.17	0,7	11,75	-0,18	15,18	17,58
Газпромбанк, БО-06	BB+/Ba2/BB+	25.09.16	0,9	11,98	0,00	-	-
Самарская обл., 08	BB/Ba3/-	13.12.17	1,4	13,44	0,00	-	-
ВЭБ 6	BB+/Ba1/BBB-	13.10.20	1,9	13,41	0,00	-	-
Ставропольский край, 34002	Withdrawn-/BB	04.11.20	2,1	12,64	0,00	-	-
ФСК ЕЭС, 19	BB+/Ba1/BBB-	06.07.23	2,5	12,22	0,00	-	-
РЖД, 28	BB+/Ba1/BBB-	21.03.28	3,7	11,85	-0,01	8,86	-
ФСК ЕЭС, 13	BB+/Ba1/BBB-	22.06.21	4,5	11,99	-0,01	0,10	195,06

График 3. Уровни доходностей ОГО(В)З Москвы, ОФЗ и некоторых субфедеральных и корпоративных выпусков и спреда ОГОВ(З) Москвы к ОФЗ

Спрэд, б. п.



На графике 3 кривая доходностей ОГО(В)З Москвы сглажена с использованием логарифмической функции

ДАННЫЕ ПО РЫНОЧНЫМ ЦЕНАМ ОГО(В)З МОСКВЫ, РАССЧИТАННЫМ В СООТВЕТСТВИИ С ПОРЯДКОМ, ОПРЕДЕЛЕННЫМ ФСФР

Выпуск ОГО(В)З Москвы	Дата начала размещения	Дата погашения	Рыночная цена (по ФСФР)	Доходность к погашению эффективная, % годовых	Дюрация, в днях
RU32064MOS0	16.11.09	16.11.15	100,21	10,54	53
RU25067MOS0	05.06.13	01.06.16	96,96	12,03	245
RU32056MOS0	22.09.08	22.09.16	96,00	11,68	358
RU32049MOS0	14.12.06	14.06.17	93,05	11,88	591
RU27066MOS0	23.11.09	23.11.18	105,00	12,08	955
RU32048MOS0	11.12.06	11.06.22	76,19	11,88	1 897

* В случае отсутствия торгов за отчетную дату, средневзвешенная доходность принимается равной последней установленной по данному выпуску

График 4. Остатки средств на корсчетах (по России) и депозиты банков в Банке России

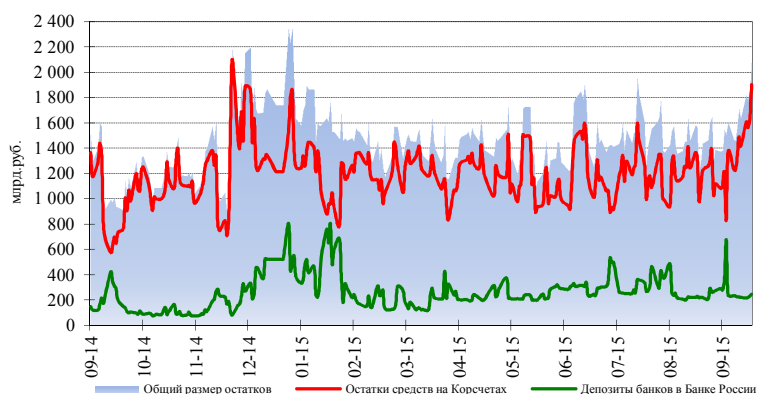


График 5. Уровень ставок MosPrime

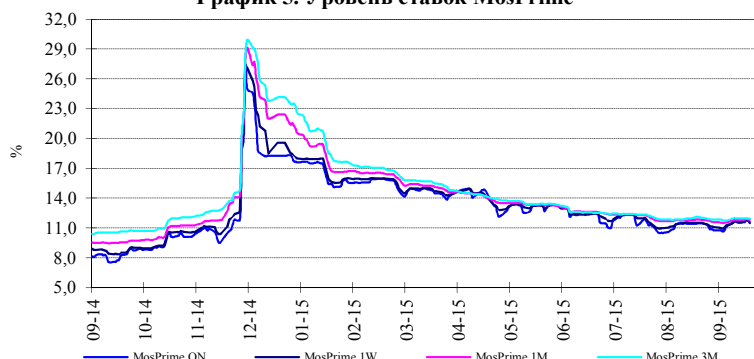


График 6. Динамика официального курса доллара США, Евро и бивалютной корзины Банка России

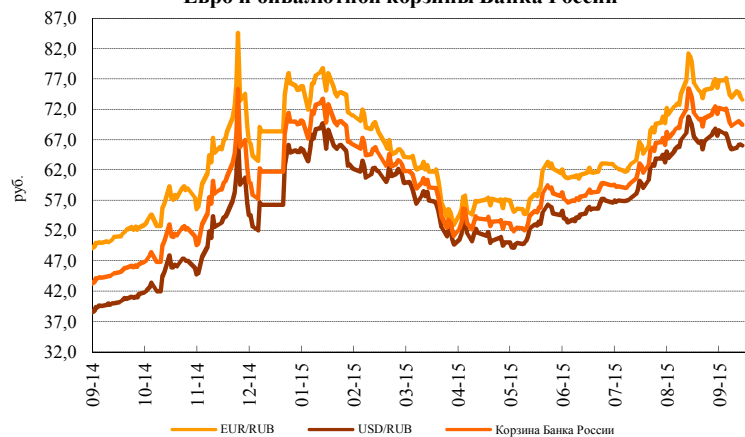
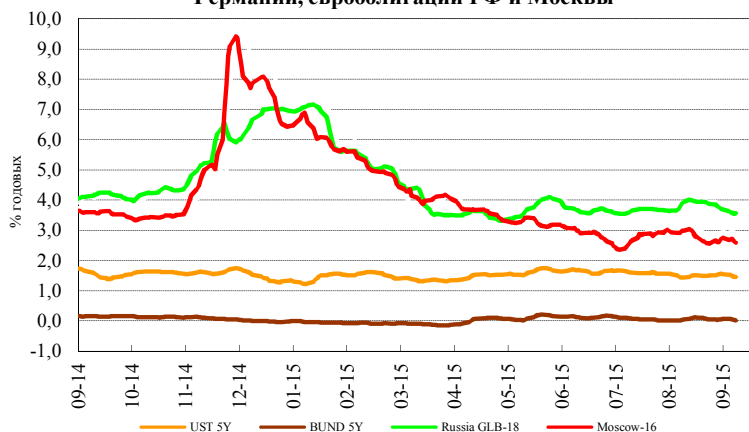


График 7. Динамика доходности гособлигаций США и Германии, еврооблигаций РФ и Москвы



Ключевые фиксированные процентные ставки Банка России

	24.09.15	дата изменения	предыдущее значение
ключевая ставка Банка России	11,00%	03.08.15	11,50%
ставка рефинансирования	8,25%	14.09.12	8,00%
прямое РЕПО (1 день)	12,00%	03.08.15	12,50%
валютный своп (1 день)	12,00%	03.08.15	12,50%
депозиты (1 день)	10,00%	03.08.15	10,50%

Денежный рынок

	24.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
Корсчета, млрд. руб.	1 901,80	16,43	27,83	39,32
Депозиты в Банке России, млрд. руб.	245,88	6,35	9,17	11,78
MosPrime ON, %	11,50	-1,63	-0,61	0,61
MosPrime 1M, %	11,81	-0,17	0,00	0,17
MosPrime 3M, %	11,94	0,00	-0,33	-0,67
Libor ON, %	0,14	0,00	-1,09	2,26
Libor 1M, %	0,19	0,21	-10,05	-2,56
Libor 3M, %	0,33	0,28	-5,42	-1,57
Libor 1Y, %	0,85	0,12	-2,75	1,62
NDF 1M, %	11,63	-0,09	0,04	-13,47
NDF 3M, %	12,04	1,43	-2,59	-13,13
NDF 12M, %	12,01	-0,83	-3,34	-11,04

Валютный рынок

	24.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
EUR/USD	1,1249	0,79	-0,60	-2,21
	25.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
EUR/RUB	74,5435	1,37	0,82	-8,14
USD/RUB	66,5151	0,72	1,76	-5,98
Бивалютная корзина Банка России	70,1279	1,03	1,31	-7,03

Индексы фондового рынка

	24.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
MICEX	1 621,43	-1,17	-6,23	-0,78
RTS	769,38	-1,62	-6,53	6,16
S&P 500	1 932,24	-0,34	-2,91	2,06
DJ	16 201,32	-0,48	-2,84	-2,84
DAX	9 427,64	-1,92	-7,84	-2,29
Hang Seng	21 095,98	-0,97	-3,47	-0,73
Bovespa	45 291,97	-0,11	-6,71	2,16
Nikkei 225	17 571,83	-2,76	-4,67	-5,23
Shanghai Composite	3 142,69	0,86	1,83	-2,09

Рынок внешнего долга

	24.09.15	изменение за день, б.п.	изменение за неделю, б.п.	изменение за месяц, б.п.
Russia GLB-18, %	3,74	0,25	0,04	-0,19
Moscow-16, %	2,50	-0,24	-0,19	-0,62
UST 5Y, %	1,45	0,00	-0,03	0,07
BUND 5Y, %	0,01	0,01	-0,10	0,01

Товарный рынок

	24.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
Brent	48,17	0,88	-1,85	12,84
WTI Nymex	44,91	0,97	-4,24	17,44
Urals	46,26	-2,41	-3,46	13,41
Золото, руб./грамм	2 387,82	-0,62	1,51	-5,14

ИТОГИ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИОННЫХ ЗАЙМОВ

Выпуск	Дата погашения	Дата oferty	Форма размещения	Объем предложения по номиналу, млн. руб.	Объем спроса по номиналу, млн. руб.	Объем размещения по номиналу, млн. руб.	Ставка купона по итогам аукциона, % год.	Доходность по цене отсечения, % год.	Доходность по средневзвеш. цене к оферте/погашению, % год.	Организатор, со-организаторы, андеррайтеры, со-андеррайтеры
Удмурдская Республика, 34007	17.09.20	-	букбилдинг	3 000	5 300	3 000	13,80	-	14,50	Внешпром-банк, Совкомбанк

БЛИЖАЙШИЕ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИОННЫХ ЗАЙМОВ

Дата	Выпуск	Форма размещения	Сектор рынка облигаций	Объем эмиссии, млн. руб.	Дата погашения	Организатор, Со-организаторы, андеррайтеры, со-андеррайтеры
28.09.15	БИНБАНК, БО-04 (доп. выпуски № 5 - 12)	букбилдинг	корпоративный	16 000	07.02.20	БИНБАНК
28.09.15	"Концерн РОССИУМ", 01	букбилдинг	корпоративный	10 000	15.09.25	ОАО "Московский Кредитный Банк"
29.09.15	ПГК-1, БО-01	букбилдинг	корпоративный	5 000	16.09.25	Газпромбанк, ВТБ Капитал, Sberbank CIB, РОСБАНК
29.09.15	"Русфинанс Банк", БО-10	букбилдинг	корпоративный	4 000	29.09.20	РОСБАНК
29.09.15	АИЖК, БО-04	букбилдинг	корпоративный	5 000	25.09.18	ВТБ Капитал, Райффайзенбанк
30.09.15	АО "КБ ДельтаКредит", БО-07	букбилдинг	корпоративный	5 000	30.09.25	РОСБАНК
30.09.15	Курганмашзавод, К-01	букбилдинг	корпоративный	3 000	21.09.22	ЗАО ИК «Аврора Капитал»
02.10.15	«Энел Россия», 001P-01R	букбилдинг	корпоративный	5 000	19.09.25	РОСБАНК, Sberbank CIB
05.10.15	Локо-Банк, БО-07	букбилдинг	корпоративный	3 000	22.09.25	"Локо-Инвест", Банк Зенит, Банк "ФК Открытие", Совкомбанк
07.10.15	Волгоградская область, 35006	букбилдинг	субфедеральный	5 000	30.10.20	Банк "ФК Открытие", Sberbank CIB, РОСБАНК, ВТБ Капитал, Совкомбанк
12.10.15	Новосибирск, 35007	букбилдинг	субфедеральный	2 000	10.10.22	БК Регион

ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ ОБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В РУБЛЯХ

ОБЛИГАЦИИ ФЕДЕРАЛЬНЫХ ЗАЙМОВ (ОФЗ)

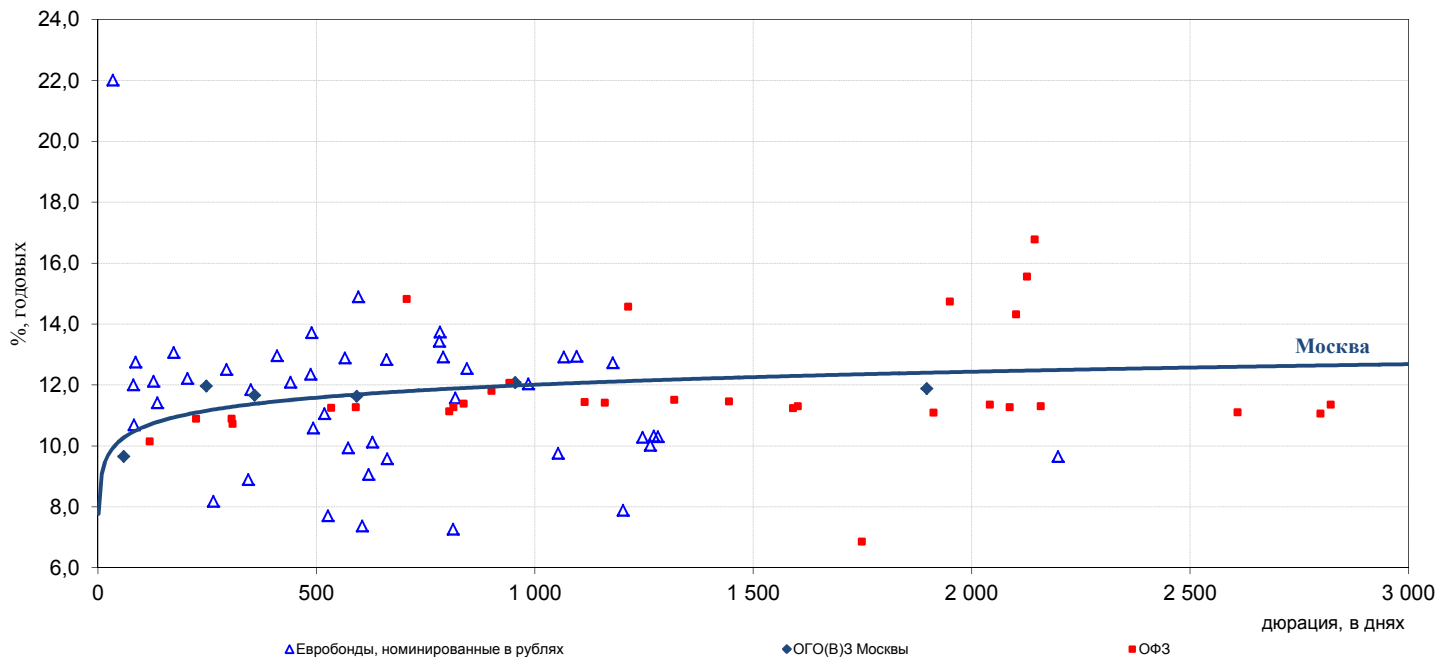
Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
				Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент				Российская Федерация					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)				BB+/Ba1/BBB-					
25077RMFS	26.01.11	20.01.16	118	10,15	62,05	62 575	10,15	66,15	66 679
25082RMFS	15.05.13	11.05.16	225	10,90	0,32	333			
26203RMFS	04.08.10	03.08.16	308	10,73	342,64	352 709	10,73	88,01	90 600
46017RMFS	16.02.05	03.08.16	306	10,89	96,66	200 452	10,89	8,18	17 000
25080RMFS	25.04.12	19.04.17	534	11,25	54,04	56 881	11,25	14,24	15 000
26206RMFS	08.06.11	14.06.17	590	11,27	920,35	973 883	11,27	0,47	500
24018RMFS	28.01.15	27.12.17	706	14,83	644,63	633 752	14,83	97,72	96 000
25081RMFS	06.02.13	31.01.18	804	11,14	184,96	204 724	11,14	1 983,57	2 190 000
26204RMFS	23.03.11	15.03.18	837	11,39	267,21	288 928	11,39	207,83	225 000
46021RMFS	21.02.07	08.08.18	814	11,27	0,01	6			
46014RMFS	05.03.03	29.08.18							
48001RMFS	18.11.04	31.10.18							
46005RMFS	14.02.03	09.01.19							
26208RMFS	07.03.12	27.02.19	1 114	11,44	367,17	407 888	11,44	514,59	573 598
46019RMFS	28.12.05	20.03.19							
26216RMFS	13.11.13	15.05.19	1 160	11,42	163,04	187 411	11,42	540,88	620 880
26210RMFS	19.12.12	11.12.19	1 319	11,51	52,45	61 335			
29011RMFS	28.01.15	29.01.20	1 213	14,57	16,45	16 276			
26214RMFS	05.06.13	27.05.20	1 444	11,46	0,05	57			
26205RMFS	13.04.11	14.04.21	1 602	11,30	18,76	21 734	11,30	215,30	250 000
46018RMFS	16.03.05	24.11.21	1 591	11,24	0,21	260	11,24	8,30	10 000
26209RMFS	01.08.12	20.07.22	1 912	11,10	0,36	419			
26211RMFS	16.01.13	25.01.23	2 042	11,36	139,91	175 008			
46022RMFS	23.01.08	19.07.23	2 087	11,27	0,00	3			
26215RMFS	04.09.13	16.08.23	2 158	11,30	116,82	147 290	11,30	198,00	250 000
29006RMFS	31.12.14	29.01.25	1 950	14,74	0,07	66	14,74	28,94	28 598
46011RMFS	14.02.03	20.08.25							
46023RMFS	30.09.11	23.07.26							
26207RMFS	22.02.12	03.02.27	2 609	11,11	64,77	78 248	11,11	5,66	6 840
52001RMFS	17.07.15	16.08.23	2 619	3,36	124,20	130 677	3,36	47,50	50 000
29007RMFS	31.12.14	03.03.27							
26212RMFS	23.01.13	19.01.28	2 798	11,06	42,20	56 521	11,06	1 153,77	1 539 581
46010RMFS	14.02.03	17.05.28							
46012RMFS	14.02.03	05.09.29							
29008RMFS	31.12.14	03.10.29							
29009RMFS	31.12.14	05.05.32	2 144	16,78	20,05	19 758			
29010RMFS	31.12.14	06.12.34							
46020RMFS	15.02.06	06.02.36	3 327	11,19	0,01	13			

ОБЛИГАЦИИ ГОРОДСКОГО ОБЛИГАЦИОННОГО (ВНУТРЕННЕГО) ЗАЙМА МОСКВЫ (ОГО(В)З МОСКВЫ)

Выпуск	Дата начала размещения	Дата погашения	Дюрация, в днях	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
				Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт	Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент				Правительство Москвы					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)				BB+/Ba1/BBB-					
RU32064MOS0	16.11.09	16.11.15							
RU25067MOS0	05.06.13	01.06.16							
RU32056MOS0	22.09.08	22.09.16							
RU26071MOS0	17.12.13	13.06.17							
RU32049MOS0	14.12.06	14.06.17							
RU32065MOS0	16.11.09	18.11.17							
RU25068MOS0	03.10.13	27.09.18							
RU27066MOS0	23.11.09	23.11.18	955	12,08	7,26	6 910			
RU26070MOS0	10.12.13	04.06.19							
RU32057MOS0	29.09.08	29.09.19							
RU26069MOS0	26.11.13	18.05.21							
RU32048MOS0	11.12.06	11.06.22	1 897	11.88	0.18	234			

На графиках 1 - 3 и 9 кривая доходностей ОГО(В)З Москвы сглажена с использованием логарифмической функции

График 1. Уровни доходностей ОГО(В)З Москвы, ОФЗ и евробондов, номинированных в рублях



ЕВРООБЛИГАЦИИ ГОСУДАРСТВЕННОГО И КОРПОРАТИВНОГО СЕКТОРА, НОМИНИРОВАННЫЕ В РУБЛЯХ*
(График 1)

Выпуск	Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	Дата погашения	Дюрация, в днях	Индикативная цена**	Средневзвешенная доходность к погашению, % годовых
Россия 2018-2, RUR	BB+/Ba1/BBB-	10.03.18	818	92,83	11,58
РЖД, 2019, RUB (LPN)	BB+/Ba1/BBB-	02.04.19	1 067	88,25	12,92
АИЖК, 2018, RUB (LPN)	BB+/Ba1/-	13.02.18	790	90,38	12,92
Газпромбанк, 2015, RUB (LPN)	BB+/Ba2/BB+	15.12.15	81	99,31	12,01
Газпромбанк, 2016-2, RUB (LNP)	BB+/Ba2/BB+	25.07.16	294	96,68	12,51
Газпромбанк, 2019, RUB (LPN)	BB+/Ba2/BB+	29.06.19	1 179	88,56	12,73
Россельхозбанк, 2016-2, RUR (LPN)	-/Ba2/BB+	17.03.16	173	98,20	13,07
Россельхозбанк, 2017, RUB (LPN)	-/Ba2/BB+	17.02.17	489	94,20	13,72
Россельхозбанк, 2018, RUB (LPN)	-/Ba2/BB+	07.02.18	783	89,25	13,74
Вымпелком, 2018, RUB	BB/Ba3/-	13.02.18	781	91,95	13,44
НОВАТЭК, 2017, RUB (LPN)	BB+/Ba1/BBB-	21.02.17	486	94,63	12,36
РусГидро, 2015, RUR	BB/Ba2/BB+	28.10.15	34	98,83	22,01
ФСК ЕЭС, 2019, RUB	BB+/Ba1/BBB-	13.03.19	1 095	88,74	12,94
СБ России ОАО, 2016, RUB (LPN)	-/Ba2/BBB-	31.01.16	127	98,38	12,12
Альфа-Банк, 2016 (LPN), RUB	BB/Ba2/BB+	26.04.16	204	98,19	12,22
Евразийский банк развития, 2017, RUB	BBB/Baa1/Withdrawn	05.10.17	661	92,22	12,84
World Bank, 2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	02.03.17	492	95,97	10,59
EIB, 2015, RUR	AAA/Aaa/AAA	15.12.15	82	99,06	10,70
EIB, 2016, RUR	AAA/Aaa/AAA	30.09.16	344	97,76	8,90
EIB, 2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	13.06.17	605	98,98	7,38
EIB, 6% 15feb2018	AAA/Aaa/AAA	15.02.18	813	97,28	7,27
EIB, 2019-2, RUB	AAA/Aaa/AAA	16.07.19	1 202	99,20	7,89
IFC, 5% 28dec2016 RUB	AAA/Aaa/-	28.12.16	440	92,29	12,09
IFC, 11% 21jan2020 (RUB/USD), RUB	AAA/Aaa/-	21.01.20	1 282	103,26	10,31
JP Morgan, 2017, RUR	A+/A2/A+	28.06.17	-	-	-
EBRD, 6.75% 12may2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	12.05.17	572	95,36	9,94
EBRD, 6.5% 27jun2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	27.06.17	619	95,97	9,07
EBRD, FRN 20may2020, RUB	AAA/Aaa/AAA	20.05.20	-	-	-
Rabobank, 2016, RUR	AA-/Aa2/AA	10.02.16	136	98,53	11,42
Rabobank, 6% 30nov2016, RUB	AA-/Aa2/AA	30.11.16	410	92,96	12,97

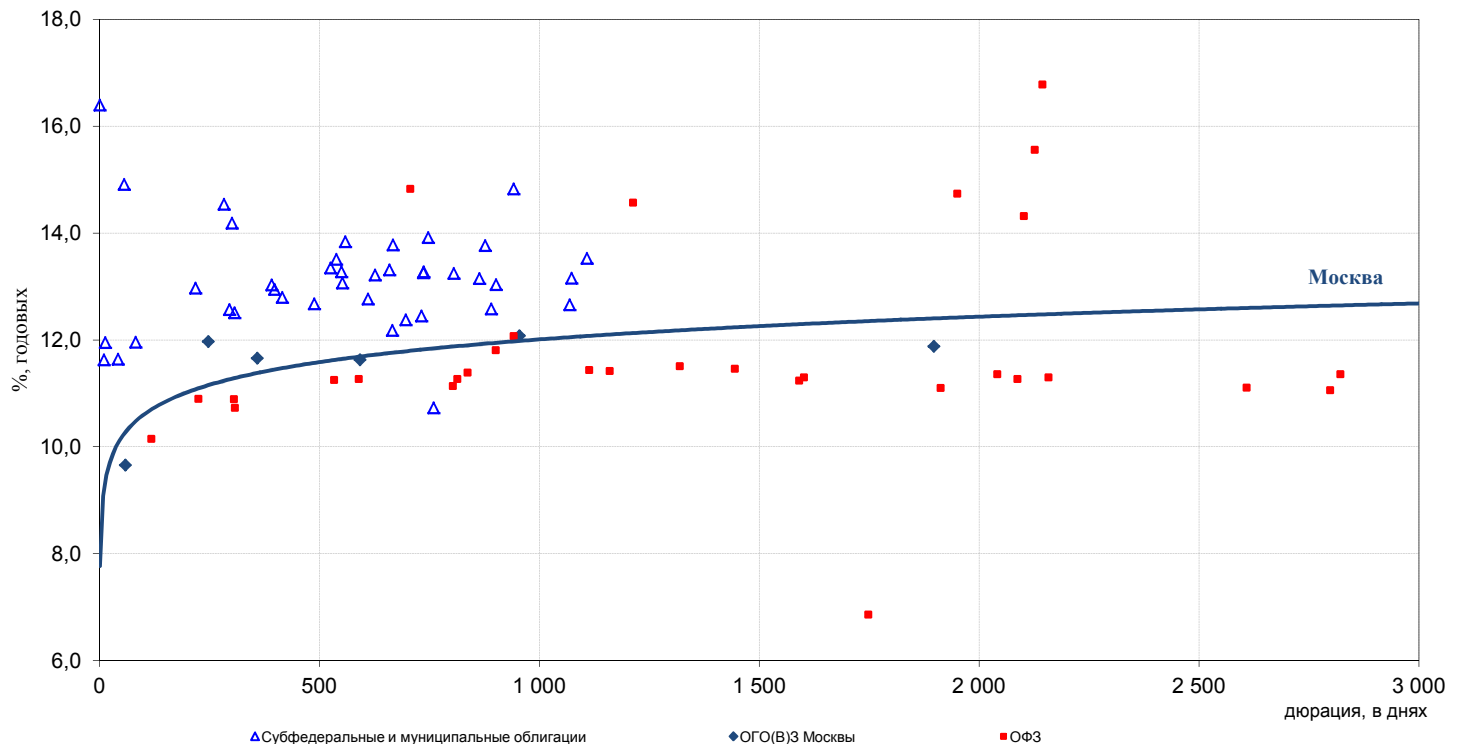
*торги на внебиржевом рынке

**Индикативная цена (здесь и далее) используется Cbonds для расчета эффективных доходностей, дюрации, модифицированной дюрации, исходя из следующего приоритета цен: Средневзвешенная цена (Average), Цена закрытия (Close), Признаваемая цена (Admitted), Средняя цена (Mid), Последняя цена (Last)

Выпуск	Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	Дата погашения	Дюрация, в днях	Индикативная цена*	Средневзвешенная доходность к погашению, % годовых
Rabobank, 2017, RUR	AA-/Aa2/AA	06.06.17	596	88,60	14,90
KfW, 2017, RUR	-/-/-	25.09.17	661	95,09	9,58
KfW, 7% 14jun2016	-/-/-	14.06.16	264	99,15	8,18
Caterpillar, 7.5% 20dec2015	-/-/-	20.12.15	86	98,86	12,75
IBRD, 7.625% 11oct2016 (RUB/USD)	-/-/-	11.10.16	350	96,03	11,85
IBRD, 6.25% 05jul2017, RUB	-/-/-	05.07.17	628	93,93	10,13
IBRD, 10.3% 05mar2019 (RUB/EUR)	-/-/-	05.03.19	1 053	101,39	9,76
IBRD, 6.5% 26jul2019 RUB/USD	-/-/-	26.07.19	1 264	89,18	10,02
IBRD, 10% 16sep2019, RUR	-/-/-	16.09.19	1 246	99,08	10,29
IBRD, 11.6% 10feb2020 (RUB/USD)	-/-/-	10.02.20	1 272	105,28	10,33
IBRD, 6.75% 2023, RUR	-/-/-	20.06.23	2 198	84,68	9,66
KEXIM, 7.63% 30may2017	-/-/-	30.05.17	565	92,78	12,89
BNP Paribas, 6.89% 30jan2018	AA+/Aa1/AA	30.01.18	-	-	-
Societe Generale, 10.5% 30mar2017, RUB	A/A2/A	30.03.17	518	99,15	11,06
Societe Generale, 8% 30mar2017, RUB	A/A2/A	30.03.17	526	100,35	7,71
Societe Generale, 10.5% 2018, RUR (Structured)	A/A2/A	27.04.18	-	-	-
Potok8 (бывш. Nazvanie.net, Миракс Групп), 2019, R	-/-/-	25.06.19	-	-	-
SovCo Capital Partners B.V., 2016 (LPN), RUB	-/-/-	25.07.16	-	-	-
Lloyds Bank, 6.2% 24apr2018, RUR	-/-/-	24.04.18	844	87,08	12,55
SEK, 6.12% 13sep2018, RUR	-/-/-	13.09.18	985	86,34	12,04

*Индикативная цена (здесь и далее) используется Cbonds для расчета эффективных доходностей, дюрации, модифицированной дюрации, исходя из следующего приоритета цен: Средневзвешенная цена (Average), Цена закрытия (Close), Признаваемая цена (Admitted), Средняя цена (Mid), Последняя цена (Last)

График 2. Уровни доходностей ОГО(В)З Москвы, ОФЗ, субфедеральных и муниципальных облигаций



СУБФЕДЕРАЛЬНЫЕ И МУНИЦИПАЛЬНЫЕ ОБЛИГАЦИИ (График 2)

Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					Санкт-Петербург					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/Ba1/BBB-					
Санкт-Петербург 38	25.11.10	19.11.15	56		14,91	0,00	5			
Санкт-Петербург 39	06.12.12	01.06.17								
Эмитент					Белгородская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B1/BB					
Белгородская обл. 06	14.08.12	08.08.17	307		12,51	1,67	5 000			
Белгородская обл. 09	07.07.15	30.06.20	902		13,04	0,84	833			
Белгородская обл. 07	06.08.13	28.07.20	877		13,77	1,98	2 220			
Белгородская обл. 08	30.06.14	21.06.21	737		13,28	0,38	400			
Эмитент					Чувашская Республика					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/Ba3/BB+					
Чувашия, 34010	07.06.13	07.06.18								
Эмитент					Министерство финансов Республики Саха (Якутия)					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB/-/BBB-					
МФ Саха, 35003	20.05.11	20.05.16								
МФ Саха, 35004	17.05.12	17.05.17								
МФ Саха, 35005	24.04.13	24.04.18								
МФ Саха, 35007	21.05.15	14.05.20								
МФ Саха, 35006	02.07.14	02.07.21								
Эмитент					Республика Коми					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B1/BB					
Республика Коми, 35008	05.12.05	03.12.15								
Республика Коми, 32010	15.12.11	15.12.16								
Республика Коми, 35011	05.06.14	27.11.19	550		13,28	0,01	11			
Республика Коми, 35012	01.07.15	23.06.21	1 069		12,66	0,01	10			
Эмитент					Нижегородская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B1/BB					
Нижегородская обл. 34006	07.10.10	07.10.15	13		11,95	2,16	7 216			
Нижегородская обл. 34007	17.11.11	16.11.16								
Нижегородская обл. 34008	29.08.12	29.08.17	488		12,68	1,06	1 377			

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата начала размещения	Дата погашения	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Нижегородская обл. 34010	24.08.15	23.08.20	1 109		13,53	304,11	302 000			
Нижегородская обл. 34009	26.08.13	26.08.20								
Эмитент					Республика Башкортостан					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/Ba2/-					
Башкортостан 34007	04.12.12	29.11.16								
Башкортостан, 34008	27.09.13	18.09.20								
Башкортостан, 34009	16.10.14	11.04.19	732		12,45	98,98	100 000			
Эмитент					Красноярский край					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/B1/BB+					
Красноярский кр. 34005	06.12.11	29.11.16								
Красноярский кр. 34006	25.10.12	19.10.17	301		14,19	0,00	1			
Красноярский кр. 34007	25.09.13	19.09.18	667		13,78	0,00	4			
Красноярский кр. 34008	26.05.14	08.07.18	611		12,77	0,30	307			
Красноярский кр. 34009	06.10.14	01.10.18								
Красноярский кр. 34010	15.09.15	10.09.19	1 073		13,16	10,44	10 411	13,16	401,30	399 998
Эмитент					Министерство финансов Волгоградской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/-/B+					
МФ Волгогр.обл. 34005	11.05.11	04.05.16								
МФ Волгогр.обл. 35002	04.05.12	28.05.17								
МФ Волгогр.обл. 35003	21.05.13	14.06.18	525		13,35	1,86	2 502			
МФ Волгогр.обл. 35004	08.10.13	01.11.18								
МФ Волгогр.обл.35005	19.06.14	13.07.19								
Эмитент					Липецкая область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/-/BB					
Липецкая область, 34007	01.06.12	26.05.17	398		12,95	0,00	1			
Липецкая область, 34009	10.06.14	04.06.19								
Липецкая область, 35008	26.04.13	26.04.20								
Эмитент					Калужская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/-/BB					
Калужская область, 34005	26.05.11	19.05.16								
Эмитент					Республика Хакасия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Республика Хакасия, 35004	28.10.14	27.10.19	737		13,26	0,01	6			
Республика Хакасия, 35003	29.10.13	27.10.20	942		14,83	0,01	12			
Эмитент					Департамент финансов Томской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/--					
Томская область, 34045	20.12.12	19.12.17	538		13,51	0,00	1			
Томская область, 34048	24.12.13	18.12.18								
Эмитент					Министерство финансов Тверской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Suspended/-/BB-					
МФ Тверской обл. 34007	21.12.10	15.12.15	82		11,96	0,08	127			
МФ Тверской обл. 34008	24.12.12	18.12.17								
МФ Тверской обл. 34009	28.11.13	22.11.18								
Эмитент					г. Томск - Администрация					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Администр. Томска 34004	04.12.12	29.11.16								
Администр. Томска 34005	16.12.14	15.12.19								
Эмитент					Рязанская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/B+					
Рязанская область, 34002	20.12.12	14.12.17	415		12,80	0,24	331			
Эмитент					Свердловская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/--					
Свердлов. область, 34001	13.12.11	11.12.16								
Свердлов. область, 34002	05.12.12	04.12.17								
Эмитент					Министерство управления финансами Самарской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB/Ba3/-					
Самарская обл., 07	08.06.11	30.11.16								
Самарская обл., 08	20.06.12	13.12.17								
Самарская обл., 09	09.08.13	31.07.20	748		13,92	0,00	1			
Самарская обл., 11	25.06.15	18.06.20	891		12,58	125,24	124 004	12,58	100,75	99 999
Эмитент					Ярославская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Ярославская область, 34012	19.07.13	13.07.18								

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

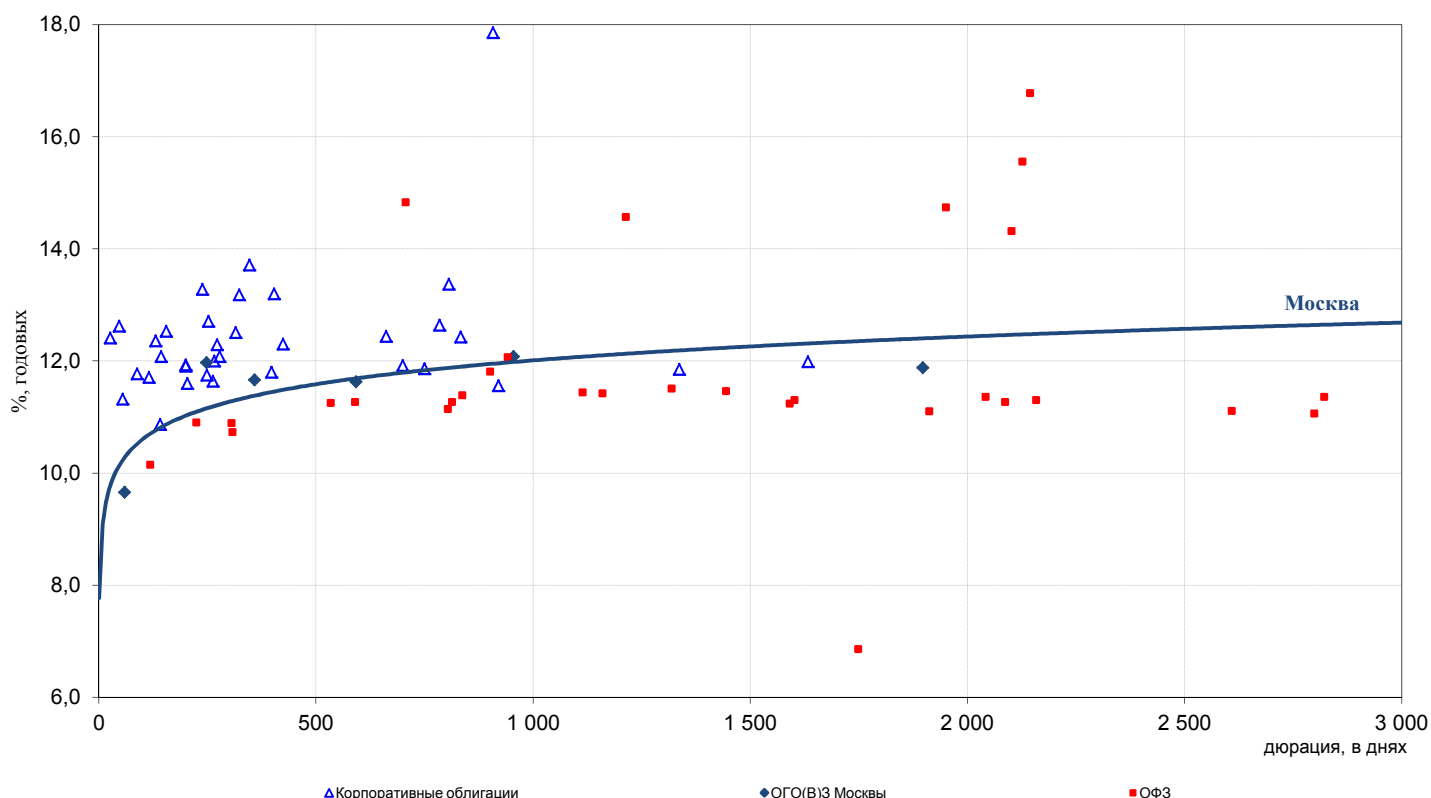
Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					г. Краснодар - Администрация города					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B1/-					
Админ. Краснодара 34002	10.11.11	05.11.15	42		11,64	0,04	152			
Эмитент					Республика Удмуртия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/Withdrawn/BB-					
Удмуртия, 34004	25.11.10	25.11.15								
Удмуртия, 34005	01.12.11	24.11.16								
Удмуртия, 34006	11.12.12	05.12.17								
Удмуртия, 34007	24.09.15	17.09.20	1 266					14,49	900,09	900 000
Удмуртия, 35001	10.10.13	01.10.20	760		10,73	0,00	1			
Эмитент					Краснодарский край					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/B1/Withdrawn					
Краснодарский край, 34004	15.11.12	09.11.17								
Эмитент					Республика Карелия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/B+					
Карелия 34014	02.12.11	30.11.16								
Карелия 34015	23.10.12	22.10.17	283		14,54	0,46	1 183			
Карелия, 34016	31.07.13	23.01.19								
Карелия, 35017	15.10.14	08.04.20								
Эмитент					г. Казань					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB-					
Казань 34008	28.12.11	21.12.16								
Эмитент					Костромская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/B+					
Костромская область, 34006	24.11.11	17.11.16								
Костромская область, 34007	04.10.13	28.09.18								
Эмитент					Тюльская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Тюльская область, 34002	25.09.12	25.09.15	1		16,40	67,28	168 228			
Тюльская область, 34003	21.11.13	18.05.17								
Эмитент					Марий Эл					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Марий Эл, 34006	04.10.12	04.10.15	10		11,63	0,06	141			
Марий Эл, 34007	28.05.14	07.07.18	295		12,57	0,00	1			
Эмитент					г. Волгоград					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B2/-					
Волгоград 34005	23.12.10	17.12.15								
Волгоград 34006	29.08.12	23.08.17								
Волгоград, 34007	16.10.14	10.10.19								
Эмитент					г. Новосибирск					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/-/-					
Новосибирск, 34005	07.09.12	06.09.17								
Новосибирск, 35006	31.07.13	22.07.20								
Эмитент					Вологодская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/B2/Withdrawn					
Вологодская область, 34002	21.12.11	14.12.16	218		12,97	0,00	1			
Вологодская область, 34003	11.12.12	05.12.17	392		13,03	0,02	47			
Эмитент					Министерство финансов Ставропольского края					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/-/BB					
Ставропольский край, 34001	18.12.12	12.12.17								
Ставропольский край, 34002	06.11.13	04.11.20								
Эмитент					Оренбургская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Оренбург. область, 34001	20.12.12	14.12.17								
Оренбург. область, 35001	26.06.13	19.06.19								
Оренбург. область, 35002	23.06.14	14.06.21								
Оренбург. область, 35003	16.07.15	03.07.25								
Эмитент					Омская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/Ba3/-					
Омская область, 34001	15.10.13	14.10.16								
Омская область, 34002	21.10.14	15.10.19	627		13,22	94,89	95 274	13,22	34,69	35 000

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					Смоленская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-B+					
Смоленская область, 34001	21.10.13	20.10.18	559		13,84	0,00	5			
Эмитент					Воронежская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-Withdrawn					
Воронежская обл., 34005	18.12.12	17.12.17								
Воронежская обл., 34006	24.10.13	23.10.18	553		13,07	2,96	3 354	13,07	155,45	175 999
Воронежская обл., 34007	15.10.14	14.10.19	864		13,15	127,46	152 817			
Эмитент					Министерство финансов Республики Мордовия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B2/-					
МФ Респ.Мордовия, 34001	28.10.13	22.10.18	659		13,31	0,04	50			
Эмитент					Новосибирская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-BBB-					
Новосибирская обл., 34015	31.10.13	30.10.18								
Новосибирская обл., 34016	09.10.14	08.10.19								
Эмитент					Администрация Кемеровской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-BB-					
Кемеровская область, 34001	29.11.13	28.11.18								
Эмитент					Ханты-Мансийский Автономный округ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba2/BBB-					
ХМАО, 34001	14.10.14	13.10.19	666		12,18	0,17	175			
Эмитент					город Омск					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/B1/-					
Омск, 34001	03.12.14	03.12.17								
Эмитент					Ленинградская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/-BBB-					
Ленинградская область, 35001	16.12.14	07.12.21								
Эмитент					Волжский					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-B+					
Волжский, 34001	25.12.14	24.12.19								
Эмитент					Магаданская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/-/-					
Магаданская область, 34001	29.12.14	24.12.18								

График 3. Уровни доходностей ОГО(В)З Москвы, ОФЗ и корпоративных облигаций крупнейших компаний России



ОБЛИГАЦИИ КОРПОРАТИВНОГО СЕКТОРА КРУПНЕЙШИХ КОМПАНИЙ РОССИИ (График 3)

Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					ОАО Банк ВТБ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba2/Withdrawn					
ВТБ, БО-19	04.10.12	01.10.15								
ВТБ, БО-20	04.10.12	01.10.15								
ВТБ, БО-21	22.01.13	19.01.16	115		11,71	11,54	11 655	11,71	29,72	29 999
ВТБ, БО-22	19.02.13	16.02.16	143		12,08	6,01	6 098			
ВТБ 06	19.07.06	06.07.16								
ВТБ, БО-43	11.10.13	29.09.23	272	12.07.16	12,29	33,25	33 166			
Эмитент					Федеральная сетевая компания Единой энергетической системы					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba1/BBB-					
ФСК ЕЭС, 12	27.04.12	19.04.19	204	28.04.16	11,60	143,66	146 210			
ФСК ЕЭС, 06	28.09.10	15.09.20								
ФСК ЕЭС, 08	28.09.10	15.09.20								
ФСК ЕЭС, 10	28.09.10	15.09.20	1 542					7,90	9 970,85	9 970 849
ФСК ЕЭС, 07	29.10.10	16.10.20								
ФСК ЕЭС, 09	29.10.10	16.10.20								
ФСК ЕЭС, 11	29.10.10	16.10.20								
ФСК ЕЭС, 13	05.07.11	22.06.21	1 633		11,99	0,10	115	11,99	195,06	224 135
ФСК ЕЭС, 19	21.07.11	06.07.23								
ФСК ЕЭС, 15	27.10.11	12.10.23								
ФСК ЕЭС, 18	12.12.11	27.11.23								
ФСК ЕЭС, 21	24.10.12	06.10.27								
ФСК ЕЭС, 29	21.10.13	07.09.48								
ФСК ЕЭС, 30	13.12.13	30.10.48								
ФСК ЕЭС, 34	13.12.13	30.10.48								
ФСК ЕЭС, 37	06.05.15	23.03.50								
ФСК ЕЭС, 38	06.05.15	23.03.50								

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата начала размещения	Дата погашения	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					АК "АЛРОСА" (ОАО)					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/Ba2/BB					
АЛРОСА, БО-01	02.11.12	30.10.15								
АЛРОСА, БО-02	02.11.12	30.10.15								
Эмитент					ОАО "Нефтяная компания "Роснефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba1/Withdrawn					
Роснефть, БО-15	11.12.14	03.12.20								
Роснефть, БО-16	11.12.14	03.12.20								
Роснефть, БО-17	11.12.14	03.12.20								
Роснефть, БО-24	11.12.14	03.12.20								
Роснефть, БО-18	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-19	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-20	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-21	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-22	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-23	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-25	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, БО-26	26.01.15	18.01.21								
Роснефть, 04	29.10.12	17.10.22								
Роснефть, 05	29.10.12	17.10.22								
Роснефть, 07	22.03.13	10.03.23								
Роснефть, 08	22.03.13	10.03.23	833	22.03.18	12,43	18,30	20 000			
Роснефть, 06	11.06.13	30.05.23								
Роснефть, 09	11.06.13	30.05.23								
Роснефть, 10	11.06.13	30.05.23								
Роснефть, БО-05	23.12.13	11.12.23								
Роснефть, БО-06	23.12.13	11.12.23								
Роснефть, БО-01	18.02.14	06.02.24								
Роснефть, БО-07	18.02.14	06.02.24								
Роснефть, БО-02	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-03	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-04	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-08	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-09	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-10	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-11	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-12	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-13	11.12.14	28.11.24								
Роснефть, БО-14	11.12.14	28.11.24								
Эмитент					ОАО АНК "Башнефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/Ba1/BB					
Башнефть, 01	22.12.09	13.12.16								
Башнефть, 02	22.12.09	13.12.16								
Башнефть, 03	22.12.09	13.12.16	424		12,30	0,01	15			
Башнефть, 04	17.02.12	04.02.22	141	18.02.16	10,87	0,04	35			
Башнефть, 06	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, 07	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, 08	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, 09	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, БО-05	26.05.14	13.05.24								
Башнефть, БО-03	22.05.15	09.05.25								
Башнефть, БО-04	01.06.15	19.05.25								
Башнефть, БО-07	16.06.15	03.06.25								
Эмитент					Газпромбанк (Открытое акционерное общество)					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba2/BB+					
Газпромбанк, БО-05	01.08.13	01.08.16								
Газпромбанк, БО-06	25.09.13	25.09.16								
Газпромбанк, БО-07	22.10.13	22.10.16								
Газпромбанк, 06	12.07.12	07.07.16	279		12,08	0,00	1			
Газпромбанк, 07	22.10.12	17.10.16								
Газпромбанк, БО-09	27.06.14	27.06.17								

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата начала размещения	Дата погашения	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзвешенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Газпромбанк, БО-10	26.09.14	26.09.17								
Газпромбанк, 10	18.10.12	12.10.17								
Газпромбанк, БО-20	09.02.15	09.02.18								
Газпромбанк, 11	18.10.12	10.10.19								
Газпромбанк, 12	18.10.12	06.10.22								
Газпромбанк, 1-ИП, А	10.12.14	27.04.48								
Газпромбанк, 1-ИП, Б	10.12.14	27.04.48								
Эмитент					ОАО АФК "Система"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB/B1/BB-					
АФК Система, 04	22.03.11	15.03.16								
АФК Система, 03	03.12.09	24.11.16	404		13,20	0,44	461			
АФК Система, БО-01	19.02.15	31.01.30	315	22.08.16	12,51	1,34	1 286			
Эмитент					ОАО "АЛЬФА-БАНК"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB/Ba2/BB+					
Альфа-Банк, БО-03	28.09.12	28.09.15								
Альфа-Банк, 01	08.02.11	02.02.16	131		12,36	0,00	1			
Альфа-Банк, БО-08	26.02.13	26.02.16	155		12,53	44,48	45 001	12,53	495,71	503 002
Альфа-Банк, БО-09	20.08.13	20.08.16	323		13,18	0,00	1			
Альфа-Банк, БО-04	24.10.13	24.10.16								
Альфа-Банк, 02	09.12.11	02.12.16								
Альфа-Банк, БО-10	11.06.14	11.06.17	252	14.06.16	12,71	275,31	280 631	12,71	98,65	100 000
Альфа-Банк, БО-13	18.09.14	30.08.29	347	19.09.16	13,71	0,02	22			
Альфа-Банк, БО-14	18.09.14	30.08.29	662	18.09.17	12,44	65,82	66 050	12,44	65,81	65 860
Альфа-Банк, БО-15	02.12.14	13.11.29	239	02.06.16	13,28	9,47	9 455			
Эмитент					ОАО "Российские железные дороги"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba1/BBB-					
РЖД, 11	26.11.08	18.11.15	55		11,32	4,16	4 179			
РЖД, 15	29.06.09	20.06.16	263		11,64	39,84	40 745			
РЖД, 16	15.06.09	05.06.17	249	08.06.16	11,75	15,18	15 545	11,75	17,58	17 999
РЖД, 17	27.07.09	16.07.18	750	17.01.18	11,86	0,50	500			
РЖД, 12	28.05.09	16.05.19	398	21.11.16	11,80	5,07	5 239			
РЖД, 18	27.07.09	15.07.19								
РЖД, 19	27.07.09	08.07.24	920	18.07.18	11,56	9,27	10 000			
РЖД, 23	04.02.10	16.01.25								
РЖД, 28	09.04.13	21.03.28	1 336	03.04.20	11,85	8,86	10 001			
РЖД, БО-09	27.06.13	08.06.28								
РЖД, 30	26.11.13	07.11.28								
РЖД, БО-10	18.12.13	29.11.28								
РЖД, БО-03	22.05.15	03.05.30								
РЖД, БО-04	22.05.15	03.05.30								
РЖД, 32	20.07.12	25.06.32								
РЖД, БО-12	12.09.13	18.08.33								
РЖД, БО-13	14.10.13	19.09.33								
РЖД, БО-14	23.06.15	29.05.35								
РЖД, БО-15	11.11.13	11.10.38								
РЖД, БО-16	21.10.14	20.09.39								
РЖД, 33	31.03.15	28.02.40								
РЖД, 34	31.03.15	28.02.40								
РЖД, БО-18	05.06.13	29.04.43								
РЖД, БО-19	27.06.14	20.05.44								
Эмитент					ОАО "Мобильные телесистемы"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba1/BB+					
МТС, 02	28.10.08	20.10.15	26		12,41	1,71	1 715			
МТС, 05	28.07.09	19.07.16								
МТС, 07	16.11.10	07.11.17	700		11,92	0,09	90			
МТС, 03	24.06.08	12.06.18								
МТС, 08	16.11.10	03.11.20	47	12.11.15	12,62	550,02	553 229	12,62	548,57	551 219
МТС, БО-01	03.04.13	22.03.23	806	02.04.18	13,37	0,00	1			

ИНДЕКСЫ РЫНКА СУБФЕДЕРАЛЬНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Наименование индекса	24.09.15	23.09.15	22.09.15	21.09.15	18.09.15
Средневзвешенная доходность Индекса MosBonds, %	11,84	11,72	11,81	11,81	11,61
Ценовой Индекс MosBonds	88,74	89,07	88,93	88,93	89,12
Средневзвешенная дюрация Индекса MosBonds, дней	797	802	803	802	805
Cbonds-Muni средневзвешенная доходность (эфф.), %	12,28	12,11	12,17	12,13	12,07
Cbonds-Muni ценовой	93,81	94,08	93,93	94,00	94,08
Cbonds-Muni дюрация инд. портфеля, дней	743	747	751	752	754

График 4. Динамика средневзвешенной доходности индекса MosBonds и Cbonds-Muni

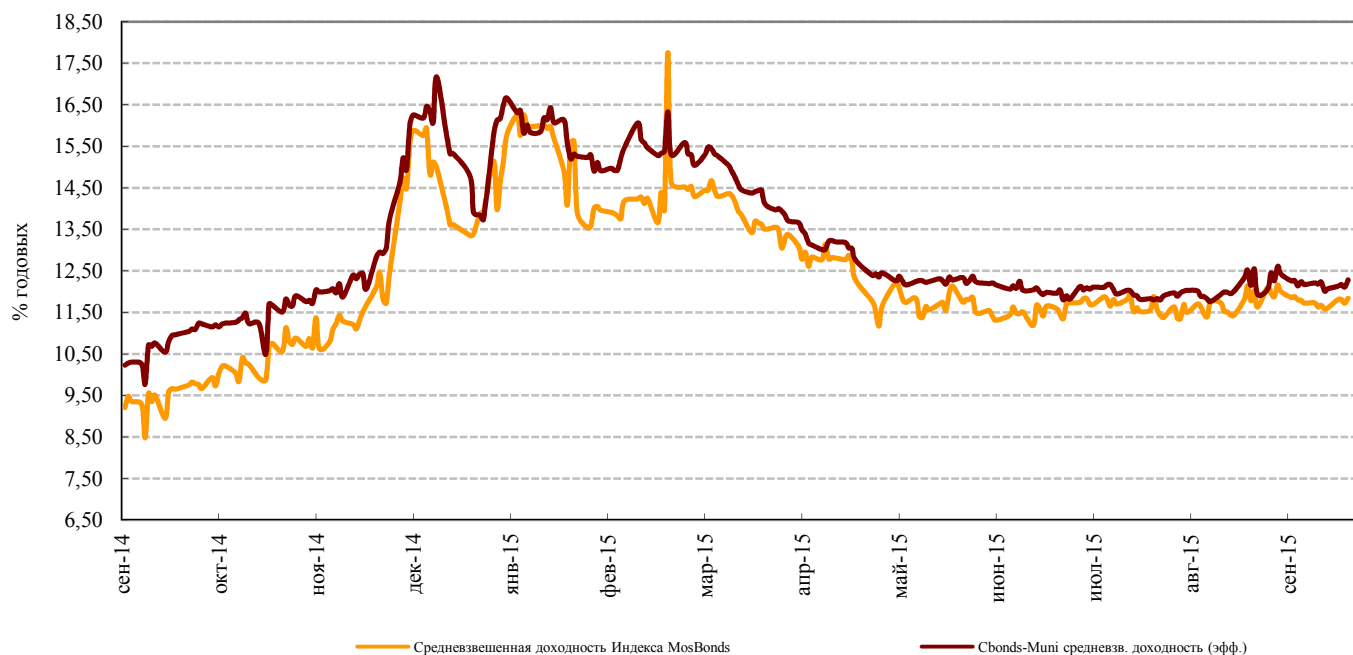
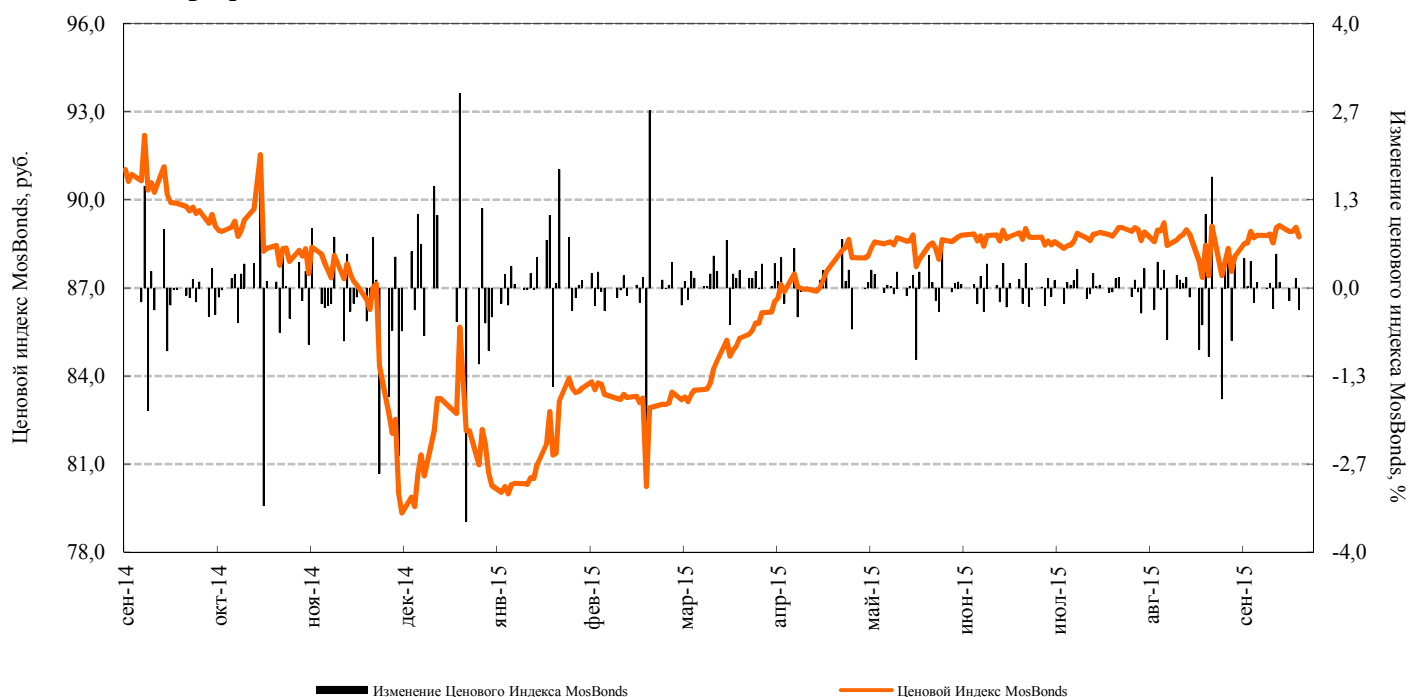
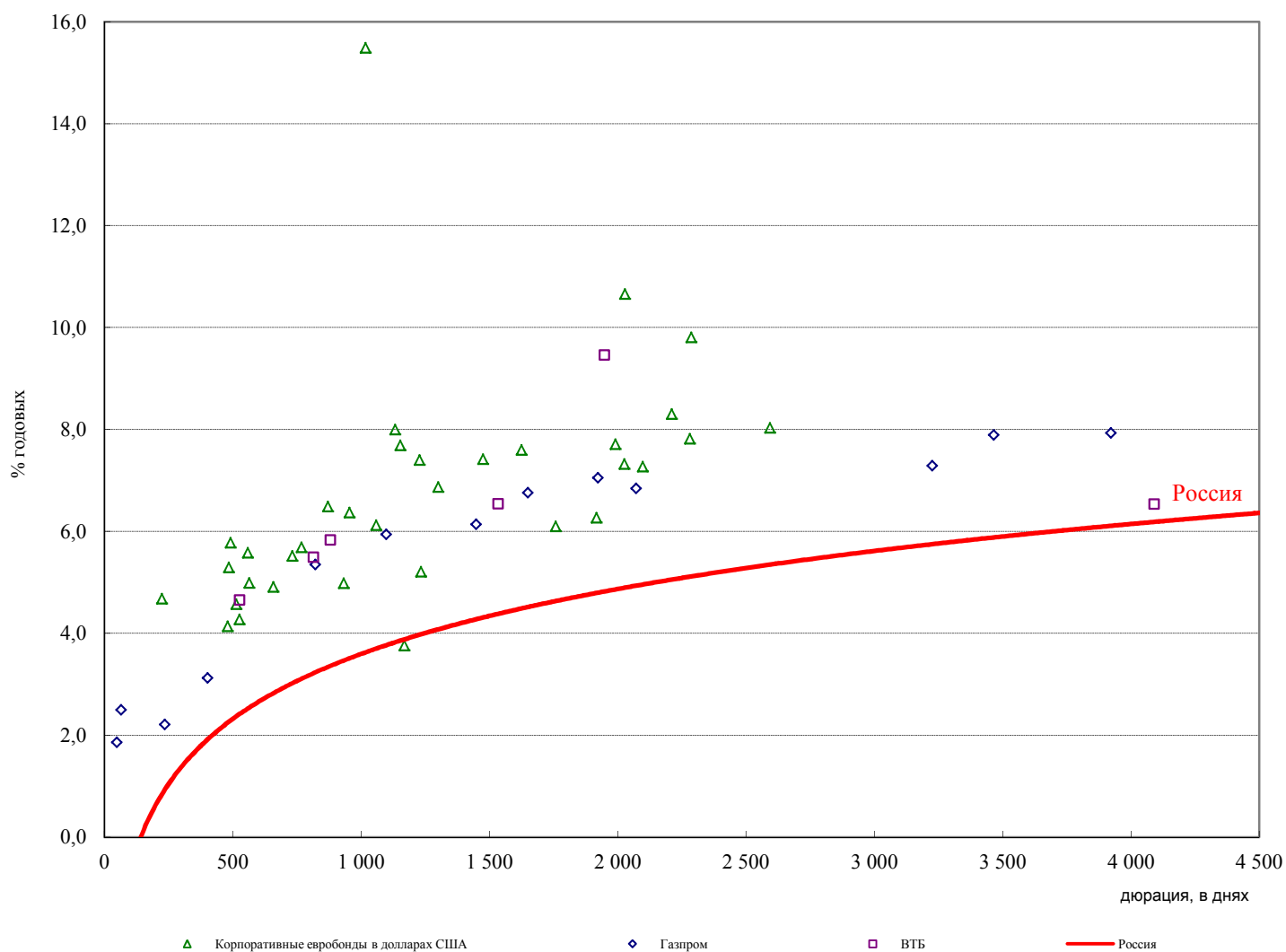


График 5. Динамика ценового индекса MosBonds и его изменения



ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ РОССИЙСКИХ ОБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ

График 6. Доходность еврооблигаций, номинированных в долларах США



ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ ЕВРООБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В ДОЛЛАРАХ США*

Выпуск	Дата погашения	Дюрация, в днях	Индикативная цена	Средневзвешенная доходность, % годовых	Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых	Изменение
ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	Российская Федерация					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Россия, 2017	04.04.17	533	100,60	2,87	2,85	0,02
Россия, 2018	24.07.18	902	120,33	3,44	3,42	0,02
Россия, 2019	16.09.19	1 129	99,78	3,60	3,58	0,02
Россия, 2020	29.04.20	1 473	103,11	4,29	4,27	0,02
Россия, 2022	04.04.22	2 017	98,88	4,76	4,75	0,01
Россия, 2023	16.09.23	2 408	99,00	5,09	5,08	0,01
Россия, 2028	24.06.28	2 759	155,98	6,40	6,34	0,06
Россия, 2030	31.03.30	1 497	117,67	3,46	3,42	0,04
Россия, 2042	04.04.42	4 710	90,64	6,46	6,27	0,19
Россия, 2043	16.09.43	4 900	93,90	6,44	6,29	0,15
КОРПОРАТИВНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	ОАО "АЛЬФА-БАНК"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB/Ba2/BB+					
Альфа-Банк, 2017 (LPN, Step Up)	22.02.17	492	100,79	5,78	5,78	0,00
Альфа-Банк, 2017-2 (LPN)	25.09.17	658	105,70	4,91	4,85	0,06
Альфа-Банк, 2019 (LPN)	26.09.19	1 228	100,79	7,40	7,35	0,05
Альфа-Банк, 2021 (LPN)	28.04.21	1 625	101,31	7,60	7,60	0,00
Альфа-Банк, 2025 (LPN)	18.02.25	2 287	99,50	9,81	9,81	0,00
Эмитент	ОАО АФК "Система"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB/B1/BB-					
АФК Система, 2019 (LPN)	17.05.19	1 153	98,11	7,69	7,65	0,04
Эмитент	ОАО Банк ВТБ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba2/Withdrawn					
ВТБ, 2017 (LPN)	12.04.17	528	102,08	4,65	4,66	-0,01
ВТБ, 2018-2 (LPN)	22.02.18	815	102,00	5,49	5,53	-0,04
ВТБ, 2018 (LPN14)	29.05.18	880	102,73	5,83	5,78	0,05
ВТБ, 2020 (LPN)	13.10.20	1 534	100,48	6,54	6,53	0,01
ВТБ, 2022 (LPN)	17.10.22	1 948	88,28	9,46	9,36	0,10
ВТБ, 2035 (LPN6)	30.06.35	4 091	98,06	6,53	6,53	0,00
Эмитент	Внешэкономбанк					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Внешэкономбанк, 2017-2 (LPN)	13.02.17	485	100,20	5,29	4,99	0,30
Внешэкономбанк, 2017 (LPN)	22.11.17	732	100,00	5,52	5,32	0,20
Внешэкономбанк, 2018 (LPN)	21.11.18	1 059	94,88	6,12	5,97	0,15
Внешэкономбанк, 2020 (LPN)	09.07.20	1 475	98,46	7,42	7,29	0,13
Внешэкономбанк, 2022 (LPN)	05.07.22	1 991	91,92	7,71	7,55	0,16
Внешэкономбанк, 2023 (LPN)	21.11.23	2 281	89,64	7,82	7,78	0,04
Внешэкономбанк, 2025 (LPN)	22.11.25	2 593	92,55	8,03	8,04	-0,01
Эмитент	ОАО "Газпром"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Газпром, 2015-4 (LPN36)	12.11.15	48	100,32	1,86	1,91	-0,05
Газпром, 2015-3 (LPN23)	29.11.15	65	100,46	2,50	1,59	0,91
Газпром, 2016-2 (LPN24)	23.05.16	235	101,80	2,21	2,24	-0,03
Газпром, 2016 (LPN7)	22.11.16	402	103,53	3,12	3,05	0,07
Газпром, 2018-2 (LPN17)	11.04.18	821	106,75	5,35	5,18	0,17
Газпром, 2019 (LPN20)	23.04.19	1 098	110,83	5,94	5,82	0,12
Газпром, 2020 (LPN28)	06.02.20	1 448	91,67	6,14	5,98	0,16
Газпром, 2021 (LPN25)	23.01.21	1 650	97,12	6,76	6,63	0,13
Газпром, 2022 (LPN9)	07.03.22	1 923	97,85	7,05	6,90	0,15

*торги на внебиржевом рынке

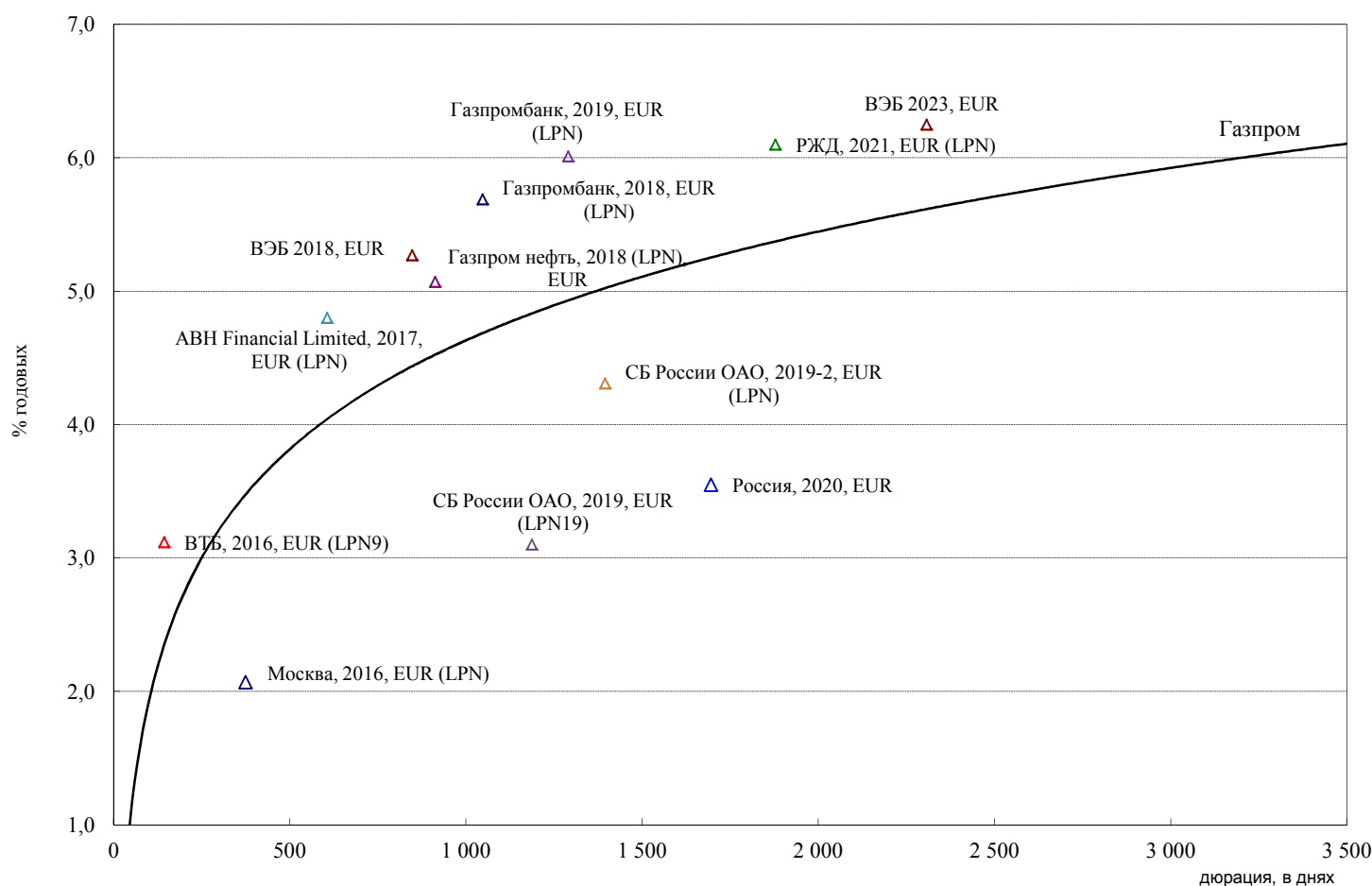
24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата погашения	Дюрация, в днях	Индикативная цена	Средневзвешенная доходность, % годовых	Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых	Изменение
Газпром, 2022-2 (LPN)	19.07.22	2 072	90,39	6,84	6,69	0,15
Газпром, 2028 (LPN29)	06.02.28	3 225	82,03	7,29	7,13	0,16
Газпром, 2034 (LPN2)	28.04.34	3 465	108,63	7,89	7,85	0,04
Газпром, 2037 (LPN12)	16.08.37	3 922	94,82	7,93	7,82	0,11
Эмитент	Газпромбанк (Открытое акционерное общество)					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba2/BB+					
Газпромбанк, 2016 (LPN)	08.05.16	224	101,56	4,68	4,59	0,09
Газпромбанк, 2017 (LPN)	17.05.17	564	101,09	4,99	5,20	-0,21
Газпромбанк, 2018 (LPN12)	21.11.18	1 018	77,50	15,49	15,48	0,01
Газпромбанк, 2019 (LPN)	03.05.19	1 133	98,15	8,00	8,06	-0,06
Газпромбанк, 2019 (LPN)	05.09.19	1 300	93,88	6,87	6,89	-0,02
Газпромбанк, 2023*	28.12.18	1 030	83,13	14,62	14,60	0,02
Эмитент	ОАО "Нефтяная компания "Роснефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/Withdrawn					
Роснефть, 2017 (LPN)	06.03.17	514	98,10	4,57	4,72	-0,15
Роснефть, 2022 (LPN)	06.03.22	2 025	84,75	7,32	7,24	0,08
Эмитент	ОАО "Россельхозбанк"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	-/Ba2/BB+					
Россельхозбанк, 2017 (LPN2)	15.05.17	559	101,23	5,58	5,57	0,01
Россельхозбанк, 2017-2 (LPN)	27.12.17	768	99,33	5,69	5,69	0,00
Россельхозбанк, 2018 (LPN3B)	29.05.18	871	103,28	6,49	6,51	-0,02
Россельхозбанк, 2021 (LPN)*	03.06.16	243	90,10	23,38	23,31	0,07
Россельхозбанк, 2018-2 (LPN)	25.07.18	955	97,00	6,37	6,34	0,03
Россельхозбанк, 2023 (LPN)	16.10.23	2 028	89,84	10,66	10,65	0,01
Эмитент	ОАО "Сбербанк России"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	-/Ba2/BBB-					
СБ России ОАО, 2017-2 (LPN)	07.02.17	480	101,13	4,14	4,14	0,00
СБ России ОАО, 2017 (LPN)	24.03.17	526	101,69	4,27	4,26	0,01
СБ России ОАО, 2023 (LPN)	23.05.18	2 210	83,76	8,30	8,29	0,01
СБ России ОАО, 2019-2 (LPN18)	06.03.19	1 168	101,38	3,76	3,74	0,02
СБ России ОАО, 2019 (LPN)	28.06.19	1 233	100,12	5,21	5,21	0,00
СБ России ОАО, 2021 (LPN)	16.06.21	1 758	98,58	6,10	6,07	0,03
СБ России ОАО, 2022 (LPN)	07.02.22	1 918	99,76	6,27	6,25	0,02
СБ России ОАО, 2022-2 (LPN)	29.10.22	2 098	88,93	7,27	7,30	-0,03
СБ России ОАО, 2024 (LPN)*	26.02.19	1 123	82,76	12,11	11,57	0,54
Эмитент	ОАО "Акционерная компания по транспорту нефти "Транснефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/-					
Транснефть, 2018 (LPN)	07.08.18	932	110,00	4,98	4,98	0,00

*По данным обязательствам указаны дата оферты, дюрация и доходность к оферте

График 7. Доходность еврооблигаций, номинированных в ЕВРО



ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ ЕВРООБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В ЕВРО* (График 7)

Выпуск	Дата погашения	Длительность, в днях	Индикативная цена	Средневзвешенная доходность, % годовых	Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых	Изменение
ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	Российская Федерация					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Россия, 2020, EUR	16.09.20	1 696	100,38	3,55	3,51	0,04
СУБФЕДЕРАЛЬНЫЕ И МУНИЦИПАЛЬНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	Правительство Москвы					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Москва, 2016, EUR (LPN)	20.10.16	375	103,14	2,07	2,11	-0,04
КОРПОРАТИВНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	ОАО Банк ВТБ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba2/Withdrawn					
ВТБ, 2016, EUR (LPN9)	15.02.16	144	100,42	3,12	2,14	0,98
Эмитент	Внешэкономбанк					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
ВЭБ 2018, EUR	21.02.18	848	95,06	5,27	5,16	0,11
ВЭБ 2023, EUR	21.02.23	2 307	87,19	6,25	6,25	0,00
Эмитент	ОАО "Российские железные дороги"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
РЖД, 2021, EUR (LPN)	20.05.21	1 879	87,28	6,10	6,04	0,06

*торги на внебиржевом рынке

24 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

Выпуск	Дата погашения	Дюрация, в днях	Индикативная цена	Средневзвешенная доходность, % годовых	Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых	Изменение
Эмитент						
ОАО "Газпром нефть"						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba1/BBB-						
Газпром нефть, 2018 (LPN), EUR	26.04.18	913	94,95	5,07	5,02	0,05
Эмитент						
Газпромбанк (Открытое акционерное общество)						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba2/BB+						
Газпромбанк, 2018, EUR (LPN)	30.10.18	1 047	95,30	5,69	5,69	0,00
Газпромбанк, 2019, EUR (LPN)	01.07.19	1 291	93,41	6,01	6,00	0,01
Эмитент						
ОАО "Газпром"						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba1/BBB-						
Газпром, 2017-3, EUR (LPN)	15.03.17	525	99,85	3,86	3,75	0,11
Газпром, 2017, EUR (LPN6)	22.03.17	527	102,11	3,65	3,77	-0,12
Газпром, 2017-2, EUR (LPN8)	02.11.17	715	102,50	4,18	4,18	0,00
Газпром, 2018, EUR (LPN13)	13.02.18	808	104,58	4,53	4,39	0,14
Газпром, 2018-3 (LPN32), EUR	27.07.18	996	97,55	4,65	4,59	0,06
Газпром, 2020 (LPN), EUR	20.03.20	1 517	92,57	5,30	5,31	-0,01
Газпром, 2021 (LPN35), EUR	26.02.21	1 788	90,63	5,66	5,69	-0,03
Газпром, 2025 (LPN), EUR	21.03.25	2 819	92,15	5,45	5,43	0,02
Эмитент						
ОАО "Сбербанк России"						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
-/Ba2/BBB-						
СБ России ОАО, 2019, EUR (LPN19)	07.03.19	1 187	100,00	3,10	3,10	0,00
СБ России ОАО, 2019-2, EUR (LPN)	15.11.19	1 395	96,46	4,31	4,33	-0,02
Эмитент						
ABH Financial Limited						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
-/-/BB						
ABH Financial Limited, 2017, EUR (LPN)	10.06.17	606	101,11	4,80	4,70	0,10

График 8. Диаграмма доходность - кредитный рейтинг (срочность 3 года)

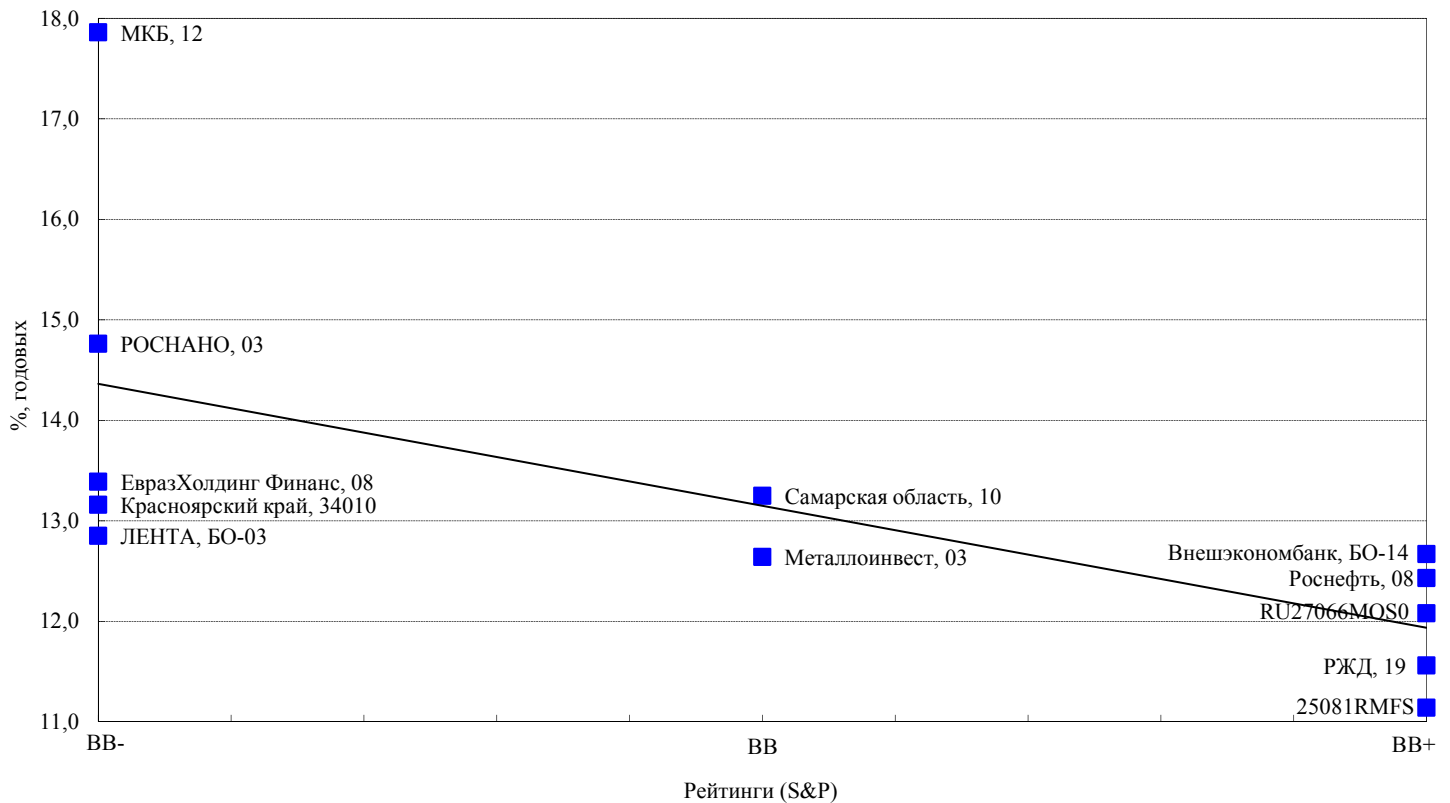


График 9. Уровни доходности на внутреннем рынке облигаций

