Локальный рынок

Государственные облигации	2
Муниципальные выпуски	5
Банки (рейтинг "BB-" и выше)	9
Банки (рейтинг "B+" и ниже)	16
Ипотечные бумаги	18
Лизинг	20
Нефть и газ	24
Металлургия и добыча	28
Розничная торговля	31
Транспорт	34
Связь, телекоммуникации и технологии	37
Электроэнергетика	40
Машиностроение	43
Химия	45
Строительство и недвижимость	47
Сельское хозяйство	50
Прочие выпуски	52

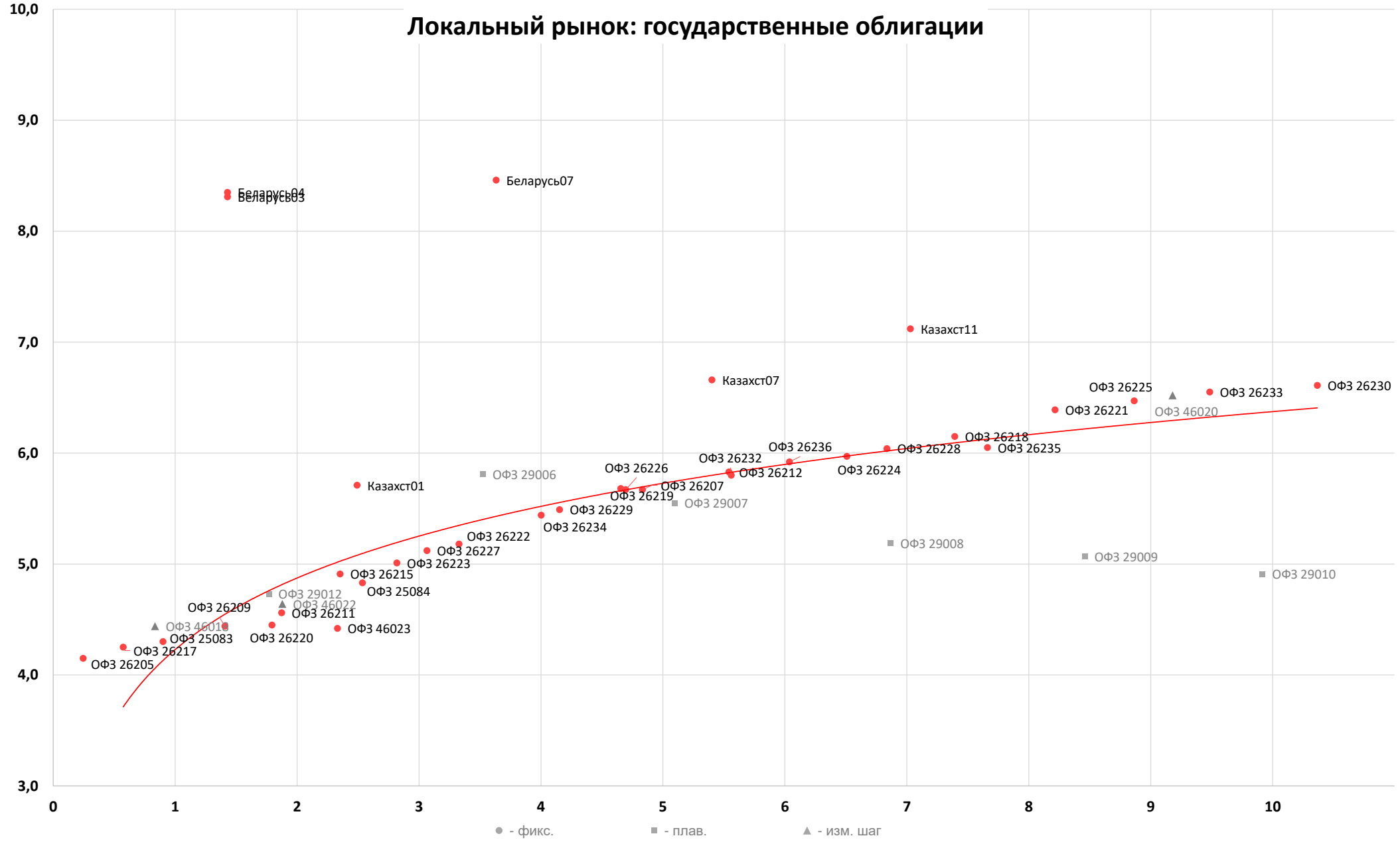
Еврооблигации

Суверенные выпуски	56
Банки с госучастием	58
Частные банки	60
Нефть и газ	62
Металлургия и добыча	64
Прочие	66
Выпуски в евро	68
Выпуски в рублях	70
Выпуски во франках	72
Выпуски в прочих валютах	74

Департамент по работе на

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк


Локальный рынок: государственные облигации
10,0
9,0
8,0
7,0
6,0
5,0
4,0
3,0
0
1
2
3
4
5
6
7
8
9
10
Беларусь04
Беларусь03
Беларусь07
Казахст11
Казахст07
Казахст01
ОФЗ 26225
ОФЗ 26233
ОФЗ 26230
ОФЗ 26221
ОФЗ 46020
ОФЗ 26218
ОФЗ 26236
ОФЗ 26228
ОФЗ 26235
ОФЗ 26232
ОФЗ 26212
ОФЗ 26224
ОФЗ 29006
ОФЗ 26226
ОФЗ 26207
ОФЗ 26219
ОФЗ 29007
ОФЗ 26229
ОФЗ 26234
ОФЗ 26222
ОФЗ 26227
ОФЗ 26223
ОФЗ 29008
ОФЗ 29009
ОФЗ 29010
ОФЗ 26215
ОФЗ 25084
ОФЗ 29012
ОФЗ 46022
ОФЗ 26209
ОФЗ 26211
ОФЗ 46010
ОФЗ 46023
ОФЗ 25083
ОФЗ 26220
ОФЗ 26217
ОФЗ 26205
● - фикс.
■ - плав.
▲ - изм. шаг

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность		РЕПО	Диск.	Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн			Разм.	Оферта	Погаш.		
Беларусь03	5,00	1,43	фикс.	8,65	2	100,69	100,67	8,31	8,34		16,37		Нет		07.08.2019		03.08.2022	B / B3u / B	RU000A100D30
Беларусь04	5,00	1,43	фикс.	8,65	2	100,66	100,65	8,35	8,36		4,278		Нет		07.08.2019		03.08.2022	B / B3u / B	RU000A100D63
Беларусь07	10,00	3,63	фикс.	8,50	2	100,73	100,59	8,46	8,50		36,20		Да	0	07.05.2020		01.05.2025	B / B3u / B	RU000A100D89
Казахст01	20,00	2,49	фикс.	5,40	2	99,43	99,23	5,71	5,79		0,271		Да	0	23.09.2020		20.09.2023	BBB- / Baa3 / BBB	RU000A101RP4
Казахст07	10,00	5,40	фикс.	6,55	2	99,97	99,97	6,66	6,66		1,242		Да	0	23.09.2020		15.09.2027	BBB- / Baa3 / BBB	RU000A101RV2
Казахст11	10,00	7,03	фикс.	7,00	2	99,98	100,00	7,12	7,12		19,46		Да	0	23.09.2020		11.09.2030	BBB- / Baa3 / BBB	RU000A101RZ3
ОФЗ 24020	100,00		плав.	#N/A N/A	4	99,80	99,81				10,12		Да	0	21.08.2019		27.07.2022	BBB- / Baa3 / BBB	SU24020RMFS8
ОФЗ 24021	300,00		плав.	#N/A N/A	4	98,96	98,90						Да	0	29.01.2020		24.04.2024	BBB- / Baa3 / BBB	SU24021RMFS6
ОФЗ 25083	350,00	0,90	фикс.	7,00	2	102,43	102,42	4,30	4,32				Да	0	11.10.2017		15.12.2021	BBB- / Baa3 / BBB	SU25083RMFS5
ОФЗ 25084	151,48	2,54	фикс.	5,30	2	101,33	101,33	4,83	4,83		62,75		Да	0	19.02.2020		04.10.2023	BBB- / Baa3 / BBB	SU25084RMFS3
ОФЗ 26205	150,00	0,25	фикс.	7,60	2	100,83	100,81	4,15	4,22		136,9		Да	0	13.04.2011		14.04.2021	BBB- / Baa3 / BBB	SU26205RMFS3
ОФЗ 26207	350,00	4,83	фикс.	8,15	2	113,01	113,05	5,67	5,66		100,7		Да	0	22.02.2012		03.02.2027	BBB- / Baa3 / BBB	SU26207RMFS9
ОФЗ 26209	293,58	1,41	фикс.	7,60	2	104,64	104,67	4,44	4,42		125,2		Да	0	01.08.2012		20.07.2022	BBB- / Baa3 / BBB	SU26209RMFS5
ОФЗ 26211	150,00	1,87	фикс.	7,00	2	104,78	104,87	4,56	4,51		77,26		Да	0	16.01.2013		25.01.2023	BBB- / Baa3 / BBB	SU26211RMFS1
ОФЗ 26212	350,00	5,54	фикс.	7,05	2	107,40	107,44	5,83	5,83		7,125		Да	0	23.01.2013		19.01.2028	BBB- / Baa3 / BBB	SU26212RMFS9
ОФЗ 26215	250,00	2,35	фикс.	7,00	2	105,16	105,17	4,91	4,90		41,61		Да	0	04.09.2013		16.08.2023	BBB- / Baa3 / BBB	SU26215RMFS2
ОФЗ 26217	290,00	0,58	фикс.	7,50	2	101,89	101,87	4,25	4,29		638,9		Да	0	04.02.2016		18.08.2021	BBB- / Baa3 / BBB	SU26217RMFS8
ОФЗ 26218	250,00	7,39	фикс.	8,50	2	119,00	119,35	6,15	6,11				Да	0	18.02.2016		17.09.2031	BBB- / Baa3 / BBB	SU26218RMFS6
ОФЗ 26219	350,00	4,65	фикс.	7,75	2	110,35	110,75	5,68	5,59				Да	0	29.06.2016		16.09.2026	BBB- / Baa3 / BBB	SU26219RMFS4
ОФЗ 26220	350,00	1,79	фикс.	7,40	2	105,38	105,40	4,45	4,44		67,20		Да	0	01.02.2017		07.12.2022	BBB- / Baa3 / BBB	SU26220RMFS2
ОФЗ 26221	350,00	8,22	фикс.	7,70	2	111,90	112,06	6,39	6,37		17,15		Да	0	15.03.2017		23.03.2033	BBB- / Baa3 / BBB	SU26221RMFS0
ОФЗ 26222	350,00	3,33	фикс.	7,10	2	106,63	106,76	5,18	5,16		30,52		Да	0	03.05.2017		16.10.2024	BBB- / Baa3 / BBB	SU26222RMFS8
ОФЗ 26223	339,42	2,82	фикс.	6,50	2	104,44	104,43	5,01	5,01		43,12		Да	0	01.03.2018		28.02.2024	BBB- / Baa3 / BBB	SU26223RMFS6
ОФЗ 26224	350,00	6,51	фикс.	6,90	2	106,65	106,74	5,97	5,95		55,09		Да	0	12.03.2018		23.05.2029	BBB- / Baa3 / BBB	SU26224RMFS4
ОФЗ 26225	350,00	8,87	фикс.	7,25	2	107,81	107,95	6,47	6,46				Да	0	01.03.2018		10.05.2034	BBB- / Baa3 / BBB	SU26225RMFS1
ОФЗ 26226	350,00	4,70	фикс.	7,95	2	111,40	111,70	5,67	5,61				Да	0	19.12.2018		07.10.2026	BBB- / Baa3 / BBB	SU26226RMFS9
ОФЗ 26227	400,00	3,07	фикс.	7,40	2	107,45	107,45	5,12	5,12		167,8		Да	0	27.03.2019		17.07.2024	BBB- / Baa3 / BBB	SU26227RMFS7
ОФЗ 26228	444,10	6,84	фикс.	7,65	2	111,94	112,10	6,04	6,02				Да	0	24.04.2019		10.04.2030	BBB- / Baa3 / BBB	SU26228RMFS5
ОФЗ 26229	450,00	4,15	фикс.	7,15	2	107,25	107,31	5,49	5,48		141,7		Да	0	05.06.2019		12.11.2025	BBB- / Baa3 / BBB	SU26229RMFS3
ОФЗ 26230	292,18	10,37	фикс.	7,70	2	112,65	112,96	6,61	6,58				Да	0	05.06.2019		16.03.2039	BBB- / Baa3 / BBB	SU26230RMFS1
ОФЗ 26231	212,64		фикс.	0,25	2								Да	0	26.07.2019		20.07.2044	BBB- / Baa3 / BBB	SU26231RMFS9
ОФЗ 26232	450,00	5,56	фикс.	6,00	2	101,54	101,45	5,80	5,82		24,76		Да	0	04.12.2019		06.10.2027	BBB- / Baa3 / BBB	SU26232RMFS7
ОФЗ 26233	126,27	9,48	фикс.	6,10	2	96,80	96,99	6,55	6,53				Да	0	19.02.2020		18.07.2035	BBB- / Baa3 / BBB	SU26233RMFS5
ОФЗ 26234	303,67	4,00	фикс.	4,50	2	96,58	96,58	5,44	5,44		3,206		Да	0	10.06.2020		16.07.2025	BBB- / Baa3 / BBB	SU26234RMFS3
ОФЗ 26235	21,57	7,66	фикс.	5,90	2	99,41	99,48	6,05	6,06		2,990		Да	0	28.10.2020		12.03.2031	BBB- / Baa3 / BBB	SU26235RMFS0
ОФЗ 26236	31,57	6,04	фикс.	5,70	2	99,20	99,23	5,92	5,91		359,6		Да	0	25.11.2020		17.05.2028	BBB- / Baa3 / BBB	SU26236RMFS8
ОФЗ 29006	390,29	3,53	плав.	6,55	2	102,92	102,90	5,81	5,82				Да	0	31.12.2014		29.01.2025	BBB- / Baa3 / BBB	SU29006RMFS2
ОФЗ 29007	190,29	5,10	плав.	6,31	2	104,30	104,41	5,55	5,53		2,365		Да	0	31.12.2014		03.03.2027	BBB- / Baa3 / BBB	SU29007RMFS0
ОФЗ 29008	190,29	6,87	плав.	6,08	2	106,64	106,64	5,19	5,19		1,606		Да	0	31.12.2014		03.10.2029	BBB- / Baa3 / BBB	SU29008RMFS8
ОФЗ 29009	190,29	8,46	плав.	5,89	2	107,51	107,43	5,07	5,08		2,123		Да	0	31.12.2014		05.05.2032	BBB- / Baa3 / BBB	SU29009RMFS6
ОФЗ 29010	190,29	9,92	плав.	5,76	2	109,13	109,08	4,91	4,91		22,67		Да	0	31.12.2014		06.12.2034	BBB- / Baa3 / BBB	SU29010RMFS4
ОФЗ 29012	212,42	1,77	плав.	4,79	2	100,20	100,19	4,73	4,73		45,53		Да	0	30.11.2016		16.11.2022	BBB- / Baa3 / BBB	SU29012RMFS0
ОФЗ 29013	427,47		плав.		4	96,80	96,81				0,528				08.04.2020		18.09.2030	BBB- / Baa3 / BBB	SU29013RMFS8
ОФЗ 29014	450,00		плав.		4	98,20	98,20				98,46				08.07.2020		25.03.2026	BBB- / Baa3 / BBB	SU29014RMFS6
ОФЗ 29015	409,80		плав.		4	97,45	97,49				0,006				23.09.2020		18.10.2028	BBB- / Baa3 / BBB	SU29015RMFS3
ОФЗ 29016	155,06		плав.		4	98,09	98,13				0,112				23.09.2020		23.12.2026	BBB- / Baa3 / BBB	SU29016RMFS1
ОФЗ 29017	350,63		плав.		4	97,01	97,01				1,432				14.10.2020		25.08.2032	BBB- / Baa3 / BBB	SU29017RMFS9
ОФЗ 29018	427,75		плав.		4	97,07	96,90								03.11.2020		26.11.2031	BBB- / Baa3 / BBB	SU29018RMFS7

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

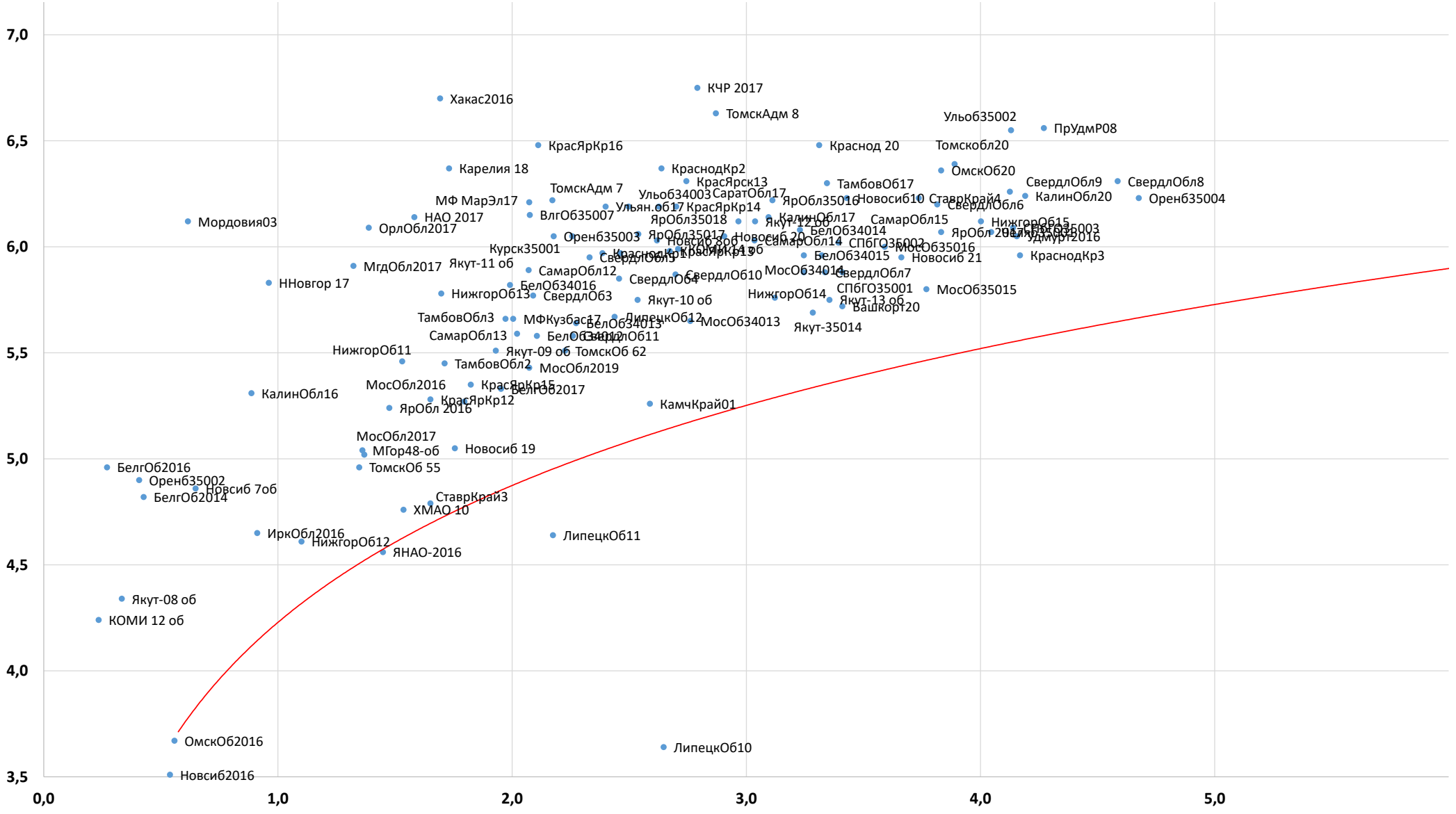
РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность		РЕПО	Диск.	Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн			Разм.	Оферта	Погаш.		

ОФЗ 29019	430,19		плав.	#N/A N/A	4,00	97,59	97,59			0,021	28.10.2020	18.07.2029	BBB- / Baa3 / BBB	SU29019RMFS5
ОФЗ 29020	294,54		плав.	#N/A N/A	4,00	97,74	97,70				11.11.2020	22.09.2027	BBB- / Baa3 / BBB	SU29020RMFS3
ОФЗ 46011	0,02	2,83	изм. шаг	10,00	1,00	133,00	133,67	-0,66	-1	0,004	14.02.2003	20.08.2025	BBB- / Baa3 / BBB	SU46011RMFS1
ОФЗ 46012	10,63	6,34	изм. шаг	9,72	1,00	150,03	150,03	0,35	0	0,004	14.02.2003	05.09.2029	BBB- / Baa3 / BBB	SU46012RMFS9
ОФЗ 46018	51,57	0,84	изм. шаг	6,50	4,00	101,78	101,85	4,44	4	0,401	16.03.2005	24.11.2021	BBB- / Baa3 / BBB	SU46018RMFS6
ОФЗ 46020	34,21	9,18	изм. шаг	6,90	2,00	104,50	104,57	6,52	7	3,993	15.02.2006	06.02.2036	BBB- / Baa3 / BBB	SU46020RMFS2
ОФЗ 46022	27,52	1,88	изм. шаг	5,50	2,00	101,73	101,67	4,64	5	0,474	23.01.2008	19.07.2023	BBB- / Baa3 / BBB	SU46022RMFS8
ОФЗ 46023	177,00	2,33	фикс.	8,16	2,00	109,00	109,38	4,42	4	0,005	30.09.2011	23.07.2026	BBB- / Baa3 / BBB	SU46023RMFS6
ОФЗ 52001	186,48	2,50	инфл. фикс	2,50	2,00	103,38	103,43	1,17	1	4,829	17.07.2015	16.08.2023	/ /	SU52001RMFS3
ОФЗ 52002	274,81	6,45	инфл. фикс	2,50	2,00	101,79	101,70	2,24	2		05.04.2018	02.02.2028	/ /	SU52002RMFS1
ОФЗ 52003	130,95	8,44	инфл. фикс	2,50	2,00	100,94	100,98	2,40	2		17.09.2020	17.07.2030	/ /	SU52003RMFS9

7,5

Локальный рынок: муниципальные выпуски



15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
Башкорт20	5,00	3,41	фикс.	5,90	4	101,00		5,72		29			Да	2	30.09.2020		24.09.2025	NR / Ba1 / BBB*	RU000A1026B3
БелгОб2014	0,25	0,43	фикс.	10,65	4	102,78	102,77	4,82	4,22	-121	0,391		Да	2	30.06.2014		21.06.2021	/ / WD	RU000A0JUQB7
БелгОб2016	1,75	0,27	фикс.	9,81	4	101,31	101,34	4,96	4,84	-59	0,065		Да	2	14.06.2016		08.06.2021	/ / WD	RU000A0JWKB6
БелгОб2017	4,00	1,95	фикс.	8,25	4	105,98		5,33		-10		95,4	Да	2	20.06.2017		11.06.2024	/ / WD	RU000A0JXTW1

БелОб34012	2,00	2,11	фикс.	7,80	4	105,00		5,58		15			Да	2	12.08.2019	05.08.2024	/ WR / WD*	RU000A100PP0
БелОб34013	2,00	2,27	фикс.	7,00	4	103,39		5,64		21			Да	2	22.10.2019	15.10.2024	/ WR / WD*	RU000A100Y84
БелОб34014	3,00	3,23	фикс.	5,90	4	99,84	99,83	6,08	6,09	66		10,0	Да	2	22.05.2020	16.05.2025	/ WR / WD*	RU000A101PA0
БелОб34015	2,70	3,25	фикс.	5,80	4	99,90	99,90	5,96	5,96	53		9,4	Нет		04.06.2020	29.05.2025	/ WR / WD*	RU000A101RB4
БелОб34016	4,50	1,99	фикс.	5,70	4	100,00	100,00	5,82	5,82	39		9,8	Нет		24.09.2020	18.09.2025	/ WR / WD*	RU000A1025F6
ВлгОб35007	10,00	2,08	фикс.	8,65	4	104,81	104,75	6,15	6,18	75	0,186	83,3	Нет		02.06.2017	02.06.2024	/ / WD	RU000A0JXSD3
ИркОбл2016	2,50	0,91	фикс.	9,25	4	104,31	104,31	4,65	4,62	-81	0,078		Да	2	26.12.2016	25.12.2021	NR / /	RU000A0JX314
КалинОбл16	0,80	0,89	фикс.	10,50	4	104,71	104,61	5,31	5,43	0	0,341		Нет		23.12.2016	17.12.2021	/ / *	RU000A0JX2S9
КалинОбл17	1,71	3,10	фикс.	7,91	4	105,96	105,87	6,14	6,17	74	0,269		Нет		19.12.2017	17.12.2024	/ / *	RU000A0ZYKU8
КалинОбл20	2,00	4,19	фикс.	6,10	4	100,00	100,00	6,24	6,24	81	0,569		Нет		23.12.2020	16.06.2027	/ / *	RU000A102KN2
КамчКрай01	1,00	2,59	фикс.	9,05	4	110,44	110,43	5,26	5,26	-17			Да	2	13.11.2018	11.11.2024	/ / *	RU000A0ZZSW4
Карелия 18	2,00	1,73	фикс.	8,00	4	103,10	103,10	6,37	6,37	94	23,97		Нет		16.10.2017	15.10.2023	/ / WD	RU000A0ZYCZ4
Карелия 19	2,00		фикс.	8,45	4	106,36		5,52		9			Нет		26.12.2018	24.12.2025	/ / WD*	RU000A0ZZZV1
КировОбл01	0,00		фикс.	8,50	4	105,75		6,74		131			Нет		14.12.2018	05.12.2025	/ / BB-	RU000A0ZZXZ7
КОМИ 12 об	4,00	0,24	изм. шаг	11,50	2	101,72	101,72	4,24	4,29	-114			Да	2	01.07.2015	23.06.2021	/ / WD	RU000A0JVKF9
КОМИ 13 об	2,17		фикс.	9,50	4								Нет		23.11.2016	16.11.2022	/ Ba3 / WD*	RU000A0JWZM1
КОМИ 14 об	10,00	2,71	фикс.	8,40	4	107,00	107,00	5,99	5,99	56			Да	2	27.06.2017	25.06.2024	/ Ba3 / WD*	RU000A0JXUD9
Краснод 20	1,60	3,31	фикс.	6,70	4	101,20	101,25	6,48	6,47	104	0,522		Нет		24.12.2020	23.12.2025	NR / Ba3 / WD*	RU000A102KT9
КраснодКр1	10,00	2,39	фикс.	8,60	4	106,72	106,90	5,97	5,90	47	192,7	73,7	Да	2	11.08.2017	09.08.2024	/ / WD	RU000A0JXYS9
КраснодКр2	10,00	2,64	фикс.	7,63	4	104,11	104,23	6,37	6,17	74	0,105	250,0	Да	2	05.06.2018	03.06.2025	NR / Ba3 / WD*	RU000A0ZZ8X4
КраснодКр3	10,00	4,17	фикс.	6,95	4	104,75	104,70	5,96	5,97	54	0,516	37,7	Да	2	14.11.2019	12.11.2026	NR / Ba3 / WD*	RU000A1011B5
КрасЯрКр12	13,67	1,65	фикс.	9,75	2	107,52	107,89	5,28	5,07	-36			Да	2	02.11.2016	25.10.2023	/ / BB+	RU000A0JWXF0
КрасЯрКр13	10,00	2,67	фикс.	7,85	4	105,38	105,04	5,98	6,11	68			Да	2	12.10.2017	03.10.2024	/ / BB+	RU000A0ZYCM2
КрасЯрКр14	7,80	2,70	фикс.	7,84	4	104,93	104,98	6,19	6,16	73		101,0	Да	2	09.11.2017	31.10.2024	BB / / BB+*	RU000A0ZYFB8
КрасЯрКр15	12,00	1,82	фикс.	7,64	4	104,45		5,35		-8			Да	2	05.07.2018	26.06.2025	/ / BB+	RU000A0ZZC48
КрасЯрКр16	12,00	2,11	фикс.	8,70	4	105,02	105,02	6,48	6,48	105			Да	2	21.09.2018	12.09.2025	BB / / BB+*	RU000A0ZZM87
КрасЯрск13	3,00	2,75	фикс.	6,25	4	100,23	100,23	6,31	6,31	88			Нет		22.10.2020	16.10.2025	/ / WD*	RU000A1029G6
Курск35001	0,98	2,26	фикс.	7,96	4	104,69	104,50	6,05	6,13	70	9,269		Да	2	10.10.2017	12.10.2025	/ / *	RU000A0ZYCD1
КЧР 2017	1,75	2,79	фикс.	8,70	4	105,96	105,96	6,75	6,75	132	0,919		Нет		20.12.2017	18.12.2024	/ / *	RU000A0ZYL22
ЛенОбл2014	0,03		фикс.	12,85	4	151,96		-30,16		-3559			Да	2	16.12.2014	07.12.2021	/ / WD	RU000A0JV2J0
ЛипецкОб10	1,80	2,65	фикс.	8,57	4	114,02		3,64		-179			Да	2	30.10.2018	21.10.2025	/ / BB+	RU000A0ZZR33
ЛипецкОб11	2,00	2,18	фикс.	6,60	4	104,47	104,47	4,64	4,64	-79			Да	2	28.11.2019	21.11.2024	/ / BB+	RU000A1013T3
ЛипецкОб12	2,50	2,44	фикс.	5,75	4	100,48		5,67		24			Да	2	22.09.2020	16.09.2025	/ / BB+	RU000A102598
МгдОбл2017	0,70	1,32	фикс.	8,00	4	102,92	102,89	5,91	5,94	51			Нет		20.12.2017	25.12.2022	NR / / *	RU000A0ZYL48
МГор48-об	30,00	1,36	изм. шаг	6,00	2	101,78	101,75	5,04	4,75	-68	1,663	58,8	Да	2	11.12.2006	11.06.2022	BBB- / / BBBu	RU000A0JNYN1
МГор69-об	40,00		фикс.	7,50	2								Нет		26.11.2013	18.05.2021	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A0JU5W7
Мордовия03	2,00	0,62	фикс.	11,70	4	103,52	103,55	6,12	6,07	64	4,342		Да	—	09.09.2016	03.09.2021	/ / WD	RU000A0JWSQ7
МосОб34013	14,00	2,76	фикс.	6,55	4	102,81		5,65		22			Да	2	27.12.2019	20.12.2024	NR / Ba1 / BBB-*	RU000A101988
МосОб34014	14,00	3,25	фикс.	5,75	4	100,00	99,90	5,88	5,91	48	0,038	10,0	Да	2	14.07.2020	08.07.2025	NR / Ba1 / BBB-*	RU000A101WL3
МосОб35015	30,00	3,77	фикс.	5,95	4	100,46	100,52	5,80	5,94	51	0,579	103,8	Нет		17.11.2020	10.11.2026	NR / Ba1 / BBB-*	RU000A102CR0
МосОб35016	30,00	3,59	фикс.	5,95	4	100,30	100,00	6,00	6,08	65		50,4	Нет		08.12.2020	30.11.2027	NR / Ba1 / BBB-*	RU000A102G35
МосОбл2016	22,50	1,80	фикс.	9,65	4	108,24	108,21	5,27	5,29	-14	0,060		Да	2	29.11.2016	21.11.2023	/ / BBB-u	RU000A0JX0B9
МосОбл2017	6,25	1,37	фикс.	7,50	4	103,61	103,69	5,02	4,90	-53	0,148	32,9	Да	2	28.12.2017	22.12.2022	/ / BBB-u	RU000A0ZYML3
МосОбл2019	25,00	2,07	фикс.	7,05	4	103,59	103,71	5,43	5,36	-7	0,346		Да	2	15.10.2019	08.10.2024	NR / Ba1 / BBB-*	RU000A100XP4

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
МФ МарЭл17	2,00	2,07	фикс.	8,60	4	105,29	105,29	6,21	6,21	78		9,0	Нет		30.08.2017		21.08.2024	/ / BB	RU000A0JY031
МФКузбас17	9,00	2,01	фикс.	8,20	4	105,34	105,34	5,66	5,66	23			Да	2	26.09.2017		26.09.2024	/ / WD	RU000A0ZYB40
НАО 2017	1,20	1,58	фикс.	7,80	4	102,85	102,84	6,14	6,14	71	0,462		Да	2	09.11.2017		07.11.2024	/ / *	RU000A0ZYF61
НижгорОб11	7,50	1,53	фикс.	10,25	4	107,58	107,04	5,46	5,81	38	0,232	94,1	Да	2	22.06.2016		22.06.2023	/ / BB	RU000A0JWLD0
НижгорОб12	6,00	1,10	фикс.	8,10	4	104,00	103,81	4,61	4,78	-65			Да	2	23.10.2017		23.10.2022	/ / BB	RU000A0ZYDQ1
НижгорОб13	8,00	1,70	фикс.	8,68	4	105,15		5,78		35			Нет		22.11.2018		24.05.2024	/ / BB	RU000A0ZZUT6

НижгорОб14	10,00	3,12	фикс.	6,75	4	103,49		5,76		33		23,3	Нет		13.12.2019	14.06.2025	/ / BB	RU000A101665
НижгорОб15	10,00	4,00	фикс.	6,10	4	100,45	99,86	6,12	6,28	85	0,902		Нет		24.11.2020	27.05.2026	/ / BB	RU000A102DS6
ННовгор 17	5,00	0,96	фикс.	8,10	4	102,29	102,29	5,83	5,83	40	11,76		Нет		05.12.2017	05.12.2022	NR / / BB-*	RU000A0ZYJ00
Новосиб 19	3,75	1,76	фикс.	8,57	4	106,50		5,05		-38			Да	2	16.10.2018	15.10.2023	/ / BBB-	RU000A0ZZPB4
Новосиб 20	5,00	2,91	фикс.	6,50	4	101,70	101,18	6,05	6,24	81			Да	2	15.11.2019	13.11.2024	/ / BBB-	RU000A1011Q3
Новосиб 21	5,00	3,66	фикс.	5,85	4	100,10		5,95		52			Нет		15.10.2020	14.10.2025	/ / BBB-	RU000A102895
Новосиб10	4,50	3,43	фикс.	7,30	4	104,22	104,22	6,23	6,23	80			Нет		10.10.2019	08.10.2026	/ / BB	RU000A100WF7
Новсиб 7об	0,80	0,65	фикс.	12,36	4	104,85	104,90	4,86	4,78	-65	0,125		Да	2	12.10.2015	10.10.2022	NR / / BB	RU000A0JVUD3
Новсиб 8об	2,10	2,62	фикс.	10,20	4	110,25		6,03		60			Да	2	30.05.2016	28.05.2026	/ / BB	RU000A0JWHW8
Новсиб 9об	5,00		фикс.	7,85	4	141,49		-4,57		-1000			Нет		29.11.2017	27.11.2027	/ / BB	RU000A0ZYH93
Новсиб2016	2,50	0,54	фикс.	8,93	4	103,00	103,50	3,51	2,60	-283			Да	2	04.10.2016	03.10.2021	/ / BBB-	RU000A0JWUV3
Новсиб2017	5,00	1,24	фикс.	7,85	4	110,00		0,06		-537		100,0	Да	2	28.09.2017	27.09.2022	/ / BBB-	RU000A0ZYBD3
ОмскОб20	5,00	3,83	фикс.	6,45	4	100,90	100,89	6,36	6,36	93	0,338	31,5	Нет		24.11.2020	24.11.2025	/ Ba3 / *	RU000A102DR8
ОмскОб2016	3,50	0,56	фикс.	9,30	4	103,20	103,20	3,67	3,67	-176			Да	2	01.11.2016	01.11.2021	/ Ba3 / *	RU000A0JWX87
Оренб35002	0,30	0,41	фикс.	11,00	4	102,50	102,53	4,90	4,82	-61			Да	2	23.06.2014	14.06.2021	/ / BB+	RU000A0JUPE3
Оренб35003	5,00	2,18	фикс.	14,00	4	118,10	118,34	6,05	5,93	50	2,369		Да	2	16.07.2015	03.07.2025	/ / BB+	RU000A0JVM81
Оренб35004	4,00	4,68	фикс.	8,18	4	110,06	111,49	6,23	5,94	51		24,4	Да	2	14.12.2017	02.12.2027	/ / BB+	RU000A0ZYKH5
ОрлОбл2017	3,50	1,39	фикс.	8,30	4	103,26	103,24	6,09	6,10	67	0,324		Нет		27.11.2017	26.11.2022	/ / *	RU000A0ZYGM3
ПрУдмР08	10,00	4,27	фикс.	6,40	4	100,00		6,56		113			Нет		29.12.2020	28.12.2025	/ WR / WD*	RU000A102M37
СамарОбл10	0,60	0,45	фикс.	10,00	4	102,86	103,01	3,41	3,39	-204	0,439		Да	2	10.07.2014	01.07.2021	BB+ / /	RU000A0JUQP7
СамарОбл12	9,00	2,07	фикс.	9,64	4	108,21	108,30	5,89	5,82	39	1,251	108,9	Да	2	01.07.2016	21.06.2024	BB+ / /	RU000A0JWM56
СамарОбл13	9,00	2,02	фикс.	8,19	4	105,55		5,59		16			Да	2	09.06.2017	31.05.2024	BB+ / Ba2 /	RU000A0JXT41
СамарОбл14	6,40	3,04	фикс.	7,45	4	104,75	104,75	6,03	6,03	60		192,0	Да	2	14.06.2018	04.06.2026	BB+ / Ba2 /	RU000A0ZZ9P8
СамарОбл15	5,00	3,32	фикс.	5,80	4	99,88	99,61	5,96	6,05	62			Нет		11.08.2020	04.08.2026	BB+ / /	RU000A1020L5
СаратОбл17	5,00	2,63	фикс.	8,10	4	105,47	105,29	6,19	6,25	82	0,140		Нет		22.11.2017	20.11.2024	/ / *	RU000A0ZYG60
СвердлОб10	10,00	2,70	фикс.	5,80	4	100,15		5,87		44		5,6	Нет		24.11.2020	23.11.2024	/ / BB+	RU000A102DQ0
СвердлОб11	10,00	2,26	фикс.	5,70	4	100,53	100,36	5,58	5,65	22			Нет		16.12.2020	16.12.2023	/ / BB+	RU000A102HF4
СвердлОб3	4,00	2,09	фикс.	9,80	4	108,90	107,71	5,77	6,32	89	0,159	50,9	Да	2	17.11.2016	15.11.2024	/ / BB+	RU000A0JWZ77
СвердлОб4	10,00	2,46	фикс.	7,70	4	104,93	104,62	5,85	5,98	55			Да	2	24.10.2017	22.10.2025	/ / BB+	RU000A0ZYDU3
СвердлОбл5	4,00	2,33	фикс.	8,68	4	106,70	106,70	5,95	5,95	52	0,321	44,4	Да	2	25.10.2018	23.10.2026	/ / BB+	RU000A0ZZQH9
СвердлОбл6	5,00	3,82	фикс.	6,70	4	102,45	102,45	6,20	6,20	77	0,102		Да	2	17.12.2019	15.12.2026	/ / BB+	RU000A1016N9
СвердлОбл7	10,00	3,34	фикс.	5,80	4	100,15	100,15	5,88	5,88	45		57,1	Да	2	29.06.2020	28.06.2025	/ / BB+	RU000A101UG7
СвердлОбл8	12,00	4,59	фикс.	6,10	4	99,70	99,81	6,31	6,28	85	0,174	12,1	Да	2	30.07.2020	29.07.2027	/ / BB+	RU000A101Z17
СвердлОбл9	8,00	4,13	фикс.	6,25	4	100,55		6,26		83		10,2	Нет		18.11.2020	17.11.2027	/ / BB+	RU000A102CT6
СПбГО35001	30,00	3,41	фикс.	7,70	2	106,50	106,50	5,88	5,88	45	0,557	197,0	Да	2	06.12.2017	28.05.2025	/ / BBB	RU000A0ZYHX8
СПбГО35002	25,00	3,39	фикс.	7,65	2	105,80	105,80	6,02	6,02	59	97,63	288,0	Да	2	15.12.2017	04.12.2026	/ / BBB	RU000A0ZYKJ1
СПбГО35003	30,00	4,14	фикс.	6,05	2	100,20	100,23	6,09	6,08	65	0,790	49,9	Да	2	27.10.2020	13.04.2027	/ / BBB	RU000A102A15
СПбГО35004	30,00	6,28	фикс.	5,90	2	101,00		5,80		37			Нет		23.12.2020	28.09.2028	/ / BBB	RU000A102K88
СтаврКрай3	3,60	1,65	фикс.	9,80	4	108,67	108,67	4,79	4,79	-64	0,002		Да	2	08.11.2016	07.11.2023	/ / BB+	RU000A0JWY29
СтаврКрай4	0,01	3,74	фикс.	6,20	4	100,40	100,40	6,23	6,23	80	0,101		Нет		15.12.2020	14.12.2027	NR / / BB+*	RU000A102H34
ТамбовОб17	3,00	3,35	фикс.	8,00	4	106,26		6,30		87			Нет		05.12.2017	05.12.2025	/ / WD*	RU000A0ZYJ18
ТамбовОбл2	1,20	1,71	фикс.	9,60	4	107,40	107,40	5,45	5,45	2	0,012		Да	2	20.09.2016	20.09.2023	/ / WD	RU000A0JWT75

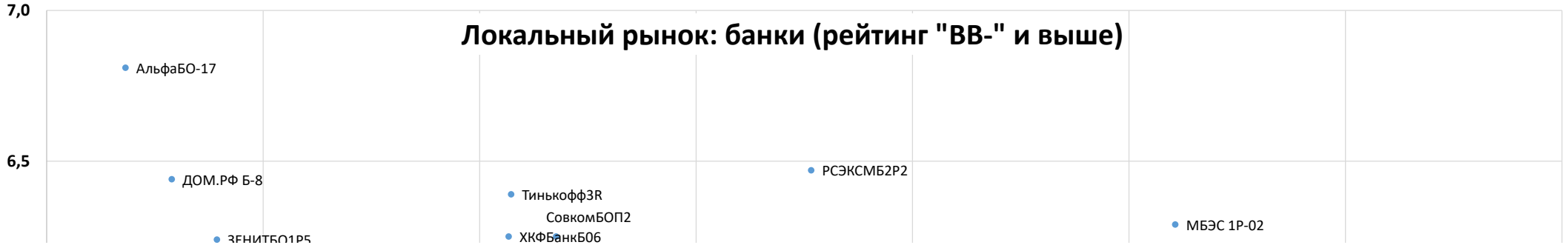
Департамент по работе на рынках капитала

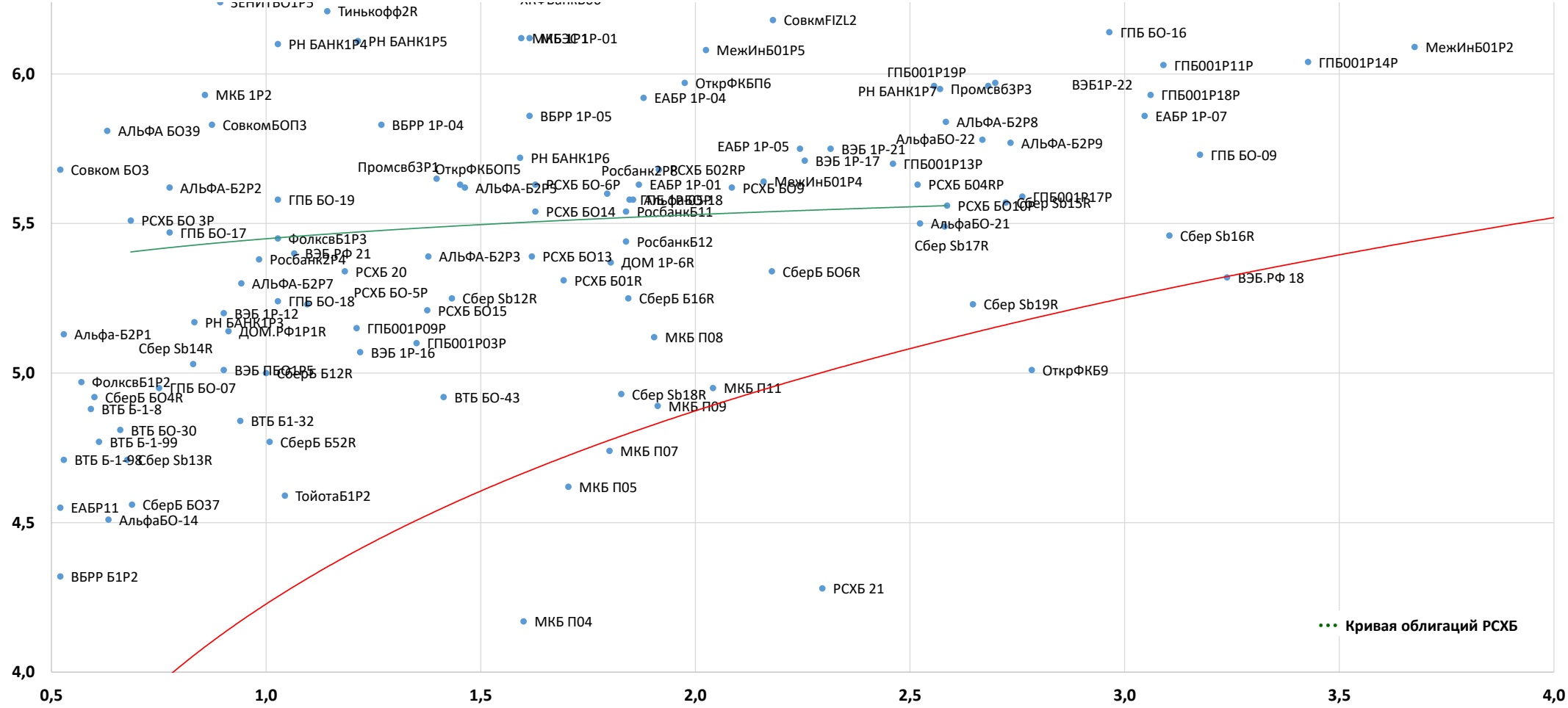
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ТамбовОбл3	3,50	1,97	фикс.	8,40	4	105,75	105,75	5,66	5,66	23			Да	2	12.07.2017		12.07.2024	/ / WD*	RU000A0JXVH8
ТомскАдм 6	0,40		фикс.	9,83	4	100,00		10,19		476			Нет		15.11.2016		14.11.2021	/ / WD	RU000A0JWZ10
ТомскАдм 7	1,00	2,17	фикс.	7,37	4	102,80	102,80	6,22	6,22	79			Нет		24.12.2019		22.12.2024	/ / WD*	RU000A1018A2
ТомскАдм 8	1,00	2,87	фикс.	6,70	4	100,66	100,66	6,63	6,63	120	5,036		Нет		28.12.2020		27.12.2025	/ / WD*	RU000A102LR1
ТомскОб 55	5,25	1,35	фикс.	9,90	4	106,82	106,87	4,96	4,92	-51			Нет		28.12.2015		19.06.2023	BB- / / *	RU000A0JW1K9
ТомскОб 62	7,00	2,23	фикс.	7,50	4	104,69	104,69	5,51	5,51	8			Нет		28.12.2017		19.12.2024	BB- / /	RU000A0ZYMJ7
Томскобл20	5,00	3,89	фикс.	6,70	4	101,79	101,79	6,39	6,39	96	1,259		Нет		17.09.2020		23.07.2027	BB- / / *	RU000A1024L7
Удмурт2016	5,00	4,16	фикс.	10,55	4	120,50	120,76	6,05	6,00	57	0,444		Да	—	21.09.2016		19.09.2026	/ / WD	RU000A0JWT91

Ульоб34003	3,50	2,50	фикс.	6,25	4	100,50	100,19	6,19	6,32	89			Нет		18.11.2020	12.11.2025	/ / WD*	RU000A102CX8
Ульоб35002	7,00	4,13	фикс.	6,60	2	100,66	100,81	6,55	6,51	108	0,474	22,7	Нет		26.06.2020	25.06.2027	/ / WD*	RU000A101U61
Ульян.об17	5,00	2,40	фикс.	8,10	4	104,95	104,98	6,19	6,18	75	0,423		Нет		07.12.2017	07.12.2024	/ / WD*	RU000A0ZYJB0
ХабарКрай7	4,12	3,05	фикс.	9,00	4	119,42		3,22		-221			Нет		26.10.2018	24.10.2025	/ / *	RU000A0ZZQQ0
Хакас2016	5,00	1,69	фикс.	11,70	4	109,01	109,02	6,70	6,69	126	3,114		Да	—	03.11.2016	02.11.2023	/ / WD	RU000A0JWXQ7
ХМАО 10	4,20	1,54	фикс.	9,15	4	106,98		4,76		-67		20,0	Да	2	19.12.2016	18.12.2023	NR / / WD*	RU000A0JX215
ХМАО 11	7,00	1,98	фикс.	7,60	4	111,79		1,83		-360			Да	2	19.12.2017	17.12.2024	NR / / WD*	RU000A0ZYKW4
Челяб35001	7,00	4,05	фикс.	6,00	4	100,25	100,34	6,07	6,05	62			Нет		08.12.2020	30.11.2027	/ / BBB	RU000A102FV5
Челяб35002	8,00		фикс.	6,00	4								Нет		25.12.2020	17.12.2027	/ / BBB	RU000A102L61
Челяб35003	8,00		фикс.	6,00	4								Нет		25.12.2020	17.12.2027	/ / BBB	RU000A102L79
Якут 35006	0,25	0,46	фикс.	10,10	4	103,25	103,25	2,99	2,99	-244			Да	2	02.07.2014	02.07.2021	NR / / BBB-	RU000A0JUQH4
Якут-08 об	1,65	0,33	фикс.	10,29	4	102,00	101,80	4,34	4,95	-48		6,9	Да	2	18.05.2016	18.05.2021	NR / / BBB-	RU000A0JWGT6
Якут-09 об	4,25	1,93	фикс.	8,59	4	106,27	106,27	5,51	5,51	8		16,5	Да	2	18.05.2017	16.05.2024	NR / / BBB-*	RU000A0JXR43
Якут-10 об	4,95	2,54	фикс.	7,55	4	104,92	104,92	5,75	5,75	32			Да	2	24.05.2018	15.05.2025	/ / BBB-	RU000A0ZZ7E6
Якут-11 об	6,00	2,46	фикс.	8,95	4	107,78	107,81	5,97	5,96	53	0,068		Да	2	03.10.2018	24.09.2025	NR / / BBB-*	RU000A0ZZNJ2
Якут-12 об	7,00	3,04	фикс.	8,59	4	107,85	107,85	6,12	6,20	77	0,298		Да	2	22.05.2019	13.05.2026	/ / BBB-	RU000A100CN3
Якут-13 об	5,00	3,36	фикс.	6,95	4	104,48		5,75		32			Да	2	11.11.2019	02.11.2026	/ / BBB-	RU000A1010D3
Якут-35014	5,50	3,28	фикс.	6,49	4	103,00	103,20	5,69	5,63	20			Да	2	20.05.2020	12.05.2027	/ / BBB-	RU000A101P27
ЯНАО-2016	6,00	1,45	фикс.	9,37	4	107,08	107,31	4,56	4,48	-95	0,428		Да	2	07.12.2016	06.12.2023	/ / BBB	RU000A0JX0Z8
ЯНАО2017-2	4,40		фикс.	7,00	4	100,00		7,18		175			Нет		27.12.2017	25.12.2024	/ / BBB	RU000A0ZYM47
ЯрОбл 2016	2,70	1,48	фикс.	10,00	4	107,33	107,29	5,24	5,26	-17		123,4	Да	2	27.05.2016	19.05.2023	/ / BB	RU000A0JWHN7
ЯрОбл 2017	10,00	3,83	фикс.	8,40	4	109,79		6,07		64			Да	2	01.06.2017	20.04.2027	/ / BB	RU000A0JXS83
ЯрОбл35016	3,00	3,11	фикс.	7,95	4	105,86	105,86	6,22	6,22	79			Нет		30.07.2018	21.09.2025	/ / BB	RU000A0ZZEM5
ЯрОбл35017	3,00	2,54	фикс.	7,95	4	105,24	105,24	6,06	6,06	63			Нет		12.08.2019	24.06.2025	/ / BB	RU000A100PR6
ЯрОбл35018	4,00	2,97	фикс.	6,00	4	100,00		6,12		69		11,0	Нет		15.07.2020	24.05.2026	/ / BB	RU000A101WD0





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АЛЬФА БО39	10,00	0,63	фикс.	7,35	2	101,00		5,81		38		0,8	Нет		06.03.2018	07.09.2021	17.03.2033	/ Ba1 /	RU000A0ZYWB3
АЛЬФА БО40	10,00	0,11	фикс.	7,35	2	100,59	100,59	1,78	1,78	-365		5,0	Нет		21.02.2018	23.02.2021	04.03.2033	/ Ba1 / BB+	RU000A0ZYU21
Альфа-Б2Р1	10,00	0,53	фикс.	7,90	2	101,50	101,43	5,13	5,27	-16	0,088	0,7	Нет		31.07.2018		02.08.2021	/ Ba1 /	RU000A0ZZEW4
АЛЬФА-Б2Р2	10,00	0,78	фикс.	8,95	2	102,60	102,68	5,62	5,51	8	4,255	0,8	Нет		30.10.2018		01.11.2021	/ Ba1 /	RU000A0ZZRB0
АЛЬФА-Б2Р3	5,00	1,38	фикс.	9,20	2	105,30	105,23	5,39	5,44	1	0,139	1,4	Нет		21.12.2018		24.06.2022	/ Ba1 /	RU000A0ZZZ66
АЛЬФА-Б2Р4	10,00	0,24	фикс.	8,55	2	100,95	100,90	4,55	4,76	-67	0,263	2,5	Нет		12.04.2019		13.04.2021	/ Ba1 /	RU000A100998
АЛЬФА-Б2Р5	8,00	1,46	фикс.	7,90	2	103,49	103,55	5,62	5,58	15		5,0	Нет		09.08.2019		11.08.2022	/ Ba1 /	RU000A100PQ8
АЛЬФА-Б2Р6	10,00	0,39	фикс.	5,75	2	100,35	100,36	4,86	4,83	-60		1,5	Нет		03.06.2020		04.06.2021	/ Ba1 /	RU000A101QP6
АЛЬФА-Б2Р7	6,00	0,94	фикс.	5,30	2	100,06	100,18	5,30	5,17	-26	3,124	4,4	Нет		08.10.2020		29.12.2021	/ Ba1 /	RU000A102788
АЛЬФА-Б2Р8	8,00	2,58	фикс.	5,90	2	100,34	100,21	5,84	5,90	47	9,411	5,4	Нет		27.10.2020		30.10.2023	/ Ba1 /	RU000A102A07
АЛЬФА-Б2Р9	8,00	2,73	фикс.	5,95	2	100,69	100,68	5,77	5,77	34	0,221		Нет		21.12.2020		24.12.2023	/ Ba1 /	RU000A102JZ8
АльфаБО-13	5,00	0,64	фикс.	5,30	2	101,98	101,98	2,22	2,22	-321		4,7	Да	—	18.09.2014	09.09.2021	30.08.2029	/ Ba1 / BB+	RU000A0JUU90

АльфаБО-14	5,00	0,63	фикс.	8,25	2	102,39	102,39	4,51	4,51	-92			Да	—	18.09.2014	09.09.2021	30.08.2029	/ Ba1 / BB+	RU000A0JUUA1
АльфаБО-15	5,00	0,36	фикс.	7,35	2	100,30		6,56		113			Да	—	02.12.2014	25.05.2021	13.11.2029	/ Ba1 / BB+	RU000A0JV0U1
АльфаБО-16	5,00	1,00	фикс.	7,80	2	107,90	107,90	0,27	0,27	-516			Да	—	11.08.2016	03.02.2022	24.07.2031	/ Ba1 / BB+	RU000A0JWPV3
АльфаБО-17	5,00	0,68	фикс.	9,50	2	101,87	101,87	6,81	6,81	138			Да	—	04.10.2016	28.09.2021	16.09.2031	/ Ba1 / BB+	RU000A0JWUX9
АльфаБО-18	5,00	1,85	фикс.	6,50	2	101,87	101,95	5,58	5,53	10	0,334	0,5	Да	—	23.01.2017	16.01.2023	05.01.2032	/ Ba1 / BB+	RU000A0JX5W4
АльфаБО-20	5,00	0,36	фикс.	5,80	2	100,14	100,34	5,45	4,86	-57		0,3	Нет		30.05.2017	25.05.2021	11.05.2032	/ Ba1 / BB+	RU000A0JXRV7
АльфаБО-21	5,00	2,52	фикс.	5,90	2	101,18	101,41	5,50	5,40	-3		0,1	Нет		02.10.2017	07.10.2023	13.10.2032	/ Ba1 /	RU000A0ZYBM4
АльфаБО-22	5,00	2,67	фикс.	5,70	2	100,00	99,93	5,78	5,81	38			Нет		23.11.2017	28.11.2023	04.12.2032	/ Ba1 /	RU000A0ZYGB6
АЛЬФА-БС01	5,00	3,07	фикс.	11,75	4	113,20		7,82		239			Нет		27.06.2019		ield Not Ap	/ Ba1 /	RU000A100GW5
БанкГПБ1Р1	8,00		фикс.	8,95	2	0,00		0,00		-543			Нет		26.10.2018		26.10.2023	/ Ba1 /	RU000A0ZZQU2
БанкГПБ1Р2	10,00		фикс.	8,95	2	0,00		0,00		-543			Нет		20.11.2018		20.11.2023	/ Ba1 /	RU000A0ZZUL3
ВБРР 1Р-03	5,00		фикс.	8,85	4	101,00		2,31		-312			Нет		15.03.2019	12.03.2021	08.03.2024	/ Ba2 /	RU000A100691
ВБРР 1Р-04	5,00	1,27	фикс.	6,50	4	101,00	101,00	5,83	5,83	40	1,234	0,3	Нет		15.05.2020	13.05.2022	09.05.2025	/ Ba2 /	RU000A101NQ1
ВБРР 1Р-05	5,00	1,61	фикс.	5,80	4	100,10		5,86		43			Нет		24.09.2020	22.09.2022	18.09.2025	/ Ba2 /	RU000A1025H2
ВБРР Б1Р2	5,00	0,52	фикс.	7,80	2	101,85	101,85	4,32	4,32	-111			Нет		02.02.2018		30.07.2021	/ Ba2 /	RU000A0ZYQX9
ВТБ Б1-135	0,24		фикс.	0,01	0	106,59	106,18	0,00		-543	0,080	0,3	Нет		03.11.2020		04.05.2021	/ Baa3 /	RU000A102754
ВТБ Б1-136	0,25		фикс.	0,01	2	96,23	96,23	0,00		-543			Нет		17.11.2020		15.11.2022	/ Baa3 /	RU000A102762
ВТБ Б1-137	0,15		фикс.	0,01	2	95,35		0,00		-543			Нет		17.11.2020		11.11.2025	/ Baa3 /	RU000A1027F2
ВТБ Б1-138	0,05		фикс.	0,01	2	99,00		0,00		-543			Нет		24.11.2020		18.11.2025	/ Baa3 /	RU000A1027G0
ВТБ Б1-139	0,39		фикс.	0,01	0	100,13	100,13	0,00		-543		0,3	Нет		24.11.2020		25.05.2021	/ Baa3 /	RU000A1027H8
ВТБ Б1-140	0,43		фикс.	0,01	0	100,22	100,22	0,00		-543	0,519	0,2	Нет		24.11.2020		25.05.2021	/ Baa3 /	RU000A1027J4
ВТБ Б1-141	0,04		фикс.	0,01	2	99,00		0,00		-543			Нет		01.12.2020		25.11.2025	/ Baa3 /	RU000A1027K2
ВТБ Б1-142	0,05		фикс.	0,01	2	95,03		0,00		-543			Нет		08.12.2020		02.12.2025	/ Baa3 /	RU000A1027L0
ВТБ Б1-146	0,31		фикс.	0,01	0	101,78	101,77	0,00		-543	0,206	0,2	Нет		17.11.2020		18.05.2021	/ Baa3 /	RU000A1027Q9
ВТБ Б1-147	0,36		фикс.	0,01	0	100,17		0,00		-543		0,2	Нет		17.11.2020		18.05.2021	/ Baa3 /	RU000A1027S5
ВТБ Б1-148	0,63		фикс.	0,01	2	97,21	97,20	0,00		-543		0,2	Нет		01.12.2020		08.12.2023	/ Baa3 /	RU000A1027T3
ВТБ Б1-149	0,27		фикс.	0,01	2	97,12	97,12	0,00		-543		0,2	Нет		24.11.2020		22.11.2022	/ Baa3 /	RU000A1027U1
ВТБ Б1-150	0,34		фикс.	0,01	0	99,49		0,00		-543		0,3	Нет		01.12.2020		01.06.2021	/ Baa3 /	RU000A1027V9
ВТБ Б1-151	0,44		фикс.	0,01	0	101,48		0,00		-543		0,5	Нет		01.12.2020		01.06.2021	/ Baa3 /	RU000A1027W7
ВТБ Б1-152	0,19		фикс.	0,01	2	97,38	97,38	0,00		-543			Нет		01.12.2020		29.11.2022	/ Baa3 /	RU000A1027X5
ВТБ Б1-153	0,07		фикс.	0,01	2	99,50		0,00		-543			Нет		15.12.2020		09.12.2025	/ Baa3 /	RU000A102EH7
ВТБ Б1-154	0,10		фикс.	0,01	2	99,50	99,50	0,00		-543			Нет		15.12.2020		22.12.2023	/ Baa3 /	RU000A102EJ3
ВТБ Б1-155	0,18		фикс.	0,01	0	99,50	99,75	0,00		-543			Нет		15.12.2020		15.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102EL9
ВТБ Б1-156	0,39		фикс.	0,01	0	104,99	102,96	0,00		-543			Нет		15.12.2020		15.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102EN5
ВТБ Б1-157	0,12		фикс.	0,01	2	99,50		0,00		-543			Нет		15.12.2020		13.12.2022	/ Baa3 /	RU000A102EP0
ВТБ Б1-159	0,13		фикс.	0,01	2	99,50	99,50	0,00		-543			Нет		22.12.2020		29.12.2023	/ Baa3 /	RU000A102ER6

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ВТБ Б1-160	0,32		фикс.	0,01	0	99,50	99,50	0,00		-543			Нет		22.12.2020		22.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102ES4
ВТБ Б1-161	0,37		фикс.	0,01	0	99,50	99,50	0,00		-543			Нет		22.12.2020		22.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102EU0
ВТБ Б1-162	0,11		фикс.	0,01	2	99,50		0,00		-543			Нет		22.12.2020		20.12.2022	/ Baa3 /	RU000A102EV8
ВТБ Б1-163	0,33		фикс.	0,01	0	99,56	99,56	0,00		-543		0,2	Нет		08.12.2020		08.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102EA2
ВТБ Б1-164	0,52		фикс.	0,01	0	101,25		0,00		-543		0,2	Нет		08.12.2020		08.06.2021	/ Baa3 /	RU000A102EB0
ВТБ Б1-165	0,13		фикс.	0,01	2	96,50		0,00		-543			Нет		08.12.2020		06.12.2022	/ Baa3 /	RU000A102EC8
ВТБ Б1-166	0,15		фикс.	0,01	2	97,00	96,60	0,00		-543	0,203	0,1	Нет		08.12.2020		15.12.2023	/ Baa3 /	RU000A102ED6
ВТБ Б1-32	0,37	0,94	фикс.	4,70	2	99,95	99,99	4,84	4,76	-67	2,457		Нет		28.12.2020		27.12.2021	/ Baa3 /	RU000A102LV3
ВТБ Б-1-49	6,30	0,01	фикс.	5,91	2	100,16	100,14	-1,32	-6,43	-675	3,369	4,3	Нет		21.01.2020		19.01.2021	/ Baa3 /	RU000A101C22
ВТБ Б-1-50	5,09	0,10	фикс.	5,65	2	100,25	100,34	3,01	2,07	-336	0,188	2,4	Нет		21.02.2020		19.02.2021	/ Baa3 /	RU000A101FV7
ВТБ Б-1-62	10,00	0,19	фикс.	6,00	2	100,20	100,24	4,92	4,70	-73	0,602	18,9	Нет		25.03.2020		24.03.2021	/ Baa3 /	RU000A101JT3
ВТБ Б-1-63	10,00	0,28	фикс.	5,75	2	100,23	100,24	4,97	4,89	-54	3,403	2,5	Нет		27.04.2020		26.04.2021	/ Baa3 /	RU000A101M53
ВТБ Б-1-64	1,03	0,36	фикс.	5,15	2	100,10	100,09	4,91	4,94	-49	1,386	2,6	Нет		28.05.2020		27.05.2021	/ Baa3 /	RU000A101Q67
ВТБ Б-1-78	0,78	2,47	фикс.	0,01	2	115,00	115,00	0,00		-543		0,2	Нет		30.06.2020		07.07.2023	/ Baa3 /	RU000A101SJ5

ВТБ Б-1-8	20,00	0,59	фикс.	8,00	4	101,91	101,92	4,88	4,85	-58	1,810	7,3	Нет		21.08.2018		24.08.2021	/ Baa3 /	RU000A0ZZH84
ВТБ Б-1-98	0,49	0,53	фикс.	4,65	0	100,02	99,98	4,71	4,79	-64	0,476	4,3	Нет		28.07.2020		28.07.2021	/ Baa3 /	RU000A101YR6
ВТБ Б-1-99	10,00	0,61	фикс.	4,65	0	99,99	99,98	4,77	4,79	-64	0,965	5,9	Нет		28.08.2020		28.08.2021	/ Baa3 /	RU000A1022J5
ВТБ БО-30	10,00	0,66	фикс.	6,95	4	101,46	101,38	4,81	4,93	-50	0,340	0,1	Да	—	26.12.2014		13.12.2024	/ Baa3 /	RU000A0JV3Q3
ВТБ БО-43	20,00	1,41	фикс.	5,10	4	100,38	100,40	4,92	4,90	-53		0,3	Да	—	11.10.2013		29.09.2023	/ Baa3 / WD	RU000A0JU773
ВТБ Т2-3	20,00	3,72	фикс.	8,40	2	103,00		7,72		229			Нет		03.12.2019		21.05.2030	/ Baa3 /	RU000A1014J2
ВТБСУБТ2-1	10,00	4,33	фикс.	7,60	2	100,00	100,00	7,74	7,74	231		0,1	Нет		14.10.2020		02.04.2031	/ Baa3 /	RU000A102879
ВТБСУБТ2-2	10,00	0,25	плав.	6,45	2	100,00	100,00	6,50	6,50	107	10,00		Нет		14.10.2020		02.04.2031	/ Baa3 /	RU000A102887
ВЭБ 1Р-12	10,00	0,90	фикс.	9,14	4	103,74	103,73	5,20	5,11	-32	0,595	1,8	Нет		25.12.2018		21.12.2021	/ NR /	RU000A0ZZZP3
ВЭБ 1Р-13	10,00		фикс.	9,08	2	0,00		0,00		-543			Нет		25.01.2019		19.01.2024	/ NR /	RU000A1001V4
ВЭБ 1Р-14	5,00		фикс.	8,93	2	0,00		0,00		-543			Нет		15.02.2019		09.02.2024	/ NR /	RU000A1003W8
ВЭБ 1Р-15	5,00	0,12	фикс.	8,73	2	101,00	100,88	-0,16	0,87	-456		1,2	Нет		28.02.2019		25.02.2021	/ NR /	RU000A1004U0
ВЭБ 1Р-16	20,00	1,22	фикс.	8,67	2	104,46	104,16	5,07	5,32	-11	0,129	96,2	Нет		30.04.2019		26.04.2022	/ NR /	RU000A100BM7
ВЭБ 1Р-17	20,00	2,25	фикс.	8,15	2	105,66	105,81	5,71	5,64	21	0,458	107,1	Нет		27.06.2019		22.06.2023	/ NR /	RU000A100GY1
ВЭБ 1Р-19	15,00	5,31	фикс.	6,59	2	100,60	100,80	6,58	6,54	111	4,646	5,7	Нет		18.06.2020		10.06.2027	/ NR /	RU000A101TB0
ВЭБ 1Р-21	20,00	2,32	фикс.	5,74	2	100,15	100,18	5,75	5,74	31	647,1	106,7	Нет		24.07.2020		21.07.2023	/ NR /	RU000A101WF5
ВЭБ ПБО1Р1	19,58		фикс.	11,60	1	100,00		11,58		615			Нет		29.02.2016		17.02.2025	/ NR /	RU000A0JW6P7
ВЭБ ПБО1Р5	10,00	0,90	фикс.	9,76	2	104,27	104,27	5,01	5,01	-42	0,636	0,3	Нет		12.01.2017		17.12.2021	/ NR /	RU000A0JX4Q9
ВЭБ ПБО1Р9	30,00	0,42	фикс.	8,75	2	101,68	101,67	4,72	4,75	-68	18,72	39,8	Да	—	23.06.2017		18.06.2021	/ NR /	RU000A0JXU71
ВЭБ.РФ 09	15,00	0,17	фикс.	8,90	2	100,68	100,61	4,82	5,24	-19	25,77	42,8	Да	—	31.03.2011		18.03.2021	/ NR / BBB	RU000A0JRCX7
ВЭБ.РФ 10	15,00		фикс.	0,00	2	100,50		5,22		-21			Да	—	04.10.2011		21.09.2021	/ NR / BBB	RU000A0JRTN2
ВЭБ.РФ 18	10,00	3,24	фикс.	7,67	2	108,04		5,32		-11		44,4	Да	—	12.10.2012	27.09.2024	17.09.2032	/ NR / BBB	RU000A0JT403
ВЭБ.РФ 19	10,00	0,23	фикс.	9,75	2	101,10		4,82		-61		0,5	Да	—	18.10.2012	08.04.2021	23.09.2032	/ NR / BBB	RU000A0JT6B2
ВЭБ.РФ 21	15,00	1,07	фикс.	8,82	2	103,75		5,40		-3		15,7	Да	—	13.03.2012	01.03.2022	17.02.2032	/ NR / BBB	RU000A0JS4Z7
ВЭБ.РФ Б11	1,00		фикс.	0,00	4	0,00		0,00		-543			Нет		04.09.2014		16.08.2029	/ NR /	RU000A0JUTB1
ВЭБ1Р-18	10,00	4,84	фикс.	7,27	2	103,50	103,73	6,64	6,60	117		4,9	Нет		26.11.2019		17.11.2026	/ NR /	RU000A1013P1
ВЭБ1Р-22	25,00	2,68	фикс.	5,95	2	100,20	100,20	5,96	5,96	53	1,540	128,3	Нет		08.12.2020		05.12.2023	/ NR /	RU000A102FC5
ВЭБПБО1Р11	30,00		фикс.	8,24	2	0,00		0,00		-543			Нет		21.12.2017		15.12.2022	/ NR /	RU000A0ZYLJ9
ГПБ 01-АТ1	20,00		фикс.	8,00	2	0,00		0,00		-543			Нет		10.08.2018		ield Not Ap	/ Ba1 /	RU000A0ZZFZ4
ГПБ 12	10,00	1,62	фикс.	7,52	2	106,00		3,92		-151			Да	—	18.10.2012		06.10.2022	BB+ / Ba1 / BBB-	RU000A0JT6J5
ГПБ 1Р-05Р	10,00	1,85	фикс.	9,15	2	106,98	107,08	5,58	5,51	8	7,363	4,2	Нет		31.01.2019		31.01.2023	/ Ba1 /	RU000A1002E8
ГПБ 1Р-06Р	5,00		фикс.	9,05	2	0,00		0,00		-543			Нет		14.02.2019		14.02.2024	/ Ba1 /	RU000A1003R8
ГПБ 1Р-07Р	10,00		фикс.	9,05	2	0,00		0,00		-543			Нет		26.03.2019		26.03.2023	/ Ba1 /	RU000A1007E7
ГПБ 1Р-08Р	6,00		фикс.	8,95	2	0,00		0,00		-543			Нет		02.04.2019		02.04.2023	/ Ba1 /	RU000A100832

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность			Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ГПБ БО-07	10,00	0,75	фикс.	8,40	2	102,60		4,95		-48		192,3	Да	—	22.10.2013	22.10.2021	22.10.2023	NR / Ba1 / NR	RU000A0JU7Y9
ГПБ БО-08	10,00	0,35	фикс.	4,31	2	100,25	100,25	3,61	3,61	-182		0,1	Да	—	23.05.2014	23.05.2021	23.05.2024	NR / WR / NR	RU000A0JUMH3
ГПБ БО-09	10,00	3,18	фикс.	5,65	2	99,99	99,76	5,73	5,81	38	0,266	285,9	Да	—	27.06.2014		27.06.2024	NR / Ba1 / NR	RU000A0JUQ39
ГПБ БО-10	10,00	0,19	фикс.	4,28	2	99,83	99,64	5,21	6,25	82	0,108	3,6	Да	—	26.09.2014	26.03.2021	26.09.2024	/ Ba1 /	RU000A0JUV08
ГПБ БО-16	10,00	2,96	фикс.	6,10	2	100,15	100,17	6,14	6,13	70	0,624	0,1	Да	—	18.04.2017		18.04.2024	/ Ba1 /	RU000A0JXP45
ГПБ БО-17	10,00	0,78	фикс.	8,00	2	101,97	101,69	5,47	5,85	42	3,215	0,9	Нет		31.10.2017	31.10.2021	31.10.2024	/ Ba1 /	RU000A0ZYEE5
ГПБ БО-18	10,00	1,03	фикс.	7,45	2	102,35	102,16	5,24	5,42	-1	0,683	3,6	Нет		12.02.2018	12.02.2022	12.02.2023	/ Ba1 /	RU000A0ZYRX7
ГПБ БО-19	10,00	1,03	фикс.	7,45	2	102,00	102,35	5,58	5,24	-19	0,097	0,5	Нет		12.02.2018	12.02.2022	12.02.2023	/ Ba1 /	RU000A0ZYRY5
ГПБ001Р03Р	10,11	1,35	фикс.	8,95	2	105,25	105,30	5,10	5,06	-37	0,928	4,9	Нет		13.12.2018		13.06.2022	/ Ba1 /	RU000A0ZZXM5
ГПБ001Р09Р	20,00	1,21	фикс.	8,70	2	104,37	104,37	5,15	5,15	-28	0,150	97,6	Нет		23.04.2019		23.04.2022	/ Ba1 /	RU000A100AF3
ГПБ001Р10Р	5,00		фикс.	8,40	2	0,00		0,00		-543			Нет		29.05.2019		29.11.2021	/ Ba1 /	RU000A100DX0
ГПБ001Р11Р	10,00	3,09	фикс.	8,20	2	106,98	107,00	6,03	6,02	59	0,077	0,5	Нет		01.07.2019		01.07.2024	/ Ba1 /	RU000A100HH4
ГПБ001Р12Р	5,00		фикс.	8,20	2	0,00		0,00		-543			Нет		05.07.2019		05.01.2025	/ Ba1 /	RU000A100JB3
ГПБ001Р13Р	5,00	2,46	фикс.	7,40	2	104,41	104,55	5,70	5,64	21	1,233	3,1	Нет		30.09.2019		30.09.2023	/ Ba1 /	RU000A100VR4
ГПБ001Р14Р	10,00	3,43	фикс.	6,90	2	103,20	103,20	6,04	6,04	61		0,2	Нет		22.11.2019		22.11.2024	/ Ba1 /	RU000A101350
ГПБ001Р15Р	5,00		фикс.	5,45	2	0,00		0,00		-543			Нет		19.06.2020		19.06.2022	/ Ba1 /	RU000A101TK1

ГПБ001Р17Р	10,00	2,76	фикс.	5,85	2	100,93	100,88	5,59	5,61	18	16,71	74,8	Нет		31.07.2020	31.01.2024	31.07.2030	/ Ba1 /	RU000A101Z74
ГПБ001Р18Р	20,00	3,06	фикс.	5,95	2	100,30	100,30	5,93	5,93	50	5,436	23,1	Нет		20.11.2020	20.05.2024	20.11.2030	/ Ba1 /	RU000A102DB2
ГПБ001Р19Р	15,00	2,70	фикс.	5,90	2	100,03	100,00	5,97	5,98	55	68,56		Нет		11.12.2020	11.12.2023	11.12.2030	/ Ba1 /	RU000A102GJ8
ГПБ001Р20Р	2,00		фикс.	6,40	2	0,00		0,00		-543			Нет		28.12.2020	28.12.2025	28.12.2030	/ Ba1 /	RU000A102LU5
ГПБ002Р-08	0,18	0,34	фикс.	0,01	0	99,92		0,00		-543			Нет		26.04.2019		26.04.2021	/ Ba1 /	RU000A1009G8
ГПБ002Р-12	0,30		фикс.	0,01	0	0,00		0,00		-543			Нет		25.11.2019		24.11.2022	/ Ba1 /	RU000A1010V5
ГПБ002Р-13	0,50	0,94	фикс.	0,01	0	96,24		0,00		-543		0,1	Нет		26.12.2019		25.12.2021	/ Ba1 /	RU000A101731
ГПБ002Р-14	0,50		фикс.	0,01	0	0,00		0,00		-543			Нет		29.07.2020		27.01.2022	/ Ba1 /	RU000A101XL1
ГПБ002Р-15	0,50		фикс.	0,01	0	100,00		0,00		-543			Нет		29.07.2020		29.07.2021	/ Ba1 /	RU000A101XM9
ГПБ002Р-16	0,70		фикс.	0,01	0	105,00		0,00		-543		0,2	Нет		06.10.2020		06.10.2021	/ Ba1 /	RU000A1025Z4
ГПБ002Р-17	0,30		фикс.	0,01	0	0,00		0,00		-543			Нет		06.10.2020		06.10.2021	/ Ba1 /	RU000A102606
ДОМ 1Р-3R	15,00	7,18	фикс.	0,00	2	98,19	98,19	0,00		-543			Да	5	06.04.2018		24.03.2028	/ / BBB	RU000A0ZZ1N0
ДОМ 1Р-4R	25,00	0,42	фикс.	7,90	2	101,80		3,04		-239		15,0	Да	5	23.05.2018		07.06.2028	/ / BBB	RU000A0ZZ7C0
ДОМ 1Р-5R	10,00	0,12	фикс.	8,35	2	100,35	100,35	5,25	5,25	-18		19,4	Да	5	01.03.2019	26.02.2021	16.02.2029	/ / BBB	RU000A1004W6
ДОМ 1Р-6R	25,00	1,80	фикс.	0,00	2	100,00		5,37		-6			Да	5	06.06.2019	23.03.2021	12.05.2039	/ / BBB	RU000A100ET6
ДОМ 1Р-7R	20,00		фикс.	6,45	2	101,00		5,34		-9			Да	5	06.12.2019	03.12.2021	11.11.2039	NR / Baa3 / BBB*	RU000A101590
ДОМ 1Р-8R	15,00		фикс.	5,50	2	115,50		-0,90		-633			Да	5	10.06.2020		07.06.2023	NR / Baa3 / BBB*	RU000A101SQ0
ДОМ.РФ Б10	10,00		фикс.	8,20	4	111,00		-4,83		-1026			Да	5	14.11.2017	09.11.2021	13.11.2050	/ Baa3 / BBB	RU000A0ZYFN3
ДОМ.РФ Б-5	5,00	0,18	фикс.	6,15	4	99,50		9,39		396		58,1	Да	5	23.12.2016	23.03.2021	22.12.2049	/ Baa3 / BBB	RU000A0JX2R1
ДОМ.РФ Б-6	5,00	29,82	фикс.	0,00	4	99,78		5,18		-25			Да	5	08.11.2017		07.11.2050	/ Baa3 / BBB	RU000A0ZYF20
ДОМ.РФ Б-7	5,00		фикс.	0,00	4	99,78		5,18		-25			Да	5	08.11.2017		07.11.2050	/ Baa3 / BBB	RU000A0ZYF38
ДОМ.РФ Б-8	5,00	0,79	фикс.	8,20	4	101,50		6,44		101			Да	5	14.11.2017	09.11.2021	13.11.2050	/ Baa3 / BBB	RU000A0ZYFM5
ДОМ.РФ1Р1R	15,00	0,91	фикс.	0,00	4	100,00		5,14		-29		0,2	Да	5	25.12.2017		13.12.2027	/ / BBB	RU000A0ZYLU6
ДОМ.РФ1Р2R	15,00	0,04	фикс.	8,25	2	101,00		-15,67		-2110			Да	5	02.02.2018	29.01.2021	21.01.2028	/ / BBB	RU000A0ZYQU5
ЕАБР 1Р-06	5,00		фикс.	7,60	2	0,00		0,00		-543			Нет		21.04.2020		18.04.2023	BBB / / BBB+*	RU000A101L54
ЕАБР 1Р-07	10,00	3,05	фикс.	5,90	4	100,50	100,36	5,86	5,91	48		0,1	Нет		28.05.2020		23.05.2024	BBB / / BBB+*	RU000A101PK9
ЕАБР 1Р-01	10,00	1,87	фикс.	5,95	2	100,75	100,75	5,63	5,63	20			Нет		24.07.2018	17.01.2023	11.07.2028	BBB / / BBB+*	RU000A0ZZDB0
ЕАБР 1Р-02	5,00	0,31	фикс.	8,90	2	101,05		5,43		0			Нет		09.11.2018		07.05.2021	BBB / / BBB+*	RU000A0ZZRR6
ЕАБР 1Р-03	5,00	0,15	фикс.	8,60	2	101,00		1,66		-377			Нет		12.03.2019		09.03.2021	BBB / / BBB+*	RU000A1004X4
ЕАБР 1Р-04	5,00	1,88	фикс.	8,00	2	104,01	104,01	5,92	5,92	49			Нет		16.07.2019		10.01.2023	BBB / / BBB+*	RU000A100JC1
ЕАБР 1Р-05	8,00	2,24	фикс.	6,80	2	102,49	102,49	5,75	5,75	32			Нет		13.12.2019		09.06.2023	BBB / / BBB+*	RU000A101574
ЕАБР09	5,00		фикс.	8,90	2	100,15		8,58		315			Да	—	02.06.2014		24.05.2021	BBB / / BBB+*	RU000A0JS918

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ЕАБР10	2,00		фикс.	12,25	2	0,00		0,00		-543			Нет		19.01.2016		10.01.2023	BBB / / BBB+*	RU000A0JS926
ЕАБР11	5,00	0,52	фикс.	7,75	2	101,70		4,55		-88			Нет		02.02.2018	30.07.2021	24.01.2025	BBB / / BBB+*	RU000A0JS934
ЗенитБО-09	5,00	4,19	фикс.	0,00	2	97,55		0,00		-543		0,1	Да	—	09.04.2015		27.03.2025	/ Ba3 / BB	RU000A0JVBX1
ЗенитБО-13	6,00		фикс.	0,00	2	98,17		0,00		-543			Да	—	26.06.2014		13.06.2024	/ Ba3 / BB	RU000A0JUPW5
ЗЕНИТБО1Р5	5,00	0,89	фикс.	7,65	2	101,30	101,14	6,24	6,43	100			Нет		16.12.2019	13.12.2021	12.12.2022	/ Ba3 /	RU000A1016K5
ЗЕНИТБО1Р6	1,19		фикс.	6,65	2	101,00		5,78		35			Нет		27.02.2020		24.02.2022	/ Ba3 /	RU000A101GH4
ЗЕНИТБО1Р7	2,05		фикс.	6,75	2	101,00		6,33		90			Нет		27.02.2020		23.02.2023	/ Ba3 /	RU000A101GG6
ИНГБ-БО1	5,00	0,21	фикс.	7,15	4	100,63		4,07		-136		1,8	Да	—	05.04.2016		30.03.2021	/ WR / BBB	RU000A0JWC74
КЕБ БО1Р03	5,00	1,62	фикс.	9,00	4	102,48	102,35	7,67	7,75	232	11,49	6,5	Нет		11.10.2019		07.10.2022	/ B1 /	RU000A100X77
МБЭС 1Р-01	7,00	1,61	фикс.	7,90	2	103,00		6,12		69		0,2	Нет		09.10.2019	05.10.2022	26.09.2029	/ Baa3 / BBB-*	RU000A100VX2
МБЭС 1Р-02	5,00	3,11	фикс.	6,20	2	100,00	100,00	6,29	6,29	86	0,050	0,8	Нет		15.06.2020	10.06.2024	03.06.2030	/ Baa3 / BBB-*	RU000A101RJ7
МежИнБ01Р1	10,00	6,12	фикс.	0,00	2	71,00		0,00		-543			Да	—	14.06.2017		01.03.2027	A- / A3 / A-*	RU000A0JXT58
МежИнБ01Р2	7,00	3,68	фикс.	7,75	2	106,49		6,09		66			Нет		29.04.2020		23.04.2025	A- / A3 / A-*	RU000A101LM4
МежИнБ01Р3	5,00		фикс.	7,75	2	0,00		0,00		-543			Нет		29.04.2020		23.04.2025	A- / A3 / A-*	RU000A101LN2
МежИнБ01Р4	7,00	2,16	фикс.	6,75	4	102,67	102,67	5,64	5,64	21		0,2	Нет		19.05.2020		16.05.2023	A- / A3 / A-*	RU000A101MZ4
МежИнБ01Р5	7,00	2,02	фикс.	5,95	4	100,00		6,08		65		0,2	Нет		11.09.2020		10.03.2023	A- / A3 / A-*	RU000A1023H7
МежИнБанк1	2,00		фикс.	0,00	2	99,98		0,02		-541			Да	—	29.04.2014		16.04.2024	/ / A-	RU000A0JUG56
МежИнБанк2	3,00	4,24	фикс.	0,00	2	100,00		0,01		-542			Да	—	29.04.2015		16.04.2025	/ / A-	RU000A0JUG72

МежИнБанк4	5,00	4,80	фикс.	0,00	2	68,00		0,00		-543			Да	—	19.11.2015		06.11.2025	/ / A-	RU000A0JUG98
МКБ 1Р1	5,00	1,59	фикс.	8,35	2	103,70	103,66	6,12	6,14	71	103,7	7,9	Нет		04.10.2019		30.09.2022	/ Ba3 /	RU000A100WC4
МКБ 1Р2	7,00	0,86	фикс.	7,75	2	101,59	101,53	5,93	6,00	57	1,122	54,1	Нет		03.12.2019		30.11.2021	/ Ba3 /	RU000A1014H6
МКБ П01	0,30	1,36	фикс.	4,50	1	101,33		3,50		-193		49,9	Нет		11.06.2019		11.06.2022	/ Ba3 /	RU000A100FF2
МКБ П02	0,30	1,45	фикс.	4,50	1	101,13		3,70		-173		49,9	Нет		15.07.2019		15.07.2022	/ Ba3 /	RU000A100KS5
МКБ П03	0,30	1,46	фикс.	4,00	1	101,16		3,18		-225		17,6	Нет		15.07.2019		15.07.2022	/ Ba3 /	RU000A100KT3
МКБ П04	0,35	1,60	фикс.	3,50	1	98,94		4,17		-126		0,3	Нет		03.09.2019		03.09.2022	/ Ba3 /	RU000A100SF5
МКБ П05	0,35	1,70	фикс.	3,25	1	97,75		4,62		-81		0,4	Нет		10.10.2019		10.10.2022	/ Ba3 /	RU000A100WT8
МКБ П07	0,50	1,80	фикс.	3,00	1	97,01		4,74		-69		1,0	Нет		13.11.2019		13.11.2022	/ Ba3 /	RU000A101160
МКБ П08	0,60	1,90	фикс.	2,55	1	95,40		5,12		-31		1,3	Нет		19.12.2019		19.12.2022	/ Ba3 /	RU000A1016Y6
МКБ П09	0,90	1,91	фикс.	1,55	1	94,00	94,00	4,89	4,89	-54		1,2	Нет		19.12.2019		19.12.2022	/ Ba3 /	RU000A1016X8
МКБ П10	0,30		фикс.	0,01	1	100,00		0,01		-542			Нет		19.12.2019		19.12.2022	/ Ba3 /	RU000A1016W0
МКБ П11	2,00	2,04	фикс.	1,25	1	92,89		4,95		-48		0,5	Нет		12.02.2020		12.02.2023	/ Ba3 /	RU000A101DL3
МКБ П12	3,00	2,07	фикс.	0,10	1	105,88		0,00		-543		107,5	Нет		12.02.2020		12.02.2023	/ Ba3 /	RU000A101DK5
МКБ П17	0,40	2,56	фикс.	0,01	2	96,38		0,00		-543		0,2	Нет		07.08.2020		07.08.2023	/ Ba3 /	RU000A102044
МКБ П18	0,40	2,56	фикс.	0,01	2	96,43		0,00		-543		0,2	Нет		07.08.2020		07.08.2023	/ Ba3 /	RU000A102051
МКБ П19	1,00	2,67	фикс.	0,01	2	99,79		0,00		-543		0,6	Нет		18.09.2020		18.09.2023	/ Ba3 /	RU000A1024V6
МосКред 15	5,00	2,49	фикс.	12,00	2	106,25		9,79		436			Нет		24.07.2018		ield Not Ap	/ Ba3 /	RU000A0ZZE87
МСП Банк 1	5,00		фикс.	7,00	2	100,93		1,49		-394			Да	—	29.03.2012		17.03.2022	NR / Ba2 /	RU000A0JS5R1
МСП Банк 2	5,00		фикс.	7,50	2	99,50		14,82		939			Да	—	23.08.2012	11.02.2021	11.08.2022	NR / Ba2 /	RU000A0JS603
ОткрФКБ9	5,00	2,78	фикс.	1,00	2	87,69		5,01		-42		0,1	Да	—	24.10.2013		11.11.2023	/ Ba2 /	RU000A0JU872
ОткрФКБОП5	10,00	1,45	фикс.	5,50	2	99,95	99,97	5,63	5,60	17	0,084	0,8	Нет		16.07.2019		12.07.2022	/ Ba2 /	RU000A100L14
ОткрФКБП6	15,00	1,98	фикс.	6,40	2	101,00	101,00	5,97	5,97	54	0,101	0,8	Нет		03.03.2020	28.02.2023	25.02.2025	/ Ba2 /	RU000A101GR3
ОткрФКБПБ1	2,00		фикс.	5,00	4	100,00		5,09		-34			Нет		07.08.2020		06.08.2021	/ Ba2 /	RU000A102085
ОткрФКИО12	0,15	2,61	фикс.	0,01	0	97,00		0,00		-543			Нет		28.07.2020		28.07.2023	/ Ba2 /	RU000A101YL9
ОткрФКИОП1	0,10		фикс.	0,01	1	91,00		0,00		-543			Нет		10.09.2020		10.09.2023	/ Ba2 /	RU000A1021C2
Промсвб-15	6,75		фикс.	2,50	4	0,00		0,00		-543			Нет		04.03.2020		27.03.2040	/ Ba2u /	RU000A101H92
Промсвб-16	14,08		фикс.	2,50	4	0,00		0,00		-543			Нет		16.03.2020		29.09.2029	/ Ba2u /	RU000A101J33
ПромсвбЗР1	10,00	1,40	фикс.	5,85	2	100,38	100,38	5,65	5,65	22		8,3	Нет		25.06.2020		23.06.2022	/ Ba2u /	RU000A101U38
ПромсвбЗР3	15,00	2,57	фикс.	6,10	2	100,60		5,95		52		0,2	Нет		29.10.2020		26.10.2023	/ Ba2u /	RU000A102AJ1

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ПромсвбБО8	5,00	0,20	фикс.	5,00	2	100,00	100,00	5,02	5,02	-41	0,105	0,2	Да	—	28.03.2016		28.03.2021	/ Ba2u /	RU000A0JUVG6
ПромсвбБП1	14,00	0,26	фикс.	10,15	2	101,20	0,00	5,40	0,00	-3		0,4	Нет		25.04.2016		19.04.2021	/ Ba2u /	RU000A0JWEU9
ПСБ FIX3P1	0,14		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		16.12.2020		14.12.2022	/ Ba2u /	RU000A102HR9
РН БАНК 01	5,00	0,48	фикс.	6,45	2	100,60	100,60	5,23	5,23	-20	0,059	2,2	Да	—	05.07.2016		09.07.2021	/ / WD	RU000A0JWMJ5
РН БАНК1Р3	5,00	0,83	фикс.	9,25	2	103,40	0,00	5,17	0,00	-26			Нет		20.11.2018		22.11.2021	BB+ / / WD*	RU000A0ZZUK5
РН БАНК1Р4	5,00	1,03	фикс.	9,15	2	103,25	103,25	6,10	6,10	67	2,137	0,4	Нет		14.02.2019		16.02.2022	BB+ / / WD*	RU000A1003Q0
РН БАНК1Р5	8,00	1,21	фикс.	8,90	2	103,47	0,00	6,11	0,00	68		80,9	Нет		23.04.2019		25.04.2022	BB+ / / WD*	RU000A100A90
РН БАНК1Р6	7,00	1,59	фикс.	7,65	2	103,20	103,20	5,72	5,72	29	0,231	0,1	Нет		24.09.2019		26.09.2022	BB+ / / WD*	RU000A100UU0
РН БАНК1Р7	8,00	2,56	фикс.	6,25	2	100,95	100,95	5,96	5,96	53	24,67	13,5	Нет		21.10.2020		24.10.2023	BB+ / / WD*	RU000A102960
Росбанк2Р3	3,00		фикс.	7,85	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		28.11.2017		02.12.2022	/ Baa3 /	RU000A0ZYH44
Росбанк2Р4	10,00	0,98	фикс.	8,95	2	103,84	104,05	5,38	4,98	-45	0,150	26,1	Нет		29.01.2019		31.01.2022	/ Baa3 /	RU000A100220
Росбанк2Р5	10,00	0,28	фикс.	8,50	2	100,90	0,00	5,23	0,00	-20		2,9	Нет		26.04.2019		27.04.2021	/ Baa3 /	RU000A100B16
Росбанк2Р6	15,00	1,99	фикс.	7,55	2	108,72	0,00	3,36	0,00	-207		0,1	Нет		12.09.2019		16.03.2023	/ Baa3 /	RU000A100TH9
Росбанк2Р7	10,00	0,37	фикс.	5,60	2	100,40	100,40	4,53	4,53	-90			Нет		29.05.2020		30.05.2021	/ Baa3 /	RU000A101QG5
Росбанк2Р8	15,00	1,79	фикс.	5,60	2	100,13	100,13	5,60	5,60	17	0,109	48,1	Нет		27.11.2020		29.11.2022	/ Baa3 /	RU000A102F28
РосбанкБ11	5,00	1,84	фикс.	6,55	2	101,95	0,00	5,54	0,00	11		0,2	Да	—	20.12.2016	20.12.2022	20.12.2026	/ Baa3 / BBB	RU000A0JX2F6
РосбанкБ12	5,00	1,84	фикс.	6,55	2	102,13	0,00	5,44	0,00	1			Да	—	20.12.2016		20.12.2026	/ Baa3 / BBB	RU000A0JX2D1
РосбанкБ19	5,00		фикс.	0,00	2	95,00	0,00	1,06	0,00	-437			Да	—	30.10.2015		30.10.2025	/ Baa3 / WD	RU000A0JVWA5
РосбанкБ20	5,00	5,33	фикс.	0,00	2	77,78	0,00	4,98	0,00	-45			Да	—	18.05.2016		18.05.2026	/ Baa3 / WD	RU000A0JWGS8
РосбанкБ25	6,00		фикс.	0,00	2	90,04	0,00	1,23	0,00	-420			Да	—	28.07.2015		28.07.2025	/ Baa3 / WD	RU000A0JVNB2

РосбанкБ26	7,00		фикс.	7,50	2	101,50	0,00	4,55	0,00	-88			Да	—	21.07.2016		21.07.2026	/ Baa3 / WD	RU000A0JWNB0
РосбанкБО5	5,00		фикс.	0,00	2	102,78	0,00	5,72	0,00	29			Да	—	21.10.2013		21.10.2023	/ Baa3 / WD	RU000A0JS6M0
РосбанкБО8	5,00	4,76	фикс.	0,00	2	79,75	0,00	5,96	0,00	53			Да	—	20.10.2015		20.10.2025	/ Baa3 / WD	RU000A0JVUY9
РосбнБО12	7,00	5,70	фикс.	0,00	2	72,99	0,00	6,90	0,00	147			Да	—	29.09.2016		29.09.2026	/ Baa3 / WD	RU000A0JWUB5
РосбнБСО12	2,00		фикс.	0,04	0	100,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		30.04.2014		30.04.2024	/ Baa3 / BBB	RU000A0JUL67
РосбнБСО13	2,00		фикс.	0,03	4	100,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		30.04.2014		30.04.2024	/ Baa3 / BBB	RU000A0JUL91
РосбнБСО14	3,00		фикс.	0,02	4	100,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		30.04.2014		30.04.2024	/ Baa3 / BBB	RU000A0JULA0
РосбнБСО15	3,00		фикс.	0,01	4	100,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		30.04.2014		30.04.2024	/ Baa3 / BBB	RU000A0JULC6
РОСЭКСИМБ1	5,00		фикс.	6,90	2	101,00	0,00	5,73	0,00	30			Да	—	24.11.2015	16.11.2021	11.11.2025	/ Ba1 /	RU000A0JVYG8
РСХБ 01Т1	10,00	5,44	фикс.	9,00	2	107,04	106,86	7,86	7,89	246	3,439	2,6	Нет		25.04.2018			/ Ba1 /	RU000A0ZZ4T1
РСХБ 06Т1	5,00		фикс.	14,50	2	129,90	0,00	7,84	0,00	241			Нет		15.07.2016			/ Ba1 /	RU000A0JWMZ1
РСХБ 07Т1	5,00		фикс.	14,50	2	129,90	0,00	7,85	0,00	242			Нет		18.07.2016			/ Ba1 /	RU000A0JWN22
РСХБ 08Т1	5,00	4,16	фикс.	14,25	2	127,97	127,74	8,18	8,23	280	2,499	5,7	Нет		05.10.2016			/ Ba1 /	RU000A0JWV63
РСХБ 09Т1	5,00	5,43	фикс.	9,00	2	106,45	106,05	7,97	8,04	261	14,44	21,2	Нет		26.04.2018			/ Ba1 /	RU000A0ZZ505
РСХБ 12	5,00	0,46	фикс.	8,15	2	102,00	102,00	3,73	3,73	-170	3,000	0,2	Да	—	14.07.2011		01.07.2021	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JRMB2
РСХБ 13	5,00	0,46	фикс.	8,15	2	101,38	101,38	5,09	5,13	-30	0,100		Да	—	15.07.2011		02.07.2021	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JRMC0
РСХБ 14	10,00	0,45	фикс.	8,15	2	101,50	101,50	4,80	4,80	-63	3,350	56,9	Да	—	12.07.2011		29.06.2021	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JRLE8
РСХБ 15	10,00	0,76	фикс.	7,00	2	102,99	0,00	3,10	0,00	-233		0,1	Да	—	08.11.2011		26.10.2021	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JRVN8
РСХБ 16	10,00	1,18	фикс.	6,15	2	103,02	103,02	2,67	3,62	-181		0,1	Да	—	16.04.2012		04.04.2022	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JS6N8
РСХБ 17	10,00	1,67	фикс.	0,00	2	103,85	103,85	2,98	2,98	-245			Да	—	23.10.2012		11.10.2022	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JT7M7
РСХБ 18	5,00	0,25	фикс.	8,20	2	101,40	101,40	2,46	2,46	-297		20,3	Да	—	25.10.2012	15.04.2021	13.10.2022	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JT874
РСХБ 20	10,00	1,18	фикс.	8,30	2	103,57	103,89	5,34	5,07	-36		0,1	Да	—	23.04.2013	12.04.2022	11.04.2023	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JTVJ2
РСХБ 21	10,00	2,30	фикс.	7,40	2	102,62	101,26	4,28	5,03	-40	0,112		Да	—	30.07.2013	21.01.2021	18.07.2023	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JU1Q8
РСХБ 22	5,00		фикс.	6,25	2	105,77	0,00	3,99	0,00	-144			Да	—	30.09.2013		18.09.2023	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JU6A1
РСХБ 23	5,00	0,81	фикс.	8,85	2	103,95	0,00	3,96	0,00	-147			Да	—	22.11.2013	12.11.2021	10.11.2023	/ Ba1 / BBB-	RU000A0JUAD7
РСХБ 24	10,00		плав.	5,85	4	100,00	0,00	5,98	0,00	55			Нет		24.07.2015		11.07.2025	/ Ba1 /	RU000A0JVN56
РСХБ 25	10,00		плав.	5,85	4	100,00	0,00	5,93	0,00	50			Нет		27.07.2015		14.07.2025	/ Ba1 /	RU000A0JVN64
РСХБ 26	10,00	0,01	плав.	5,85	4	100,00	100,00	5,93	5,93	50			Нет		28.07.2015		15.07.2025	/ Ba1 /	RU000A0JVN98

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

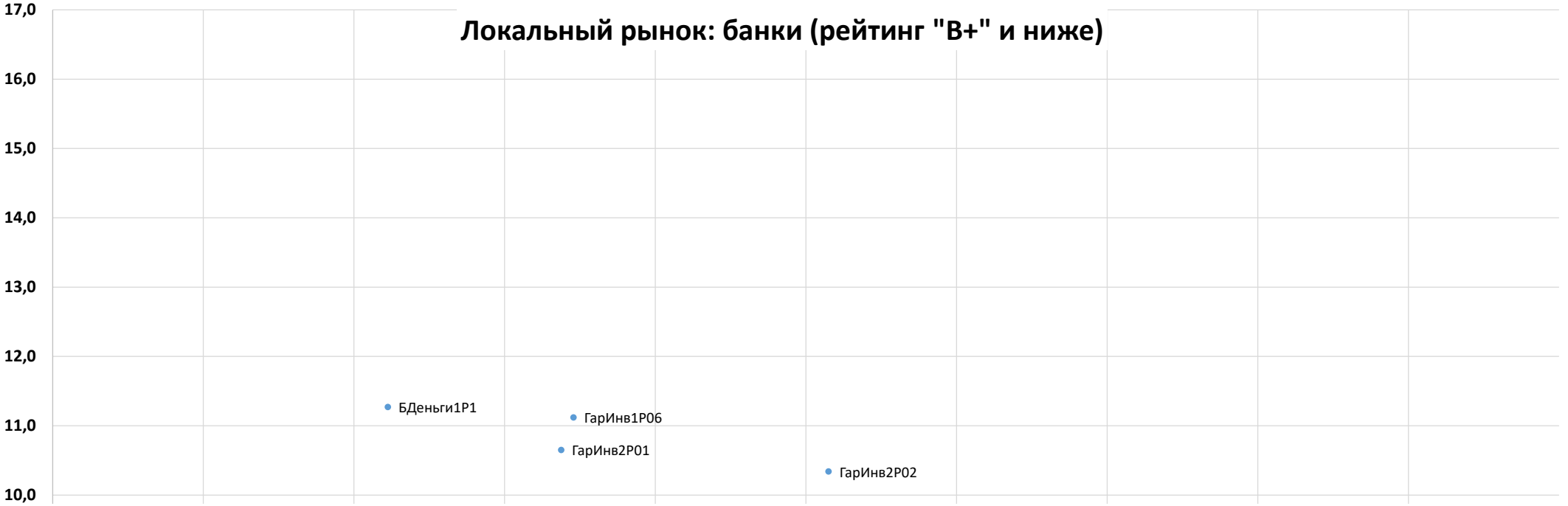
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
РСХБ 27	5,00		фикс.	12,87	4	116,00	0,00	-3,85	0,00	-928			Нет		29.12.2015		21.12.2021	/ Ba1 /	RU000A0JW1V6
РСХБ 28	5,00		фикс.	12,87	4	110,70	0,00	1,33	0,00	-410			Нет		30.12.2015		22.12.2021	/ Ba1 /	RU000A0JW1Z7
РСХБ 31Т1	5,00		фикс.	10,10	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		22.11.2018		ield Not Ap	/ Ba1 /	RU000A0ZZUS8
РСХБ Б01R	5,00	1,69	фикс.	6,75	0	102,67	102,68	5,31	5,31	-12		1,5	Нет		13.11.2019		02.11.2022	/ Ba1 /	RU000A101129
РСХБ Б02RP	5,00	1,92	фикс.	6,05	0	100,98	100,86	5,68	5,75	32	1,645	2,8	Нет		05.02.2020		25.01.2023	/ Ba1 /	RU000A101DD0
РСХБ Б04RP	1,23	2,52	фикс.	5,40	0	99,78	99,80	5,63	5,62	19	1,892	2,2	Нет		07.10.2020		27.09.2023	/ Ba1 /	RU000A102713
РСХБ Б05KP	10,00	0,16	фикс.	5,15	0	100,49	0,00	2,06	0,00	-337			Нет		15.12.2020		15.03.2021	/ Ba1 /	RU000A102H75
РСХБ БО 2Р	10,00	0,43	фикс.	8,65	2	101,63	101,56	4,82	4,99	-44	0,466	3,6	Нет		26.06.2017		21.06.2021	/ Ba1 /	RU000A0JXUC1
РСХБ БО 3Р	7,00	0,68	фикс.	8,40	2	102,00	102,00	5,51	5,51	8		0,8	Нет		03.10.2017		28.09.2021	/ Ba1 /	RU000A0ZYBT9
РСХБ БО10Р	5,00	2,59	фикс.	7,00	2	103,89	103,89	5,56	5,56	13		0,2	Нет		15.11.2019		10.11.2023	/ Ba1 /	RU000A1011R1
РСХБ БО13	5,00	1,62	фикс.	7,40	4	103,43	103,43	5,39	5,39	-4		17,0	Да	—	10.10.2014	30.09.2022	27.09.2024	/ Ba1 /	RU000A0JUW31
РСХБ БО14	5,00	1,63	фикс.	7,40	4	103,20	103,20	5,54	5,54	11	0,077	15,6	Да	—	13.10.2014	03.10.2022	30.09.2024	/ Ba1 /	RU000A0JUW72
РСХБ БО15	5,00	1,38	фикс.	0,00	4	100,25	0,00	5,21	0,00	-22		34,3	Да	—	26.12.2014		13.12.2024	/ Ba1 /	RU000A0JV3R1
РСХБ БО17	5,00		фикс.	0,00	4	101,00	0,00	5,13	0,00	-30			Да	—	26.02.2015		13.02.2025	/ Ba1 /	RU000A0JV987
РСХБ БО-5Р	25,00	1,10	фикс.	7,40	2	102,45	102,38	5,23	5,29	-14	9,278	14,4	Нет		14.03.2018		09.03.2022	/ Ba1 /	RU000A0ZYXJ4
РСХБ БО-6Р	13,00	1,63	фикс.	9,00	2	105,65	105,65	5,63	5,63	20	0,786	0,5	Нет		19.10.2018		14.10.2022	/ Ba1 /	RU000A0ZZPZ3
РСХБ БО-7Р	19,90		фикс.	10,50	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		29.11.2018		22.11.2038	/ Ba1 /	RU000A0ZZVQ0
РСХБ БО8	10,00		фикс.	6,50	4	111,19	0,00	0,98	0,00	-445			Да	—	11.02.2015		29.01.2025	/ Ba1 /	RU000A0JV805
РСХБ БО9	10,00	2,08	фикс.	7,00	4	103,15	0,00	5,62	0,00	19		0,2	Да	—	30.10.2015	21.04.2023	17.10.2025	/ Ba1 /	RU000A0JVWB3
РСХБ БО-9Р	10,00	0,44	фикс.	0,00	2	101,55	101,55	4,53	4,53	-90		14,8	Нет		25.06.2019		22.06.2021	/ Ba1 /	RU000A100GM6
РСХБ2Р2RIB	0,50		фикс.	0,01	1	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		24.12.2020	26.12.2021	24.12.2023	/ Ba1 /	RU000A102KV5
РСЭКСМБ2Р1	10,00	2,67	фикс.	6,90	2	111,98	0,00	2,62	0,00	-281			Нет		19.12.2019	14.12.2023	06.12.2029	/ Ba1 /	RU000A101780

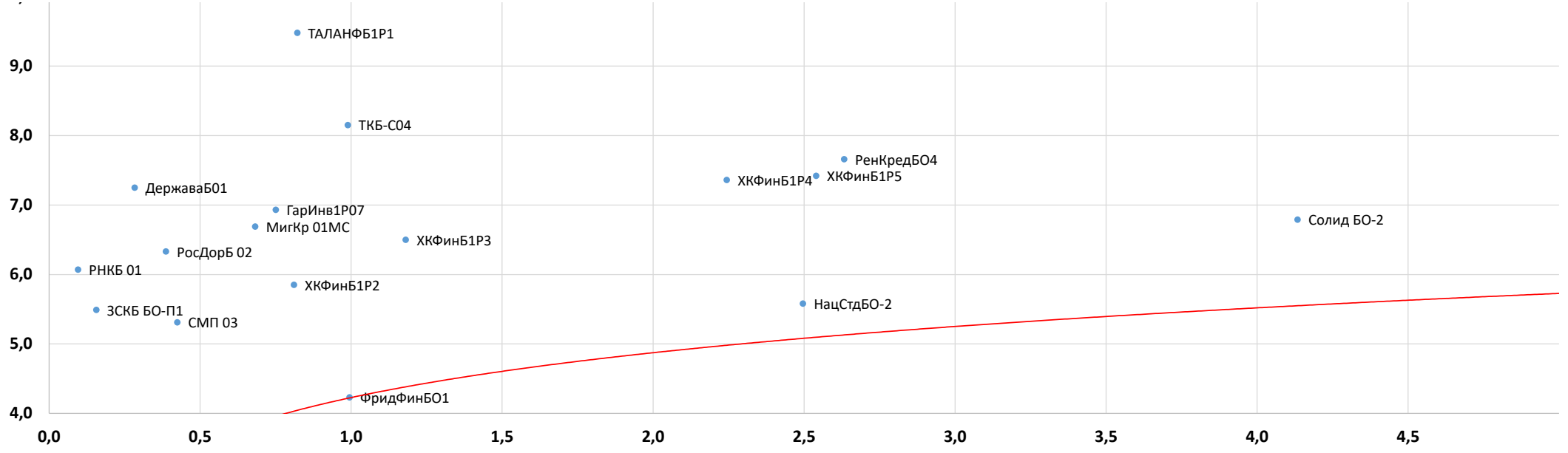
РСЭКСМБ2Р2	10,00	2,27	фикс.	6,15	2	99,51	0,00	6,47	0,00	104		0,1	Нет		16.06.2020	13.06.2023	04.06.2030	/ Ba1 /	RU000A101T56
РСЭКСМБ2Р3	7,00	5,33	фикс.	6,64	2	102,00	0,00	6,36	0,00	93		0,1	Нет		29.06.2020	24.06.2027	17.06.2030	/ Ba1 /	RU000A101UE2
Сбер Sb10R	5,00		фикс.	7,55	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		15.07.2019		12.07.2021	/ Baa3u /	RU000A100KW7
Сбер Sb11R	10,00		фикс.	7,55	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		15.07.2019		12.07.2021	/ Baa3u /	RU000A100KX5
Сбер Sb12R	30,00	1,43	фикс.	7,70	2	103,55	103,59	5,25	5,22	-21	15,75	137,4	Нет		15.07.2019		11.07.2022	/ Baa3u /	RU000A100K80
Сбер Sb13R	25,00	0,68	фикс.	7,05	2	101,61	101,52	4,71	4,83	-60	5,983	18,6	Нет		27.09.2019		24.09.2021	/ Baa3u /	RU000A100VB8
Сбер Sb14R	15,00	0,83	фикс.	6,40	2	101,16	101,16	5,03	5,03	-40	7,210	2,9	Нет		22.11.2019		19.11.2021	/ Baa3u /	RU000A1012R9
Сбер Sb15R	35,00	2,72	фикс.	6,30	2	102,22	101,81	5,57	5,72	29		96,1	Нет		27.01.2020		22.01.2024	/ Baa3u /	RU000A101C89
Сбер Sb16R	20,00	3,10	фикс.	5,65	2	100,80	100,40	5,46	5,59	16		65,8	Нет		05.06.2020		31.05.2024	/ Baa3u /	RU000A101QW2
Сбер Sb17R	40,00	2,58	фикс.	5,70	2	100,70	100,62	5,49	5,52	9		62,5	Нет		02.10.2020		29.10.2023	/ Baa3u /	RU000A1025U5
Сбер Sb18R	25,00	1,83	фикс.	5,25	2	100,52	100,53	4,93	5,01	-42			Нет		11.12.2020		09.12.2022	/ Baa3u /	RU000A102FR3
Сбер Sb19R	18,00	2,65	фикс.	5,55	2	100,99	100,12	5,23	5,58	15		93,4	Нет		20.11.2020		17.11.2023	/ Baa3u /	RU000A102CU4
СберБ Б12R	50,00	1,00	фикс.	7,60	2	102,66	102,61	5,00	5,08	-35	5,334	36,3	Нет		03.07.2018		02.02.2022	/ Baa3u /	RU000A0ZZBN9
СберБ Б16R	40,00	1,84	фикс.	7,50	2	104,45	104,44	5,25	5,21	-22	1,034	3,4	Нет		25.07.2018		18.01.2023	/ Baa3u /	RU000A0ZZE20
СберБ Б50R	15,00		фикс.	8,80	2	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		13.12.2018		07.03.2024	/ Baa3u /	RU000A0ZZXS2
СберБ Б52R	12,00	1,01	фикс.	8,45	2	103,75	103,64	4,77	4,95	-48		5,7	Нет		13.12.2018		07.02.2022	/ Baa3u /	RU000A0ZZWZ9
СберБ Б78R	60,00	0,19	фикс.	8,20	2	100,62	100,62	4,91	4,91	-52		136,7	Нет		29.03.2019		26.03.2021	/ Baa3u /	RU000A100758
СберБ БО19	15,00	0,37	фикс.	8,30	2	101,28	101,22	4,80	4,97	-46	1,205	23,1	Да	—	30.05.2017	30.05.2021	30.05.2027	/ Baa3u /	RU000A0JXRW5
СберБ БО37	10,00	0,69	фикс.	9,25	2	103,25	103,25	4,56	4,56	-87	0,632	1,9	Да	—	30.09.2016		30.09.2021	/ Baa3u /	RU000A0JWUE9
СберБ БО4R	25,00	0,60	фикс.	6,90	2	101,21	101,20	4,92	4,94	-49	3,204	17,0	Нет		02.03.2018		27.08.2021	/ Baa3u /	RU000A0ZYUJ0
СберБ БО6R	40,00	2,18	фикс.	7,20	2	104,18	103,91	5,34	5,47	4		12,7	Нет		25.05.2018		19.05.2023	/ Baa3u /	RU000A0ZZ117
СберИОС377	0,64		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		28.12.2020		05.01.2026	/ Baa3u /	RU000A102FL6
СберИОС381	0,17		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		28.12.2020		05.01.2024	/ Baa3u /	RU000A102E86
СберИОС388	1,50		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		29.12.2020		06.07.2022	/ Baa3u /	RU000A102FJ0
СберИОС389	2,50		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		12.01.2021		19.01.2026	/ Baa3u /	RU000A102GL4
СберИОС390	0,04		фикс.	0,01	0	0,00	0,00	0,00	0,00	-543			Нет		12.01.2021		19.01.2026	/ Baa3u /	RU000A102GM2

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

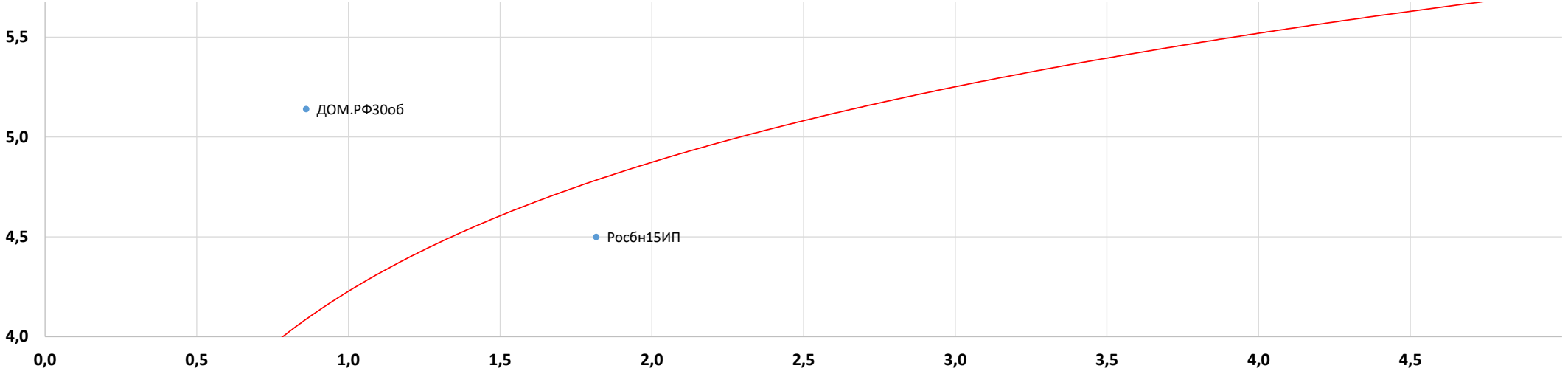
РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АбсолютБС1	5,00		фикс.	14,50	2	106,99		5,13		-30			Нет		29.04.2016		22.10.2021	/ B2 *- / NR	RU000A0JWF71
АВНГРДБ1Р2	3,00	6,60	фикс.	7,00	0	110,00		-33,97		-3940		176,5	Нет		28.03.2019		28.02.2029	/ B2 /	RU000A1007Q1
БДеньги1Р1	0,35	1,11	фикс.	16,00	0	105,64	105,75	11,27	11,47	604	2,071	2,4	Нет		03.12.2019		17.11.2022		RU000A101483
ГарИнв1Р06	0,50	1,73	фикс.	11,50	4	101,39	101,47	11,12	11,07	564	1,567	2	Нет		17.12.2019		13.12.2022		RU000A1016U4
ГарИнв1Р07	0,70	0,75	фикс.	12,00	4	103,99	103,73	6,93	7,28	185		0,1	Нет		02.07.2020	27.10.2021	30.10.2021		RU000A101V37
ГарИнв2Р01	0,80	1,69	фикс.	10,50	4	100,43	100,26	10,65	10,75	532		15,8	Нет		25.11.2020	20.11.2022	23.11.2022		RU000A102DZ1
ГарИнв2Р02	0,42	2,58	фикс.	10,00	4	100,11	100,26	10,34	10,27	484	0,670		Нет		28.12.2020		25.12.2023		RU000A102LS9
Держава 03	0,50		фикс.	15,00	2	100,00		15,55		1012		0,4	Нет		25.03.2016		12.09.2025	/ WR /	RU000A0JWB59
ДержаваБ01	2,00	0,28	плав.	5,75	4	99,77		7,25		182			Нет		10.07.2013		10.07.2023	/ WR /	RU000A0JU0B2
ЗСКБ БО-П1	0,92	0,16	фикс.	0,00	4	100,00		5,49		6		0,1	Нет		04.06.2018		15.06.2021	NR / / *	RU000A0ZZ8T2
МетИнвБ Б3	2,70		фикс.	6,40	2	96,96		30,79		2536			Нет		10.09.2018	14.02.2021	04.09.2023	/ B1 /	RU000A0ZZL05
МетИнвБ П1	2,00		фикс.	6,00	4	100,02		6,10		67		0,7	Нет		07.10.2020		30.09.2021	/ B1 /	RU000A1026W9
МигКр 01МС	0,27	0,68	фикс.	16,00	0	106,60	106,75	6,69	6,47	104	0,369	0,8	Нет		24.06.2019		19.06.2022		RU000A100GK0
НацСтдБО-2	3,00	2,50	фикс.	0,00	2	100,00		5,58		15			Нет		18.07.2013		18.07.2023	/ WR /	RU000A0JU0U2
ПЕРЕСВ БП1	5,00		дефолт	0,00	2	23,48		10,57		514			Нет		09.09.2015		02.09.2020	NR / / WD	RU000A0JVRL2
ПЕРЕСВ БП2	3,50		дефолт	0,00	2	25,90		0,00		-543		0,1	Нет		23.10.2015		16.10.2020	/ / WD	RU000A0JVVL4
ПЕРЕСВ БП3	1,10		дефолт	0,00	2	0,00		0,00		-543			Нет		13.11.2015		06.11.2020	/ / WD	RU000A0JVXX5
ПЕРЕСВ БП5	0,63	15,40	дефолт	0,51	2	20,48	20,48	10,90	10,90	547			Нет		29.06.2016		23.06.2021	/ / WD	RU000A0JWM15
ПЕРЕСВ С01	0,38		фикс.	0,51	1	13,50	13,38	0,00		-543	0,088	0,2	Нет		14.02.2017		14.02.2032	NR / / WD*	RU000A0JXGV0
ПЕРЕСВЕТБ2	3,00	13,55	фикс.	0,51	4	22,01		11,84		641			Нет		29.08.2014		04.08.2034	/ / WD	RU000A0JUT85
ПЕРЕСВЕТБ3	0,00		фикс.	12,75	4	29,52		0,00		-543			Нет		16.07.2015		24.07.2018	/ / WD	RU000A0JVM32
Промсвб3	5,00		фикс.	8,10	2	103,99		-1,78		-721			Да	—	22.12.2011		09.12.2021	/ WR / WD	RU000A0JS1F5
Промсвб4	5,00		фикс.	0,00	2	102,51		-5,34		-1077			Да	—	25.04.2012		13.04.2022	/ WR / WD	RU000A0JS793
Промсвб5	5,00		фикс.	0,00	2	100,00		0,00		-543			Да	—	19.04.2012		07.04.2022	/ WR / WD	RU000A0JS710
РенКредБО4	2,00	2,63	фикс.	8,45	2	102,39	102,31	7,66	7,69	226	6,361		Нет		15.12.2020	15.12.2023	15.12.2025	/ WR /	RU000A102H83
РНКБ 01	3,00	0,10	фикс.	7,60	2	100,14	100,14	6,07	6,07	64		21,3	Нет		20.02.2020	18.02.2021	16.02.2023		RU000A101FK0

РосДорБ 02	0,30	0,39	плав.	6,25	2	100,00		6,33		90			Нет		20.12.2018	12.12.2024		RU000A0ZZZ25
СМП 03	3,00	0,42	плав.	5,25	2	100,00		5,31		-12		0,1	Нет		13.03.2017		/ WR /	RU000A0JXJP6
СМП БО-03	10,00		плав.	4,45	4	0,00		0,00		-543			Нет		27.10.2015	14.10.2025	/ WR /	RU000A0JVVT7
Солид БО-2	1,50	4,13	фикс.	0,00	2	100,00		6,79		136			Да	—	20.03.2015	07.03.2025	/ B2 /	RU000A0JVA77
ТАЛАНФБ1Р1	0,80	0,82	фикс.	15,00	4	104,87	104,55	9,48	9,88	445	2,721	1,7	Нет		25.04.2019	21.04.2022		RU000A100AA4
ТКБ БО-2	2,00		фикс.	0,00	2	99,45		0,00		-543			Да	—	11.06.2013	30.05.2023	/ WR /	RU000A0JTYQ1
ТКБ-С04	1,50	0,99	фикс.	15,00	2	107,11	107,11	8,15	8,15	272		0,1	Нет		22.08.2016	14.02.2022	/ WR /	RU000A0JWQ45
Финанс-М 1	0,50	0,19	фикс.	7,25	2	17,00	17,00	0,00		-543			Нет		01.07.2015	12.06.2030		RU000A0JVE65
ФридФинБО1	0,50	0,99	фикс.	12,00	2	108,10	108,10	4,23	4,23	-120	3,023	1,2	Нет		14.02.2019	10.02.2022	B- / / *	RU000A1003N7
ХКФинБ1Р2	2,00	0,81	фикс.	10,00	4	103,49		5,85		42		0,1	Нет		23.11.2018	19.11.2021		RU000A0ZZUZ3
ХКФинБ1Р3	3,00	1,18	фикс.	10,00	4	104,40	104,21	6,50	6,66	123		0,6	Нет		25.04.2019	21.04.2022		RU000A100AP2
ХКФинБ1Р4	3,00	2,24	фикс.	7,50	4	100,74	100,41	7,36	7,52	209	0,304	0,7	Нет		26.06.2020	23.06.2023		RU000A101U79
ХКФинБ1Р5	0,65	2,54	фикс.	7,50	4	100,70	100,59	7,42	7,47	204	0,464	46,7	Нет		13.11.2020	10.11.2023		RU000A102CD0

Локальный рынок: ипотечные бумаги





Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

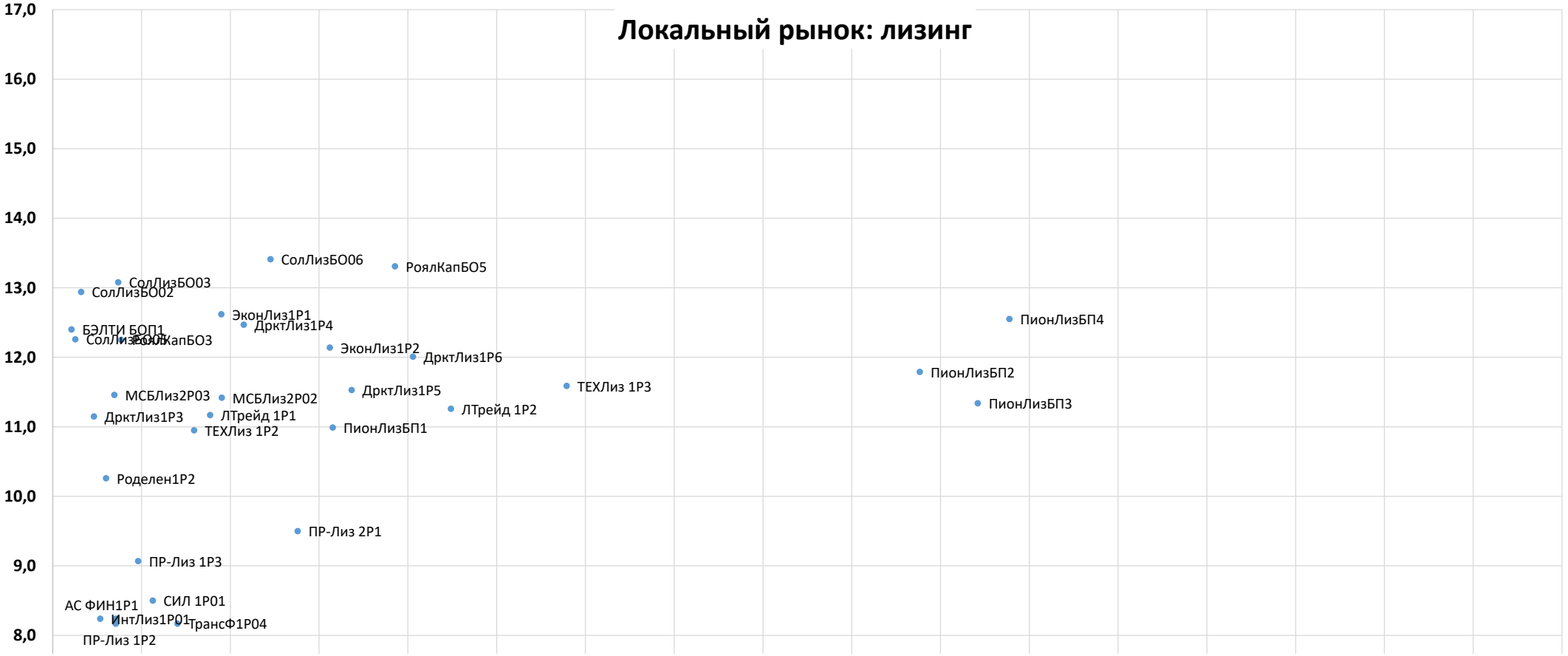
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ГПБ 2-ИП	15,00	0,10	фикс.		4	100,00		6,41		98			Да	5	26.02.2016		19.02.2021	/ Ba1 /	RU000A0JW5K0
ДОМ.РФ14об	7,00	0,33	фикс.	6,75	2	106,00	106,00	-10,35	-10,35	-1578		0,3	Да	5	27.08.2009		15.05.2023	/ Baa3 / BBB	RU000A0JQAL8
ДОМ.РФ15об	7,00	0,16	фикс.	6,75	2	114,05	114,03	-51,85	-51,80	-5723	2,281	0,7	Да	5	27.08.2009		15.09.2028	/ Baa3 / BBB	RU000A0JQAM6
ДОМ.РФ16об	1,00	0,65	фикс.	8,25	4	104,00		2,19		-324			Да	5	30.06.2010		15.09.2021	/ Baa3 / BBB	RU000A0JQXG0
ДОМ.РФ17об	2,80		фикс.	9,05	4	107,00		-1,23		-666			Да	5	09.02.2011		15.04.2022	/ Baa3 / BBB	RU000A0JR5F7
ДОМ.РФ18об	4,90	1,62	фикс.		4	105,00							Да	5	05.04.2011		15.07.2023	/ Baa3 / BBB	RU000A0JRDY3
ДОМ.РФ24об	6,00		фикс.		4	100,00		4,34		-109			Да	5	05.12.2012		01.11.2022	/ Baa3 / BBB	RU000A0JTDX1
ДОМ.РФ25об	6,00		фикс.		4	101,99		-4,66		-1009			Да	5	29.04.2013		01.10.2026	/ Baa3 / BBB	RU000A0JTW83
ДОМ.РФ26об	6,00		фикс.		4	116,05		-95,62		-10105			Да	5	25.06.2013		01.11.2029	/ Baa3 / BBB	RU000A0JTZF1
ДОМ.РФ30об	6,00	0,86	фикс.		4	100,00		5,14		-29			Да	5	28.04.2014		01.03.2033	/ Baa3 / BBB	RU000A0JUKX4
ДОМ.РФ31об	7,00		фикс.		2	100,00							Да	5	13.01.2015		01.02.2034	/ Baa3 / BBB	RU000A0JV4R9
Росбн13ИП	7,00		фикс.	9,65	2	103,56		4,53		-90			Да	5	01.10.2014	01.10.2021	01.10.2024	/ WR /	RU000A0JUV81
Росбн14ИП	3,25	1,56	фикс.	12,00	4	114,00		3,45		-198			Да	5	27.03.2014		27.03.2024	/ Baa3 /	RU000A0JUJG1
Росбн15ИП	4,69	1,82	фикс.	11,92	4	113,99		4,50		-93			Да	5	10.10.2014		10.10.2024	/ Baa3 /	RU000A0JUW23
Росбн18ИП	7,00		фикс.	10,29	2	104,70		4,68		-75			Да	5	24.11.2016		24.11.2021	/ Baa3 /	RU000A0JWZT6
Росбн19ИП	7,00		фикс.	7,82	2	99,18		8,44		301			Нет		28.12.2017		28.12.2022	/ Baa3 /	RU000A0ZYMD0

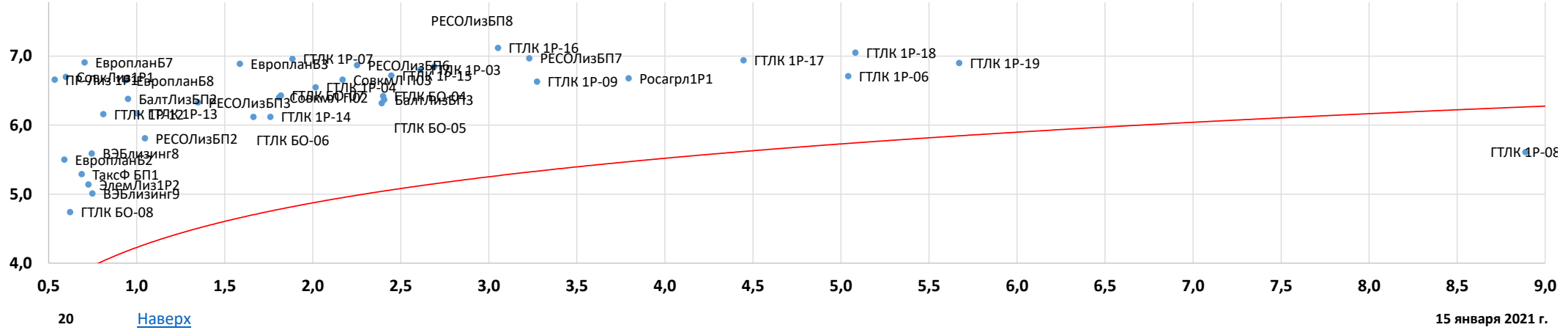
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Локальный рынок: лизинг





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АС ФИН1Р1	0,10	0,85	фикс.		4	100,00		8,24		281		0,5	Нет		18.12.2018	02.12.2021	22.11.2023		RU000A0ZZYF7
БалтЛизБО1	3,00		фикс.	12,95	4	100,99		0,05		-538			Да	10	20.02.2015		12.02.2021	/ / BB	RU000A0JV8U4
БалтЛизБО2		0,62	фикс.	8,00	4	101,55	101,55	3,71	5,59	16			Да	10	10.09.2015		02.09.2021	/ / BB	RU000A0JVRM0
БалтЛизБП2	2,80	0,95	фикс.	9,20	4	102,80	102,90	6,38	6,27	84	0,090	1,0	Да	10	08.07.2019		04.07.2022		RU000A100JE7
БалтЛизБП3	5,00	2,41	фикс.	7,15	4	102,25		6,37		94		1,5	Нет		31.07.2020		26.07.2024		RU000A101Z66
БЭЛТИ БОП1	0,11	0,61	фикс.	14,00	4	101,26	101,52	12,40	11,93	650	0,125	0,2	Нет		05.03.2019		01.03.2022		RU000A100535
ВЭБлиз2Р-1	3,00		фикс.	7,91	2								Нет		14.09.2015		01.09.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JVRV1
ВЭБлизБ01	5,00		фикс.		2								Нет		28.01.2014		16.01.2024	/ / BBB	RU000A0JUEE7
ВЭБлизБ04	5,00	0,06	фикс.	5,79	2	104,00		-45,59		-5102			Да	5	13.02.2015	05.02.2021	31.01.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JV8D0
ВЭБлизБ05	5,00		фикс.	5,79	2	104,76		-45,47		-5090			Да	5	17.02.2015	09.02.2021	04.02.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JV8G3
ВЭБлизБ06	5,00	3,50	фикс.	7,91	2	115,35		3,86		-157			Да	5	03.03.2015		18.02.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JV9D8
ВЭБлизБ07	5,00		фикс.	7,91	2	113,81		4,25		-118			Да	5	05.03.2015		20.02.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JV9H9
ВЭБлизБ09	5,00		фикс.	7,91	2								Нет		31.08.2015		18.08.2025	BBB- / / BBB*	RU000A0JVQQ3
ВЭБлизинг3	5,00	0,23	фикс.	7,27	2	100,51		4,82		-61			Да	5	15.04.2011		02.04.2021	/ / BBB	RU000A0JREW5
ВЭБлизинг4	5,00	0,21	фикс.	7,27	2	101,00	100,62	2,48	4,29	-114			Да	5	15.04.2011		02.04.2021	/ / BBB	RU000A0JREX3
ВЭБлизинг5	5,00	0,21	фикс.	7,27	2	100,70		3,90		-153			Да	5	15.04.2011		02.04.2021	/ / BBB	RU000A0JREZ8
ВЭБлизинг8	5,00	0,75	фикс.	7,25	2	101,26		5,59		16			Да	5	01.11.2011		19.10.2021	/ / BBB	RU000A0JRUY7
ВЭБлизинг9	5,00	0,75	фикс.	7,25	2	101,69	100,46	5,01	6,71	128	0,121		Да	5	02.11.2011		20.10.2021	/ / BBB	RU000A0JRV52
ГТЛК 1Р-01	2,31		фикс.	7,29	4	97,00		8,29		286			Нет		23.09.2016		05.09.2031	/ / BB+	RU000A0JWTV5
ГТЛК 1Р-02	5,66		фикс.	9,00	4	101,50		8,98		355			Нет		12.12.2016		24.11.2031	/ / BB+	RU000A0JX199
ГТЛК 1Р-03	10,00	2,61	фикс.	11,00	4	111,94	111,85	6,80	6,84	141	1,012	33,5	Да	10	09.02.2017	25.01.2024	22.01.2032	/ / BB+	RU000A0JXE06
ГТЛК 1Р-04	10,00	2,02	фикс.	9,85	4	107,20	107,08	6,55	6,61	118	2,487	9,2	Да	10	25.04.2017	11.04.2023	06.04.2032	/ / BB+	RU000A0JXPG2
ГТЛК 1Р-06	16,72	5,04	плав.	5,75	4	96,72	96,72	6,71	6,57	114		0,3	Да	10	20.09.2017		01.09.2032	NR / / BB+*	RU000A0ZYAP9
ГТЛК 1Р-07	10,00	1,88	плав.	5,00	4	96,70	96,70	6,96	6,96	153	0,772	5,2	Да	10	19.01.2018	13.01.2023	31.12.2032	NR / / BB+*	RU000A0ZYNY4
ГТЛК 1Р-08	10,00	8,89	плав.	8,15	4	97,01	97,04	5,61	5,60	17	0,165	2,5	Да	10	06.02.2018	02.08.2022	18.01.2033	/ WR /	RU000A0ZYR91
ГТЛК 1Р-09	10,00	3,27	фикс.	7,35	4	102,87	102,54	6,63	6,73	130	0,906	33,4	Да	10	06.04.2018	27.09.2024	18.03.2033	NR / / BB+*	RU000A0ZZ1J8
ГТЛК 1Р-10	10,00	9,24	плав.	4,90	4	97,18	97,19	5,32	5,31	-12		2,8	Да	10	08.06.2018	03.06.2022	20.05.2033	NR / / BB+*	RU000A0ZZ984
ГТЛК 1Р-12	5,00	0,81	фикс.	9,90	4	103,19	103,45	6,16	5,80	37		18,0	Да	10	23.11.2018	19.11.2021	04.11.2033	NR / / BB+*	RU000A0ZZV11
ГТЛК 1Р-13	10,00	1,00	фикс.	9,50	4	103,65	103,50	6,17	6,18	75	3,664	4,0	Да	10	08.02.2019	28.01.2022	20.01.2034	NR / / BB+*	RU000A1003A4
ГТЛК 1Р-14	10,00	1,76	фикс.	8,85	4	105,10	105,10	6,12	6,12	69	0,078	38,2	Да	10	13.06.2019	13.12.2022	25.05.2034	NR / / BB+*	RU000A100FE5
ГТЛК 1Р-15	25,00	2,45	фикс.	7,69	4	102,78	102,72	6,72	6,75	132	9,478	18,3	Да	10	29.10.2019		21.10.2025	NR / / BB+*	RU000A100Z91
ГТЛК 1Р-16	10,00	3,05	фикс.	6,95	4	100,05	100,05	7,12	7,12	169		120,1	Да	10	27.02.2020		17.02.2028	NR / / BB+*	RU000A101GD3
ГТЛК 1Р-17	10,00	4,45	фикс.	7,44	4	103,00	103,18	6,94	6,90	147	8,314	8,6	Да	10	01.06.2020	25.05.2026	14.05.2035	NR / / BB+*	RU000A101QL5
ГТЛК 1Р-18	5,00	5,08	фикс.	7,84	4	105,05	105,06	7,05	7,03	160	0,781	0,8	Да	10	10.06.2020	02.06.2027	23.05.2035	NR / / BB+*	RU000A101SC0

ГТЛК 1Р-19	5,00	5,67	фикс.	7,97	4	107,15	106,52	6,90	7,01	158	0,178	0,2	Нет		10.06.2020	31.05.2028	23.05.2035	NR / / BB+*	RU000A101SD8
ГТЛК БО-03	1,50		фикс.		4								Нет		23.12.2014		10.12.2024	/ / BB+	RU000A0JV375
ГТЛК БО-04	5,00	2,40	фикс.	7,98	4	104,13	104,46	6,42	6,28	85	0,331	24,7	Да	10	19.03.2015	07.09.2023	06.03.2025	/ / BB+	RU000A0JVA10
ГТЛК БО-05	4,00	2,39	фикс.	11,00	4	112,16	112,26	6,32	6,28	85		0,2	Да	10	30.10.2015	20.10.2023	17.10.2025	/ / BB+	RU000A0JVWD9
ГТЛК БО-06	4,00	1,66	фикс.	6,88	4	101,50	101,47	6,12	6,13	70	0,069	3,7	Да	10	02.11.2015		20.10.2025	/ / BB+	RU000A0JVWJ6
ГТЛК БО-07	4,00	1,82	фикс.	6,89	4	101,10	101,00	6,43	6,49	106	0,233	112,4	Да	10	29.12.2015		16.12.2025	/ / BB+	RU000A0JW1P8
ГТЛК БО-08	5,00	0,62	фикс.	11,10	2	104,90	104,90	4,74	3,36	-207			Да	10	13.09.2016	31.08.2021	01.09.2026	/ / BB+	RU000A0JWST1
ГТЛК1520 2	35,60		плав.	5,55	4								Да	10	31.01.2020		18.01.2030	NR / / BB+*	RU000A101D54
ДркгЛиз1Р2	0,10	0,19	фикс.	13,00	4	100,41	100,70	11,18	9,50	407	0,768	0,4	Нет		29.03.2018		25.03.2021		RU000A0ZZ0D3
ДркгЛиз1Р3	0,10	0,73	фикс.	14,00	4	102,42	102,54	11,15	10,97	554	0,059	0,2	Нет		30.10.2018		26.10.2021		RU000A0ZZR90
ДркгЛиз1Р4	0,10	1,58	фикс.	13,00	4	101,69	101,63	12,47	12,51	708	0,061	0,4	Нет		29.10.2019		25.10.2022		RU000A100Z00
ДркгЛиз1Р5	0,10	2,18	фикс.	12,00	4	102,04	101,99	11,53	11,56	613	0,052	0,5	Нет		04.08.2020		01.08.2023		RU000A101ZF8
ДркгЛиз1Р6	0,20	2,53	фикс.	11,50	4	99,99	99,97	12,01	12,02	659	1,058		Нет		29.12.2020		26.12.2023		RU000A102M45
ЕвропланБ2	5,00	0,59	фикс.	8,60	4	101,89		5,50		7		0,2	Да	10	31.08.2015		23.08.2021	/ / BB	RU000A0JVQT7

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ЕвропланБ3	5,00	1,59	фикс.	8,80	2	103,19	103,17	6,89	6,90	147	0,147	0,9	Да	10	03.10.2019	29.09.2022	20.09.2029	/ / BB*	RU000A100W60
ЕвропланБ5	3,00	0,11	фикс.	9,75	2	100,46	100,32	5,46	6,76	133	0,149	0,8	Да	10	27.02.2019	24.02.2021	14.02.2029	/ / BB*	RU000A1004K1
ЕвропланБ6	3,00	0,36	фикс.	9,40	2	101,12	100,94	6,23	6,75	132	0,205	0,5	Да	10	28.05.2019	25.05.2021	15.05.2029	/ / BB*	RU000A100DG5
ЕвропланБ7	5,00	0,70	фикс.	8,50	2	101,16	101,13	6,91	6,96	153	1,013	0,4	Да	10	11.10.2016	05.10.2021	29.09.2026	/ / BB	RU000A0JWVL2
ЕвропланБ8	5,00	0,94	фикс.	7,40	2	100,77	100,87	6,65	6,54	111	0,218	0,3	Да	10	03.07.2018	28.12.2021	20.06.2028	/ / BB*	RU000A0ZZBV2
ИКС5ФинР10	10,00		фикс.	6,90	2	130,00		-13,55		-1898			Нет		21.04.2020	19.04.2022	03.04.2035	BB+ / / *	RU000A101LH4
ИнтЛиз1Р01	0,61	0,77	фикс.	8,00	4	100,00	100,07	8,24	8,14	271	1,202	12,1	Нет		02.11.2020	01.11.2021	30.10.2023	/ / *	RU000A102B30
ЛТрейд 1Р1	0,50	1,39	фикс.	12,50		102,67	102,66	11,17	11,13	570	0,571	1,2	Нет		23.01.2020		07.01.2023	/ / *	RU000A101CB6
ЛТрейд 1Р2	0,30	2,74	фикс.	10,80		100,23	100,19	11,26	11,28	585	0,846	6,3	Нет		22.10.2020		01.10.2024	/ / *	RU000A1029F8
МСБЛиз2Р01	0,02	0,19	фикс.	13,75		101,49	101,48	5,95	6,01	58	0,212	0,7	Нет		21.11.2018		09.05.2021	/ / *	RU000A0ZZUR0
МСБЛиз2Р03	0,06	0,85	фикс.	12,50		101,44	101,42	11,46	11,36	593	0,968	0,4	Нет		15.10.2020		05.10.2022	/ / *	RU000A1028N4
МСБЛиз2Р02	0,10	1,45	фикс.	12,75		102,75	102,82	11,42	11,37	594	0,300	0,6	Нет		27.05.2019		30.04.2024	/ / *	RU000A100DC4
ПионЛизБП1	0,09	2,08	фикс.	12,25		103,61	102,63	10,99	11,56	613	0,609	0,3	Нет		26.06.2018		31.05.2023	/ / *	RU000A0ZZAT8
ПионЛизБП2	0,30	5,38	плав.	10,50		96,30	96,44	11,79	11,76	633	0,956	1,3	Нет		15.03.2019		21.01.2029	/ / *	RU000A1006C3
ПионЛизБП3	0,40	5,71	фикс.			96,95	96,90	11,34	11,35	592	0,784	2,0	Нет		26.11.2019		04.10.2029	/ / *	RU000A1013N6
ПионЛизБП4	0,02	5,89	фикс.	12,00	4	100,03	100,03	12,55	12,55	712	1,213		Нет		25.12.2020	24.12.2021	13.12.2030	/ / *	RU000A102LF6
ПР-Лиз 1Р1	0,10	0,53	фикс.		4	101,23	101,30	6,66	6,98	155	0,226	0,4	Нет		08.08.2018		04.08.2021	/ / *	RU000A0ZZFP5
ПР-Лиз 1Р2	0,15	0,85	фикс.		4	102,17	102,19	8,17	8,16	273	0,082	1,2	Нет		10.12.2018		06.12.2021	/ / *	RU000A0ZZX35
ПР-Лиз 1Р3	0,40	0,98	фикс.	12,00		103,25	102,97	9,07	9,37	394	1,089	1,3	Нет		13.08.2019	29.01.2022	07.07.2026	/ / *	RU000A100Q35
ПР-Лиз 2Р1	1,00	1,88	фикс.	10,00		101,68	101,45	9,50	9,63	420	6,096	5,4	Нет		27.08.2020	13.02.2023	10.08.2029	/ / *	RU000A1022E6
РГ Лиз 01	3,00	0,27	фикс.		2	100,00	100,02	7,32	7,24	181	0,078	0,2	Нет		27.10.2016		21.10.2021	NR / / *	RU000A0JWWX5
РЕСОЛизБ01	2,50		фикс.	9,60	2	99,91		9,89		446			Да	10	03.10.2013	24.03.2022	21.09.2023	BB+ / / *	RU000A0JU6M6
РЕСОЛизБ03	3,00		фикс.	6,70	2	105,15		3,62		-181			Да	10	16.10.2015	11.10.2022	03.10.2025	BB+ / / *	RU000A0JVUS1
РЕСОЛизБ04	3,00		фикс.	9,60	2	108,96		2,57		-286			Да	10	12.11.2015	10.05.2022	30.10.2025	BB+ / / *	RU000A0JVXS5
РЕСОЛизБ05	3,00		фикс.	12,60	2	140,00		-29,12		-3455			Да	10	14.10.2016	03.10.2021	02.10.2026	BB+ / / *	RU000A0JWVT5
РЕСОЛизБП2	5,00	1,05	фикс.	9,70	2	104,20	104,32	5,81	5,70	27		17,6	Да	10	28.02.2019		24.02.2022	BB+ / / *	RU000A1004S4
РЕСОЛизБП3	5,00	1,35	фикс.	7,50	2	101,65	101,35	6,33	6,57	114	0,356	0,7	Нет		11.06.2020	09.06.2022	08.06.2023	BB+ / / *	RU000A101ST4
РЕСОЛизБП4	5,00	0,40	фикс.	9,30	2	101,50	101,43	5,45	5,64	21	1,830	3,5	Да	10	11.06.2019		08.06.2021	BB+ / / *	RU000A100F95
РЕСОЛизБП6	8,00	2,25	фикс.	9,00	2	105,15	105,18	6,87	6,86	143	0,365	4,6	Да	10	06.08.2019		01.08.2023	BB+ / / *	RU000A100PE4
РЕСОЛизБП7	5,00	3,23	фикс.	8,65	2	105,82	105,89	6,97	6,95	152	0,789	2,6	Да	10	18.10.2019		11.10.2024	BB+ / / *	RU000A100XU4
РЕСОЛизБП8	5,00	2,69	фикс.	6,85	2	100,30	100,25	6,85	6,87	144	0,346		Нет		21.12.2020	18.12.2023	09.12.2030	BB+ / / *	RU000A102K39
Роделен1Р1	0,04	0,44	фикс.	12,50		101,52	101,71	9,40	8,93	350	0,218	0,4	Нет		26.11.2018		10.11.2021	/ / *	RU000A0ZZV52
Роделен1Р2	0,07	0,80	фикс.	12,00		101,75	101,58	10,26	10,49	506	0,347	0,7	Нет		02.10.2019		16.09.2022	/ / *	RU000A100W29
Росагрл1Р1	8,00	3,79	фикс.	7,35	2	102,90	102,90	6,68	6,68	125	16,00	2,6	Нет		03.06.2020		28.05.2025	/ / BB+*	RU000A101R09
РоялКапБО3	0,05	0,88	фикс.	14,00	4	101,97	101,34	12,25	13,03	760		0,1	Нет		24.12.2019		21.12.2021	/ / *	RU000A1018F1
РоялКапБО5	0,08	2,43	фикс.	13,00	4	100,72	100,78	13,31	13,28	785	0,244	0,7	Нет		08.12.2020		05.12.2023	/ / *	RU000A102FX1

СИЛ 1Р01	0,08	1,06	фикс.	10,50		102,48		8,50		307		2,3	Нет	17.03.2020	02.03.2023	/ / *	RU000A101J82
СовкЛиз1Р1	2,10	0,60	фикс.	10,35	4,00	102,25	102,18	6,70	6,82	139	0,353	0,9	Нет	25.12.2018	21.12.2021	/ / BB+*	RU000A0ZZZN8
СовкмЛ П02	2,00	1,81	фикс.	6,60	4,00	100,63	100,63	6,40	6,40	97			Нет	21.07.2020	18.07.2023	/ / BB+*	RU000A101XE6
СовкмЛ П03	1,00	2,17	фикс.	6,50	4,00	100,00		6,66		123			Нет	11.12.2020	08.12.2023	/ / BB+*	RU000A102GW1
СолЛизБО01	0,20	0,49	фикс.	13,50	4,00	101,01	101,01	11,95	11,93	650	0,112	0,1	Нет	24.07.2018	18.07.2023	/ / *	RU000A0ZZEA0
СолЛизБО02	0,18	0,66	фикс.	13,50	4,00	100,73	100,36	12,94	13,57	814	0,236	0,5	Нет	25.09.2018	19.09.2023	/ / *	RU000A0ZZMQ9
СолЛизБО03	0,11	0,87	фикс.		4,00	100,00	100,00	13,08	13,08	765	0,237	0,4	Нет	17.12.2018	11.12.2023	/ / *	RU000A0ZZY42
СолЛизБО04	0,22	0,15	фикс.		4,00	99,99	99,79	13,08	14,66	923	0,934	2,0	Нет	11.03.2019	04.03.2024	/ / *	RU000A1005N2
СолЛизБО05	0,01	0,63	фикс.		4,00	100,42	100,30	12,26	12,54	711	0,227	1,0	Нет	11.09.2019	07.09.2022	/ / *	RU000A100TD8
СолЛизБО06	0,22	1,73	фикс.	13,00	4,00	100,35	100,42	13,41	13,37	794	0,251	0,8	Нет	24.12.2019	20.12.2022	/ / *	RU000A1018D6
ТаксФ БП1	0,11	0,69	фикс.	15,00		106,90	106,32	5,29	6,12	69	0,710		Нет	03.06.2019	18.05.2022	/ / *	RU000A100E70
ТЕХЛиз 1Р1	0,11	0,31	фикс.	13,75	4,00	101,04	101,01	10,72	10,82	539	0,648	0,6	Нет	28.05.2019	25.05.2021	/ / B-*	RU000A100DM3

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

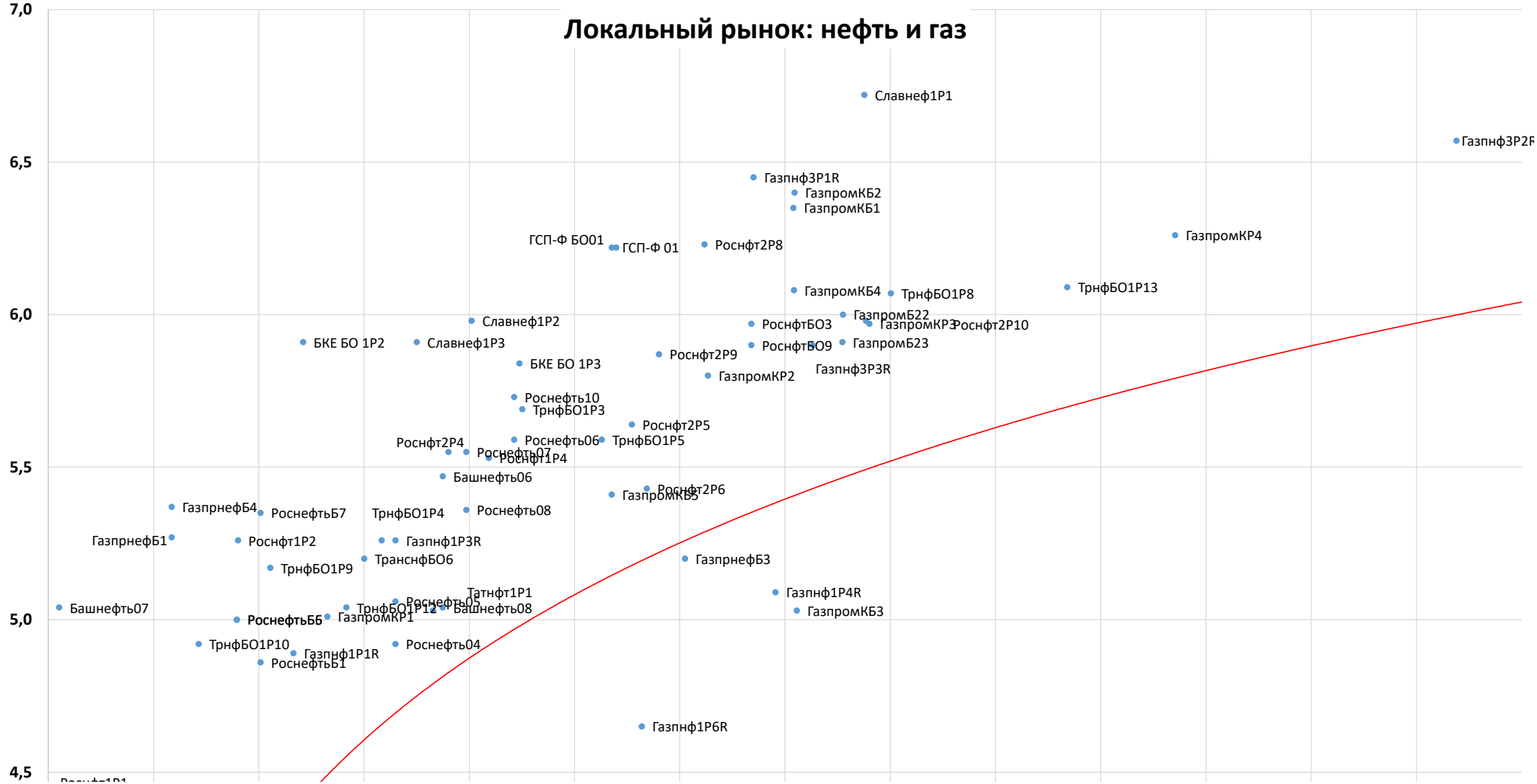
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность			Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.	
ТЕХЛиз 1Р2	0,20	1,30	фикс.	13,25	4	103,53	103,37	10,95	11,08	565	0,185	0,7	Нет		28.08.2019		24.08.2022	/ / B-*	RU000A100RS0
ТЕХЛиз 1Р3	0,25	3,39	фикс.	12,50		105,11	105,32	11,59	11,53	610	0,664	1,6	Нет		26.08.2020		31.07.2025	/ / B-*	RU000A102234
ТрансФ1Р01	1,00		фикс.	9,50	2	102,00		4,29		-114			Нет		21.10.2016		09.10.2026	B / / *	RU000A0JWWM8
ТрансФ1Р02	5,00	0,13	фикс.		2	99,91	99,91	9,55	9,46	403			Нет		06.03.2017		22.02.2027	B / / *	RU000A0JXK99
ТрансФ1Р03	0,50		фикс.	10,50	2								Нет		10.07.2017		28.06.2027	B / / *	RU000A0JXVB1
ТрансФ1Р04	10,00	1,20	фикс.		2	101,08	100,94	8,17	8,30	287	2,259	2,6	Нет		26.10.2017		14.10.2027	B / / *	RU000A0ZYEB1
ТрансФ1Р05	0,60		фикс.	9,50	2	136,20		-26,78		-3221			Нет		15.11.2017		03.11.2027	B / / *	RU000A0ZYFS2
ТрансФ1Р06	1,00		фикс.		2								Нет		16.09.2019		03.09.2029	B / / *	RU000A100TS6
ТрансФ2Р01	48,66		плав.	5,90	4							248,8	Нет		13.02.2020	29.01.2027	04.02.2027	B / / *	RU000A101EN7
ТрансФ2Р02	4,12		плав.	6,15	4							56,6	Нет		27.05.2020		04.02.2027	B / / *	RU000A101Q34
ТрансФБО27	2,60	0,41	фикс.		2	105,00		-4,06		-949			Нет		29.06.2016		23.06.2021	B / / *	RU000A0JWLW0
ТрансФБО29	2,50		фикс.		2	100,00		7,26		183			Нет		30.06.2014		17.06.2024	B / / *	RU000A0JUQ96
ТрансФБО30	2,00		фикс.		2	99,98		6,65		122			Нет		18.07.2014		05.07.2024	B / / *	RU000A0JUR04
ТрансФБО31	0,64		фикс.		2	100,40		6,16		73			Нет		11.03.2015		26.02.2025	B / / *	RU000A0JV9Q0
ТрансФБО36	7,00		фикс.	10,00	2								Нет		05.11.2014	27.10.2021	23.10.2024	B / / *	RU000A0JUYC9
ТрансФБО37	2,00		фикс.	10,50	2	128,66		-18,50		-2393			Нет		24.11.2014	15.11.2021	11.11.2024	B / / *	RU000A0JUZZ7
ТрансФБО38	2,50		фикс.		2	100,00		6,60		117			Нет		13.01.2015		31.12.2024	B / / *	RU000A0JV4S7
ТрансФБО39	2,10	0,40	фикс.	13,50	2	102,69		6,60		117		0,2	Нет		17.06.2015	09.06.2021	04.06.2025	B / / *	RU000A0JVHH1
ТрансФБО40	0,50		фикс.		2	100,00		7,11		168			Нет		24.08.2015		11.08.2025	B / / *	RU000A0JVPS1
ТрансФБО41	2,15		фикс.		2	100,00		7,62		219			Нет		23.09.2015		03.09.2025	B / / *	RU000A0JVS36
ТрансФБО42	1,00		фикс.		2								Нет		19.02.2016		06.02.2026	B / / *	RU000A0JW5B9
ТрансФБО43	1,60		фикс.		2								Нет		25.04.2016		13.04.2026	B / / *	RU000A0JWEG8
ТрансФБО44	2,50		плав.	5,75	2								Нет		06.12.2016		24.11.2026	B / / *	RU000A0JX0U9
ЭконЛиз1Р1	0,10	1,45	фикс.	13,50	4	102,13	102,71	12,62	12,14	671	0,690	0,2	Нет		28.08.2019		24.08.2022	/ / *	RU000A100RQ4
ЭконЛиз1Р2	0,20	2,06	фикс.	12,00	4	100,76	100,64	12,14	12,20	677	0,146	1,6	Нет		29.05.2020		26.05.2023	/ / *	RU000A101QC4
ЭлемЛиз1Р1	0,44	0,19	фикс.	10,60	4	101,17	100,79	4,51	6,57	114		1,5	Нет		30.03.2018		26.03.2021	NR / / WD*	RU000A0ZZ0L6
ЭлемЛиз1Р2	3,32	0,73	фикс.	10,25	4	103,83	104,35	5,14	4,43	-100		0,6	Нет		23.04.2019		19.04.2022	NR / / WD*	RU000A100A41
ЭлемЛизБО4	2,00		фикс.		4	132,82		-73,26		-7869			Нет		05.04.2016		30.03.2021	NR / / WD*	RU000A0JWC66

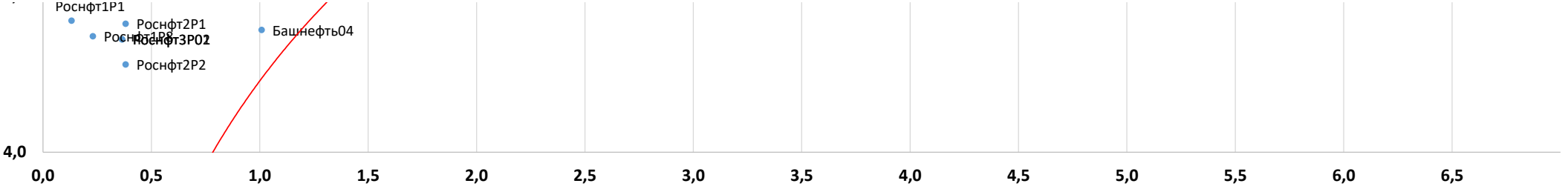
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Локальный рынок: нефть и газ





Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
Башнефть04	10,00	1,01	фикс.	7,00	2	102,71	104,71	4,39	2,46	-297			Да	5	17.02.2012		04.02.2022	/ / BBB	RU000A0JS3U0
Башнефть06	10,00	1,87	фикс.	7,70	2	104,45	104,53	5,47	5,40	-3	2,380	4,1	Да	5	12.02.2013		31.01.2023	/ / BBB	RU000A0JTM28
Башнефть07	10,00	0,05	фикс.	6,30	2	100,46	100,38	5,04	-1,37	-680		3,5	Да	5	12.02.2013	02.02.2021	31.01.2023	/ / BBB	RU000A0JTM36
Башнефть08	5,00	1,87	фикс.	7,70	2	105,22		5,04		-39			Да	5	12.02.2013		31.01.2023	/ / BBB	RU000A0JTM44
Башнефть09	5,00	0,05	фикс.	6,30	2	100,29	100,29	0,39	0,39	-504		0,2	Да	5	12.02.2013	02.02.2021	31.01.2023	/ / BBB	RU000A0JTM51
БашнфБ1Р1R	10,00		фикс.	9,50	2								Нет		22.12.2016		12.12.2024	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JX2P5
БашнфБ1Р2R	10,00		фикс.	9,50	2	109,80		5,88		45			Да	5	22.12.2016		14.12.2023	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JX2X9
БашнфБ1Р3R	5,00		фикс.	9,40	2								Нет		30.01.2017		22.01.2024	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JX9X4
БашнфБО10	5,00		фикс.	9,50	2								Нет		22.12.2016	12.12.2024	10.12.2026	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JX2Q3
БашнфБО2	10,00		фикс.	10,50	2								Нет		24.05.2016	16.05.2023	12.05.2026	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JWH87
БашнфБО3	5,00		фикс.		2								Нет		22.05.2015		09.05.2025	/ / WD	RU000A0JVEQ9
БашнфБО4	5,00		фикс.		2								Нет		01.06.2015		19.05.2025	/ / WD	RU000A0JVFD4
БашнфБО5	10,00		фикс.		2	102,19		-2,12		-755			Да	5	26.05.2014		13.05.2024	/ / WD	RU000A0JUML5
БашнфБО6	10,00	3,50	фикс.	10,90	2	106,70	106,70	9,22	9,18	375	3,632	9,5	Да	5	11.05.2016	30.04.2025	29.04.2026	/ / BBB	RU000A0JWGC2
БашнфБО7	5,00		фикс.	12,10	2								Нет		16.06.2015	08.06.2021	03.06.2025	/ / WD	RU000A0JVHF5
БашнфБО8	5,00	3,52	фикс.	10,90	2	112,00	112,00	7,71	7,71	228	0,067		Да	5	11.05.2016	30.04.2025	29.04.2026	/ / BBB	RU000A0JWGD0
БашнфБО9	5,00		фикс.	9,30	2	106,80		5,27		-16			Да	5	27.10.2016	20.10.2022	15.10.2026	/ Baa3 / BBB*	RU000A0JWX04
БКЕ БО 1Р2	15,00	1,21	фикс.	8,55	2	103,27	103,27	5,91	5,91	48	0,529	4,0	Да	10	23.04.2019		23.04.2022		RU000A100A33
БКЕ БО 1Р3	10,00	2,24	фикс.	8,40	2	105,89	105,21	5,84	6,14	71	0,707	6,0	Да	10	18.06.2019		18.06.2023		RU000A100G03
Газпнф1Р1R	15,00	1,16	фикс.	8,70	2	104,52	104,52	4,89	4,89	-54		1,6	Да	5	12.04.2017		06.04.2022	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXNF9
Газпнф1Р2R	15,00		фикс.	8,25	2								Нет		08.08.2017		30.07.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXYL4
Газпнф1Р3R	25,00	1,65	фикс.	7,85	2	104,38	104,37	5,26	5,27	-16	13,36	81,8	Да	5	23.10.2017		17.10.2022	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYDS7
Газпнф1Р4R	10,00	3,45	фикс.	7,70	2	109,38	108,10	5,09	5,44	1	0,165	0,1	Да	5	21.12.2017		12.12.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYLC4
Газпнф1Р5R	5,00	3,48	фикс.	7,70	2	114,80		3,65		-178			Да	5	25.12.2017		16.12.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYLQ4
Газпнф1Р6R	25,00	2,82	фикс.	7,20	2	107,52	107,47	4,65	4,67	-76	0,687	17,7	Да	5	15.03.2018		07.03.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYXV9
Газпнф3Р1R	25,00	3,35	фикс.	6,85	4	101,86	101,91	6,45	6,43	100	271,5	21,9	Да	5	12.11.2019		05.11.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101137
Газпнф3Р2R	20,00	6,69	фикс.	7,15	4	105,00	105,12	6,57	6,55	112	3,987	2,5	Да	5	20.12.2019		07.12.2029	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1017J5
Газпнф3Р3R	10,00	3,63	фикс.	6,20	4	101,55	101,41	5,90	5,94	51		0,3	Да	5	27.02.2020		20.02.2025	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101GJ0
Газпнф3Р4R	20,00		плав.	4,75	4								Нет		25.12.2020		05.11.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A102L95
Газпрнеф10	10,00	0,03	фикс.	7,60	2	100,30	100,39	-2,24	-5,01	-1044	2,844	39,8	Да	5	08.02.2011		26.01.2021	BBB- / / BBB	RU000A0JR878
ГазпрнефБ1	5,00	0,59	фикс.	9,40	2	102,46	102,49	5,27	5,22	-21		3,1	Да	5	30.08.2016	19.08.2021	24.07.2046	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JWRE5
ГазпрнефБ3	10,00	3,02	фикс.	7,75	2	107,99	107,99	5,20	5,20	-23			Да	5	09.06.2016	25.05.2024	03.05.2046	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JWK41
ГазпрнефБ4	10,00	0,59	фикс.	9,40	2	102,40	102,40	5,37	5,37	-6		7,5	Да	5	30.08.2016	17.08.2021	24.07.2046	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JWRF2
ГазпромБ19	15,00		плав.	4,99	2								Нет		27.11.2013		21.10.2043	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JUAN6
ГазпромБ20	15,00		плав.	4,99	2								Нет		27.11.2013		21.10.2043	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JUAP1
ГазпромБ22	15,00	3,78	фикс.	8,10	2	108,87	108,84	6,00	5,92	49	1,640	2,7	Да	5	31.07.2018	22.07.2025	23.06.2048	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZES2
ГазпромБ23	15,00	3,77	фикс.	8,10	2	108,88	108,18	5,91	6,08	65		9,3	Да	5	31.07.2018	22.07.2025	23.06.2048	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZET0
ГазпромБО7	10,00		фикс.	8,10	2								Нет		31.07.2018	22.07.2025	12.07.2033	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZER4
ГазпромКР1	15,00	1,33	фикс.	7,99	2	104,00	104,18	5,01	4,87	-56		3,7	Да	5	06.06.2019		02.06.2022	BBB- / / *	RU000A100EX8
ГазпромКР2	15,00	3,13	фикс.	7,80	2	106,51	106,50	5,80	5,80	37	21,33	2,7	Да	5	18.07.2019		11.07.2024	BBB- / / *	RU000A100LL8

ГазпромКР3	15,00	3,90	фикс.	5,70	2	99,29	99,43	5,97	5,93	50		78,1	Да	5	02.06.2020		27.05.2025	BBB- / / *	RU000A101QM3
ГазпромКР4	15,00	5,35	фикс.	5,90	2	98,58	98,95	6,26	6,19	76	5,337	4,1	Да	5	02.06.2020		25.05.2027	BBB- / / *	RU000A101QN1
ГазпромКБ1	5,00	3,54	фикс.	7,15	2	103,38	103,38	6,35	6,30	87		6,4	Да	5	27.02.2018	18.02.2025	15.02.2028	BBB / /	RU000A0ZYUV5
ГазпромКБ2	5,00	3,55	фикс.	7,15	2	103,00		6,40		97			Да	5	27.02.2018	18.02.2025	15.02.2028	BBB / /	RU000A0ZYUW3
ГазпромКБ3	10,00	3,56	фикс.	7,15	2	107,99	107,99	5,03	5,03	-40		3,0	Да	5	27.02.2018	18.02.2025	15.02.2028	BBB / /	RU000A0ZYUY9
ГазпромКБ4	10,00	3,54	фикс.	7,15	2	104,15	104,15	6,08	6,08	65	0,427	1,0	Да	5	27.02.2018	18.02.2025	15.02.2028	BBB / /	RU000A0ZYV04
ГазпромКБ5	15,00	2,68	фикс.	8,90	2	109,95	109,93	5,41	5,41	-2	9,003	12,6	Да	5	15.02.2017	07.02.2024	03.02.2027	BBB- / / *	RU000A0JXFS8
ГазпромКБ6	15,00		фикс.	8,90	2	107,90		6,13		70			Да	5	15.02.2017	05.02.2024	03.02.2027	BBB- / / *	RU000A0JXFY6

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ГСП-Ф 01	5,00	2,68	фикс.	6,85	4	102,05		6,22		79			Нет		24.12.2020		21.12.2023		RU000A102KZ6
ГСП-Ф 02	225,20		плав.	6,18	4								Нет		29.12.2020		27.03.2028		RU000A102MA5
ГСП-Ф БО01	1,00	2,70	фикс.	6,60	4	101,39		6,22		79			Нет		30.12.2020		27.12.2023		RU000A102MR9
НафтгрнБО1	0,12	2,47	фикс.	13,50		103,03	103,26	13,00	12,90	747	0,991		Нет		06.02.2019	19.01.2021	11.01.2024		RU000A100303
НафтгрнБО2	0,14	0,08	плав.	13,00		103,26	103,68	-22,97	-26,68	-3211	0,684	0,2	Нет		23.10.2019		26.09.2024		RU000A100YD8
ННК 04	5,00	0,38	фикс.		2	98,38	98,11	13,38	14,24	881	2,821	5,7	Нет		14.06.2011		01.06.2021	/ / WD	RU000A0JRJV6
ННК 06	5,00	0,39	фикс.		2	98,41	98,45	13,35	13,11	768	0,307	1,0	Нет		17.06.2011		04.06.2021	/ / WD	RU000A0JRK22
Роснефть04	10,00	1,65	фикс.	7,90	2	105,03	105,03	4,92	4,92	-51		0,1	Да	5	29.10.2012		17.10.2022	BBB- / / WD*	RU000A0JT940
Роснефть05	10,00	1,65	фикс.	7,90	2	104,80	104,79	5,06	5,07	-36		0,2	Да	5	29.10.2012		17.10.2022	BBB- / / WD*	RU000A0JT965
Роснефть06	10,00	2,21	фикс.	7,00	2	103,25	103,25	5,59	5,59	16	5,031	1,2	Да	5	11.06.2013		30.05.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JTYL2
Роснефть07	15,00	1,99	фикс.	7,30	2	103,65	104,62	5,55	5,06	-37	0,288	19,4	Да	5	22.03.2013		10.03.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JTS06
Роснефть08	15,00	1,99	фикс.	7,30	2	104,03	104,20	5,36	5,27	-16	19,07	8,6	Да	5	22.03.2013		10.03.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JTS22
Роснефть09	15,00		фикс.	7,00	2	105,00		4,80		-63			Да	5	11.06.2013		30.05.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JTYM0
Роснефть10	15,00	2,21	фикс.	7,00	2	102,95	102,93	5,73	5,74	31			Да	5	11.06.2013		30.05.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JTYN8
РоснефтьБ1	15,00	1,01	фикс.	8,90	2	104,20	104,18	4,86	4,88	-55	0,057	0,2	Да	5	18.02.2014	08.02.2022	06.02.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JUFU0
РоснефтьБ5	20,00	0,90	фикс.	6,65	2	101,50		5,00		-43		0,4	Да	5	23.12.2013		11.12.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JUCS1
РоснефтьБ6	20,00	0,90	фикс.	6,65	2	101,50	101,50	5,00	5,00	-43		19,5	Да	5	23.12.2013	13.12.2021	11.12.2023	BBB- / / WD*	RU000A0JUCR3
РоснефтьБ7	20,00	1,01	фикс.	8,90	2	103,70	103,95	5,35	5,10	-33		3,6	Да	5	18.02.2014	08.02.2022	06.02.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JUFV8
Роснфт1Р1	600,00	0,13	плав.	4,35	4	100,00		4,42		-101		0,4	Да	5	07.12.2016	01.12.2021	25.11.2026	BBB- / / WD*	RU000A0JX132
Роснфт1Р2	30,00	0,90	фикс.	9,39	2	103,72	103,72	5,26	5,26	-17		81,7	Да	5	23.12.2016	17.12.2021	11.12.2026	BBB- / / WD*	RU000A0JX355
Роснфт1Р3	20,00		фикс.	9,50	2								Нет		29.12.2016		17.12.2026	BBB- / / WD*	RU000A0JX413
Роснфт1Р4	40,00	2,09	фикс.	8,65	2	106,73	106,68	5,53	5,56	13	12,93	98,6	Да	5	04.05.2017	27.04.2023	22.04.2027	BBB- / / WD*	RU000A0JXQK2
Роснфт1Р5	15,00		фикс.	8,60	4								Нет		18.05.2017		08.05.2025	BBB- / / WD*	RU000A0JXR68
Роснфт1Р6	90,00	0,02	фикс.	8,50	2	100,32		-13,30		-1873		0,4	Да	5	26.07.2017	20.01.2021	14.07.2027	BBB- / / WD*	RU000A0JXXD3
Роснфт1Р7	176,00	0,02	фикс.	8,50	2	100,65		-31,13		-3656			Да	5	26.07.2017	20.01.2021	14.07.2027	BBB- / / WD*	RU000A0JXXE1
Роснфт1Р8	100,00	0,23	фикс.		2	100,00		4,37		-106		0,4	Да	5	12.10.2017		30.09.2027	BBB- / / WD*	RU000A0ZYCP5
Роснфт2Р1	300,00	0,38	фикс.		2	99,99		4,41		-102			Да	5	06.12.2017		24.11.2027	BBB- / / WD*	RU000A0ZYJH7
Роснфт2Р10	15,00	3,88	фикс.	5,80	4	99,81	99,72	5,98	6,00	57		16,1	Да	5	10.06.2020	04.06.2025	29.05.2030	BBB- / / WD*	RU000A101SF3
Роснфт2Р2	300,00	0,38	фикс.		2	100,04		4,28		-115			Да	5	06.12.2017		24.11.2027	BBB- / / WD*	RU000A0ZYJJ3
Роснфт2Р3	30,00	1,81	фикс.	7,75	2	109,30		2,75		-268			Да	5	21.12.2017	13.12.2022	09.12.2027	BBB- / / WD*	RU000A0ZYLG5
Роснфт2Р4	50,00	1,90	фикс.	7,50	2	103,90	103,94	5,55	5,53	10	0,265	68,2	Да	5	15.02.2018	09.02.2023	03.02.2028	BBB- / / WD*	RU000A0ZYT40
Роснфт2Р5	20,00	2,77	фикс.	7,30	2	104,87	104,38	5,64	5,82	39	0,137	11,8	Да	5	02.03.2018	23.02.2024	18.02.2028	BBB- / / WD*	RU000A0ZYVU5
Роснфт2Р6	10,00	2,84	фикс.	8,70	4	109,89	109,89	5,43	5,43	0			Да	5	05.04.2019	29.03.2024	23.03.2029	BBB- / / WD*	RU000A1008P1
Роснфт2Р7	20,00		фикс.	8,70	4								Нет		05.04.2019	29.03.2024	23.03.2029	BBB- / / WD*	RU000A1008Q9
Роснфт2Р8	25,00	3,12	фикс.	7,95	2	105,62	105,56	6,23	6,24	81	0,734	26,6	Да	5	15.07.2019	08.07.2024	02.07.2029	BBB- / / WD*	RU000A100KY3
Роснфт2Р9	25,00	2,90	фикс.	7,10	4	103,99		5,87		44		10,2	Да	5	24.10.2019	18.04.2024	11.10.2029	BBB- / / WD*	RU000A100YQ0
Роснфт3Р01	400,00	0,36	плав.	4,35	2	100,01		4,36		-107			Нет		26.11.2020	25.11.2021	14.11.2030	BBB- / / WD*	RU000A102EF1
Роснфт3Р02	400,00	0,36	плав.	4,35	2	100,01		4,36		-107			Нет		26.11.2020	25.11.2021	14.11.2030	BBB- / / WD*	RU000A102EE4
РоснфтБО10	20,00		фикс.	9,40	2	100,40		9,48		405			Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV235
РоснфтБО11	30,00	3,32	фикс.	9,40	2	105,10		8,00		257		0,1	Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV243
РоснфтБО12	30,00	3,32	фикс.	9,40	2	105,10		8,00		257		0,1	Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV250
РоснфтБО13	30,00	3,32	фикс.	9,40	2	105,10		8,00		257		0,2	Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV268

РоснфтБО14	30,00	3,32	фикс.	9,40	2	105,10	8,00	257	0,2	Да	5	11.12.2014	28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV227
РоснфтБО18	100,00		фикс.		4	100,13	-8,92	-1435	0,3	Да	5	26.01.2015	18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV763
РоснфтБО19	50,00		фикс.	6,30	4	100,10	-5,59	-1102		Да	5	26.01.2015	18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV789
РоснфтБО2	15,00		фикс.	9,40	2	110,80	6,31	88		Да	5	11.12.2014	28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV1W5
РоснфтБО20	50,00		фикс.		4	100,10	-5,59	-1102		Да	5	26.01.2015	18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV7A8
РоснфтБО21	50,00		фикс.		4	100,10	-5,59	-1102		Да	5	26.01.2015	18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV7D2

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
РоснфтБО22	50,00	0,01	фикс.		4	100,26		-22,03		-2746			Да	5	26.01.2015		18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV7C4
РоснфтБО23	50,00		фикс.		4	100,50		-41,46		-4689			Да	5	26.01.2015		18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV7B6
РоснфтБО25	25,00		фикс.		4	100,00		6,43		100			Да	5	26.01.2015		18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV797
РоснфтБО26	25,00		плав.	4,35	4	100,50		-41,46		-4689			Да	5	26.01.2015		18.01.2021	BBB- / / WD*	RU000A0JV771
РоснфтБО3	15,00	3,34	фикс.	9,40	2	112,00	112,00	5,97	5,97	54		10,1	Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV1X3
РоснфтБО4	15,00		фикс.	9,40	2	109,93		6,56		113			Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV1Y1
РоснфтБО8	20,00		фикс.	9,40	2	100,40		9,48		405			Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV201
РоснфтБО9	20,00	3,34	фикс.	9,40	2	112,25		5,90		47		20,9	Да	5	11.12.2014		28.11.2024	BBB- / / WD*	RU000A0JV219
Славнеф1Р1	10,00	3,88	фикс.	6,10	4	98,25		6,72		129			Да	5	16.06.2020	10.06.2025	04.06.2030		RU000A101T64
Славнеф1Р2	10,00	2,01	фикс.	8,65	4	105,70		5,98		55		4,7	Да	5	28.03.2019	23.03.2023	15.03.2029		RU000A1007H0
Славнеф1Р3	10,00	1,75	фикс.	6,70	4	101,60		5,91		48			Да	5	28.11.2019	24.11.2022	15.11.2029		RU000A1013U1
Татнфт1Р1	15,00	1,83	фикс.	6,45	4	102,77	102,65	5,03	5,09	-34	0,107	1,1	Да	5	24.12.2019		20.12.2022	NR / Baa2 / BBB-*	RU000A1018K1
ТранснфБО5	17,00	0,25	фикс.	10,10	2	101,69	101,60	3,15	3,51	-192	0,135	183,9	Да	5	21.04.2016	15.04.2021	09.04.2026	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWEB9
ТранснфБО6	17,00	1,50	фикс.	9,30	2	106,40	106,40	5,20	5,20	-23			Да	5	06.09.2016	25.08.2022	25.08.2026	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWS92
ТранснфБО7	17,00		фикс.	8,75	2								Нет		26.04.2017	10.04.2024	14.04.2027	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JXPK4
ТрнфБО1Р1	20,00	2,18	фикс.	9,90	2	117,00	117,00	2,51	2,51	-292			Да	5	10.06.2016		02.06.2023	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWK90
ТрнфБО1Р10	15,00	0,72	фикс.	7,00	2	101,50		4,92		-51		0,3	Да	5	13.04.2018		08.10.2021	BBB- / Baa2 / *	RU000A0ZZ349
ТрнфБО1Р12	15,00	1,42	фикс.	7,90	2	104,08		5,04		-39			Да	5	09.07.2019		05.07.2022	BBB- / Baa2 / *	RU000A100JF4
ТрнфБО1Р13	15,00	4,84	фикс.	6,85	2	104,09	104,00	6,09	6,11	68	0,505	26,6	Да	5	08.11.2019		30.10.2026	BBB- / Baa2 / *	RU000A1010B7
ТрнфБО1Р2	10,00		фикс.	9,65	2	109,70		5,45		2			Да	5	08.07.2016		30.06.2023	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWMS6
ТрнфБО1Р3	15,00	2,25	фикс.	9,45	2	109,00		5,69		26			Да	5	11.08.2016		03.08.2023	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWPW1
ТрнфБО1Р4	15,00	1,58	фикс.	9,30	2	106,60	106,60	5,26	5,26	-17	0,053	18,1	Да	5	06.10.2016		29.09.2022	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JWVC1
ТрнфБО1Р5	15,00	2,63	фикс.	9,25	2	110,30	110,44	5,59	5,54	11	0,118	16,5	Да	5	03.02.2017		26.01.2024	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JXC24
ТрнфБО1Р6	20,00	0,19	фикс.	9,00	2	101,08	101,09	3,12	3,07	-236	0,109	4,1	Да	5	29.03.2017		24.03.2021	BBB- / Baa2 / *	RU000A0JXM97
ТрнфБО1Р8	25,00	4,00	фикс.	7,90	2	107,80	107,96	6,07	6,03	60	0,310	1,2	Да	5	19.10.2017		09.10.2025	BBB- / Baa2 / *	RU000A0ZYDD9
ТрнфБО1Р9	15,00	1,05	фикс.	7,15	2	102,16	102,24	5,17	5,09	-34	3,080	0,9	Да	5	26.02.2018		21.02.2022	BBB- / Baa2 / *	RU000A0ZYUS1
ЯТЭК 1Р-1	4,00	2,51	фикс.	8,50	2	102,73	102,68	7,53	7,55	212	9,396	9,7	Нет		03.11.2020		31.10.2023	/ / WD*	RU000A102B48

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Локальный рынок: металлургия и добыча





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АЛРОСА Б03	5,00	3,84	фикс.	5,75	4	100,00	100,00	5,88	5,88	45			Да	5	22.05.2020	16.05.2025	10.05.2030	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A101PG7
АЛРОСА Б04	5,00	3,84	фикс.	5,75	4	100,00	100,00	5,88	5,88	45			Да	5	22.05.2020	16.05.2025	10.05.2030	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A101PF9
АЛРОСА Б05	5,00	3,84	фикс.	5,75	4	100,00		5,88		45		0,1	Да	5	22.05.2020	16.05.2025	10.05.2030	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A101PD4
АЛРОСА Б06	5,00	3,84	фикс.	5,75	4	100,00		5,88		45			Да	5	22.05.2020	16.05.2025	10.05.2030	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A101PB8
АЛРОСА Б07	5,00	3,84	фикс.	5,75	4	99,55	99,56	6,00	6,00	57	0,136	2,1	Да	5	22.05.2020	16.05.2025	10.05.2030	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A101PC6
ЕврХол1Р1R	15,00	0,19	фикс.	12,60	2	101,44	101,33	4,60	5,19	-24	0,863	4,3	Да	10	29.03.2016		23.03.2021	BB+ / / *	RU000A0JWBH2
ЕврХол2Р1R	20,00	3,07	фикс.	7,95	2	106,75	106,85	5,89	5,86	43	0,773	3,8	Да	10	05.08.2019		29.07.2024	BB+ / / *	RU000A100P85
Кокс БО-05	5,00		фикс.	9,20	2								Нет		23.08.2018		16.08.2023	NR / / B*	RU000A0JVDF4
МЕТАЛИНБ02	10,00	0,19	фикс.	10,95	2	101,40	101,15	3,21	4,56	-87	0,701	0,1	Да	10	29.03.2016	23.03.2021	17.03.2026	BB+ / / BB+*	RU000A0JWBF6
МЕТАЛИНБ03	10,00	3,70	фикс.	7,15	2	104,42	104,42	6,04	6,04	61	0,392	0,3	Да	10	23.10.2019	16.04.2025	10.10.2029	BB+ / / BB+*	RU000A100YF3
МЕТАЛИНБ04	10,00	4,28	фикс.	6,55	2	101,70	101,44	6,25	6,31	88	0,587	38,2	Да	10	12.02.2020	03.02.2023	30.01.2030	BB+ / / BB+*	RU000A101EF3
МЕТАЛИНБ07	5,00		фикс.	11,90	2	119,07		7,47		204			Да	10	25.02.2016		12.02.2026	BB+ / / BB+*	RU000A0JW5H6
МЕТАЛИНБ08	5,00	0,19	фикс.	10,95	2	101,04		5,16		-27		0,4	Да	10	29.03.2016	23.03.2021	17.03.2026	BB+ / / BB+*	RU000A0JWBE9
МЕТАЛИНБ09	5,00		фикс.		2	100,02		9,04		361			Нет		29.04.2019	20.04.2023	16.04.2029	BB+ / / BB+*	RU000A100B73
МЕТАЛИНБ10	5,00	3,90	фикс.	5,70	2	97,75		6,39		96		0,2	Нет		04.06.2020	29.05.2025	23.05.2030	BB+ / / BB+*	RU000A101R90
МЕТАЛИНВ 1	5,00		фикс.	0,01	2	99,99		0,02		-541			Да	10	19.03.2012		07.03.2022	BB+ / / BB+*	RU000A0JS5B5
МЕТАЛИНВ 2	5,00	1,86	фикс.	7,65	2	104,00	104,00	5,62	5,62	19		0,8	Да	10	08.02.2013		27.01.2023	BB+ / / BB+*	RU000A0JTLJ3
МЕТАЛИНВ 3	5,00	1,86	фикс.	7,65	2	103,50		5,88		45		6,4	Да	10	08.02.2013		27.01.2023	BB+ / / BB+*	RU000A0JTLL9
МЕТАЛИНВ 5	10,00	1,13	фикс.	0,01	2	96,02		4,61		-82			Да	10	19.03.2012		07.03.2022	BB+ / / BB+*	RU000A0JS5A7
МЕТАЛИНВ 6	10,00	1,14	фикс.	0,01	2	97,43		3,63		-180			Да	10	22.03.2012		10.03.2022	BB+ / / BB+*	RU000A0JS5L4
Мечел 4об	0,50	0,25	плав.	7,88	4	127,00	108,90	106,90	285,94	28051			Нет		30.07.2009		15.07.2021		RU000A0JQ8V9
Мечел 15об	5,00	0,07	фикс.	8,00	2	100,30	100,30	3,55	3,55	-188	0,163		Нет		22.02.2011		09.02.2021		RU000A0JR8L9
Мечел 16об	5,00	0,07	фикс.	8,00	2	100,52	100,59	0,54	-0,59	-602	0,429	0,2	Нет		22.02.2011		09.02.2021		RU000A0JR8P0
Мечел 17об	0,50		плав.	8,75	2	100,79	100,80				0,334	14,1	Нет		09.06.2011		27.05.2021		RU000A0JRJS2
Мечел 18об	0,50		плав.	8,75	2	100,88	100,66				0,495	0,9	Нет		09.06.2011		27.05.2021		RU000A0JRJT0
Мечел 19об	0,25		плав.	8,75	2	100,70	100,68					1,0	Нет		14.06.2011		01.06.2021		RU000A0JRJY0
НорНик БО5	15,00	3,80	фикс.	11,60	2	101,84	102,03	11,45	11,37	594	20,00	21,7	Да	5	19.02.2016		06.02.2026	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A0JW5C7
НорНикБ1Р1		3,26	фикс.	7,20	2	105,71	105,71	5,54	5,54	11	3,788	3,0	Да	5	01.10.2019		24.09.2024	BBB- / Baa2 / BBB-*	RU000A100VQ6
Полюс Б1Р1	20,00	3,28	фикс.	7,40	2	105,90	105,92	5,70	5,69	26	0,147	0,8	Да	10	14.10.2019	07.10.2024	01.10.2029	BB+ / / BB*	RU000A100XC2
ПолюсБ1	5,00	0,48	фикс.	12,10	2	103,57	103,50	4,18	4,64	-79	0,081	42,9	Да	10	16.07.2015	08.07.2021	03.07.2025	/ / WD	RU000A0JVMD0
ПолюсБ2	5,00	0,48	фикс.	12,10	2	103,20	103,38	5,28	4,89	-54	0,682	25,4	Да	10	16.07.2015	08.07.2021	03.07.2025	/ / WD	RU000A0JVM99
ПолюсБ3	5,00	0,48	фикс.	12,10	2	103,31	103,40	5,04	4,85	-58	0,419	0,1	Да	10	16.07.2015	08.07.2021	03.07.2025	/ / WD	RU000A0JVMB4
ПравоурмБ1	3,00	5,30	фикс.	9,50	2	108,00		6,79		136			Нет		27.02.2019		31.03.2028		RU000A1004L9
РУСАБрБ1Р1	15,00	1,21	фикс.	9,00	2	103,00	102,74	6,60	6,82	139	0,068	0,7	Нет		29.04.2019	27.04.2022	16.04.2029	/ / WD*	RU000A100BB0
РУСАБрБ1Р2	15,00	1,83	фикс.	8,60	2	103,94	103,93	6,59	6,60	117		0,5	Нет		11.07.2019	23.01.2023	28.06.2029	/ / WD*	RU000A100KL0
РУСАБрБ1Р3	15,00	1,54	фикс.	8,25	2	102,72	102,46	6,58	6,75	132	4,035	9,0	Нет		12.09.2019	14.09.2022	30.08.2029	/ / WD*	RU000A100TF3
РУСАБрБ1Р4	15,00	1,70	фикс.	7,45	4	101,50	101,50	6,73	6,73	130	2,205	19,0	Нет		14.11.2019	10.11.2022	01.11.2029	/ / WD*	RU000A1011C3
РУСАБрБ2Р1	10,00	2,22	фикс.	6,50	4	99,90	99,87	6,71	6,72	129	12,04	34,0	Нет		09.06.2020	06.06.2023	28.05.2030	/ / WD*	RU000A101S81
РУСАЛБАл08	15,00	0,20	фикс.	0,01	2	99,00	99,00				0,138		Да	—	18.04.2011		05.04.2021	/ / WD*	RU000A0JRF11
РУСАЛБрБ01	10,00	5,22	фикс.		2	98,63	98,23					0,1	Да	—	19.04.2016		07.04.2026	/ / WD*	RU000A0JWDN6
СеверстБ06	10,00	2,83	фикс.	8,65	2	108,90	108,99	5,66	5,63	20	0,308	5,7	Да	5	09.04.2019	04.04.2024	27.03.2029	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1008W7
СеверстБ07	15,00		фикс.	8,65	2								Нет		05.04.2019		27.03.2026	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1008L0
СУЭК-Ф1Р2R	10,00	0,55	фикс.	8,30	2	101,35	101,15	5,91	6,28	85	0,877	0,3	Нет		13.08.2018		09.08.2021	/ Ba2 /	RU000A0ZZG93
СУЭК-Ф1Р3R	21,00	2,02	фикс.	7,50	2	102,51	102,51	5,75	6,34	91	0,666	1,9	Нет		26.09.2019	23.03.2023	13.09.2029	/ Ba2 /	RU000A100VG7
СУЭК-Ф1Р4R	20,00	2,50	фикс.	7,40	2	103,80	103,00	5,97	6,29	86		218,7	Нет		21.10.2019	16.10.2023	08.10.2029	/ Ba2 /	RU000A100Y50
СУЭК-Ф1Р5R	30,00	3,47	фикс.	6,90	2	100,79	100,80	6,78	6,78	135	11,17	147,1	Нет		29.01.2020	27.01.2025	16.01.2030	/ Ba2 /	RU000A101CQ4

СУЭК-Ф1Р6R	14,00	2,94	фикс.	6,70	2	100,67	100,67	6,57	6,57	114	0,255	0,5	Нет		22.10.2020	18.04.2024	10.10.2030	/ Ba2 /	RU000A102986
ТМК 1Р01	10,00	1,21	фикс.	8,35	2	102,90	102,89	6,01	6,02	59	2,411	16,8	Нет		23.04.2020		21.04.2022	BB- / / *	RU000A101LQ5

15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

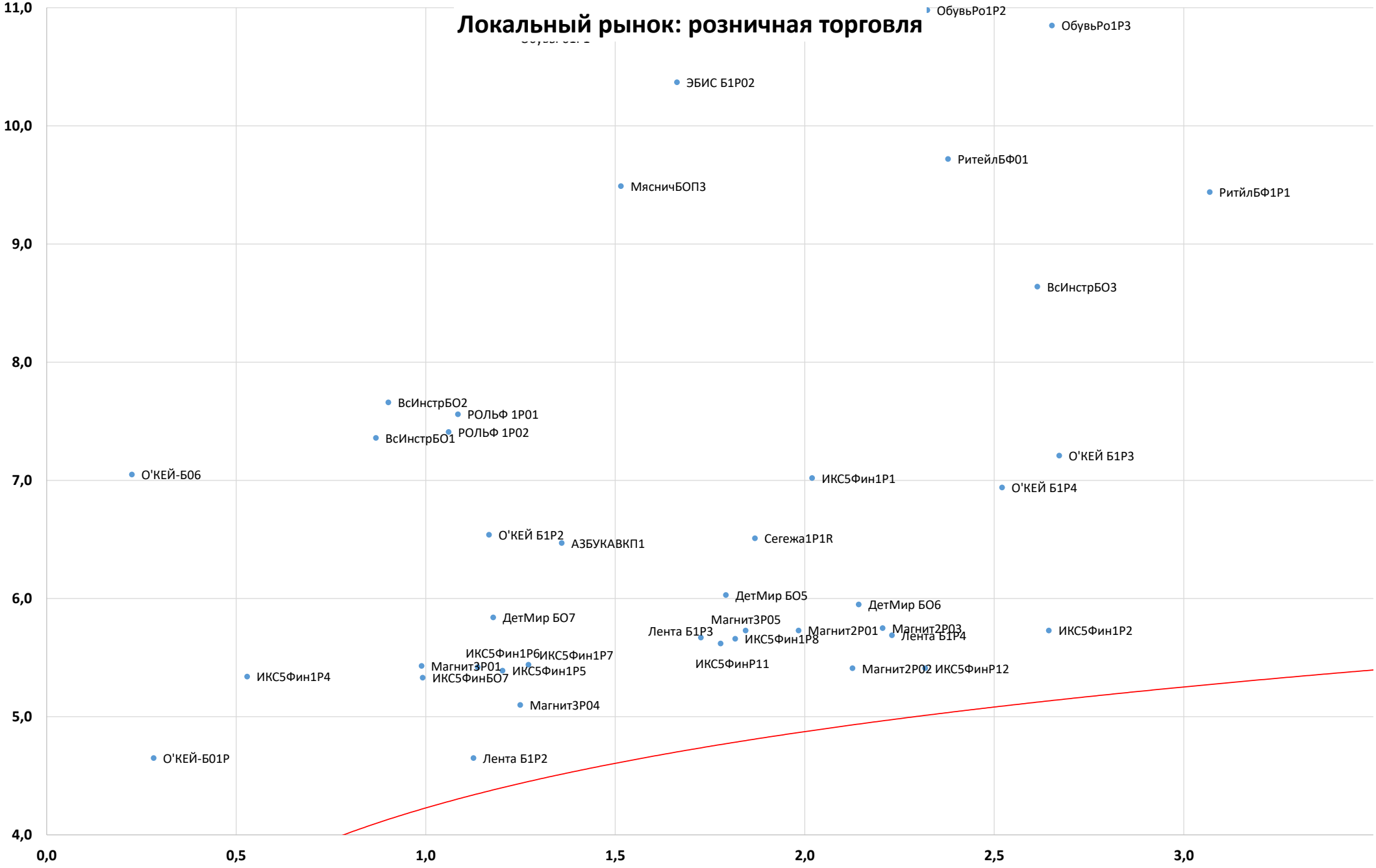
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ТМК БО-5	5,00	1,63	фикс.	6,50	2,00	100,36	100,36	6,44	6,37	94	0,672	13,4	Да	20	13.04.2016	05.10.2022	01.04.2026	BB- / / *	RU000A0JWCM0
ТМК БО-6	5,00	0,74	фикс.	8,00	2,00	102,20	102,20	5,06	5,06	-37	0,054	0,8	Да	20	25.04.2017	19.10.2021	13.04.2027	BB- / / *	RU000A0JXPD9
ТМК БО-7	10,00	0,37	фикс.	9,35	2,00	100,91	101,14	6,85	6,19	76		0,1	Нет		02.06.2017	28.05.2021	21.05.2027	BB- / / *	RU000A0JXSF8
ЧТПЗ 1Р2	5,00	1,01	фикс.	9,85	2,00	104,40	104,30	5,64	5,73	30	0,447	50,0	Да	10	16.02.2017		10.02.2022	/ / BB-*	RU000A0JXHE4
ЧТПЗ 1Р3	5,00	2,78	фикс.	9,70	4,00	109,37	109,56	6,60	6,51	108	0,815	6,5	Да	10	30.03.2017		21.03.2024	/ / BB-*	RU000A0JXME4
ЧТПЗ 1Р4	10,00	0,42	фикс.	8,95	2,00	101,70	101,97	4,79	4,13	-130		0,2	Да	10	20.06.2017	15.06.2021	08.06.2027	/ / BB-*	RU000A0JXTY7
ЧТПЗ 1Р5	10,00	3,90	фикс.	6,60	4,00	99,75	99,77	6,83	6,83	140	4,887	62,9	Нет		10.07.2020		04.07.2025	/ / BB-*	RU000A101WB4
ЧТПЗ 1Р6	10,00	2,61	фикс.	6,80	4,00	101,11	101,10	6,52	6,53	110	19,06	44,7	Нет		01.12.2020		28.11.2023	/ / BB-*	RU000A102F85
ЭлщитСтБП1	0,15	1,43	фикс.	13,00	4,00	102,61	103,18	11,65	11,23	580	0,602	0,5	Нет		20.08.2019		16.08.2022	/ / *	RU000A100QY0

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Локальный рынок: розничная торговля



Департамент по работе на рынках капитала

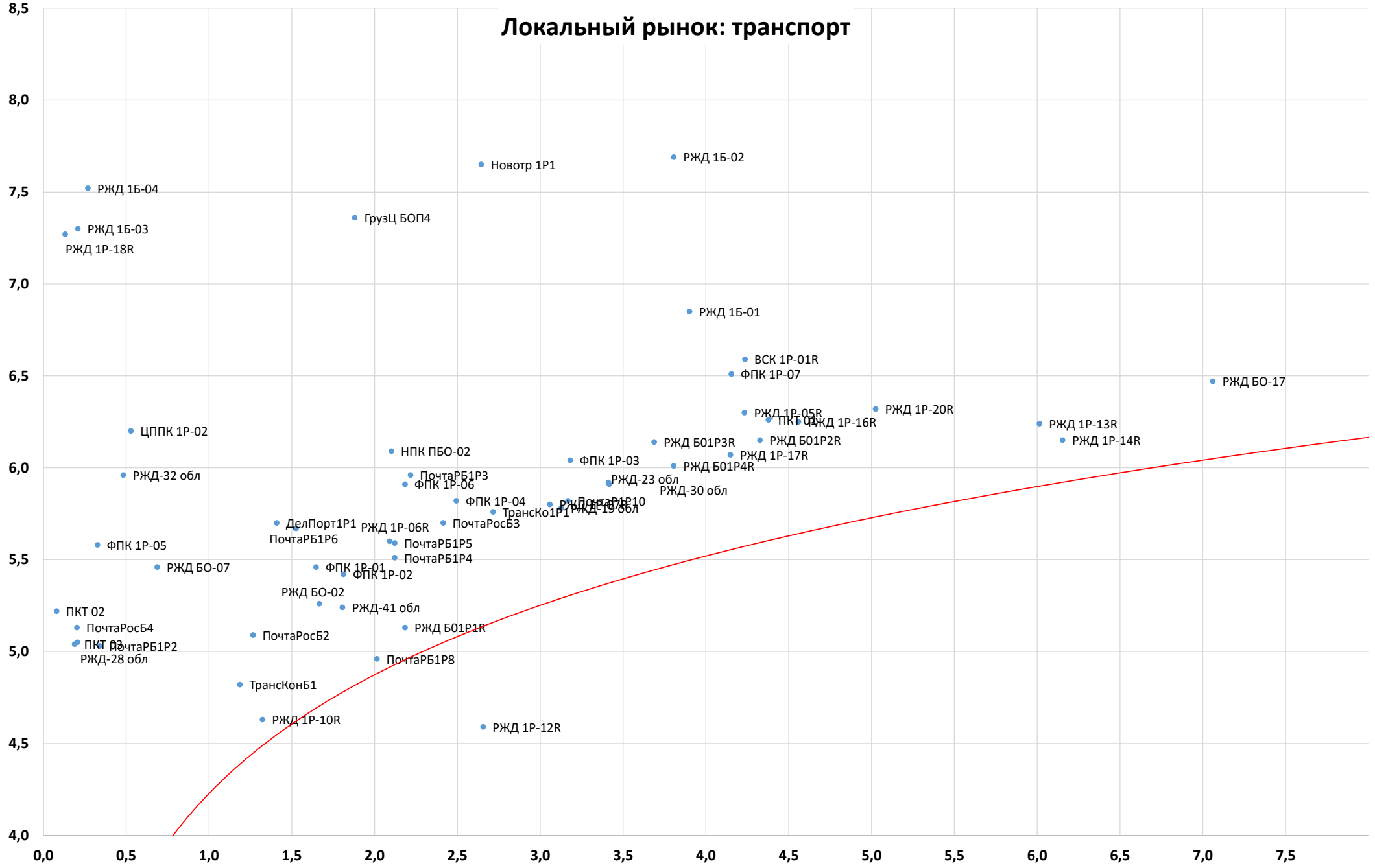
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АЗБУКАВКП1	3,50	1,36	фикс.	9,50	4	104,29	104,36	6,47	6,45	102	5,342	4,2	Нет		28.06.2019	24.06.2022	15.06.2029		RU000A100HE1
Апт36,61Р1	20,00		плав.	6,75	2								Нет		13.12.2019	09.12.2022	30.11.2029		RU000A1015T8
Апт36,62Р1	10,00		плав.	7,25	2								Нет		16.06.2020	13.06.2023	04.06.2030		RU000A101T72
ВсИнстрБО1	0,70	0,87	фикс.		4	101,58	101,66	7,36	7,26	183	0,428	1,7	Нет		13.12.2018		09.12.2021		RU000A0ZZXT0
ВсИнстрБО2	0,50	0,90	фикс.	11,50	4	103,64	103,40	7,66	7,93	250	0,448	0,5	Нет		27.12.2019	24.12.2021	23.12.2022		RU000A101970
ВсИнстрБО3	1,50	2,61	фикс.	9,00	4	101,63	101,47	8,64	8,70	327	8,329		Нет		29.12.2020		26.12.2023		RU000A102M86
ГрупПроБ01	0,07	1,56	фикс.	13,00		104,17	104,12	10,87	10,91	548	0,092	0,2	Нет		22.09.2020		12.10.2022		RU000A102580
ДетМир БО5	3,00	1,79	фикс.	7,25	2	102,29	102,34	6,03	6,01	58	0,192	53,1	Нет		10.12.2019	06.12.2022	01.12.2026	NR / / *	RU000A1015A8
ДетМир БО6	3,00	2,14	фикс.	7,00	2	102,40	102,40	5,95	5,95	52	0,133	0,1	Нет		07.05.2020	04.05.2023	29.04.2027	NR / / *	RU000A101MT7
ДетМир БО7	5,00	1,18	фикс.	8,90	2	103,69	103,69	5,84	5,83	40	0,144	19,5	Нет		15.04.2019	11.04.2022	06.04.2026	NR / / *	RU000A1009B9
ИКС5Фин1Р1	15,00	2,02	фикс.	7,30	2	100,79	100,79	7,02	7,02	159			Да	10	29.09.2016		11.09.2031	/ / BB+	RU000A0JWUD1
ИКС5Фин1Р2	10,00	2,64	фикс.	5,65	2	100,00		5,73		30			Нет		26.05.2017		07.05.2032	BB+ / / *	RU000A0JXRS3
ИКС5Фин1Р3	10,00	12,14	фикс.		2	86,16	87,29				0,059		Нет		27.03.2018		08.03.2033	BB+ / / *	RU000A0ZZ083
ИКС5Фин1Р4	5,00	0,53	фикс.	8,50	2	101,71	101,71	5,34	5,34	-9		11,5	Нет		04.02.2019	26.07.2021	16.01.2034	BB+ / / *	RU000A1002L3
ИКС5Фин1Р5	5,00	1,20	фикс.	8,45	2	103,74	103,74	5,39	5,39	-4		1,1	Нет		23.04.2019	19.04.2022	04.04.2034	BB+ / / *	RU000A100AB2
ИКС5Фин1Р6	10,00	1,14	фикс.	7,40	2	102,32		5,42		-1		1,8	Нет		26.09.2019	24.03.2022	07.09.2034	BB+ / / *	RU000A100V46
ИКС5Фин1Р7	5,00	1,27	фикс.	6,65	2	101,60		5,44		1		0,3	Нет		12.11.2019	10.05.2022	24.10.2034	BB+ / / *	RU000A1010X1
ИКС5Фин1Р8	5,00	1,82	фикс.	6,70	2	102,00	96,00	5,66	9,23	380		70,3	Нет		17.12.2019	13.12.2022	28.11.2034	BB+ / / *	RU000A1016P4
ИКС5Фин1Р9	5,00		фикс.	6,70	2								Нет		17.12.2019	13.12.2022	28.11.2034	BB+ / / *	RU000A1016Q2
ИКС5ФинР11	10,00	1,78	фикс.	5,75	2	100,35		5,62		19		0,8	Нет		28.05.2020	24.11.2022	10.05.2035	BB+ / / *	RU000A101QA8
ИКС5ФинР12	10,00	2,32	фикс.	5,65	2	100,70	100,85	5,41	5,34	-9		0,2	Нет		30.06.2020	27.06.2023	12.06.2035	BB+ / / *	RU000A101UQ6
ИКС5ФинБО4	5,00		фикс.	5,55	2	104,69		2,78		-265			Да	10	20.10.2015		11.10.2022	/ / BB+	RU000A0JVUX1
ИКС5ФинБО5	5,00	0,64	фикс.	6,95	2	102,97	102,97	2,32	2,32	-311			Да	10	17.03.2016	09.09.2021	09.03.2023	/ / BB+	RU000A0JW9G0
ИКС5ФинБО6	5,00	1,67	фикс.	8,45	2	108,92	108,77	3,23	3,36	-207			Да	10	05.05.2016	20.10.2022	27.04.2023	/ / BB+	RU000A0JWG05
ИКС5ФинБО7	5,00	0,99	фикс.	8,55	2	103,30		5,33		-10			Да	10	09.08.2016	26.01.2022	01.08.2023	/ / BB+	RU000A0JWPL4
ИСпетр1Р1	0,30	1,98	фикс.	14,00		104,70	104,31	12,28	12,49	706	1,192	0,8	Нет		25.11.2019		28.12.2024		RU000A1013C9
ИТЦ-Тр1Р01	0,05	1,93	фикс.	14,50		107,10	106,52	11,50	11,81	638	0,266		Нет		23.09.2019		02.09.2023		RU000A100UP0
Л&Д БП1	0,20	0,04	фикс.	12,00		99,53	99,55	22,97	27,54	2211	0,428		Нет		04.12.2019		13.11.2023		RU000A1014V7
Лента Б1Р2	10,00	1,13	фикс.	8,65	2	104,61	104,61	4,65	4,65	-78		0,4	Да	10	27.03.2019	23.03.2022	14.03.2029	NR / / BB*	RU000A100782
Лента Б1Р3	10,00	1,73	фикс.	6,80	2	102,05	102,05	5,67	5,67	24	9,247	3,3	Да	10	14.11.2019	10.11.2022	01.11.2029	NR / / BB*	RU000A1011A7
Лента Б1Р4	10,00	2,23	фикс.	6,30	2	101,51	101,56	5,69	5,66	23	0,087	4,9	Да	10	03.06.2020		31.05.2023	NR / / BB*	RU000A101R33
Лента БО-3	5,00	0,04	фикс.	7,25	2	100,19	100,18	1,86	2,14	-329		0,1	Да	10	06.08.2015	28.01.2021	24.07.2025	/ / BB	RU000A0JVP05
Лента БО-6	5,00		фикс.	7,00	2	103,99		0,64		-479			Да	10	10.09.2015	02.09.2021	28.08.2025	/ / BB	RU000A0JVRN8
Магнит2Р01	15,00	1,98	фикс.	6,20	2	101,09	101,10	5,73	5,72	29		84,5	Да	10	05.03.2020		02.03.2023	BB / / *	RU000A101HJ8
Магнит2Р02	10,00	2,13	фикс.	6,70	2	102,88	103,63	5,41	5,05	-38	0,138	15,9	Да	10	29.04.2020		26.04.2023	BB / / *	RU000A101MC3
Магнит2Р03	15,00	2,21	фикс.	5,90	2	100,50	100,48	5,75	5,75	32	1,919	48,8	Да	10	22.05.2020		19.05.2023	BB / / *	RU000A101PJ1
Магнит3Р01	10,00	0,99	фикс.	8,70	2	103,35	103,78	5,43	5,01	-42	0,118	11,0	Да	10	05.02.2019		01.02.2022	BB / / *	RU000A1002U4
Магнит3Р02	10,00	0,11	фикс.	8,50	2	100,61	100,52	2,72	3,55	-188	0,673	3,9	Да	10	26.02.2019		23.02.2021	BB / / *	RU000A1004G9
Магнит3Р04	10,00	1,25	фикс.	6,90	2	102,30	102,21	5,10	5,17	-26	25,90	1,4	Да	10	05.11.2019		03.05.2022	BB / / *	RU000A100ZS3
Магнит3Р05	10,00	1,84	фикс.	6,60	2	101,72	101,92	5,73	5,61	18	0,133	18,7	Да	10	26.12.2019		22.12.2022	BB / / *	RU000A1018X4
МясничБОП2	0,10	0,36	фикс.	13,50		103,94	103,74	2,69	3,24	-219	0,106	0,1	Нет		20.08.2018		04.08.2021		RU000A0ZZGZ2
МясничБОП3	0,30	1,52	фикс.	13,50		106,78	106,78	9,49	9,49	406	0,619	0,9	Нет		15.03.2019		17.02.2024		RU000A1006B5
ОбувьРо1Р1	0,86	1,22	фикс.	12,00	4	102,01	102,01	10,74	10,74	531	10,42	6,5	Нет		26.09.2019		22.09.2022		RU000A100V61
ОбувьРо1Р2	0,39	2,32	фикс.	12,00		103,60	103,60	10,98	10,98	555	15,43	6,7	Нет		11.12.2019		14.11.2024		RU000A1015P6
ОбувьРо1Р3	0,50	2,65	фикс.	11,50		103,10	103,15	10,85	10,83	540	6,504	4,0	Нет		18.08.2020		28.07.2024		RU000A1021B4
ОбувьРосБ7	1,00		фикс.		4								Нет		26.01.2017		20.01.2022		RU000A0JX8E6
О'КЕЙ Б1Р2	5,00	1,17	фикс.	9,35	4	103,52	103,17	6,54	6,85	142	0,960	1,5	Нет		19.04.2019	15.04.2022	06.04.2029		RU000A1009Z8
О'КЕЙ Б1Р3	5,00	2,67	фикс.	7,85	4	102,22	102,21	7,21	7,21	178	11,55	5,2	Нет		03.12.2019		26.11.2024		RU000A1014B9

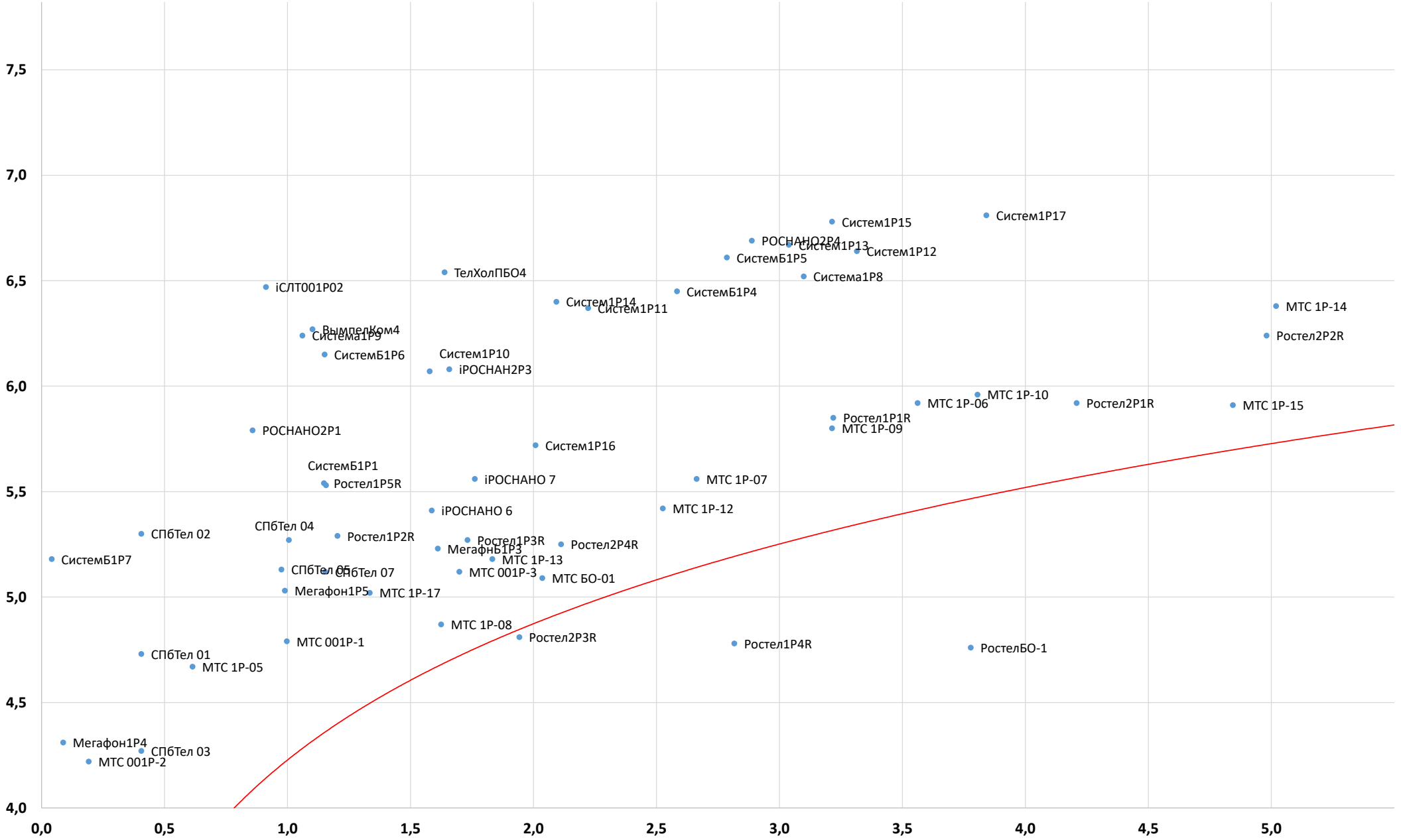
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
О'КЕЙ Б1Р4	5,00	2,52	фикс.	7,50	4,00	101,85	101,83	6,94	6,95	152	0,074	4,1	Нет		06.11.2020	03.11.2023	25.10.2030	/ / *	RU000A102BK7
О'КЕЙ-Б01Р	1,85	0,28	фикс.	9,55	4,00	101,40	101,02	4,65	6,04	61	3,189	38,3	Да	20	04.05.2017		29.04.2021	/ / WD	RU000A0JXQH8
О'КЕЙ-Б06	5,00	0,22	фикс.	9,65	2,00	100,57	100,66	7,05	6,63	120		0,1	Да	20	12.04.2016		06.04.2021	/ / WD	RU000A0JWCK4
РитейлБФ01	10,00	2,38	фикс.	10,95	4,00	103,69	103,70	9,72	9,72	429	5,058	8,9	Нет		09.07.2019		02.07.2024	/ / *	RU000A100JH0
РитйлБФ1Р1	5,00	3,07	фикс.	9,45	4,00	101,00	101,12	9,44	9,39	396	2,632	4,5	Нет		03.06.2020		28.05.2025	/ / *	RU000A101QF7
РОЛЬФ 1Р01	3,00	1,08	фикс.	10,45	4,00	103,39	103,41	7,56	7,51	208	0,252	43,5	Нет		12.03.2019		08.03.2022	/ / *	RU000A1005Y9
РОЛЬФ 1Р02	4,50	1,06	фикс.	9,00	4,00	101,90	101,88	7,41	7,42	199	2,534	47,5	Нет		27.02.2020		24.02.2022	/ / *	RU000A101GB7
Сегежа1Р1R	10,00	1,87	фикс.	7,10	2,00	101,33	101,51	6,51	6,39	96	11,85	13,8	Нет		30.01.2020		26.01.2023	/ / *	RU000A101D13
ЭБИС Б1Р02	0,15	1,66	фикс.	14,00	4,00	106,75	106,51	10,37	10,52	509		0,1	Нет		03.12.2019		29.11.2022	/ / *	RU000A1014A1
ЭБИС Б1Р03	0,15	2,19	фикс.	13,00	4,00	105,20	105,05	11,09	11,16	573	0,179	0,5	Нет		14.08.2020		11.08.2023	/ / *	RU000A102101

Локальный рынок: транспорт



Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ВСК 1Р-01R	5,00	4,24	фикс.	6,55	2	100,25	100,39	6,59	6,56	113	0,120	22,1	Нет		09.12.2020		03.12.2025		RU000A102G50
ГрузЦ БОП3	0,05	0,39	фикс.	15,00		106,00	106,00	-0,20	-0,20	-563	0,223		Нет		19.06.2019	11.06.2021	03.06.2022		RU000A100FY3
ГрузЦ БОП4	0,05	1,88	фикс.	14,00		113,70	113,26	7,36	7,58	215	0,170		Нет		27.03.2020		12.03.2023		RU000A101K30
ДелоПортс1	3,00	4,82	фикс.		2	96,00							Да	10	27.11.2015		14.11.2025	/ / B+	RU000A0JVZB6
ДелПорт1Р1	3,50	1,41	фикс.	9,40	2	105,25	104,95	5,70	5,92	49	0,103	1,0	Нет		11.07.2017		05.07.2022	B+ / / B+*	RU000A0JXVG0
ЛЕГЕНДА1Р2	2,00	1,38	фикс.	11,00	4	101,91	101,90	10,00	9,95	452	10,89	12,1	Нет		03.03.2020		14.03.2023		RU000A101GW3
ЛЕГЕНДА1Р3	1,20	0,99	фикс.	13,00	4	103,72	103,76	9,61	9,56	413	0,488	3,2	Нет		27.07.2020	07.02.2022	07.08.2023		RU000A101YD6
Новотр 1Р1	6,00	2,64	фикс.	8,75	4	103,39	103,38	7,65	7,69	226	11,03	6,2	Нет		04.12.2019		27.11.2024		RU000A1014S3
НПК ПБО-01	5,00	1,26	фикс.	7,25	2	110,00		-0,23		-566			Нет		20.02.2018		14.02.2023	/ / BBB-	RU000A0ZYTZ8
НПК ПБО-02	5,00	2,10	фикс.	8,80	2	106,00		6,09		66			Нет		21.02.2019		15.02.2024	/ / BBB-	RU000A1004A2
ОВК Фин Б1		3,09	фикс.	12,25	2	101,90		9,24		381		591,9	Нет		16.09.2014		10.09.2019		RU000A0JUU25
ОВК Фин01	15,00	0,36	фикс.	5,34	2	84,49	81,71	67,87	84,17	7874	0,476	431,3	Нет		04.12.2013		24.11.2021		RU000A0JUBD5
ПКТ 01	5,00	4,38	фикс.	5,00	2	95,12	95,29	6,26	6,22	79	0,080	221,0	Да	10	22.12.2015		09.12.2025	/ / BB+	RU000A0JW0S4
ПКТ 02	5,00	0,08	фикс.	13,10	2	100,59	100,62	5,22	4,83	-60	0,478	9,7	Да	10	19.02.2016	12.02.2021	06.02.2026	/ / BB+	RU000A0JW5E3
ПКТ 03	5,00	0,19	фикс.	12,50	2	101,36	101,36	5,04	5,04	-39		9,5	Да	10	30.03.2016	24.03.2021	18.03.2026	/ / BB+	RU000A0JWBP5
ПочтаР1Р10	10,00	3,17	фикс.	5,90	2	100,50	100,61	5,82	5,79	36	120,5	50,2	Да	5	04.08.2020	30.07.2024	23.07.2030	/ / BBB*	RU000A101ZH4
ПочтаРБ1Р1	0,83		фикс.	5,07	2								Нет		23.12.2016		17.11.2023	/ / BBB	RU000A0JX2V3
ПочтаРБ1Р2	5,00	0,34	фикс.	8,55	2	101,16	101,24	5,03	4,82	-61			Да	5	23.05.2017	11.05.2021	11.05.2027	/ / BBB	RU000A0JXRD5
ПочтаРБ1Р3	5,00	2,22	фикс.	6,00	2	100,26	100,26	5,96	5,96	53	2,759	0,6	Да	5	31.05.2017	24.05.2023	19.05.2027	/ / BBB	RU000A0JXS59
ПочтаРБ1Р4	5,00	2,12	фикс.	7,70	2	104,80		5,51		8		0,1	Да	5	07.05.2018	01.05.2023	24.04.2028	/ / BBB*	RU000A0ZZ5H3
ПочтаРБ1Р5	5,00	2,12	фикс.	7,70	2	104,64	105,46	5,59	5,20	-23	0,149	0,1	Да	5	07.05.2018	01.05.2023	24.04.2028	/ / BBB*	RU000A0ZZ5J9
ПочтаРБ1Р6	5,00	1,53	фикс.	7,55	2	103,00		5,67		24			Да	5	05.09.2019	01.09.2022	23.08.2029	/ / BBB*	RU000A100SZ3
ПочтаРБ1Р7	5,00	1,16	фикс.	8,45	2	108,70		1,24		-419			Да	5	09.04.2019	05.04.2022	27.03.2029	/ / BBB*	RU000A1008Y3
ПочтаРБ1Р8	5,00	2,01	фикс.	7,35	2	104,99		4,96		-47		35,1	Да	5	24.09.2019	21.03.2023	11.09.2029	/ / BBB*	RU000A100UT2
ПочтаРБ1Р9	5,00		фикс.	6,60	2	100,04		6,70		127			Нет		25.11.2020	17.11.2027	13.11.2030	/ / BBB*	RU000A102E52
ПочтаРосБ1	3,00		фикс.	2,75	2								Нет		16.12.2015		06.12.2023	/ / BBB	RU000A0JVZY8
ПочтаРосБ2	5,00	1,27	фикс.	8,40	2	104,25		5,09		-34			Да	5	19.05.2016	12.05.2022	07.05.2026	/ / BBB	RU000A0JWGV2
ПочтаРосБ3	5,00	2,41	фикс.	7,50	2	104,59		5,70		27			Да	5	22.09.2016	14.09.2023	10.09.2026	/ / BBB	RU000A0JWTL6
ПочтаРосБ4	5,00	0,20	фикс.	8,90	2	100,74	100,74	5,13	5,13	-30			Да	5	03.04.2017	22.03.2021	22.03.2027	/ / BBB	RU000A0JXMP0
РЖД 1Б-01	30,00	3,90	фикс.	6,55	2	99,29		6,85		142			Нет		26.06.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101TT2
РЖД 1Б-02	20,00	3,81	фикс.	7,30	2	99,05		7,69		226		81,6	Нет		31.07.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101Y18
РЖД 1Б-03	100,00	0,21	фикс.	7,25	2	100,00		7,30		187		36,8	Нет		30.09.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A102564
РЖД 1Б-04	80,00	0,27	фикс.	7,25	2	99,95		7,52		209		229,7	Нет		22.10.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1028U9
РЖД 1Б-05	33,00		фикс.	7,25	2	100,10		7,11		168		0,1	Нет		30.11.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A102E37
РЖД 1Б-06	40,00		фикс.		2								Нет		03.12.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A102FE1
РЖД 1Б-07	10,00		плав.	7,25	2							1,5	Нет		10.12.2020			BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A102GA7
РЖД 1Р-05R	20,00	4,23	фикс.	7,30	2	104,70	104,55	6,30	6,34	91	56,36	43,3	Да	5	20.02.2018	10.02.2026	01.02.2033	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYU05
РЖД 1Р-06R	15,00	2,09	фикс.	7,25	2	103,59		5,60		17		2,7	Да	5	23.04.2018	17.04.2023	04.04.2033	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZ4P9
РЖД 1Р-07R	10,00	3,06	фикс.	7,30	2	104,80	104,80	5,80	5,80	37	105,0	24,3	Да	5	14.06.2018	06.06.2024	26.05.2033	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZ9R4
РЖД 1Р-08R	10,00	0,08	плав.	6,10	2	101,94	101,94	-17,62	-17,62	-2305		0,2	Да	5	16.08.2018		03.08.2028	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZGT5
РЖД 1Р-09R	10,00		фикс.	6,28	2	101,00		2,76		-267			Да	5	02.11.2018		14.10.2033	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZRY2
РЖД 1Р-10R	10,00	1,32	фикс.	8,75	2	105,51	105,51	4,63	4,63	-80	2,292	0,4	Да	5	07.12.2018		03.06.2022	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZX19
РЖД 1Р-11R	10,00		фикс.	8,75	2								Нет		12.12.2018		10.05.2022	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZXL7
РЖД 1Р-12R	15,00	2,65	фикс.	8,70	2	111,66	111,67	4,59	4,59	-84	0,246	9,6	Да	5	01.02.2019		26.01.2024	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1002C2
РЖД 1Р-13R	20,00	6,01	фикс.	9,10	2	118,78	118,79	6,24	6,24	81		0,2	Да	5	01.04.2019		19.03.2029	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1007Z2
РЖД 1Р-14R	11,00	6,15	фикс.	9,10	2	120,09	120,28	6,15	6,06	63	0,078	0,3	Да	5	04.04.2019		04.05.2029	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1008D7
РЖД 1Р-15R	15,00		фикс.	8,80	4	110,45		6,90		147			Нет		17.04.2019		07.04.2027	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1009L8
РЖД 1Р-16R	30,00	4,56	фикс.	7,90	2	107,94	107,94	6,25	6,25	82	0,976	39,1	Да	5	04.07.2019		25.06.2026	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A100HY9

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1M средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
РЖД 1Р-17R	15,00	4,15	фикс.	6,75	2,00	103,06	103,14	6,07	6,08	65	0,374	54,2	Да	5	11.11.2019		03.11.2025	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A1010M4
РЖД 1Р-18R	15,00	0,13	фикс.	6,43	2,00	99,90	100,02	7,27	6,29	86		0,5	Да	5	04.03.2020		20.02.2030	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101H84
РЖД 1Р-19R	10,00		фикс.	7,55	2,00								Нет		23.04.2020		15.04.2027	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101LS1
РЖД 1Р-20R	15,00	5,02	фикс.	7,35	2,00	105,70	105,75	6,32	6,31	88	2,023	4,9	Да	5	24.04.2020		15.03.2027	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A101M04
РЖД 36 обл	15,25		плав.	4,00	2,00								Да	5	16.11.2015		15.10.2040	/ / BBB	RU000A0JVY04
РЖД Б01Р1R	15,00	2,18	фикс.	8,70	2,00	108,01	107,58	5,13	5,32	-11	4,007	7,2	Да	5	07.04.2017	22.05.2023	18.05.2032	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXN05
РЖД Б01Р2R	15,00	4,33	фикс.	8,50	2,00	110,81	110,79	6,15	6,16	73	0,085	0,4	Да	5	27.04.2017	16.04.2026	02.04.2037	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXQ44
РЖД Б01Р3R	15,00	3,69	фикс.	8,40	2,00	108,80		6,14		71		0,1	Да	5	18.05.2017	01.05.2025	23.04.2037	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXR84
РЖД Б01Р4R	15,00	3,81	фикс.	8,25	2,00	109,18		6,01		58		0,2	Да	5	17.08.2017	31.07.2025	29.07.2032	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXZB2
РЖД БО-02	15,00	1,67	фикс.	7,20	2,00	103,32	103,32	5,26	5,26	-17			Да	5	29.10.2015		16.10.2025	/ / BBB	RU000A0JVW71
РЖД БО-05	10,00		фикс.	10,30	2,00								Нет		15.04.2016	07.04.2023	03.04.2026	/ / BBB	RU000A0JWD57
РЖД БО-07	20,00	0,69	фикс.	7,60	2,00	101,50	101,50	5,46	5,46	3		11,3	Да	5	06.04.2016	29.09.2021	25.03.2026	/ / BBB	RU000A0JWC82
РЖД БО-09	25,00		плав.	5,91	2,00								Нет		27.06.2013		08.06.2028	/ Baa2 / BBB	RU000A0JTZM7
РЖД БО-10	25,00		плав.	4,99	2,00								Нет		18.12.2013		29.11.2028	/ Baa2 / BBB	RU000A0JUCG6
РЖД БО-11	15,00		фикс.	8,65	2,00	102,75		8,23		280			Да	5	22.02.2017	17.02.2021	04.02.2032	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JXJK7
РЖД БО-12	25,00		инфл. плав	5,91	2,00								Нет		12.09.2013		18.08.2033	/ Baa2 / BBB	RU000A0JU542
РЖД БО-13	25,00		инфл. плав	4,60	2,00								Нет		14.10.2013		19.09.2033	/ Baa2 / BBB	RU000A0JU7B7
РЖД БО-14	17,00		плав.	5,91	2,00								Нет		23.06.2015		29.05.2035	/ / BBB	RU000A0JVJS4
РЖД БО-15	25,00		инфл. плав	4,67	2,00								Нет		11.11.2013		11.10.2038	/ Baa2 / BBB	RU000A0JU9M0
РЖД БО-16	25,00		инфл. плав	5,91	2,00								Нет		21.10.2014		20.09.2039	/ Baa2 / BBB	RU000A0JUX71
РЖД БО-17	15,00	7,06	фикс.	9,85	2,00	126,00	126,94	6,47	6,36	93			Да	5	27.05.2016	04.05.2031	26.04.2041	/ / BBB	RU000A0JWHU2
РЖД БО-18	25,00		инфл. плав	4,99	2,00								Нет		05.06.2013		29.04.2043	/ Baa2 / BBB	RU000A0JTY57
РЖД БО-19	25,00		инфл. плав	5,91	2,00								Нет		27.06.2014		20.05.2044	/ Baa2 / BBB	RU000A0JUPZ8
РЖД-19 обл	10,00	3,13	фикс.	7,85	2,00	106,71	106,71	5,78	5,78	35	0,292	1,2	Да	5	27.07.2009		08.07.2024	BBB- / Baa2 / BBB	RU000A0JQ7Z2
РЖД-23 обл	15,00	3,42	фикс.	7,85	2,00	107,12		5,91		48		7,0	Да	5	04.02.2010		16.01.2025	BBB- / Baa2 / BBB	RU000A0JQRD9
РЖД-28 обл	20,00	0,21	фикс.	7,60	2,00	100,51	100,51	5,05	5,05	-38		50,9	Да	5	09.04.2013	30.03.2021	21.03.2028	/ Baa2 / BBB	RU000A0JTU85
РЖД-30 обл	15,00	3,41	фикс.	6,75	2,00	103,10	103,10	5,92	5,92	49		11,4	Да	5	26.11.2013	12.11.2024	07.11.2028	/ Baa2 / BBB	RU000A0JUAH8
РЖД-32 обл	10,00	0,48	инфл. плав	6,52	2,00	100,30	100,29	5,96	5,98	55	2,603	13,6	Да	5	20.07.2012	08.07.2022	25.06.2032	BBB- / Baa2 / BBB	RU000A0JSGV0
РЖД-33 обл	15,00		плав.	4,00	2,00								Да	5	31.03.2015		28.02.2040	/ / BBB	RU000A0JVB19
РЖД-34 обл	15,00		плав.	4,00	2,00								Да	5	31.03.2015		28.02.2040	/ / BBB	RU000A0JVB27
РЖД-35 обл	15,00		плав.	4,00	2,00								Да	5	01.07.2015		30.05.2040	/ / BBB	RU000A0JVKH5
РЖД-41 обл	15,00	1,81	фикс.	6,65	2,00	102,63		5,24		-19		1,3	Да	5	15.12.2016	08.12.2022	27.11.2031	BBB- / Baa2 / BBB*	RU000A0JX1S1
РЖД-42 обл	15,00		фикс.	9,70	2,00								Нет		28.06.2016	09.06.2026	22.05.2046	/ / BBB	RU000A0JWLU4
ТКК кл. А1	1,24		фикс.		2,00								Нет		27.09.2016	22.09.2021	23.09.2033	/ / *	RU000A0JWU31
ТКК кл. А2	3,53		инфл. плав	6,71	1,00								Нет		09.11.2017	04.11.2022	31.12.2033	/ / *	RU000A0ZYBA9
ТКК кл. А4	3,75		плав.	8,41	1,00								Нет		12.12.2018	11.12.2023	31.12.2033	/ / *	RU000A0ZYGG5
ТКК кл.Б	2,01		инфл. плав	6,71	1,00								Нет		27.09.2016	06.10.2021	20.09.2046	/ / *	RU000A0JWU23
ТрансКо1Р1	10,00	2,72	фикс.	7,30	2,00	104,30	104,30	5,76	5,80	37	10,48	1,5	Да	5	23.10.2019		16.10.2024	/ / B+*	RU000A100YE6
ТрансКонБ1	6,00	1,19	фикс.	7,50	2,00	103,30		4,82		-61		15,8	Да	5	25.01.2018		19.01.2023	/ / B+*	RU000A0ZYPG6
ТрансКонБ2	2,50	0,41	фикс.	9,40	2,00	102,40		3,58		-185		0,1	Да	5	22.09.2016		16.09.2021	/ / B+	RU000A0JWTH4
ФПК 1Р-01	5,00	1,65	фикс.	8,80	2,00	105,65	105,01	5,46	5,84	41		0,4	Да	5	27.04.2017	20.10.2022	15.04.2027	/ / BBB	RU000A0JXQ28
ФПК 1Р-02	5,00	1,81	фикс.	7,75	2,00	104,30		5,42		-1		12,5	Да	5	21.12.2017	08.12.2022	09.12.2027	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYLF7
ФПК 1Р-03	10,00	3,18	фикс.	7,20	2,00	103,99	103,97	6,04	6,05	62	6,336	0,5	Да	5	07.03.2018	21.08.2024	23.02.2028	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A0ZYX69
ФПК 1Р-04	5,00	2,49	фикс.	8,90	2,00	108,00		5,82		39		1,6	Да	5	31.10.2018	25.10.2023	18.10.2028	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZRK1
ФПК 1Р-05	10,00	0,33	фикс.		2,00	100,30	100,00	5,58	6,55	112		102,7	Да	5	15.11.2018		02.11.2028	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A0ZZTL5
ФПК 1Р-06	8,00	2,18	фикс.	8,40	2,00	105,60		5,91		48		0,1	Да	5	03.06.2019	29.05.2023	21.05.2029	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A100E88
ФПК 1Р-07	5,50	4,15	фикс.	6,90	2,00	102,00	103,25	6,51	6,20	77		12,9	Да	5	18.11.2019	10.11.2025	05.11.2029	BB+ / Baa2 / BBB*	RU000A1012B3
ЦППК 1Р-02	4,00	0,53	фикс.	9,85	2,00	101,98	102,03	6,20	6,11	68	0,298	1,7	Нет		07.08.2018		03.08.2021	/ / *	RU000A0ZZFH2



15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность					Даты		Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		

iMT_FREE01	3,00	2,16	фикс.	10,75	2	102,77	102,57	9,71	9,80	437	10,42	8,8	Нет		21.07.2020	18.07.2023	14.07.2026		RU000A101XD8
iMT-FREE02	2,50	2,90	фикс.	9,75	2	100,15	100,15	9,92	9,92	449	14,94	16,2	Нет		24.11.2020		21.05.2024		RU000A102DK3
iРОСНАН1П1	10,00		плав.	6,75	4								Нет		29.12.2018		23.12.2023	/ / BBB	RU000A1000H5
iРОСНАН2Р2	1,68		плав.	6,70	4								Нет		14.02.2020		10.11.2025	NR / / BBB*	RU000A101EW8
iРОСНАН2Р3	12,00	1,66	фикс.	7,70	2	102,80	102,87	6,08	6,04	61	1,028	8,1	Да	10	24.10.2019		20.10.2022	/ / BBB	RU000A100YR8
iРОСНАНО 6	9,00	1,59	фикс.	12,50	2	111,74	111,52	5,41	5,54	11		0,4	Да	10	22.10.2015		13.10.2022	/ / BBB	RU000A0JVVA7
iРОСНАНО 7	9,00	1,76	фикс.	12,75	2	113,05	113,07	5,56	5,55	12	0,760	1,7	Да	10	25.12.2015		16.12.2022	/ / BBB	RU000A0JW1G7
iРОСНАНО 8	13,40	0,22	фикс.		2	104,42	104,38	-11,21	-11,06	-1649	0,545	0,8	Да	10	08.04.2019		27.03.2028	/ / BBB	RU000A1008V9
iСЛТ001Р02	1,00	0,91	фикс.	11,00	2	104,14	104,35	6,47	6,22	79	0,957	1,8	Нет		26.12.2018		22.12.2021		RU000A0ZZZU3
ВымпелКБО2	10,00		фикс.		2								Нет		16.10.2015		03.10.2025	BB+ / Ba2 / *	RU000A0JVUN2
ВымпелКБО3	15,00		фикс.	5,55	2	100,99		5,00		-43			Да	10	16.10.2015	07.10.2022	03.10.2025	BB+ / Ba2 / *	RU000A0JVUP7
ВымпелКом1	0,00	1,10	фикс.	6,20	2	112,00		-3,92		-935			Да	10	20.03.2012		08.03.2022	BB+ / /	RU000A0JS5E9
ВымпелКом2	0,00		фикс.	6,20	2	128,37		-14,64		-2007			Да	10	26.03.2012		14.03.2022	BB+ / /	RU000A0JS5M2
ВымпелКом4	0,59	1,10	фикс.	6,20	2	100,74	100,74	6,27	5,59	16			Да	10	20.03.2012		08.03.2022	BB+ / /	RU000A0JS5F6
МегафнБ1Р2	10,00		фикс.	9,90	4	106,20		-5,82		-1125			Да	5	10.06.2016		29.05.2026	BB+ / WR / BB+*	RU000A0JWKA8
МегафнБ1Р3	15,00	1,61	фикс.	7,85	2	104,35	104,22	5,23	5,31	-12	0,142	0,8	Да	5	09.10.2017		03.10.2022	BB+ / WR / BB+*	RU000A0ZYC98
Мегафон1Р4	20,00	0,09	фикс.	7,20	2	100,24	100,27	4,31	3,96	-147	2,402	32,9	Да	5	19.02.2018		15.02.2021	BB+ / WR / BB+*	RU000A0ZYTM6
Мегафон1Р5	20,00	0,99	фикс.	8,55	2	103,60	103,96	5,03	4,67	-76	0,094	4,7	Да	5	04.02.2019		31.01.2022	BB+ / WR / BB+*	RU000A1002P4
Мегафон1Р6	5,00	2,79	фикс.	8,90	2	119,93	119,93	2,32	2,32	-311			Да	5	18.03.2019		11.03.2024	BB+ / WR / BB+*	RU000A1006G4
Мегафон2Р1	5,00		фикс.	8,90	2								Нет		18.03.2019		11.03.2024	BB+ / WR / BB+*	RU000A1006H2
Мегафон2Р2	10,00		фикс.	8,90	2								Нет		15.04.2019		04.06.2026	BB+ / WR / BB+*	RU000A1009A1
МТС 001Р-1	10,00	1,00	фикс.	9,00	2	104,34	104,21	4,79	4,91	-52	0,053	0,1	Да	5	10.02.2017		04.02.2022	/ / BB+	RU000A0JXEV5
МТС 001Р-2	10,00	0,19	фикс.	8,85	2	100,86	100,89	4,22	4,06	-137		0,1	Да	5	30.03.2017		25.03.2021	/ / BB+	RU000A0JXMH7
МТС 001Р-3	15,00	1,70	фикс.	7,70	2	104,49	104,35	5,12	5,20	-23	0,063	31,4	Да	5	09.11.2017		03.11.2022	/ / BB+	RU000A0ZYFC6
МТС 1Р-05	10,00	0,61	фикс.	7,10	2	101,51	101,47	4,67	4,74	-69	0,259	25,6	Да	5	07.03.2018		01.09.2021	/ / BB+	RU000A0ZYWX7
МТС 1Р-06	10,00	3,56	фикс.	7,25	2	105,11	105,30	5,92	5,87	44	6,440	8,0	Да	5	07.03.2018		26.02.2025	BBB- / / BB+*	RU000A0ZYWY5
МТС 1Р-07	10,00	2,66	фикс.	8,70	4	109,00	109,01	5,56	5,56	13	0,340	0,5	Да	5	29.01.2019		23.01.2024	/ / BB+	RU000A100238
МТС 1Р-08	5,00	1,62	фикс.	8,40	4	106,05	106,05	4,87	4,87	-56		0,5	Да	5	22.04.2019		17.10.2022	/ / BB+	RU000A100A58
МТС 1Р-09	7,50	3,21	фикс.	8,60	4	109,80	109,80	5,80	5,80	37	5,130	10,2	Да	5	22.04.2019		14.10.2024	/ / BB+	RU000A100A66
МТС 1Р-10	15,00	3,81	фикс.	8,00	4	108,46	108,60	5,96	5,92	49	0,878	81,6	Да	5	03.07.2019		25.06.2025	/ / BB+	RU000A100HU7
МТС 1Р-11	10,00		фикс.	7,90	4								Нет		17.07.2019		08.07.2026	/ / BB+	RU000A100L55
МТС 1Р-12	15,00	2,53	фикс.	6,85	4	103,95	103,92	5,42	5,43	0	0,423	11,9	Да	5	31.10.2019		26.10.2023	/ / BB+	RU000A100ZK0
МТС 1Р-13	10,00	1,83	фикс.	6,45	4	102,50	102,54	5,18	5,16	-27	0,259	0,5	Да	5	26.12.2019		22.12.2022	/ / BB+	RU000A101939
МТС 1Р-14	15,00	5,02	фикс.	6,60	4	101,85	101,96	6,38	6,35	92	6,951	141,5	Да	5	20.02.2020		11.02.2027	/ / BB+	RU000A101FH6
МТС 1Р-15	5,00	4,84	фикс.	6,60	4	103,99	104,18	5,91	5,87	44		0,2	Да	5	14.05.2020		05.11.2026	/ / BB+	RU000A101NG2
МТС 1Р-16	7,00		фикс.	6,60	4								Нет		14.05.2020		06.05.2027	/ / BB+	RU000A101NH0
МТС 1Р-17	10,00	1,33	фикс.	5,50	4	100,74	100,66	5,02	5,09	-34	0,114	10,6	Да	5	05.06.2020		03.06.2022	/ / BB+	RU000A101RD0
МТС БО-01	10,00	2,04	фикс.	6,50	2	102,98	102,81	5,09	5,18	-25		8,7	Да	5	03.04.2013		22.03.2023	/ / BB+	RU000A0JTTA5
МТС БО-02	10,00	0,12	фикс.	7,50	2	100,42	100,42	3,79	3,79	-164			Да	5	02.09.2016	26.02.2021	15.08.2031	/ / BB+	RU000A0JWRV9
РОСНАНО2Р1	4,50	0,86	фикс.	9,10	2	102,85	102,90	5,79	5,73	30	0,626	2,4	Да	10	05.06.2019		01.12.2021	/ / BBB	RU000A100ER0
РОСНАНО2Р4	6,50	2,89	фикс.	6,75	4	100,62	100,64	6,69	6,68	125	1,841	128,0	Нет		31.03.2020		26.03.2024	NR / / BBB*	RU000A101KK0
Ростел1Р1R	15,00	3,22	фикс.	7,30	2	105,00		5,85		42			Да	5	22.09.2016		10.09.2026	BB+ / / BBB-*	RU000A0JWTN2
Ростел1Р2R	10,00	1,20	фикс.	8,65	2	104,12	104,74	5,29	4,78	-65		0,1	Да	5	26.04.2017	13.04.2022	14.04.2027	/ / BBB-	RU000A0JXPN8
Ростел1Р3R	10,00	1,73	фикс.	7,70	2	104,30	104,30	5,27	5,27	-16	0,143	5,8	Да	5	21.11.2017	08.11.2022	09.11.2027	BB+ / / BBB-*	RU000A0ZYG52
Ростел1Р4R	10,00	2,82	фикс.	7,15	2	106,99	104,50	4,78	5,64	21		1,5	Да	5	16.03.2018	08.03.2024	03.03.2028	BB+ / / BBB-*	RU000A0ZYYE3
Ростел1Р5R	15,00	1,15	фикс.	8,45	2	103,41		5,54		11		0,1	Да	5	03.04.2019	30.03.2022	21.03.2029	BB+ / / BBB-*	RU000A100881
Ростел2Р1R	10,00	4,21	фикс.	6,85	2	104,23	104,23	5,92	5,92	49		4,8	Да	5	05.12.2019		27.11.2025	BB+ / / BBB-*	RU000A101541
Ростел2Р2R	15,00	4,98	фикс.	6,65	2	102,50	102,39	6,24	6,27	84	0,409	11,6	Да	5	19.02.2020		10.02.2027	BB+ / / BBB-*	RU000A101FG8

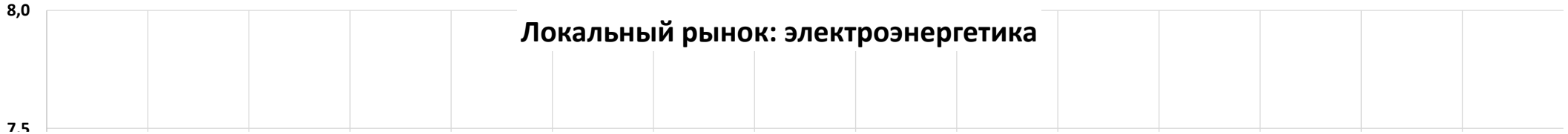
Департамент по работе на рынках капитала

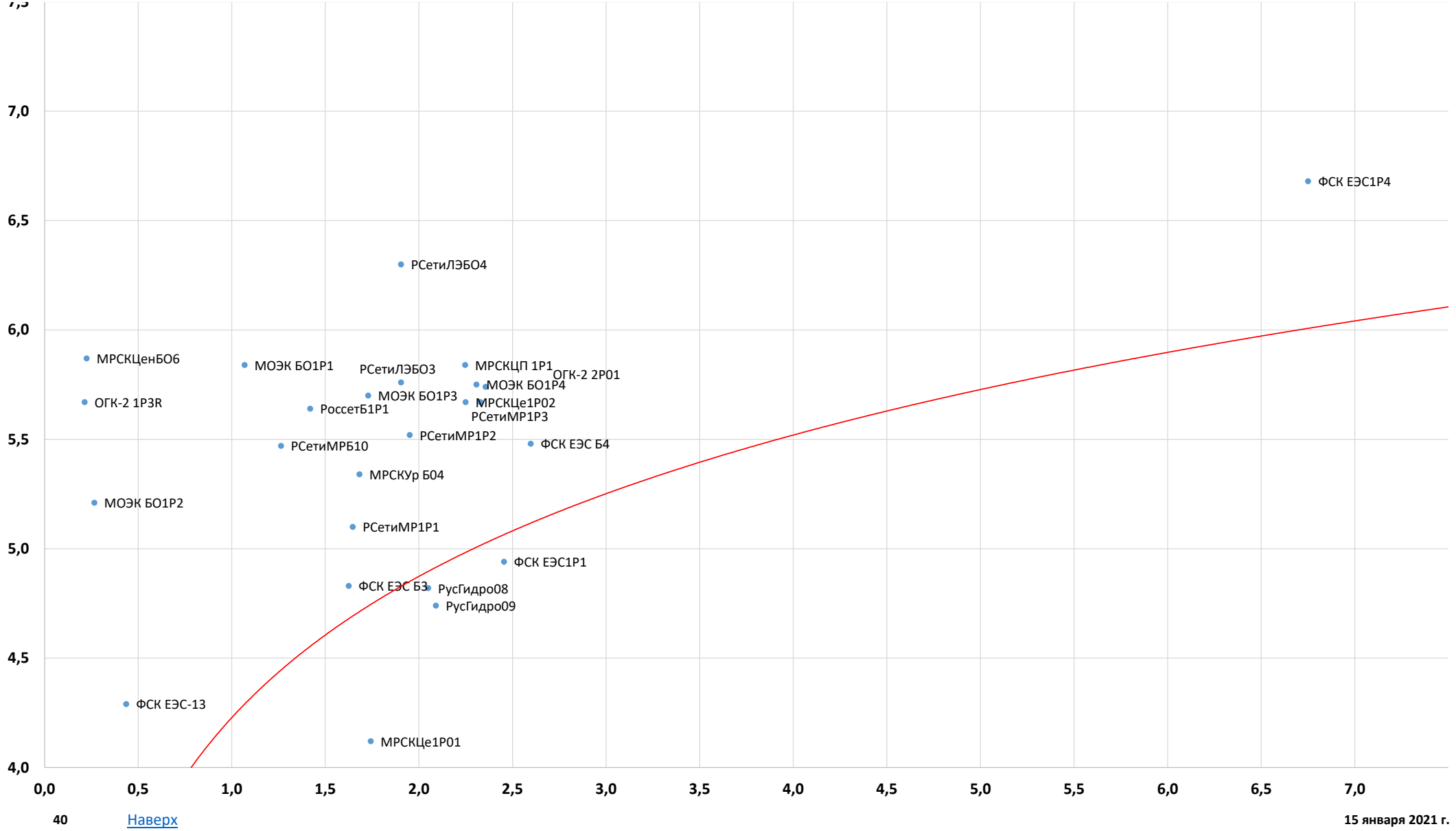
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
Ростел2Р3R	15,00	1,94	фикс.	6,25	2,00	102,92	102,53	4,81	5	-42	0,072	0,8	Да	5	18.02.2020		14.02.2023	BB+ / / BBB-*	RU000A101FC7
Ростел2Р4R	10,00	2,11	фикс.	6,75	2,00	103,29	102,62	5,25	6	14		2,6	Да	5	24.04.2020		21.04.2023	BB+ / / BBB-*	RU000A101LY9

Ростел2Р5R	10,00		фикс.	6,30	2,00								Нет		14.10.2020		08.10.2025	BB+ / / BBB-*	RU000A1028G8
РостелБО-1	5,00	3,78	фикс.	7,50	2,00	109,99	109,99	4,76	5	-67			Да	5	29.05.2015		16.05.2025	BB+ / / BBB-*	RU000A0JVFC6
Систем1Р10	10,00	1,58	фикс.	9,90	2,00	106,25	106,23	6,07	6	65	54,71	4,6	Нет		05.04.2019	30.09.2022	23.03.2029	/ / BB-	RU000A1008J4
Систем1Р11	10,00	2,22	фикс.	9,40	2,00	107,19	106,99	6,37	6	102	64,33	10,0	Да	10	29.07.2019	24.07.2023	16.07.2029	/ / BB-	RU000A100N12
Систем1Р12	10,00	3,32	фикс.	7,85	2,00	104,16	104,05	6,64	7	130	0,881	9,9	Нет		05.11.2019	29.10.2024	23.10.2029	/ / BB-	RU000A101012
Систем1Р13	15,00	3,04	фикс.	6,60	2,00	100,10	100,14	6,67	7	123	17,12	196,1	Да	10	27.05.2020	22.05.2024	15.05.2030	/ / BB-	RU000A101Q26
Систем1Р14	10,00	2,09	фикс.	6,35	4,00	100,20	100,20	6,40	6	97		0,9	Да	10	22.07.2020	19.04.2023	10.07.2030	BB / / BB-*	RU000A101XN7
Систем1Р15	10,00	3,21	фикс.	6,70	4,00	100,10	100,12	6,78	7	134	0,246	30,7	Да	10	07.09.2020	02.09.2024	26.08.2030	BB / / BB-*	RU000A1023K1
Систем1Р16	5,00	2,01	фикс.	6,10	4,00	101,00		5,72		29		54,3	Нет		07.12.2020	06.03.2023	25.11.2030	BB / / BB-*	RU000A102FS1
Систем1Р17	14,00	3,84	фикс.	6,75	2,00	100,02	100,12	6,81	7	140	3,183	180,4	Нет		07.12.2020	02.06.2025	25.11.2030	BB / / BB-*	RU000A102FT9
Система1Р8	15,00	3,10	фикс.	9,00	2,00	108,22	108,22	6,52	7	109	0,098	0,5	Нет		07.03.2018	28.08.2024	23.02.2028	/ / BB-	RU000A0ZYWU3
Система1Р9	10,00	1,06	фикс.	9,90	2,00	104,01	104,02	6,24	6	80	47,94	6,3	Нет		06.03.2019	02.03.2022	21.02.2029	/ / BB-	RU000A1005L6
СистемБ1Р1	5,00	1,16	фикс.	9,75	2,00	104,98	104,52	5,53	6	50	0,582	2,6	Да	10	13.10.2015	05.04.2022	30.09.2025	/ / BB-	RU000A0JVUK8
СистемБ1Р2	1,70		фикс.	7,50	2,00	104,00		6,62		119			Нет		13.11.2015		31.10.2025	/ / BB-	RU000A0JVXZ0
СистемБ1Р4	6,50	2,58	фикс.	6,35	2,00	100,01	100,01	6,45	6	101		0,5	Да	10	11.11.2016	03.11.2023	30.10.2026	/ / BB-	RU000A0JWYQ5
СистемБ1Р5	10,00	2,79	фикс.	6,85	4,00	101,10	101,00	6,61	7	122		83,9	Да	10	25.11.2016	16.02.2024	13.11.2026	/ / BB-	RU000A0JWZY6
СистемБ1Р6	15,00	1,15	фикс.	8,90	2,00	103,25	103,21	6,15	6	75	0,250	0,7	Нет		07.04.2017	01.04.2022	26.03.2027	/ / BB-	RU000A0JXN21
СистемБ1Р7	10,00	0,04	фикс.	10,00	2,00	100,18	100,15	5,18	6	53	6,651	7,1	Нет		02.02.2018	29.01.2021	21.01.2028	/ / BB-	RU000A0ZYQY7
СОксБ1Р1	0,20	1,53	фикс.	15,00	4,00	104,70	105,14	12,62	12	671	1,048	0,7	Нет		02.10.2019		28.09.2022	/ / *	RU000A100W52
СПбТел 01	5,00	0,41	фикс.	8,50	2,00	101,50	101,50	4,73	5	-70	0,102	1,1	Да	20	24.06.2011		11.06.2021	/ / BBB-	RU000A0JRKC4
СПбТел 02	5,00	0,41	фикс.	5,50	2,00	100,11	100,11	5,30	5	-16	0,501	2,2	Да	20	24.06.2011		11.06.2021	/ / BBB-	RU000A0JRKD2
СПбТел 03	3,00	0,41	фикс.	5,50	2,00	100,50		4,27		-116		3,7	Да	20	24.06.2011		11.06.2021	/ / BBB-	RU000A0JRKM3
СПбТел 04	3,00	1,01	фикс.	5,70	2,00	100,50	100,62	5,27	5	-29		2,6	Да	20	13.02.2012		31.01.2022	/ / BBB-	RU000A0JS3M7
СПбТел 05	4,00	0,98	фикс.	10,70	2,00	105,56	105,56	5,13	5	-21			Да	20	13.02.2012		31.01.2022	/ / BBB-	RU000A0JS3L9
СПбТел 07	6,00	1,15	фикс.	9,95	2,00	105,64	105,67	5,12	5	-28	0,407	16,2	Да	20	17.04.2012		05.04.2022	/ / BBB-	RU000A0JRVU3
ТелХолПБО2	5,00		фикс.	10,85	2,00								Нет		07.12.2016		01.12.2021	B+ / / *	RU000A0JX108
ТелХолПБО4	7,00	1,64	фикс.	7,90	4,00	102,51	102,50	6,54	7	112	0,925	5,2	Нет		23.10.2020		21.10.2022	B+ / / *	RU000A1029P7





Наверх

15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АтомэнпБО8	5,00	3,93	фикс.	11,10	2	108,39	108,35	9,15	9,16	373	19,23	7,0	Да	5	25.12.2015		12.12.2025	/ / BBB	RU000A0JW175
Калсб 1Р01	3,00	0,88	фикс.	13,00	2	102,35	102,48	10,46	10,30	487	1,220	1,6	Нет		17.12.2018	06.12.2021	11.12.2023		RU000A0ZZYL5
КубнЭн1Р01	3,60		фикс.	10,44	2								Нет		04.12.2015		21.11.2025		RU000A0JVZK7
МОЭК БО1Р1	5,00	1,07	фикс.	8,65	2	103,10		5,84		41		0,4	Да	10	06.03.2019	02.03.2022	26.02.2025	NR / / WD*	RU000A1005H4

МОЭК БО1Р2	5,00	0,27	фикс.	8,45	2	100,84	100,84	5,21	5,21	-22	0,101	1,1	Да	10	24.04.2019	02.03.2022	16.04.2025	NR / / WD*	RU000A100AN7
МОЭК БО1Р3	5,00	1,73	фикс.	6,80	2	102,00		5,70		27		0,4	Да	10	15.11.2019	11.11.2022	07.11.2025	NR / / WD*	RU000A101228
МОЭК БО1Р4	5,00	2,31	фикс.	5,80	2	100,30	100,30	5,75	5,75	32		5,1	Нет		22.07.2020	19.07.2023	15.07.2026	NR / / WD*	RU000A101XS6
МРСКУр Б02	1,60		фикс.	11,58	2								Нет		24.11.2015	15.11.2022	11.11.2025		RU000A0JVYM6
МРСКУр Б03	3,00		фикс.	7,00	2	96,10		8,39		296			Да	5	30.10.2019	26.10.2022	17.10.2029		RU000A100ZF0
МРСКУр Б04	4,00	1,68	фикс.	7,00	2	102,88		5,34		-9			Да	5	30.10.2019	26.10.2022	17.10.2029		RU000A100ZD5
МРСКУр Б05	5,00		фикс.	9,32	2								Нет		26.08.2016	20.08.2021	14.08.2026		RU000A0JWR51
МРСКЦе1Р01	5,00	1,74	фикс.	6,85	2	104,85	104,85	4,12	4,12	-131			Да	5	19.11.2019	15.11.2022	12.11.2024	BB+ / / *	RU000A1012N8
МРСКЦе1Р02	5,00	2,25	фикс.	5,60	2	100,00		5,67		24			Да	5	05.06.2020		02.06.2023	BB+ / / *	RU000A101RH1
МРСКЦенБО4	5,00		фикс.	11,58	2								Нет		24.11.2015	15.11.2022	11.11.2025	BB+ / / *	RU000A0JVYL8
МРСКЦенБО6	5,00	0,22	фикс.	6,95	2	100,24	100,24	5,87	5,87	44	0,083	0,1	Да	5	10.04.2018	06.04.2021	28.03.2028	BB+ / / *	RU000A0ZZ1Y7
МРСКЦП 1Р1	8,00	2,25	фикс.	5,65	2	99,75	99,80	5,84	5,82	39		59,2	Да	5	05.06.2020		02.06.2023		RU000A101RF5
МРСКЦП Б02	5,00	1,78	фикс.	6,85	2	108,82		2,03		-340			Да	5	03.12.2019	29.11.2022	20.11.2029		RU000A101459
ОГК-2 1Р3R	5,00	0,21	фикс.	6,95	2	100,27	100,26	5,67	5,72	29		0,1	Да	5	06.04.2018	02.04.2021	31.03.2023	/ / BBB-*	RU000A0ZZ1H2
ОГК-2 2Р01	5,00	2,36	фикс.	5,75	2	100,20	100,19	5,74	5,75	32		6,1	Да	5	15.07.2020	12.07.2023	08.07.2026	/ / BBB-*	RU000A101WR0
ОГК-2 3Р01	27,04		плав.	4,25	4								Нет		29.12.2020		28.03.2023	/ / BBB-*	RU000A102M94
РоссетБ1Р1	5,00	1,42	фикс.	8,15	2	103,61	104,86	5,64	4,75	-68			Да	5	13.07.2017		07.07.2022	BBB- / Baa3 / *	RU000A0JXVM8
РоссетБ1Р2	10,00		фикс.	6,50	4	101,00		6,38		95			Да	5	30.04.2020		24.04.2025	BBB- / Baa3 / *	RU000A101MG4
РоссетБ1Р3	10,00		плав.	4,67	4								Нет		27.07.2020	26.07.2021	24.07.2023	BBB- / Baa3 / *	RU000A101YB0
РоссЮг БО2	5,00		фикс.	9,24	4								Нет		14.07.2017		01.07.2022		RU000A0JXVT3
РСетиЛЭБО3	5,00	1,90	фикс.	6,20	2	101,00	101,11	5,76	5,70	27		46,5	Да	5	05.02.2020	01.02.2023	23.01.2030		RU000A101DE8
РСетиЛЭБО4	5,00	1,90	фикс.	6,20	2	100,00	101,11	6,30	5,70	27		20,5	Да	5	05.02.2020	01.02.2023	23.01.2030		RU000A101DF5
РСетиЛЭБО5	2,40		фикс.		2								Нет		22.07.2015		09.07.2025		RU000A0JVLM3
РСетиМР1Р1	8,00	1,65	фикс.	8,45	2	105,65	105,65	5,10	5,10	-33		4,8	Да	5	23.04.2019		18.10.2022	BB+ / / BB+*	RU000A100AD8
РСетиМР1Р2	10,00	1,95	фикс.	6,15	2	101,37		5,52		9			Да	5	21.02.2020	17.02.2023	14.02.2025	BB+ / / BB+*	RU000A101FY1
РСетиМР1Р3	5,00	2,33	фикс.	5,55	4	100,00	100,00	5,67	5,67	24			Да	5	22.07.2020	19.07.2023	16.07.2025	BB+ / / BB+*	RU000A101XH9
РСетиМРБ10	10,00	1,26	фикс.	8,55	2	103,95	103,95	5,47	5,47	4	0,975	20,1	Да	5	18.05.2017	12.05.2022	06.05.2027	BB+ / / BB+*	RU000A0JXR50
РСетиМРБ5	5,00		фикс.	8,40	2								Нет		07.06.2016		26.05.2026	BB+ / / BB+*	RU000A0JWJX2
РусГидро01	10,00	0,24	фикс.	9,50	2	104,00	104,00	-6,66	-6,66	-1209			Да	5	25.04.2011		12.04.2021	/ / BBB	RU000A0JRFN1
РусГидро02	5,00		фикс.	9,50	2	104,50		-8,48		-1391			Да	5	25.04.2011		12.04.2021	/ / BBB	RU000A0JRFP6
РусГидро07	10,00		фикс.	0,10	2	99,83		2,64		-279			Да	5	14.02.2013		02.02.2023	/ / BBB	RU000A0JTMG7
РусГидро08	10,00	2,05	фикс.	0,10	2	91,00	92,05	4,82	4,23	-120			Да	5	14.02.2013		02.02.2023	/ / BBB	RU000A0JTMK9
РусГидро09	10,00	2,09	фикс.	7,50	2	105,94	105,94	4,74	4,74	-69			Да	5	28.04.2015	18.04.2023	15.04.2025	/ / BBB	RU000A0JVD25
ТГК-1 03	2,00		инфл. плав	4,50	2	100,00		4,54		-89			Нет		27.12.2011		14.12.2021	/ / BBB	RU000A0JS1W0
ТГК-1 04	2,00		инфл. плав	4,50	2	100,00		4,51		-92			Нет		27.02.2012		14.02.2022	/ / BBB	RU000A0JS470
ТЕПЛОЭН1Р1	0,30	1,76	фикс.	10,00	2	101,96	102,01	9,17	9,14	371	0,638		Нет		17.12.2020		15.12.2022		RU000A102J57
ФСК ЕЭС Б2	10,00		фикс.	9,35	4								Нет		29.11.2016	18.11.2021	17.10.2051	/ / BBB	RU000A0JX090
ФСК ЕЭС Б3	9,00	1,62	фикс.	7,75	4	105,00	104,98	4,83	4,84	-59		6,7	Да	5	20.10.2017	07.10.2022	06.09.2052	/ / BBB	RU000A0ZYDH0
ФСК ЕЭС Б4	7,00	2,60	фикс.	7,60	4	105,90	105,90	5,48	5,48	5		0,1	Да	5	06.12.2017	29.11.2023	23.10.2052	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A0ZYJ91
ФСК ЕЭС-13	10,00	0,44	фикс.	8,50	2	101,80		4,29		-114		5,1	Да	5	05.07.2011		22.06.2021	/ / BBB	RU000A0JRL96
ФСК ЕЭС1Р1	10,00	2,45	фикс.	8,70	4	109,89	109,89	4,94	4,94	-49	0,055	0,3	Да	5	25.10.2018		19.10.2023	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A0ZZQN7
ФСК ЕЭС1Р2	10,00		фикс.	6,60	4								Нет		20.10.2020	12.10.2027	02.10.2035	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A1028T1
ФСК ЕЭС1Р4	10,00	6,75	фикс.	6,75	4	101,53	101,59	6,68	6,68	125	29,62	33,9	Да	5	30.01.2020	17.01.2030	11.01.2035	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A101CL5
ФСК ЕЭС1Р5	15,00		фикс.	6,50	4	101,97		6,11		68			Да	5	29.04.2020	23.04.2025	11.04.2035	BBB- / Baa3 / BBB*	RU000A101LX1

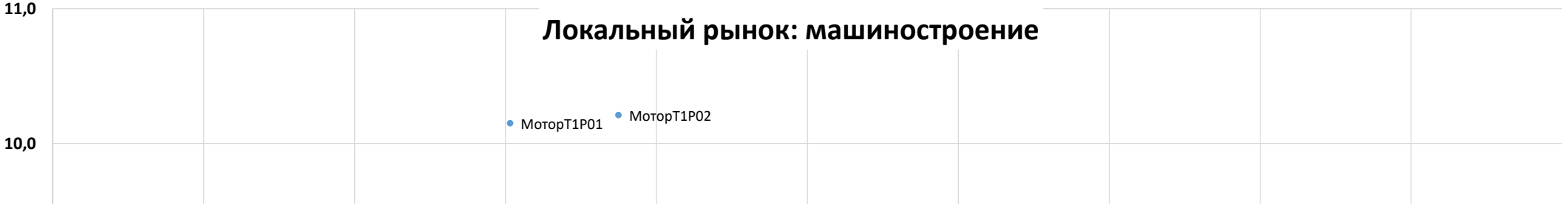
Департамент по работе на рынках капитала

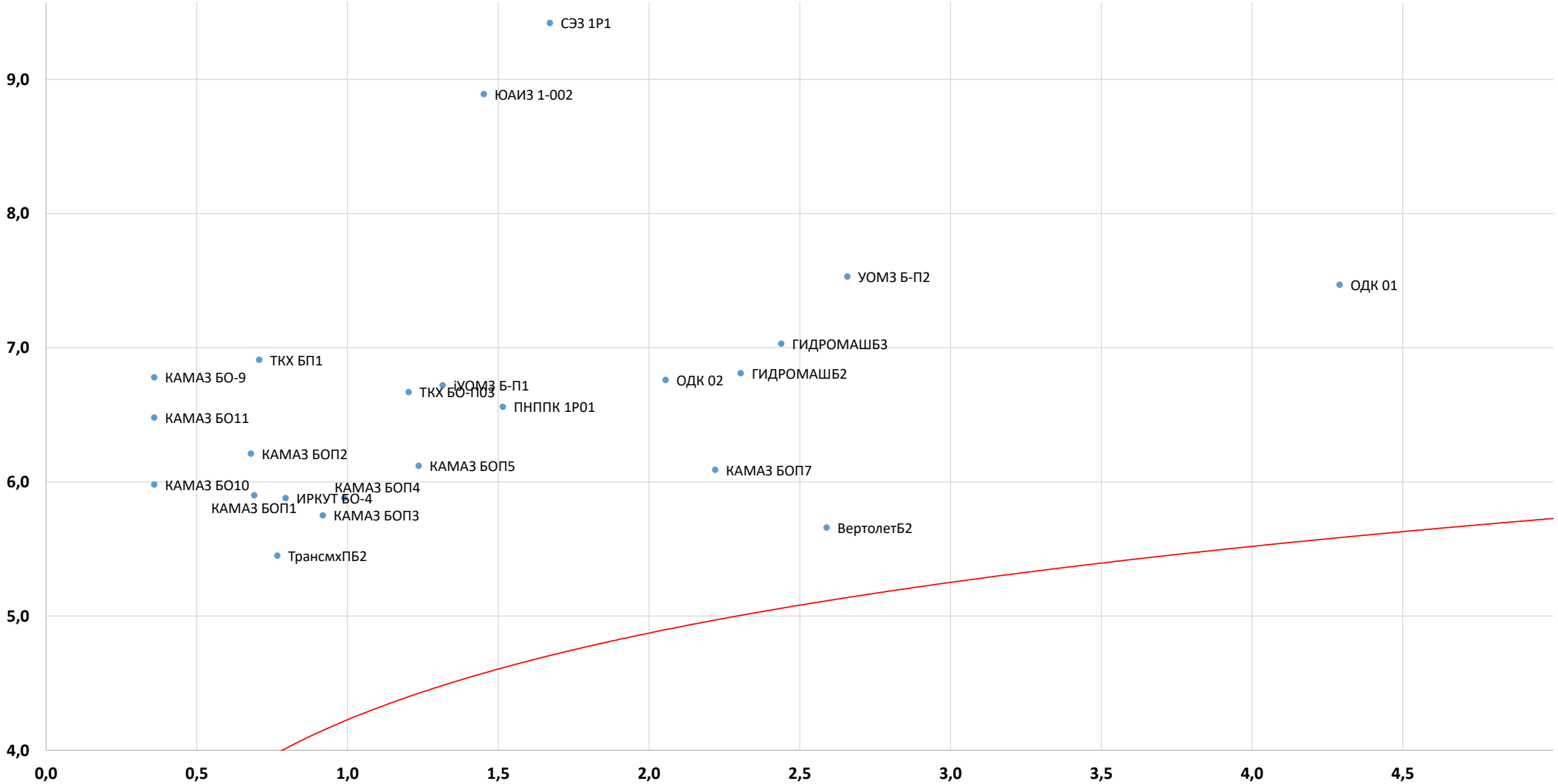
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
ФСК ЕЭС-21	10,00		фикс.	7,40	2	100,04		7,52		209			Да	5	24.10.2012	10.04.2024	06.10.2027	/ / BBB	RU000A0JT7T2
ФСК ЕЭС-22	10,00	0,04	плав.	5,50	2	100,59	100,59	-11,41	-11,41	-1684		1,8	Да	5	08.08.2012	27.07.2022	21.07.2027	/ / BBB	RU000A0JSQ58
ФСК ЕЭС-23	10,00		плав.	4,99	4								Нет		10.06.2013		27.04.2048	/ / BBB	RU000A0JTYJ6
ФСК ЕЭС-24	10,00	0,00	фикс.		2	100,49							Да	5	25.01.2013		07.01.2028	/ / BBB	RU000A0JTKA4
ФСК ЕЭС-26	15,00		инфл. плав	4,67	4								Нет		13.08.2013	02.07.2047	30.06.2048	/ / BBB	RU000A0JU2K9
ФСК ЕЭС-27	11,00		инфл. плав	4,67	4								Нет		13.08.2013	02.07.2047	30.06.2048	/ / BBB	RU000A0JU2L7

ФСК ЕЭС-28	20,00	плав.	4,99	4					Нет	10.06.2013		27.04.2048	/ / BBB	RU000A0JTYK4
ФСК ЕЭС-29	20,00	инфл. плав	5,42	4					Нет	21.10.2013		07.09.2048	/ / BBB	RU000A0JU7S1
ФСК ЕЭС-30	10,00	инфл. плав	5,91	4					Нет	13.12.2013	02.11.2046	30.10.2048	/ / BBB	RU000A0JUC92
ФСК ЕЭС-34	14,00	инфл. плав	4,99	4					Нет	13.12.2013	01.11.2047	30.10.2048	/ / BBB	RU000A0JUCA9
ФСК ЕЭС-37	20,00	инфл. плав	4,67	4					Нет	06.05.2015	29.03.2045	23.03.2050	/ / BBB	RU000A0JVCB5
ФСК ЕЭС-38	20,00	инфл. плав	4,67	4					Нет	06.05.2015	29.03.2045	23.03.2050	/ / BBB	RU000A0JVDD9
Энел 1Р-2R	3,00	фикс.	8,60	2					Нет	02.04.2019		15.12.2022	/ / BB+*	RU000A100824
Энел 1Р-3R	2,00	фикс.	8,50	2	102,70	4,66	-77		Нет	02.04.2019		03.10.2021	/ / BB+*	RU000A100840





Наверх

15 января 2021 г.

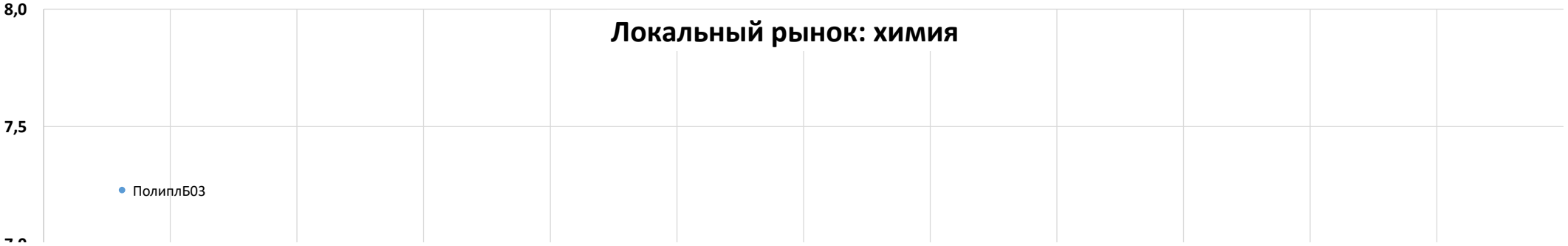
Департамент по работе на рынках капитала

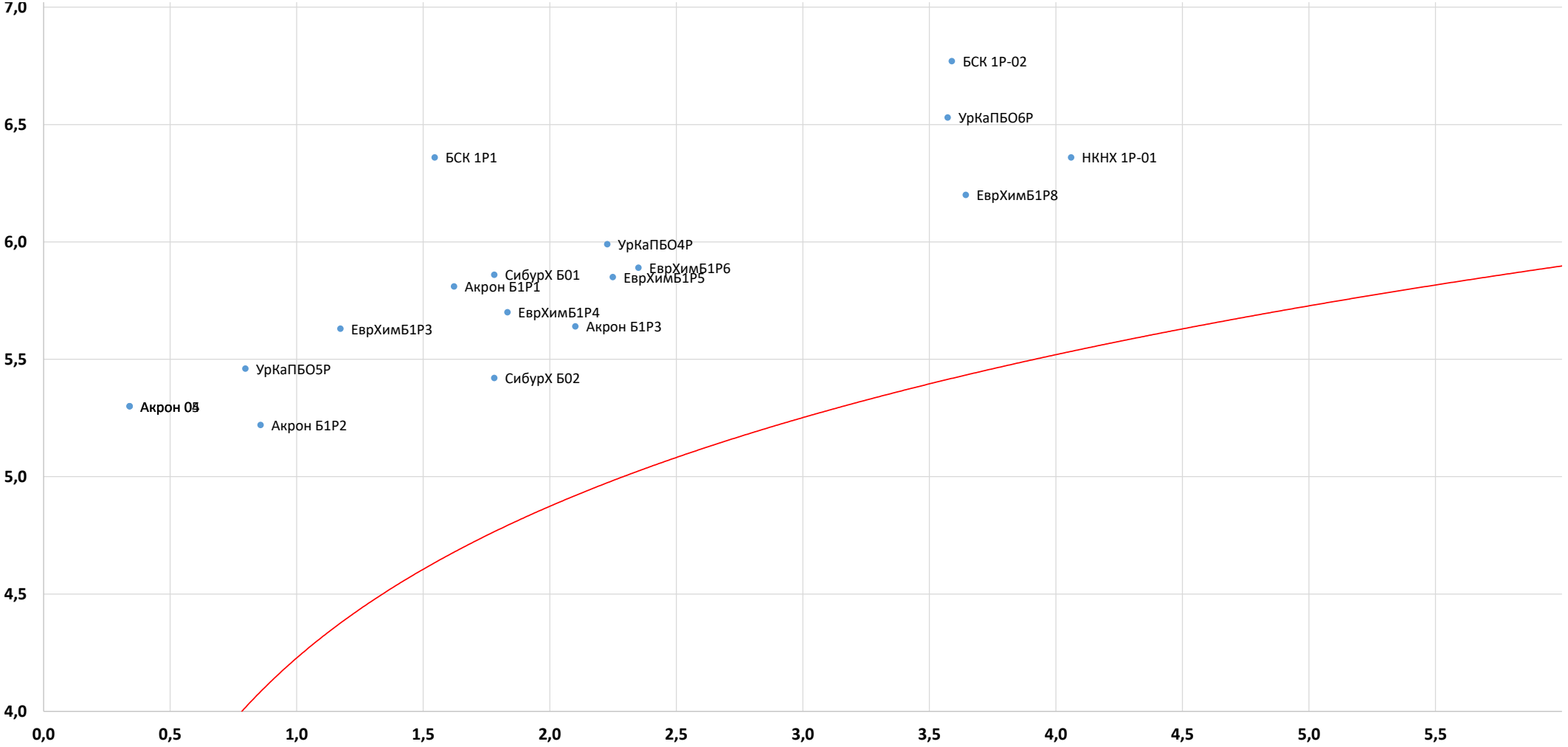
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
iУОМЗ Б-П1	3,50	1,32	фикс.	103,43	2	103,60	103,47	6,72	6,82	139	0,579	0,1	Нет		06.06.2019	26.05.2022	24.05.2029	NR / / *	RU000A100EV2
ВертолетБ1	10,00		фикс.	0,00	2	109,80		9,62		419			Да	5	28.01.2016		15.01.2026	/ / WD*	RU000A0JW3A6
ВертолетБ2	5,00	2,59	фикс.	104,69	2	104,95	104,95	5,66	5,66	23			Да	5	28.11.2013		16.11.2023	/ / WD*	RU000A0JUAT3
ВертолетБ3	5,00		фикс.	0,00	2	90,71		11,02		559			Да	5	28.12.2017		16.12.2027	/ / WD*	RU000A0ZYMN9
ВертолетБ4	5,00	5,35	фикс.	105,00	2	105,00		8,00		257			Да	5	28.12.2017		16.12.2027	/ / WD*	RU000A0ZYMM1
ГИДРОМАШБ2	3,00	2,30	фикс.	103,03	2	103,28	103,03	6,81	6,92	149	1,420	3,2	Нет		14.07.2020	11.07.2023	02.07.2030		RU000A101WH1
ГИДРОМАШБ3	3,00	2,44	фикс.	102,09	2	102,50	102,09	7,03	7,21	178	66,35	8,3	Нет		02.10.2020	29.09.2023	20.09.2030		RU000A1026H0
ИРКУТ БО-4	5,00	0,79	фикс.	102,24	2	102,50	102,60	5,88	5,75	32			Да	—	18.11.2013	08.11.2021	06.11.2023		RU000A0JUA45

КАМАЗ 12	5,00		фикс.	0,00	2								Нет		06.08.2015		18.07.2030		RU000A0JVP39
КАМАЗ БО10	3,00	0,36	плав.	100,06	2	100,17		5,98		55		0,8	Да	10	29.05.2018		10.05.2033		RU000A0ZZ877
КАМАЗ БО11	3,00	0,36	фикс.		2	100,00		6,48		105			Да	10	29.05.2018		10.05.2033		RU000A0ZZ893
КАМАЗ БО13	5,00		фикс.	0,00	2								Нет		24.12.2015		05.12.2030		RU000A0JW126
КАМАЗ БО14	5,00		фикс.	0,00	2								Нет		12.12.2016		24.11.2031		RU000A0JX1C5
КАМАЗ БО15	5,00		фикс.	0,00	2								Нет		20.12.2016		02.12.2031		RU000A0JX2B5
КАМАЗ БО-7	3,00		фикс.		2								Нет		24.05.2018	11.05.2028	05.05.2033		RU000A0ZZ7G1
КАМАЗ БО-8	3,00		фикс.		2								Нет		24.05.2018	11.05.2028	05.05.2033		RU000A0ZZ7H9
КАМАЗ БО-9	3,00	0,36	плав.	100,14	2	99,90		6,78		135		1,1	Да	10	29.05.2018		10.05.2033		RU000A0ZZ885
КАМАЗ БОП1	5,25	0,69	фикс.	102,11	2	102,20	102,11	5,90	6,03	60	0,508	0,5	Да	10	08.02.2019		04.02.2022		RU000A1003C0
КАМАЗ БОП2	4,50	0,68	фикс.	101,82	4	101,80	101,80	6,21	6,21	78	0,762	0,5	Да	10	29.03.2019		25.03.2022		RU000A1007V1
КАМАЗ БОП3	7,00	0,92	фикс.	102,88	4	102,85	102,85	5,75	5,75	32	0,210	0,4	Да	10	14.06.2019		10.06.2022		RU000A100FR7
КАМАЗ БОП4	3,00	0,99	фикс.	102,68	4	102,69	102,51	5,88	6,07	64	0,120	1,1	Да	10	10.07.2019		06.07.2022		RU000A100K49
КАМАЗ БОП5	5,00	1,24	фикс.	102,10	4	102,20	102,10	6,12	6,20	77	8,944	2,3	Да	10	23.10.2019		19.10.2022		RU000A100YK3
КАМАЗ БОП6	2,00	0,59	фикс.	100,36	2	101,83		3,05		-238		75,9	Да	10	20.02.2020		19.08.2021		RU000A101FR5
КАМАЗ БОП7	3,00	2,22	фикс.	101,64	4	101,65	101,65	6,09	6,09	66	0,289	1,1	Нет		10.06.2020		07.06.2023		RU000A101SM9
МоторТ1Р01	0,05	1,52	фикс.	108,91	4	108,08	108,30	10,15	9,95	452	0,073	0,1	Нет		25.09.2019		21.09.2022		RU000A100V38
МоторТ1Р02	0,06	1,87	фикс.	105,54	4	105,98	105,51	10,21	10,47	504	0,484	0,1	Нет		04.03.2020		01.03.2023		RU000A101HA7
ОДК 01	6,64	4,29	фикс.	115,56	2,00	115,00	116,00	7,47	7,25	182	0,833	0,4	Да	20	10.06.2016		10.06.2026		RU000A0JWK74
ОДК 02	2,57	2,05	фикс.	104,43	2,00	104,40	104,42	6,76	6,75	132	0,605	137,4	Нет		15.04.2016		17.04.2023		RU000A0JWDA3
ОДК 03	2,93		фикс.	0,00	2,00								Нет		15.04.2016		26.06.2024		RU000A0JWDB1
ПНППК 1Р01	0,25	1,52	фикс.	104,55	4,00	106,01		6,56		113			Нет		10.09.2019	06.09.2022	28.08.2029		RU000A100TB2
СЭЗ 1Р1	0,30	1,67	фикс.	105,41	2,00	105,41	105,41	9,42	9,42	399	0,626	0,6	Нет		19.11.2019		15.11.2022		RU000A1012K4
ТКХ БО-П02	5,00		фикс.	0,00	2,00								Нет		15.11.2018	09.11.2023	02.11.2028		RU000A0ZZTK7
ТКХ БО-П03	4,00	1,20	фикс.	103,40	2,00	103,79	103,40	6,67	7,00	157	1,606	0,4	Нет		30.04.2019	22.04.2022	13.04.2029		RU000A100AZ1
ТКХ БП1	7,00	0,71	фикс.	101,65	2,00	101,52	101,65	6,91	6,72	129	36,01	9,6	Нет		12.10.2017	30.09.2021	30.09.2027		RU000A0ZYCR1
ТрансмхПБ2	5,00	0,77	фикс.	102,90	2,00	102,85	102,85	5,45	5,45	2	1,980	21,7	Да	10	02.11.2018		29.10.2021	/ / ВВ*	RU000A0ZZRZ9
УОМЗ Б-П2	1,50	2,66	фикс.	101,17	2,00	100,01	100,01	7,53	7,53	210			Нет		16.12.2020	13.12.2023	04.12.2030	NR / / *	RU000A102HU3
ЮАИЗ 1-002	0,25	1,45	фикс.	102,21	4,00	102,02	102,04	8,89	8,87	344	0,377	0,1	Нет		15.08.2019	11.08.2022	13.08.2024		RU000A100Q92





Наверх

15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

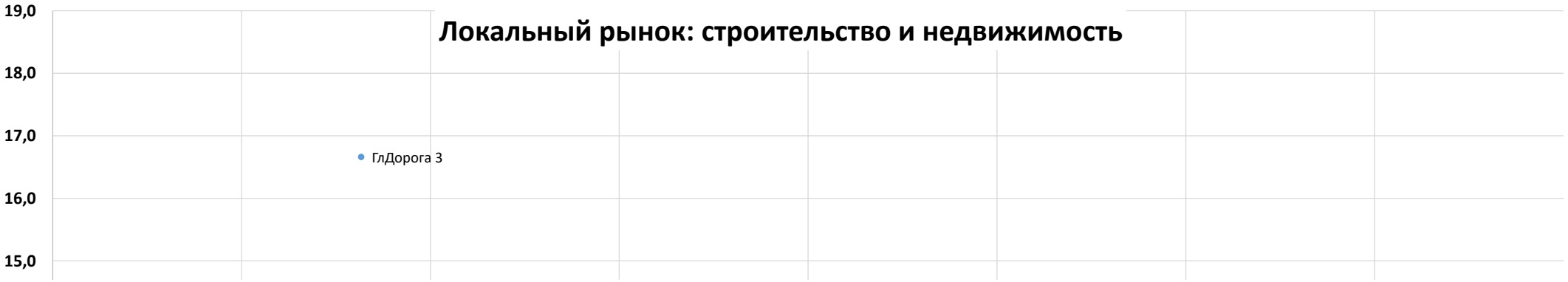
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
Акрон 04	2,37	0,34	фикс.	6,50	2	100,42	100,42	5,30	5,27	-16			Да	10	31.05.2011		18.05.2021	/ Ba3 / BB-	RU000A0JRHF3
Акрон 05	1,75	0,34	фикс.	6,50	2	100,42	100,09	5,30	6,29	86	0,244		Да	10	31.05.2011		18.05.2021	/ Ba3 / BB-	RU000A0JRHG1
Акрон Б1Р1	5,00	1,62	фикс.	5,90	2	100,26	100,47	5,81	5,68	25		0,1	Да	10	06.10.2016		24.09.2026	/ / BB-	RU000A0JWV89
Акрон Б1Р2	5,00	0,86	фикс.	8,60	2	102,90		5,22		-21		1,0	Да	10	06.06.2017	23.11.2021	25.05.2027	/ / BB-	RU000A0JXSS1
Акрон Б1Р3	10,00	2,10	фикс.	7,25	2	103,54	103,77	5,64	5,53	10		65,7	Да	10	25.10.2019		21.04.2023	/ / BB-*	RU000A100YU2
АРАГОН БП1	0,50		фикс.		4	102,00		-0,42		-585			Нет		29.03.2019		16.03.2029		RU000A1007U3
АРАГОН БП2	0,30		фикс.		4	103,50		1,60		-383			Нет		23.07.2019	09.07.2024	10.07.2029		RU000A100ME1
АРАГОН об	1,00		фикс.		4	102,50		0,69		-474			Нет		10.05.2017		04.05.2022		RU000A0JXQQ9
БСК 1Р1	8,00	1,55	фикс.	8,10	4	102,94	102,75	6,36	6,49	106	0,470	1,3	Да	10	02.02.2018		27.01.2023		RU000A0ZYR18
БСК 1Р-02	5,00	3,59	фикс.	6,60	4,00	99,98	99,99	6,77	6,77	134	0,074	0,9	Нет		30.06.2020		24.06.2025		RU000A101UR4

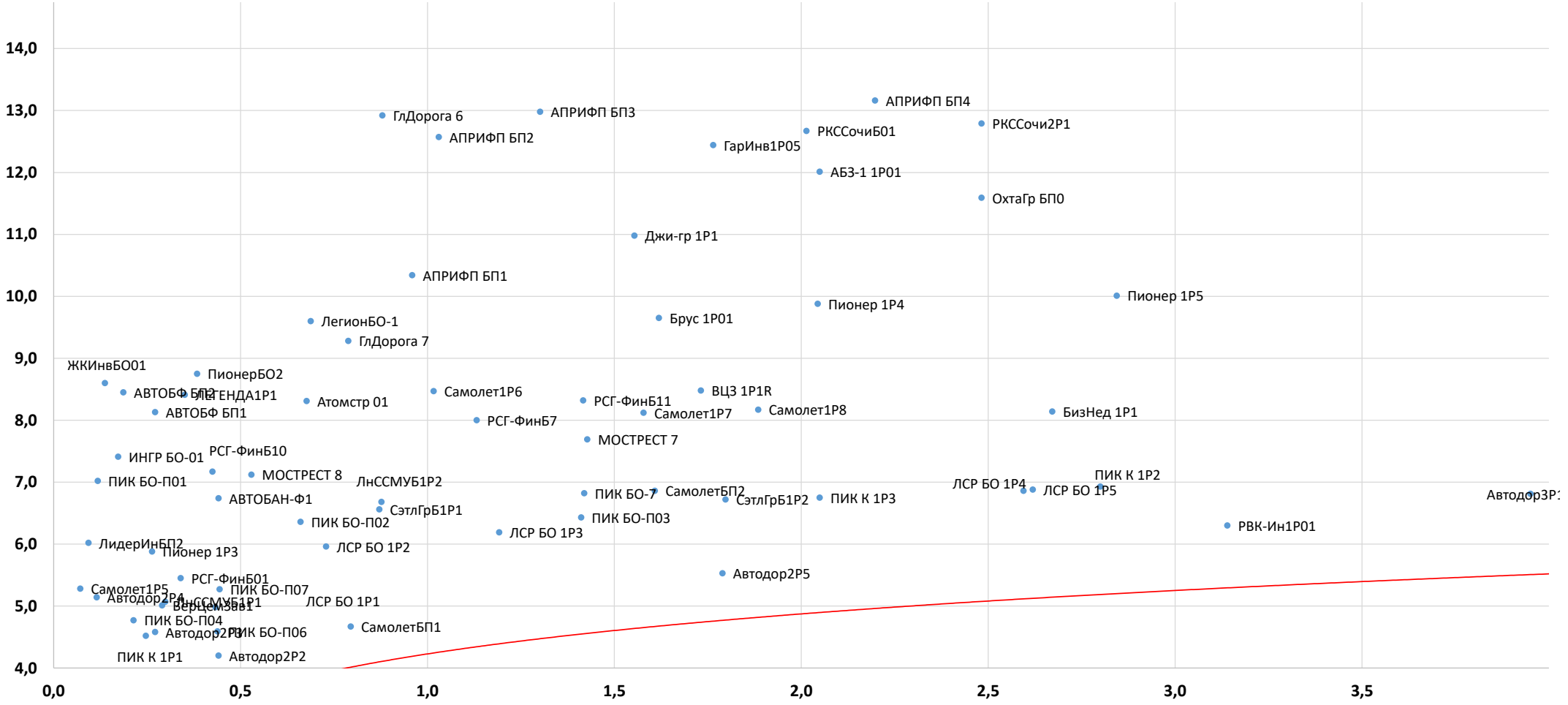
ЕврХимБ1Р3	19,00	1,17	фикс.	8,55	2,00	103,50	103,49	5,63	5,64	21	0,282	0,1	Да	10	09.04.2019		09.04.2022	NR / / WD*	RU000A1008Z0
ЕврХимБ1Р4	10,00	1,83	фикс.	7,85	2,00	104,18	104,18	5,70	5,70	27	0,166	1,1	Да	10	18.07.2019		18.01.2023	NR / / WD*	RU000A100LS3
ЕврХимБ1Р5	10,00	2,25	фикс.	7,85	2,00	104,80		5,85		42		121,8	Да	10	19.07.2019		19.07.2023	NR / / WD*	RU000A100LV7
ЕврХимБ1Р6	13,00	2,35	фикс.	7,85	4,00	104,99	104,99	5,89	5,89	46	0,090	11,6	Да	10	23.08.2019		18.08.2023	NR / / WD*	RU000A100RG5
ЕврХимБ1Р7	10,00		фикс.	8,25	2,00								Нет		16.04.2020		10.04.2025	NR / / WD*	RU000A101L96
ЕврХимБ1Р8	25,00	3,64	фикс.	8,05	2,00	107,15	107,14	6,20	6,21	78	0,571	131,8	Да	10	21.04.2020		15.04.2025	NR / / WD*	RU000A101LJ0
НКНХ 1Р-01	15,00	4,06	фикс.	9,75	2,00	114,54	115,12	6,36	6,23	80	0,357	0,4	Да	10	20.12.2018	05.12.2025	07.12.2028	NR / / WD*	RU000A0ZZZ17
ПолиплБ03	0,65	0,31	фикс.		2,00	100,25		7,23		180		0,1	Нет		11.11.2016		05.11.2021		RU000A0JWYK8
ПолиплП1Б1	0,90		фикс.		2,00								Нет		25.04.2017		18.04.2023		RU000A0JXPJ6
СибурХ Б01	5,00	1,78	фикс.	5,50	2,00	99,76		5,86		43			Да	5	28.05.2020	24.11.2022	16.05.2030	BBB- / Baa3 / BBB-*	RU000A101Q42
СибурХ Б02	10,00	1,78	фикс.	5,50	2,00	100,25	100,25	5,42	5,42	-1	7,940	5,7	Да	5	28.05.2020	24.11.2022	16.05.2030	BBB- / Baa3 / BBB-*	RU000A101Q59
СИБУРХол10	10,00	0,19	фикс.	10,50	2,00	101,51	101,68	2,19	1,29	-414	0,073	1,4	Да	5	29.03.2016	23.03.2021	17.03.2026	/ / BBB-	RU000A0JWBK6
УрКаПБО4Р	15,00	2,23	фикс.	7,70	2,00	103,95	103,95	5,99	5,99	56	10,62	11,0	Да	10	15.06.2018		09.06.2023	BB- *- / / BB-*	RU000A0ZZ9W4
УрКаПБО5Р	10,00	0,80	фикс.	9,30	2,00	103,07	103,05	5,46	5,49	6	0,718	11,3	Да	10	13.11.2018		09.11.2021	BB- *- / / BB-*	RU000A0ZZT80
УрКаПБО6Р	30,00	3,57	фикс.	6,85	2,00	101,52	101,45	6,53	6,55	112	5,376	20,8	Нет		03.03.2020		25.02.2025	BB- *- / / BB-*	RU000A101GZ6

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
АБЗ-1 1Р01	2,00	2,05	фикс.	12,00	4	100,99	100,99	12,01	12,01	658	39,33		Нет		28.12.2020		25.12.2023		RU000A102LW1
АВТОБАН-Ф1	3,00	0,44	фикс.	11,00	2	101,85	102,02	6,74	6,33	90	1,111	0,6	Да	20	30.06.2016		24.06.2021	/ B1 /	RU000A0JWM49
АВТОБФ БП1	3,00	0,27	плав.	7,50	2	99,86	99,86	8,13	8,13	270	0,065	0,3	Да	20	28.04.2017		19.04.2024	/ B1 /	RU000A0JXQ51
АВТОБФ БП2	3,00	0,19	фикс.	11,00	2	100,58	100,32	8,45	9,25	382	0,677	10,3	Нет		26.03.2019	23.03.2021	19.03.2024		RU000A100733
Автодор2Р1	2,72	5,95	фикс.		2	102,00		1,86		-357			Да	5	27.12.2018		12.12.2030	/ / BBB*	RU000A100030
Автодор2Р2	17,70	0,44	плав.	6,00	2	100,79	100,31	4,20	5,33	-10	0,076	0,1	Да	5	27.12.2018		23.12.2021	/ / BBB*	RU000A100048
Автодор2Р3	10,00	0,27	фикс.	8,70	2	101,09	100,99	4,58	4,95	-48		0,3	Да	5	26.04.2019		23.04.2021	/ / BBB*	RU000A100B40
Автодор2Р4	8,30	0,12	фикс.	8,00	2	100,31	100,31	5,14	5,14	-29			Да	5	26.07.2019		25.02.2021	/ / BBB*	RU000A100MV5
Автодор2Р5	25,92	1,79	фикс.	7,15	2	102,82	102,80	5,53	5,63	20	0,155	4,1	Да	5	25.12.2019	21.12.2022	12.12.2029	/ / BBB*	RU000A1017H9
Автодор3Р1	14,00	3,95	фикс.	6,75	2	100,21	100,05	6,81	6,85	142	177,8		Нет		15.12.2020		09.12.2025	/ / BBB*	RU000A102H91
АПРИФП БП1	0,20	0,96	фикс.	16,00		105,95	105,83	10,34	10,51	508	0,583	0,8	Нет		12.02.2019		27.01.2022		RU000A1003E6
АПРИФП БП2	0,24	1,03	фикс.	15,00	4	103,01	102,90	12,57	12,69	726	1,667	1,2	Нет		10.07.2019		06.07.2022		RU000A100K64

АПРИФП БП3	0,18	1,30	фикс.	14,25	4	102,56	102,66	12,98	12,77	734	2,445	1,6	Нет		14.11.2019		10.11.2022		RU000A101178
АПРИФП БП4	0,50	2,20	фикс.	13,00	4	100,94	100,87	13,16	13,20	777	7,021		Нет		23.12.2020		20.12.2023		RU000A102KR3
Атомстр 01	1,00	0,68	фикс.	11,75	2	102,38	102,40	8,31	8,28	285	1,213	0,9	Нет		01.10.2019	28.09.2021	24.09.2024		RU000A100VS2
БизНед 1Р1	4,00	2,67	фикс.	7,90	4	99,99	99,99	8,14	8,14	271	4,552	13,5	Нет		28.08.2020		23.08.2024		RU000A1022G1
Брус 1Р01	4,00	1,62	фикс.	11,00	4	102,70	102,73	9,65	9,63	420	9,651	10,4	Нет		12.03.2020		09.03.2023		RU000A101HU5
ВерЦемЗав1	3,60	0,29	фикс.	0,50	4	98,70		5,01		-42			Нет		14.05.2013		04.05.2021		RU000A0JTWT9
ВЦЗ 1Р1R	7,60	1,73	фикс.	12,50	4	107,48	107,31	8,48	8,59	316	0,225	0,4	Нет		22.12.2017	09.12.2022	10.12.2027		RU000A0ZYLK7
ГарИнв1Р05	5,28	1,76	фикс.	12,00	4	100,18	100,31	12,44	12,35	692		30,8	Нет		12.03.2019		05.04.2024		RU000A1005T9
ГлДорога 3	8,00	0,82	инфл. фикс	4,00	1	91,00		16,66		1123		0,4	Нет		22.11.2010		30.10.2028		RU000A0JR4U9
ГлДорога 6	8,17	0,88	инфл. плав	4,00	1	85,85	90,76	12,92	16,09	1066	0,133		Да	20	12.12.2012		22.11.2028		RU000A0JTFB2
ГлДорога 7	1,40	0,79	инфл. плав	4,00	1	96,00		9,28		385			Нет		20.11.2012		30.10.2029		RU000A0JTB96
Джи-гр 1Р1	1,00	1,55	фикс.	12,50	4	102,99	103,13	10,98	10,88	545	3,802	3,8	Нет		22.06.2020		19.06.2023		RU000A101TS4
ЖКИнвБО01	0,17	0,14	фикс.	14,00	2	100,70	100,74	8,60	8,30	287		0,3	Нет		06.03.2018		05.03.2021		RU000A0ZYSS5
ЗСД 01	5,00		фикс.	10,44	2	130,00		6,52		109			Да	10	07.06.2011		13.05.2031	/ Ba2 /	RU000A0JRJB8
ЗСД 02	5,00		фикс.	10,44	2	130,00		6,52		109			Да	10	07.06.2011		13.05.2031	/ Ba2 /	RU000A0JRJL7
ЗСД 03	5,00		фикс.	9,84	2	107,00		9,03		360			Да	10	02.03.2012		06.02.2032	/ Ba2 /	RU000A0JS4J1
ЗСД 04	5,00		фикс.	9,84	2	130,00		6,17		74			Да	10	02.03.2012		06.02.2032	/ Ba2 /	RU000A0JS4K9
ЗСД 05	5,00		фикс.	9,84	2	107,00		9,03		360			Да	10	02.03.2012		06.02.2032	/ Ba2 /	RU000A0JS4L7
ИНГР Б1Р1	10,00	6,79	фикс.		2	100,55		5,12		-31			Нет		21.11.2017	02.11.2027	09.11.2027	/ / NR*	RU000A0ZYG37
ИНГР БО-01	5,00	0,17	плав.	8,50	2	99,90	99,90	7,41	7,41	198			Нет		23.03.2017		17.03.2022	/ / NR*	RU000A0JXLM9
ИНГРАД 2Р1	20,00		плав.	6,75	2								Нет		19.12.2019	16.12.2021	06.12.2029		RU000A101798
ИНГРАД 2Р2	15,00		плав.	6,73	2								Нет		11.03.2020	09.03.2022	27.02.2030		RU000A101HP5
ИНГРАД1Р2	20,00		фикс.		2								Нет		11.12.2018		28.11.2028		RU000A0ZZXD4
ИнДевелБО1	0,52	0,23	фикс.		2	104,90	104,90	-13,53	-13,53	-1896			Нет		14.04.2016		02.04.2026		RU000A0JWCW9
КВС БО-01	2,00		плав.	7,75	1								Нет		25.12.2019		08.12.2033		RU000A1018G9
ЛЕГЕНДА1Р1	0,50	0,35	фикс.	14,00	4	102,00	102,13	8,41	8,02	259	4,922	6,0	Нет		12.07.2018		08.07.2021		RU000A0ZZCV0
ЛегионБО-1	0,20	0,69	фикс.		2	101,70	101,75	9,60	9,52	409	1,047	0,4	Нет		08.10.2018		04.10.2021		RU000A0ZZNV7
ЛидерИнБП2	5,00	0,09	фикс.	11,70	2	100,50	100,29	6,02	8,39	296	5,452	1,4	Нет		21.02.2018	17.02.2021	15.02.2023	B- / / *	RU000A0ZYU39
ЛнССМУБ1Р1	1,15	0,30	фикс.	11,85	4	102,03	101,73	5,07	6,11	68	0,266	1,0	Да	20	23.06.2016		17.06.2021	B- / / *	RU000A0JWLG3
ЛнССМУБ1Р2	3,90	0,88	фикс.	8,95	4	102,14	102,20	6,68	6,58	115	0,260	0,9	Нет		15.09.2017		09.09.2022	B- / / *	RU000A0ZYA66
ЛСР БО 1Р1	2,00	0,43	фикс.	10,75	4	102,50	102,50	4,98	4,98	-45		0,5	Да	20	28.09.2016		22.09.2021	/ / B+	RU000A0JWU98
ЛСР БО 1Р2	3,00	0,73	фикс.	9,65	4	102,75	102,88	5,96	5,86	43	0,627	2,0	Да	20	26.04.2017		20.04.2022	/ / B+	RU000A0JXPM0
ЛСР БО 1Р3	5,00	1,19	фикс.	9,00	4	103,51	103,38	6,19	6,30	87	1,395	4,1	Нет		03.10.2017		27.09.2022	/ / B+	RU000A0ZYBV5
ЛСР БО 1Р4	7,00	2,59	фикс.	8,50	4	104,60	104,50	6,86	6,94	151		12,7	Нет		04.10.2019		27.09.2024	/ / B+*	RU000A100WA8
ЛСР БО 1Р5	6,00	2,62	фикс.	8,40	4	104,48	104,26	6,88	6,97	154		8,4	Нет		31.10.2019		24.10.2024	/ / B+*	RU000A100ZL8
МДС кл.А1	7,50		фикс.		4								Нет		29.05.2015		10.05.2030		RU000A0JVF98

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
МДС кл.А2	5,50		фикс.		4,00	106,00		-19,63		-2506			Нет		08.07.2015		19.06.2030	/ / *	RU000A0JVLA8
МОСТРЕСТ 7	5,00	1,43	фикс.	9,25	2,00	102,35	102,34	7,69	8	227	0,536	1,7	Да	—	19.07.2016	12.07.2022	07.07.2026	/ / *	RU000A0JWN63
МОСТРЕСТ 8	5,00	0,53	фикс.	11,15	2,00	102,20	102,06	7,12	7	195		0,6	Нет		10.08.2016	04.08.2021	29.07.2026	/ / *	RU000A0JWN89
ОхтаГр БП0	0,30	2,48	фикс.	12,00	4,00	102,17	102,18	11,59	12	615	0,583		Нет		16.12.2020		13.12.2023	/ / *	RU000A102HG2
ПИК БО-7	15,00	1,42	фикс.	8,70	2,00	102,85	102,90	6,82	7	136	0,135	0,3	Нет		05.08.2016		24.07.2026	NR / / BB-*	RU000A0JWP46
ПИК БО-П01	13,00	0,12	фикс.	5,65	2,00	99,86	99,86	7,02	7	150	1,855	8,2	Нет		03.03.2017		25.02.2022	NR / / BB-*	RU000A0JXK40
ПИК БО-П02	5,20	0,66	фикс.	11,25	4,00	103,35	103,34	6,36	6	94	1,255	4,6	Нет		28.04.2017		22.04.2022	NR / / BB-*	RU000A0JXQ93
ПИК БО-П03	10,00	1,41	фикс.	10,75	4,00	106,49	106,41	6,43	6	105	13,71	4,2	Да	20	04.08.2017		29.07.2022	NR / / BB-*	RU000A0JXY44
ПИК БО-П04	7,00	0,21	плав.	4,75	2,00	99,99	99,99	4,77	5	-61			Нет		06.04.2018		24.03.2028	NR / / BB-*	RU000A0ZZ1M2
ПИК БО-П06	6,00	0,44	плав.	5,70	2,00	100,49	100,26	4,59	5	-29		0,4	Нет		27.06.2018		23.06.2021	NR / / BB-*	RU000A0ZZAW2
ПИК БО-П07	4,00	0,44	фикс.	8,70	2,00	101,50	101,51	5,27	5	-18	2,572	4,6	Нет		29.06.2018		25.06.2021	NR / / BB-*	RU000A0ZZBJ7
ПИК К 1Р1	1,16	0,25	плав.	5,75	2,00	100,30	100,30	4,52	5	-91			Нет		16.10.2019		12.04.2023	/ / BB-*	RU000A100XR0
ПИК К 1Р2	7,00	2,80	фикс.	8,25	4,00	104,20	104,13	6,93	7	153		5,9	Нет		18.12.2019		11.12.2024	/ / BB-*	RU000A1016Z3
ПИК К 1Р3	7,00	2,05	фикс.	7,40	4,00	101,65	101,62	6,75	7	134	17,72	27,6	Нет		30.09.2020		29.03.2023	/ / BB-*	RU000A1026C1

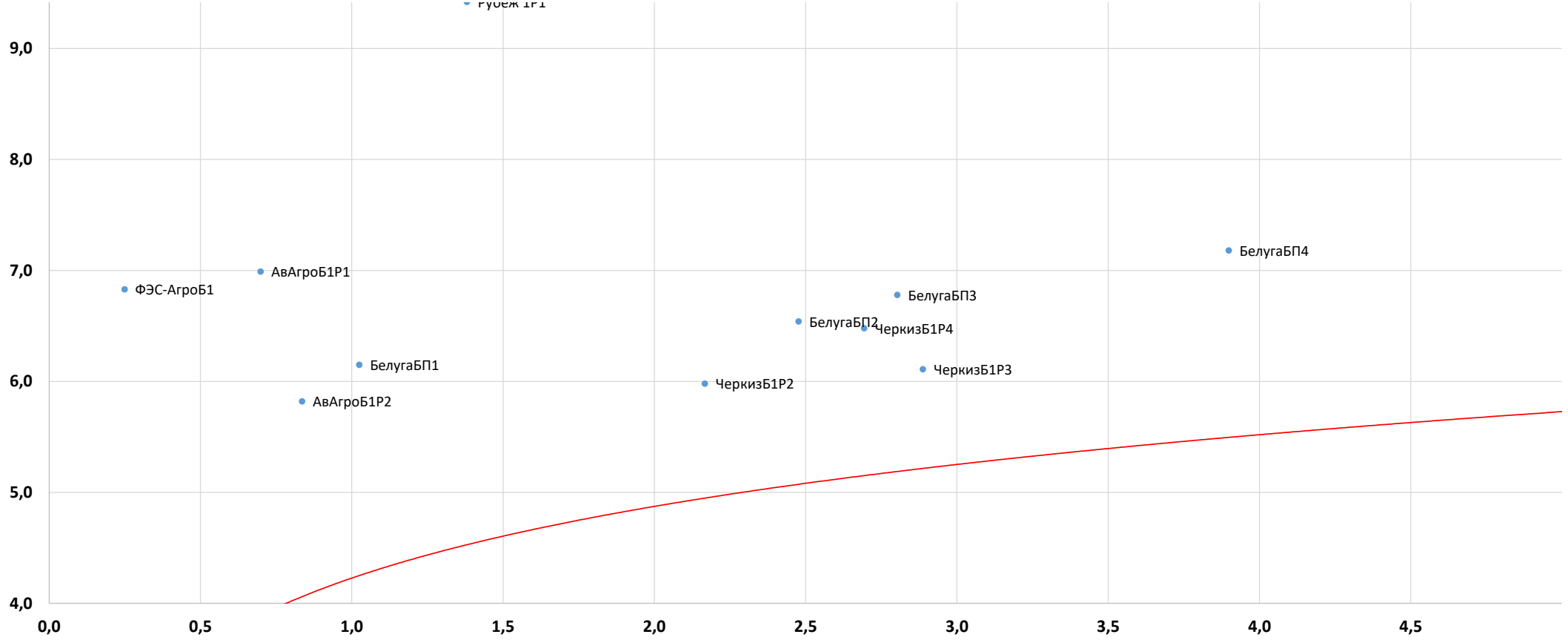
Пионер 1Р3	3,00	0,26	фикс.	12,00	4,00	101,65	101,53	5,88	6	92		0,8	Нет		27.04.2018		23.04.2021	NR / / *	RU000A0ZZ547
Пионер 1Р4	5,00	2,04	фикс.	10,50	4,00	101,95	101,72	9,88	10	457		12,9	Нет		16.12.2019		11.12.2023	NR / / *	RU000A1016F5
Пионер 1Р5	5,00	2,84	фикс.	9,75	4,00	100,21	100,20	10,01	10	460	22,56		Нет		22.12.2020		17.12.2024	NR / / *	RU000A102KG6
ПионерБО2	3,00	0,38	фикс.	0,01	4,00	96,86		8,75		332			Нет		09.06.2016		03.06.2021	NR / / *	RU000A0JWK66
ПрГрад Б01	0,50		фикс.	6,35	2,00								Нет		29.12.2020		26.12.2023	/ / *	RU000A102M29
ПропфинБО1		3,13	фикс.	13,00	2,00	45,54	45,54	37,58	38	3215		0,1	Нет		09.10.2015		02.10.2020	NR / WR /	RU000A0JVUB7
РВК-Ин1Р01	3,00	3,14	фикс.	7,15	2,00	103,00	102,82	6,30	6	92	0,374	3,1	Нет		18.08.2020	13.08.2024	06.08.2030	/ / *	RU000A1021G3
РКССочи2Р1	0,50	2,48	фикс.	12,50	4,00	100,68	100,66	12,79	13	737	1,473		Нет		23.12.2020		20.12.2023	/ / *	RU000A102KQ5
РКССочиБ01	0,50	2,01	фикс.	14,00	4,00	103,80	103,69	12,67	13	730	0,454	0,7	Нет		26.05.2020		23.05.2023	/ / *	RU000A101PV6
РСГ-ФинБ01	3,00	0,34	фикс.		2,00	102,00	101,60	5,45	7	124		0,1	Да	—	26.11.2013		11.11.2025	NR / /	RU000A0JUAG0
РСГ-ФинБ10	1,00	0,42	фикс.	14,50	2,00	103,03	103,98	7,17	5	-54	0,106	0,1	Нет		24.06.2016		18.06.2021	NR / /	RU000A0JWLJ7
РСГ-ФинБ11	1,50	1,42	фикс.	12,00	2,00	105,55	106,79	8,32	7	204	0,066	0,1	Нет		15.08.2019		11.08.2022	NR / / *	RU000A100PM7
РСГ-ФинБ7	3,00	1,13	фикс.	12,00	2,00	104,67	104,67	8,00	8	257		0,4	Нет		07.04.2017		01.04.2022	NR / /	RU000A0JXN13
Самолет 01	1,50		фикс.		4,00	109,00		-15,63		-2106			Нет		11.11.2016		30.10.2026	/ / *	RU000A0JWYJ0
Самолет1Р4	0,70		фикс.	12,00	4,00	98,13		14,93		950			Нет		27.12.2018	23.12.2021	14.12.2028	/ / *	RU000A0ZZZZ2
Самолет1Р5	0,30	0,07	фикс.	9,50	4,00	100,14	100,16	5,28	7	183	0,333	0,1	Нет		13.08.2019		31.07.2029	/ / *	RU000A100Q50
Самолет1Р6	0,50	1,02	фикс.		4,00	101,30	101,25	8,47	9	309	1,909	5,3	Нет		14.08.2019		01.08.2029	/ / *	RU000A100QA0
Самолет1Р7	3,00	1,58	фикс.	12,00	4,00	106,70	106,80	8,12	8	263	5,314	4,3	Нет		23.10.2019		19.10.2022	/ / *	RU000A100YG1
Самолет1Р8	6,00	1,88	фикс.	11,00	2,00	105,72	105,70	8,17	8	274	14,04	29,3	Нет		03.03.2020		28.02.2023	/ / *	RU000A101H43
СамолетБП1	1,25	0,79	фикс.	12,00	4,00	106,00	104,05	4,67	7	166	0,053	0,1	Нет		23.05.2017		17.05.2022	/ / *	RU000A0JXRF0
СамолетБП2	1,50	1,61	фикс.	11,50	4,00	108,01	108,05	6,86	7	140		0,1	Нет		02.11.2017		27.10.2022	/ / *	RU000A0ZYEM8
СамолетБП3	0,10		фикс.	9,50	4,00								Нет		28.12.2017		17.12.2021	/ / *	RU000A0ZYME8
СЗКК 03	4,50	0,23	плав.	6,58	2,00	94,77	90,33	34,11	65	5912			Да	20	21.10.2011		26.09.2031	/ / *	RU000A0JRU20
СЗКК 04	4,50	0,23	инфл. плав	6,58	2,00	93,03	93,03	32,73	45	3971			Да	20	21.10.2011		26.09.2031	/ / *	RU000A0JRU46
СэтлГрБ1Р1	4,45	0,87	фикс.	9,70	4,00	102,88	102,75	6,56	7	128	0,349	1,6	Да	20	02.11.2017		27.10.2022	B+ / / *	RU000A0ZYEQ9
СэтлГрБ1Р2	5,00	1,80	фикс.	10,75	4,00	107,81	107,63	6,72	7	139		2,1	Нет		23.07.2019		17.01.2023	B+ / / *	RU000A100MG6
ТрежИн БО2	3,00		фикс.	7,00	2,00	80,00		42,52		3709			Нет		07.11.2014		29.10.2021	/ / *	RU000A0JUYJ4
ЯмалСтИн 1	2,90	0,27	фикс.	14,25	4,00	104,50		-0,48		-591			Нет		29.06.2016		24.04.2021	/ / *	RU000A0JWKL5

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк





Наверх

15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

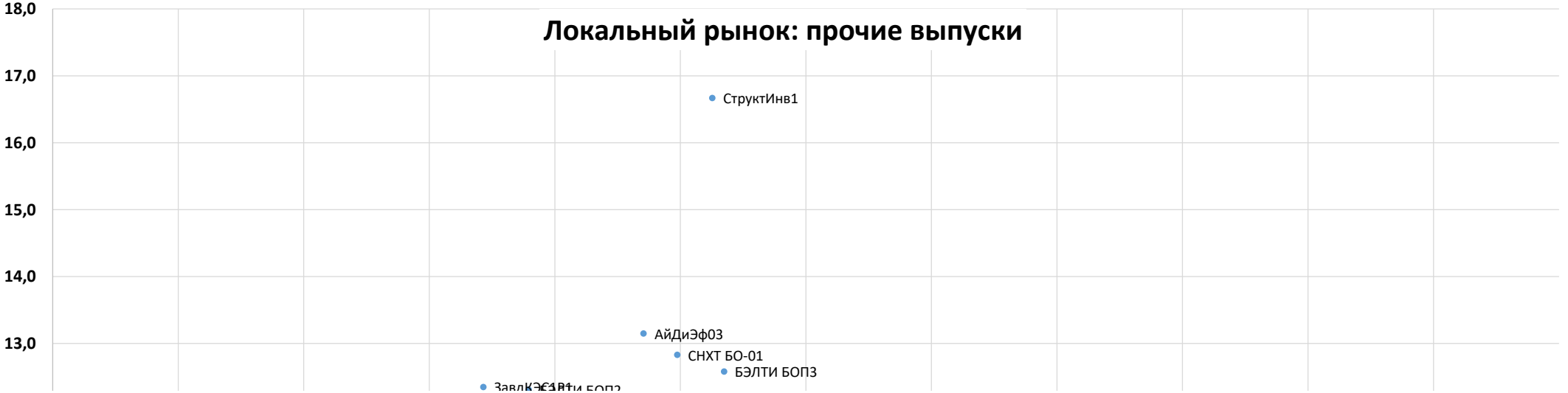
Монитор долговых рынков

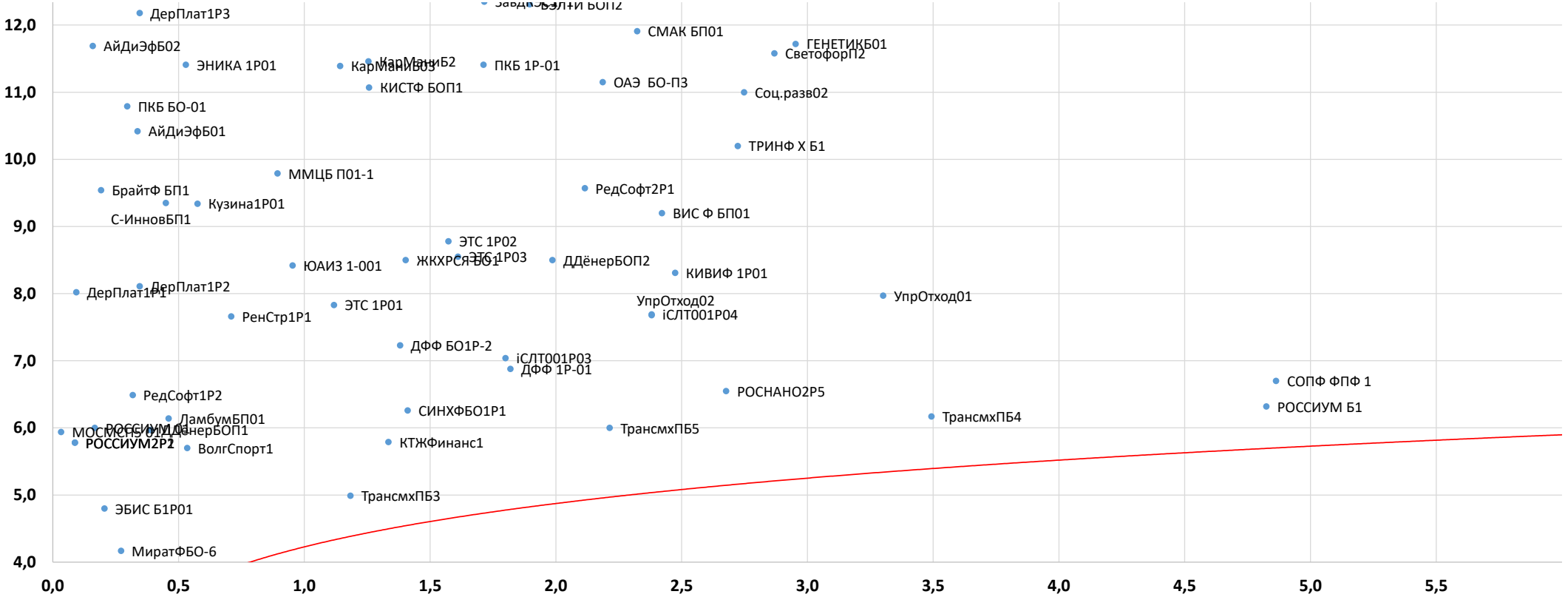
РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность			Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Разм.	Оферта	Погаш.		
АвАгроБ1Р1	3,00	0,70	фикс.	6,00	4	99,44	99,44	6,99	6,99	156		41,8	Нет	05.10.2017	30.09.2021	23.09.2027		RU000A0ZYC31
АвАгроБ1Р2	3,00	0,84	фикс.	6,00	2	100,25	100,30	5,82	5,76	33		47,4	Нет	27.11.2017	23.11.2021	16.11.2027		RU000A0ZYH02
Агро-Л 1Р1	2,50		плав.	8,50	2							27,1	Нет	28.07.2020	22.07.2025	20.07.2027		RU000A101YQ8
БелугаБП1	3,75	1,02	фикс.	9,50	2	103,45	103,51	6,15	6,09	66	0,095	0,5	Нет	13.06.2017		07.06.2022	/ / B+*	RU000A0JXTB5
БелугаБП2	5,00	2,48	фикс.	9,50	2	107,51	107,30	6,54	6,63	120	0,797	3,2	Нет	17.07.2019		10.07.2024	/ / B+*	RU000A100L63
БелугаБП3	5,00	2,80	фикс.	8,25	2	104,37	104,38	6,78	6,78	135	2,688	0,9	Нет	10.12.2019		03.12.2024	/ / B+*	RU000A1015E0
БелугаБП4	5,00	3,90	фикс.	7,40	2	101,32	101,27	7,18	7,19	176	12,26		Нет	11.12.2020		05.12.2025	/ / B+*	RU000A102GU5
ОАЭ БО-П1	0,20	1,28	фикс.	13,75		104,45	104,49	10,82	10,79	536	0,706	0,4	Нет	05.12.2018		12.02.2023		RU000A0ZZWJ3
Рубеж 1Р1	0,25	1,38	фикс.	14,00	2	106,45	106,01	9,42	9,75	432	0,186	0,5	Нет	10.07.2019		06.07.2022		RU000A100K31
УрожайБО01	0,15	2,13	фикс.	13,00	2	102,70	102,61	12,01	12,06	663	0,372	0,4	Нет	18.06.2020		15.06.2023		RU000A101TA2
ФЭС-АгроБ1	0,25	0,25	фикс.	14,00	0,00	101,77	101,37	6,83	8,59	316	0,268	2,5	Нет	18.04.2019		15.04.2021		RU000A1009R5
ЧеркизБ1Р2	10,00	2,17	фикс.	7,50	4,00	103,60	103,60	5,98	5,98	55	2,496	41,9	Нет	28.11.2019		25.05.2023		RU000A1013Y3
ЧеркизБ1Р3	6,30	2,89	фикс.	6,20	4,00	100,65	100,73	6,11	6,08	65	0,306	0,5	Нет	18.09.2020		15.03.2024		RU000A1024W4
ЧеркизБ1Р4	6,00	2,69	фикс.	6,40	4,00	100,21	100,29	6,48	6	101	0,958		Нет	25.12.2020	22.12.2023	19.12.2025		RU000A102LD1
Шевченк1Р2	0,30	3,11	фикс.	13,00	2,00	103,07	103,04	12,56	13	714	0,833	1,2	Нет	21.05.2020		15.05.2025		RU000A101P92

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков





15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность			Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.	
BCS GMf11	0,60	3,94	фикс.	9,00	2	103,90							Нет		03.12.2020		20.12.2025	B+ / / *	XS2269286345
BCS GMf8	0,60	3,62	фикс.	9,60	2	100,00							Нет		11.08.2020		20.06.2025	B+ / / *	XS2215497830
BCS06/25-9	0,60	3,63	фикс.	9,50	2	92,00							Нет		04.08.2020		30.06.2025	B+ / / *	XS2212035690
BCSALORPT2	0,10		фикс.		1	100,00							Нет		09.10.2020		20.11.2023	B+ / / *	XS2242762651
BCSGM PG3	0,60		изм. шаг	4,00	2	100,00							Нет		08.09.2020		01.10.2025	B+ / / *	XS2228213471
BCSGM PG4	0,60	3,39	изм. шаг	4,00	2	101,50							Нет		15.10.2020		10.11.2025	B+ / / *	XS2243038663
iСЛТ001Р03	1,35	1,80	фикс.	11,00	4	107,70	107,44	7,04	7,18	175	0,112	0,3	Нет		23.04.2020		19.01.2023		RU000A101LV5
iСЛТ001Р04	4,95	2,38	фикс.	8,90	4	103,38	103,43	7,69	7,68	225	16,66	9,3	Нет		23.10.2020		23.12.2023		RU000A1029T9
АйДиЭф03	0,70	2,35	фикс.	12,50		100,19	100,07	13,15	13,20	777	6,629	3,9	Нет		17.11.2020		02.11.2023		RU000A102CZ3
АйДиЭфБ01	0,30	0,34	фикс.	15,00	4	101,64	101,87	10,42	9,69	426	0,232	0,4	Нет		23.05.2019		19.05.2022		RU000A100CT0
АйДиЭфБ02	0,50	0,16	фикс.	13,00		100,29	100,03	11,69	13,57	814	11,25	2,5	Нет		18.03.2020	13.03.2021	15.03.2023		RU000A101JF2
АккордФ 01	0,40		фикс.	10,00	2								Нет		17.02.2020		12.02.2024		RU000A101F11
АрчерФин01	5,90	0,89	фикс.	9,25	2	9,00	9,00						Нет		08.04.2014	25.03.2022	29.03.2022		RU000A0JUJW8
БизнКонс 1	3,00		фикс.	6,00	2	90,99							Нет		26.12.2014		06.12.2030		RU000A0JV3T7
БКЗФин 01	5,00	6,72	фикс.	6,00	2	99,99	99,99						Нет		26.12.2014		06.12.2030		RU000A0JV3U5
БрайтФ БП1	0,22	0,19	плав.	9,25	4	100,00	100,00	9,54	9,54	411		0,1	Нет		28.03.2019	25.03.2021	01.04.2029		RU000A100725
БЭЛТИ БОП2	0,30	1,90	фикс.	12,50		101,58	101,13	12,31	12,57	714	0,754	0,5	Нет		17.09.2019		21.08.2024		RU000A100TT4
БЭЛТИ БОП3	0,20	2,67	фикс.	12,00		100,24	100,21	12,58	12,59	716	0,984	9,7	Нет		10.12.2020		14.11.2025		RU000A102GC3

ВИС Ф БП01	2,50	2,42	фикс.	9,00	4	100,25	100,25	9,20	9,20	377	17,43	14,2	Нет		20.10.2020	17.10.2023	12.10.2027		RU000A102952
ВолгСпорт1	1,40	0,53	инфл. плав	5,77	1	100,00		5,70		27			Нет		04.04.2011		04.04.2022		RU000A0JRJC6
ВолгСпорт2	1,90		плав.	9,00	1	100,00		8,85		342			Нет		30.10.2012		29.02.2024		RU000A0JT593
ВСК 01Р-01	4,00	0,22	фикс.	10,35	2	103,68	103,68	-5,72	-5,72	-1115			Да	—	11.04.2017		05.04.2022	/ / BB	RU000A0JXNB8
ГЕНЕТИКБ01	0,15	2,95	фикс.	14,00	4	108,23	107,95	11,72	11,81	638	0,171	0,4	Нет		29.06.2020		23.06.2025		RU000A101UL7
ДДёнерБОП1	0,06	0,39	фикс.			103,19	102,81	5,97	6,99	156	0,360		Нет		25.05.2018		08.07.2021		RU000A0ZZ7R8
ДДёнерБОП2	0,05	1,99	фикс.	13,50		111,01	111,77	8,50	8,12	269	0,358		Нет		11.03.2020		25.04.2023		RU000A101HQ3
ДерПлат1Р1	0,50	0,09	фикс.		2	100,00	100,00	8,02	8,02	259			Нет		21.02.2018		15.02.2023		RU000A0ZYU54
ДерПлат1Р2	0,25	0,35	фикс.		2	100,00		8,11		268		240,5	Нет		03.10.2018		18.05.2023		RU000A0ZZNL8
ДерПлат1Р3	0,25	0,35	фикс.		2	100,02	100,02	12,18	12,18	675			Нет		07.11.2018		18.05.2023		RU000A0ZZS73
ДФФ 1Р-01	10,00	1,82	фикс.	8,10	2	102,37	102,36	6,88	6,88	145	15,79	6,3	Нет		26.12.2017		20.12.2022		RU000A0ZYM21
ДФФ БО1Р-2	5,00	1,38	фикс.	8,65	4	102,20	102,28	7,23	7,17	174	10,71	1,9	Нет		04.07.2019		30.06.2022		RU000A100J18
ЖКХРСЯ БО1	3,00	1,40	фикс.	12,50	4	106,12	106,22	8,50	8,42	299	2,197	4,9	Нет		06.08.2019	26.07.2022	28.07.2026		RU000A100PB0
ЗавдКЭС1Р1	0,15	1,72	фикс.		4	103,71	103,81	12,35	12,28	685	0,297	0,4	Нет		24.12.2019		20.12.2022		RU000A1018L9
ИНВЕКТОР 2			фикс.	7,00	1	94,20		11,26		583			Нет		31.07.2014		30.07.2019		RU000A0JURT7
КарМаниБ03	0,21	1,14	фикс.	15,00		105,23	104,88	11,39	11,30	587	1,574	1,3	Нет		04.12.2019		24.12.2022		RU000A1014P9
КарМаниБ1	0,30	0,25	фикс.	17,00		104,23	103,90	-1,31	0,18	-525	0,549	0,6	Нет		21.09.2017		25.10.2022		RU000A0ZYAQ7
КарМаниБ2	0,30	1,25	фикс.			104,60	104,40	11,46	11,63	620	1,016	1,1	Нет		06.04.2018		10.05.2023		RU000A0ZZ1F6
КИВИФ 1Р01	5,00	2,47	фикс.	8,40	4	100,99	100,74	8,31	8,34	291	30,62	26,3	Нет		13.10.2020		10.10.2023		RU000A1028C7
КИСТФ БОП1	0,04	1,26	фикс.			105,69	105,46	11,07	11,26	583	0,190		Нет		18.06.2019		02.06.2022		RU000A100FZ0
КРАУС Б1Р1	1,00		фикс.	10,00	2								Нет		22.12.2016		10.12.2026		RU000A0JX2L4
КТЖФинанс1	15,00	1,33	фикс.	8,75	2	104,00	104,01	5,79	5,79	36	31,39	13,9	Нет		13.06.2017		07.06.2022	/ Baa3 /	RU000A0JXS34
Кузина1Р01	0,06	0,58	фикс.	15,00		103,34	103,34	9,34	9,62	419	0,362		Нет		16.09.2019	05.09.2021	26.08.2023		RU000A100TL1
ЛамбумБП01	0,12	0,46	фикс.	13,50		103,49	103,42	6,14	6,29	86	0,155		Нет		17.07.2019	06.07.2021	20.06.2024		RU000A100LE3
ЛевенгукБ1	0,10	0,13	фикс.	15,00	4	101,85	101,39		3,67		0,147	0,3	Нет		04.12.2017	22.02.2021	22.11.2027		RU000A0ZYHW0
МиратФБО-6	5,00	0,27	фикс.	9,20	2	101,33	100,68	4,17	6,64	121		0,2	Нет		29.04.2016		23.04.2021	/ / WD	RU000A0JWF22
МиратФБО-7	5,00		фикс.	11,00	2								Нет		30.08.2016		24.08.2021		RU000A0JWRH8
ММЦБ П01-1	0,03	0,89	фикс.		4	102,22	102,79	9,79	8,87	344	0,097		Нет		25.01.2019		12.01.2029		RU000A1001T8
МОСМСП2 02	4,20		фикс.	6,75									Нет		12.12.2019		26.11.2033		RU000A1015Z5
МОСМСП3 01	2,33	7,11	фикс.	6,70		104,53	104,53	-75,31	-75,31	-8074		25,0	Нет		13.12.2019		26.11.2033		RU000A1016A6

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

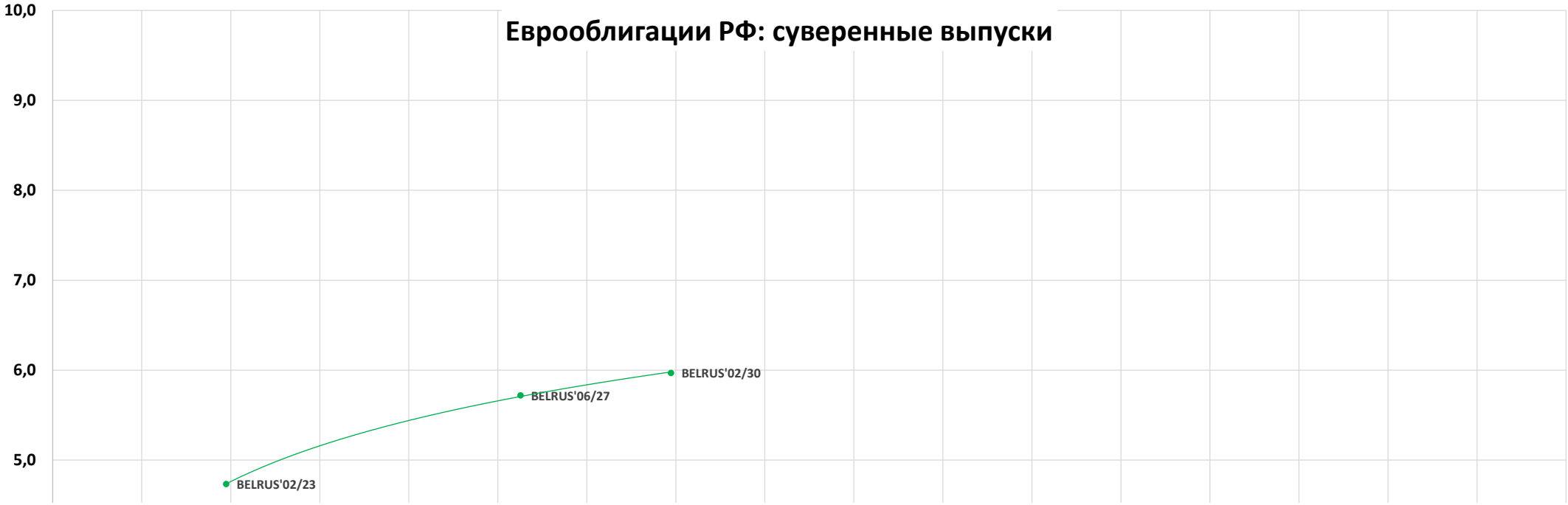
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
МОСМСП5 01	4,00	0,03	фикс.	5,85		100,00		5,94		51			Нет		03.11.2020		26.11.2034		RU000A102B71
МОСМСП6 01	6,20	0,03	фикс.	5,83		100,10		2,54		-289		2,9	Нет		15.10.2020		26.05.2033		RU000A1028R5
НПФ 01	0,08		фикс.	5,00	1								Нет		07.05.2009		06.05.2029		RU000A0JQ5C5
НХП БО-П01	0,07	0,53	фикс.	12,50		105,09	105,09	3,07	3,07	-236			Нет		06.08.2020		16.07.2024		RU000A102036
ОАЭ БО-П3	0,35	2,19	фикс.	13,75		107,00	106,96	11,15	11,17	574	1,042	1,7	Нет		20.05.2019		22.05.2024		RU000A100CG7
ОбКонФ БО1	1,70		фикс.	8,00	2	100,23		6,96		153			Нет		15.04.2013	05.04.2021	03.04.2023	/ / B	RU000A0JTV50
ПКБ 1Р-01	0,75	1,71	фикс.	13,00	4	103,52	103,28	11,41	11,56	613	6,199	2,9	Нет		13.08.2020		10.08.2023	B- / / *	RU000A1020S0
ПКБ БО-01	0,54	0,30	фикс.	15,00	4	102,25	102,07	10,79	11,10	567	1,736	4,0	Нет		21.10.2016		15.10.2021	B- / / *	RU000A0JWWG0
ПрГарант 2			фикс.	7,00	1	94,30		11,18		575			Нет		31.07.2014		30.07.2019		RU000A0JURP5
Промкап 02			фикс.	7,00	1	93,10		12,12		669			Нет		31.07.2014		30.07.2019		RU000A0JURQ3
РедСофт1Р2		0,32	фикс.	13,50	4	102,27	102,13	6,49	6,94	151	0,334	0,2	Нет		15.01.2019		12.01.2021		RU000A1000V6
РедСофт2Р1	0,10	2,12	фикс.	12,50	4	106,96	106,70	9,57	9,70	427	0,257	0,3	Нет		18.06.2020		15.06.2023		RU000A101TE4
РенСтр1Р1	3,00	0,71	фикс.	9,00	2	101,01	101,01	7,66	7,66	223	29,31	4,0	Нет		11.10.2019	08.10.2021	07.10.2022		RU000A100X69
РОСНАНО2Р5	5,50	2,68	фикс.	6,75	2	100,80	100,80	6,55	6,55	112	18,29		Нет		15.12.2020		12.12.2023	NR / / BBB*	RU000A102HB3
РОССИУМ 01	10,00	0,17	фикс.	6,25	2	100,05		6,00		57			Нет		28.09.2015		15.09.2025	B- / / *	RU000A0JVT43
РОССИУМ Б1	20,00	4,82	фикс.		2	100,02		6,32		89			Нет		27.11.2015		14.11.2025	B- / / *	RU000A0JVZA8
РОССИУМ1Р1	25,00		фикс.		2								Нет		12.07.2018		30.12.2027	B- / / *	RU000A0ZZCX6
РОССИУМ1Р2	10,00		плав.	6,25	2								Нет		26.12.2018	20.12.2023	13.12.2028	B- / / *	RU000A0ZZZY5
РОССИУМ1Р3	15,00		плав.	6,25	2								Нет		24.12.2019		11.12.2029	B- / / *	RU000A1018N5
РОССИУМ2Р1	20,00	0,09	плав.	6,00	2	100,02		5,78		35		0,1	Нет		17.08.2020	11.08.2025	05.08.2030	B- / / *	RU000A102192

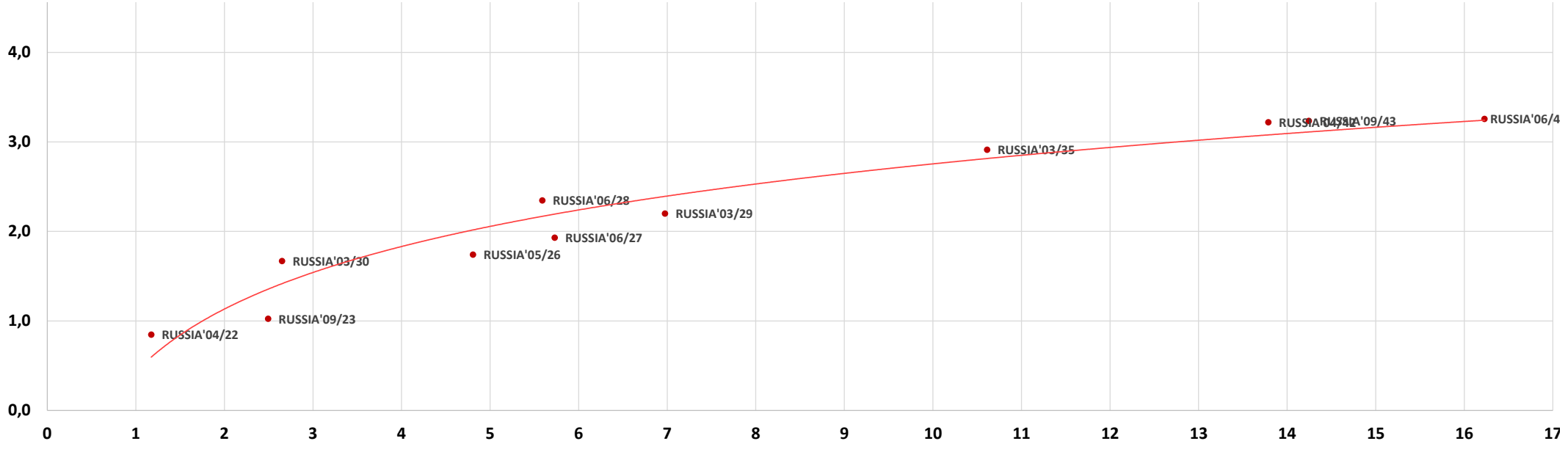
РОССИУМ2Р2	20,00	0,09	плав.	6,00	2	100,02		5,78		35		0,1	Нет		17.08.2020		05.08.2030	B- / / *	RU000A1021A6
РОССИУМ2Р3	10,00		плав.	6,00	2								Нет		16.12.2020		04.12.2030	B- / / *	RU000A102HX7
РСБ ХМАО01	1,10		плав.	5,75	1								Нет		19.12.2018		17.06.2031		RU000A0ZZYS0
РСГ-ФинБ09	2,00		фикс.	12,00	2	108,00		6,66		123			Нет		15.08.2019	04.08.2022	08.08.2024	NR / / *	RU000A100PS4
РуСол клА	4,62	0,09	фикс.	9,09	4	102,10		-14,10		-1953		0,5	Нет		12.02.2020		15.02.2031		RU000A101DA6
РуСол клБ	0,86	0,09	фикс.	13,09	4	104,00		-27,73		-3316		1,6	Нет		12.02.2020		15.02.2031		RU000A101DB4
РуСол клВ	0,10		фикс.		4								Нет		12.02.2020		15.02.2031		RU000A101D96
СветофорП2	0,20	2,87	фикс.	12,00	4	102,55	102,31	11,58	11,67	624	1,262	0,7	Нет		13.08.2020		07.08.2025		RU000A1020W2
С-ИнновБП1		0,45	фикс.		4	102,40	102,40	9,35	9,35	392	0,382	0,4	Нет		03.07.2019		30.06.2021		RU000A100HW3
СИНХФБО1Р1	20,00	1,41	фикс.	8,90	2	103,78	103,84	6,26	6,22	79	3,389	130,3	Нет		11.07.2017		05.07.2022	/ / BBB-	RU000A0JXVE5
СМАК БП01	0,05	2,32	фикс.	13,00		103,99	104,72	11,91	11,57	614	0,052		Нет		23.12.2020		02.12.2024		RU000A102KP7
СНХТ БО-01	0,30	2,49	фикс.	13,50		103,42	103,36	12,83	12,86	743	1,731	1,2	Нет		14.10.2020		27.03.2024		RU000A1028H6
СОПФ ФПФ 1	10,00	4,86	фикс.	6,84	4	101,48	101,44	6,70	6,71	128	0,054		Нет		25.12.2019		25.12.2026		RU000A1018M7
Соц.разв01	3,00		фикс.	10,21	4								Нет		30.06.2020		08.01.2027		RU000A101UU8
Соц.разв02	1,68	2,75	фикс.	16,31	4	116,00		11,00		557			Нет		30.06.2020		08.01.2027		RU000A101UW4
СтруктИнв1	10,00	2,63	фикс.	0,01		66,74		16,67		1124			Нет		03.06.2016		01.09.2023	BB+p / /	RU000A0JWJQ6
СФО БКС 01	0,60		фикс.	0,00		101,00							Нет		18.12.2019		05.12.2029		RU000A101715
СФО СБ 01	1,00		бескуп.			103,00							Нет		10.02.2020		09.12.2024		RU000A101CJ9
СФО СФИ 02	1,00		плав.	8,75	4								Нет		18.08.2020		18.08.2023		RU000A1021E8
СФОВТБИП02	5,00		фикс.	0,01		97,00						0,1	Нет		15.09.2020		13.11.2023		RU000A1024A0
СФОВТБИП03	3,00		фикс.	0,01		101,59	101,60				1,117	0,2	Нет		04.08.2020		10.03.2023		RU000A101ZJ0
ТМэнерго 1	6,00		фикс.	6,00	2	89,00							Нет		04.09.2014		14.02.2030		RU000A0JUTC9
ТрансмхПБ3	5,00	1,18	фикс.	8,60	2	104,35		4,99		-44			Да	10	17.04.2019		13.04.2022	/ / BB*	RU000A1009M6
ТрансмхПБ4	10,00	3,49	фикс.	6,95	2	103,00	102,98	6,17	6,17	74		0,4	Да	10	23.12.2019		16.12.2024	/ / BB*	RU000A1018C8
ТрансмхПБ5	10,00	2,21	фикс.	6,10	2	100,40	100,42	6,00	5,99	56	0,194	28,4	Да	10	27.05.2020	24.05.2023	21.05.2025	/ / BB*	RU000A101PU8
ТРИНФ Х Б1	1,00	2,72	фикс.	10,00	2	100,10		10,20		477			Нет		27.03.2019	14.02.2021	20.03.2024		RU000A100790
УпрОтход01	2,80	3,30	фикс.		1	98,90		7,97		254			Нет		07.11.2013		07.05.2024		RU000A0JU9K4
УпрОтход02	0,71	2,38	инфл. фикс		1	98,50		7,68		225			Нет		01.12.2014		01.06.2025		RU000A0JV0T3

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон			Цена		Дох-ть		G-спред	Ликвидность				Даты			Рейтинг (S/M/F)	ISIN
			Тип	Ставка	Период.	Закр.	WAP	Закр.	WAP		1D	1М средн	РЕПО	Диск.	Разм.	Оферта	Погаш.		
УпрОтходБ1	1,85		фикс.	4,00	1								Нет		01.06.2016		29.04.2027		RU000A0JWJF9
УпрОтходБ2	1,75		фикс.		1								Нет		12.04.2018		09.10.2030		RU000A0ZZ2W9
УпрОтходНН	1,15		плав.	6,80	2	100,00		6,25		82			Нет		27.06.2012		15.06.2022		RU000A0JS9X1
Финстоун01			фикс.	9,25	2	67,50							Нет		16.01.2014		10.01.2019		RU000A0JUDX9
ФКОНС П02	14,00		фикс.		4								Нет		13.02.2018		01.02.2028		RU000A0ZYSE5
ЭБИС Б1Р01	0,15	0,21	фикс.	15,00	4	102,16	102,13	4,80	4	-98	0,315	0,4	Нет		01.10.2019	30.03.2021	27.09.2022		RU000A100VY0
ЭНИКА 1Р01	0,05	0,53	фикс.	15,00	4	102,14	102,15	11,41	11	596		0,3	Нет		06.08.2020	05.08.2021	31.07.2025		RU000A102028
ЭТС 1Р01	0,25	1,12	фикс.	12,00	4	104,91	104,70	7,83	8	259	0,160	0,2	Нет		11.12.2019		07.12.2022		RU000A1015S0
ЭТС 1Р02	0,50	1,57	фикс.	12,00	4	105,51	105,93	8,78	9	307	0,388	1,2	Нет		22.06.2020		19.06.2023		RU000A101TR6
ЭТС 1Р03	0,25	1,61	фикс.	12,00	4	106,00		8,55		312		0,3	Нет		07.07.2020		04.07.2023		RU000A101VR2
ЮАИЗ 1-001	0,25	0,95	фикс.	10,25	4	102,00	101,93	8,42	9	307			Нет		23.01.2019	12.01.2022	22.01.2024		RU000A1001L5


Еврооблигации РФ: суверенные выпуски
10,0
9,0
8,0
7,0
6,0
5,0
BELRUS'02/23
BELRUS'06/27
BELRUS'02/30



Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

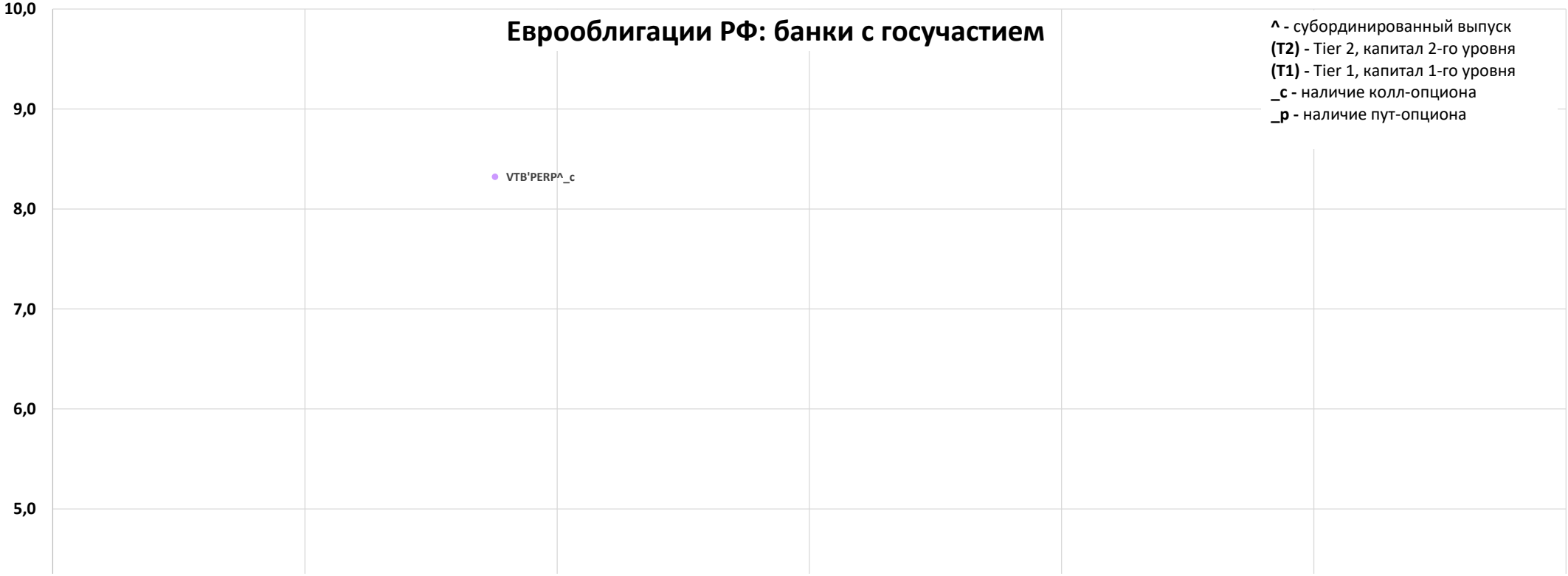
РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
BELRUS 6.2 02/28/30	0,60	6,95	6,20	101,39	101,80	101,59	6,00	5,94	5,97	502		SR UNSECURED	28.02.2018	28.02.2021		28.02.2030	B / B3u / B	XS1760804184
BELRUS 6 7/8 02/28/23	0,80	1,95	6,88	104,02	104,45	104,24	4,84	4,63	4,73	452		SR UNSECURED	29.06.2017	28.02.2021		28.02.2023	B / B3u / B	XS1634369067
BELRUS 7 5/8 06/29/27	0,60	5,26	7,63	109,80	110,47	110,13	5,78	5,66	5,72	504		SR UNSECURED	29.06.2017	29.06.2021		29.06.2027	B / B3u / B	XS1634369224
RUSSIA 12 3/4 06/24/28	2,50	5,59	12,75	170,31	170,77	170,54	2,37	2,32	2,35	158		SR UNSECURED	24.06.1998	24.06.2021		24.06.2028	BBB- / Baa3 / BBB	XS0088543193
RUSSIA 4 1/2 04/04/22	2,00	1,17	4,50	104,25	104,49	104,37	0,95	0,75	0,85	65		SR UNSECURED	04.04.2012	04.04.2021		04.04.2022	BBB- / Baa3 / BBB	XS0767472458
RUSSIA 4 1/4 06/23/27	2,40	5,73	4,25	113,89	114,00	113,94	1,94	1,92	1,93	122		SR UNSECURED	23.06.2017	23.06.2021		23.06.2027	/ / BBB	RU000A0JXTS9
RUSSIA 4 3/4 05/27/26	3,00	4,81	4,75	115,17	115,44	115,31	1,77	1,72	1,74	118		SR UNSECURED	27.05.2016	27.05.2021		27.05.2026	/ / BBB	RU000A0JWHA4
RUSSIA 4 3/8 03/21/29	3,00	6,98	4,38	116,14	116,22	116,18	2,21	2,19	2,20	130		SR UNSECURED	21.03.2018	21.03.2021		21.03.2029	/ / BBB	RU000A0ZYYN4
RUSSIA 4 7/8 09/16/23	3,00	2,49	4,88	110,00	110,12	110,06	1,04	1,00	1,02	77		SR UNSECURED	16.09.2013	16.03.2021		16.09.2023	BBB- / Baa3 / BBB	XS0971721450
RUSSIA 5 1/4 06/23/47	7,00	16,23	5,25	134,97	135,29	135,13	3,26	3,25	3,26	177		SR UNSECURED	23.06.2017	23.06.2021		23.06.2047	/ / BBB	RU000A0JXU14
RUSSIA 5 5/8 04/04/42	3,00	13,79	5,63	136,59	136,91	136,75	3,23	3,21	3,22	179		SR UNSECURED	04.04.2012	04.04.2021		04.04.2042	BBB- / Baa3 / BBB	XS0767473852
RUSSIA 5 7/8 09/16/43	1,50	14,25	5,88	141,98	142,34	142,16	3,24	3,23	3,23	179		SR UNSECURED	16.09.2013	16.03.2021		16.09.2043	BBB- / Baa3 / BBB	XS0971721963
RUSSIA 5.1 03/28/35	4,00	10,61	5,10	125,20	125,35	125,28	2,92	2,91	2,91	164		SR UNSECURED	28.03.2019	28.03.2021		28.03.2035	/ / BBB	RU000A1006S9
RUSSIA 7 1/2 03/31/30	2,26	2,65	7,50	115,59	115,82	115,70	1,71	1,63	1,67	-85		SR UNSECURED	25.08.2000	31.03.2021		31.03.2030	BBB- / Baa3 / BBB	XS0114288789

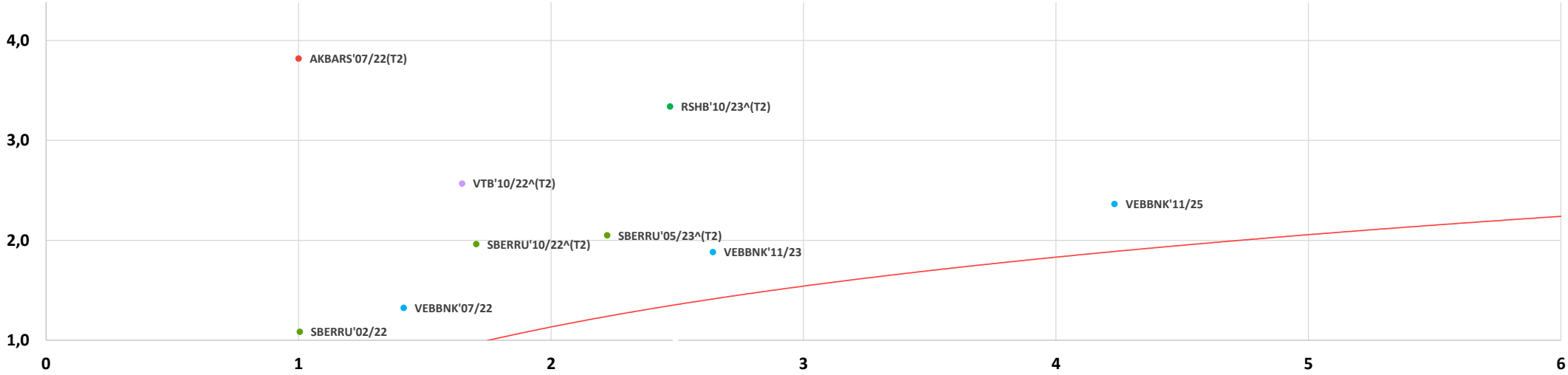
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

Еврооблигации РФ: банки с госучастием



^ - субординированный выпуск
(T2) - Tier 2, капитал 2-го уровня
(T1) - Tier 1, капитал 1-го уровня
_c - наличие колл-опциона
_p - наличие пут-опциона



Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
AKBARS'07/22(T2)	0,60	1,43	8,00	105,59	106,33	105,96	4,07	3,57	3,82	362		UNSECURED	13.07.2012	13.07.2021		13.07.2022	/ / WD	XS0805131439
RSHB'10/23^(T2)	0,50	2,47	8,50	113,2	113,6	113,4	3,40	3,28	3,34	308		SUBORDINATED	16.10.2013	16.04.2021		16.10.2023	/ NR /	XS0979891925
SBERRU'02/22	1,50	1,00	6,13	105,18	105,28	105,23	1,13	1,04	1,08	89		SR UNSECURED	07.02.2012	07.02.2021		07.02.2022	/ Baa3 / BBB	XS0743596040
SBERRU'05/23^(T2)	1,00	2,22	5,25	107,14	107,41	107,28	2,11	1,99	2,05	182		SUBORDINATED	23.05.2013	23.05.2021		23.05.2023	/ / BBB-	XS0935311240
SBERRU'06/21	1,00	0,41	5,72	102,0	102,1	102,1	0,70	0,53	0,61	41		SR UNSECURED	16.06.2011	16.06.2021		16.06.2021	/ Baa3 / BBB	XS0638572973
SBERRU'10/22^(T2)	2,00	1,70	5,13	105,37	105,61	105,49	2,03	1,90	1,96	176		SUBORDINATED	29.10.2012	29.04.2021		29.10.2022	/ Ba1 / BBB-	XS0848530977
VEBBNK'07/22	1,00	1,42	6,03	106,7	106,8	106,8	1,37	1,28	1,33	113		SR UNSECURED	05.07.2012	05.07.2021		05.07.2022	BBB- / / BBB	XS0800817073
VEBBNK'11/23	1,15	2,64	5,94	111,09	111,22	111,16	1,91	1,86	1,88	162		SR UNSECURED	21.11.2013	21.05.2021		21.11.2023	BBB- / / BBB	XS0993162683
VEBBNK'11/25	1,00	4,23	6,80	120,1	120,3	120,2	2,38	2,35	2,36	187		SR UNSECURED	22.11.2010	22.05.2021		22.11.2025	BBB- / / BBB	XS0559915961
VTB'06/35	0,02	9,95	6,25	110,0	111,4	110,7	5,25	5,13	5,19	395		SR UNSECURED	30.06.2005	30.06.2021		30.06.2035	BBB- / Baa3 / WD	XS0223715920
VTB'1//RP_c	2,25	1,75	9,50	111,12	111,31	111,22	8,33	8,32	8,32	308		JR SUBORDINATED	06.08.2012	06.06.2021	06.12.2022 (к)		/ NR /	XS0810596832
VTB'10/22^(T2)	1,41	1,65	6,95	107,3	107,5	107,4	3	2,49	2,57	237		SUBORDINATED	17.10.2012	17.04.2021		17.10.2022	B- / Ba2 / WD	XS0842078536

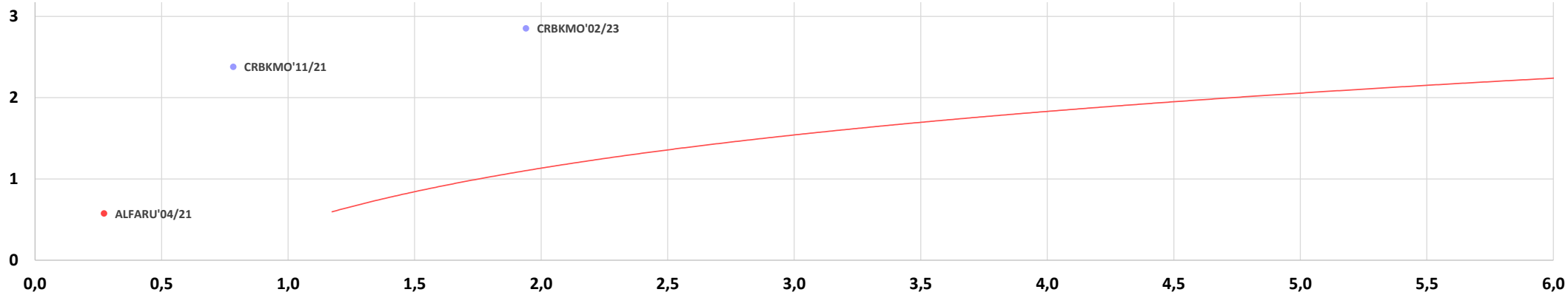
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Еврооблигации РФ: частные банки





Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

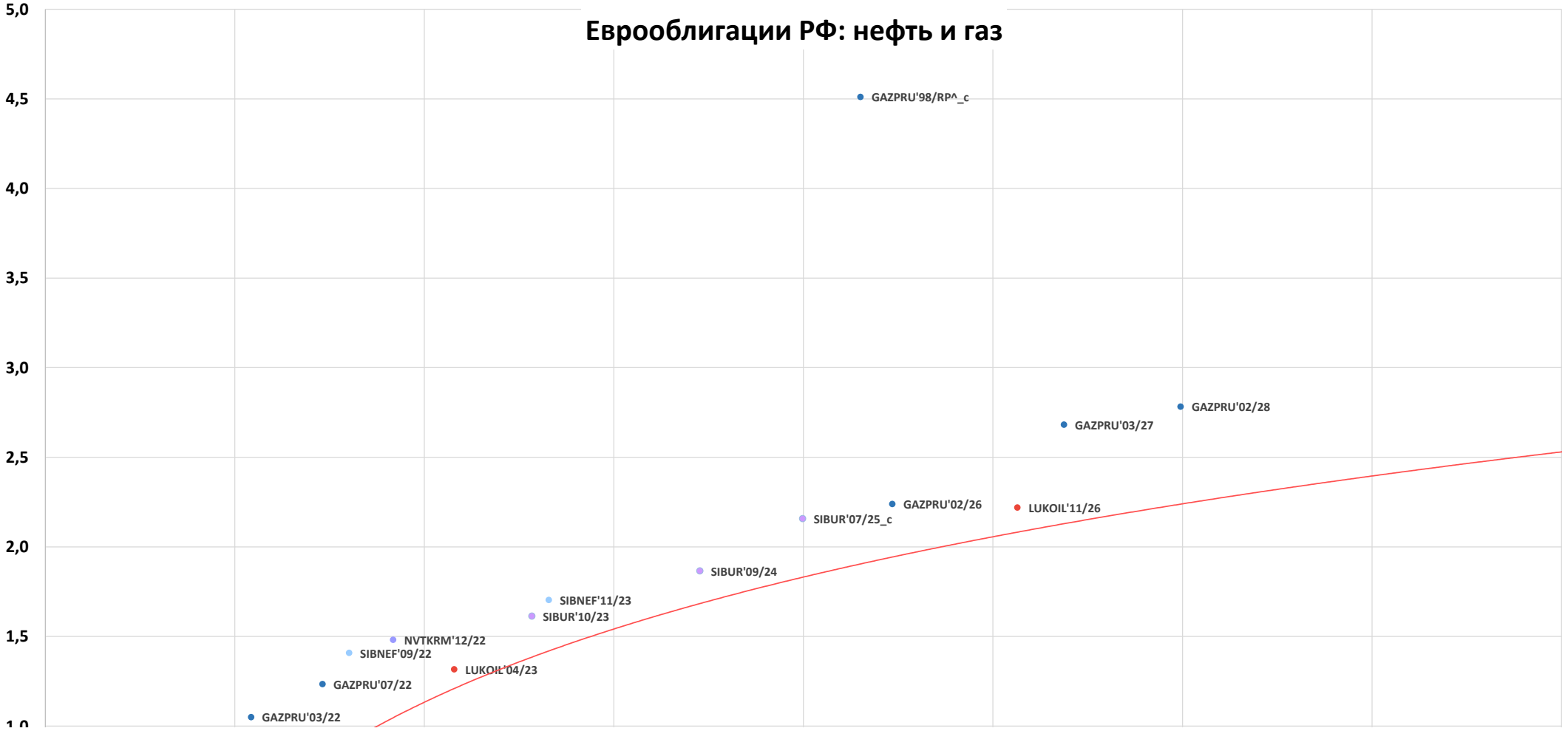
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	Z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
AKBHC'PERP^_c	0,30	1,54	9,25	105,50	106,36	105,93	7,79	7,73	7,76	527		SUBORDINATED	15.06.2017	15.03.2021	15.09.2022 (к)		/ / B-	XS1631338495
ALFARU'PERP^_c	0,50	2,10	6,95	104,0	104,3	104,2	5,06	5,05	5,05	477		SUBORDINATED	30.01.2018	30.01.2021	30.04.2023 (к)		/ B2 / B	XS1760786340
ALFARU'04/21	1,00	0,27	7,75	101,89	102,01	101,95	0,79	0,36	0,58	34		SR UNSECURED	28.04.2011	28.04.2021		28.04.2021	BB+ / Ba1 / BB+	XS0620695204
ALFARU'04/30^(T2)_c	0,85	3,77	5,95	105,25	105,48	105,36	4,79	4,76	4,78	413		SUBORDINATED	15.10.2019	15.04.2021	15.04.2025 (к)	15.04.2030	/ B1u / BB-	XS2063279959
ALFARU'PERP^_c	0,70	0,99	8,00	103,4	103,8	103,6	6,85	6,83	6,84	423		SUBORDINATED	03.11.2016	03.02.2021	03.02.2022 (к)		/ B2u / B	XS1513741311
CRBKMO'01/25	0,58	3,64	4,70	102,90	103,54	103,22	3,91	3,74	3,83	344		SR UNSECURED	29.01.2020	29.01.2021		29.01.2025	BB- / / BB	XS2099763075
CRBKMO'06/24	0,34	3,11	7,12	110,8	111,5	111,1	3,75	3,53	3,64	332		SR UNSECURED	25.03.2019	25.06.2021		25.06.2024	BB- / / BB	XS1964558339
CRBKMO'10/27^(T2)_c	0,44	1,60	7,50	99,95	100,29	100,12	6,42	6,35	6,39	721		SUBORDINATED	05.04.2017	05.04.2021	05.10.2022 (к)	05.10.2027	/ / B+	XS1589106910
CRBKMO'11/21	0,21	0,78	5,88	102,50	102,98	102,74	2,68	2,08	2,38	218		SR UNSECURED	07.11.2016	07.05.2021		07.11.2021	BB- / / BB	XS1510534677
CRBKMO'PERP^_c	0,54	1,66	8,88	97,1	98,0	97,5	7,89	7,82	7,86	1020		JR SUBORDINATED	10.05.2017	10.02.2021	10.11.2022 (к)		/ Caa2u / B-	XS1601094755
SOVCOM'04/30^(T2)_c	0,30	3,61	8,00	107,45	108,24	107,85	6,40	6,29	6,35	546		SUBORDINATED	07.10.2019	07.04.2021	07.04.2025 (к)	07.04.2030	/ / BB-	XS2010043656
TRACAP' 1/RP^(T2)(T2)	0,06	6,66	0,00	64,0	65,9	64,9	15,62	15,18	15,40	1435		SUBORDINATED	18.07.2007	18.03.2021			/ WR /	XS0311369978

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Еврооблигации РФ: нефть и газ





Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

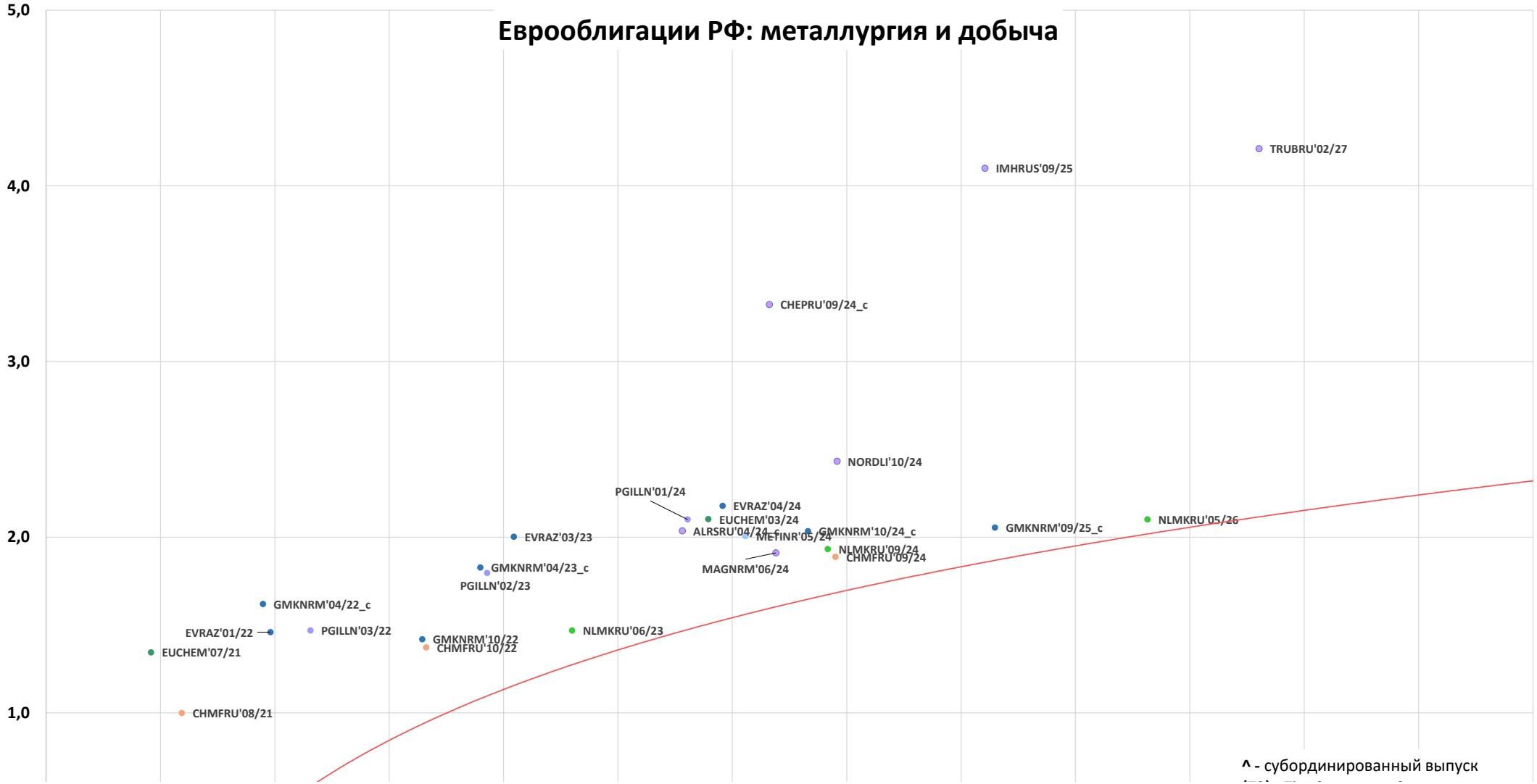
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
GAZPRU'01/21	0,60	0,01	6,00	100,1	100,2	100,1	-1,28	-15,94	-8,62	-868		SR UNSECURED	23.11.2011	23.01.2021		23.01.2021	BBB- / Baa2 / BBB	XS0708813810
GAZPRU'02/26	1,25	4,47	5,15	113,70	114,00	113,85	2,27	2,21	2,24	171		SR UNSECURED	11.02.2019	11.02.2021		11.02.2026	BBB- / Baa2 / BBB	XS1951084471
GAZPRU'02/28	0,90	5,99	4,95	113,6	114,0	113,8	2,81	2,76	2,78	201		SR UNSECURED	06.02.2013	06.02.2021		06.02.2028	BBB- / Baa2 / BBB	XS0885736925
GAZPRU'03/22	1,30	1,09	6,51	106,01	106,23	106,12	1,14	0,96	1,05	85		SR UNSECURED	07.03.2007	07.03.2021		07.03.2022	BBB- / Baa2 / BBB	XS0290580595
GAZPRU'03/27	0,75	5,37	4,95	112,7	113,0	112,8	2,71	2,65	2,68	201		SR UNSECURED	23.03.2017	23.03.2021		23.03.2027	BBB- / Baa2 / BBB	XS1585190389
GAZPRU'04/34	1,20	9,08	8,63	153,33	153,75	153,54	3,55	3,52	3,54	236		SR UNSECURED	28.04.2004	28.04.2021		28.04.2034	BBB- / Baa2 / BBB	XS0191754729
GAZPRU'07/22	1,00	1,46	4,95	105,4	105,6	105,5	1,32	1,15	1,23	104		SR UNSECURED	19.07.2012	19.07.2021		19.07.2022	BBB- / Baa2 / BBB	XS0805570354
GAZPRU'08/37	1,25	10,82	7,29	144,03	144,47	144,25	3,71	3,68	3,69	239		SR UNSECURED	16.08.2007	16.02.2021		16.08.2037	BBB- / Baa2 / BBB	XS0316524130
GAZPRU'98/RP^_c	1,40	4,30	4,60	104,6	104,8	104,7	4,51	4,51	4,51	303		SUBORDINATED	26.10.2020	26.01.2021	26.10.2025 (к)		BB / / BB+	XS2243631095
LUKOIL'04/23	1,50	2,16	4,56	107,04	107,37	107,21	1,39	1,25	1,32	109		COMPANY GUARNT	24.04.2013	24.04.2021		24.04.2023	BBB / Baa2 / BBB+	XS0919504562
LUKOIL'06/22	0,50	1,33	6,66	107,8	108,1	107,9	0,96	0,76	0,86	66		COMPANY GUARNT	07.06.2007	07.06.2021		07.06.2022	BBB / Baa2 / BBB+	XS0304274599
LUKOIL'11/26	1,00	5,13	4,75	113,51	113,82	113,66	2,25	2,19	2,22	160		COMPANY GUARNT	02.11.2016	02.05.2021		02.11.2026	BBB / / BBB+	XS1514045886
NVTKRM'02/21	0,65	0,04	6,60	100,3	100,4	100,3	-1,25	-4,00	-2,63	-287		SR UNSECURED	03.02.2011	03.02.2021		03.02.2021	BBB / Baa2 / BBB	XS0588433267
NVTKRM'12/22	1,00	1,84	4,42	105,38	105,59	105,48	1,54	1,43	1,48	128		SR UNSECURED	13.12.2012	13.06.2021		13.12.2022	BBB / Baa2 / BBB	XS0864383723
ROSNRM'03/22	2,00	1,10	4,20	102,9	103,1	103,0	1,60	1,41	1,50	130		SR UNSECURED	06.12.2012	06.03.2021		06.03.2022	BBB- / Baa3 / WD	XS0861981180
SIBNEF'09/22	1,50	1,60	4,38	104,75	104,97	104,86	1,47	1,34	1,41	121		SR UNSECURED	19.09.2012	19.03.2021		19.09.2022	BBB- / Baa2 / BBB	XS0830192711
SIBNEF'11/23	1,50	2,66	6,00	111,8	112,0	111,9	1,73	1,67	1,70	144		SR UNSECURED	27.11.2013	27.05.2021		27.11.2023	BBB- / Baa2 / BBB	XS0997544860
SIBUR'07/25_c	0,50	4,00	2,95	103,17	103,54	103,36	2,20	2,11	2,16	169		COMPANY GUARNT	08.07.2020	08.07.2021	08.04.2025 (к)	08.07.2025	/ Baa3 / BBB-	XS2199713384
SIBUR'09/24	0,50	3,45	3,45	105,4	105,8	105,6	1,91	1,82	1,87	151		COMPANY GUARNT	23.09.2019	23.03.2021		23.09.2024	/ Baa3 / BBB-	XS2010044621
SIBUR'10/23	0,31	2,57	4,13	106,39	106,86	106,63	1,70	1,53	1,61	136		COMPANY GUARNT	05.10.2017	05.04.2021		05.10.2023	/ Baa3 / BBB-	XS1693971043
VOSTOK'05/23	0,40	1,15	7,50	84,5	87,5	86,0	16,73	14,98	15,84	2559		COMPANY GUARNT	03.05.2013	04.05.2021		04.05.2023	NR / / WD	XS0925043100

Департамент по работе на рынках капитала

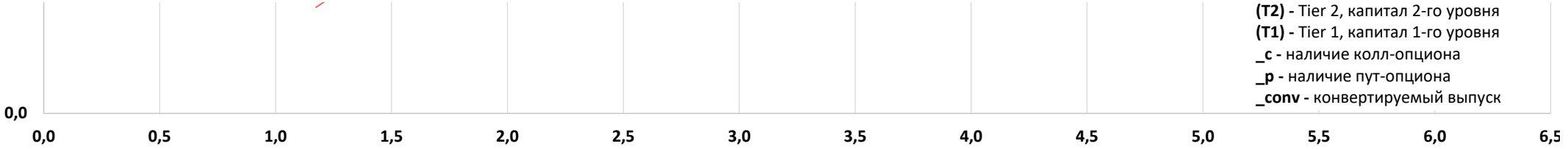
Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Еврооблигации РФ: металлургия и добыча



^ - субординированный выпуск



(T2) - Tier 2, капитал 2-го уровня
(T1) - Tier 1, капитал 1-го уровня
_c - наличие колл-опциона
_p - наличие пут-опциона
_conv - конвертируемый выпуск

15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
ALRSRU'04/24_c	0,50	2,78	4,65	107,9	108,3	108,1	2,09	1,98	2,04	156		COMPANY GUARNT	09.04.2019	09.04.2021	09.01.2024 (к)	09.04.2024	BBB- / / BBB-	XS1843441731
CHEPRU'09/24_c	0,30	3,16	4,50	103,78	104,26	104,02	3,39	3,26	3,32	293		SR UNSECURED	19.09.2019	19.03.2021	19.06.2024 (к)	19.09.2024	/ Ba3 / BB-	XS2010044548
CHMFRU'08/21	0,50	0,59	3,85	101,6	101,8	101,7	1,22	0,78	1,00	80		SR UNSECURED	27.02.2017	27.02.2021		27.08.2021	BBB- / / BBB	XS1567051443
CHMFRU'09/24	0,80	3,45	3,15	104,31	104,56	104,44	1,92	1,85	1,89	154		SR UNSECURED	16.09.2019	16.03.2021		16.09.2024	/ Baa2 / BBB	XS2046736919
CHMFRU'10/22	0,63	1,66	5,90	107,6	107,9	107,8	1,46	1,29	1,37	117		SR UNSECURED	17.10.2012	17.04.2021		17.10.2022	BBB- / Baa2 / BBB	XS0841671000
EUCHEM'03/24	0,70	2,90	5,50	110,14	110,44	110,29	2,15	2,06	2,10	181		COMPANY GUARNT	13.03.2019	13.03.2021		13.03.2024	/ Ba3 / BB	XS1961080501
EUCHEM'07/21	0,13	0,46	3,95	101,0	101,3	101,2	1,64	1,05	1,34	114		COMPANY GUARNT	05.07.2017	05.07.2021		05.07.2021	BB- / / BB	XS1632225154
EVRAZ'01/21	0,75	0,02	8,25	100,16	100,24	100,20	0,92	-2,23	-0,66	-90		SR UNSECURED	17.12.2015	28.01.2021		28.01.2021	BB+ / / BB+	XS1319822752
EVRAZ'01/22	0,50	0,98	6,75	105,3	105,4	105,4	1,52	1,40	1,46	126		SR UNSECURED	16.06.2016	31.01.2021		31.01.2022	BB+ / / BB+	XS1405775377
EVRAZ'03/23	0,75	2,04	5,38	106,97	107,26	107,11	2,07	1,94	2,00	178		SR UNSECURED	20.03.2017	20.03.2021		20.03.2023	BB+ / Ba2 / BB+	XS1533915721
EVRAZ'04/24	0,70	2,96	5,25	109,3	109,5	109,4	2,21	2,15	2,18	188		SR UNSECURED	02.04.2019	02.04.2021		02.04.2024	BB+ / Ba2 / BB+	XS1843443273
GMKNRM'04/22_c	0,50	0,95	3,85	102,49	102,86	102,67	1,77	1,47	1,62	87		SR UNSECURED	08.06.2017	08.04.2021	08.01.2022 (к)	08.04.2022	BBB- / / BBB-	XS1622146758
GMKNRM'04/23_c	1,00	1,90	4,10	104,8	105,1	104,9	1,90	1,76	1,83	135		SR UNSECURED	11.04.2017	11.04.2021	11.01.2023 (к)	11.04.2023	BBB- / / BBB-	XS1589324075
GMKNRM'09/25_c	0,50	4,15	2,55	102,02	102,35	102,18	2,09	2,02	2,05	158		SR UNSECURED	11.09.2020	11.03.2021	11.06.2025 (к)	11.09.2025	/ Baa2 / BBB-(EXP)	XS2134628069
GMKNRM'10/22	1,00	1,64	6,63	108,8	109,0	108,9	1,46	1,37	1,42	122		SR UNSECURED	14.10.2015	14.04.2021		14.10.2022	BBB- / Baa2 / BBB-	XS1298447019
GMKNRM'10/24_c	0,75	3,33	3,38	104,76	104,93	104,84	2,06	2,01	2,03	161		SR UNSECURED	28.10.2019	28.04.2021	28.07.2024 (к)	28.10.2024	BBB- / Baa2 / BBB-	XS2069992258
IMHRUS'09/25	0,35	4,10	5,90	107,3	107,9	107,6	4,18	4,03	4,10	363		COMPANY GUARNT	23.09.2020	23.03.2021		23.09.2025	/ B2 / B	XS2232013263
MAGNRM'06/24	0,50	3,19	4,38	107,87	108,27	108,07	1,97	1,85	1,91	159		COMPANY GUARNT	13.06.2019	13.06.2021		13.06.2024	/ Baa2 / BBB	XS1843434959
METINR'05/24	0,80	3,06	4,85	108,7	109,3	109,0	2,09	1,92	2,01	170		COMPANY GUARNT	02.05.2017	02.05.2021		02.05.2024	BB+ / Ba1 / BB+	XS1603335610
NLMKRU'05/26	0,50	4,81	4,70	113,00	113,23	113,11	2,12	2,08	2,10	153		SR UNSECURED	30.05.2019	31.05.2021		30.05.2026	/ Baa2 / BBB	XS1843435337
NLMKRU'06/23	0,70	2,30	4,50	106,9	107,4	107,1	1,56	1,37	1,47	123		SR UNSECURED	15.06.2016	15.06.2021		15.06.2023	BBB- / Baa2 / BBB	XS1405775617
NLMKRU'09/24	0,50	3,42	4,00	107,10	107,48	107,29	1,98	1,88	1,93	158		SR UNSECURED	21.09.2017	21.03.2021		21.09.2024	BBB- / / BBB	XS1577953174
NORDLI'10/24	0,40	3,46	4,13	105,8	106,2	106,0	2,49	2,38	2,43	208		COMPANY GUARNT	09.10.2019	09.04.2021		09.10.2024	/ Ba2 / BB	XS2060792236
PGILLN'01/24	0,47	2,80	4,70	107,36	107,80	107,58	2,17	2,03	2,10	182		COMPANY GUARNT	29.01.2018	29.01.2021		29.01.2024	BB+ / Ba1 / BB	XS1713474325
PGILLN'02/23	0,79	1,93	5,25	106,7	107,1	106,9	1,89	1,71	1,80	158		COMPANY GUARNT	07.02.2017	07.02.2021		07.02.2023	BB+ / Ba1 / BB	XS1533922933
PGILLN'03/22	0,48	1,16	4,70	103,62	103,97	103,79	1,61	1,33	1,47	127		COMPANY GUARNT	26.10.2016	28.03.2021		28.03.2022	BB+ / Ba1 / BB	XS1405766384
POGLN'11/22_c	0,50	1,48	8,13	104,7	105,6	105,1	5,39	4,84	5,12	448		COMPANY GUARNT	14.11.2017	14.05.2021	14.08.2022 (к)	14.11.2022	B- / / B *-	XS1711554102
TRUBRU'02/27	0,50	5,30	4,30	100,25	100,68	100,47	4,25	4,17	4,21	355		SR UNSECURED	12.02.2020	12.02.2021		12.02.2027	BB- / B1 /	XS2116222451

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков





Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

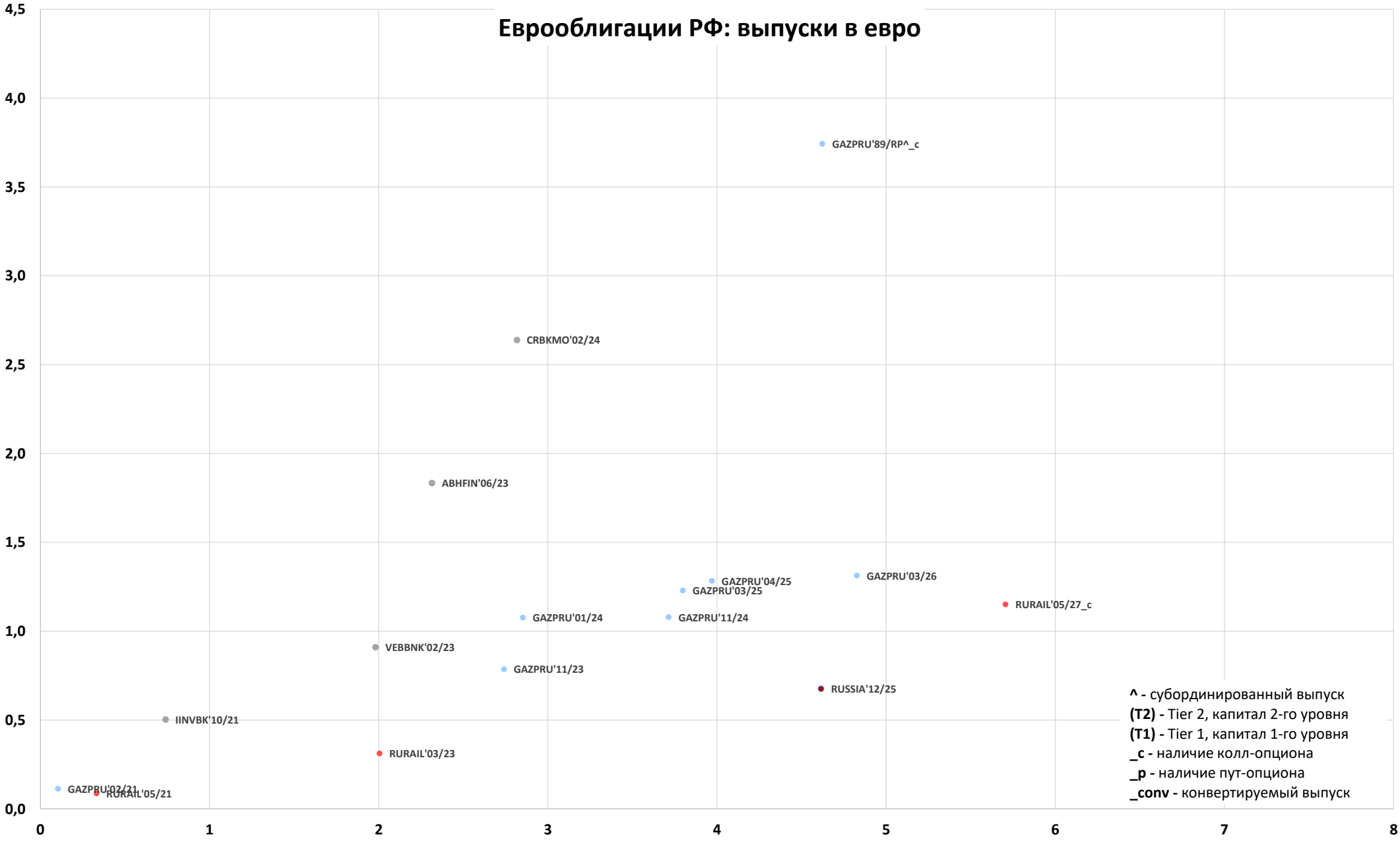
Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	Z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
BORFIN'04/22	0,16	1,17	6,50	102,09	103,20	102,65	4,70	3,77	4,23	403		COMPANY GUARNT	07.04.2017	07.04.2021		07.04.2022	BB- / Ba3 / BB-	XS1596115409
BORFIN'09/26	0,35	4,81	6,00	104,8	105,3	105,0	5,02	4,91	4,97	437		COMPANY GUARNT	17.09.2020	17.03.2021		17.09.2026	BB- / Ba3 / BB-	XS2230649225
BRCSTR'02/28_c_p	0,10	0,03	0,82	95,14	96,14	95,64	1,47	1,32	1,39	486		SR UNSECURED	01.02.2018	01.02.2021	01.02.2022 (п)0	01.02.2028	/ /	XS1764143597
EUCHEM'03/24	0,70	2,90	5,50	110,1	110,4	110,3	2,15	2,06	2,10	181		COMPANY GUARNT	13.03.2019	13.03.2021		13.03.2024	/ Ba3 / BB	XS1961080501
GLPRLI'01/22	0,20	0,97	6,87	104,54	105,01	104,78	2,32	1,86	2,09	189		COMPANY GUARNT	18.04.2016	25.01.2021		25.01.2022	/ Ba2 / BB+	XS1319813769
GTLKOA'02/28	0,50	6,06	4,80	104,5	104,9	104,7	4,06	4,00	4,03	325		COMPANY GUARNT	26.10.2020	26.02.2021		26.02.2028	/ Ba2 / BB+	XS2249778247
GTLKOA'03/27_c	0,60	5,15	4,65	104,01	104,54	104,28	3,91	3,81	3,86	320		COMPANY GUARNT	10.03.2020	10.03.2021	10.12.2026 (к)	10.03.2027	/ Ba2 / BB+	XS2131995958
GTLKOA'04/25	0,50	3,78	5,95	109,0	109,4	109,2	3,64	3,55	3,59	318		COMPANY GUARNT	17.04.2019	17.04.2021		17.04.2025	/ Ba2 / BB+	XS1713473608
GTLKOA'05/24	0,50	3,12	5,13	106,04	106,45	106,25	3,21	3,09	3,15	284		COMPANY GUARNT	31.05.2017	31.05.2021		31.05.2024	/ Ba2 / BB+	XS1577961516
GTLKOA'07/21	0,35	0,50	5,95	102,0	102,5	102,3	1,82	0,91	1,37	116		COMPANY GUARNT	19.07.2016	19.07.2021		19.07.2021	/ Ba2 / BB+	XS1449458915
HCDNDA'02/23	0,30	1,95	5,08	100,69	101,85	101,27	4,72	4,13	4,42	421		SR UNSECURED	15.02.2018	15.02.2021		15.02.2023	/ Ba1 / BB	XS1772800204
HCDNDA'11/21	0,35	0,79	5,88	100,5	101,4	101,0	5,20	4,06	4,63	443		SR UNSECURED	10.11.2016	11.05.2021		11.11.2021	NR / / BB	XS1516324321
MAILLI'10/25_conv	0,40	4,52	1,63	102,18	102,50	102,34	1,15	1,08	1,11	384		SR UNSECURED	01.10.2020	01.04.2021		01.10.2025	/ /	XS2239639433
MOBTEL'05/23	0,50	2,25	5,00	107,2	107,5	107,3	1,87	1,75	1,81	158		SR UNSECURED	30.05.2013	30.05.2021		30.05.2023	BBB- / Baa3u / BB+	XS0921331509
OPRORU'09/21	0,35	0,69	8,25	33,82	36,31	35,07	253,89	230,94	242,06	#N/A N/A		COMPANY GUARNT	27.09.2016	27.03.2021		27.09.2021	NR / C /	XS1495585355
POGLN'07/24_conv	0,09	3,24	8,25	322,5	323,7	323,1	-27,93	-28,03	-27,98	274		COMPANY GUARNT	03.07.2019	03.04.2021		03.07.2024	/ /	XS1843433555
PHORRU'01/25_c	0,50	3,53	3,05	104,24	104,44	104,34	1,95	1,90	1,92	149		SR UNSECURED	23.01.2020	23.01.2021	23.10.2024 (к)	23.01.2025	BBB- / Baa3 / BBB-	XS2099039542
PHORRU'04/23_c	0,50	1,94	3,95	104,7	105,1	104,9	1,83	1,66	1,75	128		SR UNSECURED	24.01.2018	24.04.2021	24.01.2023 (к)	24.04.2023	BBB- / Baa3 / BBB-	XS1752568144
PHORRU'11/21	0,35	0,78	3,95	102,24	102,48	102,36	1,09	0,78	0,93	74		SR UNSECURED	03.05.2017	03.05.2021		03.11.2021	BBB- / Baa3 / BBB-	XS1599428726
RENOTE'04/21	0,20	0,24	9,50	98,8	100,5	99,6	14,46	7,23	10,82	1073		SR UNSECURED	14.04.2016	14.04.2021		14.04.2021	B- / / WD	XS1391575245
RURAIL'03/24	0,32	2,91	4,38	108,77	109,25	109,01	1,48	1,33	1,41	112		SR UNSECURED	01.03.2017	01.03.2021		01.03.2024	/ Baa2 / BBB	XS1574068844
RURAIL'04/22	0,62	1,17	5,70	105,5	105,8	105,7	1,08	0,83	0,95	76		SR UNSECURED	05.04.2012	05.04.2021		05.04.2022	BBB- / Baa2 / BBB	XS0764220017
URKARM'10/24	0,50	3,50	4,00	104,22	104,55	104,39	2,81	2,72	2,76	240		SR UNSECURED	22.10.2019	22.04.2021		22.10.2024	/ Ba2 / BB-	XS2010040397
VIP'02/21	0,26	0,03	7,75	100,6	100,8	100,7	-10,93	-15,28	-13,10	-1297		SR UNSECURED	02.02.2011	02.02.2021		02.02.2021	BB+ / Ba2u / BBB-	XS0587031096
VIP'02/21	0,26	0,03	7,75	100,64	100,79	100,71	-10,93	-15,28	-13,10	-1297		SR UNSECURED	02.02.2011	02.02.2021		02.02.2021	BB+ / Ba2u / BBB-	XS0587031096
VIP'02/23	0,53	1,93	5,95	108,6	109,1	108,9	1,68	1,44	1,56	134		COMPANY GUARNT	13.02.2013	13.02.2021		13.02.2023	BB+ / Ba2u / BBB-	XS0889401724
VIP'03/22	0,42	1,06	7,50	106,95	107,19	107,07	1,20	1,00	1,10	90		COMPANY GUARNT	29.06.2011	01.03.2021		01.03.2022	BB+ / Ba2u / BBB-	XS0643183220
VIP'04/23_c	0,70	1,89	7,25	110,4	110,9	110,7	2,48	2,27	2,38	162		SR UNSECURED	26.04.2016	26.04.2021	26.01.2023 (к)	26.04.2023	BB+ / Ba2u / BBB-	XS1400710726
VIP'04/25_c	1,00	3,68	4,00	105,88	106,34	106,11	2,52	2,41	2,47	199		SR UNSECURED	09.10.2019	09.04.2021	09.01.2025 (к)	09.04.2025	BB+ / / BBB-	XS2058691663
YNDX'03/25_conv	1,25	4,06	0,75	129,45	130,04	129,75	-5,52	-5,63	-5,57	644		SR UNSECURED	03.03.2020	03.03.2021		03.03.2025	/ /	XS2126193379

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Еврооблигации РФ: выпуски в евро



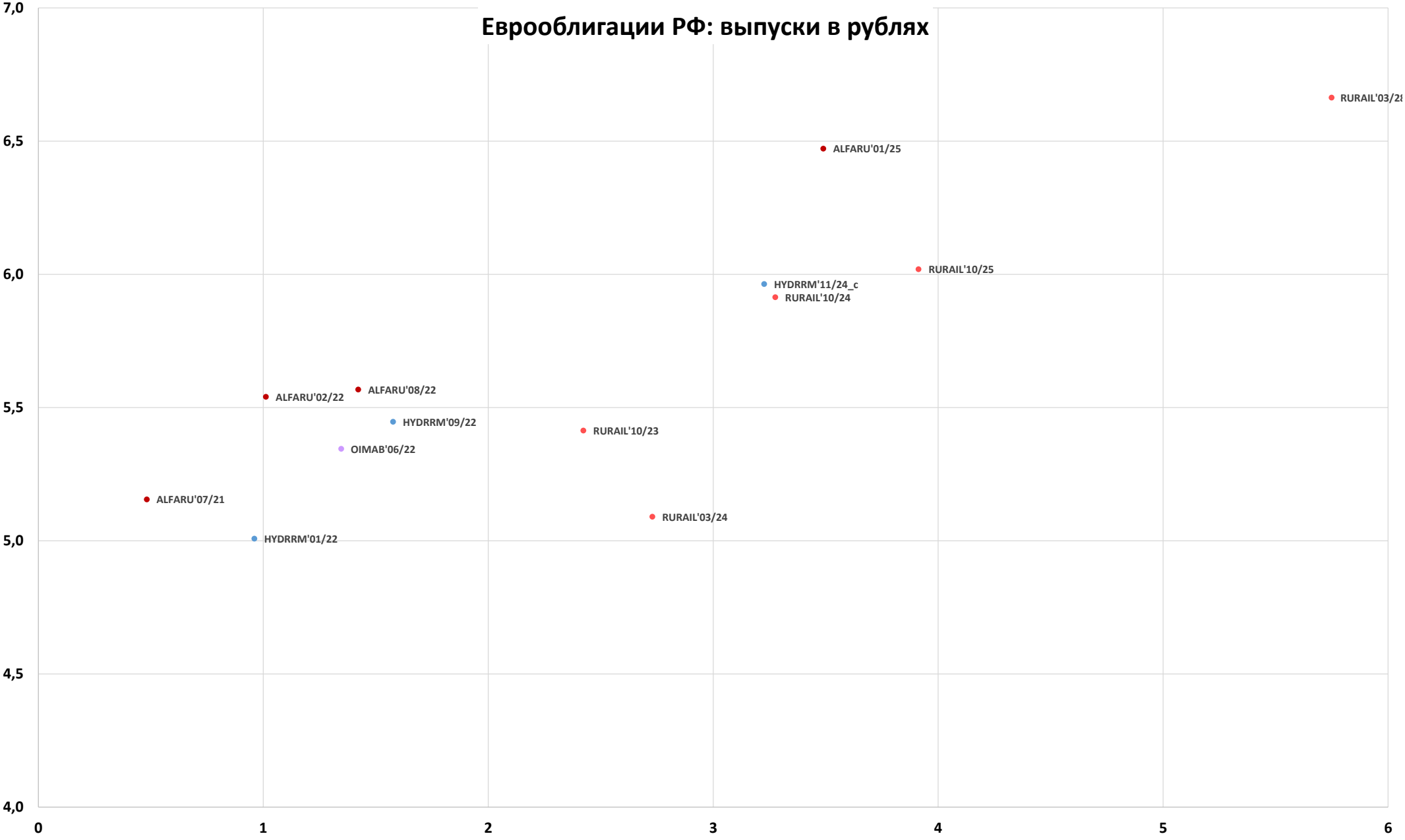
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

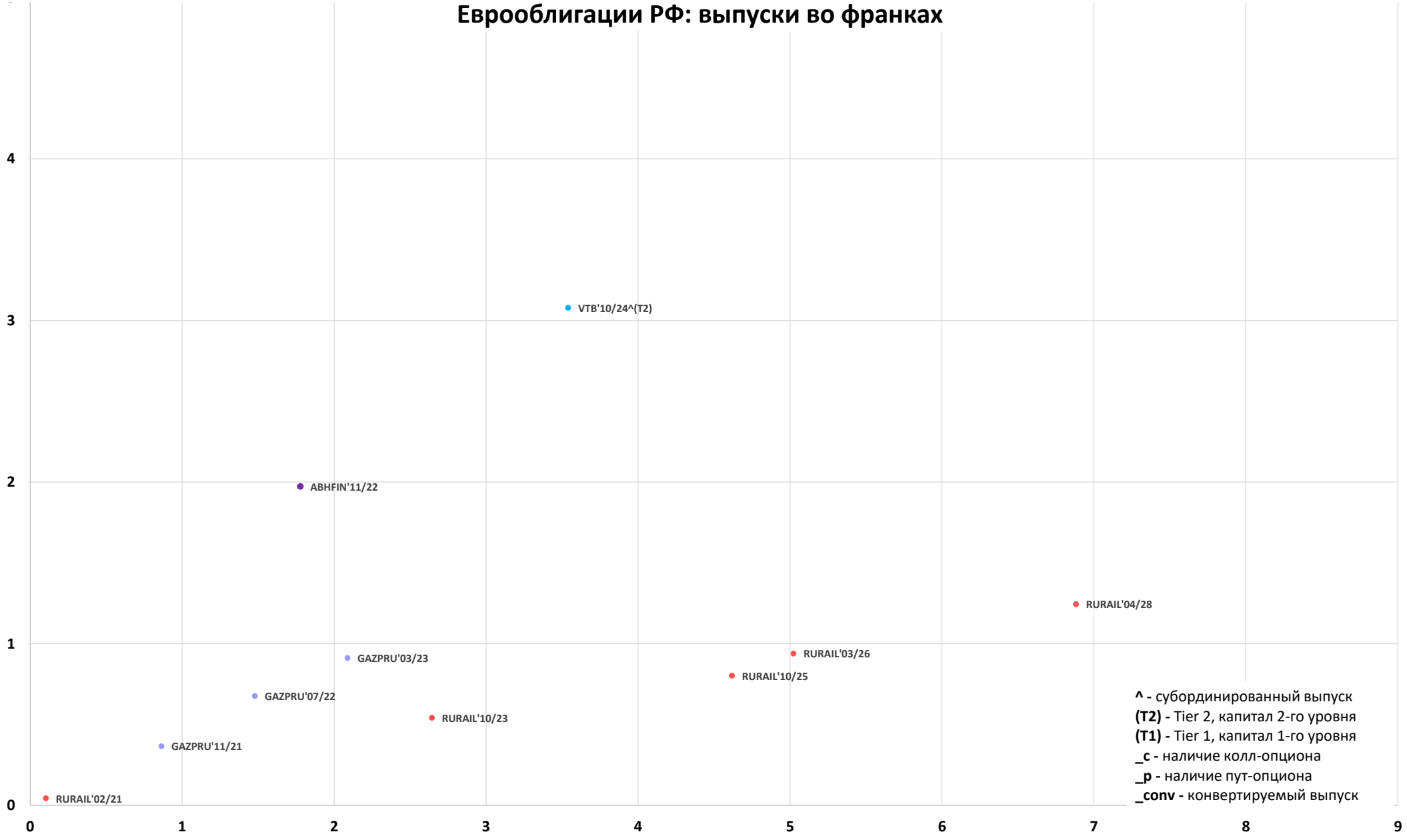
РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
ABHFIN'06/23	0,35	2,31	2,70	101,77	102,24	102,00	1,93	1,73	1,83	236		SR UNSECURED	11.06.2020	11.06.2021		11.06.2023	BB- / / BB	XS2183144810
CRBKMO'02/24	0,37	2,82	5,15	107,1	107,6	107,3	2,71	2,57	2,64	315		SR UNSECURED	20.02.2019	20.02.2021		20.02.2024	BB- / / BB	XS1951067039
GAZPRU'01/24	1,00	2,85	2,95	105,30	105,74	105,52	1,15	1,00	1,08	159		SR UNSECURED	16.11.2018	24.01.2021		24.01.2024	BBB- / Baa2 / BBB	XS1911645049
GAZPRU'02/21	0,75	0,10	3,60	100,2	100,5	100,4	1,17	-0,94	0,11	64		SR UNSECURED	26.02.2014	26.02.2021		26.02.2021	BBB- / Baa2 / BBB	XS1038646078
GAZPRU'03/25	0,50	3,80	4,36	112,33	112,98	112,66	1,30	1,15	1,23	172		SR UNSECURED	21.03.2013	21.03.2021		21.03.2025	BBB- / Baa2 / BBB	XS0906949523
GAZPRU'03/26	0,75	4,83	2,50	105,8	106,0	105,9	1,33	1,30	1,31	177		SR UNSECURED	21.03.2018	21.03.2021		21.03.2026	BBB- / Baa2 / BBB	XS1795409082
GAZPRU'04/25	1,00	3,97	2,95	106,63	107,02	106,82	1,33	1,24	1,28	177		SR UNSECURED	15.04.2020	15.04.2021		15.04.2025	BBB- / Baa2 / BBB	XS2157526315
GAZPRU'11/23	1,00	2,74	3,13	106,4	106,6	106,5	0,83	0,74	0,79	131		SR UNSECURED	17.11.2016	17.11.2021		17.11.2023	BBB- / Baa2 / BBB	XS1521039054
GAZPRU'11/24	0,75	3,71	2,25	104,14	104,62	104,38	1,14	1,02	1,08	158		SR UNSECURED	22.11.2017	22.11.2021		22.11.2024	/ Baa2 / BBB	XS1721463500
GAZPRU'89/RP^_c	1,00	4,62	3,90	103,8	104,1	104,0	3,75	3,74	3,74	350		SUBORDINATED	26.10.2020	26.01.2021	25.10.2025 (к)		BB / / BB+	XS2243636219
IINVBK'10/21	0,08	0,74	1,50	100,72	100,75	100,73	0,52	0,48	0,50	103		SR UNSECURED	15.10.2018	15.10.2021		15.10.2021	/ A3 / A-	ROAB22JS4SS1
RCCF'12/24^	0,04	3,28	10,00	96,4	97,6	97,0	11,14	10,78	10,96	1146		SUBORDINATED	13.06.2019	13.06.2021		13.12.2024	/ /	XS2011269912
RURAIL'03/23	0,50	2,00	4,60	108,94	109,23	109,08	0,38	0,25	0,31	84		SR UNSECURED	06.03.2014	06.03.2021		06.03.2023	BBB- / Baa2 / BBB	XS1041815116
RURAIL'05/21	0,65	0,33	3,37	101,0	101,2	101,1	0,36	-0,18	0,09	62		SR UNSECURED	18.04.2013	20.05.2021		20.05.2021	BBB- / Baa2 / BBB	XS0919581982
RURAIL'05/27_c	0,50	5,71	2,20	106,10	106,66	106,38	1,19	1,11	1,15	153		SR UNSECURED	23.05.2019	23.05.2021	23.02.2027 (к)	23.05.2027	/ Baa2 / BBB	XS1843437036
RUSSIA'12/25	1,75	4,62	2,88	110,4	110,6	110,5	0,70	0,65	0,68	114		SR UNSECURED	04.12.2018	04.12.2021		04.12.2025	/ / BBB	RU000A0ZZVE6
VEBBNK'02/23	0,50	1,98	4,03	106,26	106,61	106,43	0,99	0,83	0,91	144		SR UNSECURED	21.02.2013	21.02.2021		21.02.2023	BBB- / / BBB	XS0893212398

Еврооблигации РФ: выпуски в рублях



Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	Z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
ALFARU'01/25	15,00	3,49	6,75	100,8	101,2	101,0	6,53	6,41	6,47	87		SR UNSECURED	30.01.2020	30.01.2021		30.01.2025	/ Ba1 / BB+	XS2107554896
ALFARU'02/22	10,00	1,01	9,25	103,66	103,96	103,81	5,68	5,40	5,54	58		SR UNSECURED	16.02.2017	16.02.2021		16.02.2022	/ Ba1 / BB+	XS1567117566
ALFARU'07/21	10,00	0,48	8,90	101,8	101,9	101,8	5,26	5,05	5,16	31		SR UNSECURED	20.07.2017	20.01.2021		20.07.2021	/ Ba1 / BB+	XS1648266788
ALFARU'08/22	10,00	1,42	9,35	105,35	105,71	105,53	5,69	5,45	5,57	51		SR UNSECURED	06.02.2019	06.02.2021		06.08.2022	/ Ba1 / BB+	XS1946883342
CRBKMO'05/25^(T2)	5,00	3,33	16,50	123,03	123,71	123,37	9,85	9,68	9,77	418		SUBORDINATED	26.11.2014	26.05.2021		26.05.2025	/ / B+	XS1143363940
HYDRRM'01/22	15,00	0,96	8,98	103,8	104,0	103,9	5,11	4,91	5,01	7		SR UNSECURED	27.11.2018	27.01.2021		27.01.2022	BBB- / Baa3 / BBB	XS1912654677
HYDRRM'02/21	20,00	0,07	7,40	100,2	100,3	100,3	4,88	2,58	3,73	-99		SR UNSECURED	15.02.2018	15.02.2021		15.02.2021	BBB- / Baa3 / BBB	XS1769724755
HYDRRM'09/22	20,00	1,58	8,13	104,1	104,4	104,3	5,55	5,34	5,45	34		SR UNSECURED	28.09.2017	28.03.2021		28.09.2022	BBB- / Baa3 / BBB	XS1691350455
HYDRRM'11/24_c	15,00	3,23	6,80	102,58	103,03	102,81	6,03	5,90	5,96	40		SR UNSECURED	25.11.2019	25.05.2021	25.08.2024 (к)	25.11.2024	BBB- / Baa3 /	XS2082937967
OIMAB'06/22	18,00	1,35	9,00	105,1	105,4	105,2	5,45	5,24	5,35	31		SR UNSECURED	20.06.2012	17.06.2021		18.06.2022	/ /	XS0795156719
RURAIL'03/24	15,00	2,73	8,99	110,72	111,52	111,12	5,22	4,96	5,09	-33		SR UNSECURED	03.03.2017	03.03.2021		03.03.2024	/ Baa2 / BBB	XS1574787294
RURAIL'03/28	25,00	5,75	6,60	99,5	99,8	99,6	6,69	6,64	6,66	68		SR UNSECURED	10.12.2020	02.03.2021		02.03.2028	BBB- / / BBB	XS2271376498
RURAIL'10/23	15,00	2,42	9,20	109,28	109,58	109,43	5,47	5,36	5,41	8		SR UNSECURED	07.10.2016	07.04.2021		07.10.2023	BBB- / / BBB	XS1502188375
RURAIL'10/24	15,00	3,28	7,90	106,31	106,84	106,58	5,99	5,84	5,91	37		SR UNSECURED	19.10.2017	19.04.2021		19.10.2024	/ / BBB	XS1701384494
RURAIL'10/25	20,00	3,91	8,80	110,97	111,51	111,24	6,08	5,96	6,02	34		SR UNSECURED	04.04.2019	04.04.2021		04.10.2025	BBB- / / BBB	XS1843442465



15 января 2021 г.

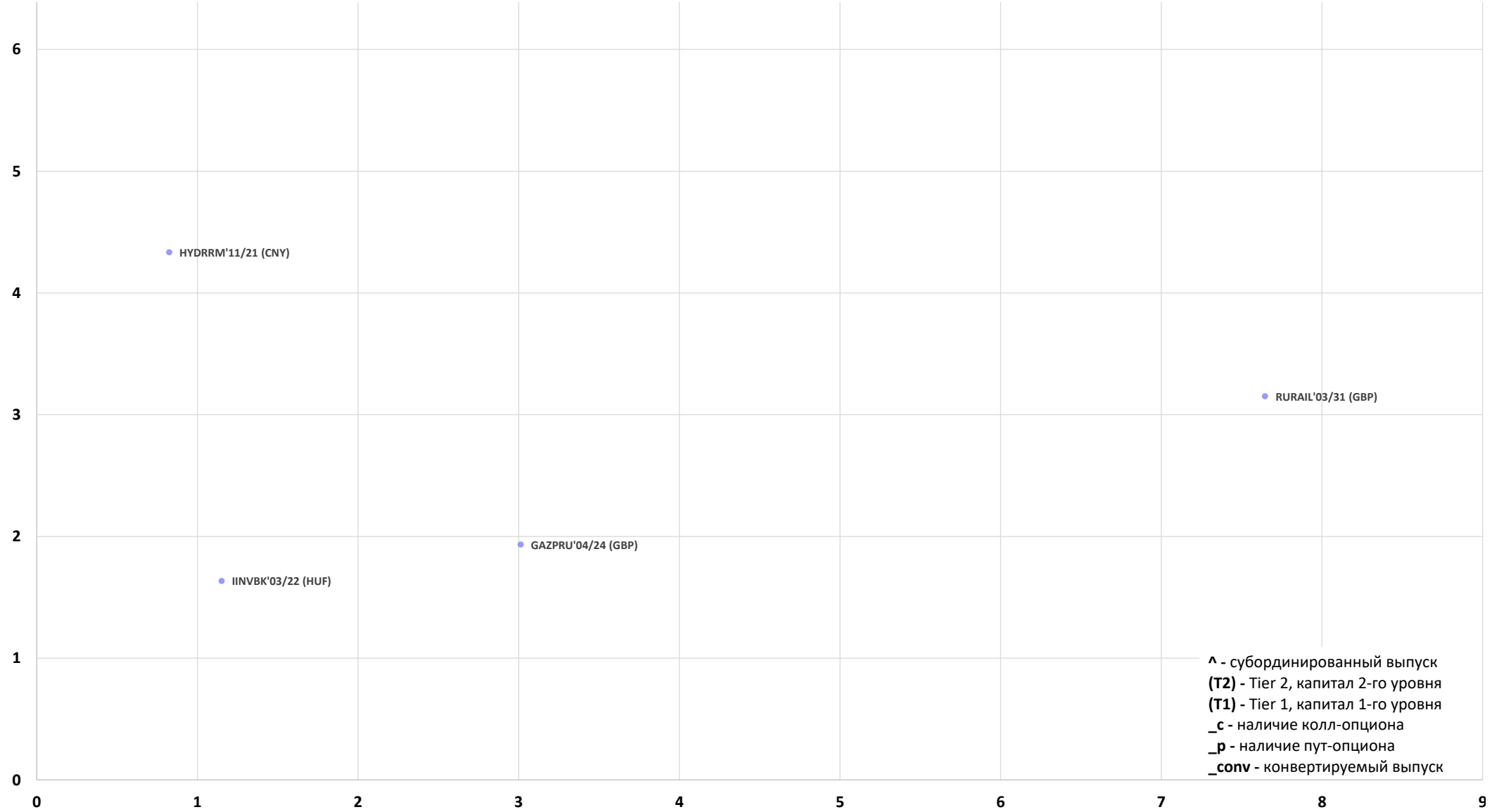
Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		

ABHFIN'11/22	0,17	1,78	2,88	101,3	101,9	101,6	2,15	1,80	1,97	269	SR UNSECURED	09.11.2017	09.11.2021	09.11.2022	BB- / / BB	CH0385518086
GAZPRU'03/23	0,75	2,09	1,45	100,95	101,31	101,13	1,00	0,83	0,91	162	SR UNSECURED	06.03.2018	06.03.2021	06.03.2023	BBB- / Baa2 / BBB	CH0404311711
GAZPRU'07/22	0,50	1,48	2,25	102,17	102,51	102,34	0,79	0,56	0,68	140	SR UNSECURED	19.07.2017	19.07.2021	19.07.2022	BBB- / Baa2 / BBB	CH0374882816
GAZPRU'11/21	0,50	0,86	2,75	102,0	102,1	102,1	0,46	0,27	0,37	109	SR UNSECURED	30.11.2016	30.11.2021	30.11.2021	BBB- / Baa2 / BBB	CH0346828400
RURAIL'02/21	0,15	0,10	2,73	100,25	100,30	100,28	0,28	-0,19	0,04	78	SR UNSECURED	26.02.2013	26.02.2021	26.02.2021	BBB- / Baa2 / BBB	CH0205819441
RURAIL'03/26	0,25	5,02	0,84	99,1	99,9	99,5	1,01	0,87	0,94	149	SR UNSECURED	12.03.2020	12.03.2021	12.03.2026	/ Baa2 / BBB	CH0522690715
RURAIL'04/28	0,15	6,88	1,20	99,21	100,11	99,66	1,31	1,18	1,24	167	SR UNSECURED	03.10.2019	03.04.2021	03.04.2028	/ Baa2 / BBB	CH0419041634
RURAIL'10/23	0,45	2,64	2,10	103,9	104,4	104,2	0,62	0,46	0,54	123	SR UNSECURED	02.10.2017	02.10.2021	02.10.2023	/ Baa2 / BBB	CH0379268748
RURAIL'10/25	0,35	4,62	0,90	100,2	100,7	100,4	0,85	0,75	0,80	138	SR UNSECURED	03.10.2019	03.10.2021	03.10.2025	/ Baa2 / BBB	CH0419041618
VTB'10/24^(T2)	0,26	3,54	4,07	103,08	103,87	103,47	3,19	2,97	3,08	372	SUBORDINATED	24.07.2014	24.10.2021	24.10.2024	/ /	CH0248531110



15 января 2021 г.

Департамент по работе на рынках капитала

Монитор долговых рынков

РоссельхозБанк

Выпуск	Объем	Дюр.	Купон	Цена			Дох-ть			Спреды		Тип	Даты				Рейтинг (S/M/F)	ISIN
				bid	ask	mid	bid	ask	mid	z	G		Разм.	Сл. куп.	Оферта	Погаш.		
GAZPRU'04/24 (GBP)	0,85	3,01	4,25	106,9	107,5	107,2	2,04	1,83	1,93	178		SR UNSECURED	06.04.2017	06.04.2021		06.04.2024	BBB- / Baa2 / BBB	XS1592279522
HYDRRM'11/21 (CNY)	1,50	0,82	6,13	101,33	101,58	101,45	4,48	4,19	4,33	112		UNSECURED	21.11.2018	21.05.2021		21.11.2021	BBB- / Baa3 / BBB	XS1912655054
IINVBK'03/22 (HUF)	24,70	1,15	2,00	100,3	100,6	100,4	1,78	1,49	1,63	85		SR UNSECURED	22.03.2019	22.03.2021		22.03.2022	/ /	HU0000358825
RURAIL'03/31 (GBP)	0,63	7,65	7,49	137,02	138,00	137,51	3,20	3,11	3,15	270		SR UNSECURED	25.03.2011	25.03.2021		25.03.2031	BBB- / Baa2 / BBB	XS0609017917