

Обзор финансовых инструментов за период с 23.01.12 по 27.01.12

(часть 1)

Выпуск	45 выпуск		54 выпуск		61 выпуск		53 выпуск		63 выпуск		62 выпуск		39 выпуск		44 выпуск		64 выпуск		56 выпуск		49 выпуск		66 выпуск		48 выпуск	
Дата погашения	июн.12		сен.12		июн.13		сен.13		дек.13		июн.14		июл.14		июн.15		ноя.15		сен.16		июн.17		ноя.18		июн.22	
Среднезв. за период показатель	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.
ОГО(В)З г.Москвы (ОснТорг и РПС)	6.73	131.0	6.84	26.0	6.74	0.0	7.15	16.8	6.14	-	7.61	0.8	9.21	-	8.75	0.0	7.61	182.9	8.05	27.2	7.62	0.2	8.23	17.7	8.19	0.6
Дюрация, в гг	0.5		0.6		1.3		1.5		1.7		2.1		2.3		3.1		3.2		4.0		4.5		5.2		7.4	
ГКО-ОФЗ РФ	6.15	299.6	6.13	95.5	6.30	230.6	6.55	2.2	6.39	-	7.04	159.2	7.19	36.2	7.59	223.0	7.57	72.6	7.71	53.0	7.92	426.7	8.08	1.0	8.33	96.9
Дюрация, в гг	0.5		0.7		1.1		1.4		1.6		2.2		2.2		3.1		3.1		3.9		3.9		5.1		6.6	

Аналоги выпусков субфедеральных и корпоративных эмитентов	Мос. обл. 9 мар.12	РЖД 12 май.19	Газпр 13 июн.12	Мос. обл. 8 июн.13	Газп. Кап-03 ноя.14	РЖД 1-06 дек.12	ВТБ-1,2,5 мар.13	РЖД 10 мар.14	Газпр 11 июн.14	Мос. обл. 7 апр.14	РЖД 23 янв.25	ДМ-Центр 1 май.15	С-Пб-38	ноя.15	РЖД 16 июн.17	ВЭБ, 6 окт.20														
Среднезв. за период показатель	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.	дох. % год.	торгов. млн. руб.														
Среднезв. за период показатель	6.91	-	7.94	-	7.0	47.3	8.19	0.7	7.25	111.3	7.2	42.1	8.1	271.8	7.82	243.6	7.4	78.9	8.89	0.4	8.4	53.2	11.59	0.2	7.28	-	8.74	176.4	9.38	236.8
Дюрация, в гг	0.2		0.4		0.5		0.8		0.8		0.9		1.1		1.9		2.1		2.1		2.6		3.0		3.4		3.8		4.6	

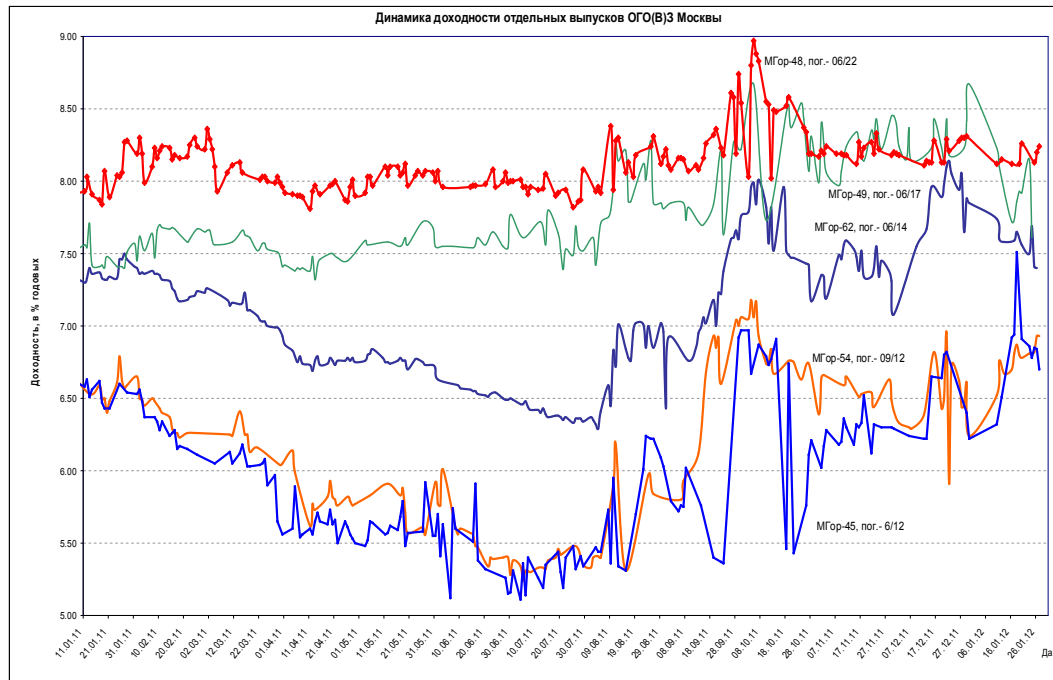
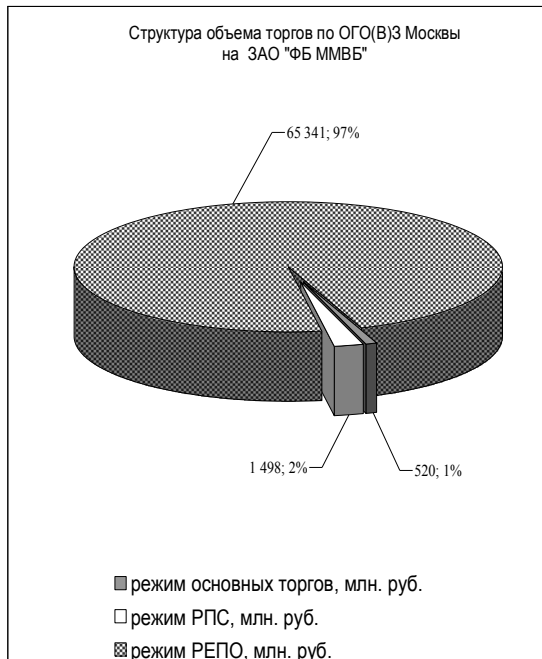
Выпуск	45	54	61	53	63	62	39	44	64	56	49	66	48
Москва 20 января 2012	6.91	6.78	6.70	7.88	6.14	7.56	7.81	7.75	7.85	8.05	7.92	8.26	8.26
ОФЗ РФ 20 января 2012	6.08	6.12	6.16	6.47	6.39	7.23	7.23	7.62	7.62	7.84	8.01	8.20	8.39
Спред 20 января 2012	83	66	54	141	-25	33	58	13	23	21	-9	6	-13
Москва 27 января 2012	6.70	6.93	7.36	6.96	6.14	7.40	7.81	7.75	7.35	8.05	7.61	8.27	8.24
ОФЗ РФ 27 января 2012	6.16	6.11	6.29	6.55	6.39	7.14	7.14	7.51	7.54	7.55	7.87	8.08	8.28
Спред 27 января 2012	54	82	107	41	-25	26	67	24	-19	50	-26	19	-4
Изменение за неделю Москва	-0.21	0.15	0.66	-0.92	0.00	-0.16	0.00	0.00	-0.50	0.00	-0.31	0.01	-0.02
Изменение за неделю ОФЗ РФ	0.08	-0.01	0.13	0.08	0.00	-0.09	-0.09	-0.11	-0.08	-0.29	-0.14	-0.12	-0.11

Среднедневной оборот по сегменту рынка, млн. руб.	
ОГО(В)З Москвы	ГКО-ОФЗ РФ
всего торги*	403
режим РЕПО	13 068

* - включая:
 режим основных торгов 104
 режим переговорных сделок 300

Данные за период по ОГО(В)З Москвы	23/01-27/01	16/01-20/01
всего объем торгов за период, млн. руб.	67 358	56 854
объем вторичных торгов, млн. руб.	520	160
кол - во сделок, шт.	97	114
объем торгов в РПС, млн. руб.	1 498	566
кол - во сделок, шт.	9	9
объем РЕПО, млн. руб.	65 341	56 128
аукционы, млн. руб.	0	0

MOSPRIME						
срок	27 янв	26 янв	25 янв	24 янв	23 янв	20 янв
O/N	6.07	6.03	5.85	5.28	5.03	4.95
1W	6.02	6.01	5.90	5.38	5.26	5.22
2W	6.06	6.06	5.96	5.58	5.53	5.49
1M	6.18	6.18	6.13	6.12	6.07	6.06
2M	6.65	6.67	6.66	6.69	6.65	6.65
3M	6.97	6.98	6.99	6.99	6.98	6.98
6M	7.17	7.17	7.19	7.19	7.19	7.18



Обзор финансовых инструментов за период с 23.01.11 по 27.01.12

(часть 2)

