

**БЮЛЛЕТЕНЬ РЫНКА ГКО-ОФЗ за
01.02.2010-05.02.2010**

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				6068.05		
25061	0.3	0.3	01.02.2010	146.38	100.0449	5.74
		0.2	02.02.2010	0.03	100.0400	5.76
		0.2	03.02.2010	4.12	100.0700	5.63
		0.2	04.02.2010	5.66	100.1200	5.41
46003	0.4	0.2	05.02.2010	5.94	100.1025	5.48
		0.4	04.02.2010	0.92	102.0000	5.38
25059	1.0	0.9	01.02.2010	81.89	100.0000	6.24
		0.9	02.02.2010	50.50	100.1000	6.13
		0.9	03.02.2010	23.81	100.0998	6.13
25062	1.3	0.9	05.02.2010	4.01	100.0500	6.18
		1.2	01.02.2010	43.12	99.2000	6.63
		1.2	02.02.2010	0.00	99.2000	6.63
		1.2	03.02.2010	0.35	99.4500	6.41
		1.2	05.02.2010	54.61	99.2591	6.58
25066	1.4	1.3	01.02.2010	0.01	105.4545	6.67
		1.3	02.02.2010	120.34	105.7072	6.47
		1.3	03.02.2010	64.50	105.6002	6.54
		1.3	04.02.2010	91.87	106.2445	6.05
25070	1.7	1.5	02.02.2010	5.56	104.7752	7.00
		1.5	04.02.2010	0.00	105.5000	6.52
		1.5	05.02.2010	4.88	104.7836	6.98
25063	1.8	1.7	01.02.2010	44.84	99.3500	6.76
		1.7	02.02.2010	50.43	99.4389	6.70
		1.7	03.02.2010	1.50	99.7500	6.50
		1.7	05.02.2010	3.33	99.4000	6.73
		1.8	01.02.2010	21.96	109.4000	6.92
25064	2.0	1.8	02.02.2010	118.20	109.7009	6.74
		1.8	03.02.2010	0.00	109.4000	6.90
		1.8	04.02.2010	0.01	109.2955	6.95
		1.8	05.02.2010	3.33	109.7000	6.72
26199	2.4	2.3	01.02.2010	0.00	97.8550	7.25
		2.3	04.02.2010	0.10	98.0767	7.15
		2.3	05.02.2010	3.33	98.3489	7.02
25073	2.5	2.3	02.02.2010	164.75	99.7342	7.09
46002	2.5	1.6	02.02.2010	25.36	101.8500	6.98
		2.3	01.02.2010	58.12	108.9860	7.12
		2.3	02.02.2010	125.89	109.1000	7.07
25069	2.6	2.3	03.02.2010	0.00	109.2250	7.01
		2.3	04.02.2010	308.61	108.2546	7.41
		2.3	05.02.2010	0.78	109.1184	7.05
		2.4	01.02.2010	0.56	110.6986	7.12
		2.4	02.02.2010	53.36	110.8992	7.03
25067	2.7	2.4	03.02.2010	114.73	110.9587	7.00
		2.4	04.02.2010	144.84	110.9500	7.00
		2.4	05.02.2010	127.87	110.6974	7.10
		2.6	05.02.2010	21.38	97.4496	7.04
		2.7	01.02.2010	22.99	113.8500	7.25
25065	3.2	2.7	02.02.2010	91.83	114.0298	7.18
		2.7	03.02.2010	16.14	114.1200	7.15
		2.7	04.02.2010	135.34	114.1915	7.12
		2.7	05.02.2010	0.00	113.9900	7.21
26200	3.5	3.1	01.02.2010	384.32	98.8501	7.33
		3.1	02.02.2010	58.31	96.9600	7.29
		3.1	03.02.2010	50.21	97.2000	7.21
		3.1	04.02.2010	340.90	97.1500	7.23
		3.1	05.02.2010	116.91	96.9236	7.31
25068	4.6	3.6	01.02.2010	48.81	116.8000	7.71
		3.6	02.02.2010	36.71	117.1000	7.63
		3.6	03.02.2010	159.53	117.4200	7.55
		3.5	04.02.2010	29.56	117.3586	7.56
		3.5	05.02.2010	562.18	116.8963	7.66
25071	4.8	4.0	02.02.2010	0.83	102.5000	7.61
		4.0	03.02.2010	0.00	102.0000	7.74
		4.0	04.02.2010	103.09	102.5000	7.61
		4.0	05.02.2010	0.00	102.1000	7.71
26202	4.9	3.9	01.02.2010	120.30	114.8903	7.74
		3.9	02.02.2010	116.37	115.1150	7.68
		3.9	03.02.2010	154.13	115.3847	7.61
		3.9	04.02.2010	191.02	115.4389	7.60
46017	6.5	3.9	05.02.2010	426.17	115.0903	7.68
		4.8	01.02.2010	1.02	95.0500	8.00
		4.8	02.02.2010	1.68	95.2510	7.95
		4.8	03.02.2010	68.55	96.2000	7.74
		4.8	04.02.2010	6.17	95.9500	7.79
46021	8.5	4.8	05.02.2010	3.67	95.7999	7.83
		6.1	02.02.2010	3.67	88.6023	7.97
		6.1	03.02.2010	3.72	89.7500	7.75
		6.1	04.02.2010	0.00	88.4500	8.00
46014	8.6	6.1	05.02.2010	55.32	89.5000	7.80
		3.2	01.02.2010	1.44	98.5000	7.75
		3.2	02.02.2010	459.66	98.8195	7.64
		3.2	03.02.2010	5.11	99.0000	7.58
		3.2	04.02.2010	15.34	99.0000	7.58
46019	9.1	3.2	05.02.2010	0.00	98.9000	7.62
		6.3	04.02.2010	19.22	65.7000	8.39
46018	11.8	7.3	02.02.2010	48.39	95.5000	8.02
		7.3	03.02.2010	4.87	96.0000	7.95
		7.3	04.02.2010	0.00	95.4500	8.03
		7.3	05.02.2010	38.81	95.4981	8.02
46020	26.0	11.1	01.02.2010	3.75	88.1000	8.17
		11.0	04.02.2010	41.98	87.1531	8.27
		11.0	05.02.2010	19.13	87.3052	8.25

* здесь номинал - непогашенная часть номинальной стоимости

Часть 2. ОСНОВНЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ОБРАЩАЮЩИХСЯ ВЫПУСКОВ ГКО-ОФЗ по состоянию на 05.02.2010

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.
46002	05.02.2003	08.08.2012	1000	62000.00	10.02.2010	0.01	купон	8.000	39.89	2473.18
							погашение	-	-	-
46017	16.02.2005	03.08.2016	1000	80000.00	10.02.2010	0.01	купон	7.500	18.70	1496.00
							погашение	-	-	-
46020	15.02.2006	06.02.2036	1000	116911.01	10.02.2010	0.01	купон	6.900	34.41	4022.91
							погашение	-	-	-
25063	09.07.2008	09.11.2011	1000	30000.00	10.02.2010	0.01	купон	6.200	15.46	463.80
							погашение	-	-	-
46021	21.02.2007	08.08.2018	1000	92794.44	17.02.2010	0.03	купон	7.000	34.90	3238.53
							погашение	-	-	-
25068	26.08.2009	20.08.2014	1000	45000.00	24.02.2010	0.05	купон	12.000	59.84	2692.80
							погашение	-	-	-
46014	05.03.2003	29.08.2018	1000	58289.89	10.03.2010	0.09	купон	8.000	39.89	2325.18
							частичное погашение	25.000	250.00	14572.47
46018	16.03.2005	24.11.2021	1000	128933.65	10.03.2010	0.09	купон	8.500	21.19	2732.10
							погашение	-	-	-
26202	23.09.2009	17.12.2014	1000	40000.00	24.03.2010	0.13	купон	11.200	27.92	1116.80
							погашение	-	-	-
25069	23.09.2009	19.09.2012	1000	44059.51	24.03.2010	0.13	купон	10.800	53.85	2372.60
							погашение	-	-	-
25065	01.07.2009	27.03.2013	1000	46000.00	31.03.2010	0.15	купон	12.000	29.92	1376.32
							погашение	-	-	-
25070	30.09.2009	28.09.2011	1000	44946.82	31.03.2010	0.15	купон	10.000	49.86	2241.05
							погашение	-	-	-
25066	08.07.2009	06.07.2011	1000	40000.00	07.04.2010	0.17	купон	10.550	26.30	1052.00
							погашение	-	-	-
26199	17.01.2007	11.07.2012	1000	40290.85	14.04.2010	0.19	купон	6.100	15.21	612.82
							погашение	-	-	-
25059	25.01.2006	19.01.2011	1000	41000.00	21.04.2010	0.21	купон	6.100	15.21	623.61
							погашение	-	-	-
26200	23.01.2008	17.07.2013	1000	50000.00	21.04.2010	0.21	купон	6.100	15.21	760.50
							погашение	-	-	-
26201	23.07.2008	16.10.2013	1000	13866.48	21.04.2010	0.21	купон	6.550	16.33	226.44
							погашение	-	-	-
25064	21.01.2009	18.01.2012	1000	45000.00	21.04.2010	0.21	купон	11.900	29.67	1335.15
							погашение	-	-	-
25067	05.08.2009	17.10.2012	1000	45000.00	21.04.2010	0.21	купон	11.300	28.17	1267.65
							погашение	-	-	-
25061	07.02.2007	05.05.2010	1000	42512.63	05.05.2010	0.24	купон	5.800	14.46	614.73
							погашение	100.000	1000.00	42512.63
25062	06.02.2008	04.05.2011	1000	45000.00	05.05.2010	0.24	купон	5.800	14.46	650.70
							погашение	-	-	-
25071	02.12.2009	26.11.2014	1000	10760.78	02.06.2010	0.32	купон	8.100	40.39	434.63
							погашение	-	-	-
46003	14.02.2003	14.07.2010	500	18648.78	14.07.2010	0.44	купон	10.000	24.93	929.83
							частичное погашение	50.000	500.00	18648.78
46022	23.01.2008	19.07.2023	1000	28222.71	21.07.2010	0.45	купон	7.500	37.40	1055.53
							погашение	-	-	-
25072	20.01.2010	23.01.2013	1000	38957.58	28.07.2010	0.47	купон	7.150	37.02	1442.21
							погашение	-	-	-
25073	27.01.2010	01.08.2012	1000	1667.95	04.08.2010	0.49	купон	6.850	35.47	59.16
							погашение	-	-	-
46012	14.02.2003	05.09.2029	1000	40000.00	29.09.2010	0.65	купон	1.948	19.43	777.20
							погашение	-	-	-
26198	09.10.2002	02.11.2012	1000	42117.40	03.11.2010	0.74	купон	6.000	60.00	2527.04
							погашение	-	-	-
48001	18.11.2004	31.10.2018	1000	24099.48	10.11.2010	0.76	купон	13.000	129.64	3124.26
							погашение	-	-	-
46019	28.12.2005	20.03.2019	1000	26000.00	27.03.2013	3.14	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	3.33	купон	10.000	99.73	2991.90
							погашение	-	-	-
46011	14.02.2003	20.08.2025	1000	30000.00	04.09.2013	3.58	купон	10.000	99.73	2991.90
							погашение	-	-	-
46005	14.02.2003	09.01.2019	1000	27477.45	10.01.2018	7.93	частичное погашение	70.000	700.00	19234.22

* здесь номинал - непогашенная часть номинальной стоимости

Часть 3. НЕКОТОРЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ РЫНОК ГКО-ОФЗ

Дата	01.02.2010	02.02.2010	03.02.2010	04.02.2010	05.02.2010
Номинальная стоимость, млн. руб.	1,469,557.41	1,469,557.41	1,469,557.41	1,469,557.41	1,469,557.41
до 1 года*	102,161.40	102,161.40	102,161.40	102,161.40	102,161.40
1-5 лет	684,667.37	684,667.37	684,667.37	684,667.37	684,667.37
более 5 лет	682,728.64	682,728.64	682,728.64	682,728.64	682,728.64
Рыночная стоимость, млн. руб.	1,442,433.03	1,444,040.43	1,446,134.08	1,444,110.39	1,445,039.60
до 1 года*	103,345.47	103,402.97	102,819.90	102,848.29	102,839.01
1-5 лет	730,472.03	731,276.08	731,262.46	731,680.66	731,468.29
более 5 лет	608,615.54	609,361.39	612,051.72	609,581.43	610,732.29
Оборот по рыночной стоимости, млн. руб.	979.50	1,531.87	671.28	1,433.73	1,451.67
до 1 года*	228.27	50.53	27.94	6.58	9.96
1-5 лет	745.03	967.93	561.10	1,345.34	1,324.78
более 5 лет	6.20	513.41	82.24	81.81	116.94
Коэффициент оборачиваемости по рыночной стоимости	0.07	0.11	0.05	0.10	0.10
до 1 года*	0.44	0.10	0.05	0.01	0.02
1-5 лет	0.20	0.26	0.15	0.37	0.36
более 5 лет	0.00	0.17	0.03	0.03	0.04
Индикатор рыночного портфеля, % годовых**	8.14	8.12	8.07	8.12	8.11
до 1 года*	6.05	5.98	5.96	5.89	5.94
1-5 лет	7.23	7.19	7.16	7.14	7.16
более 5 лет	8.40	8.39	8.32	8.39	8.36
Дюрация, лет***	4.41	4.40	4.41	4.39	4.39
до 1 года*	0.60	0.60	0.60	0.60	0.60
1-5 лет	2.40	2.40	2.40	2.40	2.40
более 5 лет	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50

* 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