

Риск-параметры рынка ценных бумаг (облигации) в период новогодних праздников

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
1	ОФЗ 25075	RU000A0JQYN4	7,00%	10,00%	15,00%	1 000 000	5 000 000
2	ОФЗ 25077	RU000A0JR7G1	7,00%	10,00%	15,00%	1 000 000	5 000 000
3	ОФЗ 25079	RU000A0JRHZ1	7,00%	10,00%	15,00%	1 000 000	5 000 000
4	ОФЗ 25080	RU000A0JS751	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
5	ОФЗ 25081	RU000A0JTKZ1	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
6	ОФЗ 25082	RU000A0JTWV3	12,00%	14,00%	19,00%	1 000 000	5 000 000
7	ОФЗ 26202	RU000A0JQCL4	7,00%	10,00%	15,00%	1 000 000	5 000 000
8	ОФЗ 26203	RU000A0JQZ18	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
9	ОФЗ 26204	RU000A0JRCJ6	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
10	ОФЗ 26205	RU000A0JREQ7	21,00%	28,00%	36,00%	1 000 000	5 000 000
11	ОФЗ 26206	RU000A0JRJU8	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
12	ОФЗ 26207	RU000A0JS3W6	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
13	ОФЗ 26208	RU000A0JS4M5	18,00%	23,00%	29,00%	1 000 000	5 000 000
14	ОФЗ 26209	RU000A0JSMA2	24,00%	32,00%	40,00%	1 000 000	5 000 000
15	ОФЗ 26210	RU000A0JTG59	21,00%	28,00%	36,00%	1 000 000	5 000 000
16	ОФЗ 26211	RU000A0JTJL3	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
17	ОФЗ 26212	RU000A0JTK38	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
18	ОФЗ 26214	RU000A0JTJA5	18,00%	23,00%	29,00%	1 000 000	5 000 000
19	ОФЗ 26215	RU000A0JU4L3	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
20	ОФЗ 26216	RU000A0JU9V1	18,00%	23,00%	29,00%	1 000 000	5 000 000
21	ОФЗ 46005	RU0002867631	18,00%	24,00%	33,00%	1 000 000	5 000 000
22	ОФЗ 46010	RU0002867839	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
23	ОФЗ 46011	RU0002867854	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
24	ОФЗ 46012	RU0002868001	26,00%	34,00%	42,00%	1 000 000	5 000 000
25	ОФЗ 46014	RU0002868076	15,00%	20,00%	26,00%	2 000 000	10 000 000
26	ОФЗ 46017	RU000A0DY8K8	7,00%	10,00%	15,00%	1 000 000	5 000 000

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
27	ОФЗ 46018	RU000A0D0G29	21,00%	28,00%	36,00%	1 000 000	5 000 000
28	ОФЗ 46019	RU000A0JNHJ4	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
29	ОФЗ 46020	RU000A0GN9A7	26,00%	34,00%	42,00%	1 000 000	5 000 000
30	ОФЗ 46021	RU000A0JP2S9	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
31	ОФЗ 46022	RU000A0JPLH5	23,00%	29,00%	38,00%	1 000 000	5 000 000
32	ОФЗ 46023	RU000A0JRTL6	21,00%	28,00%	36,00%	1 000 000	5 000 000
33	ОФЗ 48001	RU000A0D0GJ32	15,00%	20,00%	26,00%	1 000 000	5 000 000
34	АИЖК, 17	RU000A0JR5F7	24,00%	32,00%	48,00%	100 000	500 000
35	АИЖК, 19	RU000A0JRF37	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
36	АИЖК, 10	RU000A0JPJE6	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
37	АИЖК, 18	RU000A0JR0Y3	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
38	АИЖК, 11	RU000A0JPLU8	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
39	АИЖК, 25	RU000A0JTW83	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
40	АИЖК, 21	RU000A0JS488	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
41	АИЖК, 24	RU000A0JTDX1	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
42	АИЖК, 16	RU000A0JQXG0	55,00%	63,00%	79,00%	200 000	1 000 000
43	АИЖК, БО-01	RU000A0JU5T3	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
44	Альфа-Банк, БО-3	RU000A0JT213	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
45	Альфа-Банк, 01	RU000A0JR7S6	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
46	Альфа-Банк, 02	RU000A0JRZB4	21,00%	29,00%	45,00%	200 000	1 000 000
47	Альфа-Банк, БО-07	RU000A0JSW35	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
48	Альфа-Банк, БО-09	RU000A0JU2T0	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
49	Альфа-Банк, БО-04	RU000A0JU849	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
50	Альфа-Банк, БО-8	RU000A0JTP41	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
51	Внешэкономбанк, 21	RU000A0JS4Z7	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
52	Внешэкономбанк, 08	RU000A0JR3G0	21,00%	29,00%	45,00%	200 000	1 000 000
53	Внешэкономбанк, 10	RU000A0JR0N2	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
54	Внешэкономбанк, 06	RU000A0JR3H8	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
55	Внешэкономбанк, 09	RU000A0JRCX7	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
56	Внешэкономбанк, 18	RU000A0JT403	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
57	Внешэкономбанк, 19	RU000A0JT6B2	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
58	Внешэкономбанк, БО-14	RU000A0JU6K0	52,00%	60,00%	76,00%	200 000	1 000 000
59	ВТБ, БО-04	RU000A0JS1P4	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
60	ВТБ, БО-08	RU000A0JSX00	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
61	ВТБ, БО-03	RU000A0JS1M1	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
62	ВТБ, БО-06	RU000A0JS1T6	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
63	ВТБ, БО-21	RU000A0JTK20	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
64	ВТБ, 06	RU000A0JNGU3	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
65	ВТБ, БО-07	RU000A0JS1U4	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
66	ВТБ, БО-20	RU000A0JT3E3	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
67	ВТБ, БО-19	RU000A0JT3C7	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
68	ВТБ, БО-22	RU000A0JTNO1	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
69	ВЭБ-Лизинг, 08	RU000A0JRUY7	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
70	ВЭБ-Лизинг, 03	RU000A0JREW5	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
71	ВЭБ-Лизинг, 09	RU000A0JRV52	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
72	ВЭБ-Лизинг, 04	RU000A0JREX3	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
73	ВЭБ-Лизинг, 05	RU000A0JREZ8	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
74	ВЭБ-Лизинг, 06	RU000A0JS389	28,00%	36,00%	52,00%	100 000	500 000
75	ВЭБ-Лизинг, 11	RU000A0JTQU9	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
76	ВЭБ-Лизинг, 10	RU000A0JTQS3	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
77	ВЭБ-Лизинг, 12	RU000A0JU9S7	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
78	ВЭБ-Лизинг, 13	RU000A0JU9T5	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
79	Газпром Капитал, 05	RU000A0JTNC4	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
80	Газпром Капитал, 06	RU000A0JTND2	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
81	Газпром Капитал, 04	RU000A0JTNB6	52,00%	60,00%	76,00%	200 000	1 000 000
82	Газпром нефть, 11	RU000A0JS3B0	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
83	Газпром нефть, 12	RU000A0JTDY9	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
84	Газпром нефть, 09	RU000A0JR860	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
85	Газпром нефть, 10	RU000A0JR878	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
86	Газпром нефть, 08	RU000A0JR852	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
87	Газпром нефть, 04	RU000A0JQ557	52,00%	60,00%	76,00%	200 000	1 000 000
88	Газпромбанк, 06	RU000A0JSD38	21,00%	29,00%	45,00%	400 000	2 000 000
89	Газпромбанк, БО-03	RU000A0JS322	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
90	Газпромбанк, БО-04	RU000A0JS173	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
91	Газпромбанк, БО-08	RU000A0JUMH3	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
92	Газпромбанк, БО-09	RU000A0JUQ39	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
93	Газпромбанк, БО-10	RU000A0JUV08	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
94	Газпромбанк, 12	RU000A0JT6J5	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
95	Газпромбанк, 10	RU000A0JT6D8	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
96	Газпромбанк, 11	RU000A0JT6G1	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
97	Газпромбанк, 07	RU000A0JT767	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
98	Евразийский банк развития, 06	RU000A0JS8Y1	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
99	Евразийский банк развития, 07	RU000A0JS8Z8	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
100	Москва, 44	RU000A0E6TK0	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
101	Москва, 49	RU000A0JNYP6	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
102	Москва, 56	RU000A0JPZ50	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
103	Москва, 64	RU000A0JQHJ7	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
104	Москва, 48	RU000A0JNYN1	55,00%	63,00%	79,00%	200 000	1 000 000
105	Москва, 67	RU000A0JTXW1	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
106	НЛМК, 07	RU000A0JSZU2	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
107	НЛМК, 08	RU000A0JTED1	28,00%	36,00%	52,00%	400 000	2 000 000
108	НЛМК, БО-13	RU000A0JU7E1	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
109	РЖД, 14	RU000A0JQ4U0	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
110	РЖД, 23	RU000A0JQRD9	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
111	РЖД, 17	RU000A0JQ7W9	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
112	РЖД, 12	RU000A0JQ5Q5	21,00%	29,00%	45,00%	400 000	2 000 000
113	РЖД, 15	RU000A0JQ6S9	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
114	РЖД, 16	RU000A0JQ656	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
115	РЖД, 11	RU000A0JQ177	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
116	РЖД, 19	RU000A0JQ7Z2	52,00%	60,00%	76,00%	200 000	1 000 000
117	РЖД, 28	RU000A0JTU85	55,00%	63,00%	79,00%	400 000	2 000 000
118	Росбанк, БО-04	RU000A0JSYR1	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
119	Росбанк, БО-05	RU000A0JRW93	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
120	Росбанк, БО-06	RU000A0JTKE6	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
121	Росбанк, БО-07	RU000A0JTQ32	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
122	Роснефть, БО-05	RU000A0JUCS1	52,00%	60,00%	76,00%	400 000	2 000 000
123	Роснефть, БО-06	RU000A0JUCR3	55,00%	63,00%	79,00%	400 000	2 000 000
124	Россельхозбанк, 13	RU000A0JRMC0	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
125	Россельхозбанк, 06	RU000A0JPMT8	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
126	Россельхозбанк, 08	RU000A0JQK64	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
127	Россельхозбанк, 07	RU000A0JPTE5	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
128	Россельхозбанк, БО-02	RU000A0JS371	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
129	Россельхозбанк, 18	RU000A0JT874	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
130	Россельхозбанк, 17	RU000A0JT7M7	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
131	Россельхозбанк, 09	RU000A0JQK72	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
132	Россельхозбанк, 12	RU000A0JRMB2	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
133	Россельхозбанк, 03	RU000A0JP2G4	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
134	Россельхозбанк, 10	RU000A0JQS09	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
135	Россельхозбанк, 11	RU000A0JQS74	16,00%	24,00%	40,00%	100 000	500 000
136	Россельхозбанк, БО-03	RU000A0JS3D6	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
137	Россельхозбанк, 14	RU000A0JRLE8	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
138	Россельхозбанк, 16	RU000A0JS6N8	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000

№ п/п	Облигация	ISIN	Минимальные ограничительные уровни Ставок рыночного риска, %			Лимит концентрации, шт.	
			1 уровень, S_1_min	2 уровень, S_2_min	3 уровень, S_3_min	1 уровень	2 уровень
139	Россельхозбанк, 15	RU000A0JRVN8	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
140	Россельхозбанк, 05	RU000A0JQ1H3	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
141	Россельхозбанк, 20	RU000A0JTVJ2	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
142	Россельхозбанк, 21	RU000A0JU1Q8	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
143	Россельхозбанк, 22	RU000A0JU6A1	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
144	ФСК ЕЭС, 08	RU000A0JR209	24,00%	32,00%	48,00%	200 000	1 000 000
145	ФСК ЕЭС, 06	RU000A0JR1Y7	24,00%	32,00%	48,00%	200 000	1 000 000
146	ФСК ЕЭС, 15	RU000A0JRUS9	21,00%	29,00%	45,00%	400 000	2 000 000
147	ФСК ЕЭС, 18	RU000A0JRZK5	24,00%	32,00%	48,00%	400 000	2 000 000
148	ФСК ЕЭС, БО-01	RU000A0JT7U0	16,00%	24,00%	40,00%	400 000	2 000 000
149	ФСК ЕЭС, 07	RU000A0JR1Z4	28,00%	36,00%	52,00%	100 000	500 000
150	ФСК ЕЭС, 09	RU000A0JR3M8	32,00%	40,00%	56,00%	100 000	500 000
151	ФСК ЕЭС, 10	RU000A0JR217	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
152	ФСК ЕЭС, 25	RU000A0JT2K2	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
153	ФСК ЕЭС, 12	RU000A0JS7H8	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
154	ФСК ЕЭС, 11	RU000A0JR3L0	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000
155	ФСК ЕЭС, 21	RU000A0JT7T2	32,00%	40,00%	56,00%	400 000	2 000 000
156	ФСК ЕЭС, 19	RU000A0JRMX6	52,00%	60,00%	76,00%	400 000	2 000 000
157	ФСК ЕЭС, 13	RU000A0JRL96	55,00%	63,00%	79,00%	200 000	1 000 000
158	ФСК ЕЭС, 24	RU000A0JTКА4	55,00%	63,00%	79,00%	200 000	1 000 000
159	ЮниКредит Банк, БО-09	RU000A0JTP58	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
160	ЮниКредит Банк, БО-08	RU000A0JTP33	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
161	ЮниКредит Банк, БО-04	RU000A0JT8V6	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
162	ЮниКредит Банк, БО-05	RU000A0JT9F7	16,00%	24,00%	40,00%	200 000	1 000 000
163	ЮниКредит Банк, БО-06	RU000A0JTMN3	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
164	ЮниКредит Банк, БО-07	RU000A0JTMP8	28,00%	36,00%	52,00%	200 000	1 000 000
165	ЮниКредит Банк, БО-10	RU000A0JUАJ4	32,00%	40,00%	56,00%	200 000	1 000 000