

Комментарий

В пятницу, 1 октября, индекс корпоративных облигаций RUCBITR закрылся без изменений. В зеленой зоне среди корпоративных долговых бумаг закрылись выпуски Роснфт1P4, Сбер Sb18R, Росгео01 и ПочтаРБ1P7, которые выросли на 0,12- 0,36%. В числе аутсайдеров торговались выпуски МТС 1P-14, РСХБ БО13, МОСТРЕСТ 7 и Пионер 1P4, потеряв на прошедших торгах 0,27-0,71%.

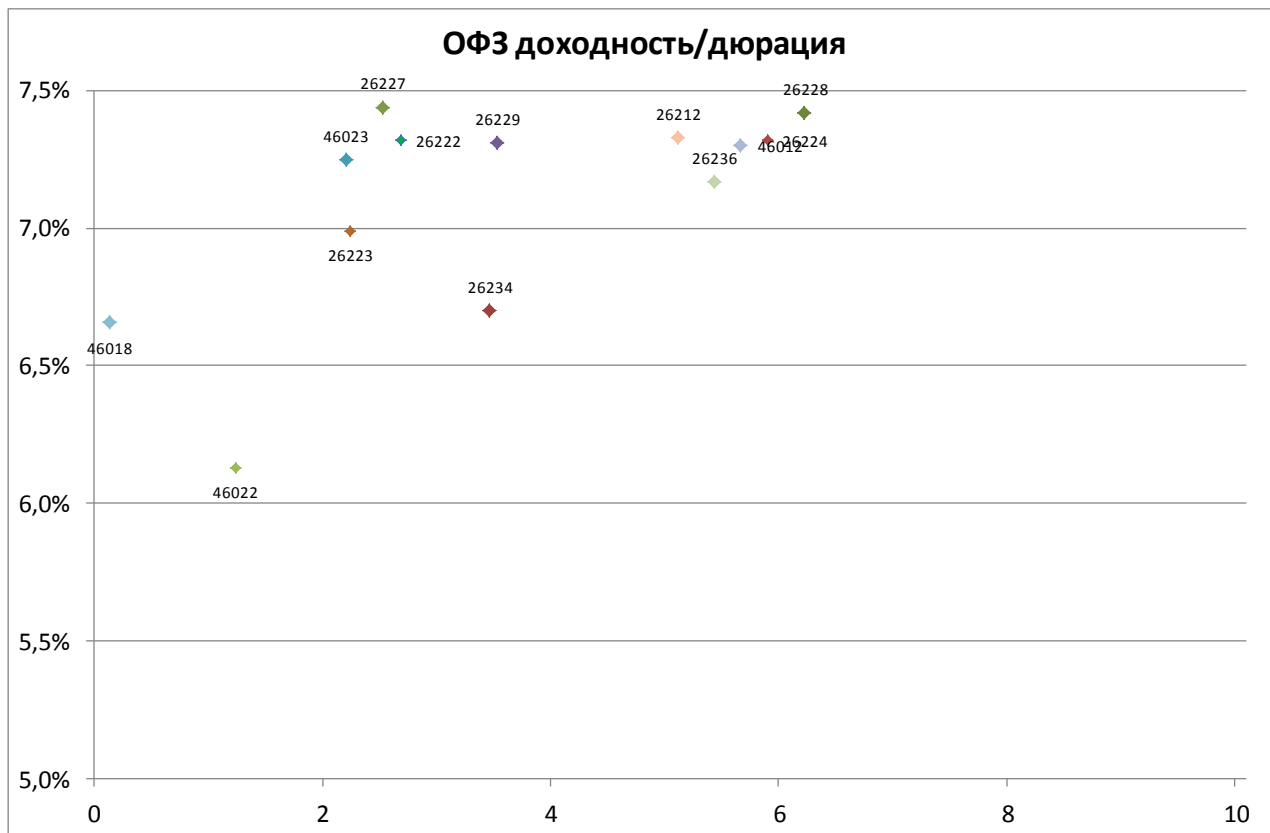
Индекс муниципальных облигаций RUMBTR продемонстрировал отрицательную динамику, снизившись на 0,16%. Среди лидеров роста стоит отметить выпуски Якут-10 об и Казахст01, которые прибавили 0,81% и 0,63% соответственно. В красной зоне закрылись выпуски КрасЯрск13 и КраснодарКрЗ, упав на 0,69% и 0,56% соответственно.

Индекс государственных облигаций RGBITR снизился на 0,19%. Лучше индекса среди ОФЗ торговались выпуски 46023, 46020, 46012 и 26226, которые прибавили 0,09-0,31%. В лидерах снижения оказались выпуски 26230, 26222, 26212 и 26221, которые снизились на 0,25-0,40%.

Индикаторы рынка

	Значение закрытия	Изм. к пред. дню	Изм. за неделю	Изм. за мес.
Золото	1760,98	+0,23%	+0,62%	-2,69%
Нефть Brent	79,28	+0,96%	-0,31%	+8,56%
5-летний CDS	88	+0,14%	+0,52%	+12,14%
Бивалютная корзина	77,88	-0,04%	-0,38%	-1,48%
Mosprime о/п	6,95	-0,07	-0,07	+0,52
Депозиты в ЦБ	1012,4	-10,7	+387,0	+29,00
Остатки на корп. сч.	3195,4	-28,3	+325,7	-60,60
UST 2	0,26	-0,01	-0,01	+0,06
UST 10	1,46	-0,03	-0,03	+0,18
Russia 2028	2,22	+0,01	+0,08	+0,18
Brazil 2028	6,13	+0,05	-0,05	+0,83
Turkey 2028	5,70	+0,06	-0,09	+0,89
Portugal 10 yr	0,32	-0,03	+0,01	+0,12
Ireland 10 yr	0,14	-0,04	-0,00	+0,15
Italy 10 yr	0,81	-0,05	+0,02	+0,14
Greece 10 yr	0,83	-0,02	+0,03	+0,09
Spain 10 yr	0,42	-0,04	+0,01	+0,11

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	4,09	7,51	103,45	+0,09%	26207	8,15	03.02.2027	4,40	7,56	104,50	+0,05%
26227	7,40	17.07.2024	2,53	7,44	100,72	+0,07%	26236	5,70	17.05.2028	5,43	7,17	92,25	
26234	4,50	16.07.2025	3,47	6,66	91,18	+0,00%	26220	7,40	07.12.2022	1,12	7,42	100,35	-0,08%
46020	6,90	06.02.2036	8,82	7,52	95,80	+0,25%	29007	6,46	03.03.2027	0,42	8,26	102,35	-0,13%
46018	6,50	24.11.2021	0,14	6,66	100,14	+0,00%	26215	7,00	16.08.2023	1,76	7,17	99,90	-0,05%
46023	8,16	23.07.2026	2,21	7,25	103,50	+0,31%	29006	6,69	29.01.2025	0,32	8,35	101,19	-0,03%
26223	6,50	28.02.2024	2,25	6,99	98,62	-0,08%	26211	7,00	25.01.2023	1,26	7,15	99,99	-0,00%
29009	5,74	05.05.2032	0,18	8,10	106,36	+0,24%	26219	7,75	16.09.2026	4,20	7,47	102,61	-0,17%
26225	7,25	10.05.2034	8,22	7,56	99,15	-0,17%	26218	8,50	17.09.2031	7,04	7,52	109,21	-0,18%
25083	7,00	15.12.2021	0,19	7,11	100,05	-0,01%	29012	4,64	16.11.2022	0,10	8,21	99,05	+0,05%
26224	6,90	23.05.2029	5,90	7,30	98,31	-0,25%	29010	6,01	06.12.2034	0,28	8,04	108,30	-0,10%
26221	7,70	23.03.2033	7,59	7,52	103,17	-0,28%	26209	7,60	20.07.2022	0,77	7,58	100,40	-0,07%
46011	10,00	20.08.2025	3,57	-2,02	168,00	-	29008	5,57	03.10.2029	0,13	8,16	104,30	-0,00%
46022	5,50	19.07.2023	1,24	6,13	98,47	-0,02%	26229	7,15	12.11.2025	3,54	7,31	100,23	-0,03%
26222	7,10	16.10.2024	2,69	7,32	99,75	-0,27%	26212	7,05	19.01.2028	5,12	7,33	99,50	-0,25%
46012	6,57	05.09.2029	5,67	7,30	100,00	+0,11%	26230	7,70	16.03.2039	9,60	7,59	102,92	-0,40%

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.)
ВЭБ ПБО1Р5	100.44	-0.01	625	ВТБРКО1	99.96	-0.06	32
РоснефтьБ1	100.37	-0.08	503	ТКХ БП1	100.05	-0.03	31
ГТЛК 1Р-15	99.33	-0.06	495	СберБ Б52R	100.4	+0.01	29
РоснефтьБ7	100.37	0	490	ВТБСУБТ2-1	92	-0.25	26
МТС 1Р-14	95.52	-0.53	353	РЖД Б01Р1R	101.3	-0.01	23
Европлн1Р2	98.19	0	277	МОСТРЕСТ 7	97.95	-0.6	22
УрКаПБОБР	100.14	+0.02	208	АЛЬФА-Б2Р7	99.5	+0.03	21
Сбер Sb12R	100.2	-0.02	196	ТМК БО-5	98.35	0	19
Систем1Р18	97.42	-0.08	187	Роснфт1Р4	101.28	+0.23	18
МТС 1Р-08	100.75	+0.1	124	МКБ П19	87.52	-0.3	18
ОткрФКБП09	99.89	-0.1	113	Аэрофл БО1	101.5	-0.24	17
ТрнфБО1Р9	99.96	-0.04	101	Пионер 1Р4	101.02	-0.27	16
ЕврХимБ1Р3	100.4	0	100	АЛЬФА-Б2Р2	100.11	-0.04	15
СовкомБОП3	99.7	0	68	ПИК К 1Р4	99.74	-0.04	15
СберБ БО6R	99.31	-0.07	67	АЛЬФАБ2Р14	100.21	-0.03	15
БалтЛизБП4	99.65	0	61	Сбер Sb18R	97.4	+0.12	15
Систем1Р10	101.5	0	60	СовкомБОП1	99.29	+0.09	14
ГПБ001Р09Р	100.5	0	50	ЧеркизБ1Р2	98.81	+0.01	14
ПочтаРБ1Р7	100.4	+0.2	50	МТС 1Р-17	98.85	+0.2	13
РСХБ БО13	99.5	-0.71	49	Боржоми1Р1	97.8	+0.22	12
РЖД 1Р-20R	99	0	39	МГор48-об	99.3	+0.01	12
СамолетР10	100	-0.12	38	Сбер Sb17R	96.15	0	11
Росрео01	100.66	+0.36	32	Сбер Sb32R	99.7	-0.04	11

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.	152	0,61	0,42	102,47	46	-0,04	-0,06	-0,16	1 300	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 22-2	4,95	19.07.2022	N.A.	105	0,94	0,77	103,14	78	-0,01	-0,12	-0,49	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 25 (EUR)	4,36	21.03.2025	N.A.	166	1,00	3,23	111,37	132	-0,02	-0,12	-0,20	500	EUR	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 26	5,15	11.02.2026	N.A.	128	2,35	3,95	111,49	145	-0,12	-0,45	-1,22	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 27	4,95	23.03.2027	N.A.	168	2,78	4,88	110,93	171	-0,46	-0,14	-1,02	750	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 28	4,95	06.02.2028	N.A.	123	3,10	5,52	110,56	192	-0,12	-0,45	-1,22	900	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 34	8,63	28.04.2034	N.A.	22	3,85	8,56	147,18	233	-0,46	-0,14	-1,02	1 200	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпром 37	7,29	16.08.2037	N.A.	133	4,03	10,55	137,96	240	-0,29	-0,50	-0,98	1 250	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 22	4,38	19.09.2022	N.A.	164	0,98	0,94	103,21	82	+0,17	-0,08	-0,42	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Газпромнефть 23	6,00	27.11.2023	N.A.	52	1,24	2,01	110,02	83	+0,54	-0,05	-0,39	1 500	USD	Baa2	BBB	BBB-
Лукойл 22	6,66	07.06.2022	N.A.	62	2,77	0,65	102,55	258	-1,53	-1,59	-1,89	500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 23	4,56	24.04.2023	N.A.	18	1,24	1,49	105,09	98	-0,18	-0,35	-0,71	1 500	USD	Baa2	BBB+	BBB
Лукойл 26	4,75	02.11.2026	N.A.	27	2,44	4,52	110,95	142	-	+0,00	+0,05	1 000	USD		BBB+	BBB
НК Альянс 20	8,00	04.05.2023	N.A.	29	13,71	0,76	96,07	1 567	-	+0,00	+0,05	500	USD		WD	NR
Новатэк 22	4,42	13.12.2022	N.A.	68	0,89	1,15	104,16	70	-0,01	-0,05	-0,16	1 000	USD	Baa2	BBB	BBB
Роснефть 22	4,20	06.03.2022	N.A.	151	0,95	0,42	101,35	80	-0,01	-0,06	-0,28	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.	99	2,89	0,75	103,85	274	+0,12	-0,06	-0,75	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.	54	6,09	16,60	32,85	570	-0,03	+0,01	-0,76	125	USD	WR		
ВТБ 22	6,95	17.10.2022	N.A.	11	2,47	0,98	104,53	231	+0,57	-0,07	-0,46	1 500	USD	Ba2	WD	B-
ВТБ 24 (CHF)	4,07	24.10.2024	N.A.	18	2,87	2,83	103,46	N.A.	+0,07	+0,17	-0,26	350	CHF			
ВТБ 35	6,25	30.06.2035	N.A.	85	4,80	9,59	114,48	322	-	+0,06	+0,52	1 000	USD	Baa3	WD	BBB-
ВЭБ 2022	6,03	05.07.2022	N.A.	91	1,04	0,73	103,70	89	-0,02	-0,12	-0,50	1 000	USD			BBB
ВЭБ 2023	5,94	21.11.2023	N.A.	46	1,72	1,99	108,76	132	-0,24	-0,79	-0,96	1 150	USD			BBB
ВЭБ 2023 (EUR)	4,03	21.02.2023	N.A.	138	0,58	1,34	104,72	106	-0,03	-0,18	-0,43	500	EUR			BBB
ВЭБ 2025	6,80	22.11.2025	N.A.	47	2,34	3,63	117,45	148	-0,08	-0,18	-0,61	1 000	USD			BBB
МКБ 25 (RUB)	16,50	26.05.2025	N.A.	51	11,28	2,79	115,19	354	-0,68	-0,89	-2,67	5 000	RUB			B+
Открытие Холдинг 17 (RUB)	9,00	18.06.2022	N.A.	73	7,22	0,68	101,33	-59	+0,03	+0,02	-0,43	18 000	RUB			
РСХБ 23	8,50	16.10.2023	N.A.	10	2,14	1,85	112,55	177	-0,03	-0,23	-0,44	500	USD		NR	
Сбербанк 22	6,13	07.02.2022	N.A.	124	0,45	0,34	101,90	29	-0,01	-0,06	-0,50	1 500	USD	Baa3		BBB
Сбербанк 22-2	5,13	29.10.2022	N.A.	23	1,38	1,03	103,94	121	-0,01	-0,08	-0,32	2 000	USD	Ba1		BBB-
Сбербанк 23	5,25	23.05.2023	N.A.	48	1,75	1,56	105,60	147	-	-0,01	-0,14	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.	111	1,18	0,30	101,71	104	+0,01	-0,22	-0,78	350	USD	Ba2		BB+
Global Ports 23	6,50	22.09.2023	N.A.	167	1,54	1,87	109,55	118	+0,04	-0,05	-0,48	350	USD	Ba2	WD	
Алроса 24	4,65	09.04.2024	09.01.2024	3	1,40	2,13	107,19	96	-	-	-	500	USD			BBB
Вымпелком 22	7,50	01.03.2022	N.A.	146	1,89	0,40	102,24	174	-0,51	-0,63	-1,08	1 500	USD	Ba2u		BBB-
Вымпелком 23	5,95	13.02.2023	N.A.	130	1,31	1,31	106,21	109	-0,01	-0,25	-0,36	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.	55	1,49	1,58	105,69	121	+0,00	-0,08	-0,46	500	USD	Baa3u		BB+
Норникель 2022	6,63	14.10.2022	N.A.	8	1,07	0,98	105,63	90	-0,01	-0,17	-0,57	1 000	USD	Baa2		BBB-
Норникель 2023	4,10	11.04.2023	11.01.2023	5	1,36	1,22	103,42	116	-0,01	+0,28	-0,13	1 000	USD			BBB-
РЖД 2022	5,70	05.04.2022	N.A.	181	1,11	0,50	102,27	95	-0,02	-0,21	-0,50	1 400	USD	Baa2		BBB
РЖД 2023 (EUR)	4,60	06.03.2023	N.A.	151	0,08	1,37	106,38	56	-0,01	-0,18	-0,55	500	EUR	Baa2		BBB
РЖД 2031 (GBP)	7,49	25.03.2031	N.A.	170	3,36	7,32	133,24	221	-0,03	-0,39	-0,44	650	GBP	Baa2		BBB
Северсталь 22	5,90	17.10.2022	N.A.	11	1,02	0,99	104,99	85	-0,01	-0,17	-0,57	750	USD	Baa2		BBB
Сибур 2023	4,13	05.10.2023	05.07.2023	181	1,24	1,70	104,97	94	-0,03	-0,13	-0,32	500	USD	Baa3		BBB-
ТМК 27	4,30	12.02.2027	N.A.	129	4,03	4,81	101,26	297				500	USD	B1		B+

Календарь событий долговых рынков на 4 октября

Размещение	
ВТБ-СУБ-Т1-8	52 500 000 USD
ВТБ-СУБ-Т1-9	100 000 000 EUR
ВТБ-СУБ-Т1-10	50 000 000 EUR
ВТБ-СУБ-Т1-11	10 000 000 000 RUR
ВТБ-СУБ-Т1-12	5 000 000 000 RUR
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-04	89 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-05	122 400 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-06	122 300 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-07	210 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-08	300 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-09	300 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-10	400 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-11	400 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-12	400 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-13	400 000 000 USD
СИБУР ХОЛДИНГ-БО-14	280 900 000 USD
ТЕХНО ЛИЗИНГ-001Р-05	500 000 000 RUR
ВТБ-КС-4-108	50 000 000 000 RUR
Погашение	
ГОЛОС.ДЕВЕЛОПМЕНТ-БО-01	200 000 000 RUR
Оферта	
БАНК ЗЕНИТ-БО-09	5 000 000 000 RUR
ПИОНЕР-ЛИЗИНГ-БО-П01	100 000 000 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