

Комментарий

В понедельник, 6 сентября, индекс корпоративных облигаций RUCBITR снизился на 0,06%. Значительным ростом среди корпоративных долговых бумаг отмечился выпуск СберИОС200, прибавив 1,8%. Также лучше индекса торговались выпуски Систем1Р12, ГТЛК БО-08, ГПБ БО-09 и БЭЛТИ БОП4, которые выросли на 0,29-0,97%. В числе аутсайдеров торгов оказались выпуски ВТБ Т2-3, Самолет1Р9, РУСАБрБ1Р3 и ГТЛК 1Р-13, снизившись на 0,15-0,75%.

Индекс муниципальных облигаций RUMBITR прибавил 0,11%. В лидерах роста среди муниципальных бумаг оказались выпуски МГор72-об и ННовгор 17, которые выросли на 0,34% и 0,17% соответственно.

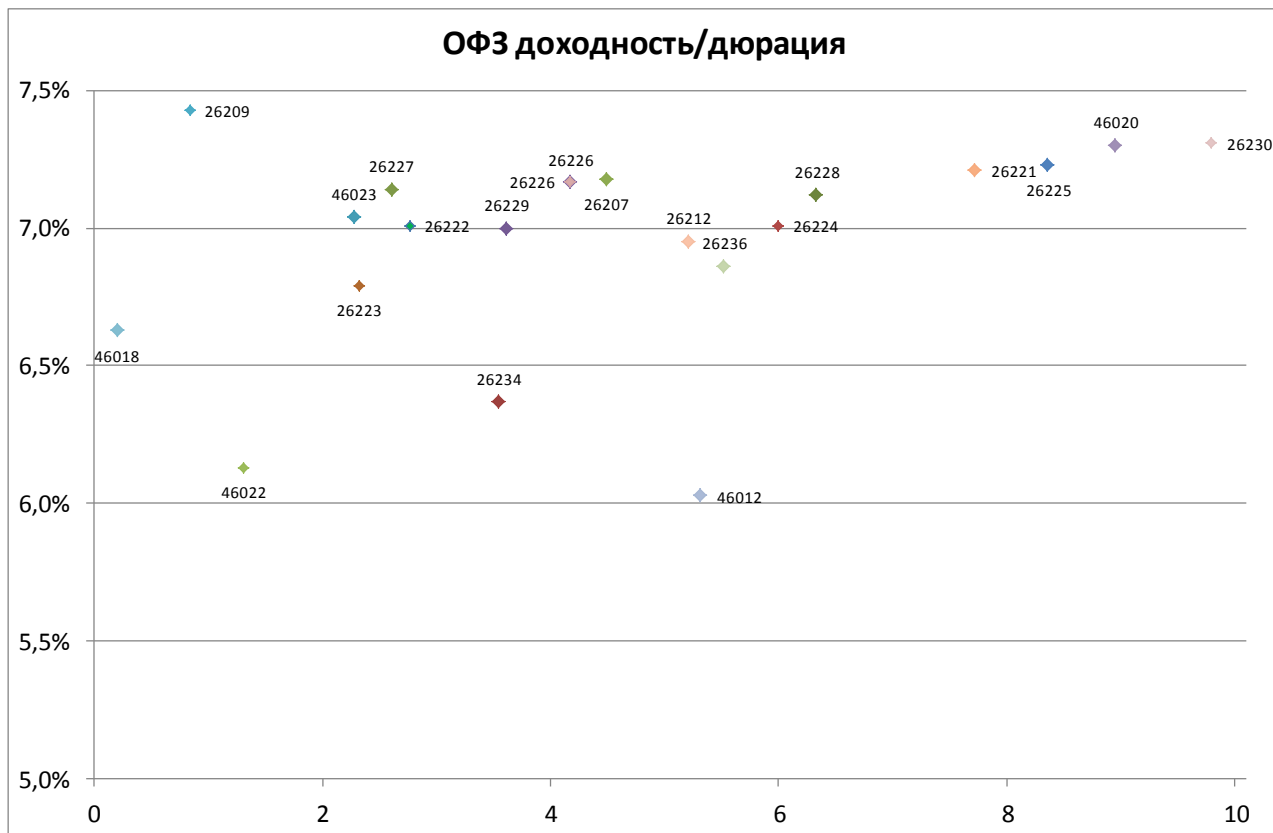
Противоположным образом закрылись выпуски МГор48-об и Ульоб35002, потерявшие на прошедших торгах 0,19% и 0,12% соответственно.

Индекс государственных облигаций RGBITR показал снижение на 0,06%. В лидерах роста среди ОФЗ оказались выпуски 46011, 29009, 26212 и 29010, которые выросли на 0,06-0,68%. В лидерах по темпам снижения оказались выпуски 46012, 26225, 26207 и 26229, потеряв на торгах 0,11-1,05%.

Индикаторы рынка

	Значение закрытия	Изм. к пред. дню	Изм. за неделю	Изм. за мес.
Золото	1823,29	-0,24%	+0,53%	+3,42%
Нефть Brent	72,22	-0,54%	-1,05%	+2,15%
5-летний CDS	77	+0,22%	-2,20%	-10,98%
Бивалютная корзина	79,14	+0,23%	-0,36%	+0,14%
Mosprime о/п	6,63	+0,20	+0,06	+0,31
Депозиты в ЦБ	1904,7	+30,4	+1095,2	-467,39
Остатки на корп. сч.	2418,5	+223,2	-1032,9	+326,60
UST 2	0,21	-	-0,00	-0,00
UST 10	1,32	-	+0,01	+0,03
Russia 2028	2,03	-	-0,02	-0,04
Brazil 2028	5,30	-0,01	+0,05	-0,26
Turkey 2028	4,83	-	+0,06	-0,26
Portugal 10 yr	0,20	-0,02	-0,01	+0,07
Ireland 10 yr	0,01	-0,01	+0,01	+0,08
Italy 10 yr	0,69	-0,02	-0,02	+0,12
Greece 10 yr	0,80	+0,02	+0,04	+0,25
Spain 10 yr	0,32	-0,02	-0,02	+0,08

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	4,17	7,17	105,00	-0,05%	26207	8,15	03.02.2027	4,49	7,18	106,12	-0,17%
26227	7,40	17.07.2024	2,61	7,14	101,60	-0,09%	26236	5,70	17.05.2028	5,52	6,86	93,89	
26234	4,50	16.07.2025	3,55	6,37	92,21	-0,02%	26220	7,40	07.12.2022	1,19	7,25	100,81	-0,02%
46020	6,90	06.02.2036	8,95	7,30	97,46	-0,11%	29007	6,46	03.03.2027	0,49	8,27	102,41	+0,05%
46018	6,50	24.11.2021	0,20	6,63	100,02	-0,12%	26215	7,00	16.08.2023	1,84	7,01	100,45	-0,04%
46023	8,16	23.07.2026	2,28	7,04	103,48	-0,00%	29006	6,36	29.01.2025	0,40	8,31	101,30	-0,05%
26223	6,50	28.02.2024	2,32	6,79	99,36	-0,07%	26211	7,00	25.01.2023	1,33	7,01	100,40	+0,00%
29009	5,74	05.05.2032	0,24	8,08	106,43	+0,12%	26219	7,75	16.09.2026	4,13	7,13	104,00	-0,11%
26225	7,25	10.05.2034	8,36	7,23	101,27	-0,27%	26218	8,50	17.09.2031	6,89	7,20	111,50	+0,11%
26228	7,65	10.04.2030	6,33	7,12	105,15	-0,10%	26217	7,50	18.08.2021	N.A.	N.A.	N.A.	-
25083	7,00	15.12.2021	0,26	7,05	100,16	+0,01%	29012	4,64	16.11.2022	0,18	8,20	98,91	-0,02%
26224	6,90	23.05.2029	6,00	7,01	100,38	-0,03%	29010	6,01	06.12.2034	0,34	8,01	108,70	+0,06%
26221	7,70	23.03.2033	7,72	7,21	105,60	-0,09%	26209	7,60	20.07.2022	0,84	7,43	100,80	-0,00%
46011	10,00	20.08.2025	3,66	-2,60	149,00	+0,68%	29008	5,57	03.10.2029	0,13	8,18	104,27	-0,03%
46022	5,50	19.07.2023	1,31	6,13	98,50	-0,00%	26229	7,15	12.11.2025	3,61	7,00	101,22	-0,11%
26222	7,10	16.10.2024	2,77	7,01	100,80	-0,03%	26212	7,05	19.01.2028	5,21	6,95	101,38	-0,00%
46012	9,72	05.09.2029	5,31	6,03	105,19	-1,05%	26230	7,70	16.03.2039	9,79	7,31	105,44	-0,11%

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.)
РоснефтьБ5	99,85	0	494	ГарИнв1Р05	100	0	14
ГПБ001Р09Р	100,95	+0,05	293	ЧеркизБ1Р2	99,35	-0,02	14
ГПБ001Р11Р	101,89	+0,1	176	АЛЬФА-Б2Р5	100,52	-0,08	13
ГТЛК БО-06	99,23	+0,24	140	ЯТЭК 1Р-2	100,36	+0,01	12
Сбер Sb17R	96,99	-0,01	67	Сбер Sb14R	100,2	+0,2	12
Самолет1Р9	100,3	-0,34	58	СберИОС254	109,8	+0,6	12
МГор48-о6	99,56	-0,19	54	Брус 1Р02	100,85	+0,18	12
РН БАНК1Р4	100,68	-0,05	50	СистемБ1Р7	95,3	+0,01	11
ТрнфБО1Р8	101,94	+0,04	47	СберИОС172	109	0	11
Сбер Sb15R	97,79	-0,06	46	ИКС5ФинР12	97	+0,15	11
СовкомБОПЗ	99,7	0	44	Систем1Р12	99,99	+0,29	11
Сбер Sb12R	100,54	-0,12	39	АЛЬФА-БС01	108,5	+0,3	10
СамолетР10	100,5	-0,13	31	БЭЛТИ БОП4	101,31	+0,31	10
Сбер Sb32R	100,1	-0,04	29	АБЗ-1 1Р01	100,56	-0,13	10
ГТЛК БО-08	101,57	+0,97	27	ТКХ БП1	99,97	-0,07	10
ВТБРКС01	100,01	-0,05	26	ЛСР БО 1Р4	100,79	-0,01	10
ГПБ БО-09	95,99	+0,49	25	ПочтаРБ1Р4	100,16	-0,15	10
СберИОС200	113,1	+1,8	23	ВТБ Б1-205	99,25	+0,18	10
ГТЛК 1Р-13	100,74	-0,15	21	СибурХ БО3	101,5	+0,11	10
Сбер Sb16R	96,12	+0,02	20	РСХБ БО-5Р	100,28	+0,09	10
Сбер Sb13R	100,06	+0,02	18	ПКБ 1Р-01	103,79	-0,15	9
РУСАБрБ1РЗ	100,35	-0,27	17	ВТБ Т2-3	99,25	-0,75	9
ГТЛК 1Р-03	106,91	-0,1	15	Роснфт1Р4	101,62	-0,16	9

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.	179	1,21	0,49	102,61	106	-	-0,04	-0,68	1 300	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 22-2	4,95	19.07.2022	N.A.	132	0,76	0,85	103,59	62	-	-0,07	-0,16	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 25 (EUR)	4,36	21.03.2025	N.A.	193	1,02	3,30	111,53	141	-0,00	+0,09	+0,08	500	EUR	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 26	5,15	11.02.2026	N.A.	155	2,19	4,03	112,43	140	-	-0,10	+0,88	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 27	4,95	23.03.2027	N.A.	14	2,63	4,85	111,87	169	-	+0,05	+0,35	750	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 28	4,95	06.02.2028	N.A.	150	2,93	5,60	111,72	189	-	-0,10	+0,88	900	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 34	8,63	28.04.2034	N.A.	49	3,76	8,65	148,60	236	-	+0,05	+0,35	1 200	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 37	7,29	16.08.2037	N.A.	160	3,87	10,68	140,40	237	-	-0,05	-0,26	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 22	4,38	19.09.2022	N.A.	10	0,94	1,00	103,51	79	-	-0,12	-0,24	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 23	6,00	27.11.2023	N.A.	79	1,22	2,08	110,43	87	-	-0,03	+0,07	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Лукойл 22	6,66	07.06.2022	N.A.	89	0,61	0,73	104,48	44	-	-0,04	-0,34	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 23	4,56	24.04.2023	N.A.	45	0,94	1,56	105,83	71	-	+0,08	+0,05	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 26	4,75	02.11.2026	N.A.	54	2,21	4,59	112,30	132	-	+0,24	+0,51	1 000	USD		BBB+	BBB
НК Альянс 20	8,00	04.05.2023	N.A.	56	14,03	0,84	95,44	1 586	-	+0,24	+0,51	500	USD		WD	NR
Новатэк 22	4,42	13.12.2022	N.A.	95	0,97	1,23	104,32	80	-	-0,02	-0,42	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB
Роснефть 22	4,20	06.03.2022	N.A.	178	0,90	0,49	101,62	75	-	-0,03	-0,29	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.	126	2,25	0,83	104,78	211	-0,07	-0,20	+0,09	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.	81	6,03	16,84	33,17	574	-0,04	+0,83	+1,92	125	USD	WR		
ВТБ 22	6,95	17.10.2022	N.A.	38	2,36	1,06	104,98	220	-0,01	+0,01	-0,49	1 500	USD	Ba2	WD	B-
ВТБ 24 (CHF)	4,07	24.10.2024	N.A.	45	2,83	2,90	103,66	N.A.	-0,00	-0,03	-0,15	350	CHF			
ВТБ 35	6,25	30.06.2035	N.A.	112	4,81	9,66	114,35	336	+0,15	+0,25	+0,43	1 000	USD	Baa3	WD	BBB-
ВЭБ 2022	6,03	05.07.2022	N.A.	118	0,82	0,81	104,26	67	+0,04	-0,04	-0,29	1 000	USD			BBB
ВЭБ 2023	5,94	21.11.2023	N.A.	73	1,44	2,07	109,72	109	+0,05	+0,00	-0,02	1 150	USD			BBB
ВЭБ 2023 (EUR)	4,03	21.02.2023	N.A.	165	0,48	1,41	105,12	98	-0,03	-0,09	+0,08	500	EUR			BBB
ВЭБ 2025	6,80	22.11.2025	N.A.	74	2,17	3,71	118,49	144	+0,17	+0,17	+0,15	1 000	USD			BBB
МКБ 25 (RUB)	16,50	26.05.2025	N.A.	78	10,64	2,88	117,53	337	-0,14	-0,12	-4,54	5 000	RUB			B+
Открытие Холдинг 17 (RUB)	9,00	18.06.2022	N.A.	100	6,89	0,75	101,72	-65	-0,02	-0,05	-0,14	18 000	RUB			
РСКБ 23	8,50	16.10.2023	N.A.	37	2,09	1,92	113,11	178	+0,05	-0,08	-0,11	500	USD		NR	
Сбербанк 22	6,13	07.02.2022	N.A.	151	0,35	0,41	102,37	21	-0,02	-0,07	-0,02	1 500	USD	Baa3		BBB
Сбербанк 22-2	5,13	29.10.2022	N.A.	50	1,35	1,10	104,25	119	-0,02	-0,04	-0,17	2 000	USD	Ba1		BBB-
Сбербанк 23	5,25	23.05.2023	N.A.	75	1,83	1,63	105,72	158	-0,01	-0,02	-0,12	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.	138	-	0,38	102,66	-	+0,17	-0,08		350	USD	Ba2		BB+
Global Ports 23	6,50	22.09.2023	N.A.	13	1,44	1,89	110,11	114	-	+0,06	-0,06	350	USD	Ba2	WD	
Алроса 24	4,65	09.04.2024	09.01.2024	30	1,15	2,20	108,02	78	-	-	-	500	USD			BBB
Вымпелком 22	7,50	01.03.2022	N.A.	173	0,74	0,48	103,22	60	-	-0,12	-0,49	1 500	USD	Ba2u		BBB-
Вымпелком 23	5,95	13.02.2023	N.A.	157	1,24	1,39	106,64	104	-	+0,06	+0,04	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.	82	1,45	1,66	106,03	120	-	-0,20	-0,09	500	USD	Baa3u		BB+
Норникель 2022	6,63	14.10.2022	N.A.	35	0,91	1,05	106,23	75	-	+0,00	-0,30	1 000	USD	Baa2		BBB-
Норникель 2023	4,10	11.04.2023	11.01.2023	32	1,16	1,30	103,90	97	-	-0,01	+0,01	1 000	USD			BBB-
РЖД 2022	5,70	05.04.2022	N.A.	26	0,48	0,56	102,98	33	-	-0,06	-0,35	1 400	USD	Baa2		BBB
РЖД 2023 (EUR)	4,60	06.03.2023	N.A.	178	-	1,45	106,90	46	-0,00	-0,04	-0,09	500	EUR	Baa2		BBB
РЖД 2031 (GBP)	7,49	25.03.2031	N.A.	16	3,30	7,20	134,04	244	+0,08	+0,18	+0,67	650	GBP	Baa2		BBB
Северсталь 22	5,90	17.10.2022	N.A.	38	0,69	1,06	105,72	53	-	-0,04	-0,14	750	USD	Baa2		BBB
Сибур 2023	4,13	05.10.2023	05.07.2023	26	1,17	1,75	105,30	91	-	-0,03	-0,11	500	USD	Baa3		BBB-
ТМК 27	4,30	12.02.2027	N.A.	156	4,19	4,88	100,51	327				500	USD	B1		B+

Календарь событий долговых рынков на 7 сентября

Размещение	
ФЛАЙ ПЛЭНИНГ-002Р	500 000 000 RUR
ДОМ.РФ ИПОТЕЧНЫЙ АГЕНТ-БО-001Р-09	9 749 207 000 RUR
БАНК РОССИИ-49-КОБР	300 000 000 000 RUR
ВТБ-КС-4-89	25 000 000 000 RUR
Погашение	
ВТБ-КС-4-88	50 000 000 000 RUR
ТАТФОНДБАНК-БО-11	4 000 000 000 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