

**БЮЛЛЕТЕНЬ РЫНКА ГКО-ОФЗ за
23.01.2012-27.01.2012**

Часть 1. ИТОГИ ТОРГОВ НА РЫНКЕ ГКО-ОФЗ

Код выпуска	Срок до погашения, лет	Дюрация, лет	Дата торгов	Оборот по рыночной стоимости, млн. руб.	Цена, % от номинала*	Доходность, % годовых
Итого				15597.19		
25065	1.2	1.1	23.01.2012	99.72	106.6016	6.27
25067	0.7	0.7	23.01.2012	647.67	103.7211	6.22
25068	2.6	2.2	23.01.2012	90.16	111.3355	7.23
25071	2.8	2.6	23.01.2012	29.24	101.9491	7.46
25072	1.0	1.0	23.01.2012	71.32	100.9500	6.25
25073	0.5	0.5	23.01.2012	710.61	100.4107	6.13
25075	3.5	3.1	23.01.2012	1.28	98.0502	7.67
25076	2.1	2.0	23.01.2012	20.94	100.2000	7.11
25077	4.0	3.4	23.01.2012	11.10	99.1000	7.76
25078	1.0	1.0	23.01.2012	50.75	100.5245	6.26
25079	3.4	3.0	23.01.2012	309.80	98.6280	7.60
26199	0.5	0.5	23.01.2012	26.08	100.1000	6.01
26200	1.5	1.4	23.01.2012	10.86	99.5917	6.55
26202	2.9	2.5	23.01.2012	63.09	110.4465	7.37
26203	4.5	3.8	23.01.2012	0.98	96.9218	7.87
26204	6.1	4.9	23.01.2012	181.29	97.8516	8.10
26205	9.2	6.6	23.01.2012	14.11	96.1084	8.38
26206	5.4	4.5	23.01.2012	99.56	98.0066	8.01
46021	6.5	5.0	23.01.2012	18.17	88.2200	8.13
25067	0.7	0.7	24.01.2012	52.73	103.6997	6.23
25069	0.7	0.6	24.01.2012	10.66	102.9000	6.28
25071	2.8	2.6	24.01.2012	5.16	101.9002	7.48
25072	1.0	0.9	24.01.2012	49.20	100.9036	6.30
25073	0.5	0.5	24.01.2012	276.28	100.4027	6.14
25075	3.5	3.1	24.01.2012	9.79	97.6902	7.80
25076	2.1	2.0	24.01.2012	82.24	100.2500	7.09
25077	4.0	3.4	24.01.2012	0.00	99.2000	7.73
25078	1.0	1.0	24.01.2012	3.11	100.4500	6.34
25079	3.4	3.0	24.01.2012	54.70	98.5218	7.64
26198	0.8	0.8	24.01.2012	19.99	99.8300	6.19
26199	0.5	0.5	24.01.2012	10.05	100.0995	6.01
26202	2.9	2.5	24.01.2012	46.12	110.3681	7.40
26203	4.5	3.8	24.01.2012	0.00	96.5000	7.99
26204	6.1	4.9	24.01.2012	37.32	97.8986	8.09
26205	9.2	6.6	24.01.2012	49.32	95.6109	8.46
26206	5.4	4.5	24.01.2012	0.99	97.9500	8.03
25065	1.2	1.1	25.01.2012	0.00	106.6100	6.24
25067	0.7	0.7	25.01.2012	665.71	103.6669	6.26
25069	0.7	0.6	25.01.2012	56.62	102.9067	6.25
25071	2.8	2.6	25.01.2012	54.26	102.1000	7.39
25072	1.0	1.0	25.01.2012	312.15	100.8873	6.32
25073	0.5	0.5	25.01.2012	158.51	100.3978	6.15
25075	3.5	3.1	25.01.2012	54.12	98.2618	7.60
25076	2.1	2.0	25.01.2012	0.10	100.2000	7.11
25077	4.0	3.5	25.01.2012	19.64	99.1924	7.73
25078	1.0	1.0	25.01.2012	99.76	100.4726	6.32
25079	3.4	3.0	25.01.2012	448.13	98.5900	7.62
26198	0.8	0.8	25.01.2012	127.90	99.7824	6.25
26199	0.5	0.5	25.01.2012	15.50	100.0472	6.13
26202	2.9	2.5	25.01.2012	62.05	110.3309	7.41
26203	4.5	3.8	25.01.2012	10.02	97.0500	7.83
26204	6.1	4.9	25.01.2012	455.87	97.8849	8.10
26205	9.2	6.6	25.01.2012	101.10	96.0654	8.38
26206	5.4	4.5	25.01.2012	424.44	97.9954	8.04
46017	4.5	3.5	25.01.2012	2.61	96.0000	7.82
46021	6.5	5.0	25.01.2012	0.91	88.3000	8.11
25065	1.2	1.1	26.01.2012	1.69	106.6000	6.24
25067	0.7	0.7	26.01.2012	92.67	103.6499	6.26
25068	2.6	2.2	26.01.2012	29.14	111.4500	7.17
25069	0.6	0.6	26.01.2012	117.40	102.9714	6.13
25071	2.8	2.6	26.01.2012	10.34	102.1001	7.39
25072	1.0	1.0	26.01.2012	0.00	100.8501	6.35
25073	0.5	0.5	26.01.2012	205.89	100.3613	6.22
25075	3.5	3.1	26.01.2012	111.27	98.3132	7.58
25076	2.1	2.0	26.01.2012	159.51	100.3237	7.05
25077	4.0	3.5	26.01.2012	352.12	99.4599	7.65
25078	1.0	1.0	26.01.2012	268.59	100.4500	6.34
25079	3.4	3.0	26.01.2012	149.54	98.7359	7.57
26198	0.8	0.8	26.01.2012	98.85	99.8179	6.21
26199	0.5	0.5	26.01.2012	47.69	100.1474	5.89
26202	2.9	2.5	26.01.2012	186.75	110.4617	7.36
26203	4.5	3.8	26.01.2012	166.08	97.1926	7.79
26204	6.1	4.9	26.01.2012	404.97	98.2188	8.02
26205	9.2	6.6	26.01.2012	58.92	96.2750	8.35
26206	5.4	4.5	26.01.2012	606.43	98.2609	7.95
46014	6.6	5.1	26.01.2012	4.91	95.4499	8.08
46017	4.5	3.5	26.01.2012	77.31	96.0870	7.80
25065	1.2	1.1	27.01.2012	5.20	106.5000	6.31
25067	0.7	0.7	27.01.2012	202.63	103.6994	6.17
25068	2.6	2.2	27.01.2012	69.98	111.4967	7.14
25069	0.6	0.6	27.01.2012	310.20	102.9700	6.11
25071	2.8	2.6	27.01.2012	11.21	102.3045	7.31
25072	1.0	1.0	27.01.2012	73.14	100.9183	6.28
25073	0.5	0.5	27.01.2012	195.40	100.3862	6.16
25075	3.5	3.1	27.01.2012	187.31	98.4134	7.54
25076	2.1	2.0	27.01.2012	553.67	100.3841	7.02
25077	4.0	3.5	27.01.2012	394.26	99.7019	7.58
25078	1.0	1.0	27.01.2012	766.68	100.4965	6.29
25079	3.4	3.0	27.01.2012	163.29	98.8942	7.51
26198	0.8	0.8	27.01.2012	118.46	99.8500	6.16
26199	0.5	0.5	27.01.2012	20.13	100.1402	5.91
26202	2.9	2.5	27.01.2012	62.51	110.4821	7.34
26203	4.5	3.8	27.01.2012	96.67	98.0585	7.55
26204	6.1	4.9	27.01.2012	1395.63	98.5623	7.95
26205	9.2	6.6	27.01.2012	270.94	96.7071	8.28
26206	5.4	4.5	27.01.2012	1159.93	98.5962	7.87
46002	0.5	0.3	27.01.2012	0.76	100.5500	6.07
46017	4.5	3.5	27.01.2012	147.00	96.4833	7.67
46022	11.5	7.8	27.01.2012	8.39	83.7500	8.39

* здесь номинал - непогашенная часть номинальной стоимости

Часть 2. ОСНОВНЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ОБРАЩАЮЩИХСЯ ВЫПУСКОВ ГКО-ОФЗ по состоянию на 27.01.2012

Код выпуска	Дата начала размещения	Дата погашения	Номинал одной облигации*, руб.	Объем в обращении, млн. руб.	Дата ближайшей выплаты	Лет до выплаты	Тип выплаты	Ставка купона, % годовых / Погашаемая доля номинала, %	Размер выплат на одну облигацию, руб.	Сумма выплаты, млн. руб.
25073	27.01.2010	01.08.2012	1000	150000.00	01.02.2012	0.01	купон	6.850	34.16	5124.00
							погашение	-	-	-
46002	05.02.2003	08.08.2012	500	31000.00	08.02.2012	0.03	купон	8.000	19.95	1236.90
							частичное погашение	25.000	250.00	15500.00
46017	16.02.2005	03.08.2016	1000	80000.00	08.02.2012	0.03	купон	7.000	17.45	1396.00
							погашение	-	-	-
26203	04.08.2010	03.08.2016	1000	139560.20	08.02.2012	0.03	купон	6.900	34.41	4802.27
							погашение	-	-	-
25078	02.02.2011	06.02.2013	1000	99736.47	08.02.2012	0.03	купон	6.700	33.41	3332.20
							погашение	-	-	-
46023	30.09.2011	23.07.2026	1000	295000.00	09.02.2012	0.04	купон	8.160	29.51	8705.45
							погашение	-	-	-
46020	15.02.2006	06.02.2036	1000	116911.01	15.02.2012	0.05	купон	6.900	35.73	4177.23
							погашение	-	-	-
46021	21.02.2007	08.08.2018	1000	92794.44	15.02.2012	0.05	купон	6.000	29.92	2776.41
							погашение	-	-	-
25068	26.08.2009	20.08.2014	1000	45000.00	22.02.2012	0.07	купон	12.000	59.84	2692.80
							погашение	-	-	-
46014	05.03.2003	29.08.2018	500	29144.95	07.03.2012	0.11	купон	7.000	17.45	1017.16
							погашение	-	-	-
46018	16.03.2005	24.11.2021	1000	128933.65	07.03.2012	0.11	купон	8.000	19.95	2572.23
							погашение	-	-	-
25076	19.01.2011	14.03.2014	1000	136261.47	15.03.2012	0.13	купон	7.100	35.40	4823.66
							погашение	-	-	-
26202	23.09.2009	17.12.2014	1000	40000.00	21.03.2012	0.15	купон	11.200	27.92	1116.80
							погашение	-	-	-
25069	23.09.2009	19.09.2012	1000	44059.51	21.03.2012	0.15	купон	10.800	53.85	2372.60
							погашение	-	-	-
26204	23.03.2011	15.03.2018	1000	146726.53	22.03.2012	0.15	купон	7.500	37.40	5487.57
							погашение	-	-	-
25065	01.07.2009	27.03.2013	1000	46000.00	28.03.2012	0.17	купон	12.000	29.92	1376.32
							погашение	-	-	-
26199	17.01.2007	11.07.2012	1000	44000.00	11.04.2012	0.21	купон	6.100	15.21	669.24
							погашение	-	-	-
26200	23.01.2008	17.07.2013	1000	50000.00	18.04.2012	0.22	купон	6.100	15.21	760.50
							погашение	-	-	-
26201	23.07.2008	16.10.2013	1000	47000.00	18.04.2012	0.22	купон	6.550	16.33	767.51
							погашение	-	-	-
25067	05.08.2009	17.10.2012	1000	45000.00	18.04.2012	0.22	купон	11.300	28.17	1267.65
							погашение	-	-	-
26205	13.04.2011	14.04.2021	1000	44800.79	25.04.2012	0.24	купон	7.600	37.90	1697.95
							погашение	-	-	-
25071	02.12.2009	26.11.2014	1000	80000.00	30.05.2012	0.34	купон	8.100	40.39	3231.20
							погашение	-	-	-
25079	01.06.2011	03.06.2015	1000	120134.85	06.06.2012	0.36	купон	7.000	34.90	4192.71
							погашение	-	-	-
26206	08.06.2011	14.06.2017	1000	111872.54	20.06.2012	0.4	купон	7.400	36.90	4128.10
							погашение	-	-	-
46022	23.01.2008	19.07.2023	1000	28222.71	18.07.2012	0.47	купон	6.500	32.41	914.70
							погашение	-	-	-
25075	28.07.2010	15.07.2015	1000	137603.89	18.07.2012	0.47	купон	6.880	34.31	4721.19
							погашение	-	-	-
25072	20.01.2010	23.01.2013	1000	150000.00	25.07.2012	0.49	купон	7.150	35.65	5347.50
							погашение	-	-	-
25077	26.01.2011	20.01.2016	1000	97232.14	25.07.2012	0.49	купон	7.350	36.65	3563.56
							погашение	-	-	-
46012	14.02.2003	05.09.2029	1000	40000.00	26.09.2012	0.67	купон	3.741	37.31	1492.40
							погашение	-	-	-
26198	09.10.2002	02.11.2012	1000	42117.40	02.11.2012	0.77	купон	6.000	60.00	2527.04
							погашение	100.000	1000.00	42117.40
48001	18.11.2004	31.10.2018	1000	24099.48	07.11.2012	0.78	купон	6.500	64.82	1562.13
							погашение	-	-	-
46019	28.12.2005	20.03.2019	1000	26000.00	27.03.2013	1.16	купон	3.000	30.00	780.00
							частичное погашение	10.000	100.00	2600.00
46010	14.02.2003	17.05.2028	1000	30000.00	05.06.2013	1.36	купон	10.000	99.73	2991.90
							погашение	-	-	-
46011	14.02.2003	20.08.2025	1000	30000.00	04.09.2013	1.61	купон	10.000	99.73	2991.90
							погашение	-	-	-
46005	14.02.2003	09.01.2019	1000	27477.45	10.01.2018	5.96	частичное погашение	70.000	700.00	19234.22
							погашение	-	-	-

* здесь номинал - непогашенная часть номинальной стоимости

Часть 3. НЕКОТОРЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ РЫНОК ГКО-ОФЗ

Дата	23.01.2012	24.01.2012	25.01.2012	26.01.2012	27.01.2012
Номинальная стоимость, млн. руб.	2,776,851.09	2,776,851.09	2,796,689.48	2,796,689.48	2,796,689.48
до 1 года*	356,176.91	506,176.91	506,176.91	506,176.91	506,176.91
1-5 лет	1,268,529.02	1,118,529.02	1,118,529.02	1,118,529.02	1,118,529.02
более 5 лет	1,152,145.16	1,152,145.16	1,171,983.54	1,171,983.54	1,171,983.54
Рыночная стоимость, млн. руб.	2,758,569.13	2,757,567.54	2,770,635.98	2,773,313.75	2,778,215.90
до 1 года*	368,292.92	524,965.06	519,637.60	519,712.57	519,972.47
1-5 лет	1,298,087.79	1,140,415.01	1,138,816.75	1,140,068.67	1,142,663.96
более 5 лет	1,092,188.42	1,092,187.46	1,112,181.63	1,113,532.50	1,115,579.47
Оборот по рыночной стоимости, млн. руб.	2,456.72	707.64	3,069.39	3,150.05	6,213.38
до 1 года*	1,384.36	418.90	1,336.38	562.50	920.72
1-5 лет	759.24	201.11	750.70	1,512.33	2,457.76
более 5 лет	313.12	87.63	982.32	1,075.23	2,834.90
Коэффициент оборачиваемости по рыночной стоимости	0.09	0.03	0.11	0.11	0.22
до 1 года*	0.75	0.16	0.51	0.22	0.35
1-5 лет	0.12	0.04	0.13	0.27	0.43
более 5 лет	0.06	0.02	0.18	0.19	0.51
Индикатор рыночного портфеля, % годовых**	8.09	8.14	8.09	8.04	7.96
до 1 года*	6.15	6.23	6.25	6.25	6.19
1-5 лет	7.42	7.53	7.46	7.43	7.34
более 5 лет	8.27	8.31	8.27	8.22	8.14
Дюрация, лет***	3.78	3.78	3.80	3.80	3.80
до 1 года*	0.60	0.70	0.70	0.70	0.70
1-5 лет	2.40	2.60	2.60	2.60	2.60
более 5 лет	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50

* срок до погашения

** рассчитывается как эффективная доходность по выпускам ГКО-ОФЗ, взвешенная по объемам в обращении и дюрации

*** рассчитывается как дюрация выпусков облигаций, взвешенная по объемам в обращении