

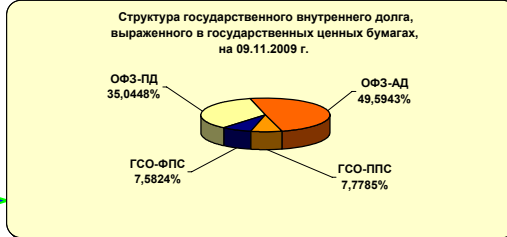
Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах

9 ноября 2009 года

Государственный внутренний долг Российской Федерации, выраженный в государственных ценных бумагах 1 740 881,661 млн. рублей

По видам ценных бумаг:

| | млн. рублей |
|---------|-------------|
| ОФЗ-ПД | 610 089,119 |
| 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 - 09.11.2009

млн. рублей

| Чистое привлечение | | 321 437,709 | |
|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| Привлечение | 421 399,651 | Погашение | 99 961,942 |
| в том числе | | в том числе | |
| ОФЗ-ПД | 321 454,051 | 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 - 09.11.2009

млн. рублей

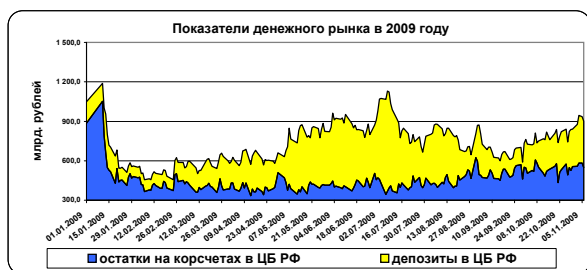
| | Кассовый расход | Уменьшение расходов по статье 113 БК РФ | | По бюджету |
|--------------|-------------------|---|--------------------------|-------------------|
| | | НКД | превышение над номиналом | |
| ОФЗ-ПД | 25 642,541 | 2 487,450 | 4 753,865 | 18 401,226 |
| ОФЗ-ФК | 4 176,877 | - | - | 4 176,877 |
| ОФЗ-АД | 44 953,143 | - | - | 44 953,143 |
| ГСО-ППС | 2 865,756 | - | - | 2 865,756 |
| ГСО-ФПС | 8 614,360 | - | - | 8 614,360 |
| ИТОГО | 86 252,677 | 2 487,450 | 4 753,865 | 79 011,362 |

Текущее состояние рынка

9 ноября 2009 года

Финансовые индикаторы

| | на 06.11.2009 | на 30.10.2009 | Изменение за неделю, % |
|---|---------------|---------------|------------------------|
| Курс доллара США (Банк России), руб./долл. | 29,1330 | 29,3441 | -0,72% |
| Курс евро (Банк России), руб./евро | 43,1897 | 43,2180 | -0,07% |
| Курс USD / EUR | 1,4825 | 1,4728 | 0,66% |
| Остатки на кор. счетах ЦБ РФ, млрд. рублей | 548,3 | 554,9 | -1,19% |
| Средства на депозитах, млрд. рублей | 352,8 | 286,5 | 23,14% |
| | 30.10.2009 | 23.10.2009 | Изменение за неделю, % |
| Золотовалютные резервы ЦБ РФ, млрд. долл. США | 432,8 | 429,3 | 0,82% |



Показатели рынка ГКО-ОФЗ

| | на 06.11.2009 | на 30.10.2009 | Изменение за неделю, % |
|--|---------------|---------------|------------------------|
| Объем рынка ГКО-ОФЗ по номиналу, млн. рублей (*) | 1 373 460,485 | 1 372 858,990 | 0,04% |
| Капитализация рынка ГКО-ОФЗ, млн. рублей (*) | 1 279 752,087 | 1 277 106,026 | 0,21% |
| Дюрация рынка ГКО-ОФЗ, дней (*) | 1 650,56 | 1 648,99 | 0,10% |

(*) Данные Банка России

Операции Минфина России на рынке

Проведенные операции
в период с 02.11.2009 по 06.11.2009

| | млн. рублей | |
|--------------|----------------|----------------|
| | Эмиссия | Привлечение |
| ОФЗ-ПД | 601,495 | 581,277 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | 601,495 | 581,277 |

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 | | 3 627,294 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | | 3 627,294 |

Планируемые операции
в период с 09.11.2009 по 13.11.2009

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

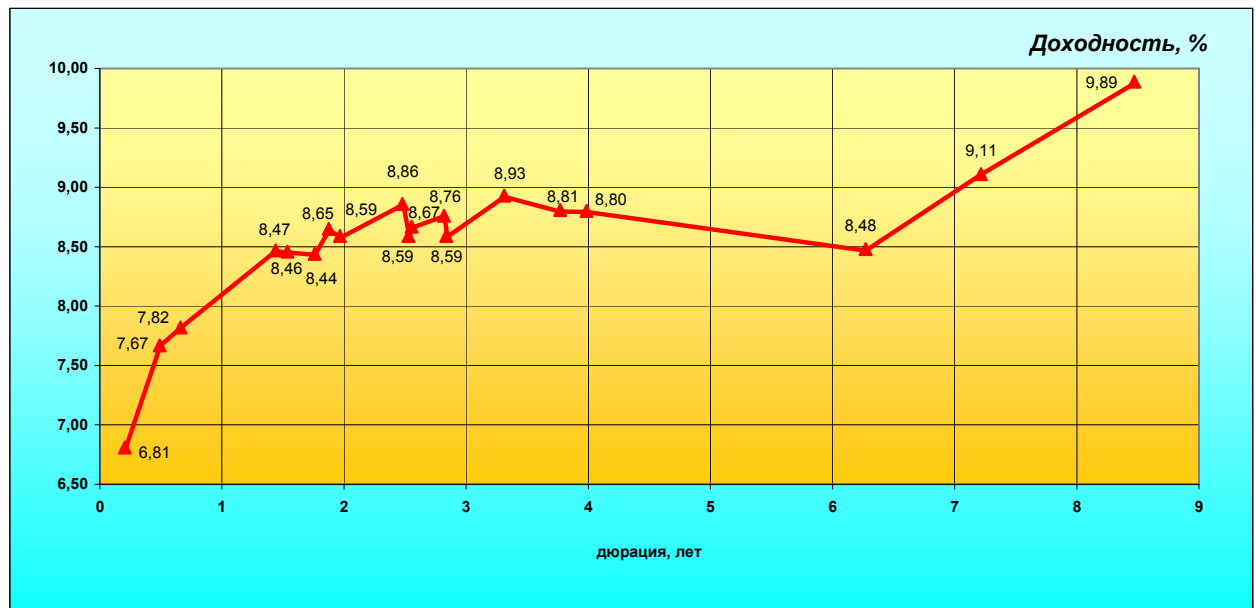
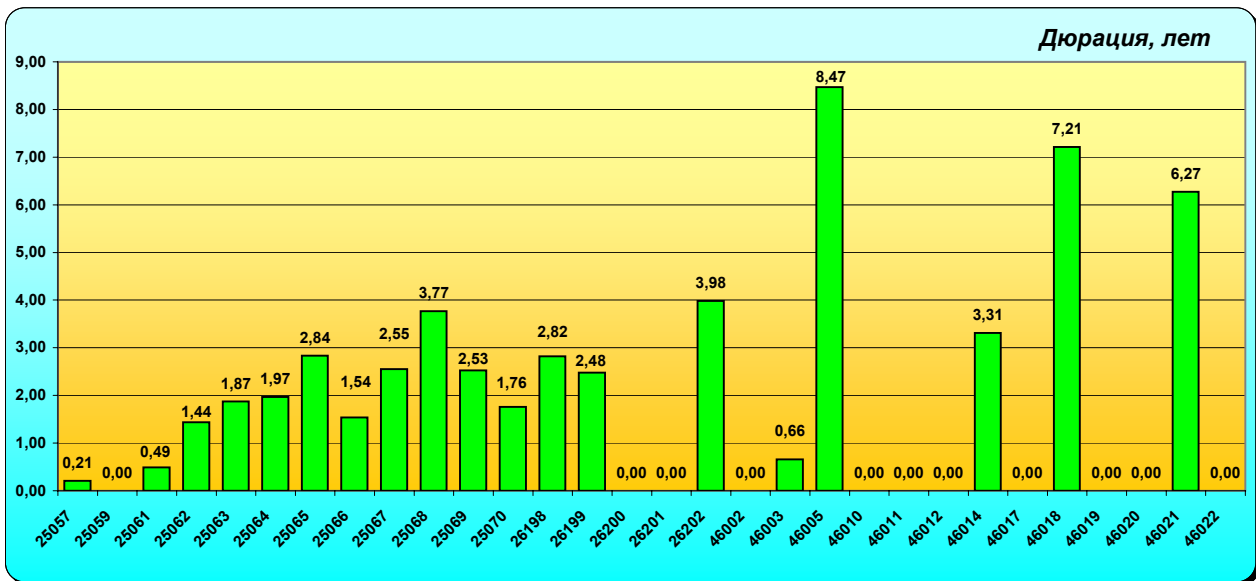
Погашение

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

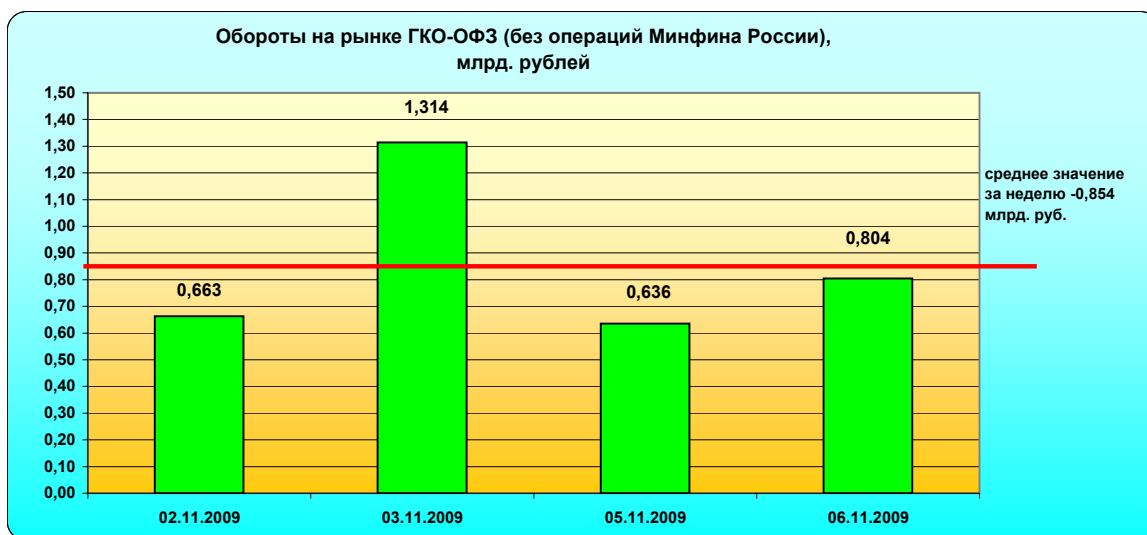
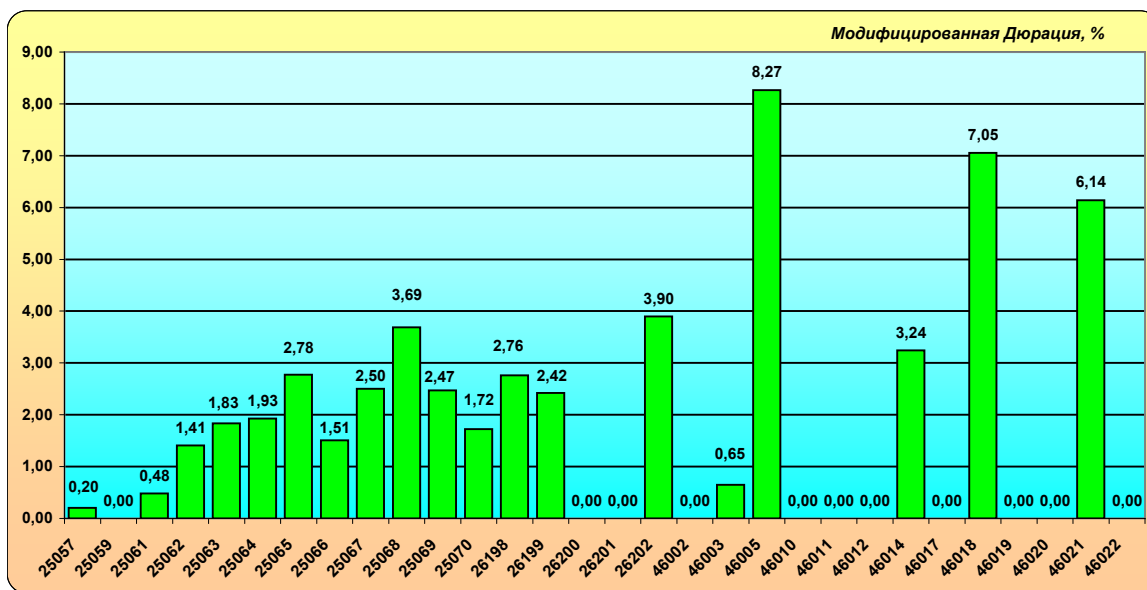
Выплата купонов

| | млн. рублей | |
|--------------|-------------|------------------|
| ОФЗ-ПД | | 309,200 |
| ОФЗ-ФК | | |
| ОФЗ-АД | | 4 119,457 |
| ГСО-ППС | | |
| ГСО-ФПС | | |
| ВСЕГО | | 4 428,657 |

Текущее состояние рынка

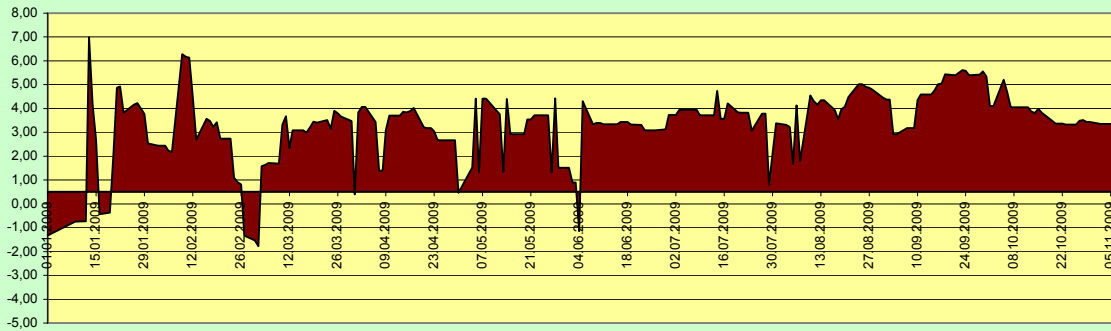


Текущее состояние рынка

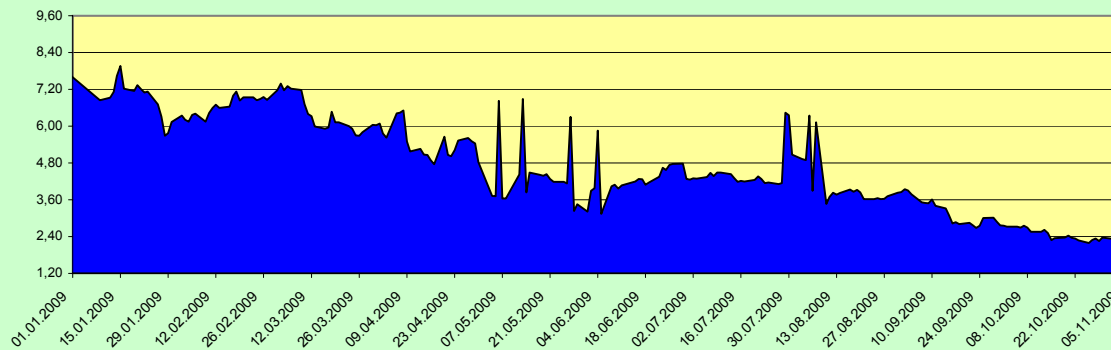


Текущее состояние рынка

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



Спрэд доходности RUSSIA-30 к UST-10, %



Спрэды доходностей, %

