

Комментарий

В четверг 23 сентября, снижением на 0,02% отметился индекс корпоративных облигаций RUCBITR. В зеленой зоне среди корпоративных долговых бумаг закрылись выпуски СПбТел 07, МОСТРЕСТ 7, РСХБ 01Т1 и ИА ДОМ БР2, которые прибавили 0,05-0,49%. В числе аутсайдеров торговались выпуски РСХБ 15, ВТБРКО1 и РитейлБФ01, снизившись на 0,04-0,06%.

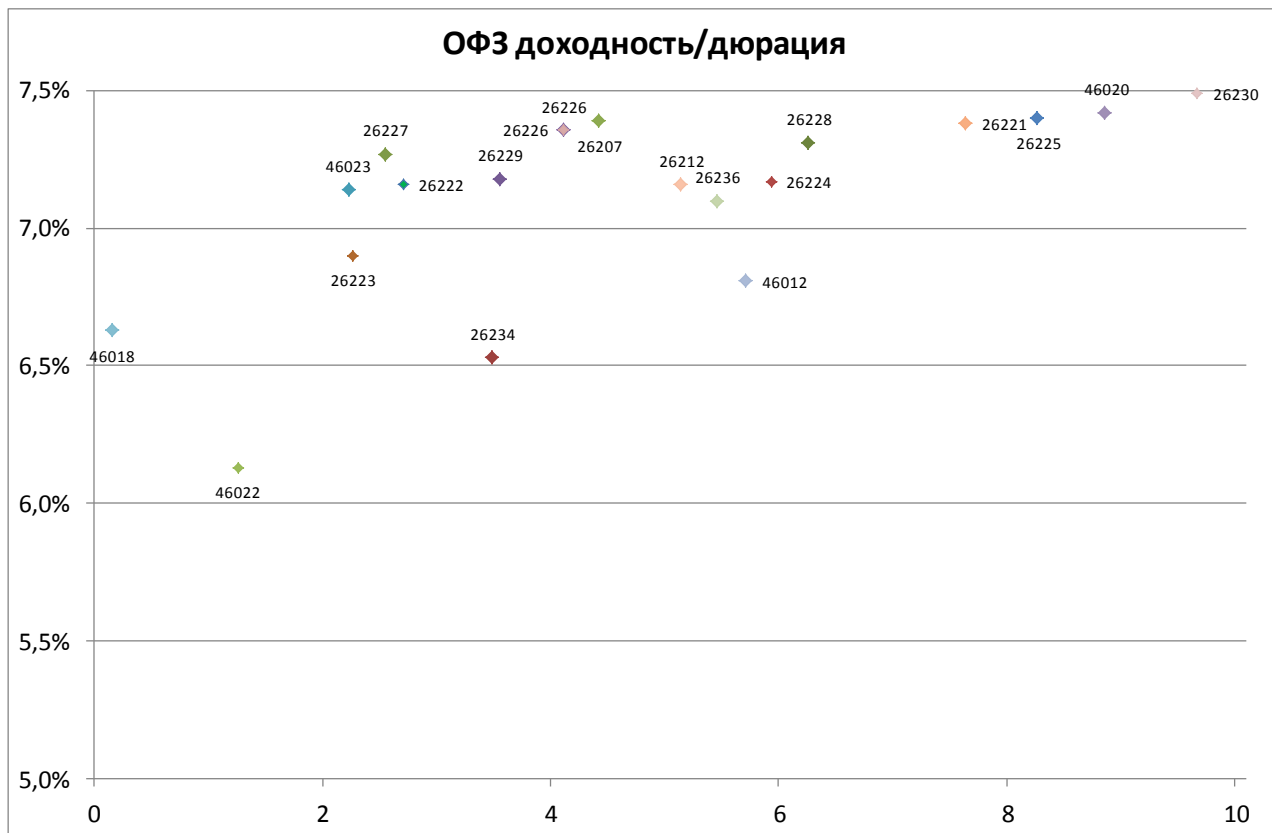
Индекс муниципальных облигаций RUMBITR вырос на 0,01%. Среди лидеров торгов стоит отметить выпуски Новсиб 7об и Краснодар 20, которые выросли на 1,14% и 0,17% соответственно. Противоположным образом закрылись выпуски Новосиб10 и КрасЯрск13, потерявшие на прошедших торгах 0,83% и 0,23% соответственно.

Индекс государственных облигаций RGBITR показал снижение на 0,23%. Значительным ростом среди ОФЗ отметились выпуски 46011 и 46012, которые прибавили 18,23% и 3,43% соответственно. В лидерах снижения оказались выпуски 26230, 26221, 26225 и 46020, потеряв 0,36-0,67%.

Индикаторы рынка

	Значение закрытия	Изм. к пред. дню	Изм. за неделю	Изм. за мес.
Золото	1742,76	-1,44%	-0,66%	-2,69%
Нефть Brent	77,25	+1,37%	+2,54%	+6,92%
5-летний CDS	84	+0,83%	+9,93%	+3,17%
Бивалютная корзина	78,45	-0,15%	-0,25%	-1,68%
Mosprime o/n	6,93	-0,03	-0,04	+0,25
Депозиты в ЦБ	579,3	-4,7	-179,9	-411,66
Остатки на корп. сч.	3771,4	+40,4	+309,5	+229,70
UST 2	0,26	+0,02	+0,04	+0,02
UST 10	1,43	+0,13	+0,07	+0,09
Russia 2028	2,04	+0,02	+0,02	+0,00
Brazil 2028	5,91	+0,19	+0,21	+0,54
Turkey 2028	5,52	+0,25	+0,26	+0,63
Portugal 10 yr	0,28	+0,06	+0,02	+0,08
Ireland 10 yr	0,10	+0,06	+0,01	+0,14
Italy 10 yr	0,72	+0,06	-0,00	+0,06
Greece 10 yr	0,77	+0,04	-0,04	+0,13
Spain 10 yr	0,37	+0,06	+0,02	+0,07

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	4,12	N.A.	104,05	-0,24%	26207	8,15	03.02.2027	4,43	N.A.	105,29	-0,08%
26227	7,40	17.07.2024	2,55	N.A.	100,93	-0,12%	26236	5,70	17.05.2028	5,46	N.A.	92,91	
26234	4,50	16.07.2025	3,49	N.A.	91,65	-	26220	7,40	07.12.2022	1,14	N.A.	100,47	-0,11%
46020	6,90	06.02.2036	8,87	N.A.	96,41	-0,36%	29007	6,46	03.03.2027	0,44	N.A.	102,41	-0,07%
46018	6,50	24.11.2021	0,16	N.A.	100,00	-0,06%	26215	7,00	16.08.2023	1,79	N.A.	100,05	-0,10%
46023	8,16	23.07.2026	2,23	N.A.	103,00	-0,19%	29006	6,59	29.01.2025	0,34	N.A.	101,11	-0,06%
26223	6,50	28.02.2024	2,27	N.A.	98,85	-0,10%	26211	7,00	25.01.2023	1,28	N.A.	100,00	-0,07%
29009	5,74	05.05.2032	0,19	N.A.	106,15	-0,08%	26219	7,75	16.09.2026	4,23	N.A.	103,10	-0,20%
26225	7,25	10.05.2034	8,27	N.A.	100,02	-0,53%	26218	8,50	17.09.2031	6,81	N.A.	110,00	-0,43%
26228	7,65	10.04.2030	6,26	N.A.	103,92	-0,31%	26217	7,50	18.08.2021	N.A.	N.A.	N.A.	-
25083	7,00	15.12.2021	0,22	N.A.	100,01	-0,01%	29012	4,64	16.11.2022	0,13	N.A.	98,97	-0,06%
26224	6,90	23.05.2029	5,93	N.A.	99,18	-0,41%	29010	6,01	06.12.2034	0,29	N.A.	108,58	+0,06%
26221	7,70	23.03.2033	7,63	N.A.	104,10	-0,52%	26209	7,60	20.07.2022	0,79	N.A.	100,45	-0,18%
46011	10,00	20.08.2025	3,59	N.A.	166,00	+18,23%	29008	5,57	03.10.2029	0,10	N.A.	104,26	+0,01%
46022	5,50	19.07.2023	1,26	N.A.	98,50	+0,00%	26229	7,15	12.11.2025	3,56	N.A.	100,53	-0,09%
26222	7,10	16.10.2024	2,72	N.A.	100,20	-0,09%	26212	7,05	19.01.2028	5,15	N.A.	100,19	-0,25%
46012	6,57	05.09.2029	5,71	N.A.	103,99	+3,42%	26230	7,70	16.03.2039	9,68	N.A.	103,80	-0,67%

Итоги торгов наиболее ликвидными российскими рублевыми корпоративными и муниципальными облигациями

Выпуск	Объемы торгов (руб.)	Цена закрытия	Выпуск	Объемы торгов (руб.)	Цена закрытия
ВЭБлизинг9	95 070 534	100	Росагрл1Р3	1 839 000	100
РСХБ 15	70 740 943	99,94	Атомстр 01	1 269 760	100,08
СПБТел 07	47 635 050	101,25	ИА ДОМ 6Р2	1 232 614	104
МОСТРЕСТ 7	45 541 164	99,49	Башнефть06	1 023 010	100
ВТБСУБТ1-3	10 616 929	97,1171	РСХБ 09Т1	981 566	100,09
ДОМ.РФ15о6	9 818 410	112	ВЭББНКР 01	830 868	99,99
ВТБРКС01	9 375 154	100,01	ФСК ЕЭС-22	731 882	100,9
КарМани 01	9 034 479	99,95	ДонЛом001Р	705 162	102
РитейлБФ01	7 755 392	100,68	РЖД-32 обл	681 534	100,54
ИА ДОМ 5Р1	5 623 725	96,66	ВЭБлизинг8	672 191	100,04
РСХБ 08Т1	4 879 516	119,59	Займер 03	572 983	100,1
ВЭБ.РФ 19	4 558 287	99,7	АйДиКоле01	418 720	98,06
МаниМен 02	4 320 271	99,88	МаниМен 03	379 065	100
Росагрл1Р1	4 064 999	96,95	Роснефть05	279 070	100,4
МФК ЦФПО02	3 478 492	100	іРОСНАНО 8	241 654	103
РСХБ 01Т1	3 448 697	100,03	МигКр 01К	223 851	99,02
Росагрл1Р2	3 058 009	98,82	Продкорп01	194 770	101,95
Роснефть07	2 515 003	99,84	Маньч02	172 671	100,99
АйДиЭф03	2 513 385	100,59	ЮниМетр01	167 736	101,17
АПРИФП 05	2 425 721	100	КировЗд1Р1	159 759	100,39
Страна 01	2 379 229	100,73	ИнфрОблР1	130 348	100,25
Займер 02	1 960 163	100	РусГидро08	128 587	94,98
РЖД-19 обл	1 901 748	101,39	Роснефть04	119 750	100,45

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.	160	0,48	0,44	102,66	33	-0,01	-0,08	-0,37	1 300	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 22-2	4,95	19.07.2022	N.A.	113	0,77	0,80	103,36	61	-0,03	-0,09	-0,25	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 25 (EUR)	4,36	21.03.2025	N.A.	174	0,97	3,25	111,56	129	-0,07	-0,10	+0,13	500	EUR	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 26	5,15	11.02.2026	N.A.	136	2,22	3,97	112,12	131	-0,32	-0,43	+0,11	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 27	4,95	23.03.2027	N.A.	176	2,64	4,91	111,74	158	-1,01	-0,48	-0,39	750	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 28	4,95	06.02.2028	N.A.	131	2,92	5,55	111,71	176	-0,32	-0,43	+0,11	900	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 34	8,63	28.04.2034	N.A.	30	3,75	8,60	148,59	229	-1,01	-0,48	-0,39	1 200	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 37	7,29	16.08.2037	N.A.	141	3,92	10,61	139,53	237	-1,01	-0,59	+0,10	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 22	4,38	19.09.2022	N.A.	172	0,89	0,96	103,38	72	+0,04	+0,06	-0,29	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 23	6,00	27.11.2023	N.A.	60	1,15	2,03	110,34	73	+0,02	-0,12	-0,15	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Лукойл 22	6,66	07.06.2022	N.A.	70	0,41	0,68	104,31	22	-0,02	-0,10	-0,32	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 23	4,56	24.04.2023	N.A.	26	0,97	1,51	105,60	69	-0,03	+0,01	-0,36	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 26	4,75	02.11.2026	N.A.	35	2,26	4,54	111,91	124	-	-	+0,21	1 000	USD		BBB+	BBB
НК Альянс 20	8,00	04.05.2023	N.A.	37	14,61	0,79	95,31	1 687	-	-	+0,21	500	USD		WD	NR
Новатэк 22	4,42	13.12.2022	N.A.	76	0,80	1,18	104,34	61	+0,01	-0,13	-0,26	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB
Роснефть 22	4,20	06.03.2022	N.A.	159	0,84	0,44	101,47	69	-0,01	-0,08	-0,23	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.	108	2,94	0,78	103,94	278	-0,07	-0,24	-0,85	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.	63	6,09	16,63	32,86	585	-0,00	-0,69	+1,14	125	USD	WR		
ВТБ 22	6,95	17.10.2022	N.A.	20	2,25	1,01	104,88	207	-0,01	-0,12	-0,39	1 500	USD	Ba2	WD	B-
ВТБ 24 (CHF)	4,07	24.10.2024	N.A.	27	2,93	2,85	103,32	N.A.	+0,01	+0,08	-0,34	350	CHF			
ВТБ 35	6,25	30.06.2035	N.A.	94	4,81	9,61	114,35	336	+0,01	-0,00	+0,67	1 000	USD	Baa3	WD	BBB-
ВЭБ 2022	6,03	05.07.2022	N.A.	100	0,90	0,76	103,93	74	-0,00	-0,17	-0,46	1 000	USD			BBB
ВЭБ 2023	5,94	21.11.2023	N.A.	55	1,45	2,02	109,48	105	+0,13	-0,13	-0,28	1 150	USD			BBB
ВЭБ 2023 (EUR)	4,03	21.02.2023	N.A.	147	0,51	1,37	104,90	98	-0,02	-0,11	-0,31	500	EUR			BBB
ВЭБ 2025	6,80	22.11.2025	N.A.	56	2,20	3,66	118,16	135	-0,01	-0,17	-0,15	1 000	USD			BBB
МКБ 25 (RUB)	16,50	26.05.2025	N.A.	60	10,97	2,82	116,26	352	+0,15	-1,07	-5,99	5 000	RUB			B+
Открытие Холдинг 17 (RUB)	9,00	18.06.2022	N.A.	82	7,31	0,70	101,31	-36	-0,05	-0,16	-0,41	18 000	RUB			
РСХБ 23	8,50	16.10.2023	N.A.	19	1,99	1,87	113,02	162	+0,07	-0,21	-0,26	500	USD		NR	
Сбербанк 22	6,13	07.02.2022	N.A.	133	0,39	0,36	102,07	23	-0,01	-0,12	-0,51	1 500	USD	Baa3		BBB
Сбербанк 22-2	5,13	29.10.2022	N.A.	32	1,31	1,05	104,11	113	-0,02	-0,12	-0,23	2 000	USD	Ba1		BBB-
Сбербанк 23	5,25	23.05.2023	N.A.	57	1,74	1,58	105,71	145	-0,01	-0,12	-0,11	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 23	6,87	25.01.2022	N.A.	124	0,52	0,34	102,15	38	-0,05	-0,31	-0,45	350	USD	Ba2		BB+
Global Ports 22	6,50	22.09.2023	N.A.	180	1,55	1,91	109,71	122	-0,17	-0,37	-0,37	350	USD	Ba2	WD	
Алроса 24	4,65	09.04.2024	09.01.2024	16	1,20	2,16	107,80	80	-	-	-	500	USD			BBB
Вымпелком 22	7,50	01.03.2022	N.A.	159	0,68	0,44	102,98	53	-0,05	-0,10	+0,06	1 500	USD	Ba2u		BBB-
Вымпелком 23	5,95	13.02.2023	N.A.	143	1,22	1,35	106,49	101	-0,15	-0,28	-0,20	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.	68	1,42	1,62	105,95	116	-0,07	-0,15	-0,30	500	USD	Baa3u		BB+
Норникель 2022	6,63	14.10.2022	N.A.	21	0,95	1,01	105,97	77	-0,09	-0,10	-0,55	1 000	USD	Baa2		BBB-
Норникель 2023	4,10	11.04.2023	11.01.2023	18	1,13	1,26	103,82	94	-0,03	-0,05	-0,12	1 000	USD			BBB-
РЖД 2022	5,70	05.04.2022	N.A.	12	0,33	0,52	102,86	17	-0,05	-0,03	-0,33	1 400	USD	Baa2		BBB
РЖД 2023 (EUR)	4,60	06.03.2023	N.A.	164	0,07	1,41	106,57	55	-0,10	-0,18	-0,40	500	EUR	Ba2		BBB
РЖД 2031 (GBP)	7,49	25.03.2031	N.A.	2	3,28	7,16	134,15	233	-0,01	-0,01	+0,09	650	GBP	Baa2		BBB
Северсталь 22	5,90	17.10.2022	N.A.	24	0,75	1,03	105,46	58	-0,09	-0,12	-0,39	750	USD	Baa2		BBB
Сибур 2023	4,13	05.10.2023	05.07.2023	12	1,15	1,71	105,23	87	-0,07	-0,04	-0,15	500	USD	Baa3		BBB-
ТМК 27	4,30	12.02.2027	N.A.	142	4,04	4,85	101,24	308				500	USD	B1		B+

Календарь событий долговых рынков на 24 сентября

Размещение	
ИСК ПЕТРОИНЖИНИРИНГ-001P-01	500 000 000 RUR
ПЕРВОЕ КОЛЛЕКТОРСКОЕ БЮРО-001P-02	1 500 000 000 RUR
ВЭБ.РФ-ПБО-001P-K343	20 000 000 000 RUR
ВТБ-КС-4-102	50 000 000 000 RUR
Погашение	
ВТБ-КС-4-101	50 000 000 000 RUR
ВЭБ.РФ-ПБО-001P-K335	20 000 000 000 RUR
СБЕРБАНК-001P-SBER13	40 000 000 000 RUR
СБЕРБАНК-ИОС-BSK_FIX_MEM-24M-001P-137R	3 000 000 000 RUR
Оферта	
КОНЦЕРН РОССИУМ-01	10 000 000 000 RUR
САМАРАТРАНСНЕФТЬ-ТЕРМИНАЛ-БО-02	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