

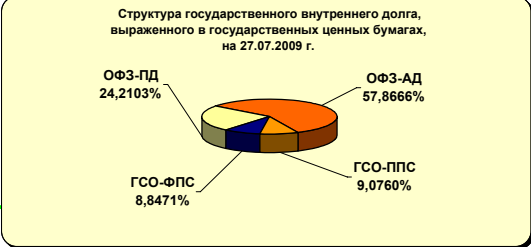
Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах

27 июля 2009 года

Государственный внутренний долг Российской Федерации,
выраженный в государственных ценных бумагах 1 492 012,887 млн. рублей

По видам ценных бумаг:

| | млн. рублей |
|---------|-------------|
| ОФЗ-ПД | 361 220,345 |
| 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 - 27.07.2009

млн. рублей

| | | | |
|---------------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| Чистое привлечение | | 73 000,020 | |
| ↓ | | ↓ | |
| Привлечение | 172 961,962 | Погашение | 99 961,942 |
| в том числе | | в том числе | |
| ОФЗ-ПД | 73 016,362 | ОФЗ-ПД | 40 587,636 |
| ОФЗ-ФК | - | ОФЗ-ФК | 30 779,330 |
| ОФЗ-АД | - | ОФЗ-АД | 18 648,776 |
| ГСО-ППС | 99 945,600 | ГСО-ППС | 9 946,200 |
| ГСО-ФПС | - | ГСО-ФПС | - |

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

01.01.2009 - 27.07.2009

млн. рублей

| | Кассовый расход | Уменьшение расходов по статье 113 БК РФ | | По бюджету |
|--------------|-------------------|---|--------------------------|-------------------|
| | | НКД | превышение над номиналом | |
| ОФЗ-ПД | 13 209,547 | 731,129 | 517,837 | 11 960,581 |
| ОФЗ-ФК | 4 176,877 | - | - | 4 176,877 |
| ОФЗ-АД | 27 378,609 | - | - | 27 378,609 |
| ГСО-ППС | 2 397,842 | - | - | 2 397,842 |
| ГСО-ФПС | 5 036,480 | - | - | 5 036,480 |
| ИТОГО | 52 199,355 | 731,129 | 517,837 | 50 950,389 |

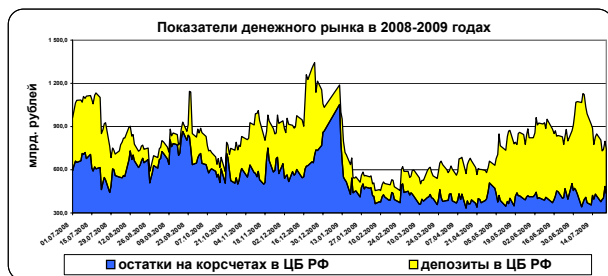
Текущее состояние рынка

27 июля 2009 года

Финансовые индикаторы

| | на 24.07.2009 | на 17.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Курс доллара США (Банк России), руб./долл. | 31,0760 | 31,6943 | -1,95% |
| Курс евро (Банк России), руб./евро | 44,2771 | 44,6066 | -0,74% |
| Курс USD / EUR | 1,4248 | 1,4074 | 1,24% |
| Остатки на кор. счетах ЦБ РФ, млрд. рублей | 436,1 | 417,1 | 4,56% |
| Средства на депозитах, млрд. рублей | 308,3 | 431,2 | -28,50% |

| | 17.07.2009 | 10.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|---|------------|------------|------------------------|
| Золотовалютные резервы ЦБ РФ, млрд. долл. США | 398,1 | 400,9 | -0,70% |



Показатели рынка ГКО-ОФЗ

| | 24.07.2009 | 17.07.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Объем рынка ГКО-ОФЗ по номиналу, млн. рублей (*) | 1 125 006,841 | 1 112 434,247 | 1,13% |
| Капитализация рынка ГКО-ОФЗ, млн. рублей (*) | 955 182,051 | 937 035,845 | 1,94% |
| Дюрация рынка ГКО-ОФЗ, дней (*) | 1 816,85 | 1 816,32 | 0,03% |

(*) Данные Банка России

Операции Минфина России на рынке

Проведенные операции
в период с 20.07.2009 по 24.07.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------------|-------------------|
| | Эмиссия | Привлечение |
| ОФЗ-ПД | 12 157,464 | 12 145,202 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 12 157,464 | 12 145,202 |

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

Планируемые операции
в период с 27.07.2009 по 31.07.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------|-------------------|
| | Эмиссия | |
| ОФЗ-ПД | | 15 000,000 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | | 15 000,000 |

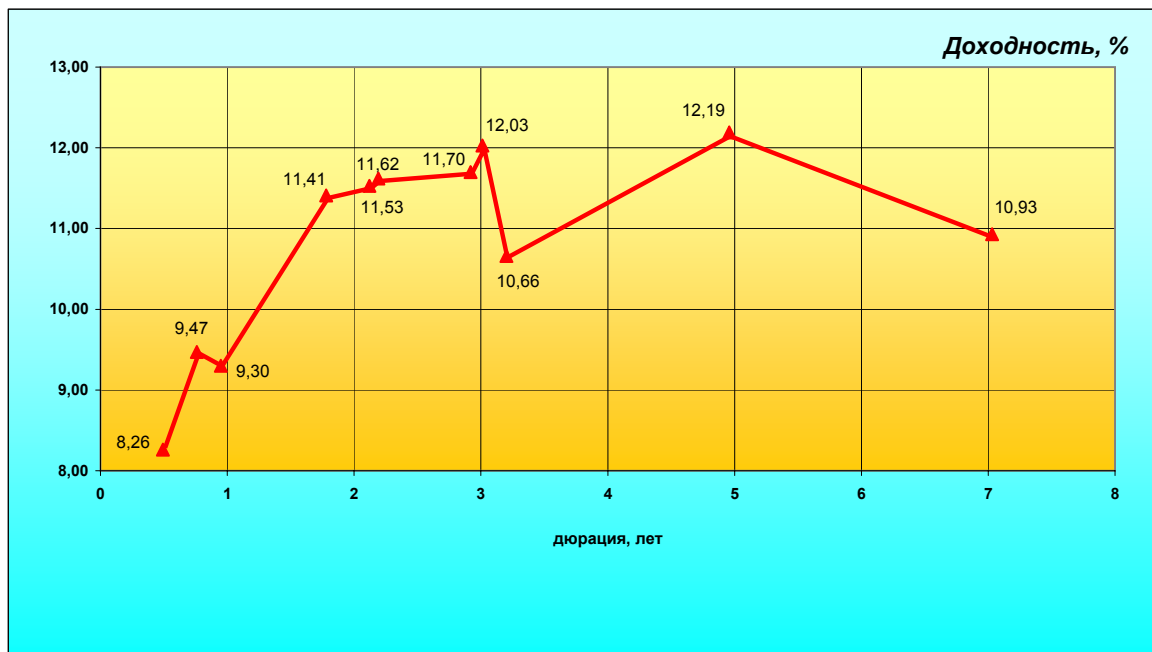
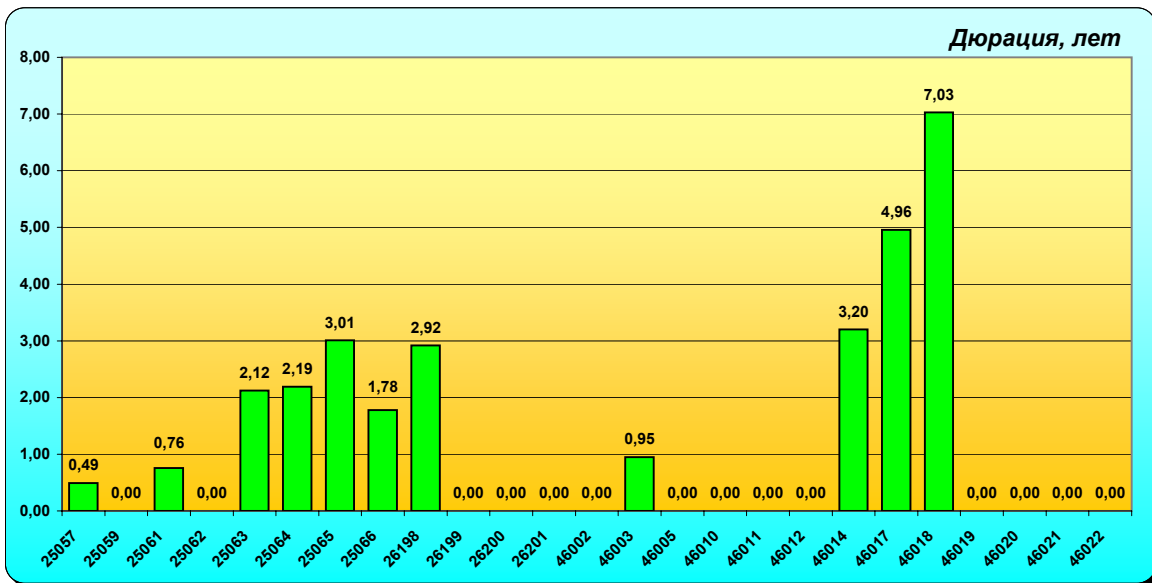
Погашение

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

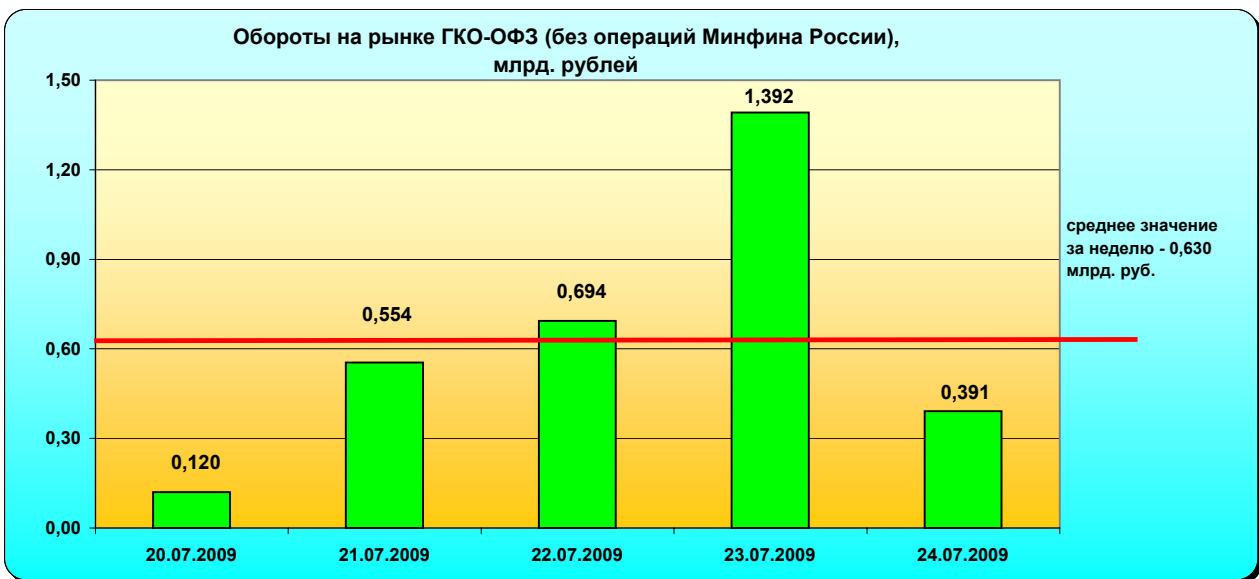
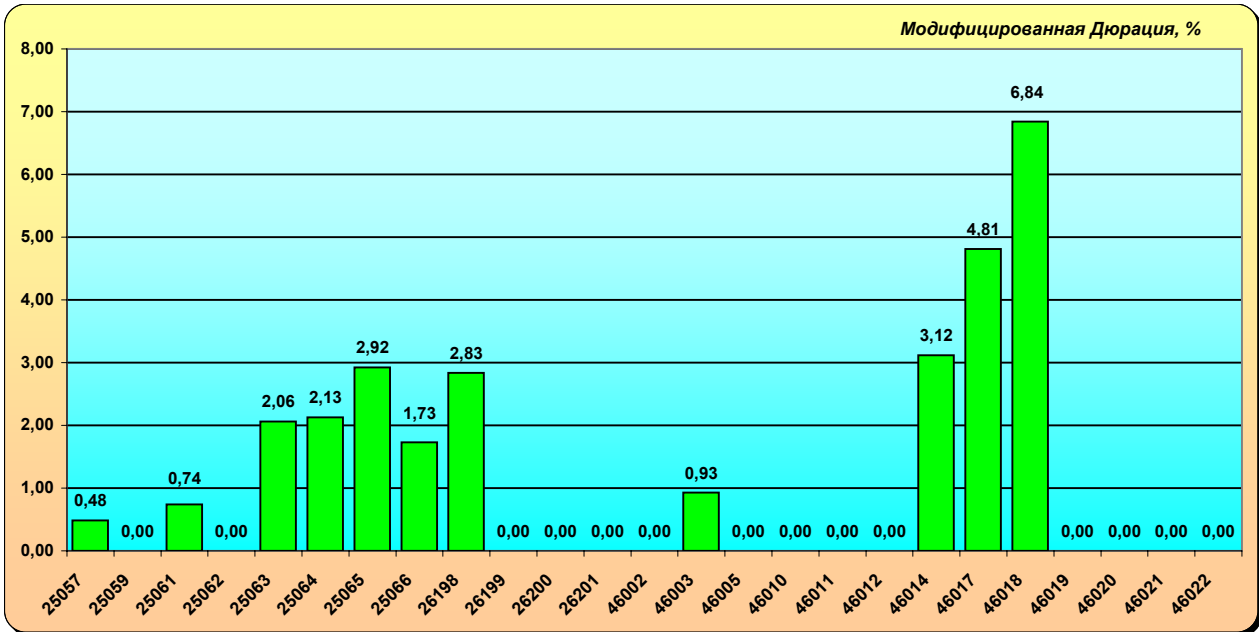
Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------|------------------|
| ОФЗ-ПД | | |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | 1 944,800 |
| ВСЕГО | | 1 944,800 |

Текущее состояние рынка

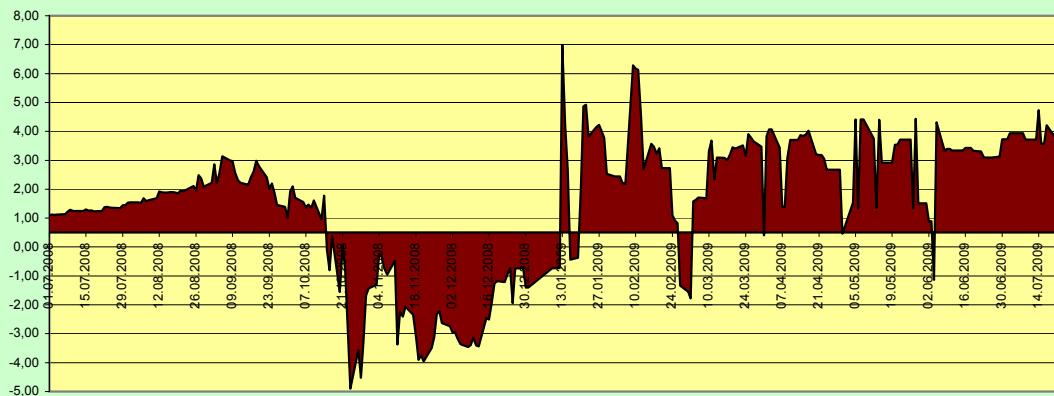


Текущее состояние рынка

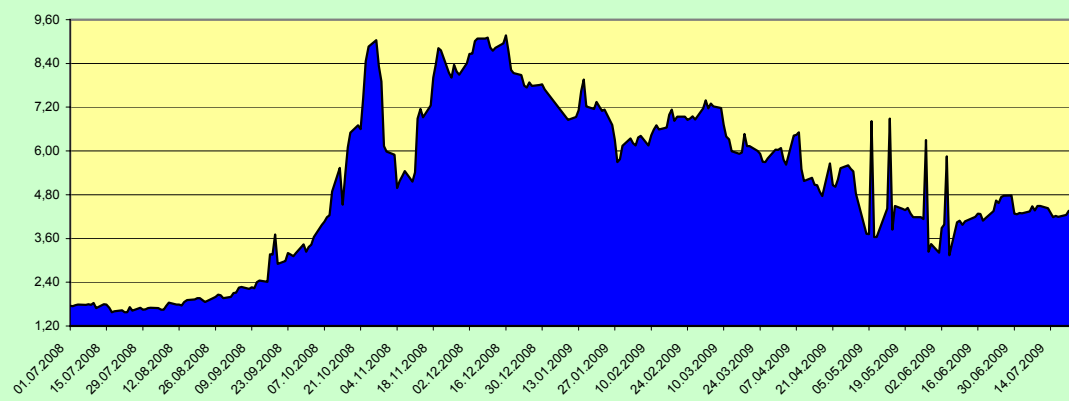


Текущее состояние рынка

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



Спрэд доходности RUSSIA-30 к UST-10, %



Спрэды доходностей, %

