

Комментарий

В четверг, 19 августа, снижением на 0,02% отметился индекс корпоративных облигаций RUCBITR. Лучше индекса среди корпоративных долговых бумаг торговались выпуски Роснфт2P5, МОСТРЕСТ 7, РЖД-41 обл и АЛЬФАБ2P10, которые выросли на 0,11-0,46%. В числе аутсайдеров торговались выпуски ФСК ЕЭС БЗ, Самолет1P9, ТрансмхПББ и МТС 1P-06, потеряв на торгах 0,19-0,59%.

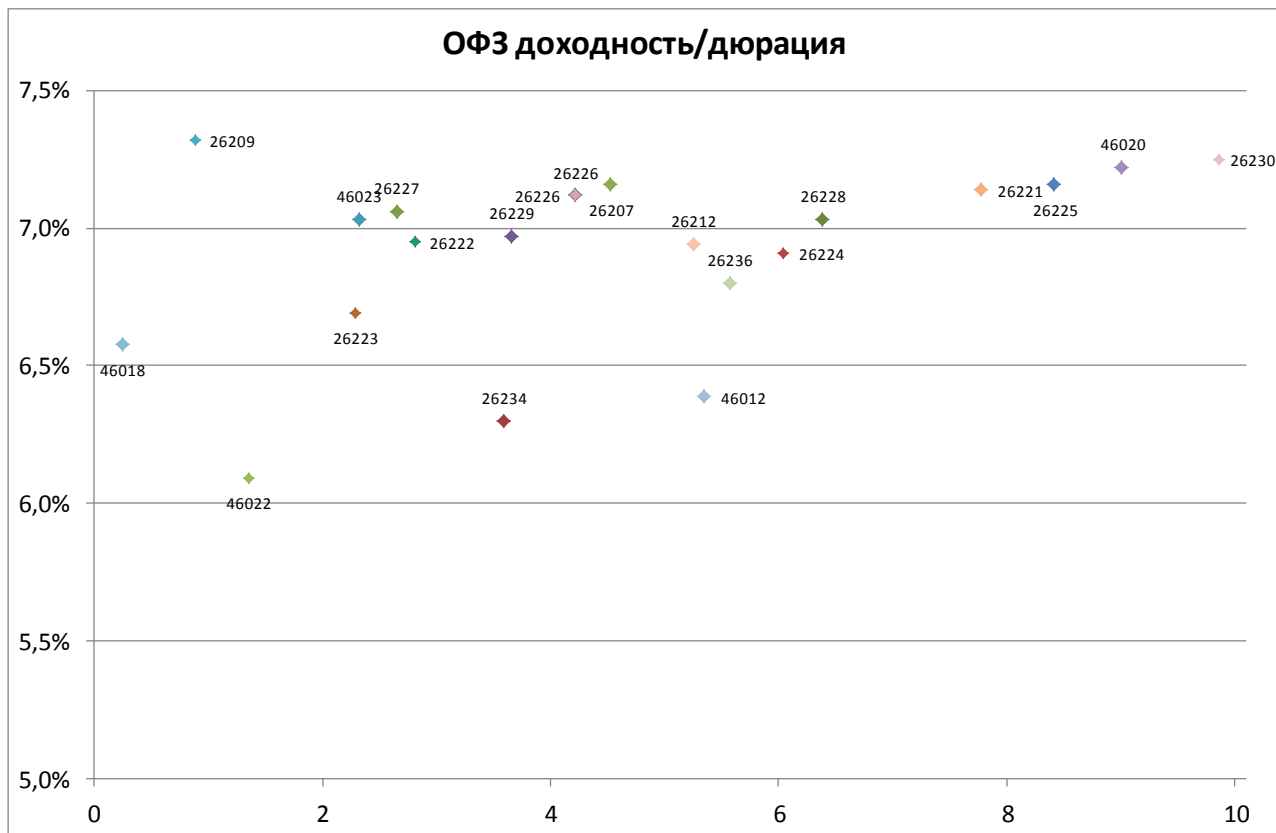
Индекс муниципальных облигаций RUMBITR продемонстрировал отрицательную динамику, снизившись на 0,10%. Среди лидеров роста стоит отметить выпуски ИркОбл2016 и Казахст13, которые прибавили 0,44% и 0,30% соответственно. В красной зоне закрылись выпуски СвердлОб11 и Новосиб 19, упав на 0,75% и 0,60% соответственно.

Индекс государственных облигаций RGBITR потерял 0,03%. Значительным ростом среди ОФЗ отметился выпуск 46011, прибавив 5,46%. В зеленой зоне также торговались выпуски 46012, 46023, 26209 и 26211, которые прибавили 0,04-1,33%. В лидерах снижения оказались выпуски 26221, 26228, 26225 и 26230, которые снизились на 0,41-0,55%.

Индикаторы рынка

	Значение закрытия	Изм. к пред. дню	Изм. за неделю	Изм. за мес.
Золото	1780,38	-0,42%	+0,04%	-1,29%
Нефть Brent	66,45	-2,68%	-5,86%	-8,00%
5-летний CDS	87	+1,45%	+2,47%	+0,95%
Бивалютная корзина	79,87	+0,50%	+0,81%	-0,14%
Mosprime o/n	6,67	-0,05	+0,13	+0,61
Депозиты в ЦБ	989,6	-15,9	-189,0	+317,92
Остатки на корп. сч.	3591,7	-105,1	+222,5	-367,40
UST 2	0,22	+0,00	+0,01	+0,01
UST 10	1,24	-0,01	-0,03	-0,05
Russia 2028	2,04	-0,01	-0,03	-0,09
Brazil 2028	5,52	+0,04	+0,01	+0,00
Turkey 2028	5,05	+0,06	+0,03	-0,04
Portugal 10 yr	0,11	+0,01	+0,00	-0,14
Ireland 10 yr	-0,11	-0,01	-0,02	-0,11
Italy 10 yr	0,56	+0,01	+0,02	-0,13
Greece 10 yr	0,55	+0,01	+0,01	-0,13
Spain 10 yr	0,22	+0,00	+0,00	-0,06

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	4,22	7,12	105,25	-0,24%	26207	8,15	03.02.2027	4,53	7,16	106,31	-0,41%
26227	7,40	17.07.2024	2,65	7,06	101,80	-	26236	5,70	17.05.2028	5,57	6,80	94,07	-
26234	4,50	16.07.2025	3,59	6,30	92,38	+0,02%	26220	7,40	07.12.2022	1,24	7,15	101,00	+0,00%
46020	6,90	06.02.2036	9,01	7,22	98,25	-0,14%	29007	5,45	03.03.2027	0,07	8,29	102,30	+0,00%
46018	6,50	24.11.2021	0,25	6,58	100,15	+0,05%	26215	7,00	16.08.2023	1,88	6,94	100,60	-
46023	8,16	23.07.2026	2,32	7,03	103,50	+0,17%	29006	6,15	29.01.2025	0,44	8,31	101,34	+0,00%
26223	6,50	28.02.2024	2,29	6,69	99,49	-0,10%	26211	7,00	25.01.2023	1,37	6,93	100,65	+0,05%
29009	5,74	05.05.2032	0,28	8,08	106,30	-0,14%	26219	7,75	16.09.2026	4,18	7,05	104,30	-0,11%
26225	7,25	10.05.2034	8,42	7,16	101,71	-0,48%	26218	8,50	17.09.2031	6,94	7,12	111,90	-0,16%
26228	7,65	10.04.2030	6,38	7,03	105,55	-0,55%	26217	7,50	18.08.2021	N.A.	N.A.	N.A.	-
25083	7,00	15.12.2021	0,30	7,02	100,20	+0,00%	29012	4,64	16.11.2022	0,22	8,23	98,84	-0,04%
26224	6,90	23.05.2029	6,05	6,91	100,74	-0,27%	29010	6,01	06.12.2034	0,38	8,05	108,50	+0,01%
26221	7,70	23.03.2033	7,77	7,14	105,95	-0,42%	26209	7,60	20.07.2022	0,89	7,32	100,99	+0,04%
46011	10,00	20.08.2025	3,47	0,51	163,97	+5,46%	29008	5,57	03.10.2029	0,17	8,17	104,30	-0,10%
46022	5,50	19.07.2023	1,36	6,09	98,55	-0,06%	26229	7,15	12.11.2025	3,66	6,97	101,39	-0,19%
26222	7,10	16.10.2024	2,81	6,95	101,00	-	26212	7,05	19.01.2028	5,25	6,94	101,48	-0,30%
46012	9,72	05.09.2029	5,35	6,39	106,00	+1,33%	26230	7,70	16.03.2039	9,87	7,25	105,90	-0,41%

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.)
ГТЛК 1Р-15	99,81	+0,02	341	АЛЬФАБ2Р10	97,25	+0,14	48
Магнит2Р02	98,98	-0,02	223	ВЭБ1Р-22	97	+0,09	45
МОСТРЕСТ 7	99,6	+0,11	213	ГТЛК 1Р-14	101,55	-0,03	45
ПСБ 3Р-05	99,98	+0,01	202	ГТЛК 1Р-13	100,9	+0,01	42
ФолксвБ1Р3	100,8	+0,02	172	Новосиб 19	101,8	-0,6	37
РСХБ 23	100,33	-0,14	144	МКБ 1Р2	100,1	+0,02	36
ГТЛК 1Р-16	97,25	0	131	МОЭК БО1Р1	100,75	+0,12	34
МТС 001Р-3	100,44	+0,02	117	СберБ БО4R	99,99	-0,02	32
ТрнфБО1Р9	100,06	-0,01	102	РУСАБрБ2Р1	97,38	-0,1	31
Роснфт2Р5	100,41	+0,46	99	ВТБСУБТ2-1	92,6	-0,4	27
ВЭБ 1Р-21	96,99	-0,2	94	Ростел1Р3R	100,53	-0,03	26
Самолет1Р9	100,45	-0,19	88	ВЭБ 1Р-12	100,76	-0,23	26
Сбер Sb32R	100,09	-0,11	77	ВТБРКС01	100,09	+0,08	25
Сбер Sb17R	96,85	0	77	РЖД-41 обл	99,35	+0,15	24
МКБ 1Р1	100,65	-0,1	74	СберБ Б12R	100,4	0	24
Росбанк2Р4	100,9	+0,05	74	ИКС5Фин1Р7	99,59	-0,01	23
МТС 1Р-06	99,96	-0,22	69	Казахст01	96	+0,1	21
РоссетБ1Р1	100,8	+0,01	68	Система1Р9	101,18	+0,01	21
ФСК ЕЭС Б3	100,66	-0,59	67	Сбер Sb24R	98,71	-0,12	20
Курск35001	101,65	-0,12	53	ГТЛК 1Р-03	107,14	-0,13	19
ТрансмхПБ6	100,9	-0,27	53	Аэрофл БО1	102,68	-0,07	17
ГТЛК БО-05	106,77	+0,04	53	ЯТЭК 1Р-2	100,3	-0,2	17
СвердлОб11	97,25	-0,75	50	Джи-гр 2Р1	100,68	-0,02	17

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.	14	0,56	0,52	103,18	40	-0,06	-0,18	-0,59	1 300	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 22-2	4,95	19.07.2022	N.A.	148	1,12	0,89	103,43	96	-0,01	-0,31	-0,56	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 25 (EUR)	4,36	21.03.2025	N.A.	209	1,08	3,34	111,44	143	-0,01	-0,00	-0,10	500	EUR	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 26	5,15	11.02.2026	N.A.	171	2,19	4,07	112,50	155	+0,07	-0,16	-0,10	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 27	4,95	23.03.2027	N.A.	30	2,71	4,89	111,51	184	+0,20	-0,56	-0,20	750	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 28	4,95	06.02.2028	N.A.	166	2,94	5,64	111,70	199	+0,07	-0,16	-0,10	900	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 34	8,63	28.04.2034	N.A.	65	3,71	8,70	149,30	245	+0,20	-0,56	-0,20	1 200	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 37	7,29	16.08.2037	N.A.	176	3,92	10,70	139,78	255	-0,31	-0,81	-	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 22	4,38	19.09.2022	N.A.	26	0,84	1,04	103,75	68	-0,01	-0,04	-0,14	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 23	6,00	27.11.2023	N.A.	95	1,25	2,13	110,54	89	-0,02	+0,16	+0,31	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Лукойл 22	6,66	07.06.2022	N.A.	105	0,65	0,77	104,70	46	-0,01	-0,08	-0,56	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 23	4,56	24.04.2023	N.A.	61	0,95	1,60	105,95	70	-0,02	+0,10	-0,09	1 500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 26	4,75	02.11.2026	N.A.	70	2,26	4,64	112,14	142	+0,01	+0,05	+0,05	1 000	USD		BBB+	BBB
НК Альянс 20	8,00	04.05.2023	N.A.	72	14,43	0,88	94,90	1 626	+0,01	+0,05	+0,05	500	USD		WD	NR
Новатэк 22	4,42	13.12.2022	N.A.	111	0,89	1,27	104,57	70	-0,02	-0,21	-0,17	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB
Роснефть 22	4,20	06.03.2022	N.A.	13	0,70	0,52	101,86	55	-0,01	-0,07	-0,21	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.	142	2,60	0,87	104,70	243	-0,08	-0,15	-0,34	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.	97	6,16	16,53	32,47	600	-0,00	-0,01	-0,00	125	USD	WR		
ВТБ 22	6,95	17.10.2022	N.A.	54	2,21	1,10	105,33	204	-0,05	-0,13	-0,17	1 500	USD	Ba2	WD	B-
ВТБ 24 (CHF)	4,07	24.10.2024	N.A.	61	2,83	2,94	103,71	N.A.	-0,01	-0,00	-0,09	350	CHF			
ВТБ 35	6,25	30.06.2035	N.A.	128	4,89	9,69	113,58	358	-0,06	-0,02	+0,01	1 000	USD	Baa3	WD	BBB-
ВЭБ 2022	6,03	05.07.2022	N.A.	134	0,84	0,85	104,45	68	-0,02	-0,05	-0,47	1 000	USD			BBB
ВЭБ 2023	5,94	21.11.2023	N.A.	89	1,47	2,11	109,82	112	+0,06	+0,03	+0,07	1 150	USD			BBB
ВЭБ 2023 (EUR)	4,03	21.02.2023	N.A.	181	0,51	1,46	105,24	102	+0,10	+0,16	-0,03	500	EUR			BBB
ВЭБ 2025	6,80	22.11.2025	N.A.	90	2,25	3,75	118,31	155	+0,04	+0,05	+0,09	1 000	USD			BBB
МКБ 25 (RUB)	16,50	26.05.2025	N.A.	94	9,05	2,94	123,25	185	-	-	+0,00	5 000	RUB			B+
Открытие Холдинг 17 (RUB)	9,00	18.06.2022	N.A.	116	7,00	0,80	101,72	-45	-0,01	-0,08	-0,43	18 000	RUB			
РСКБ 23	8,50	16.10.2023	N.A.	53	2,14	1,96	113,25	181	-0,03	-0,04	+0,09	500	USD		NR	
Сбербанк 22	6,13	07.02.2022	N.A.	167	1,04	0,45	102,29	89	-0,01	-0,07	-0,26	1 500	USD	Baa3		BBB
Сбербанк 22-2	5,13	29.10.2022	N.A.	66	1,40	1,14	104,34	123	+0,01	-0,04	-0,22	2 000	USD	Ba1		BBB-
Сбербанк 23	5,25	23.05.2023	N.A.	91	1,85	1,67	105,81	159	-0,02	-0,02	-0,18	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.	155	0,69	0,42	102,60	55	-0,00	-0,07	-0,54	350	USD	Ba2		BB+
Global Ports 22	6,50	22.09.2023	N.A.	30	1,52	1,94	110,17	120	+0,07	-0,05	+0,08	350	USD	Ba2	WD	
Алроса 24	4,65	09.04.2024	09.01.2024	47	1,16	2,25	108,16	78	-	-	-	500	USD			BBB
Вымпелком 22	7,50	01.03.2022	N.A.	9	1,80	0,50	102,95	165	-0,01	-0,31	-1,15	1 500	USD	Ba2u		BBB-
Вымпелком 23	5,95	13.02.2023	N.A.	174	1,34	1,43	106,70	113	+0,02	-0,04	-0,10	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.	99	1,38	1,70	106,30	113	-0,01	+0,18	+0,05	500	USD	Baa3u		BB+
Норникель 2022	6,63	14.10.2022	N.A.	52	0,91	1,10	106,47	75	-0,05	-0,10	-0,28	1 000	USD	Baa2		BBB-
Норникель 2023	4,10	11.04.2023	11.01.2023	49	1,22	1,34	103,93	103	+0,02	+0,03	-0,24	1 000	USD			BBB-
РЖД 2022	5,70	05.04.2022	N.A.	43	0,46	0,60	103,22	31	-0,02	-0,09	-0,31	1 400	USD	Baa2		BBB
РЖД 2023 (EUR)	4,60	06.03.2023	N.A.	195	-	1,49	107,07	51	+0,00	+0,02	-0,08	500	EUR	Ba2		BBB
РЖД 2031 (GBP)	7,49	25.03.2031	N.A.	33	3,32	7,24	133,96	255	+0,03	+0,20	+0,52	650	GBP	Baa2		BBB
Северсталь 22	5,90	17.10.2022	N.A.	55	0,77	1,11	105,86	61	-0,01	-0,05	-0,24	750	USD	Baa2		BBB
Сибур 2023	4,13	05.10.2023	05.07.2023	43	1,19	1,79	105,40	92	+0,02	-0,04	-0,09	500	USD	Baa3		BBB-
ТМК 27	4,30	12.02.2027	N.A.	173	4,18	4,93	100,60	332				500	USD	B1		B+

Календарь событий долговых рынков на 20 августа

Размещение	
ЕВРОПЛАН-001P-03	7 000 000 000 RUR
ВТБ-КС-4-77	50 000 000 000 RUR
Погашение	
ВТБ-КС-4-76	50 000 000 000 RUR
Оферта	
МРСК УРАЛА-БО-05	5 000 000 000 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