

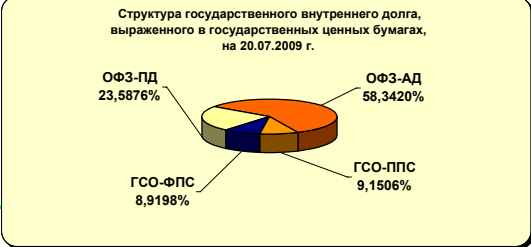
Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах

20 июля 2009 года

Государственный внутренний долг Российской Федерации,
выраженный в государственных ценных бумагах 1 479 855,423 млн. рублей

По видам ценных бумаг:

| | млн. рублей |
|---------|-------------|
| ОФЗ-ПД | 349 062,881 |
| ОФЗ-АД | 863 377,412 |
| ГСО-ППС | 135 415,130 |
| ГСО-ФПС | 132 000,000 |



Операции Минфина России на внутреннем рынке государственных ценных бумаг

01.01.2009 - 20.07.2009 млн. рублей

| | |
|---------------------------|--------------------|
| Чистое привлечение | 60 854,818 |
| Привлечение | 160 816,760 |
| в том числе | |
| ОФЗ-ПД | 60 871,160 |
| ОФЗ-ФК | - |
| ОФЗ-АД | - |
| ГСО-ППС | 99 945,600 |
| ГСО-ФПС | - |
| Погашение | 99 961,942 |
| в том числе | |
| ОФЗ-ПД | 40 587,636 |
| ОФЗ-ФК | 30 779,330 |
| ОФЗ-АД | 18 648,776 |
| ГСО-ППС | 9 946,200 |
| ГСО-ФПС | - |

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

01.01.2009 - 20.07.2009 млн. рублей

| | Кассовый расход | Уменьшение расходов по статье 113 БК РФ | | По бюджету |
|--------------|-------------------|---|--------------------------|-------------------|
| | | НКД | превышение над номиналом | |
| ОФЗ-ПД | 9 982,040 | 685,104 | 383,172 | 8 913,764 |
| ОФЗ-ФК | 4 176,877 | - | - | 4 176,877 |
| ОФЗ-АД | 26 323,080 | - | - | 26 323,080 |
| ГСО-ППС | 2 391,528 | - | - | 2 391,528 |
| ГСО-ФПС | 5 036,480 | - | - | 5 036,480 |
| ИТОГО | 47 910,005 | 685,104 | 383,172 | 46 841,729 |

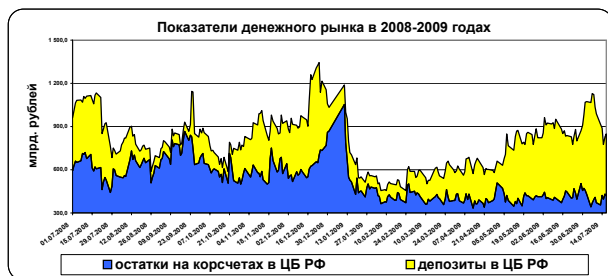
Текущее состояние рынка

20 июля 2009 года

Финансовые индикаторы

| | на 17.07.2009 | на 10.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Курс доллара США (Банк России), руб./долл. | 31,6943 | 31,8878 | -0,61% |
| Курс евро (Банк России), руб./евро | 44,6066 | 44,4070 | 0,45% |
| Курс USD / EUR | 1,4074 | 1,3926 | 1,06% |
| Остатки на кор. счетах ЦБ РФ, млрд. рублей | 417,1 | 370,4 | 12,61% |
| Средства на депозитах, млрд. рублей | 431,2 | 619,4 | -30,38% |

| | 10.07.2009 | 03.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|---|------------|------------|------------------------|
| Золотовалютные резервы ЦБ РФ, млрд. долл. США | 400,7 | 409,1 | -2,05% |



Показатели рынка ГКО-ОФЗ

| | 17.07.2009 | 10.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Объем рынка ГКО-ОФЗ по номиналу, млн. рублей (*) | 1 112 434,247 | 1 122 210,115 | -0,87% |
| Капитализация рынка ГКО-ОФЗ, млн. рублей (*) | 937 035,845 | 950 532,150 | -1,42% |
| Дюрация рынка ГКО-ОФЗ, дней (*) | 1 816,32 | 1 797,21 | 1,06% |

(*) Данные Банка России

Операции Минфина России на рынке

Проведенные операции
в период с 13.07.2009 по 17.07.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------------|-------------------|
| | Эмиссия | Привлечение |
| ОФЗ-ПД | 8 872,907 | 8 679,171 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | 30 000,000 | 29 981,790 |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 38 872,907 | 38 660,961 |

Планируемые операции
в период с 20.07.2009 по 24.07.2009

| | 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 | 18 648,776 | 18 648,776 |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 18 648,776 | 18 648,776 |

Погашение

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

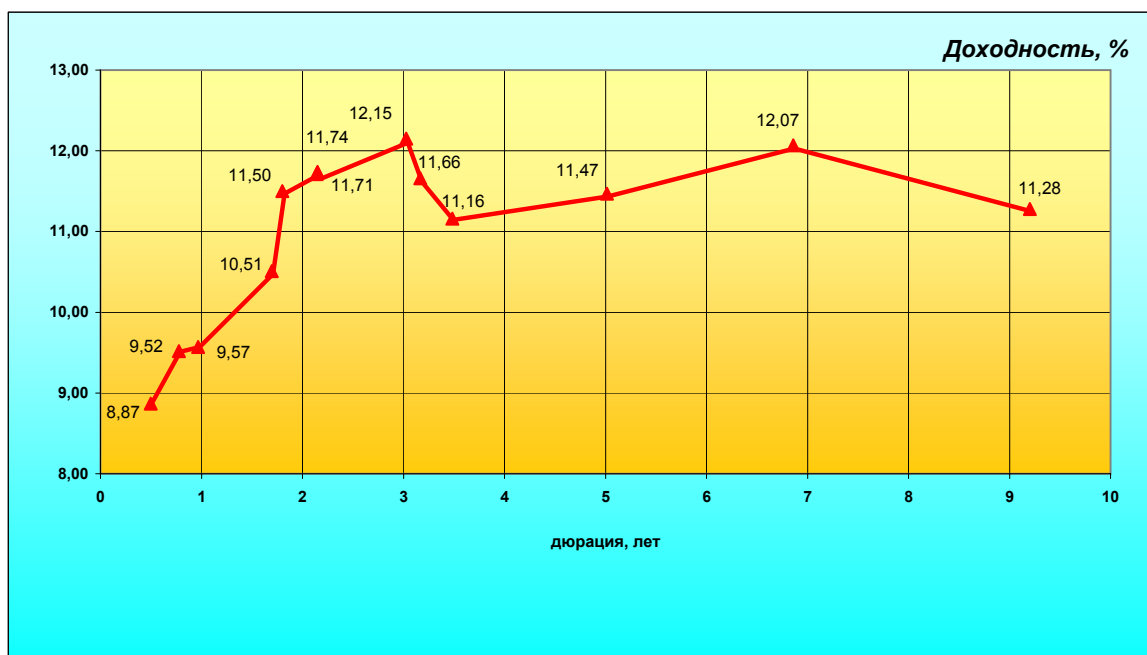
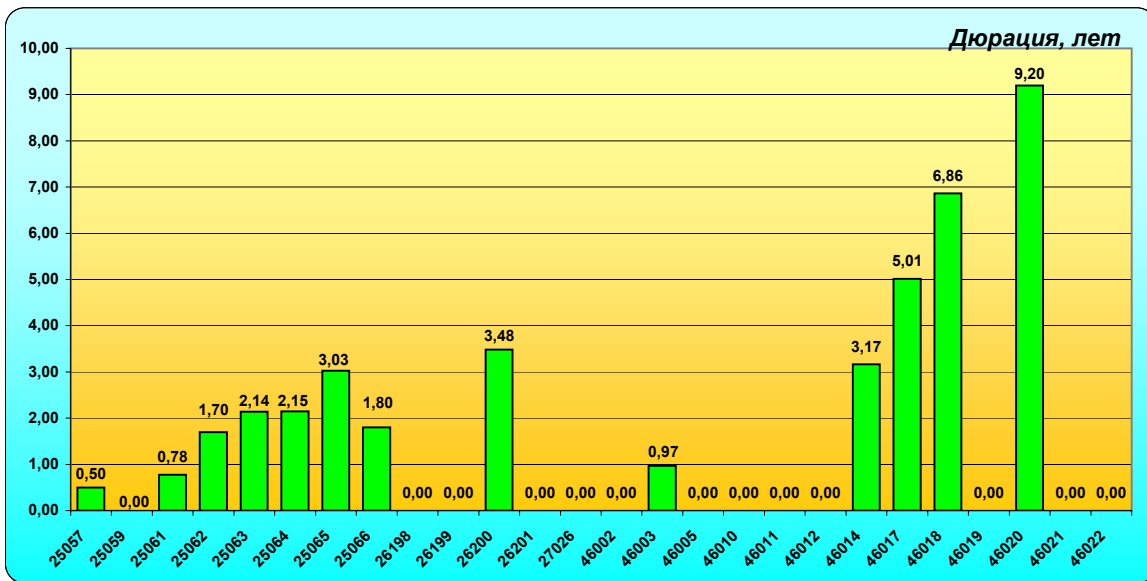
Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|------------------|--|
| ОФЗ-ПД | 612,824 | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | 1 859,656 | |
| ГСО-ППС | 2 060,800 | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 4 533,280 | |

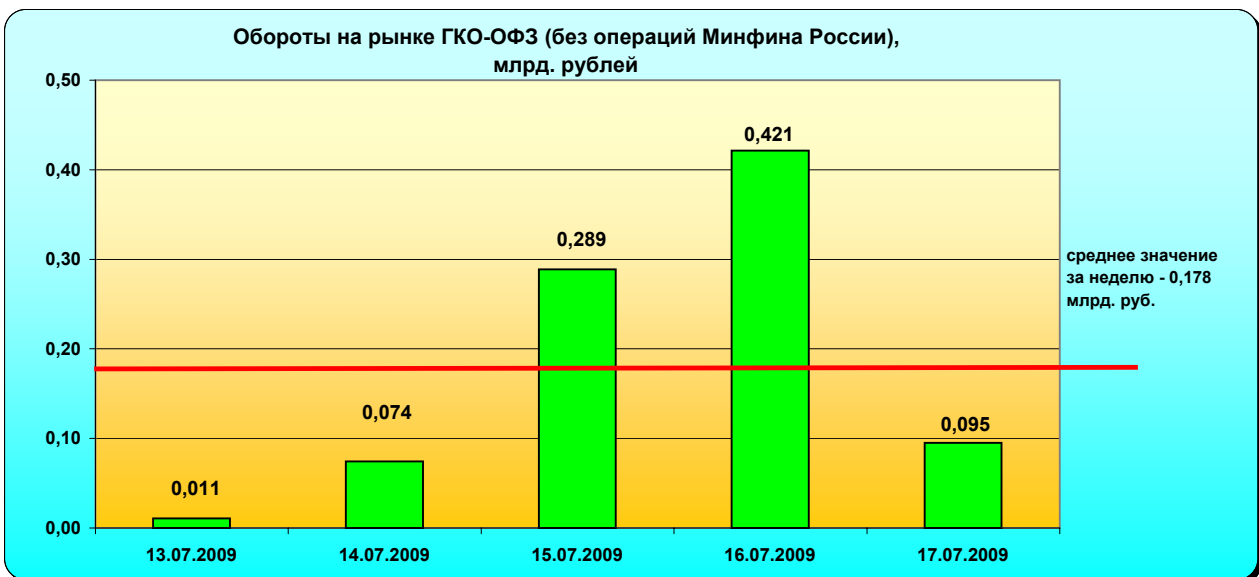
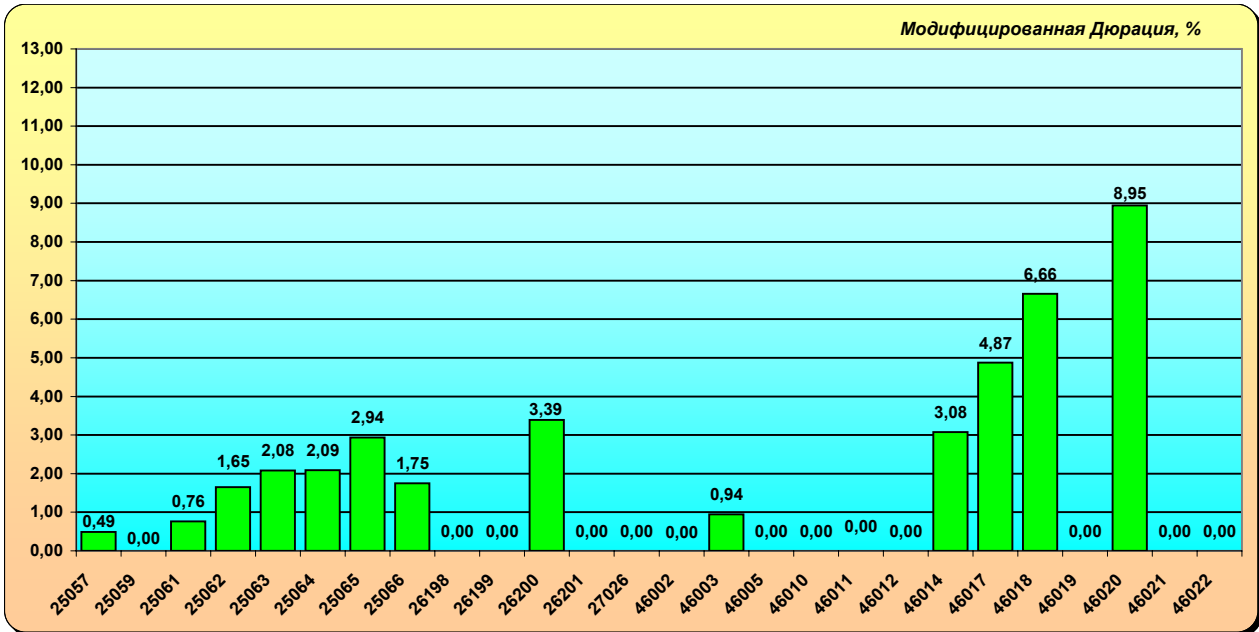
Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|------------------|--|
| ОФЗ-ПД | 3 227,507 | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | 1 055,529 | |
| ГСО-ППС | 6,314 | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 4 289,350 | |

Текущее состояние рынка

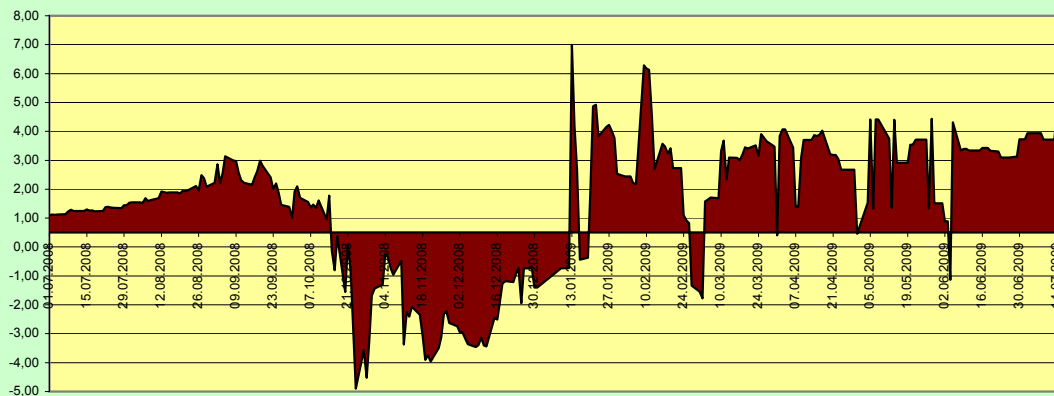


Текущее состояние рынка

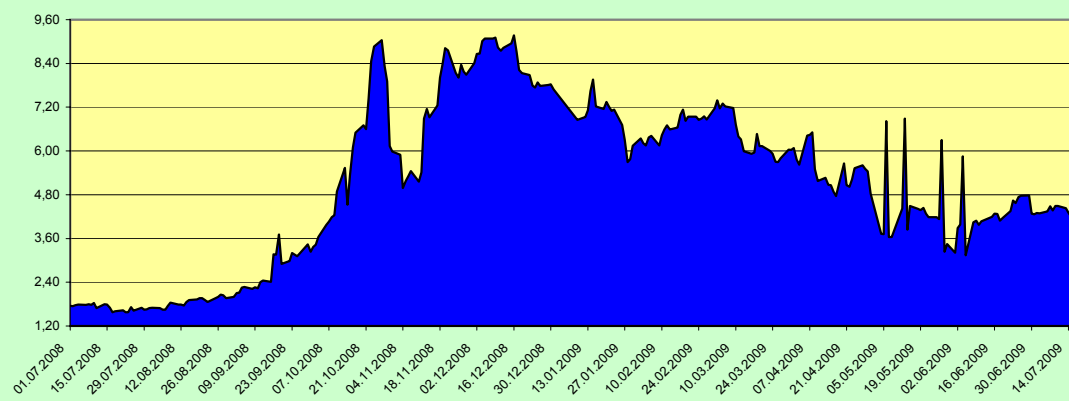


Текущее состояние рынка

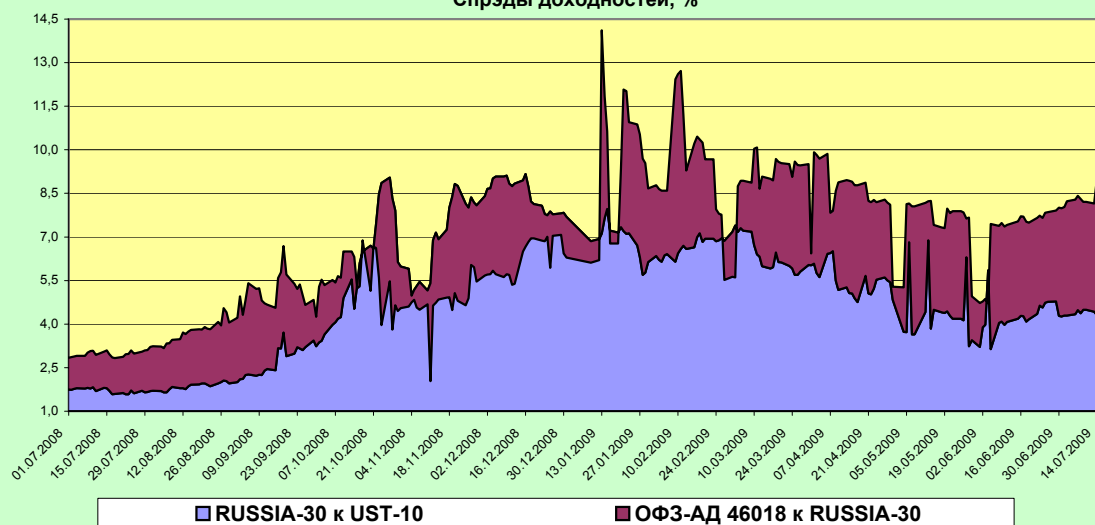
Спрэд доходности ОФЗ-АД 46018 к RUSSIA-30, %



Спрэд доходности RUSSIA-30 к UST-10, %



Спрэды доходностей, %



Информация по аукционам ОФЗ с 13.07.2009 по 17.07.2009

| 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. |
|---------------|--------------|------------|----------------|-------------------------------------|---|-----------------------------|--------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---|--|--------------------------|------------------------|-------------------|--------------------|-----------|------------------------------|
| 15.07.2009 | SU25065RMFS2 | ОФЗ-ПД | 27.03.2013 | 8 507,831 | 8 565,427 | 5 983,315 | 6 057,576 | 100,5711 | 100,7811 | 12,34 | 12,26 | 6 000,00 | 1 000 | 1 351 | 0,460 | 4,60 | 10 319,539 |