

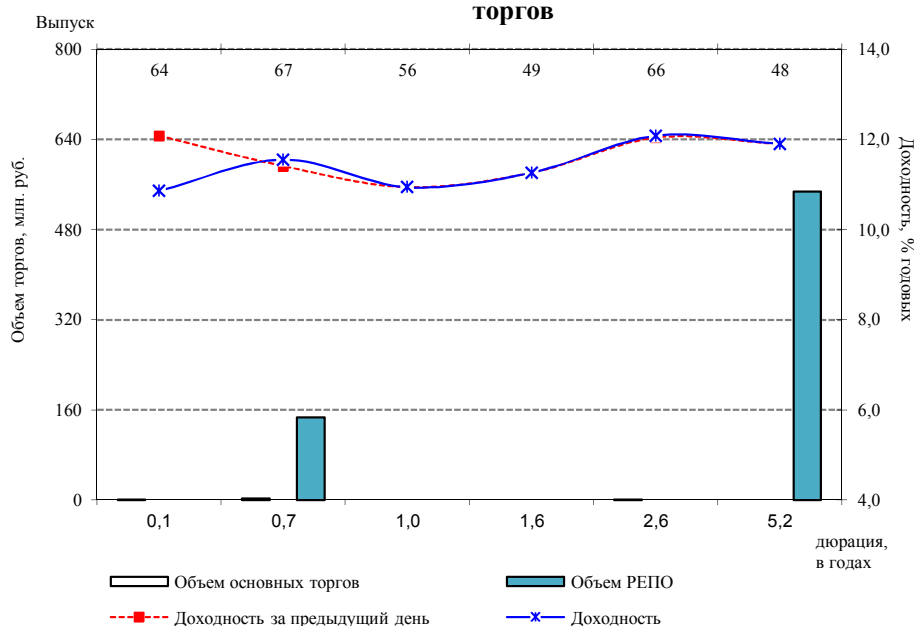
Ежедневный информационно-аналитический обзор за 29 сентября 2015 года

| | |
|---|-----------|
| <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> |

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. |
|------------------------|----------------|------------------|--------------------------------------|----------------------|-------------|----------------|------------------|--------------------------------------|----------------------|---------------------------|
| RU32064MOSO | 16.11.15 | 0,1 | 10,86 | -1,22 | 25077RMFS | 20.01.16 | 0,3 | 9,95 | -0,25 | 91 |
| RU25067MOSO | 01.06.16 | 0,7 | 11,55 | 0,14 | 25082RMFS | 11.05.16 | 0,6 | 10,81 | -0,07 | 74 |
| RU32056MOSO | 22.09.16 | 1,0 | 10,94 | 0,00 | 26203RMFS | 03.08.16 | 0,8 | 10,89 | 0,05 | 5 |
| RU32049MOSO | 14.06.17 | 1,6 | 11,26 | 0,00 | 26206RMFS | 14.06.17 | 1,6 | 11,08 | -0,15 | 18 |
| RU27066MOSO | 23.11.18 | 2,6 | 12,08 | 0,04 | 24018RMFS | 27.12.17 | 1,9 | 14,82 | -0,02 | -274 |
| RU32048MOSO | 11.06.22 | 5,2 | 11,90 | 0,00 | 26209RMFS | 20.07.22 | 5,2 | 11,41 | 0,26 | 49 |
| | | | | | 26211RMFS | 25.01.23 | 5,6 | 11,29 | 0,04 | 61 |

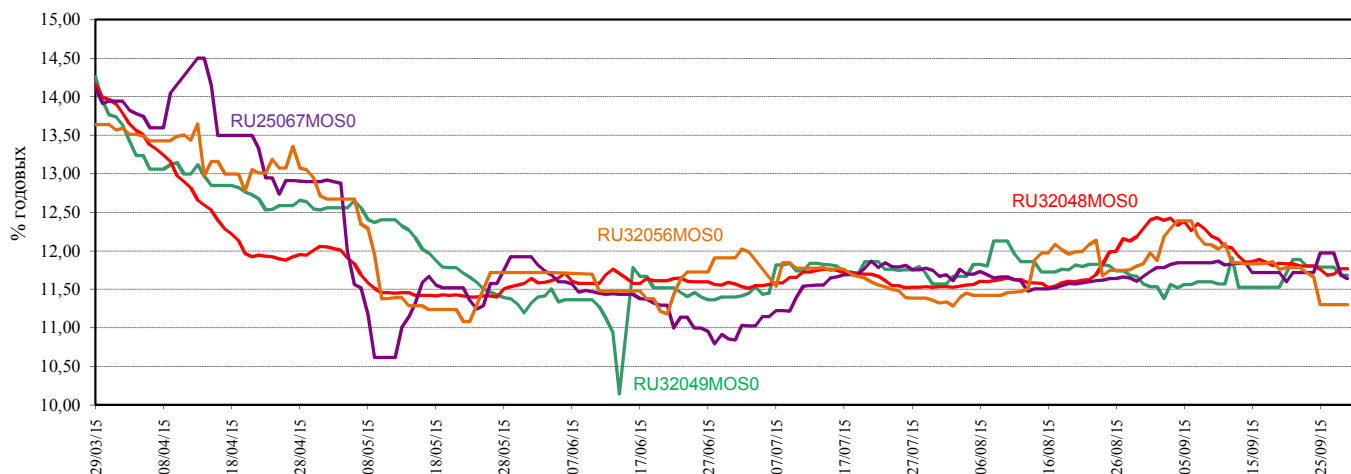
График 1. Кривые доходности ОГО(В)З Москвы и объемы торгов



| Объем торгов на ММВБ, млн. руб. | ОГО(В)З Москвы | ОФЗ |
|---------------------------------|----------------|--------|
| режим основных торгов | 3 | 1 852 |
| РПС | 0 | 10 909 |
| РЕПО | 694 | 10 554 |

| Дата | Средневзвешенная доходность рынка ОГО(В)З, % годовых |
|-----------|--|
| 25 сен 15 | 11,66 |
| 28 сен 15 | 11,76 |
| 29 сен 15 | 11,77 |

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



На графике построены линии тренда

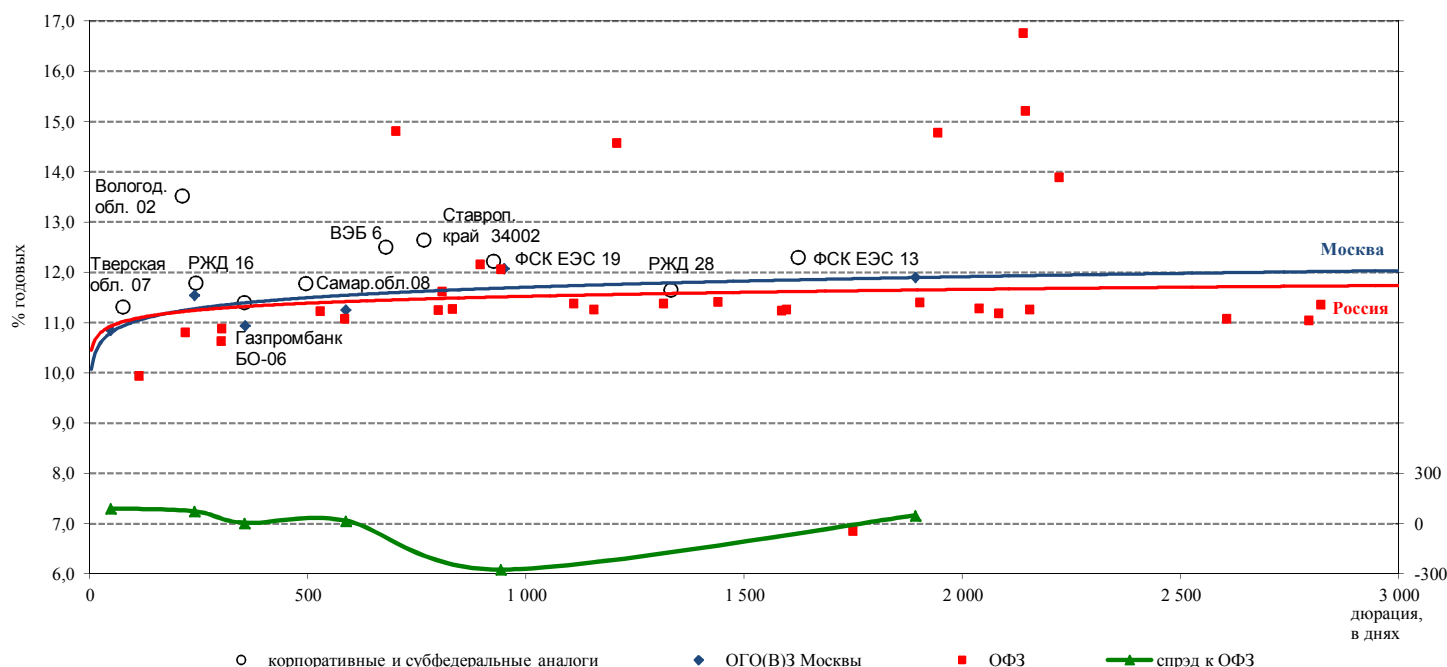
* В случае отсутствия торгов за отчетную дату, средневзвешенная доходность принимается равной последней установленной по данному выпуску

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 | 11,31 | -0,70 | 0,39 | - |
| Вологодская область, 34002 | Withdrawn/B2/Withdrawn | 14.12.16 | 0,6 | 13,52 | 0,05 | 0,05 | - |
| РЖД, 16 | BB+/Ba1/BBB- | 05.06.17 | 0,7 | 11,79 | -0,20 | 109,01 | 9,77 |
| Газпромбанк, БО-06 | BB+/Ba2/BB+ | 25.09.16 | 1,0 | 11,40 | -0,05 | 164,21 | - |
| Самарская обл., 08 | BB/Ba3/- | 13.12.17 | 1,4 | 11,77 | 0,00 | - | - |
| ВЭБ 6 | BB+/Ba1/BBB- | 13.10.20 | 1,9 | 12,50 | -0,91 | 0,01 | - |
| 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 | 11,65 | -0,15 | 9,02 | - |
| ФСК ЕЭС, 13 | BB+/Ba1/BBB- | 22.06.21 | 4,5 | 12,29 | 0,30 | 0,52 | - |

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

Спрэд, б. п.



На графике 3 кривые доходностей ОГО(В)З Москвы и ОФЗ сглажены с использованием логарифмической функции

ДАННЫЕ ПО РЫНОЧНЫМ ЦЕНАМ ОГО(В)З МОСКВЫ, РАСЧИТАННЫМ 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 | 100,22 | 10,86 | 48 |
| RU25067MOS0 | 05.06.13 | 01.06.16 | 97,04 | 11,55 | 240 |
| RU32056MOS0 | 22.09.08 | 22.09.16 | 96,00 | 11,74 | 353 |
| RU32049MOS0 | 14.12.06 | 14.06.17 | 93,94 | 11,27 | 586 |
| RU27066MOS0 | 23.11.09 | 23.11.18 | 105,10 | 12,08 | 950 |
| RU32048MOS0 | 11.12.06 | 11.06.22 | 76,46 | 11,77 | 1 894 |

* 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

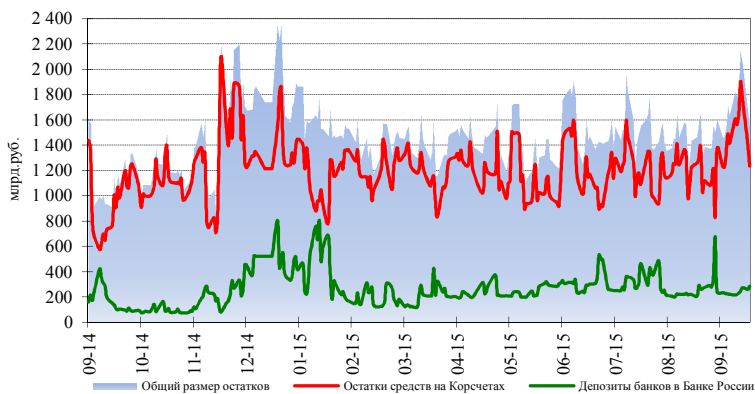


График 5. Уровень ставок MosPrime

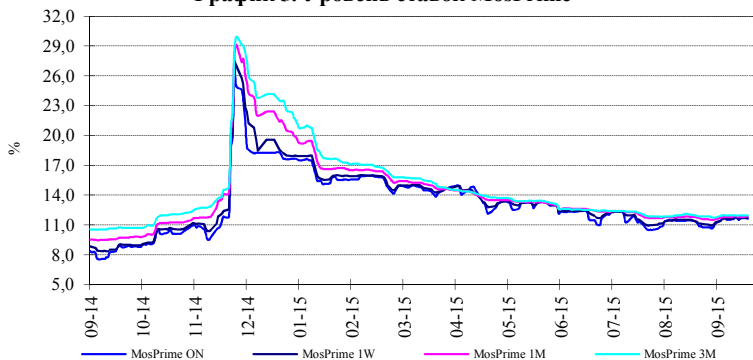


График 6. Динамика официального курса доллара США, Евро и бивалютной корзины Банка России

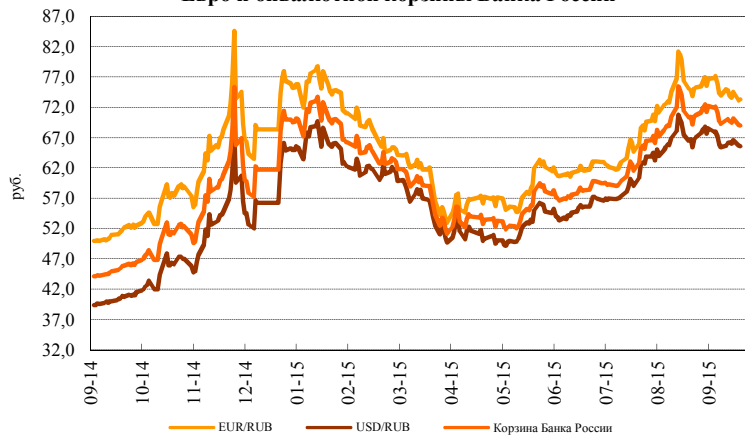
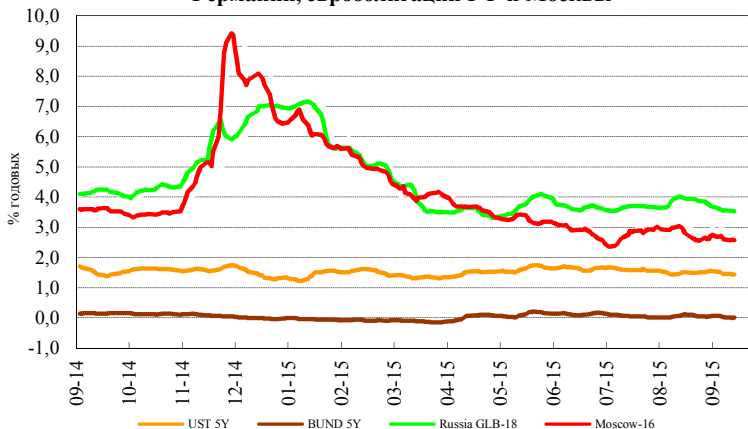


График 7. Динамика доходности гособлигаций США и Германии, еврооблигаций РФ и Москвы



Ключевые фиксированные процентные ставки Банка России

| | 29.09.15 | 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

| | 29.09.15 | изменение за день, % | изменение за неделю, % | изменение за месяц, % |
|-------------------------------------|----------|----------------------|------------------------|-----------------------|
| Корсчета, млрд. руб. | 1 234,00 | -11,94 | -20,99 | 1,21 |
| Депозиты в Банке России, млрд. руб. | 284,63 | 9,60 | 30,06 | 29,65 |
| MosPrime ON, % | 11,64 | -0,34 | -1,44 | 1,48 |
| MosPrime 1M, % | 11,83 | 0,00 | -0,84 | 0,08 |
| MosPrime 3M, % | 11,96 | 0,08 | -0,25 | -0,66 |
| Libor ON, % | 0,13 | -0,74 | -1,48 | 0,00 |
| Libor 1M, % | 0,19 | -0,31 | -1,33 | -2,80 |
| Libor 3M, % | 0,33 | -0,34 | -0,31 | -1,06 |
| Libor 1Y, % | 0,85 | -0,29 | 1,28 | 1,07 |
| NDF 1M, % | 11,66 | -0,09 | -0,09 | -1,69 |
| NDF 3M, % | 11,92 | 0,29 | -1,08 | -6,03 |
| NDF 12M, % | 12,12 | 1,76 | -0,37 | -4,19 |

Валютный рынок

| | 29.09.15 | изменение за день, % | изменение за неделю, % | изменение за месяц, % |
|---------------------------------|----------|----------------------|------------------------|-----------------------|
| EUR/USD | 1,1232 | 0,49 | 0,66 | -0,25 |
| | 30.09.15 | изменение за день, % | изменение за неделю, % | изменение за месяц, % |
| EUR/RUB | 74,5825 | 1,79 | 0,85 | -0,62 |
| USD/RUB | 66,2367 | 1,05 | 0,09 | -0,36 |
| Бивалютная корзина Банка России | 69,9923 | 1,41 | 0,45 | -0,49 |

Индексы фондового рынка

| | 29.09.15 | изменение за день, % | изменение за неделю, % | изменение за месяц, % |
|--------------------|-----------|----------------------|------------------------|-----------------------|
| MICEX | 1 630,51 | 0,88 | -2,03 | -5,16 |
| RTS | 784,11 | 1,08 | -0,69 | -5,52 |
| S&P 500 | 1 884,09 | 0,12 | -3,02 | -5,27 |
| DJ | 16 049,13 | 0,30 | -1,72 | -1,72 |
| DAX | 9 450,40 | -0,35 | -1,26 | -8,24 |
| Hang Seng | 20 556,60 | -2,97 | -5,69 | -4,89 |
| Bovespa | 44 131,82 | 0,40 | -4,61 | -6,41 |
| Nikkei 225 | 16 930,84 | -4,05 | -6,31 | -11,53 |
| Shanghai Composite | 3 038,14 | -2,02 | -4,63 | -6,01 |

Рынок внешнего долга

| | 29.09.15 | изменение за день, б.п. | изменение за неделю, б.п. | изменение за месяц, б.п. |
|------------------|----------|-------------------------|---------------------------|--------------------------|
| Russia GLB-18, % | 3,47 | 0,00 | -0,04 | -0,51 |
| Moscow-16, % | 2,38 | -0,31 | -0,10 | -0,67 |
| UST 5Y, % | 1,38 | -0,04 | -0,05 | -0,14 |
| BUND 5Y, % | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -0,09 |

Товарный рынок

| | 29.09.15 | изменение за день, % | изменение за неделю, % | изменение за месяц, % |
|--------------------|----------|----------------------|------------------------|-----------------------|
| Brent | 48,23 | 1,88 | -1,73 | -3,64 |
| WTI Nymex | 45,23 | 1,80 | -1,31 | 0,02 |
| Urals | 46,48 | 3,66 | 0,63 | -1,25 |
| Золото, руб./грамм | 2 397,15 | -0,89 | -0,85 | -2,04 |

ИТОГИ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИОННЫХ ЗАЙМОВ

| Выпуск | Дата погашения | Дата оферты | 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 |
|---------------------------------------|----------------|-------------|----------------------|--|-------------------------------------|---|--|--------------------------------------|--|---|
| ПГК-1, БО-01 | 16.09.25 | 01.10.18 | буклидинг | 5 000 | 13 000 | 5 000 | 12,70 | - | 13,11 | Газпромбанк ВТБ Капитал, Sberbank СІВ, РОСБАНК |
| "Русфинанс Банк", БО-10 | 29.09.20 | 31.03.17 | буклидинг | 4 000 | - | 4 000 | 12,10 | - | 12,47 | РОСБАНК |
| АИЖК, БО-04 | 25.09.18 | 28.09.17 | буклидинг | 5 000 | - | 5 000 | 11,50 | - | 12,01 | ВТБ Капитал, Райффайзен-банк |
| Международный инвестиционный банк, 03 | 19.11.24 | 02.06.17 | вторичное размещение | 2 310 | - | 2 310 | - | - | 12,33 | Банк Зенит |

БЛИЖАЙШИЕ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИОННЫХ ЗАЙМОВ

| Дата | Выпуск | Форма размещения | Сектор рынка облигаций | Объем эмиссии, млн. руб. | Дата погашения | Организатор, Со-организаторы, андеррайтеры, со-андеррайтеры |
|----------|---|-------------------|------------------------|--------------------------|----------------|--|
| 30.09.15 | ОФЗ-ПД, 26214 | аукцион | государственный | 10 000 | 27.05.20 | Банк России |
| 30.09.15 | ОФЗ-ПК, 29006 | аукцион | государственный | 5 000 | 29.01.25 | Банк России |
| 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» |
| 30.09.15 | Открытие Холдинг, БО-03 (доп. выпуск) | букбилдинг | корпоративный | 10 000 | 26.07.17 | Банк "ФК Открытие" |
| 30.09.15 | «Мультиоригинаторный ипотечный агент 1», классы А/3, Б1/3, Б2/3, Б3/3 | закрытая подписка | корпоративный | 6 696 | 24.12.47 | - |
| 30.09.15 | "Ипотечный агент КМ", 01 | букбилдинг | корпоративный | 13 504 | 30.06.22 | БК Регион |
| 30.09.15 | БИНБАНК, БО-03 (доп. выпуски № 4 - 6) | букбилдинг | корпоративный | 5 000 | 16.07.16 | БИНБАНК |
| 02.10.15 | «Энел Россия», 001P-01R | букбилдинг | корпоративный | 5 000 | 28.09.18 | РОСБАНК, Sberbank СІВ |
| 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 СІВ, 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)

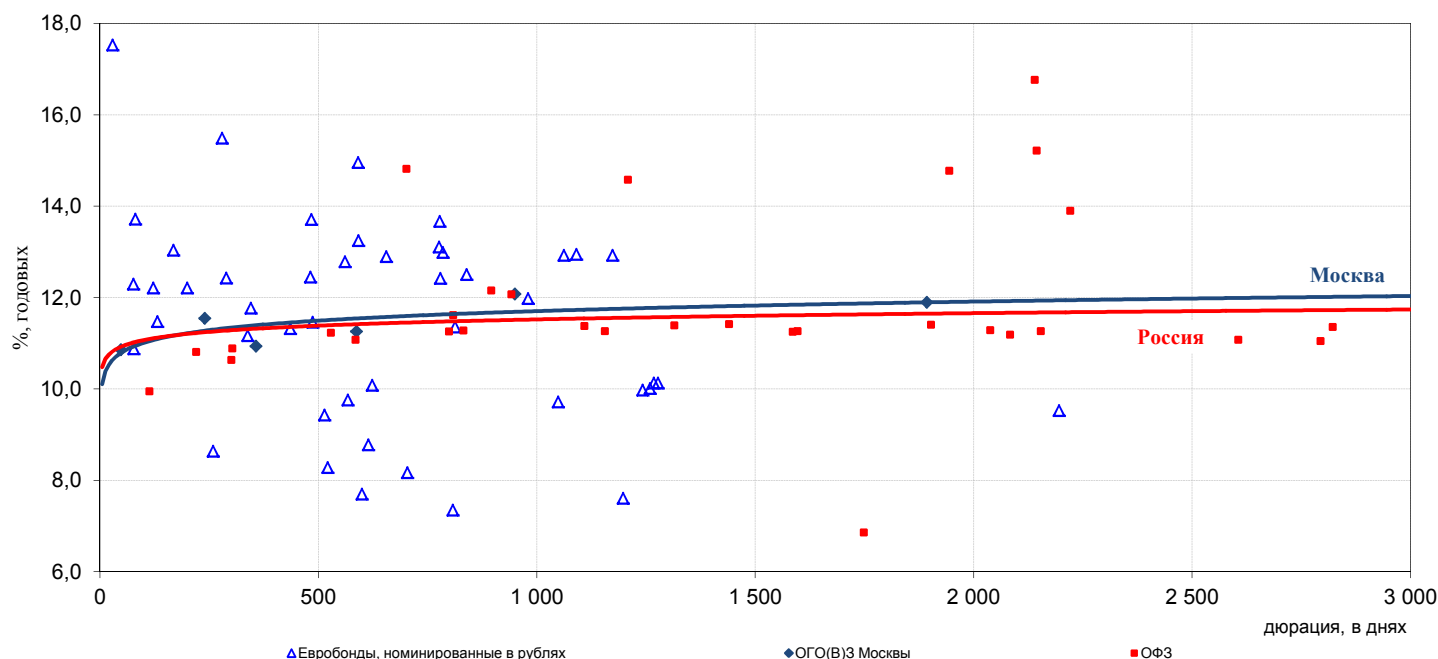
| Выпуск | Дата начала размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Режим основных торгов | | | Режим переговорных сделок | | |
|--|------------------------|----------------|-----------------|-------------------------------------|-------------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------------|-------------------|
| | | | | Средневзвешенная доходность, % год. | Объем торгов, млн. руб. | Кол-во бумаг, шт. | Средневзвешенная доходность, % год. | Объем торгов, млн. руб. | Кол-во бумаг, шт. |
| Эмитент | | | | Российская Федерация | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | BB+/Ba1/BBB- | | | | | |
| 25077RMFS | 26.01.11 | 20.01.16 | 113 | 9,95 | 287,21 | 289 303 | | | |
| 25082RMFS | 15.05.13 | 11.05.16 | 220 | 10,81 | 23,38 | 24 018 | | | |
| 26203RMFS | 04.08.10 | 03.08.16 | 303 | 10,89 | 113,66 | 117 113 | | | |
| 46017RMFS | 16.02.05 | 03.08.16 | 301 | 10,64 | 0,00 | 2 | | | |
| 25080RMFS | 25.04.12 | 19.04.17 | 529 | 11,23 | 24,19 | 25 448 | 11,23 | 1 577,97 | 1 660 000 |
| 26206RMFS | 08.06.11 | 14.06.17 | 585 | 11,08 | 20,61 | 21 733 | | | |
| 24018RMFS | 28.01.15 | 27.12.17 | 701 | 14,82 | 401,88 | 395 123 | 14,82 | 838,95 | 824 660 |
| 25081RMFS | 06.02.13 | 31.01.18 | 799 | 11,26 | 0,27 | 300 | | | |
| 26204RMFS | 23.03.11 | 15.03.18 | 832 | 11,28 | 75,56 | 81 579 | 11,28 | 185,37 | 200 000 |
| 46021RMFS | 21.02.07 | 08.08.18 | 808 | 11,62 | 479,41 | 549 151 | | | |
| 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 | 1 109 | 11,38 | 12,62 | 14 011 | 11,38 | 703,63 | 781 449 |
| 46019RMFS | 28.12.05 | 20.03.19 | | | | | | | |
| 26216RMFS | 13.11.13 | 15.05.19 | 1 156 | 11,27 | 0,01 | 6 | | | |
| 26210RMFS | 19.12.12 | 11.12.19 | 1 315 | 11,39 | 0,01 | 17 | 11,39 | 59,54 | 69 310 |
| 29011RMFS | 28.01.15 | 29.01.20 | 1 208 | 14,58 | 105,23 | 104 179 | 14,58 | 5 555,84 | 5 499 995 |
| 26214RMFS | 05.06.13 | 27.05.20 | 1 440 | 11,42 | 16,71 | 20 073 | 11,42 | 249,62 | 300 031 |
| 26205RMFS | 13.04.11 | 14.04.21 | 1 597 | 11,27 | 0,01 | 13 | | | |
| 46018RMFS | 16.03.05 | 24.11.21 | 1 586 | 11,25 | 0,00 | 1 | | | |
| 26209RMFS | 01.08.12 | 20.07.22 | 1 902 | 11,41 | 3,39 | 4 055 | | | |
| 26211RMFS | 16.01.13 | 25.01.23 | 2 038 | 11,29 | 0,44 | 551 | 11,29 | 62,67 | 78 090 |
| 46022RMFS | 23.01.08 | 19.07.23 | 2 084 | 11,19 | 0,00 | 1 | | | |
| 26215RMFS | 04.09.13 | 16.08.23 | 2 154 | 11,27 | 158,63 | 200 040 | 11,27 | 1 072,42 | 1 350 000 |
| 29006RMFS | 31.12.14 | 29.01.25 | 1 944 | 14,78 | 12,14 | 12 011 | | | |
| 46011RMFS | 14.02.03 | 20.08.25 | | | | | | | |
| 46023RMFS | 30.09.11 | 23.07.26 | | | | | | | |
| 26207RMFS | 22.02.12 | 03.02.27 | 2 605 | 11,08 | 87,39 | 105 334 | | | |
| 52001RMFS | 17.07.15 | 16.08.23 | 2 614 | 3,37 | 19,23 | 20 252 | | | |
| 29007RMFS | 31.12.14 | 03.03.27 | 2 221 | | | | 13,90 | 204,00 | 200 000 |
| 26212RMFS | 23.01.13 | 19.01.28 | 2 794 | 11,05 | 1,16 | 1 547 | 11,05 | 112,45 | 150 000 |
| 46010RMFS | 14.02.03 | 17.05.28 | | | | | | | |
| 46012RMFS | 14.02.03 | 05.09.29 | | | | | | | |
| 29008RMFS | 31.12.14 | 03.10.29 | 2 144 | | | | 15,22 | 210,00 | 200 000 |
| 29009RMFS | 31.12.14 | 05.05.32 | 2 140 | 16,77 | 8,37 | 8 236 | 16,77 | 76,15 | 75 000 |
| 29010RMFS | 31.12.14 | 06.12.34 | | | | | | | |
| 46020RMFS | 15.02.06 | 06.02.36 | 3 297 | 11,36 | 0,44 | 654 | | | |

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 | 48 | 10,86 | 0,02 | 16 | | | |
| RU25067MOS0 | 05.06.13 | 01.06.16 | 240 | 11,55 | 2,99 | 3 070 | | | |
| 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 | 950 | 12,08 | 0,09 | 88 | | | |
| 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 | | | | | | | |

На графиках 1 - 3 и 9 кривые доходностей ОГО(В)З Москвы и ОФЗ сглажены 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 | 813 | 93,28 | 11,36 |
| РЖД, 2019, RUB (LPN) | BB+/Ba1/BBB- | 02.04.19 | 1 062 | 88,25 | 12,93 |
| АИЖК, 2018, RUB (LPN) | BB+/Ba1/- | 13.02.18 | 785 | 90,31 | 12,99 |
| Газпромбанк, 2015, RUB (LPN) | BB+/Ba2/BB+ | 15.12.15 | 76 | 99,30 | 12,30 |
| Газпромбанк, 2016-2, RUB (LNP) | BB+/Ba2/BB+ | 25.07.16 | 289 | 96,79 | 12,43 |
| Газпромбанк, 2019, RUB (LPN) | BB+/Ba2/BB+ | 29.06.19 | 1 173 | 88,06 | 12,93 |
| Россельхозбанк, 2016-2, RUR (LPN) | -/Ba2/BB+ | 17.03.16 | 168 | 98,26 | 13,04 |
| Россельхозбанк, 2017, RUB (LPN) | -/Ba2/BB+ | 17.02.17 | 484 | 94,26 | 13,71 |
| Россельхозбанк, 2018, RUB (LPN) | -/Ba2/BB+ | 07.02.18 | 778 | 89,43 | 13,67 |
| Вымпелком, 2018, RUB | BB/Ba3/- | 13.02.18 | 776 | 92,59 | 13,11 |
| НОВАТЭК, 2017, RUB (LPN) | BB+/Ba1/BBB- | 21.02.17 | 481 | 94,56 | 12,45 |
| РусГидро, 2015, RUR | BB/Ba2/BB+ | 28.10.15 | 29 | 99,30 | 17,53 |
| ФСК ЕЭС, 2019, RUB | BB+/Ba1/BBB- | 13.03.19 | 1 090 | 88,76 | 12,95 |
| СБ России ОАО, 2016, RUB (LPN) | -/Ba2/BBB- | 31.01.16 | 122 | 98,41 | 12,21 |
| Альфа-Банк, 2016 (LPN), RUB | BB/Ba2/BB+ | 26.04.16 | 199 | 98,24 | 12,21 |
| Евразийский банк развития, 2017, RUB | BBB/Baa1/Withdrawn | 05.10.17 | 655 | 92,18 | 12,90 |
| World Bank, 2017, RUR | AAA/Aaa/AAA | 02.03.17 | 487 | 94,95 | 11,46 |
| EIB, 2015, RUR | AAA/Aaa/AAA | 15.12.15 | 77 | 99,08 | 10,88 |
| EIB, 2016, RUR | AAA/Aaa/AAA | 30.09.16 | 338 | 95,79 | 11,17 |
| EIB, 2017, RUR | AAA/Aaa/AAA | 13.06.17 | 600 | 98,50 | 7,70 |
| EIB, 6% 15feb2018 | AAA/Aaa/AAA | 15.02.18 | 808 | 97,13 | 7,35 |
| EIB, 2019-2, RUB | AAA/Aaa/AAA | 16.07.19 | 1 198 | 100,10 | 7,61 |
| IFC, 5% 28dec2016 RUB | AAA/Aaa/- | 28.12.16 | 435 | 93,15 | 11,32 |
| IFC, 11% 21jan2020 (RUB/USD), RUB | AAA/Aaa/- | 21.01.20 | 1 278 | 103,85 | 10,13 |
| JP Morgan, 2017, RUR | A+/A2/A+ | 28.06.17 | 591 | 91,09 | 13,25 |
| EBRD, 6.75% 12may2017, RUR | AAA/Aaa/AAA | 12.05.17 | 567 | 95,64 | 9,76 |
| EBRD, 6.5% 27jun2017, RUR | AAA/Aaa/AAA | 27.06.17 | 614 | 96,42 | 8,78 |
| EBRD, FRN 20may2020, RUB | AAA/Aaa/AAA | 20.05.20 | - | - | - |
| Rabobank, 2016, RUR | AA-/Aa2/AA | 10.02.16 | 131 | 98,56 | 11,48 |
| Rabobank, 6% 30nov2016, RUR | AA-/Aa2/AA | 30.11.16 | - | - | - |

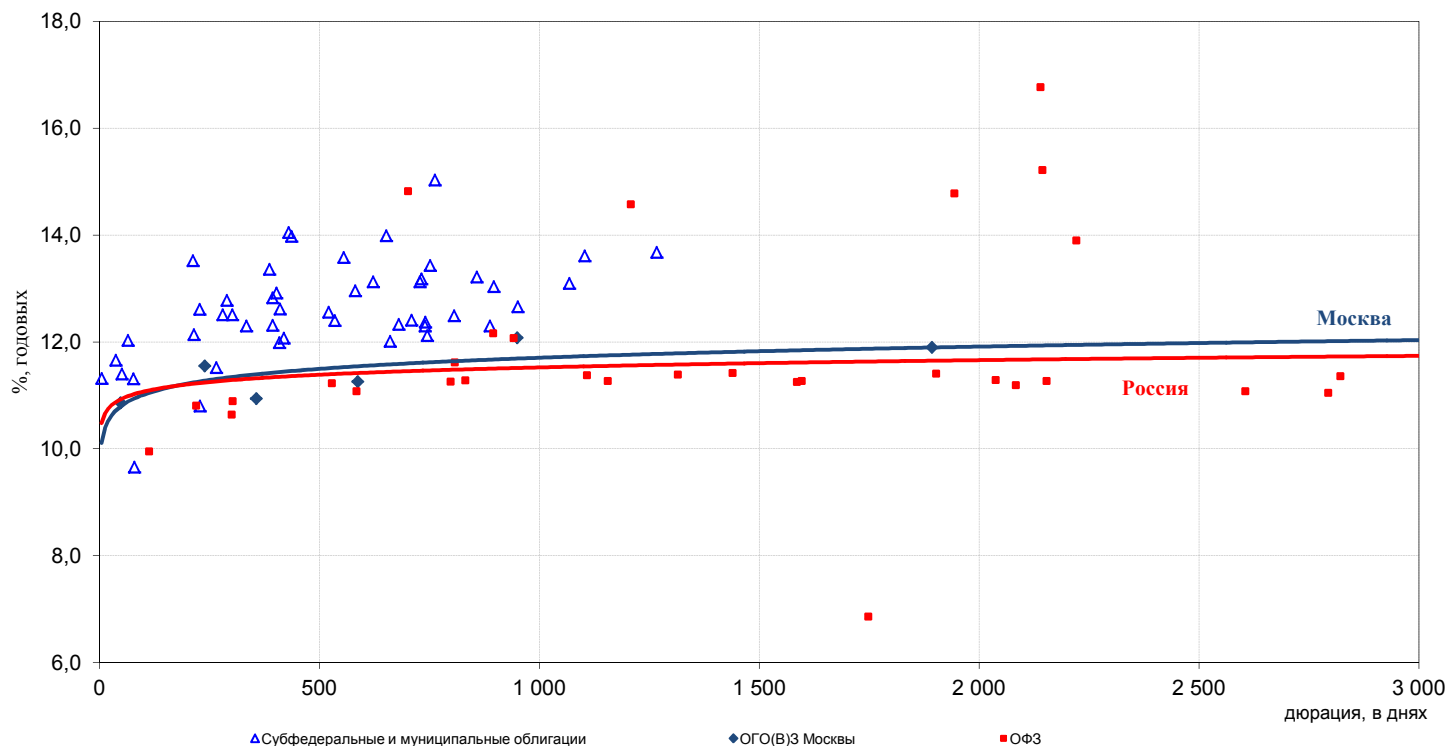
*торги на внебиржевом рынке

**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 | 591 | 88,60 | 14,96 |
| KfW, 2017, RUR | -/-/- | 25.09.17 | 704 | 97,50 | 8,17 |
| KfW, 7% 14jun2016 | -/-/- | 14.06.16 | 259 | 98,86 | 8,64 |
| Caterpillar, 7.5% 20dec2015 | -/-/- | 20.12.15 | 81 | 98,73 | 13,72 |
| IBRD, 7.625% 11oct2016 (RUB/USD) | -/-/- | 11.10.16 | 345 | 96,16 | 11,77 |
| IBRD, 6.25% 05jul2017, RUB | -/-/- | 05.07.17 | 623 | 94,05 | 10,08 |
| IBRD, 10.3% 05mar2019 (RUB/EUR) | -/-/- | 05.03.19 | 1 048 | 101,51 | 9,72 |
| IBRD, 6.5% 26jul2019 RUB/USD | -/-/- | 26.07.19 | 1 259 | 89,24 | 10,01 |
| IBRD, 10% 16sep2019, RUR | -/-/- | 16.09.19 | 1 242 | 100,06 | 9,98 |
| IBRD, 11.6% 10feb2020 (RUB/USD) | -/-/- | 10.02.20 | 1 268 | 105,94 | 10,13 |
| IBRD, 6.75% 2023, RUR | -/-/- | 20.06.23 | 2 195 | 85,29 | 9,53 |
| KEXIM, 7.63% 30may2017 | -/-/- | 30.05.17 | 560 | 92,97 | 12,79 |
| BNP Paribas, 6.89% 30jan2018 | AA+/Aa1/AA | 30.01.18 | 779 | 89,73 | 12,42 |
| Societe Generale, 10.5% 30mar2017, RUB | A/A2/A | 30.03.17 | 514 | 101,34 | 9,43 |
| Societe Generale, 8% 30mar2017, RUB | A/A2/A | 30.03.17 | 521 | 99,56 | 8,28 |
| 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 | 280 | 101,00 | 15,49 |
| Lloyds Bank, 6.2% 24apr2018, RUR | -/-/- | 24.04.18 | 839 | 87,21 | 12,51 |
| SEK, 6.12% 13sep2018, RUR | -/-/- | 13.09.18 | 980 | 86,52 | 11,98 |

*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 размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Дата oferty | 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 | | | | | Санкт-Петербург | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | Withdrawn/Ba1/BBB- | | | | | |
| Санкт-Петербург 38 | 25.11.10 | 19.11.15 | 51 | | 11,40 | 0,03 | 32 | | | |
| 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 | 302 | | 12,51 | 0,50 | 1 502 | 12,51 | 127,36 | 380 003 |
| Белгородская обл. 09 | 07.07.15 | 30.06.20 | 897 | | 13,04 | 0,00 | 4 | | | |
| Белгородская обл. 07 | 06.08.13 | 28.07.20 | | | | | | | | |
| Белгородская обл. 08 | 30.06.14 | 21.06.21 | 752 | | 13,43 | 0,01 | 14 | | | |
| 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 | 229 | | 10,80 | 0,05 | 120 | | | |
| 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 | 888 | | 12,30 | 0,22 | 289 | | | |
| Эмитент | | | | | Республика Коми | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/B1/BB | | | | | |
| Республика Коми, 35008 | 05.12.05 | 03.12.15 | 65 | | 12,03 | 4,04 | 8 166 | | | |
| Республика Коми, 32010 | 15.12.11 | 15.12.16 | | | | | | | | |
| Республика Коми, 35011 | 05.06.14 | 27.11.19 | | | | | | | | |
| Республика Коми, 35012 | 01.07.15 | 23.06.21 | | | | | | | | |
| Эмитент | | | | | Нижегородская область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/B1/BB | | | | | |
| Нижегородская обл. 34006 | 07.10.10 | 07.10.15 | | | | | | | | |
| Нижегородская обл. 34007 | 17.11.11 | 16.11.16 | 214 | | 12,14 | 26,08 | 52 953 | 12,14 | 193,19 | 392 256 |
| Нижегородская обл. 34008 | 29.08.12 | 29.08.17 | | | | | | | | |

29 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

| Выпуск | Дата начала размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Дата oferty | 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 | 1 103 | | 13,61 | 2,03 | 2 022 | | | |
| 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 | | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | |
| Красноярский кр. 34007 | 25.09.13 | 19.09.18 | | | | | | | | |
| Красноярский кр. 34008 | 26.05.14 | 08.07.18 | | | | | | | | |
| Красноярский кр. 34009 | 06.10.14 | 01.10.18 | 740 | | 12,30 | 0,08 | 78 | 12,30 | 1 375,56 | 1 388 051 |
| Красноярский кр. 34010 | 15.09.15 | 10.09.19 | 1 068 | | 13,10 | 186,39 | 185 548 | | | |
| 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 | 280 | | 12,51 | 0,87 | 2 000 | | | |
| МФ Волгогр.обл. 35003 | 21.05.13 | 14.06.18 | 521 | | 12,56 | 0,00 | 2 | 12,56 | 225,53 | 299 906 |
| МФ Волгогр.обл. 35004 | 08.10.13 | 01.11.18 | | | | | | | | |
| МФ Волгогр.обл.35005 | 19.06.14 | 13.07.19 | 729 | | 13,13 | 0,16 | 200 | | | |
| Эмитент | | | | | Липецкая область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | Withdrawn/-/BB | | | | | |
| Липецкая область, 34007 | 01.06.12 | 26.05.17 | 394 | | 12,31 | 0,39 | 1 000 | | | |
| Липецкая область, 34009 | 10.06.14 | 04.06.19 | 741 | | 12,37 | 14,94 | 16 986 | 12,37 | 340,35 | 388 469 |
| 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 | 228 | | 12,61 | 0,00 | 2 | | | |
| Эмитент | | | | | Республика Хакасия | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/-/BB | | | | | |
| Республика Хакасия, 35004 | 28.10.14 | 27.10.19 | 732 | | 13,18 | 0,03 | 25 | | | |
| Республика Хакасия, 35003 | 29.10.13 | 27.10.20 | 951 | | 12,66 | 0,01 | 10 | 12,66 | 87,05 | 95 866 |
| Эмитент | | | | | Департамент финансов Томской области | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | BB-/-- | | | | | |
| Томская область, 34045 | 20.12.12 | 19.12.17 | 535 | | 12,40 | 0,48 | 912 | 12,40 | 36,95 | 70 412 |
| Томская область, 34048 | 24.12.13 | 18.12.18 | 680 | | 12,33 | 0,00 | 3 | 12,33 | 113,46 | 120 001 |
| Эмитент | | | | | Министерство финансов Тверской области | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | Suspended/-/BB- | | | | | |
| МФ Тверской обл. 34007 | 21.12.10 | 15.12.15 | 77 | | 11,31 | 0,39 | 610 | | | |
| МФ Тверской обл. 34008 | 24.12.12 | 18.12.17 | | | | | | | | |
| МФ Тверской обл. 34009 | 28.11.13 | 22.11.18 | 437 | | 13,98 | 0,00 | 2 | | | |
| 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 | 411 | | 12,62 | 0,00 | 2 | 12,62 | 480,66 | 659 340 |
| Эмитент | | | | | Свердловская область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | BB-/-- | | | | | |
| Свердлов. область, 34001 | 13.12.11 | 11.12.16 | 419 | | 12,07 | 0,00 | 2 | 12,07 | 52,72 | 271 908 |
| Свердлов. область, 34002 | 05.12.12 | 04.12.17 | 409 | | 11,99 | 2,11 | 6 250 | | | |
| Эмитент | | | | | Министерство управления финансами Самарской области | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | BB/Ba3/- | | | | | |
| Самарская обл., 07 | 08.06.11 | 30.11.16 | 265 | | 11,52 | 0,00 | 1 | 11,52 | 40,64 | 138 971 |
| Самарская обл., 08 | 20.06.12 | 13.12.17 | | | | | | | | |
| Самарская обл., 09 | 09.08.13 | 31.07.20 | | | | | | | | |
| Самарская обл., 11 | 25.06.15 | 18.06.20 | | | | | | | | |
| Эмитент | | | | | Ярославская область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/-/BB | | | | | |
| Ярославская область, 34012 | 19.07.13 | 13.07.18 | | | | | | | | |

29 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

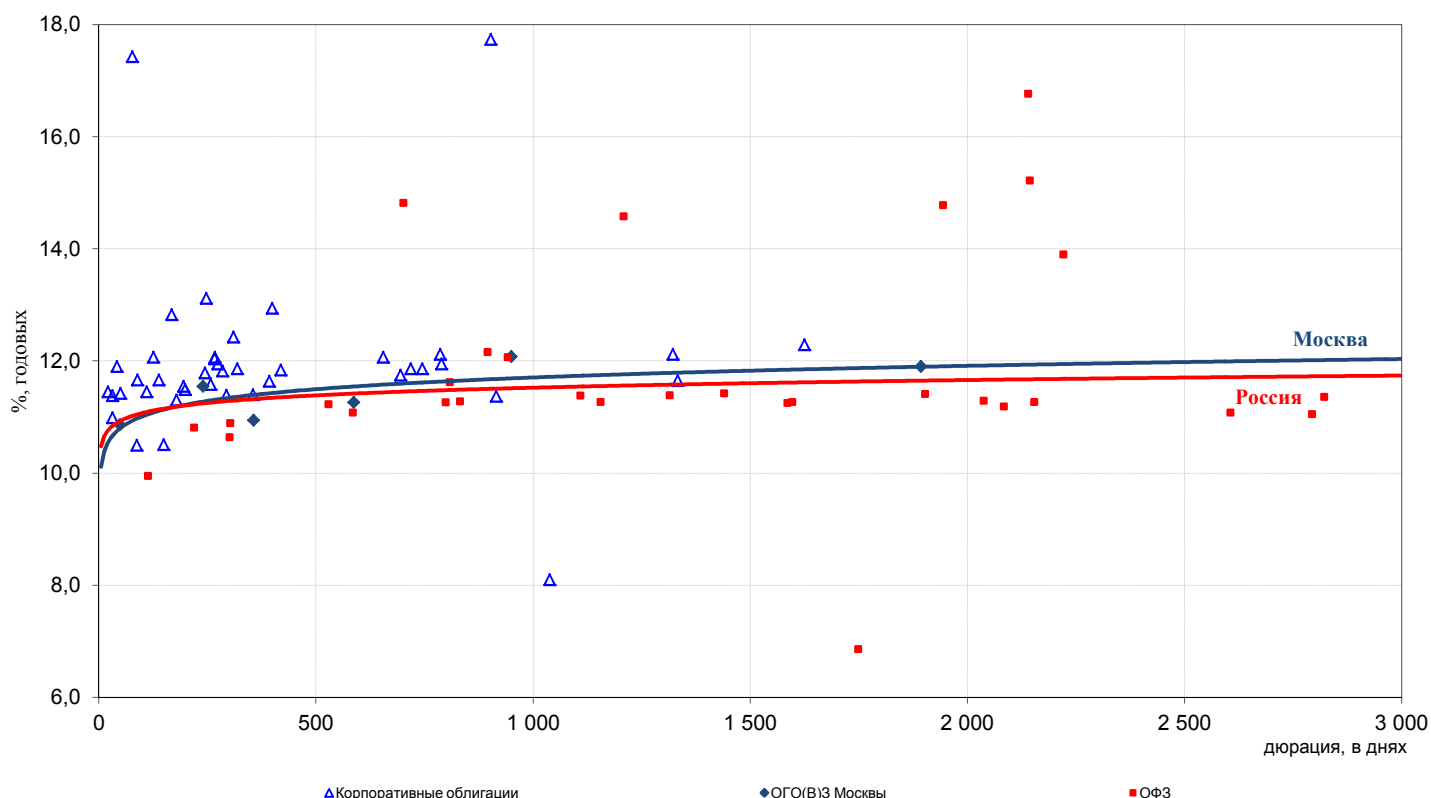
| Выпуск | Дата начала размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Дата oferty | Режим основных торгов | | | Режим переговорных сделок | | |
|--|------------------------|----------------|-----------------|-------------|---|-------------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------------|-------------------|
| | | | | | Средневзвешенная доходность, % год. | Объем торгов, млн. руб. | Кол-во бумаг, шт. | Средневзвешенная доходность, % год. | Объем торгов, млн. руб. | Кол-во бумаг, шт. |
| Эмитент | | | | | г. Краснодар - Администрация города | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/B1/- | | | | | |
| Админ. Краснодара 34002 | 10.11.11 | 05.11.15 | 37 | | 11,66 | 1,09 | 4 385 | | | |
| 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 | 1 267 | | 13,68 | 0,00 | 1 | 13,68 | 153,75 | 149 999 |
| Удмуртия, 35001 | 10.10.13 | 01.10.20 | 745 | | 12,12 | 0,00 | 2 | 12,12 | 699,75 | 756 483 |
| Эмитент | | | | | Краснодарский край | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | Withdrawn/B1/Withdrawn | | | | | |
| Краснодарский край, 34004 | 15.11.12 | 09.11.17 | 334 | | 12,30 | 0,20 | 526 | 12,30 | 265,64 | 681 484 |
| Эмитент | | | | | Республика Карелия | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/-/B+ | | | | | |
| Карелия 34014 | 02.12.11 | 30.11.16 | 402 | | 12,92 | 0,26 | 1 800 | | | |
| Карелия 34015 | 23.10.12 | 22.10.17 | | | | | | | | |
| 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 | 394 | | 12,83 | 0,08 | 1 056 | | | |
| Костромская область, 34007 | 04.10.13 | 28.09.18 | 582 | | 12,96 | 0,00 | 4 | | | |
| Эмитент | | | | | Тульская область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/-/BB | | | | | |
| Тульская 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 | 5 | | 11,32 | 0,06 | 148 | | | |
| Марий Эл, 34007 | 28.05.14 | 07.07.18 | 290 | | 12,78 | 0,01 | 12 | 12,78 | 29,87 | 30 079 |
| Эмитент | | | | | г. Волгоград | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/B2/- | | | | | |
| Волгоград 34005 | 23.12.10 | 17.12.15 | 79 | | 9,66 | 0,02 | 40 | | | |
| Волгоград 34006 | 29.08.12 | 23.08.17 | 430 | | 14,05 | 0,01 | 14 | | | |
| 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 | 182 | | 27,55 | 0,00 | 2 | | | |
| 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 | 213 | | 13,52 | 0,05 | 98 | | | |
| Вологодская область, 34003 | 11.12.12 | 05.12.17 | 386 | | 13,36 | 8,99 | 18 541 | | | |
| 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 | 622 | | 13,13 | 0,55 | 557 | | | |

29 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

| Выпуск | Дата начала размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Дата oferty | 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 | | | | | Смоленская область | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -/-B+ | | | | | |
| Смоленская область, 34001 | 21.10.13 | 20.10.18 | 555 | | 13,58 | 0,02 | 24 | | | |
| 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 | | | | | | | | |
| Воронежская обл., 34007 | 15.10.14 | 14.10.19 | 858 | | 13,22 | 0,43 | 518 | | | |
| Эмитент | | | | | Министерство финансов Республики Мордовия | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | -B2/- | | | | | |
| МФ Респ.Мордовия, 34001 | 28.10.13 | 22.10.18 | 652 | | 13,99 | 0,00 | 1 | | | |
| 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 | 661 | | 12,01 | 31,19 | 31 250 | | | |
| 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 | 763 | | 15,03 | 10,15 | 10 000 | | | |
| 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 размещения | Дата погашения | Дюрация, в днях | Дата oferty | 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 | | | | | 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 | 110 | | 11,45 | 1,98 | 2 001 | 11,45 | 208,98 | 210 768 |
| ВТБ, БО-22 | 19.02.13 | 16.02.16 | 138 | | 11,66 | 13,32 | 13 482 | | | |
| ВТБ 06 | 19.07.06 | 06.07.16 | | | | | | | | |
| ВТБ, БО-43 | 11.10.13 | 29.09.23 | 267 | 12.07.16 | 12,07 | 100,87 | 100 461 | 12,07 | 250,95 | 250 000 |
| 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 | 199 | 28.04.16 | 11,49 | 0,00 | 2 | 11,49 | 60,98 | 61 998 |
| 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 | | | | | | | | |
| 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 | 1 625 | | 12,29 | 0,52 | 610 | | | |
| 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 | | | | | | | | |

29 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 | 31 | | 11,38 | 0,26 | 257 | | | |
| АЛРОСА, БО-02 | 02.11.12 | 30.10.15 | 31 | | 10,99 | 1,69 | 1 688 | | | |
| 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 | | | | | | | | |
| 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 | 1 038 | 19.12.18 | 8,10 | 0,00 | 1 | 8,10 | 286,70 | 286 699 |
| 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 | 419 | | 11,84 | 0,01 | 10 | | | |
| Башнефть, 03 | 22.12.09 | 13.12.16 | | | | | | | | |
| Башнефть, 04 | 17.02.12 | 04.02.22 | | | | | | | | |
| Башнефть, 06 | 12.02.13 | 31.01.23 | 786 | 12.02.18 | 12,12 | 6,82 | 7 278 | | | |
| Башнефть, 07 | 12.02.13 | 31.01.23 | | | | | | | | |
| Башнефть, 08 | 12.02.13 | 31.01.23 | | | | | | | | |
| Башнефть, 09 | 12.02.13 | 31.01.23 | 1 322 | 10.02.20 | 12,12 | 0,23 | 251 | 12,12 | 270,75 | 299 999 |
| 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 | 355 | | 11,40 | 164,21 | 169 170 | | | |
| Газпромбанк, БО-07 | 22.10.13 | 22.10.16 | | | | | | | | |
| Газпромбанк, 06 | 12.07.12 | 07.07.16 | 274 | | 11,95 | 0,01 | 6 | | | |
| Газпромбанк, 07 | 22.10.12 | 17.10.16 | | | | | | | | |
| Газпромбанк, БО-09 | 27.06.14 | 27.06.17 | 89 | 29.12.15 | 11,66 | 0,10 | 100 | | | |

29 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 | 179 | 29.03.16 | 11,30 | 0,01 | 6 | 11,30 | 5 459,65 | 5 459 654 |
| 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 | 168 | | 12,83 | 1,93 | 25 585 | | | |
| АФК Система, 03 | 03.12.09 | 24.11.16 | 399 | | 12,94 | 20,24 | 21 079 | | | |
| АФК Система, БО-01 | 19.02.15 | 31.01.30 | 310 | 22.08.16 | 12,43 | 2,81 | 2 700 | | | |
| Эмитент | | | | | ОАО "АЛЬФА-БАНК" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | BB/Ba2/BB+ | | | | | |
| Альфа-Банк, 01 | 08.02.11 | 02.02.16 | 126 | | 12,07 | 0,00 | 1 | 12,07 | 212,31 | 214 999 |
| Альфа-Банк, БО-08 | 26.02.13 | 26.02.16 | | | | | | | | |
| Альфа-Банк, БО-09 | 20.08.13 | 20.08.16 | 319 | | 11,86 | 3,70 | 3 800 | | | |
| 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 | 247 | 14.06.16 | 13,12 | 0,01 | 14 | | | |
| Альфа-Банк, БО-13 | 18.09.14 | 30.08.29 | | | | | | | | |
| Альфа-Банк, БО-14 | 18.09.14 | 30.08.29 | | | | | | | | |
| Альфа-Банк, БО-15 | 02.12.14 | 13.11.29 | | | | | | | | |
| Эмитент | | | | | ОАО "Российские железные дороги" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) | | | | | BB+/Ba1/BBB- | | | | | |
| РЖД, 11 | 26.11.08 | 18.11.15 | 50 | | 11,42 | 2,42 | 2 427 | | | |
| РЖД, 15 | 29.06.09 | 20.06.16 | 258 | | 11,58 | 0,00 | 1 | 11,58 | 701,65 | 716 995 |
| РЖД, 16 | 15.06.09 | 05.06.17 | 244 | 08.06.16 | 11,79 | 109,01 | 111 600 | 11,79 | 9,77 | 10 000 |
| РЖД, 17 | 27.07.09 | 16.07.18 | 745 | 17.01.18 | 11,86 | 2,01 | 2 010 | | | |
| РЖД, 12 | 28.05.09 | 16.05.19 | 393 | 21.11.16 | 11,64 | 5,43 | 5 600 | | | |
| РЖД, 18 | 27.07.09 | 15.07.19 | 285 | 20.07.16 | 11,82 | 0,15 | 150 | | | |
| РЖД, 19 | 27.07.09 | 08.07.24 | 915 | 18.07.18 | 11,37 | 0,04 | 39 | | | |
| РЖД, 23 | 04.02.10 | 16.01.25 | | | | | | | | |
| РЖД, 28 | 09.04.13 | 21.03.28 | 1 333 | 03.04.20 | 11,65 | 9,02 | 10 108 | | | |
| 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, 35 | 01.07.15 | 30.05.40 | | | | | | | | |
| 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 | 21 | | 11,45 | 17,71 | 17 750 | | | |
| МТС, 05 | 28.07.09 | 19.07.16 | 294 | | 11,39 | 0,98 | 1 000 | | | |
| МТС, 07 | 16.11.10 | 07.11.17 | 695 | | 11,75 | 0,01 | 9 | | | |
| МТС, 03 | 24.06.08 | 12.06.18 | 77 | 17.12.15 | 17,43 | 0,01 | 7 | | | |
| МТС, 08 | 16.11.10 | 03.11.20 | 42 | 12.11.15 | 11,90 | 33,66 | 33 789 | | | |
| МТС, БО-01 | 03.04.13 | 22.03.23 | | | | | | | | |

ИНДЕКСЫ РЫНКА СУБФЕДЕРАЛЬНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

| Наименование индекса | 29.09.15 | 28.09.15 | 25.09.15 | 24.09.15 | 23.09.15 |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|
| Средневзвешенная доходность Индекса MosBonds, % | 11,57 | 11,63 | 11,69 | 11,84 | 11,72 |
| Ценовой Индекс MosBonds | 89,11 | 88,98 | 89,13 | 88,74 | 89,07 |
| Средневзвешенная дюрация Индекса MosBonds, дней | 794 | 792 | 801 | 797 | 802 |
| Cbonds-Muni средневзвешенная доходность (эфф.), % | 12,07 | 12,09 | 12,12 | 12,28 | 12,11 |
| Cbonds-Muni ценовой | 94,20 | 94,15 | 94,08 | 93,81 | 94,08 |
| Cbonds-Muni дюрация инд. портфеля, дней | 738 | 739 | 745 | 743 | 747 |

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

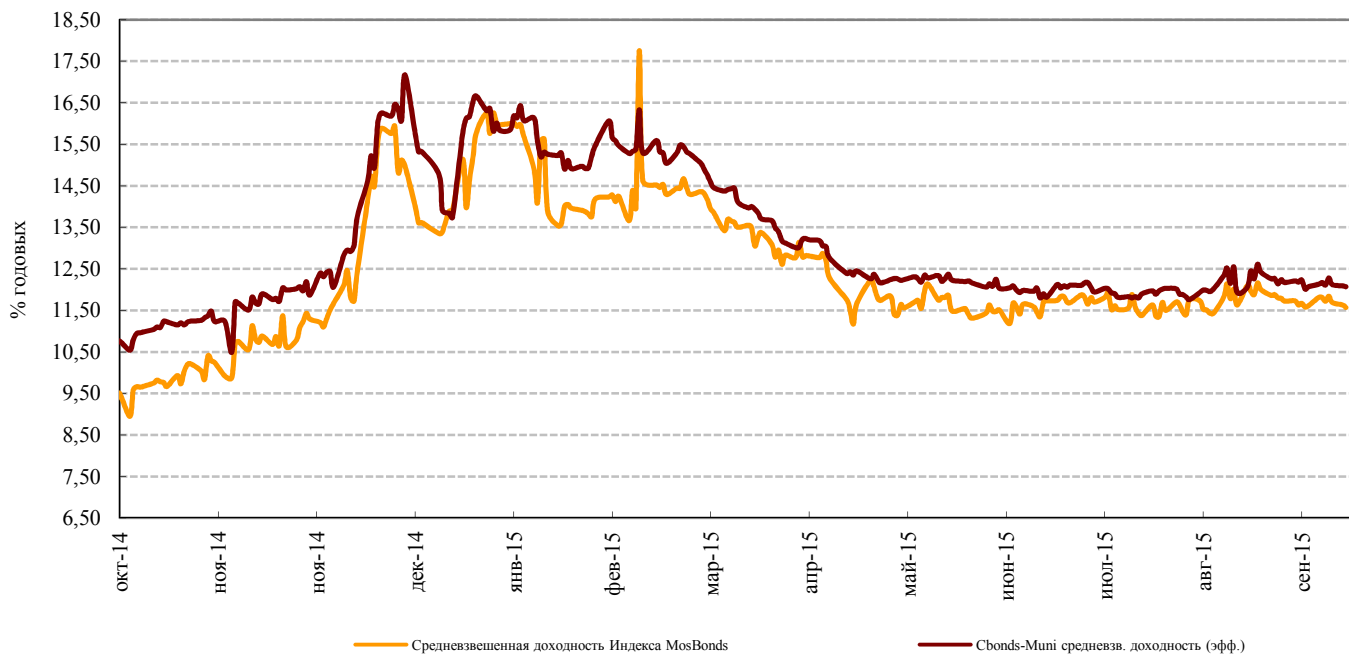
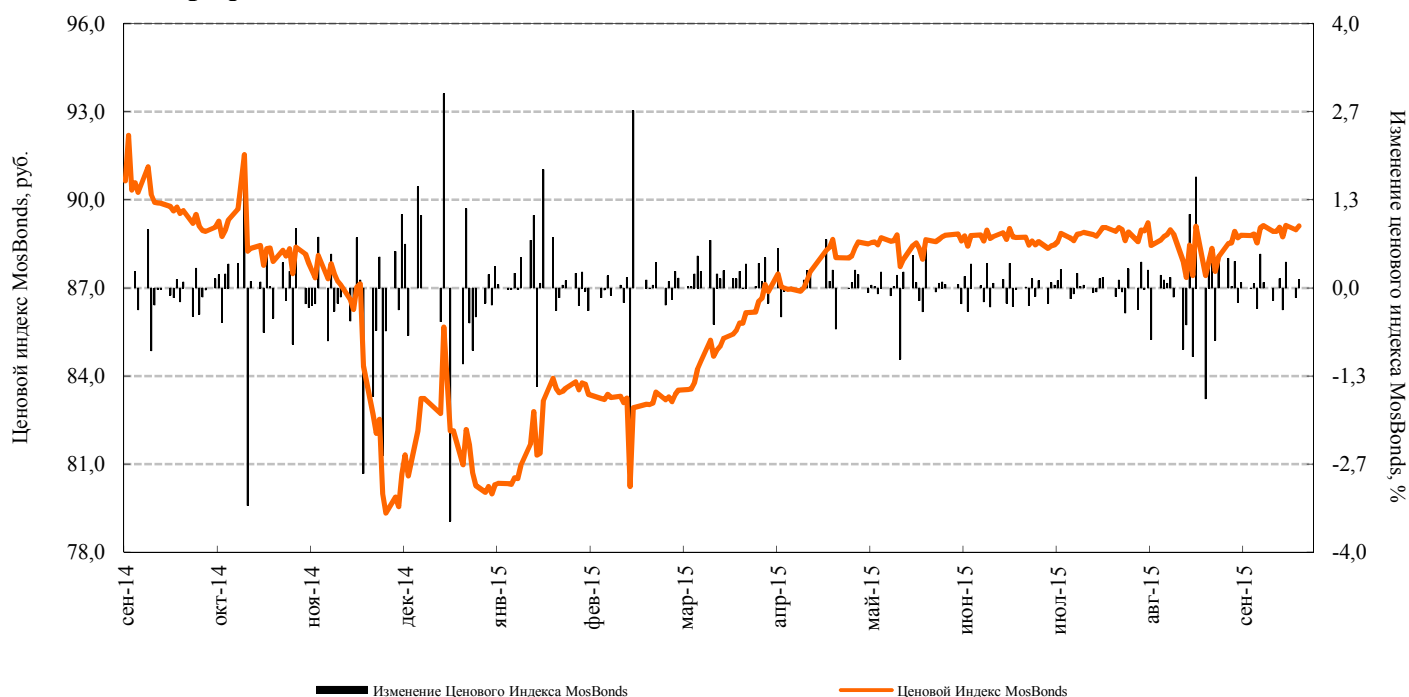
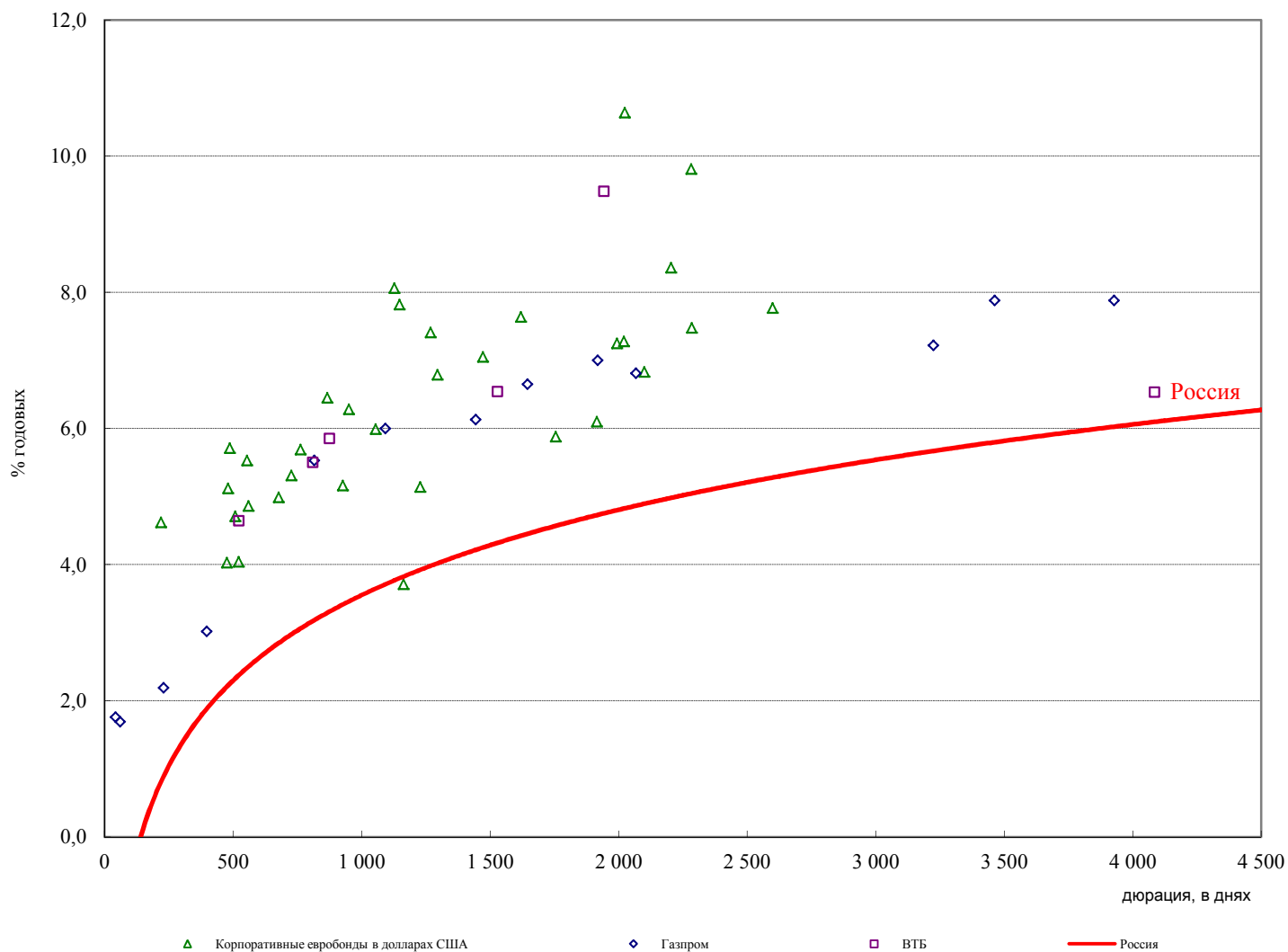


График 5. Динамика ценового индекса MosBonds и его изменения



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*

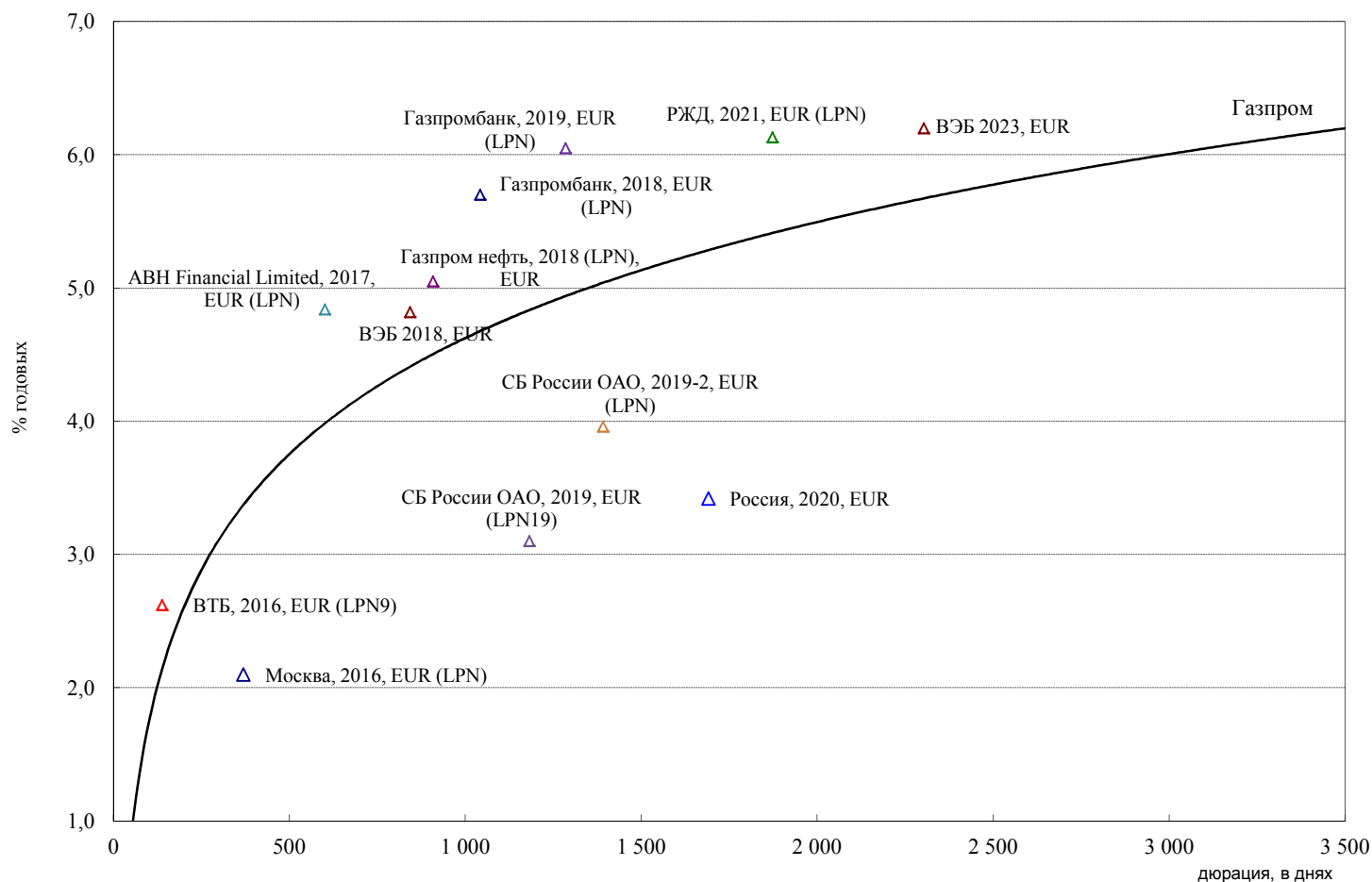
| Выпуск | Дата погашения | Дюрация, в днях | Индикативная цена | Средневзвешенная доходность, % годовых | Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых | Изменение |
|---|----------------|-----------------|-------------------|--|---|-----------|
| ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ | | | | | | |
| Эмитент <i>Российская Федерация</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB+/Ba1/BBB-</i> | | | | | | |
| Россия, 2017 | 04.04.17 | 528 | 100,69 | 2,80 | 2,88 | -0,08 |
| Россия, 2018 | 24.07.18 | 898 | 120,36 | 3,40 | 3,40 | 0,00 |
| Россия, 2019 | 16.09.19 | 1 124 | 99,95 | 3,55 | 3,54 | 0,01 |
| Россия, 2020 | 29.04.20 | 1 469 | 103,22 | 4,26 | 4,22 | 0,04 |
| Россия, 2022 | 04.04.22 | 2 013 | 99,25 | 4,69 | 4,67 | 0,02 |
| Россия, 2023 | 16.09.23 | 2 405 | 99,53 | 5,01 | 5,02 | -0,01 |
| Россия, 2028 | 24.06.28 | 2 760 | 156,83 | 6,32 | 6,34 | -0,02 |
| Россия, 2030 | 31.03.30 | 1 494 | 117,79 | 3,42 | 3,40 | 0,02 |
| Россия, 2042 | 04.04.42 | 4 738 | 91,94 | 6,35 | 6,32 | 0,03 |
| Россия, 2043 | 16.09.43 | 4 918 | 94,78 | 6,37 | 6,36 | 0,01 |
| КОРПОРАТИВНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ | | | | | | |
| Эмитент <i>ОАО "АЛЬФА-БАНК"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB/Ba2/BB+</i> | | | | | | |
| Альфа-Банк, 2017 (LPN, Step Up) | 22.02.17 | 487 | 100,88 | 5,71 | 5,78 | -0,07 |
| Альфа-Банк, 2017-2 (LPN) | 25.09.17 | 677 | 105,51 | 4,99 | 4,99 | 0,00 |
| Альфа-Банк, 2019 (LPN) | 26.09.19 | 1 268 | 100,75 | 7,41 | 7,41 | 0,00 |
| Альфа-Банк, 2021 (LPN) | 28.04.21 | 1 619 | 101,13 | 7,64 | 7,60 | 0,04 |
| Альфа-Банк, 2025 (LPN) | 18.02.25 | 2 282 | 99,50 | 9,81 | 9,81 | 0,00 |
| Эмитент <i>ОАО АФК "Система"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB/B1/BB-</i> | | | | | | |
| АФК Система, 2019 (LPN) | 17.05.19 | 1 147 | 97,73 | 7,82 | 7,70 | 0,12 |
| Эмитент <i>ОАО Банк ВТБ</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB+/Ba2/Withdrawn</i> | | | | | | |
| ВТБ, 2017 (LPN) | 12.04.17 | 523 | 102,07 | 4,64 | 4,56 | 0,08 |
| ВТБ, 2018-2 (LPN) | 22.02.18 | 810 | 101,98 | 5,50 | 5,47 | 0,03 |
| ВТБ, 2018 (LPN14) | 29.05.18 | 875 | 102,67 | 5,85 | 5,71 | 0,14 |
| ВТБ, 2020 (LPN) | 13.10.20 | 1 529 | 100,50 | 6,54 | 6,54 | 0,00 |
| ВТБ, 2022 (LPN) | 17.10.22 | 1 943 | 88,21 | 9,48 | 9,39 | 0,09 |
| ВТБ, 2035 (LPN6) | 30.06.35 | 4 085 | 98,00 | 6,53 | 6,37 | 0,16 |
| Эмитент <i>Внешэкономбанк</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB+/Ba1/BBB-</i> | | | | | | |
| Внешэкономбанк, 2017-2 (LPN) | 13.02.17 | 480 | 100,41 | 5,12 | 5,06 | 0,06 |
| Внешэкономбанк, 2017 (LPN) | 22.11.17 | 727 | 100,41 | 5,31 | 5,33 | -0,02 |
| Внешэкономбанк, 2018 (LPN) | 21.11.18 | 1 054 | 95,25 | 5,99 | 6,07 | -0,08 |
| Внешэкономбанк, 2020 (LPN) | 09.07.20 | 1 472 | 99,86 | 7,05 | 7,08 | -0,03 |
| Внешэкономбанк, 2022 (LPN) | 05.07.22 | 1 993 | 94,19 | 7,25 | 7,46 | -0,21 |
| Внешэкономбанк, 2023 (LPN) | 21.11.23 | 2 284 | 91,50 | 7,48 | 7,56 | -0,08 |
| Внешэкономбанк, 2025 (LPN) | 22.11.25 | 2 599 | 94,25 | 7,77 | 7,82 | -0,05 |
| Эмитент <i>ОАО "Газпром"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch) <i>BB+/Ba1/BBB-</i> | | | | | | |
| Газпром, 2015-4 (LPN36) | 12.11.15 | 43 | 100,30 | 1,76 | 1,79 | -0,03 |
| Газпром, 2015-3 (LPN23) | 29.11.15 | 60 | 100,56 | 1,69 | 1,61 | 0,08 |
| Газпром, 2016-2 (LPN24) | 23.05.16 | 230 | 101,78 | 2,19 | 2,16 | 0,03 |
| Газпром, 2016 (LPN7) | 22.11.16 | 397 | 103,59 | 3,02 | 3,08 | -0,06 |
| Газпром, 2018-2 (LPN17) | 11.04.18 | 816 | 106,28 | 5,53 | 5,34 | 0,19 |
| Газпром, 2019 (LPN20) | 23.04.19 | 1 093 | 110,59 | 6,00 | 5,90 | 0,10 |
| Газпром, 2020 (LPN28) | 06.02.20 | 1 443 | 91,72 | 6,13 | 6,07 | 0,06 |
| Газпром, 2021 (LPN25) | 23.01.21 | 1 645 | 97,58 | 6,65 | 6,65 | 0,00 |
| Газпром, 2022 (LPN9) | 07.03.22 | 1 918 | 98,08 | 7,00 | 6,98 | 0,02 |

*торги на внебиржевом рынке

| Выпуск | Дата погашения | Дюрация, в днях | Индикативная цена | Средневзвешенная доходность, % годовых | Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых | Изменение |
|---|---|-----------------|-------------------|--|---|-----------|
| Газпром, 2022-2 (LPN) | 19.07.22 | 2 067 | 90,56 | 6,81 | 6,81 | 0,00 |
| Газпром, 2028 (LPN29) | 06.02.28 | 3 225 | 82,53 | 7,22 | 7,21 | 0,01 |
| Газпром, 2034 (LPN2) | 28.04.34 | 3 463 | 108,78 | 7,88 | 7,84 | 0,04 |
| Газпром, 2037 (LPN12) | 16.08.37 | 3 927 | 95,33 | 7,88 | 7,85 | 0,03 |
| Эмитент | Газпромбанк (Открытое акционерное общество) | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba2/BB+ | | | | | |
| Газпромбанк, 2016 (LPN) | 08.05.16 | 219 | 101,56 | 4,62 | 4,53 | 0,09 |
| Газпромбанк, 2017 (LPN) | 17.05.17 | 559 | 101,27 | 4,86 | 4,88 | -0,02 |
| Газпромбанк, 2018 (LPN12) | 21.11.18 | - | - | - | - | - |
| Газпромбанк, 2019 (LPN) | 03.05.19 | 1 127 | 97,98 | 8,06 | 8,01 | 0,05 |
| Газпромбанк, 2019 (LPN) | 05.09.19 | 1 295 | 94,15 | 6,79 | 6,74 | 0,05 |
| Газпромбанк, 2023* | 28.12.18 | 1 025 | 83,28 | 14,57 | 14,53 | 0,04 |
| Эмитент | ОАО "Нефтяная компания "Роснефть" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba1/Withdrawn | | | | | |
| Роснефть, 2017 (LPN) | 06.03.17 | 509 | 97,92 | 4,71 | 4,54 | 0,17 |
| Роснефть, 2022 (LPN) | 06.03.22 | 2 021 | 84,98 | 7,28 | 7,24 | 0,04 |
| Эмитент | ОАО "Россельхозбанк" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | -/Ba2/BB+ | | | | | |
| Россельхозбанк, 2017 (LPN2) | 15.05.17 | 554 | 101,28 | 5,53 | 5,60 | -0,07 |
| Россельхозбанк, 2017-2 (LPN) | 27.12.17 | 763 | 99,34 | 5,69 | 5,69 | 0,00 |
| Россельхозбанк, 2018 (LPN3B) | 29.05.18 | 866 | 103,38 | 6,45 | 6,44 | 0,01 |
| Россельхозбанк, 2021 (LPN)* | 03.06.16 | 238 | 90,06 | 23,84 | 23,56 | 0,28 |
| Россельхозбанк, 2018-2 (LPN) | 25.07.18 | 950 | 97,23 | 6,28 | 6,34 | -0,06 |
| Россельхозбанк, 2023 (LPN) | 16.10.23 | 2 024 | 89,93 | 10,64 | 10,63 | 0,01 |
| Эмитент | ОАО "Сбербанк России" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | -/Ba2/BBB- | | | | | |
| СБ России ОАО, 2017-2 (LPN) | 07.02.17 | 475 | 101,25 | 4,03 | 4,10 | -0,07 |
| СБ России ОАО, 2017 (LPN) | 24.03.17 | 521 | 102,00 | 4,04 | 4,10 | -0,06 |
| СБ России ОАО, 2023 (LPN) | 23.05.18 | 2 204 | 83,50 | 8,36 | 8,29 | 0,07 |
| СБ России ОАО, 2019-2 (LPN18) | 06.03.19 | 1 163 | 101,50 | 3,71 | 3,73 | -0,02 |
| СБ России ОАО, 2019 (LPN) | 28.06.19 | 1 228 | 100,33 | 5,14 | 5,11 | 0,03 |
| СБ России ОАО, 2021 (LPN) | 16.06.21 | 1 755 | 99,63 | 5,88 | 5,92 | -0,04 |
| СБ России ОАО, 2022 (LPN) | 07.02.22 | 1 914 | 100,59 | 6,10 | 6,13 | -0,03 |
| СБ России ОАО, 2022-2 (LPN) | 29.10.22 | 2 100 | 91,12 | 6,83 | 6,88 | -0,05 |
| СБ России ОАО, 2024 (LPN)* | 26.02.19 | 1 119 | 83,58 | 11,78 | 11,59 | 0,19 |
| Эмитент | ОАО "Акционерная компания по транспорту нефти "Транснефть" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba1/- | | | | | |
| Транснефть, 2018 (LPN) | 07.08.18 | 927 | 109,45 | 5,16 | 5,10 | 0,06 |

*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 | Дюрация, 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 | 1 691 | 100,93 | 3,42 | 3,49 | -0,07 |
| СУБФЕДЕРАЛЬНЫЕ И МУНИЦИПАЛЬНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ | | | | | | |
| Эмитент | Правительство Москвы | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba1/BBB- | | | | | |
| Москва, 2016, EUR (LPN) | 20.10.16 | 370 | 103,07 | 2,10 | 2,06 | 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 | 139 | 100,60 | 2,62 | 2,61 | 0,01 |
| Эмитент | Внешэкономбанк | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba1/BBB- | | | | | |
| ВЭБ 2018, EUR | 21.02.18 | 843 | 96,05 | 4,82 | 4,85 | -0,03 |
| ВЭБ 2023, EUR | 21.02.23 | 2 303 | 87,48 | 6,20 | 6,20 | 0,00 |
| Эмитент | ОАО "Российские железные дороги" | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | BB+/Ba1/BBB- | | | | | |
| РЖД, 2021, EUR (LPN) | 20.05.21 | 1 873 | 87,17 | 6,13 | 6,05 | 0,08 |

*торги на внебиржевом рынке

| Выпуск | Дата погашения | Дюрация, в днях | Индикативная цена | Средневзвешенная доходность, % годовых | Предыдущая средневзвешенная доходность, % годовых | Изменение |
|--|----------------|-----------------|-------------------|--|---|-----------|
| Эмитент | | | | | | |
| <i>ОАО "Газпром нефть"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | | | | | | |
| <i>BB+/Ba1/BBB-</i> | | | | | | |
| Газпром нефть, 2018 (LPN), EUR | 26.04.18 | 908 | 95,03 | 5,05 | 5,03 | 0,02 |
| Эмитент | | | | | | |
| <i>Газпромбанк (Открытое акционерное общество)</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | | | | | | |
| <i>BB+/Ba2/BB+</i> | | | | | | |
| Газпромбанк, 2018, EUR (LPN) | 30.10.18 | 1 042 | 95,30 | 5,70 | 5,57 | 0,13 |
| Газпромбанк, 2019, EUR (LPN) | 01.07.19 | 1 285 | 93,30 | 6,05 | 5,99 | 0,06 |
| Эмитент | | | | | | |
| <i>ОАО "Газпром"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | | | | | | |
| <i>BB+/Ba1/BBB-</i> | | | | | | |
| Газпром, 2017-3, EUR (LPN) | 15.03.17 | 520 | 99,98 | 3,77 | 3,69 | 0,08 |
| Газпром, 2017, EUR (LPN6) | 22.03.17 | 522 | 102,12 | 3,63 | 3,64 | -0,01 |
| Газпром, 2017-2, EUR (LPN8) | 02.11.17 | 711 | 102,90 | 3,97 | 3,97 | 0,00 |
| Газпром, 2018, EUR (LPN13) | 13.02.18 | 803 | 104,57 | 4,53 | 4,54 | -0,01 |
| Газпром, 2018-3 (LPN32), EUR | 27.07.18 | 991 | 97,43 | 4,70 | 4,63 | 0,07 |
| Газпром, 2020 (LPN), EUR | 20.03.20 | 1 512 | 92,19 | 5,41 | 5,39 | 0,02 |
| Газпром, 2021 (LPN35), EUR | 26.02.21 | 1 783 | 90,35 | 5,73 | 5,74 | -0,01 |
| Газпром, 2025 (LPN), EUR | 21.03.25 | 2 814 | 92,23 | 5,44 | 5,43 | 0,01 |
| Эмитент | | | | | | |
| <i>ОАО "Сбербанк России"</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | | | | | | |
| <i>-/Ba2/BBB-</i> | | | | | | |
| СБ России ОАО, 2019, EUR (LPN19) | 07.03.19 | 1 182 | 100,00 | 3,10 | 3,10 | 0,00 |
| СБ России ОАО, 2019-2, EUR (LPN) | 15.11.19 | 1 392 | 97,74 | 3,96 | 4,02 | -0,06 |
| Эмитент | | | | | | |
| <i>ABH Financial Limited</i> | | | | | | |
| Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch) | | | | | | |
| <i>-/-/BB</i> | | | | | | |
| ABH Financial Limited, 2017, EUR (LPN) | 10.06.17 | 601 | 101,03 | 4,84 | 4,84 | 0,00 |

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

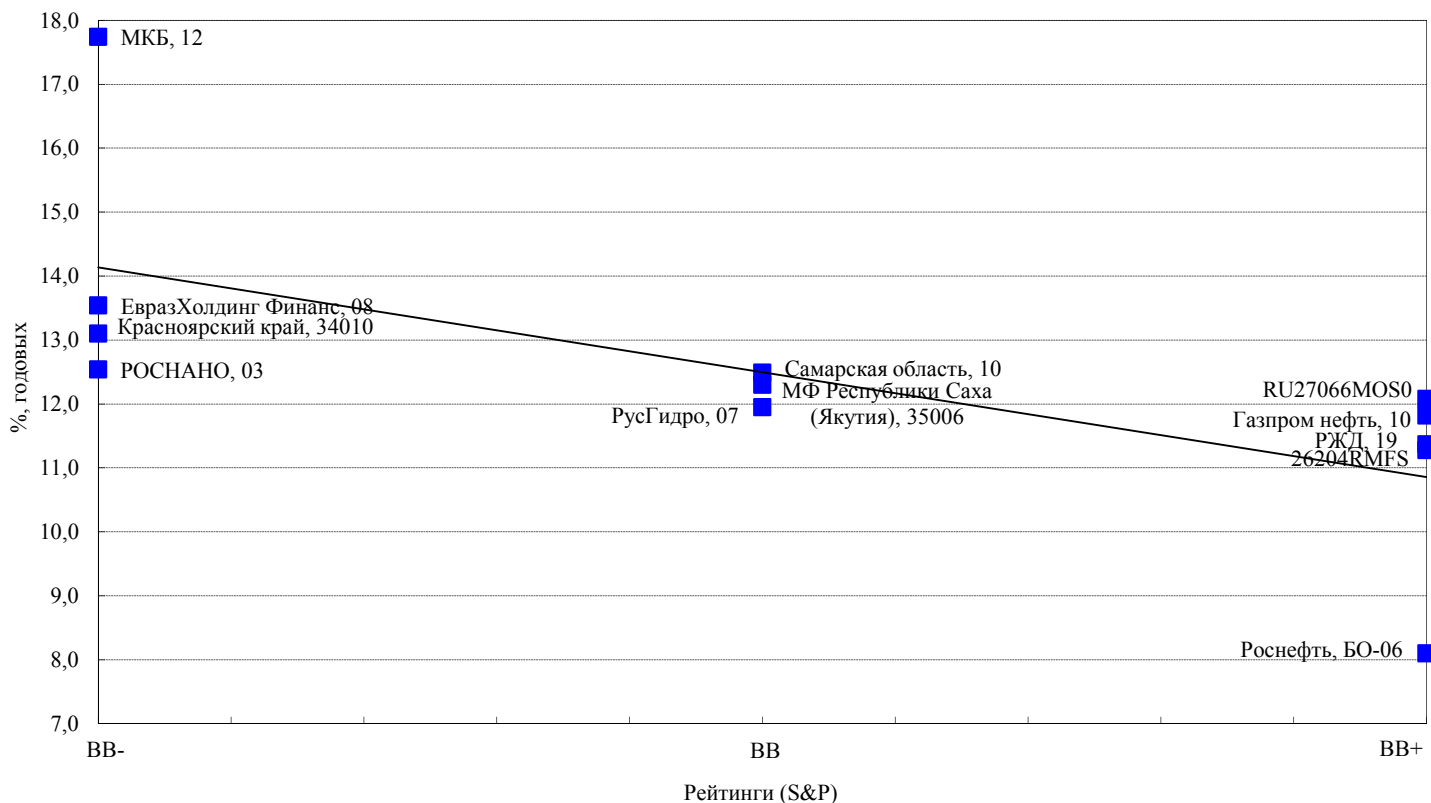


График 9. Уровни доходности на внутреннем рынке облигаций

