

Комментарий

В четверг, 7 октября, индекс корпоративных облигаций RUCBITR снизился на 0,02%. Лучше индекса среди корпоративных долговых бумаг торговались выпуски Аэрофл БО1, РЖД-19 обл, Сбер Sb24R и ТКХ БП1, которые выросли на 0,24-0,79%. В числе аутсайдеров торговались выпуски Роснефть05, ЕврХол2Р1R, Славнеф1Р2 и АЛЬФАБ2Р10, снизившись на прошедших торгах на 0,15-0,55%.

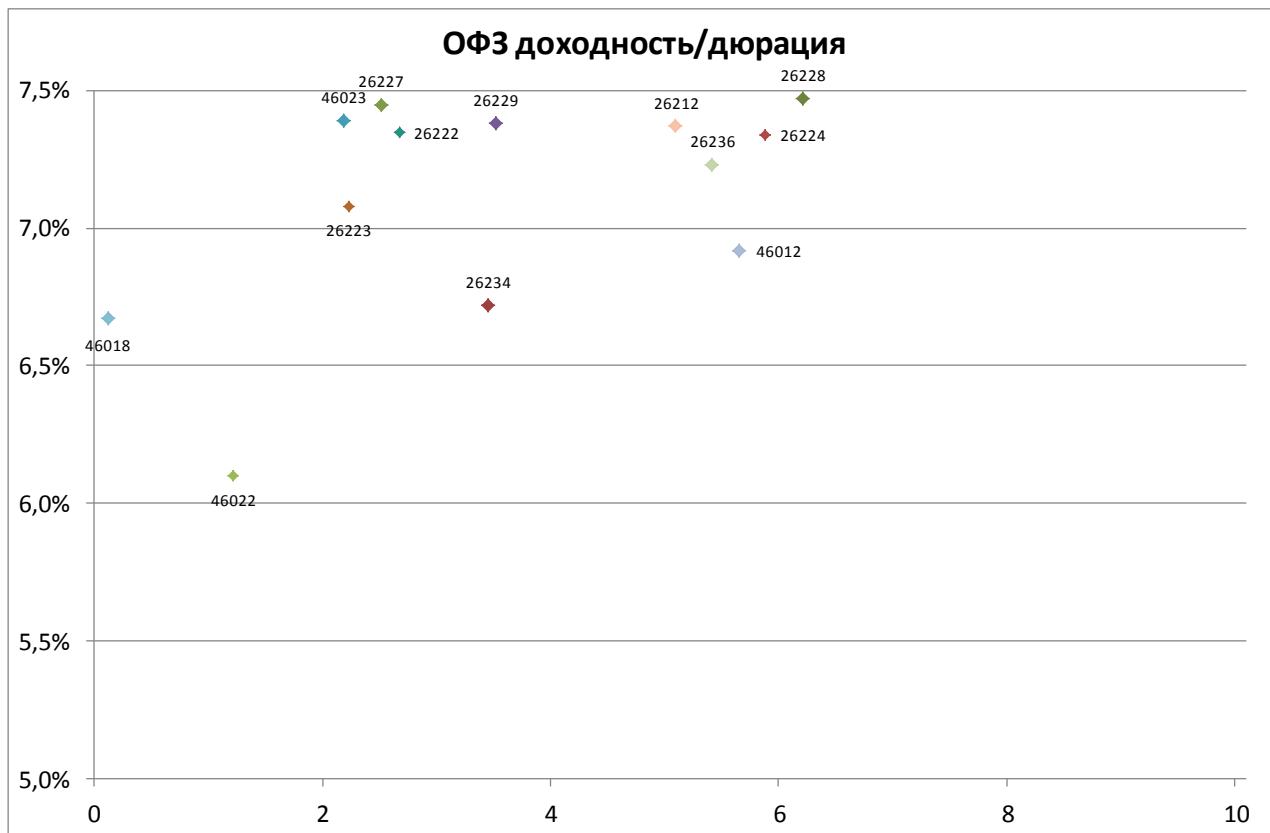
Индекс муниципальных облигаций RUMBITR отметился ростом на 0,04%. Среди лидеров торгов стоит отметить выпуски КрасЯрКр13 и Беларусь07, которые выросли на 0,60% и 0,49% соответственно. Противоположным образом закрылись выпуски Томскобл20 и Казахст01, потеряв на торгах 0,54% и 0,49% соответственно.

Индекс государственных облигаций RGBITR показал рост на 0,40%. В зеленой зоне среди ОФЗ закрылись выпуски 26226, 26221, 26225 и 26230, которые прибавили 0,43-1,13%. В числе аутсайдеров оказались выпуски 46011, 46022, 29009 и 29006, потеряв на торгах 0,15-1,21%.

Индикаторы рынка

	Значение закрытия	Изм. к пред. дню	Изм. за неделю	Изм. за мес.
Золото	1762,74	+0,15%	+0,33%	-1,76%
Нефть Brent	81,08	-1,83%	+3,26%	+13,10%
5-летний CDS	90	+0,26%	+2,52%	+16,56%
Бивалютная корзина	77,53	+0,00%	-0,49%	-2,39%
Mosprime о/н	6,76	-0,19	-0,18	+0,13
Депозиты в ЦБ	1369,1	+473,7	+346,0	-1009,27
Остатки на корп. сч.	2862,3	-443,6	-361,4	+443,80
UST 2	0,29	+0,01	+0,02	+0,07
UST 10	1,52	-0,01	+0,03	+0,15
Russia 2028	2,28	+0,03	+0,08	+0,23
Brazil 2028	6,11	+0,01	+0,03	+0,80
Turkey 2028	5,66	+0,02	+0,02	+0,83
Portugal 10 yr	0,37	+0,01	+0,02	+0,12
Ireland 10 yr	0,18	+0,01	+0,00	+0,12
Italy 10 yr	0,89	+0,03	+0,03	+0,14
Greece 10 yr	0,90	+0,04	+0,05	+0,04
Spain 10 yr	0,47	+0,01	+0,01	+0,10

Источник: Bloomberg, ПАО Московская биржа
Оценка: ПАО «ИК РУСС-ИНВЕСТ»



Выпуск	Купон	Погашение	Дюрация	Доходность	Посл. цена	Изм. цены	Выпуск	Купон	Погашение	Дюрация	Доходность	Посл. цена	Изм. цены
26226	7,95	07.10.2026	4,07	7,57	102,92	+0,43%	26207	8,15	03.02.2027	4,38	7,59	103,89	+0,53%
26227	7,40	17.07.2024	2,51	7,45	100,28	+0,19%	26236	5,70	17.05.2028	5,42	7,23	91,75	
26234	4,50	16.07.2025	3,45	6,72	90,90	+0,04%	26220	7,40	07.12.2022	1,10	7,47	100,28	+0,11%
46020	6,90	06.02.2036	8,79	7,55	95,27	+0,04%	29007	6,46	03.03.2027	0,41	8,29	102,32	-0,13%
46018	6,50	24.11.2021	0,12	6,67	100,00	-0,00%	26215	7,00	16.08.2023	1,75	7,27	99,50	+0,08%
46023	8,16	23.07.2026	2,19	7,39	103,16	-	29006	6,77	29.01.2025	0,31	8,38	100,98	-0,15%
26223	6,50	28.02.2024	2,23	7,08	98,25	+0,10%	26211	7,00	25.01.2023	1,24	7,21	99,62	-0,11%
29009	5,74	05.05.2032	0,16	8,11	106,22	-0,17%	26219	7,75	16.09.2026	4,18	7,52	101,84	+0,25%
26225	7,25	10.05.2034	8,20	7,56	98,39	+1,12%	26218	8,50	17.09.2031	7,02	7,54	108,43	+1,12%
25083	7,00	15.12.2021	0,18	7,12	100,02	-0,00%	29012	4,64	16.11.2022	0,09	8,18	99,00	+0,07%
26224	6,90	23.05.2029	5,88	7,34	97,64	+0,39%	29010	6,01	06.12.2034	0,26	8,05	108,35	-0,12%
26221	7,70	23.03.2033	7,85	7,53	102,35	+1,04%	26209	7,60	20.07.2022	0,75	7,62	100,35	+0,03%
46011	10,00	20.08.2025	3,56	-3,76	165,88	-1,21%	29008	5,57	03.10.2029	8,07	8,18	104,22	+0,11%
46022	5,50	19.07.2023	1,22	6,10	98,50	-0,35%	26229	7,15	12.11.2025	3,52	7,38	99,60	+0,35%
26222	7,10	16.10.2024	2,68	7,35	99,55	+0,18%	26212	7,05	19.01.2028	5,10	7,37	98,90	+0,50%
46012	6,57	05.09.2029	5,66	6,92	100,00	+0,00%	26230	7,70	16.03.2039	9,94	7,64	102,00	+1,13%

Итоги торгов наиболее ликвидными российскими рублевыми корпоративными и муниципальными облигациями

Выпуск	Цена закрытия	Изм. цены за день (%)	Объемы торгов (млн. руб.)	Выпуск	Цена закрытия	Изм. цены за день (%)	Объемы торгов (млн. руб.)
МосОбл2017	99.9	+0.01	238	ЕврХол2Р1R	99.8	-0.55	20
РЖД 1Р-17R	95.95	-0.04	157	ПСБ 3Р-07	99.8	+0.02	19
Систем1Р13	95.1	+0.11	147	ГарИнв1Р05	99.54	-0.01	18
ЛидерИнП03	99	+0.02	111	РусАква1Р1	100.95	+0.15	18
КОБР-48	100	-0.1	74	Джи-гр 2Р1	99.97	+0.17	16
КАМАЗ БОП2	100	0	60	СберИОС160	104.4	-1	15
ГПБ001Р09Р	100.4	-0.04	51	Казахст01	95.5	-0.49	15
УркаПБО5Р	100.06	0	50	КАМАЗ БОП3	100	0	14
Магнит2Р02	98.15	0	50	Аэрофл БО1	100.75	+0.43	14
ТКХ БП1	100.35	+0.24	41	ГТЛК 1Р-15	98.59	-0.1	14
ВЭБ ПБО1Р5	100.43	-0.04	38	Пионер 1Р5	99.4	-0.06	14
АльфаБ2Р10	95.94	-0.27	33	іСЛТ001Р04	99.71	+0.1	13
Сбер Sb12R	100.2	+0.16	32	іРОСНАН2Р3	99.41	+0.01	12
РЖД-19 обл	101.69	+0.79	30	ЛСР БО 1Р2	100.37	-0.13	12
ГТЛК 1Р-20	100.5	+1	30	Сбер Sb24R	98.3	+0.31	11
Роснефть08	99.5	+0.03	27	МКБ 1Р2	99.93	-0.02	11
ЛСР БО 1Р4	99.78	-0.08	26	Роснефть05	100.08	-0.22	11
Славнеф1Р2	100.75	-0.15	26	ГТЛК 1Р-04	102.2	+0.05	11
ВТБРКС01	99.8	+0.01	26	Самолет1Р9	99.69	+0.01	11
СамолетР10	99.7	+0.02	24	Новотр 1Р1	99.95	+0.06	11
СовкомБОП3	99.67	-0.03	22	АЛЬФА-БС01	107.24	-0.01	10
РитейлБФ01	100.46	-0.03	21	Славнеф1Р3	98.5	0	10
Сбер Sb14R	99.97	-0.01	21	Брус 1Р02	99.8	+0.05	10

Итоги торгов еврооблигациями нефтегазового сектора

Выпуск	Купон	Погашение	Колл-опцион	Дн. до след. куп.	Доходность	Дюрация	Цена посл. сделки	Z-спрэд	Изм. цены	Изм. цены за нед.	Изм. цены за месяц	Объем выпуска, млн у.е	Валюта (у.е.)	Moody's	Fitch	S&P
Газпром 22	6,51	07.03.2022	N.A.	145	0,41	0,40	102,43	27	-0,06	-0,06	-0,49	1 300	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 22-2	4,95	19.07.2022	N.A.	98	0,96	0,75	103,04	81	-0,04	-0,11	-0,50	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 25 (EUR)	4,36	21.03.2025	N.A.	160	1,04	3,21	111,18	133	-0,01	-0,14	-0,32	200	EUR	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 26	5,15	11.02.2026	N.A.	121	2,52	3,93	110,72	155	+0,43	-0,33	-1,42	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 27	4,95	23.03.2027	N.A.	161	2,85	4,86	110,51	170	+1,04	-1,71	-3,00	750	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 28	4,95	06.02.2028	N.A.	116	3,14	5,50	110,29	188	+0,43	-0,33	-1,42	900	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 34	8,63	28.04.2034	N.A.	15	4,02	8,51	145,00	241	+1,04	-1,71	-3,00	1 200	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 37	7,29	16.08.2037	N.A.	126	4,16	10,50	136,06	245	+0,36	-1,68	-3,09	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 22	4,38	19.09.2022	N.A.	157	1,01	0,92	103,12	85	-0,03	-0,10	-0,42	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 23	6,00	27.11.2023	N.A.	45	1,36	1,99	109,68	91	-0,19	-0,34	-0,63	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Лукойл 22	6,66	07.06.2022	N.A.	55	0,72	0,63	103,84	54	+0,33	+1,24	-0,58	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 23	4,56	24.04.2023	N.A.	11	1,27	1,47	104,98	98	-0,04	-0,12	-0,72	1 500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 26	4,75	02.11.2026	N.A.	20	2,55	4,49	110,35	146	-	-	+0,05	1 000	USD		BBB+	BBB
НК Альянс 20	8,00	04.05.2023	N.A.	22	13,86	0,74	96,07	1 597	-	-	+0,05	500	USD		WD	NR
Новатэк 22	4,42	13.12.2022	N.A.	61	0,91	1,14	104,07	71	-0,01	-0,08	-0,20	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB
Роснефть 22	4,20	06.03.2022	N.A.	144	0,92	0,40	101,30	78	-0,07	-0,06	-0,31	2 000	USD	Baa3	WD	BBB-

Итоги торгов еврооблигациями финансового сектора

Выпуск	Купон	Погашение	Колл-опцион	Дн. до след. куп.	Доходность	Дюрация	Цена посл. сделки	Z-спрэд	Изм. цены	Изм. цены за нед.	Изм. цены за месяц	Объем выпуска, млн у.е	Валюта (у.е.)	Moody's	Fitch	S&P
АкБарс 22	8,00	13.07.2022	N.A.	92	3,30	0,73	103,45	314	-0,08	-0,49	-1,17	600	USD			WD
Альфа Банк 25	9,50	18.02.2025	N.A.		N.A.	N.A.	N.A.	N.A.				250	USD	B1u		WD
Восточный Экспресс Банк	2,00	N.A.	N.A.	47	6,09	16,57	32,83	562	-0,03	-0,06	-0,96	125	USD	WR		
ВТБ 22	6,95	17.10.2022	N.A.	4	2,49	0,96	104,43	231	-0,03	-0,11	-0,50	1 500	USD	Ba2	WD	B-
ВТБ 24 (CHF)	4,07	24.10.2024	N.A.	12	2,89	2,81	103,37	N.A.	-0,01	+0,06	-0,16	350	CHF			
ВТБ 35	6,25	30.06.2035	N.A.	78	4,80	9,57	114,43	314	+0,03	-0,07	+0,08	1 000	USD	Baa3	WD	BBB-
ВЭБ 2022	6,03	05.07.2022	N.A.	84	1,15	0,71	103,52	100	-	-0,24	-0,56	1 000	USD			BBB
ВЭБ 2023	5,94	21.11.2023	N.A.	39	1,70	1,97	108,73	126	-0,03	-0,31	-1,03	1 150	USD			BBB
ВЭБ 2023 (EUR)	4,03	21.02.2023	N.A.	132	0,58	1,32	104,66	105	-0,00	-0,00	-0,39	500	EUR			BBB
ВЭБ 2025	6,80	22.11.2025	N.A.	40	2,36	3,61	117,30	143	-0,00	-0,34	-1,01	1 000	USD			BBB
МКБ 25 (RUB)	16,50	26.05.2025	N.A.	45	11,17	2,78	115,48	337	+0,23	+0,43	-1,81	5 000	RUB			B+
Открытие Холдинг 17 (RUB)	9,00	18.06.2022	N.A.	67	7,29	0,66	101,26	-60	-0,04	-0,07	-0,44	18 000	RUB			
РСХБ 23	8,50	16.10.2023	N.A.	3	2,15	1,83	112,41	174	-0,02	-0,16	-0,62	500	USD		NR	
Сбербанк 22	6,13	07.02.2022	N.A.	117	0,55	0,32	101,76	41	-0,06	-0,17	-0,56	1 500	USD	Baa3		BBB
Сбербанк 22-2	5,13	29.10.2022	N.A.	16	1,42	1,01	103,83	124	+0,11	-0,12	-0,39	2 000	USD	Ba1		BBB-
Сбербанк 23	5,25	23.05.2023	N.A.	41	1,77	1,54	105,51	147	-0,05	-0,11	-0,24	1 000	USD			BBB-

Итоги торгов еврооблигациями металлургического сектора, транспорта и связи

Выпуск	Купон	Погашение	Колл-опцион	Дн. до след. куп.	Доходность	Дюрация	Цена посл. сделки	Z-спрэд	Изм. цены	Изм. цены за нед.	Изм. цены за месяц	Объем выпуска, млн у.е	Валюта (у.е.)	Moody's	Fitch	S&P
DME Airport 2021	5,88	11.11.2021	N.A.			N.A.	N.A.	N.A.	-	-	-	350	USD		PIF	NR
Global Ports 22	6,87	25.01.2022	N.A.	104	1,08	0,28	101,63	95	-0,07	-0,11	-0,96	350	USD	Ba2		BB+
Global Ports 23	6,50	22.09.2023	N.A.	160	1,56	1,85	109,42	117	-0,05	-0,15	-0,62	350	USD	Ba2		WD
Алроса 24	4,65	09.04.2024	09.01.2024	178	1,55	2,15	106,80	107	-	-	-	500	USD			BBB
Вымпелком 22	7,50	01.03.2022	N.A.	139	1,88	0,38	102,13	174	-0,06	-0,13	-1,02	1 500	USD	Ba2u		BBB-
Вымпелком 23	5,95	13.02.2023	N.A.	123	1,40	1,29	105,98	117	-0,03	-0,24	-0,59	1 000	USD	Ba2u		BBB-
ГТЛК 21	5,95	19.07.2021	N.A.			N.A.	N.A.	N.A.	-	-	-	500	USD	WR		NR
МТС 23	5,00	30.05.2023	N.A.	48	1,50	1,56	105,61	120	-0,03	-0,10	-0,38	500	USD	Baa3u		BB+
Норникель 2022	6,63	14.10.2022	N.A.	1	1,10	0,96	105,50	92	-0,04	-0,15	-0,49	1 000	USD	Baa2		BBB-
Норникель 2023	4,10	11.04.2023	11.01.2023	180	1,41	1,22	103,31	119	-0,02	-0,11	-0,55	1 000	USD			BBB-
РЖД 2022	5,70	05.04.2022	N.A.	174	1,06	0,48	102,21	91	-0,00	-0,08	-0,72	1 400	USD	Baa2		BBB
РЖД 2023 (EUR)	4,60	06.03.2023	N.A.	145	0,12	1,36	106,26	58	-0,04	-0,08	-0,58	500	EUR	Ba2		BBB
РЖД 2031 (GBP)	7,49	25.03.2031	N.A.	164	3,36	7,30	133,14	214	+0,14	+0,01	-0,61	650	GBP	Baa2		BBB
Северсталь 22	5,90	17.10.2022	N.A.	4	0,99	0,97	104,93	81	-0,05	-0,08	-0,72	750	USD	Baa2		BBB
Сибур 2023	4,13	05.10.2023	05.07.2023	174	1,26	1,68	104,89	93	-0,06	-0,12	-0,39	500	USD	Baa3		BBB-
ТМК 27	4,30	12.02.2027	N.A.	122	4,08	4,79	101,03	295				500	USD	B1		B+

Календарь событий долговых рынков на 8 октября

Размещение	
ВЭБ.РФ-ПБО-001Р-К350	20 000 000 000 RUR
ВТБ-КС-4-112	50 000 000 000 RUR
Погашение	
ВТБ-КС-4-111	50 000 000 000 RUR
ВЭБ.РФ-ПБО-001Р-К341	20 000 000 000 RUR
РЕНЕССАНС СТРАХОВАНИЕ-001Р-01R	3 000 000 000 RUR
СБЕРБАНК-БСО-SBER_PRT-42М-001Р-05R	1 000 000 000 RUR
ТРАНСНЕФТЬ-БО-001Р-10	15 000 000 000 RUR
Оферта	
ЕВРОПЛАН-БО-07	5 000 000 000 RUR
РЕНЕССАНС СТРАХОВАНИЕ-001Р-01R	3 000 000 000 RUR

Заявление об ограничении ответственности. Настоящие обзоры подготовлены в информационных целях, Они ни в коем случае не являются и не должны рассматриваться как предложение купить или продать соответствующие ценные бумаги, Информация, содержащаяся в данных обзорах, получена из вызывающих доверия открытых источников, Несмотря на то, что при подготовке обзоров были предприняты необходимые меры для получения достоверной информации, ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ" не исключает возможность включения в обзор ошибочной информации, предоставленной соответствующими источниками, и не несет за это ответственности, ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ", его работники и клиенты могут быть заинтересованы в покупке или продаже ценных бумаг, упомянутых в обзорах.

ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ"

<http://www.russ-invest.com>

Москва

Тел: +7(495) 363-93-80

Факс: +7(495) 363-93-90

E-mail: mail@russ-invest.com

Адрес: Москва, 119019, 5-3/12 Нащокинский переулок

© 2007 | ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ"

Лицензия № 045-11769-001000

Лицензия № 045-08757-000100

Лицензия № 045-06310-100000

Лицензия № 045-06312-010000