

BONDS USD GOVERNMENTAL

Эмитент	Валюта	Купон	Котировка на 22.01.2010	Дата погашения	Рейтинг S&P	Код ISIN
RUSSIA FEDERATION	USD	7.500	113.05	31.03.2030	BBB	XS0114288789

BONDS USD CORPORATE

Эмитент	Валюта	Купон	Котировка на 22.01.2010	Дата погашения	Рейтинг S&P	Код ISIN
GAZPROMBANK	USD	6.500	98.05	23.09.2015	BB+	XS0230577941
GAZPROMBANK	USD	7.933	104.65	28.06.2013	BBB-	XS0372523281
TRANSNEFT	USD	5.670	100.70	05.03.2014	BBB	XS0288747669
VTB BANK	USD	6.609	102.45	31.10.2012	N/A	XS0328682587
BK OF MOSCOW	USD	6.807	96.05	10.05.2017	BB+	XS0299183250
VIMPELKOM	USD	8.250	105.20	23.05.2016	BB+	XS0253861834
NAFTOGAS	USD	9.500	92.75	30.09.2014	N/A	XS0459207121
PETROBRAS	USD	6.875	101.10	20.01.2040	BBB	US71645WAQ42

BONDS EUR CORPORATE

Эмитент	Валюта	Купон	Котировка на 22.01.2010	Дата погашения	Рейтинг S&P	Код ISIN
DAIMLER AG	EUR	4.625	104.28	02.09.2014	BBB+	DE000A1A55G9
FIAT FINANCE & TRADE	EUR	7.625	104.41	15.09.2014	BB+	XS0451641285
RENAULT S.A.	EUR	6.000	103.75	13.10.2014	BB	FR0010809236
MORGAN STANLEY	EUR	4.500	102.05	29.10.2014	A	XS0461758830
GOLDMAN SACHS GROUP INC	EUR	4.750	104.60	28.01.2014	A	XS0184927761
GAS CAPITAL SA	EUR	5.030	102.40	25.02.2014	BBB	XS0272762963
MERRILL LYNCH & CO	EUR	4.875	103.60	30.05.2014	A	XS0302633168
BMW US CAPITAL LLC	EUR	5.000	106.18	28.05.2015	A	XS0364671346
GAS CAPITAL SA	EUR	8.125	112.85	04.02.2015	BBB	XS0442330295
RWE FINANCE BV	EUR	5.000	108.82	10.02.2015	A	XS0412842428
FIAT FINANCE & TRADE	EUR	6.875	101.25	13.02.2015	BB+	XS0465889912
METRO AG	EUR	7.625	117.90	05.03.2015	BBB	DE000A0XFCT5
DANONE	EUR	5.500	111.25	06.05.2015	A-	FR0010612713
VODAFONE GROUP PLC	EUR	6.250	113.56	15.01.2016	A-	XS0408285913
E.ON INTL FINANCE BV	EUR	5.500	111.14	19.01.2016	A	XS0408095387
TAYOTA MOTOR CREDIT CORP	EUR	6.625	116.92	03.02.2016	AA	XS0411602765
IMPERIAL TOBACCO FINANCE	EUR	8.375	122.75	17.02.2016	BBB	XS0413494500
ROCHE HLDGS INC	EUR	5.625	112.55	04.03.2016	AA-	XS0415624120
PHILIP MORRIS INTL INC	EUR	5.750	111.77	24.03.2016	A	XS0419195408
MAN SE	EUR	7.250	117.32	20.05.2016	A-	XS0429612566
PFIZER INC	EUR	4.750	108.35	03.06.2016	AA	XS0432070752

LLOYDS TSB BANK PLC	EUR	6.375	109.23	17.06.2016	A+	XS0435070288
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	EUR	6.500	107.41	07.07.2016	BBB-	XS0438813536
NATIONAL AUSTRALIA BANK	EUR	4.750	105.05	15.07.2016	AA	XS0440279338
HEINEKEN NV	EUR	4.625	103.70	10.10.2016	N/A	XS0456567055
AIR FRANCE-KLM	EUR	6.750	105.40	27.10.2016	N/A	FR0010814459
PETROLEOS MEXICANOS	EUR	5.500	101.00	09.01.2017	BBB+	XS0456477578
TOTAL CAPITAL SA	EUR	4.875	108.90	28.01.2019	AA	XS0410303647
ALLIANZ FINANCE II B.V.	EUR	4.750	105.20	22.07.2019	AA	DE000A1AKHB8
LLOYDS TSB BANK PLC	EUR	5.375	100,90	03.09.2019	A+	XS0449361350
AUSTRALIA BANKING GROUP	EUR	5.125	105.05	10.09.2019	AA-	XS0450880496
PORTUGAL TELECOM INT FIN	EUR	5.000	99.04	04.11.2019	BBB	XS0462994343

BONDS GBP CORPORATE

Эмитент	Валюта	Купон	Котировка на 22.01.2010	Дата погашения	Рейтинг S&P	Код ISIN
TESCO PLC	GBP	5.000	104.31	24.02.2014	A-	XS0414350974
NATIONAL GRID PLC	GBP	6.125	107.48	15.04.2014	BBB+	XS0412068453
ROCHE HLDGS INC	GBP	5.500	106.72	04.03.2015	AA-	XS0415625283
FRANCE TELECOM	GBP	5.000	102.42	12.05.2016	A-	XS0427529325
EUROPEAN INVESTMENT BANK	GBP	4.375	105.05	08.07.2015	AAA	XS0223923870
RAIFFEISEN BANK	GBP	4.000	101.00	10.09.2015	AAA	XS0451037062
UBS AG LONDON	GBP	6.375	107.76	20.07.2016	A+	XS0440316635
EDF ENERGY NETWORKS LPN	GBP	5.125	101.65	11.11.2016	A	XS0466117057
BASF SE	GBP	5.875	106.51	31.03.2017	A+	XS0420401779
AT&T INC	GBP	5.875	105.56	28.04.2017	A	XS0426513031
TOTAL CAPITAL SA	GBP	4.250	100.51	08.12.2017	AA	XS0430265693
EUROPEAN INVESTMENT BANK	GBP	4.125	101.62	07.12.2017	AAA	XS0434040167
ROLLS-ROYCE PLC	GBP	6.750	110.83	30.04.2019	A-	XS0426014899
VATTENFALL AB	GBP	6.125	106.50	16.12.2019	A	XS0422688282
GE CAPITAL UK FUNDING	GBP	5.875	98.98	04.11.2020	AA+	XS0463588052
TESCO PLC	GBP	6.125	105.34	24.02.2022	A-	XS0414345974

BONDS AUD, CAD, NZD CORPORATE

Эмитент	Валюта	Купон	Котировка на 22.01.2010	Дата погашения	Рейтинг S&P	Код ISIN
BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	AUD	6.250	100.40	25.06.2014	AAA	XS0434514641
RABOBANK NEDERLAND (AUST)	AUD	6.625	99.89	06.08.2014	AAA	XS0442441522
RAIFFEISEN BANK	NZD	6.250	101.45	10.07.2014	AAA	XS0437848038