



## **Индекс Cbonds-CBI RU High Yield**

## Критерии формирования индексного списка

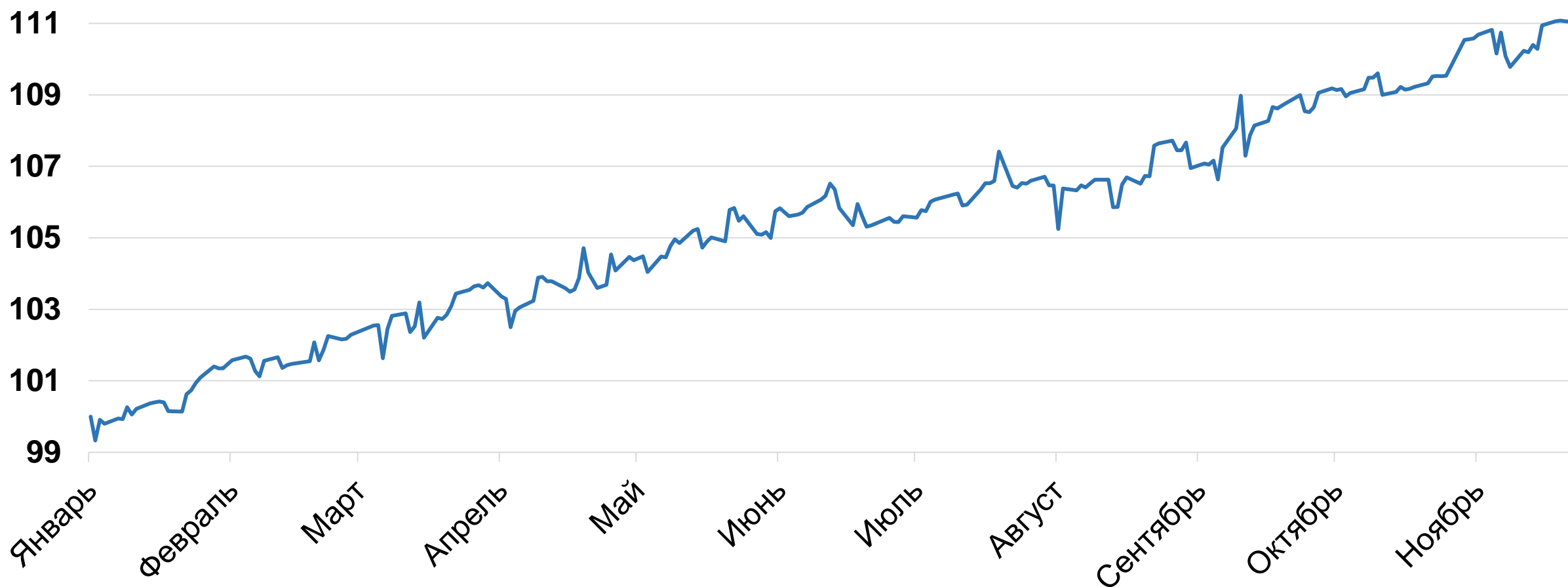
Внутренние корпоративные облигации РФ:

- Объем эмиссии  $\leq 1$  млрд руб.
- Текущая ставка купона  $\geq$  **Ключевая ставка ЦБ РФ + 5%**
- Оставшийся срок до погашения/оферты  $\geq 182$  дней
- Бумага торговалась не менее 1/3 от торговых дней предыдущего квартала

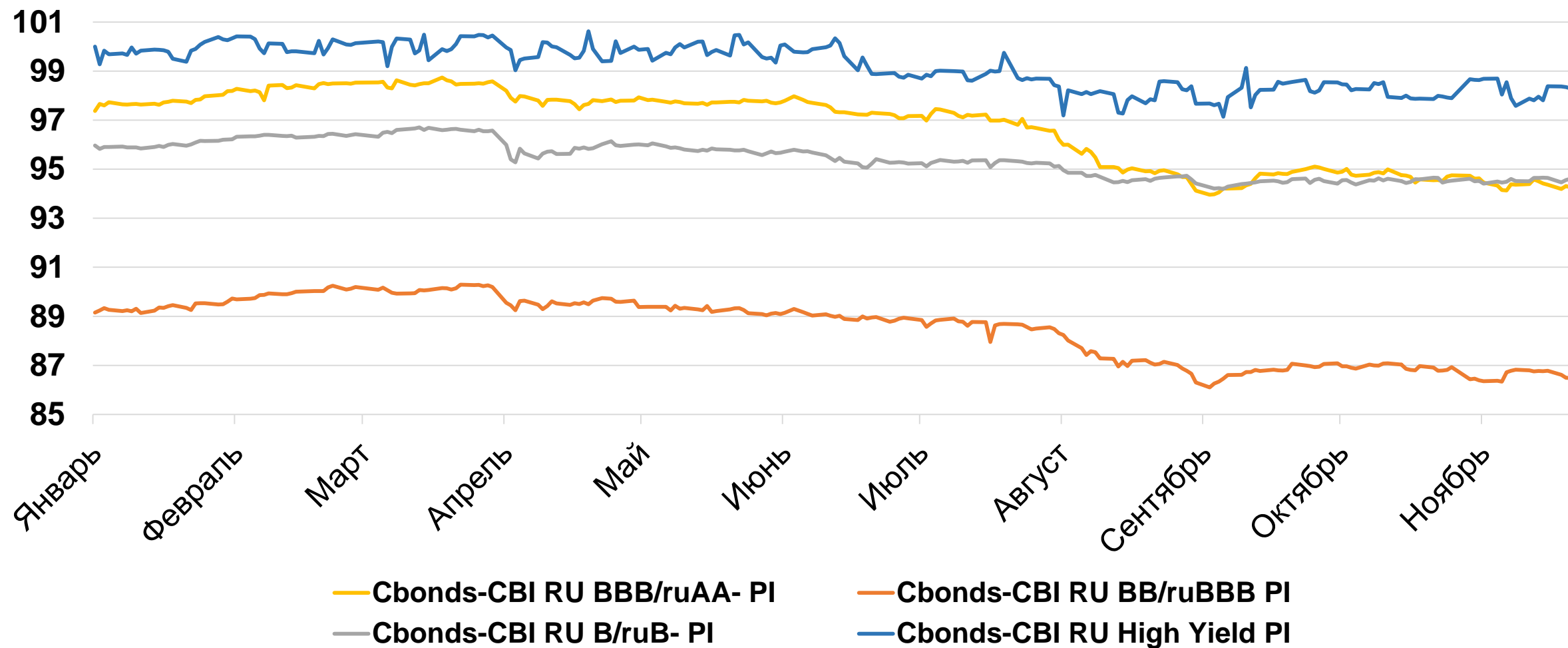
Дата начала расчета индекса – 01.01.2018

Список пересматривается раз в квартал

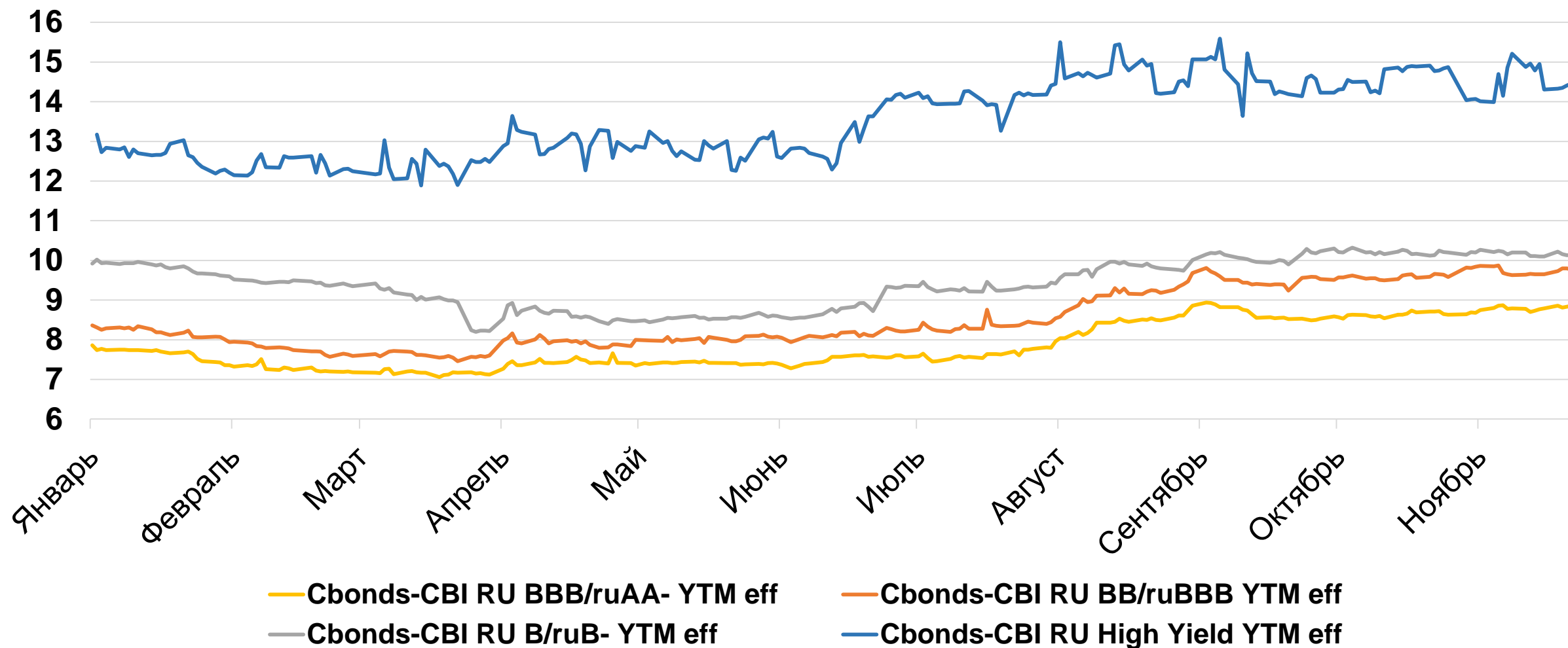
## Динамика основного индекса



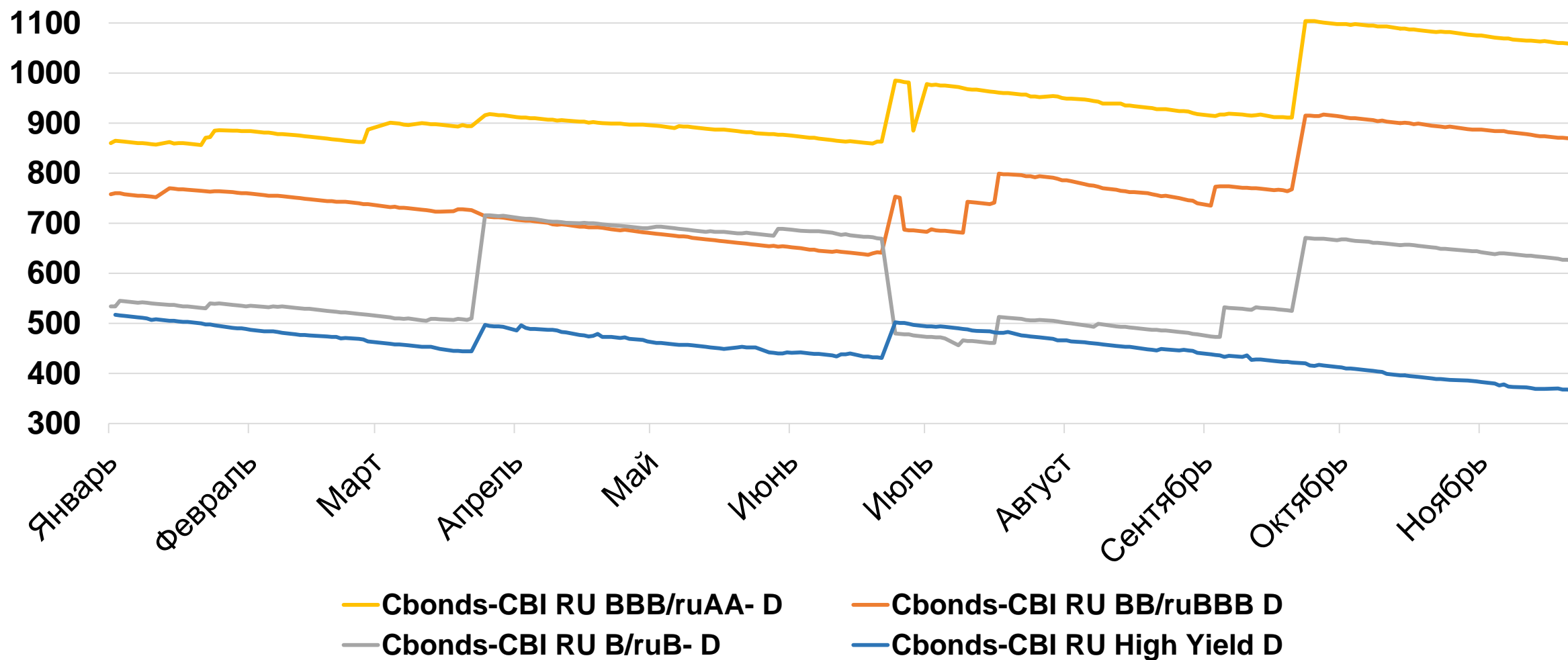
## Динамика ценового индекса



## Динамика эффективной доходности индекса



## Динамика дюрации индекса



## Список бумаг, входящих в индекс

Эмиссия	Объем эмиссии, млн руб.	Ставка купона, %	Список от 01.01.2018	Список от 01.04.2018	Список от 01.07.2018	Список от 01.10.2018
Ломбард Мастер, БО-П01	50	19				+
АПРИ Флай Плэнинг, БО-01	200	18			+	+
Первый Ювелирный – драгоценные металлы, БО-П01	190	18			+	+
Ломбард Мастер, БО-П02	50	18				+
Роял Капитал, БО-П01	50	18				+
Левенгук, БО-01	100	17		+	+	+
КарМани, БО-001-01	300	17	+	+	+	+
ГРУЗОВИЧКОФ-ЦЕНТР, БО-П01	50	17			+	+
Мани Мен, БО-01-01	500	16,5		+	+	+
Полипласт, БО-03	1 000	16	+			
КарМани, БО-001-02	6	16			+	+
ИнфоВотч, 001Р	1,5	15			+	+
РСГ-Финанс, БО-001-01	1,5	15	+	+	+	+
Полипласт, БО-01	1 000	14	+	+		
Жилкапинвест, БО-01	200	14			+	+
Ред Софт, 001Р-01	100	14			+	+
Дядя Дёнер, БО-П01	60	14			+	+
ТД Мясничий, БО-П01	100	13,5				+
ТД Мясничий, БО-П02	100	13,5				+
Коммерческая недвижимость ФПК Гарант-Инвест, 001Р-01	1 000	13	+	+	+	+
ДиректЛизинг, 001Р-01	100	15	+	+	+	+
ДиректЛизинг, 001Р-02	100	13			+	+
Солид-Лизинг, БО-001-01	200	13				+
ПР-Лизинг, 001Р-01	100	13				+
Коммерческая недвижимость ФПК Гарант-Инвест, 001Р-03	1 000	12,75		+	+	+

Наблюдается увеличение количества бумаг,  
удовлетворяющих критериям включения в список

Приглашаем участников рынка высказать мнение  
о методологии расчета индекса Cbonds-CBI RU High Yield

Отдел долговых рынков России и стран СНГ

тел.: +7 (812) 336 97 21

email: [russia@cbonds.info](mailto:russia@cbonds.info)