

Ежедневный информационно-аналитический обзор

за 28 сентября 2015 года

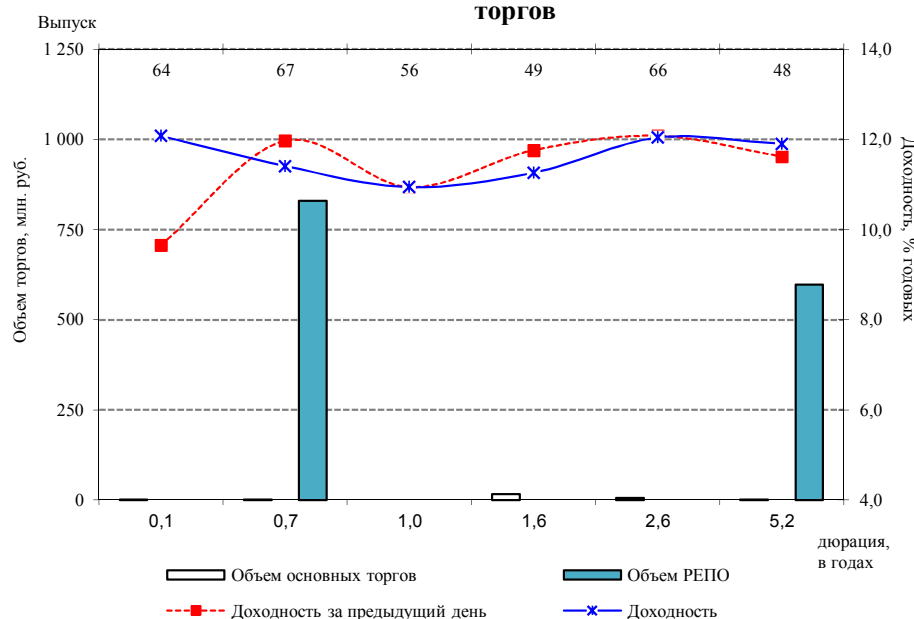
<i>Рынок ОГО(В)З Москвы (в сопоставлении с ключевыми инструментами внутреннего рынка облигаций).....</i>	<i>2</i>
<i>Ключевые рыночные факторы ОГО(В)З Москвы (денежный, валютный, фондовый, товарные рынки, а также рынок внешнего долга).....</i>	<i>4</i>
<i>Первичный рынок (итоги размещений и планируемые 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>

29 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	0,1	12,08	2,42	25077RMFS	20.01.16	0,3	10,20	0,29	188
RU25067MOS0	01.06.16	0,7	11,41	-0,56	25082RMFS	11.05.16	0,6	10,88	0,43	53
RU32056MOS0	22.09.16	1,0	10,94	0,00	26203RMFS	03.08.16	0,8	10,84	-0,01	10
RU32049MOS0	14.06.17	1,6	11,26	-0,50	26206RMFS	14.06.17	1,6	11,23	0,05	3
RU27066MOS0	23.11.18	2,6	12,04	-0,04	24018RMFS	27.12.17	1,9	14,84	0,01	-280
RU32048MOS0	11.06.22	5,2	11,90	0,28	26209RMFS	20.07.22	5,2	11,15	-0,10	75
					26211RMFS	25.01.23	5,6	11,25	0,05	65

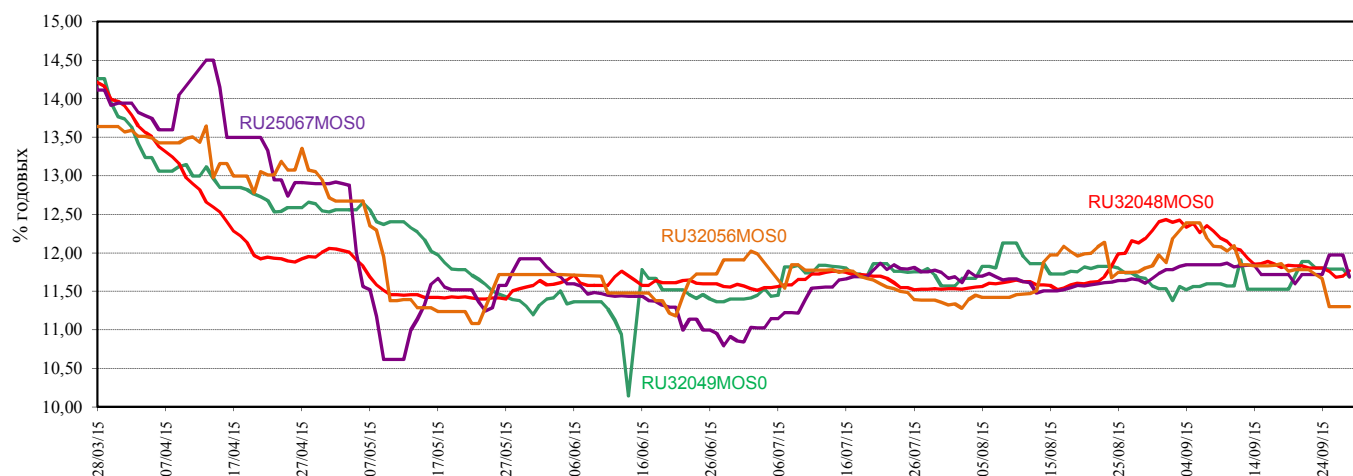
График 1. Кривые доходности ОГО(В)З Москвы и объемы торгов



Объем торгов на ММВБ, млн. руб.	ОГО(В)З Москвы	ОФЗ
режим основных торгов	23	1 876
РПС	0	8 532
РЕПО	1 427	19 115

Дата	Средневзвешенная доходность рынка ОГО(В)З, % годовых
24 сен 15	11,85
25 сен 15	11,66
28 сен 15	11,76

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



На графике построены линии тренда

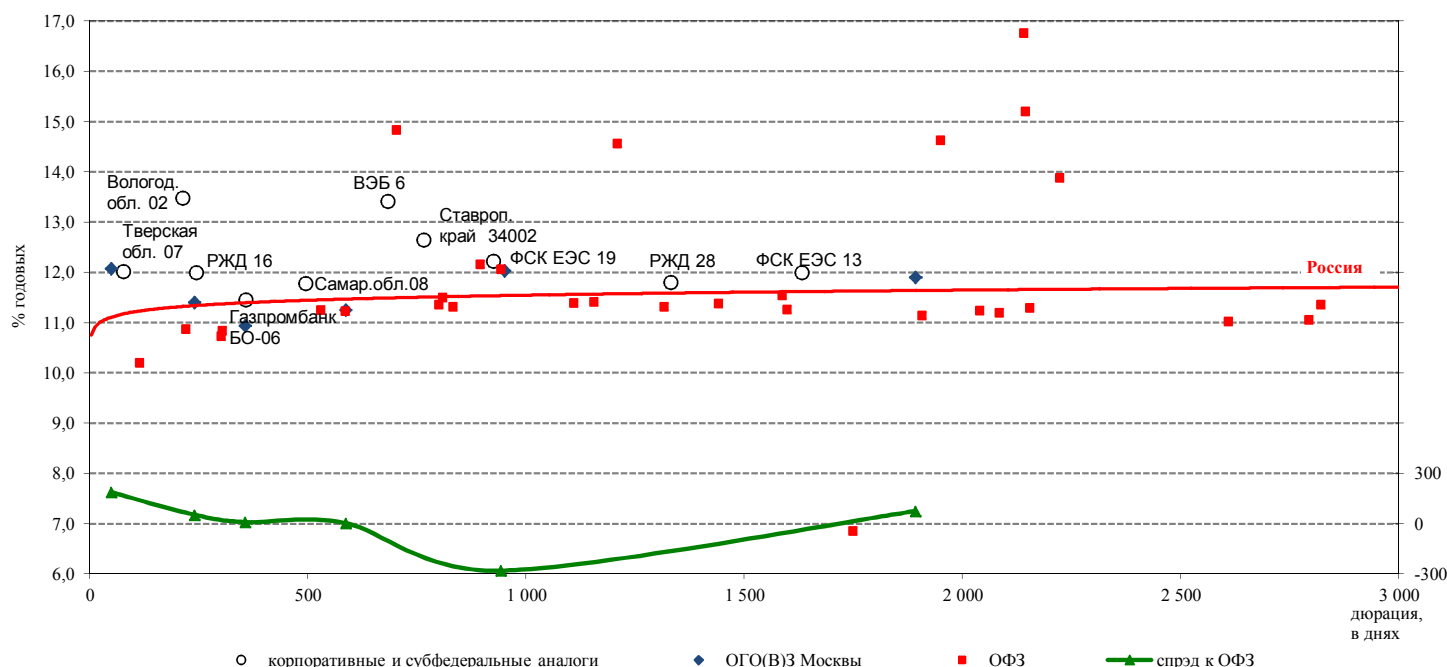
* В случае отсутствия торгов за отчетную дату, средневзвешенная доходность принимается равной последней установленной по данному выпуску

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	12,01	0,05	3,33	-
Вологодская область, 34002	Withdrawn/B2/Withdrawn	14.12.16	0,6	13,47	0,12	5,41	-
РЖД, 16	BB+/Ba1/BBB-	05.06.17	0,7	11,99	0,24	2,68	-
Газпромбанк, БО-06	BB+/Ba2/BB+	25.09.16	1,0	11,45	0,00	-	-
Самарская обл., 08	BB/Ba3/-	13.12.17	1,4	11,77	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	11,80	0,19	8,87	-
ФСК ЕЭС, 13	BB+/Ba1/BBB-	22.06.21	4,5	11,99	0,00	-	-

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 кривая доходностей ОФЗ 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	100,22	12,08	49
RU25067MOS0	05.06.13	01.06.16	96,96	11,41	241
RU32056MOS0	22.09.08	22.09.16	96,00	11,72	354
RU32049MOS0	14.12.06	14.06.17	93,94	11,26	587
RU27066MOS0	23.11.09	23.11.18	105,06	12,04	951
RU32048MOS0	11.12.06	11.06.22	76,46	11,90	1 893

* 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

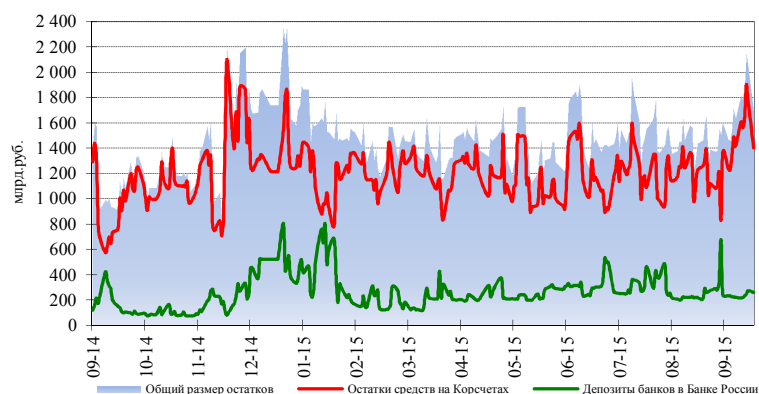


График 5. Уровень ставок MosPrime

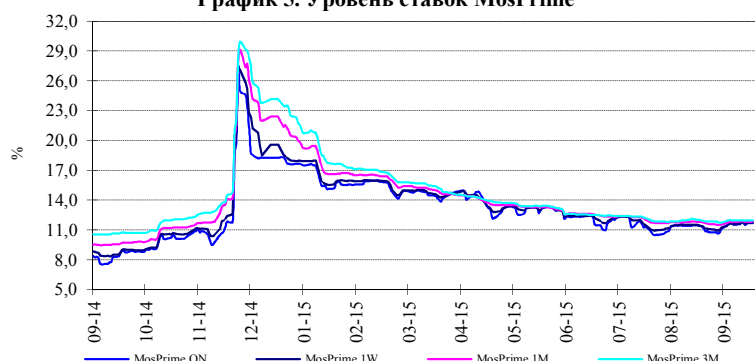


График 6. Динамика официального курса доллара США, Евро и бивалютной корзины Банка России

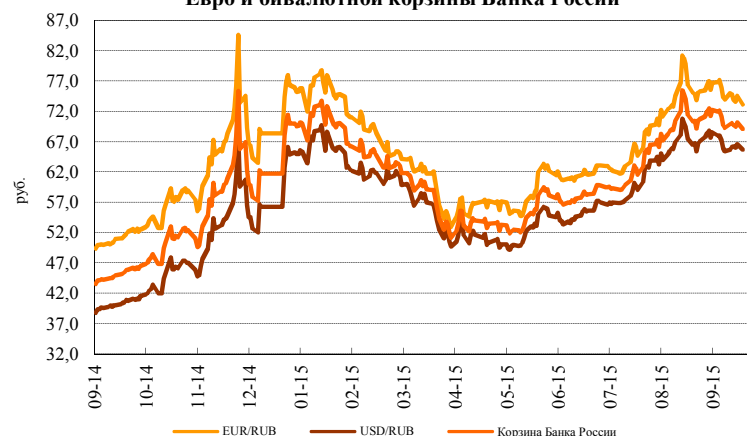
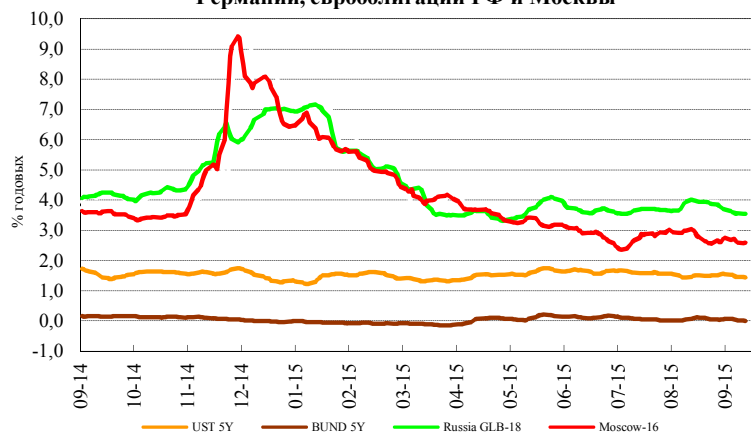


График 7. Динамика доходности гособлигаций США и Германии, еврооблигаций РФ и Москвы



Ключевые фиксированные процентные ставки Банка России

	28.09.15	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

	28.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
Корсчета, млрд. руб.	1 401,30	-20,90	-12,64	14,93
Депозиты в Банке России, млрд. руб.	259,70	-4,91	19,68	18,29
MosPrime ON, %	11,68	0,00	0,86	1,83
MosPrime 1M, %	11,83	0,08	0,00	0,08
MosPrime 3M, %	11,95	0,00	-0,17	-0,75
Libor ON, %	0,13	0,00	-0,74	0,75
Libor 1M, %	0,19	-0,36	-0,72	-2,49
Libor 3M, %	0,33	0,15	0,18	-0,73
Libor 1Y, %	0,85	-0,70	1,91	1,37
NDF 1M, %	11,67	-0,04	0,43	-1,60
NDF 3M, %	11,88	-0,54	-1,70	-6,31
NDF 12M, %	11,91	0,21	-2,54	-5,85

Валютный рынок

	28.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
EUR/USD	1,1177	0,08	-0,70	-0,74
	29.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
EUR/RUB	73,2684	0,18	-2,09	-2,37
USD/RUB	65,5470	-0,19	-0,90	-1,40
Бивалютная корзина Банка России	69,0216	-0,02	-1,47	-1,87

Индексы фондового рынка

	28.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
MICEX	1 616,36	-1,42	-4,90	-5,98
RTS	775,73	-1,63	-4,09	-6,53
S&P 500	1 881,77	-2,57	-4,33	-5,38
DJ	16 001,89	-1,92	-3,08	-3,08
DAX	9 483,55	-2,12	-4,67	-7,91
Hang Seng	21 186,32	0,00	-2,62	-1,97
Bovespa	43 956,63	-1,95	-5,65	-6,78
Nikkei 225	17 645,11	-1,32	-2,35	-7,79
Shanghai Composite	3 100,76	0,27	-1,77	-4,07

Рынок внешнего долга

	28.09.15	изменение за день, б.п.	изменение за неделю, б.п.	изменение за месяц, б.п.
Russia GLB-18, %	3,47	-0,01	-0,05	-0,51
Moscow-16, %	2,69	0,15	0,08	-0,36
UST 5Y, %	1,42	-0,06	-0,07	-0,10
BUND 5Y, %	0,00	-0,03	-0,05	-0,09

Товарный рынок

	28.09.15	изменение за день, %	изменение за неделю, %	изменение за месяц, %
Brent	47,34	-2,59	-3,23	-5,41
WTI Nymex	44,43	-2,78	-4,82	-1,75
Urals	44,84	-2,69	-4,88	-4,74
Золото, руб./грамм	2 418,64	-0,30	0,88	-1,16

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
БИНБАНК, БО-04 (доп. выпуски № 5 - 12)	07.02.20	17.02.16	буклидинг	16 000	-	16 000	-	-	12,50	БИНБАНК
"Концерн РОССИУМ", 01	15.09.25	29.09.17	буклидинг	10 000	-	10 000	13,50	-	13,96	ОАО "Московский Кредитный Банк"

БЛИЖАЙШИЕ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИОННЫХ ЗАЙМОВ

Дата	Выпуск	Форма размещения	Сектор рынка облигаций	Объем эмиссии, млн. руб.	Дата погашения	Организатор, Со-организаторы, андеррайтеры, со-андеррайтеры
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»
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 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

Отчет подготовлен на основе данных, полученных из Thomson Reuters Eikon, а также из различных публичных источников информации, расчеты – ГБУ «Мосфинагентство».

ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ ОБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В РУБЛЯХ

ОБЛИГАЦИИ ФЕДЕРАЛЬНЫХ ЗАЙМОВ (ОФЗ)

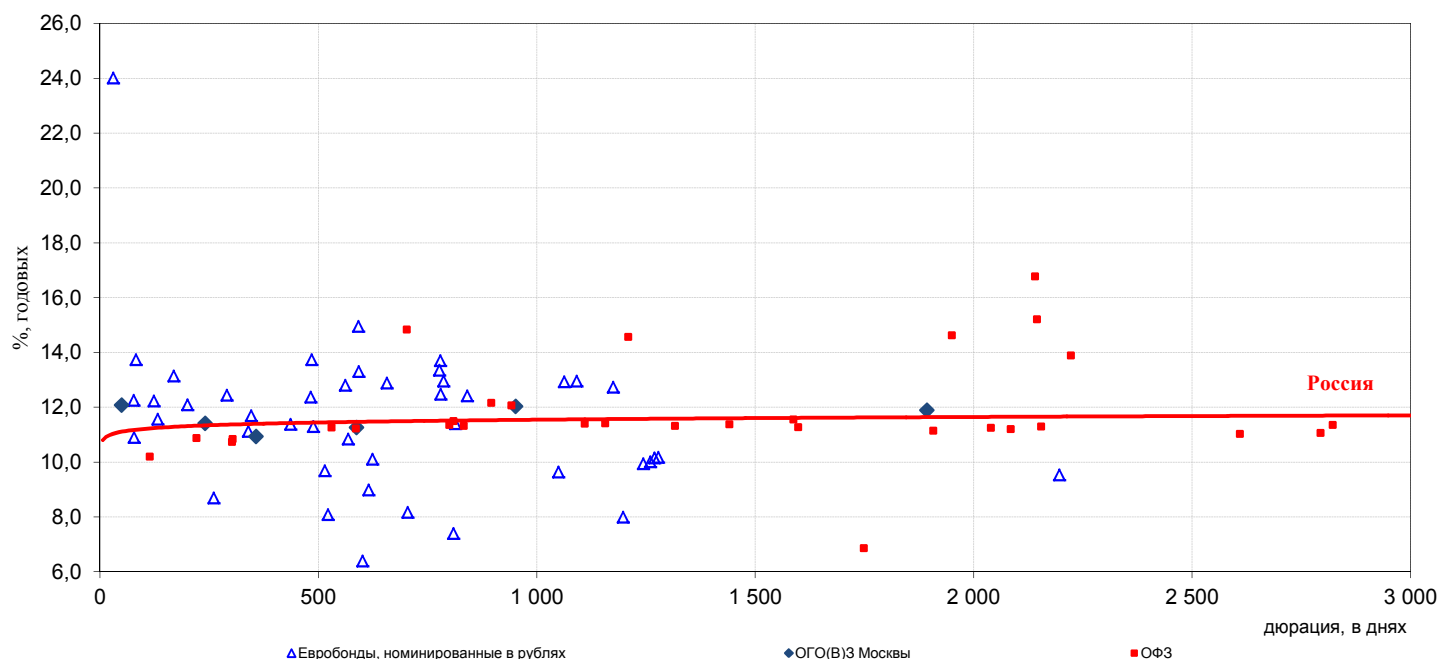
Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
				Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент				Российская Федерация					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)				BB+/Ba1/BBB-					
25077RMFS	26.01.11	20.01.16	114	10,20	91,28	92 021	10,20	18,26	18 400
25082RMFS	15.05.13	11.05.16	221	10,88	0,34	345			
26203RMFS	04.08.10	03.08.16	304	10,84	1,76	1 814			
46017RMFS	16.02.05	03.08.16	302	10,74	16,59	34 385			
25080RMFS	25.04.12	19.04.17	530	11,26	2,51	2 645			
26206RMFS	08.06.11	14.06.17	586	11,23	9,99	10 559			
24018RMFS	28.01.15	27.12.17	702	14,84	69,33	68 159	14,84	335,41	329 800
25081RMFS	06.02.13	31.01.18	800	11,36	0,07	77	11,36	1 307,76	1 450 000
26204RMFS	23.03.11	15.03.18	833	11,32	0,63	678	11,32	277,75	300 000
46021RMFS	21.02.07	08.08.18	809	11,50	0,58	663			
46014RMFS	05.03.03	29.08.18	895	12,16	0,00	2			
48001RMFS	18.11.04	31.10.18							
46005RMFS	14.02.03	09.01.19							
26208RMFS	07.03.12	27.02.19	1 110	11,40	0,31	340	11,40	90,00	100 000
46019RMFS	28.12.05	20.03.19							
26216RMFS	13.11.13	15.05.19	1 156	11,42	0,01	8	11,42	1 219,25	1 400 000
26210RMFS	19.12.12	11.12.19	1 316	11,32	0,03	34			
29011RMFS	28.01.15	29.01.20	1 209	14,57	1,63	1 612	14,57	2 526,00	2 500 000
26214RMFS	05.06.13	27.05.20	1 441	11,38	0,01	13	11,38	624,74	750 000
26205RMFS	13.04.11	14.04.21	1 598	11,27	0,00	2	11,27	637,78	739 460
46018RMFS	16.03.05	24.11.21							
26209RMFS	01.08.12	20.07.22	1 908	11,15	0,01	9			
26211RMFS	16.01.13	25.01.23	2 039	11,25	32,28	40 002	11,25	50,37	62 800
46022RMFS	23.01.08	19.07.23	2 084	11,20	0,00	1			
26215RMFS	04.09.13	16.08.23	2 154	11,30	1 447,54	1 827 273	11,30	634,70	800 000
29006RMFS	31.12.14	29.01.25	1 950	14,63	0,40	393			
46011RMFS	14.02.03	20.08.25							
46023RMFS	30.09.11	23.07.26							
26207RMFS	22.02.12	03.02.27	2 609	11,03	16,64	20 023	11,03	84,01	100 900
52001RMFS	17.07.15	16.08.23	2 615	3,37	99,54	104 844			
29007RMFS	31.12.14	03.03.27	2 223				13,89	204,12	200 000
26212RMFS	23.01.13	19.01.28	2 794	11,06	78,03	104 167	11,06	224,77	300 090
46010RMFS	14.02.03	17.05.28							
46012RMFS	14.02.03	05.09.29							
29008RMFS	31.12.14	03.10.29	2 145				15,21	210,00	200 000
29009RMFS	31.12.14	05.05.32	2 141	16,77	5,89	5 806	16,77	87,31	86 000
29010RMFS	31.12.14	06.12.34							
46020RMFS	15.02.06	06.02.36	3 295	11,38	0,24	352			

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

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				Правительство Москвы					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)				BB+/Ba1/BBB-					
RU32064MOS0	16.11.09	16.11.15	49	12,08	0,04	35			
RU25067MOS0	05.06.13	01.06.16	241	11,41	0,40	406			
RU32056MOS0	22.09.08	22.09.16							
RU26071MOS0	17.12.13	13.06.17							
RU32049MOS0	14.12.06	14.06.17	587	11,26	16,01	17 041			
RU32065MOS0	16.11.09	18.11.17							
RU25068MOS0	03.10.13	27.09.18							
RU27066MOS0	23.11.09	23.11.18	951	12,04	6,39	6 081			
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	1 893	11,90	0,41	539			

На графиках 1 - 3 и 9 кривая доходностей ОФЗ 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	814	93,20	11,40
РЖД, 2019, RUB (LPN)	BB+/Ba1/BBB-	02.04.19	1 063	88,25	12,93
АИЖК, 2018, RUB (LPN)	BB+/Ba1/-	13.02.18	786	90,35	12,96
Газпромбанк, 2015, RUB (LPN)	BB+/Ba2/BB+	15.12.15	77	99,30	12,26
Газпромбанк, 2016-2, RUB (LNP)	BB+/Ba2/BB+	25.07.16	290	96,77	12,44
Газпромбанк, 2019, RUB (LPN)	BB+/Ba2/BB+	29.06.19	1 175	88,56	12,74
Россельхозбанк, 2016-2, RUR (LPN)	-/Ba2/BB+	17.03.16	169	98,21	13,14
Россельхозбанк, 2017, RUB (LPN)	-/Ba2/BB+	17.02.17	485	94,21	13,74
Россельхозбанк, 2018, RUB (LPN)	-/Ba2/BB+	07.02.18	779	89,37	13,70
Вымпелком, 2018, RUB	BB/Ba3/-	13.02.18	777	92,15	13,35
НОВАТЭК, 2017, RUB (LPN)	BB+/Ba1/BBB-	21.02.17	482	94,64	12,37
РусГидро, 2015, RUR	BB/Ba2/BB+	28.10.15	30	98,83	24,01
ФСК ЕЭС, 2019, RUB	BB+/Ba1/BBB-	13.03.19	1 091	88,72	12,96
СБ России ОАО, 2016, RUB (LPN)	-/Ba2/BBB-	31.01.16	123	98,39	12,23
Альфа-Банк, 2016 (LPN), RUB	BB/Ba2/BB+	26.04.16	200	98,29	12,09
Евразийский банк развития, 2017, RUB	BBB/Baa1/Withdrawn	05.10.17	656	92,18	12,89
World Bank, 2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	02.03.17	488	95,14	11,30
EIB, 2015, RUR	AAA/Aaa/AAA	15.12.15	78	99,06	10,90
EIB, 2016, RUR	AAA/Aaa/AAA	30.09.16	339	95,82	11,12
EIB, 2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	13.06.17	601	100,53	6,40
EIB, 6% 15feb2018	AAA/Aaa/AAA	15.02.18	809	97,01	7,40
EIB, 2019-2, RUB	AAA/Aaa/AAA	16.07.19	1 197	98,90	7,99
IFC, 5% 28dec2016 RUB	AAA/Aaa/-	28.12.16	436	93,08	11,38
IFC, 11% 21jan2020 (RUB/USD), RUB	AAA/Aaa/-	21.01.20	1 278	103,70	10,18
JP Morgan, 2017, RUR	A+/A2/A+	28.06.17	592	90,99	13,31
EBRD, 6.75% 12may2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	12.05.17	568	94,14	10,84
EBRD, 6.5% 27jun2017, RUR	AAA/Aaa/AAA	27.06.17	615	96,11	8,99
EBRD, FRN 20may2020, RUB	AAA/Aaa/AAA	20.05.20	-	-	-
Rabobank, 2016, RUR	AA-/Aa2/AA	10.02.16	132	98,52	11,57
Rabobank, 6% 30nov2016, RUR	AA-/Aa2/AA	30.11.16	-	-	-

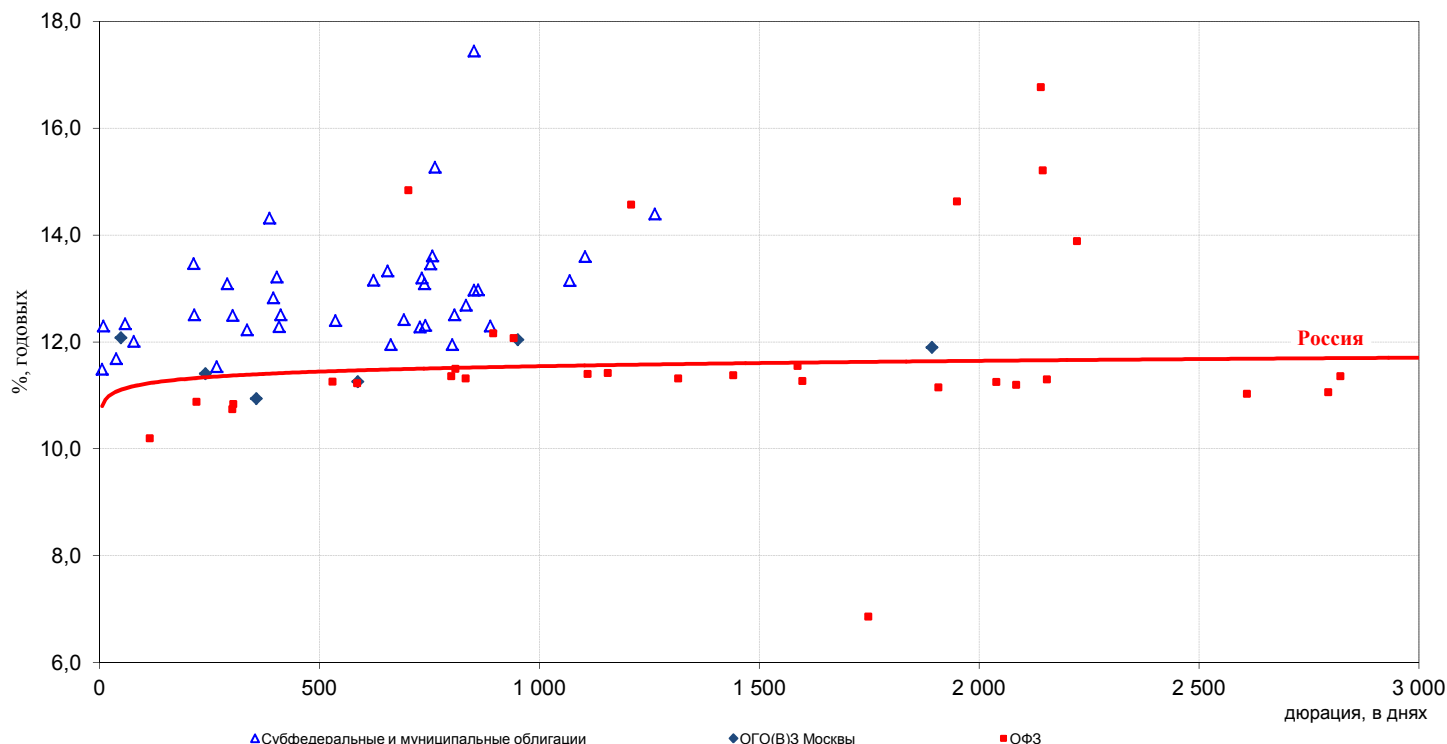
*торги на внебиржевом рынке

**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	592	88,60	14,95
KfW, 2017, RUR	-/-/-	25.09.17	705	97,50	8,17
KfW, 7% 14jun2016	-/-/-	14.06.16	260	98,83	8,69
Caterpillar, 7.5% 20dec2015	-/-/-	20.12.15	82	98,71	13,74
IBRD, 7.625% 11oct2016 (RUB/USD)	-/-/-	11.10.16	346	96,21	11,70
IBRD, 6.25% 05jul2017, RUB	-/-/-	05.07.17	624	94,00	10,11
IBRD, 10.3% 05mar2019 (RUB/EUR)	-/-/-	05.03.19	1 050	101,75	9,64
IBRD, 6.5% 26jul2019 RUB/USD	-/-/-	26.07.19	1 260	89,24	10,01
IBRD, 10% 16sep2019, RUR	-/-/-	16.09.19	1 243	100,16	9,95
IBRD, 11.6% 10feb2020 (RUB/USD)	-/-/-	10.02.20	1 269	105,85	10,15
IBRD, 6.75% 2023, RUR	-/-/-	20.06.23	2 197	85,32	9,53
KEXIM, 7.63% 30may2017	-/-/-	30.05.17	561	92,93	12,81
BNP Paribas, 6.89% 30jan2018	AA+/Aa1/AA	30.01.18	780	89,61	12,48
Societe Generale, 10.5% 30mar2017, RUB	A/A2/A	30.03.17	515	100,99	9,69
Societe Generale, 8% 30mar2017, RUB	A/A2/A	30.03.17	522	99,83	8,09
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	840	87,37	12,42
SEK, 6.12% 13sep2018, RUR	-/-/-	13.09.18	-	-	-

*Индикативная цена (здесь и далее) используется Cbonds для расчета эффективных доходностей, дюрации, модифицированной дюрации, исходя из следующего приоритет 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								
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	303		12,50	1,68	5 000			
Белгородская обл. 09	07.07.15	30.06.20								
Белгородская обл. 07	06.08.13	28.07.20								
Белгородская обл. 08	30.06.14	21.06.21	753		13,46	0,65	679			
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	851		17,45	0,00	1			
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								
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	9		12,30	4,98	16 621			
Нижегородская обл. 34007	17.11.11	16.11.16	215		12,51	11,43	23 265			
Нижегородская обл. 34008	29.08.12	29.08.17								

28 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	1 104		13,60	7,04	6 992	13,60	48,39	48 151
Нижегородская обл. 34009	26.08.13	26.08.20	852		12,97	0,25	318			
Эмитент					Республика Башкортостан					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/Ba2/-					
Башкортостан 34007	04.12.12	29.11.16	409		12,29	0,04	96			
Башкортостан, 34008	27.09.13	18.09.20								
Башкортостан, 34009	16.10.14	11.04.19	729		12,28	0,00	2			
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	741		12,31	8,43	8 503	12,31	990,90	1 000 000
Красноярский кр. 34010	15.09.15	10.09.19	1 069		13,15	85,80	85 655	13,15	180,72	180 000
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								
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								
Липецкая область, 34009	10.06.14	04.06.19	739		13,09	112,44	130 000			
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	733		13,20	0,00	1			
Республика Хакасия, 35003	29.10.13	27.10.20								
Эмитент					Департамент финансов Томской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB-/--					
Томская область, 34045	20.12.12	19.12.17	536		12,40	1,05	2 000			
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	78		12,01	3,33	5 159			
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	412		12,51	0,04	50			
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	266		11,54	2,93	10 038	11,54	37,69	128 934
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	889		12,30	0,00	1			
Эмитент					Ярославская область					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB					
Ярославская область, 34012	19.07.13	13.07.18								

28 сентября 2015 г.

Приложение к ежедневному информационно-аналитическому обзору

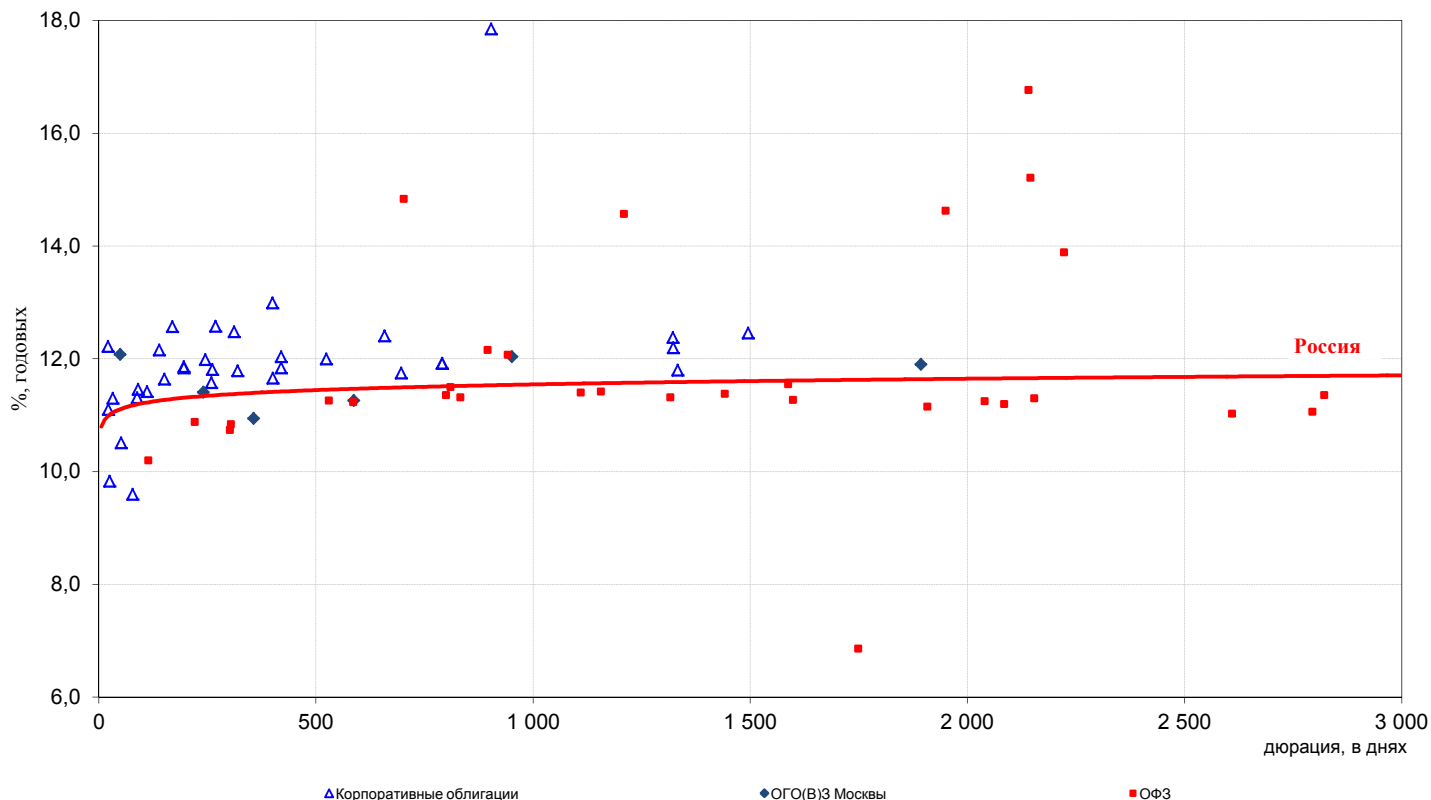
Выпуск	Дата начала разме- щения	Дата погаше- ния	Дюрация, в днях	Дата оферты	Режим основных торгов			Режим переговорных сделок		
					Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.	Средневзве- шенная доходность, % год.	Объем торгов, млн. руб.	Кол-во бумаг, шт.
Эмитент					г. Краснодар - Администрация города					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B1/-					
Админ. Краснодара 34002	10.11.11	05.11.15	38		11,69	2,86	11 459			
Эмитент					Республика Удмуртия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/Withdrawn/BB-					
Удмуртия, 34004	25.11.10	25.11.15	58		12,34	0,00	1			
Удмуртия, 34005	01.12.11	24.11.16								
Удмуртия, 34006	11.12.12	05.12.17								
Удмуртия, 34007	24.09.15	17.09.20	1 263		14,40	10,15	10 123	14,40	190,57	190 000
Удмуртия, 35001	10.10.13	01.10.20								
Эмитент					Краснодарский край					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					Withdrawn/B1/Withdrawn					
Краснодарский край, 34004	15.11.12	09.11.17	335		12,23	0,20	500			
Эмитент					Республика Карелия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/B+					
Карелия 34014	02.12.11	30.11.16	403		13,22	0,00	7			
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	395		12,83	0,15	2 001			
Костромская область, 34007	04.10.13	28.09.18								
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	6		11,49	0,14	340			
Марий Эл, 34007	28.05.14	07.07.18	290		13,09	0,01	7			
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	214		13,47	5,41	10 948			
Вологодская область, 34003	11.12.12	05.12.17	386		14,32	0,18	367			
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	833		12,69	0,09	100			
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	623		13,16	20,48	20 571			

28 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								
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	861		12,98	0,00	1	12,98	83,72	100 000
Эмитент					Министерство финансов Республики Мордовия					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/B2/-					
МФ Респ.Мордовия, 34001	28.10.13	22.10.18	655		13,33	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	802		11,95	0,02	24			
Эмитент					Администрация Кемеровской области					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					-/-/BB-					
Кемеровская область, 34001	29.11.13	28.11.18	757		13,61	0,09	98			
Эмитент					Ханты-Мансийский Автономный округ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB+/Ba2/BBB-					
ХМАО, 34001	14.10.14	13.10.19	662		11,95	0,77	775			
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	762		15,27	19,52	19 303			
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	111		11,42	20,63	20 805			
ВТБ, БО-22	19.02.13	16.02.16	139		12,16	4,34	4 402			
ВТБ 06	19.07.06	06.07.16								
ВТБ, БО-43	11.10.13	29.09.23	268	12.07.16	12,58	282,38	282 224			
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								
ФСК ЕЭС, 06	28.09.10	15.09.20	1 495		12,46	17,19	20 003			
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	25	27.10.15	9,83	0,00	1	9,83	14,98	15 003
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								
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	523	26.04.17	12,00	0,96	1 000			
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								

28 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					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	32		11,30	0,00	1			
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								
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	420		12,04	0,01	10			
Башнефть, 02	22.12.09	13.12.16								
Башнефть, 03	22.12.09	13.12.16	420		11,84	0,01	15			
Башнефть, 04	17.02.12	04.02.22								
Башнефть, 06	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, 07	12.02.13	31.01.23	1 321	10.02.20	12,38	0,01	11			
Башнефть, 08	12.02.13	31.01.23								
Башнефть, 09	12.02.13	31.01.23	1 322	10.02.20	12,20	4,01	4 456			
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								
Газпромбанк, 07	22.10.12	17.10.16	21	21.10.15	12,22	0,00	1	12,22	129,74	129 999
Газпромбанк, БО-09	27.06.14	27.06.17	90	29.12.15	11,46	2,44	2 445			

28 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	169		12,57	0,00	10			
АФК Система, 03	03.12.09	24.11.16	400		12,99	0,81	844			
АФК Система, БО-01	19.02.15	31.01.30	311	22.08.16	12,48	11,39	10 959			
Эмитент					ОАО "АЛЬФА-БАНК"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)					BB/Ba2/BB+					
Альфа-Банк, 01	08.02.11	02.02.16								
Альфа-Банк, БО-08	26.02.13	26.02.16	151		11,64	2,52	2 550			
Альфа-Банк, БО-09	20.08.13	20.08.16	320		11,79	0,74	758			
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								
Альфа-Банк, БО-13	18.09.14	30.08.29								
Альфа-Банк, БО-14	18.09.14	30.08.29	658	18.09.17	12,41	0,01	12			
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	51		10,51	0,20	201	10,51	29,90	30 005
РЖД, 15	29.06.09	20.06.16	259		11,58	0,00	4	11,58	701,58	716 994
РЖД, 16	15.06.09	05.06.17	245	08.06.16	11,99	2,68	2 747			
РЖД, 17	27.07.09	16.07.18								
РЖД, 12	28.05.09	16.05.19								
РЖД, 18	27.07.09	15.07.19								
РЖД, 19	27.07.09	08.07.24								
РЖД, 23	04.02.10	16.01.25								
РЖД, 28	09.04.13	21.03.28	1 333	03.04.20	11,80	8,87	10 001			
РЖД, БО-09	27.06.13	08.06.28								
РЖД, 30	26.11.13	07.11.28	401	25.11.16	11,66	0,02	20			
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	22		11,10	0,01	11			
МТС, 05	28.07.09	19.07.16								
МТС, 07	16.11.10	07.11.17	696		11,75	0,15	159			
МТС, 03	24.06.08	12.06.18	78	17.12.15	9,60	0,00	1			
МТС, 08	16.11.10	03.11.20								
МТС, БО-01	03.04.13	22.03.23								

ИНДЕКСЫ РЫНКА СУБФЕДЕРАЛЬНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Наименование индекса	28.09.15	25.09.15	24.09.15	23.09.15	22.09.15
Средневзвешенная доходность Индекса MosBonds, %	11,63	11,69	11,84	11,72	11,81
Ценовой Индекс MosBonds	88,98	89,13	88,74	89,07	88,93
Средневзвешенная дюрация Индекса MosBonds, дней	792	801	797	802	803
Cbonds-Muni средневзвешенная доходность (эфф.), %	12,09	12,12	12,28	12,11	12,17
Cbonds-Muni ценовой	94,15	94,08	93,81	94,08	93,93
Cbonds-Muni дюрация инд. портфеля, дней	739	745	743	747	751

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

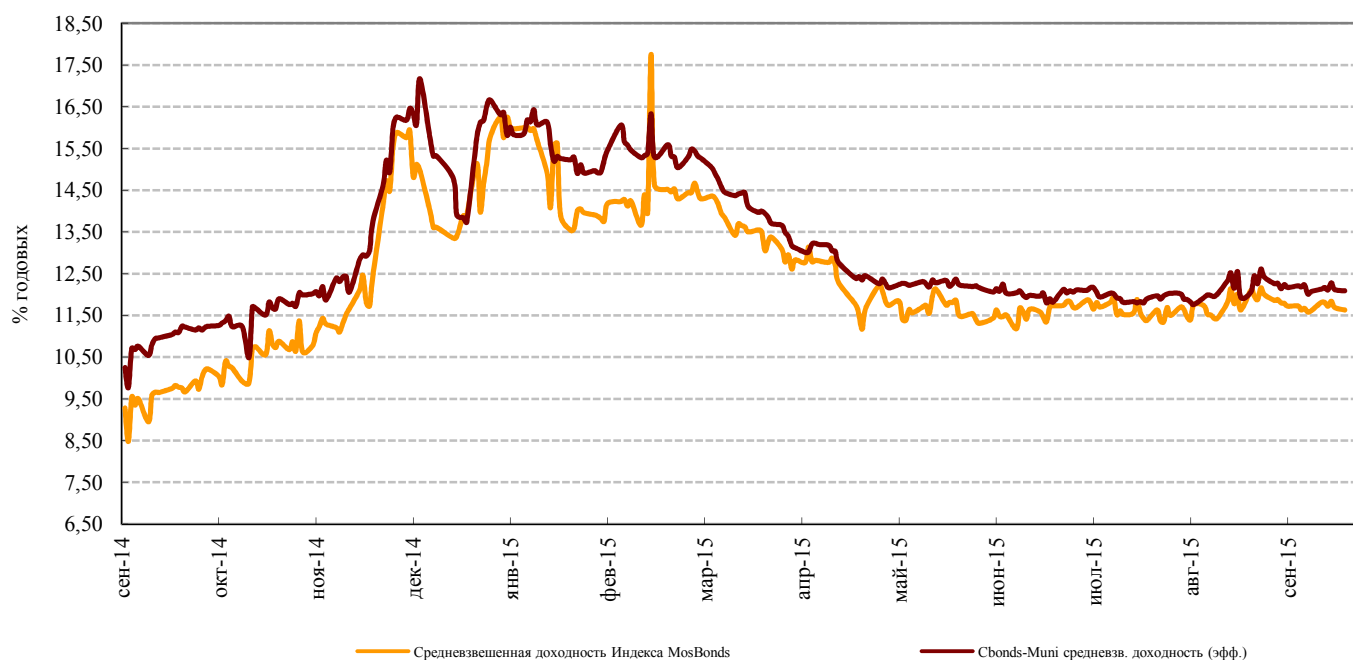
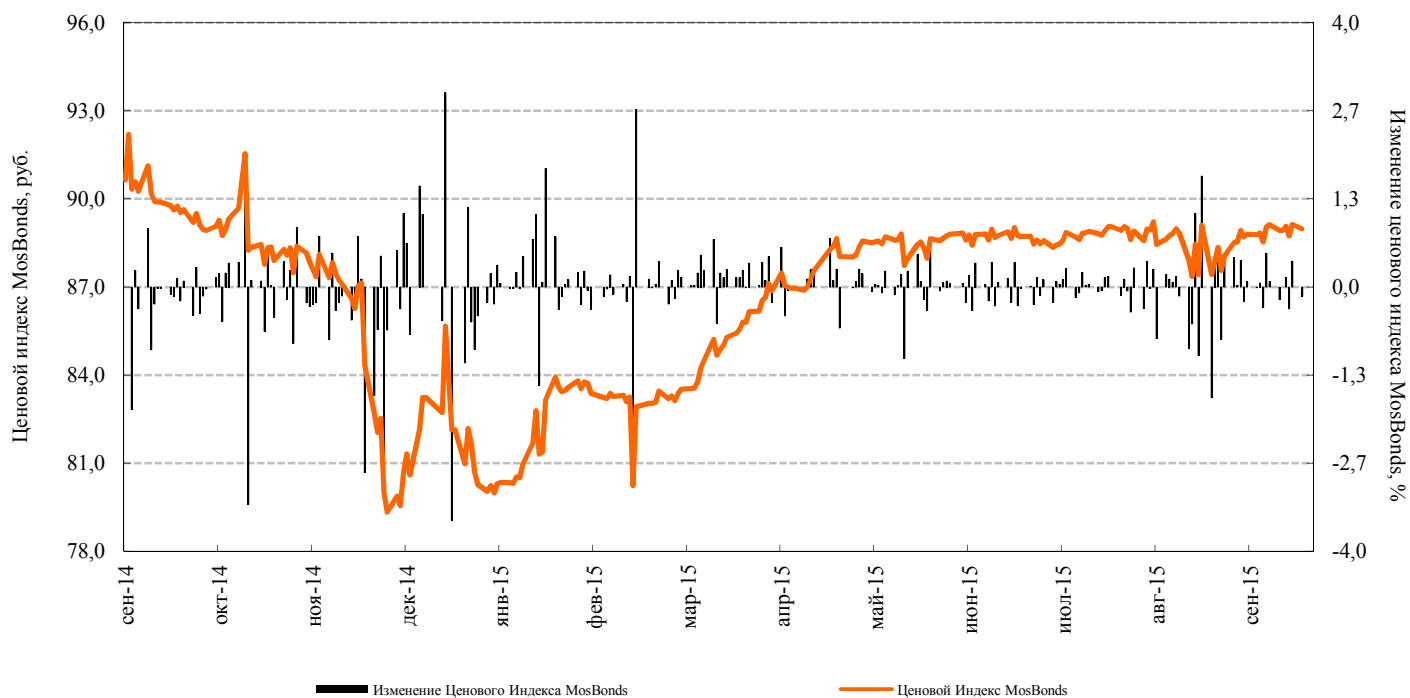
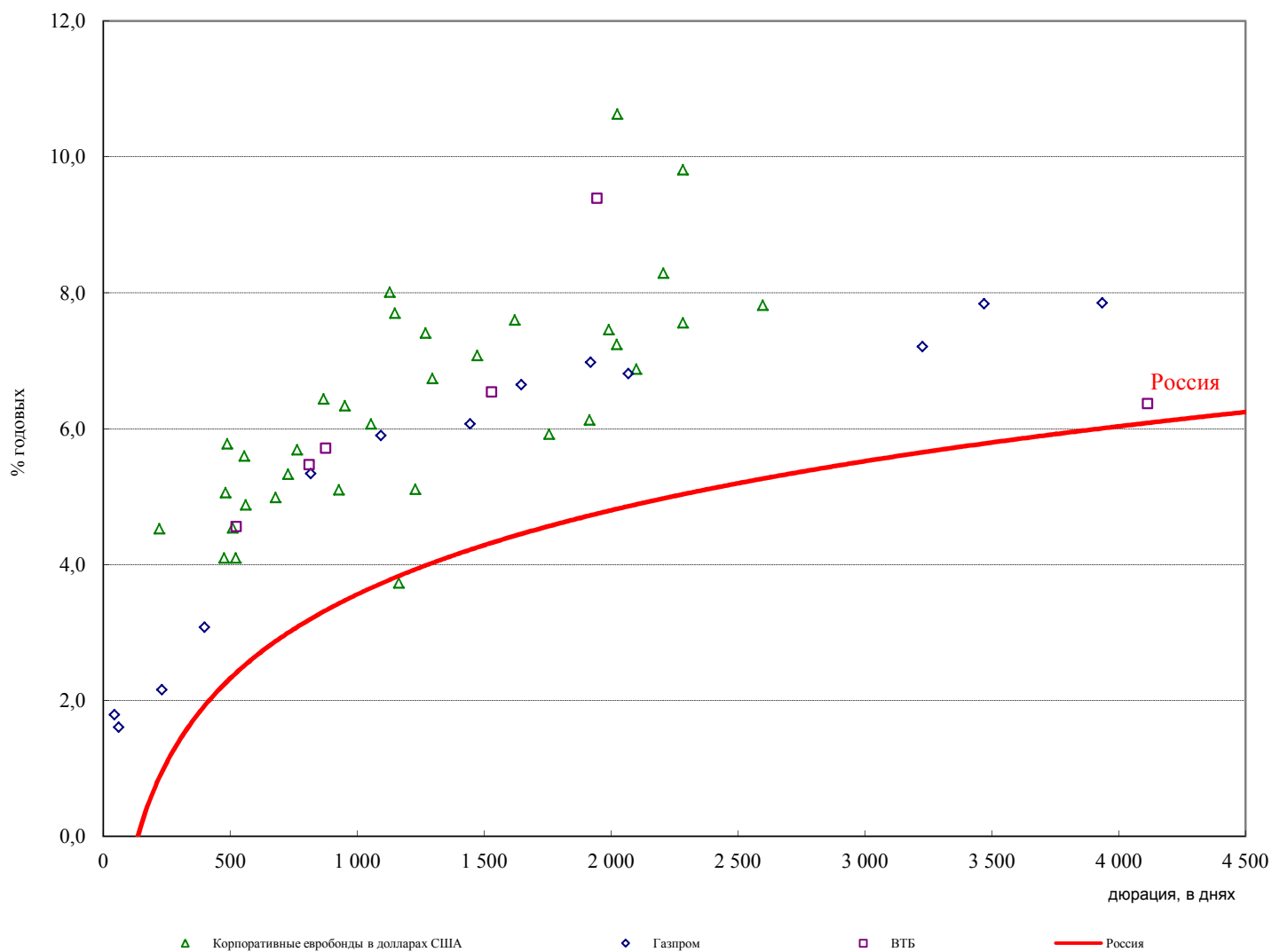


График 5. Динамика ценового индекса MosBonds и его изменения



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	529	100,58	2,88	2,88	0,00
Россия, 2018	24.07.18	899	120,36	3,40	3,11	0,29
Россия, 2019	16.09.19	1 125	99,98	3,54	3,55	-0,01
Россия, 2020	29.04.20	1 470	103,40	4,22	4,24	-0,02
Россия, 2022	04.04.22	2 014	99,38	4,67	4,68	-0,01
Россия, 2023	16.09.23	2 405	99,43	5,02	5,04	-0,02
Россия, 2028	24.06.28	2 759	156,62	6,34	6,34	0,00
Россия, 2030	31.03.30	1 495	117,90	3,40	3,49	-0,09
Россия, 2042	04.04.42	4 748	92,28	6,32	6,32	0,00
Россия, 2043	16.09.43	4 924	94,98	6,36	6,34	0,02
КОРПОРАТИВНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент	ОАО "АЛЬФА-БАНК"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB/Ba2/BB+					
Альфа-Банк, 2017 (LPN, Step Up)	22.02.17	488	100,79	5,78	5,83	-0,05
Альфа-Банк, 2017-2 (LPN)	25.09.17	678	105,53	4,99	4,91	0,08
Альфа-Банк, 2019 (LPN)	26.09.19	1 269	100,77	7,41	7,41	0,00
Альфа-Банк, 2021 (LPN)	28.04.21	1 621	101,30	7,60	7,64	-0,04
Альфа-Банк, 2025 (LPN)	18.02.25	2 283	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	1 149	98,09	7,70	7,68	0,02
Эмитент	ОАО Банк ВТБ					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba2/Withdrawn					
ВТБ, 2017 (LPN)	12.04.17	524	102,19	4,56	4,65	-0,09
ВТБ, 2018-2 (LPN)	22.02.18	811	102,03	5,47	5,47	0,00
ВТБ, 2018 (LPN14)	29.05.18	877	103,01	5,71	5,75	-0,04
ВТБ, 2020 (LPN)	13.10.20	1 530	100,48	6,54	6,54	0,00
ВТБ, 2022 (LPN)	17.10.22	1 945	88,58	9,39	9,41	-0,02
ВТБ, 2035 (LPN6)	30.06.35	4 114	99,75	6,37	6,56	-0,19
Эмитент	Внешэкономбанк					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Внешэкономбанк, 2017-2 (LPN)	13.02.17	481	100,49	5,06	5,06	0,00
Внешэкономбанк, 2017 (LPN)	22.11.17	728	100,38	5,33	5,38	-0,05
Внешэкономбанк, 2018 (LPN)	21.11.18	1 055	95,01	6,07	6,05	0,02
Внешэкономбанк, 2020 (LPN)	09.07.20	1 473	99,75	7,08	7,10	-0,02
Внешэкономбанк, 2022 (LPN)	05.07.22	1 991	93,13	7,46	7,59	-0,13
Внешэкономбанк, 2023 (LPN)	21.11.23	2 283	91,07	7,56	7,66	-0,10
Внешэкономбанк, 2025 (LPN)	22.11.25	2 597	93,89	7,82	7,86	-0,04
Эмитент	ОАО "Газпром"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moodys/Fitch)	BB+/Ba1/BBB-					
Газпром, 2015-4 (LPN36)	12.11.15	44	100,30	1,79	1,81	-0,02
Газпром, 2015-3 (LPN23)	29.11.15	61	100,59	1,61	1,68	-0,07
Газпром, 2016-2 (LPN24)	23.05.16	231	101,80	2,16	2,20	-0,04
Газпром, 2016 (LPN7)	22.11.16	398	103,53	3,08	3,10	-0,02
Газпром, 2018-2 (LPN17)	11.04.18	817	106,74	5,34	5,32	0,02
Газпром, 2019 (LPN20)	23.04.19	1 094	110,93	5,90	5,93	-0,03
Газпром, 2020 (LPN28)	06.02.20	1 445	91,94	6,07	6,06	0,01
Газпром, 2021 (LPN25)	23.01.21	1 646	97,59	6,65	6,64	0,01
Газпром, 2022 (LPN9)	07.03.22	1 919	98,19	6,98	6,99	-0,01

*торги на внебиржевом рынке

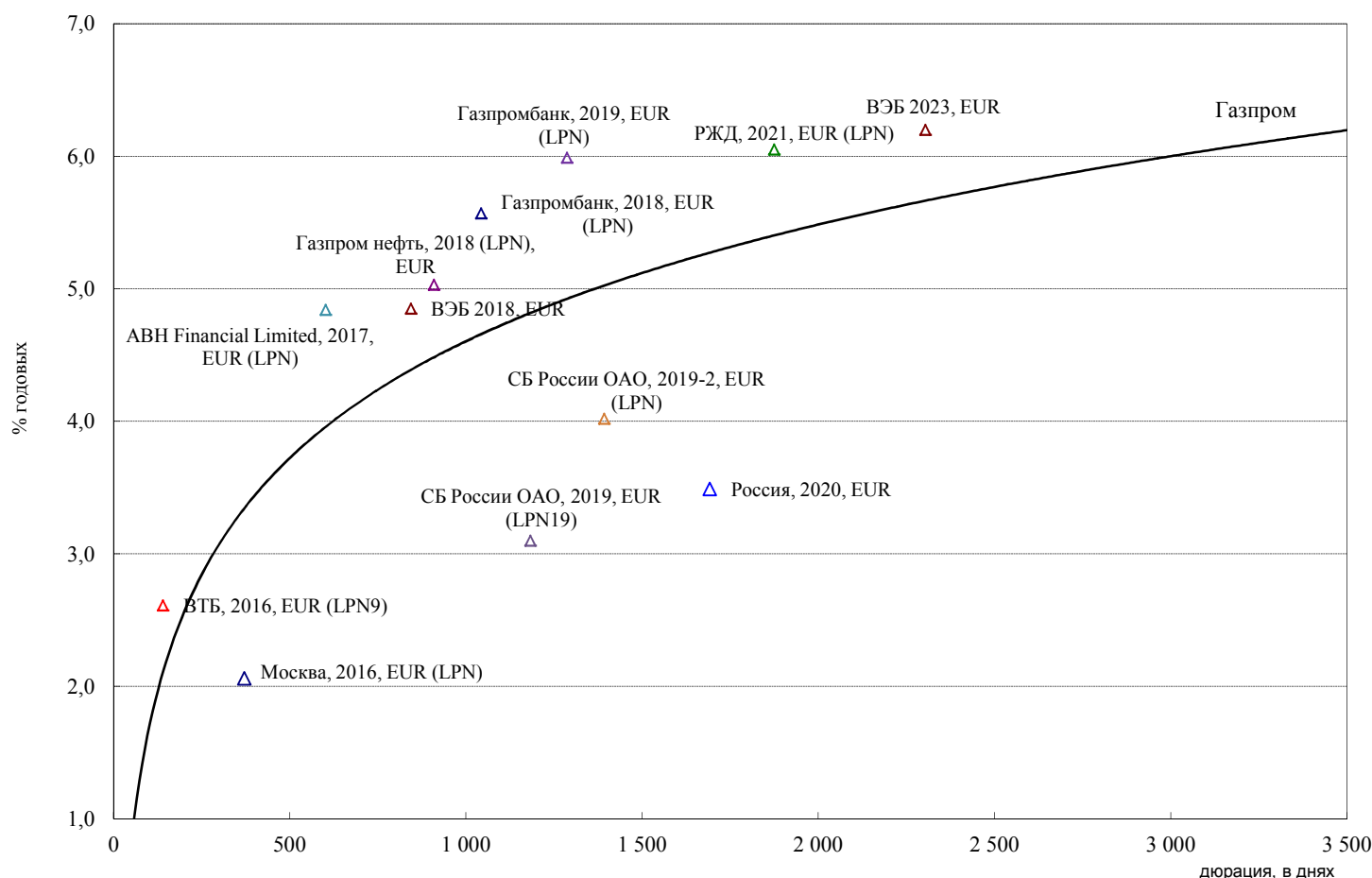
28 сентября 2015 г.

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	2 068	90,58	6,81	6,72	0,09
Газпром, 2028 (LPN29)	06.02.28	3 227	82,63	7,21	7,12	0,09
Газпром, 2034 (LPN2)	28.04.34	3 469	109,18	7,84	7,84	0,00
Газпром, 2037 (LPN12)	16.08.37	3 935	95,68	7,85	7,82	0,03
Эмитент	Газпромбанк (Открытое акционерное общество)					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba2/BB+					
Газпромбанк, 2016 (LPN)	08.05.16	220	101,63	4,53	4,57	-0,04
Газпромбанк, 2017 (LPN)	17.05.17	560	101,24	4,88	4,99	-0,11
Газпромбанк, 2018 (LPN12)	21.11.18	-	-	-	-	-
Газпромбанк, 2019 (LPN)	03.05.19	1 128	98,13	8,01	8,05	-0,04
Газпромбанк, 2019 (LPN)	05.09.19	1 297	94,29	6,74	6,80	-0,06
Газпромбанк, 2023*	28.12.18	1 026	83,36	14,53	14,56	-0,03
Эмитент	ОАО "Нефтяная компания "Роснефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/Withdrawn					
Роснефть, 2017 (LPN)	06.03.17	510	98,15	4,54	4,57	-0,03
Роснефть, 2022 (LPN)	06.03.22	2 022	85,13	7,24	7,27	-0,03
Эмитент	ОАО "Россельхозбанк"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	-/Ba2/BB+					
Россельхозбанк, 2017 (LPN2)	15.05.17	555	101,18	5,60	5,48	0,12
Россельхозбанк, 2017-2 (LPN)	27.12.17	764	99,34	5,69	5,70	-0,01
Россельхозбанк, 2018 (LPN3B)	29.05.18	867	103,39	6,44	6,53	-0,09
Россельхозбанк, 2021 (LPN)*	03.06.16	239	90,16	23,56	23,46	0,10
Россельхозбанк, 2018-2 (LPN)	25.07.18	951	97,08	6,34	6,41	-0,07
Россельхозбанк, 2023 (LPN)	16.10.23	2 025	89,98	10,63	10,68	-0,05
Эмитент	ОАО "Сбербанк России"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	-/Ba2/BBB-					
СБ России ОАО, 2017-2 (LPN)	07.02.17	476	101,16	4,10	4,11	-0,01
СБ России ОАО, 2017 (LPN)	24.03.17	522	101,92	4,10	4,15	-0,05
СБ России ОАО, 2023 (LPN)	23.05.18	2 206	83,84	8,29	8,29	0,00
СБ России ОАО, 2019-2 (LPN18)	06.03.19	1 164	101,44	3,73	3,78	-0,05
СБ России ОАО, 2019 (LPN)	28.06.19	1 229	100,43	5,11	5,20	-0,09
СБ России ОАО, 2021 (LPN)	16.06.21	1 756	99,44	5,92	6,01	-0,09
СБ России ОАО, 2022 (LPN)	07.02.22	1 915	100,46	6,13	6,13	0,00
СБ России ОАО, 2022-2 (LPN)	29.10.22	2 100	90,88	6,88	7,02	-0,14
СБ России ОАО, 2024 (LPN)*	26.02.19	1 120	84,00	11,59	11,74	-0,15
Эмитент	ОАО "Акционерная компания по транспорту нефти "Транснефть"					
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)	BB+/Ba1/-					
Транснефть, 2018 (LPN)	07.08.18	928	109,63	5,10	5,09	0,01

*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	1 692	100,62	3,49	3,51	-0,02
СУБФЕДЕРАЛЬНЫЕ И МУНИЦИПАЛЬНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент						
Правительство Москвы						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba1/BBB-						
Москва, 2016, EUR (LPN)	20.10.16	371	103,12	2,06	2,07	-0,01
КОРПОРАТИВНЫЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ						
Эмитент						
ОАО Банк ВТБ						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba2/Withdrawn						
ВТБ, 2016, EUR (LPN9)	15.02.16	140	100,61	2,61	2,89	-0,28
Эмитент						
Внешэкономбанк						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba1/BBB-						
ВЭБ 2018, EUR	21.02.18	844	95,97	4,85	5,12	-0,27
ВЭБ 2023, EUR	21.02.23	2 304	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	1 875	87,53	6,05	6,07	-0,02

*торги на внебиржевом рынке

28 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	909	95,06	5,03	4,99	0,04
Эмитент						
Газпромбанк (Открытое акционерное общество)						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba2/BB+						
Газпромбанк, 2018, EUR (LPN)	30.10.18	1 044	95,63	5,57	5,70	-0,13
Газпромбанк, 2019, EUR (LPN)	01.07.19	1 287	93,50	5,99	5,98	0,01
Эмитент						
ОАО "Газпром"						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
BB+/Ba1/BBB-						
Газпром, 2017-3, EUR (LPN)	15.03.17	521	100,09	3,69	3,78	-0,09
Газпром, 2017, EUR (LPN6)	22.03.17	523	102,10	3,64	3,64	0,00
Газпром, 2017-2, EUR (LPN8)	02.11.17	712	102,90	3,97	3,98	-0,01
Газпром, 2018, EUR (LPN13)	13.02.18	804	104,55	4,54	4,39	0,15
Газпром, 2018-3 (LPN32), EUR	27.07.18	992	97,60	4,63	4,67	-0,04
Газпром, 2020 (LPN), EUR	20.03.20	1 513	92,26	5,39	5,21	0,18
Газпром, 2021 (LPN35), EUR	26.02.21	1 784	90,31	5,74	5,67	0,07
Газпром, 2025 (LPN), EUR	21.03.25	2 815	92,33	5,43	5,38	0,05
Эмитент						
ОАО "Сбербанк России"						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
-/Ba2/BBB-						
СБ России ОАО, 2019, EUR (LPN19)	07.03.19	1 183	100,00	3,10	3,10	0,00
СБ России ОАО, 2019-2, EUR (LPN)	15.11.19	1 392	97,53	4,02	4,15	-0,13
Эмитент						
ABH Financial Limited						
Рейтинг эмитента (S&P/Moody's/Fitch)						
-/-/BB						
ABH Financial Limited, 2017, EUR (LPN)	10.06.17	602	101,03	4,84	4,79	0,05

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

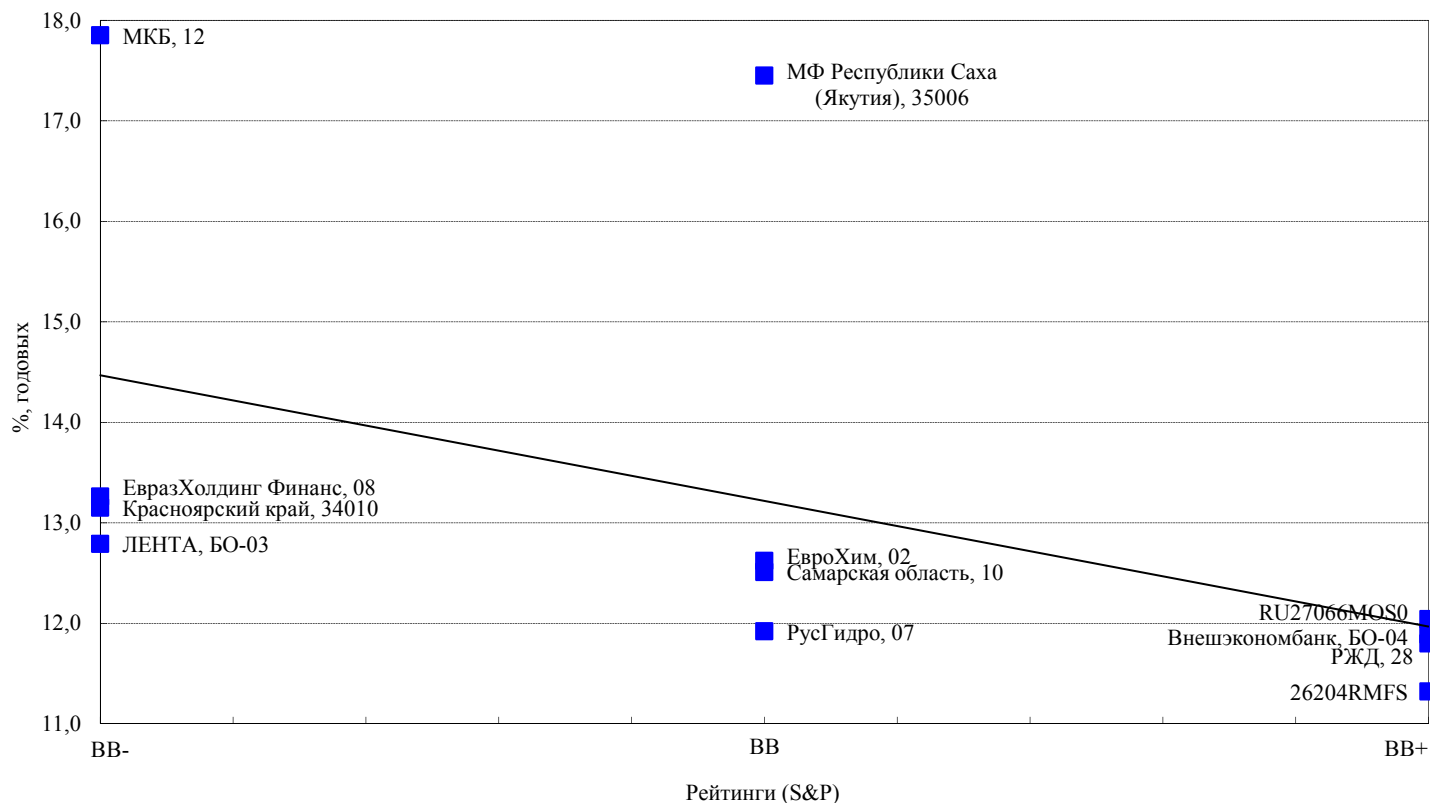


График 9. Уровни доходности на внутреннем рынке облигаций

