

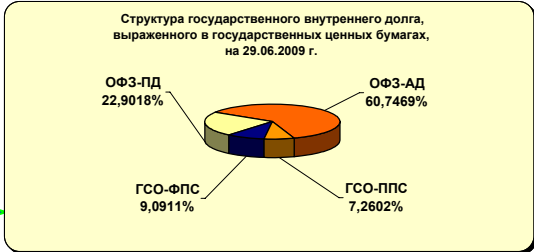
Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах

29 июня 2009 года

| | | |
|---|---------------|-------------|
| Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах | 1 451 967,976 | млн. рублей |
|---|---------------|-------------|

По видам ценных бумаг:

| | млн. рублей |
|---------|-------------|
| ОФЗ-ПД | 332 526,659 |
| ОФЗ-АД | 882 026,187 |
| ГСО-ППС | 105 415,130 |
| ГСО-ФПС | 132 000,000 |



Операции Минфина России на внутреннем рынке государственных ценных бумаг

01.01.2009 - 29.06.2009 млн. рублей

| | | | |
|--------------------|------------|-----------|------------|
| Чистое привлечение | 33 198,642 | Погашение | 81 313,166 |
|--------------------|------------|-----------|------------|

| Привлечение | | Погашение | |
|-------------|------------|-------------|------------|
| в том числе | | в том числе | |
| ОФЗ-ПД | 44 547,998 | ОФЗ-ПД | 40 587,636 |
| ОФЗ-ФК | - | ОФЗ-ФК | 30 779,330 |
| ОФЗ-АД | - | ОФЗ-АД | - |
| ГСО-ППС | 69 963,810 | ГСО-ППС | 9 946,200 |
| ГСО-ФПС | - | ГСО-ФПС | - |

Расходы на обслуживание государственного внутреннего долга, выраженного в государственных ценных бумагах

01.01.2009 - 29.06.2009 млн. рублей

| | Кассовый расход | Уменьшение расходов по статье 113 БК РФ | | По бюджету |
|--------------|-------------------|---|--------------------------|-------------------|
| | | НКД | превышение над номиналом | |
| ОФЗ-ПД | 9 369,215 | 581,506 | 262,248 | 8 525,461 |
| ОФЗ-ФК | 4 176,877 | - | - | 4 176,877 |
| ОФЗ-АД | 24 463,424 | - | - | 24 463,424 |
| ГСО-ППС | 330,728 | - | - | 330,728 |
| ГСО-ФПС | 5 036,480 | - | - | 5 036,480 |
| ИТОГО | 43 376,724 | 581,506 | 262,248 | 42 532,970 |

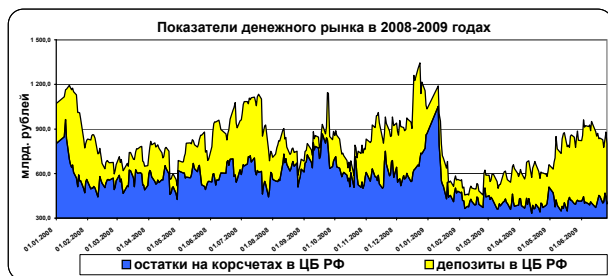
Текущее состояние рынка

29 июня 2009 года

Финансовые индикаторы

| | на 26.06.2009 | на 19.06.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Курс доллара США (Банк России), руб./долл. | 31,2037 | 31,0998 | 0,33% |
| Курс евро (Банк России), руб./евро | 43,5728 | 43,4340 | 0,32% |
| Курс USD / EUR | 1,3964 | 1,3966 | -0,01% |
| Остатки на кор. счетах ЦБ РФ, млрд. рублей | 395,2 | 446,5 | -11,49% |
| Средства на депозитах, млрд. рублей | 404,7 | 391,6 | 3,35% |

| | 19.06.2009 | 12.06.2009 | Изменение за неделю, % |
|---|------------|------------|------------------------|
| Золотовалютные резервы ЦБ РФ, млрд. долл. США | 407,1 | 406,6 | 0,12% |



Показатели рынка ГКО-ОФЗ

| | 26.06.2009 | 19.06.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Объем рынка ГКО-ОФЗ по номиналу, млн. рублей (*) | 1 114 546,800 | 1 111 617,209 | 0,26% |
| Капитализация рынка ГКО-ОФЗ, млн. рублей (*) | 952 451,835 | 953 414,454 | -0,10% |
| Дюрация рынка ГКО-ОФЗ, дней (*) | 1 802,32 | 1 855,73 | -2,88% |

(*) Данные Банка России

Операции Минфина России на рынке

Проведенные операции
в период с 22.06.2009 по 26.06.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|------------------|------------------|
| | Эмиссия | Привлечение |
| ОФЗ-ПД | 2 929,591 | 2 929,591 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 2 929,591 | 2 929,591 |

Погашение

| | млн. рублей | |
|--------------|--------------------------|-------------------------|
| | по номинальной стоимости | по основной сумме долга |
| ОФЗ-ПД | | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | - | - |

Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------|----------|
| ОФЗ-ПД | | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | - | - |

Планируемые операции
в период с 29.06.2009 по 03.07.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------------|--|
| | Эмиссия | |
| ОФЗ-ПД | 10 000,000 | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 10 000,000 | |

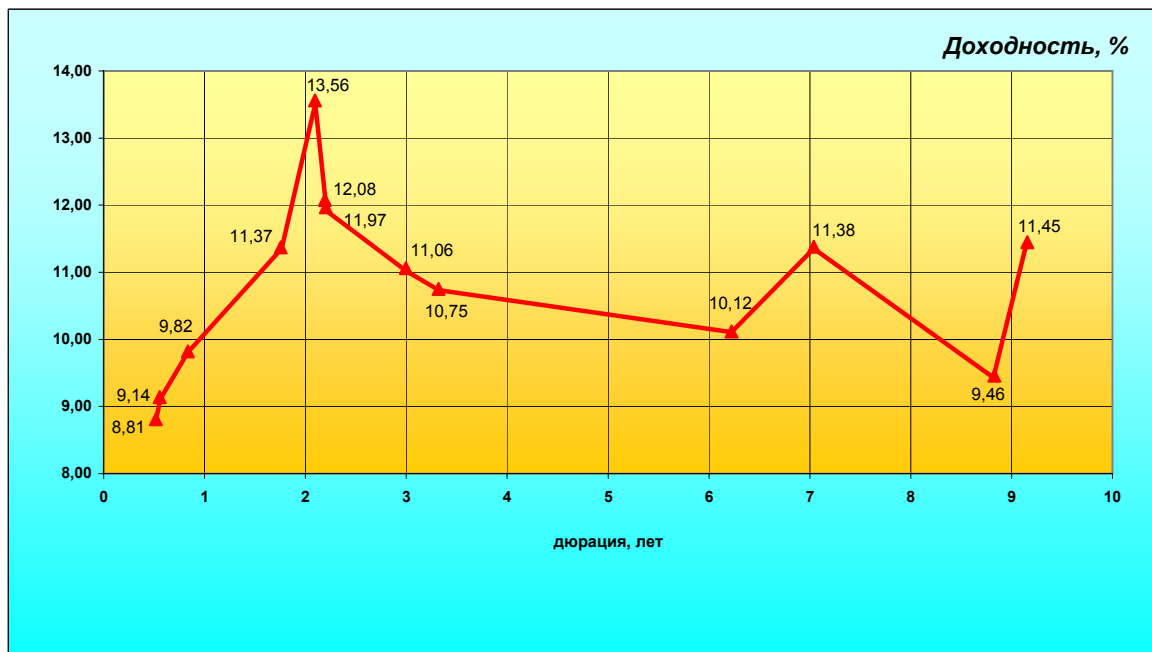
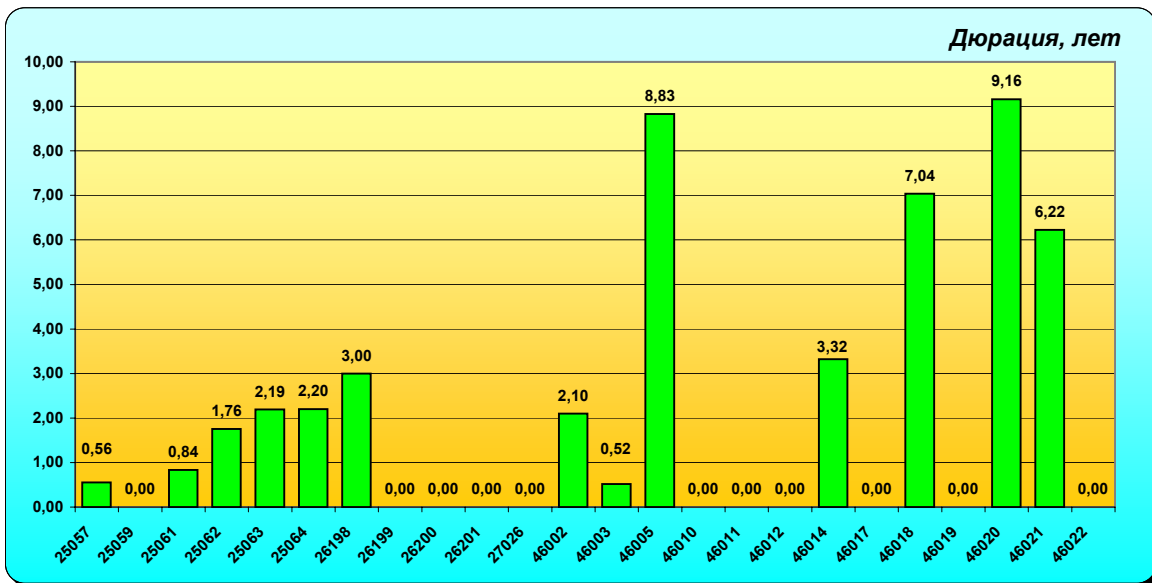
Погашение

| | млн. рублей | |
|--------------|--------------------------|-------------------------|
| | по номинальной стоимости | по основной сумме долга |
| ОФЗ-ПД | | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | - | - |

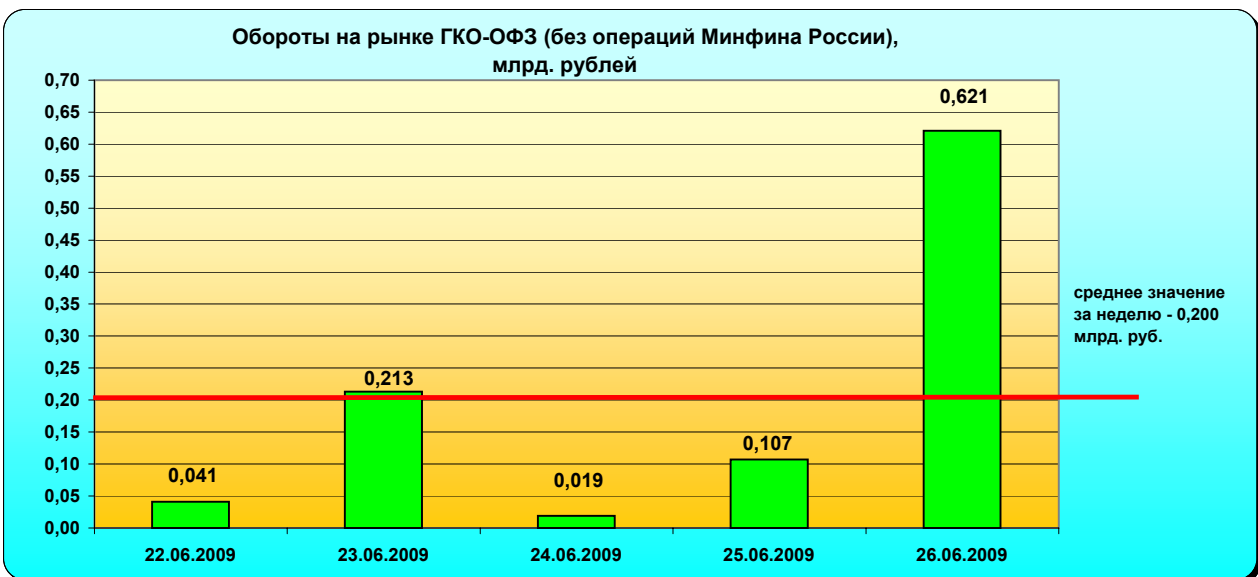
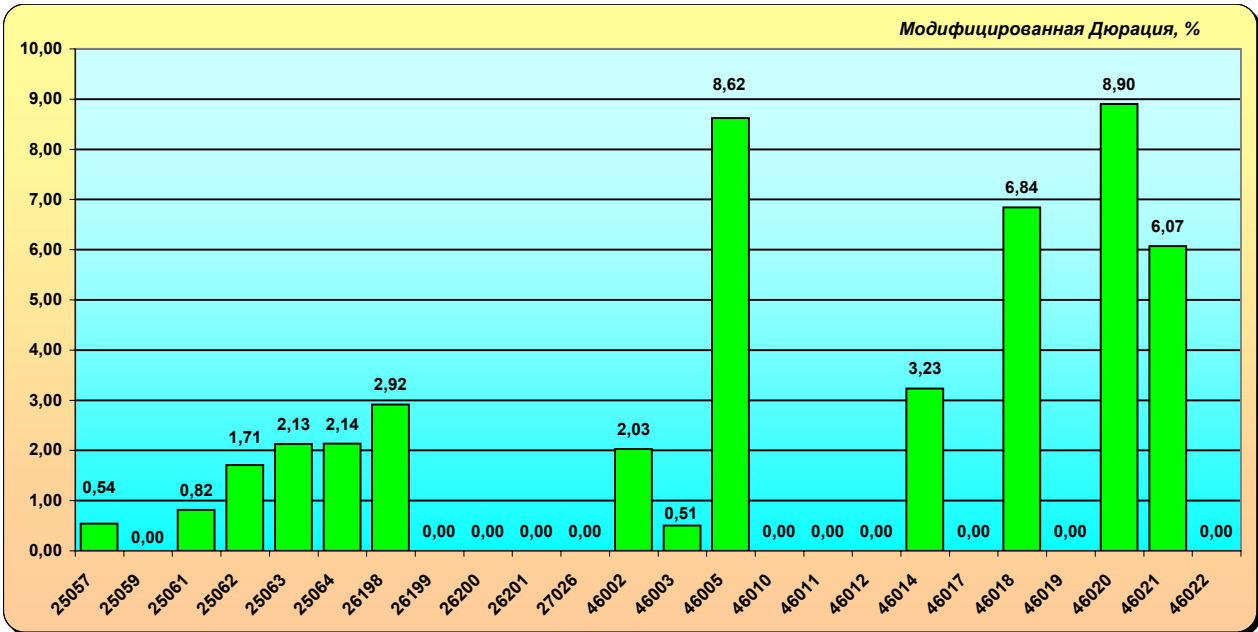
Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------|----------|
| ОФЗ-ПД | | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | - | - |

Текущее состояние рынка

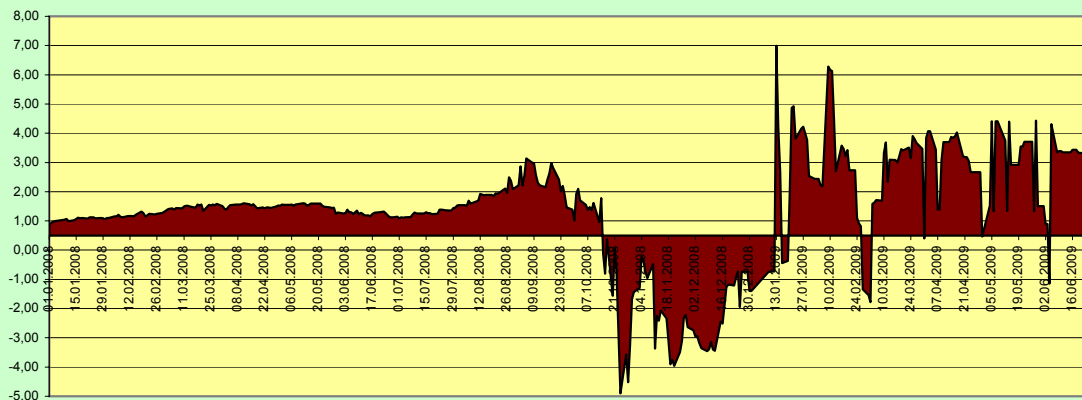


Текущее состояние рынка

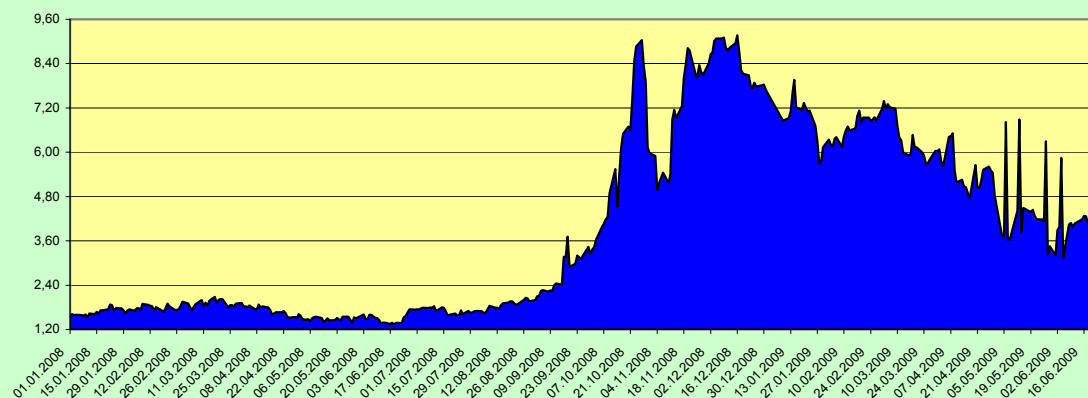


Текущее состояние рынка

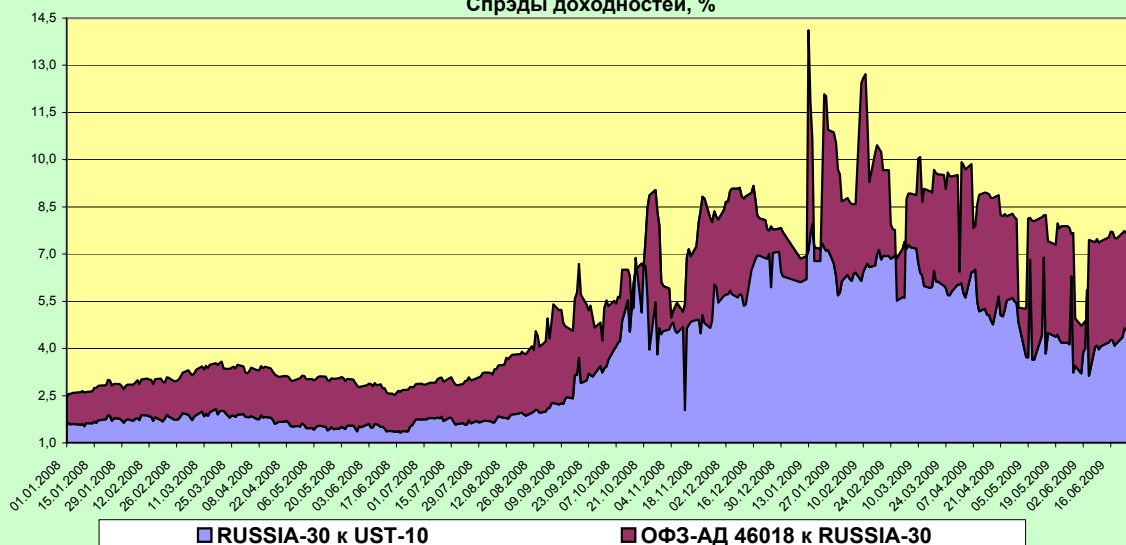
Спрэд доходности ОФЗ-АД 46018 к RUSSIA-30, %



Спрэд доходности RUSSIA-30 к UST-10, %



Спрэды доходностей, %



■ RUSSIA-30 к UST-10

■ ОФЗ-АД 46018 к RUSSIA-30

Информация по аукционам ОФЗ с 22.06.2009 по 26.06.2009

| Дата аукциона | Код бумаги | Тип бумаги | Дата погашения | Объем спроса по номиналу, млн. руб. | Объем спроса по рыночной стоимости, млн. руб. | Объем размещения, млн. руб. | Объем выручки, млн. руб. | Цена отсечения, % от номинала | Средневзвешенная цена, % от номинала | Доходность по цене отсечения, % годовых | Доходность по средневзвешенной цене, % годовых | Объем эмиссии, млн. руб. | Номинал бумаги, рублей | Дней до погашения | НКД, % от номинала | НКД, руб. | Объем в обращении, млн. руб. |
|---------------|--------------|------------|----------------|-------------------------------------|---|-----------------------------|--------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---|--|--------------------------|------------------------|-------------------|--------------------|-----------|------------------------------|
| 24.06.2009 | SU25064RMFS5 | ОФЗ-ПД | 18.01.2012 | 6 780,969 | 6 937,798 | 2 018,001 | 2 078,257 | 100,8940 | 100,9319 | 11,99 | 11,98 | 10 000,00 | 1 000 | 938 | 2,054 | 20,54 | 37 929,591 |