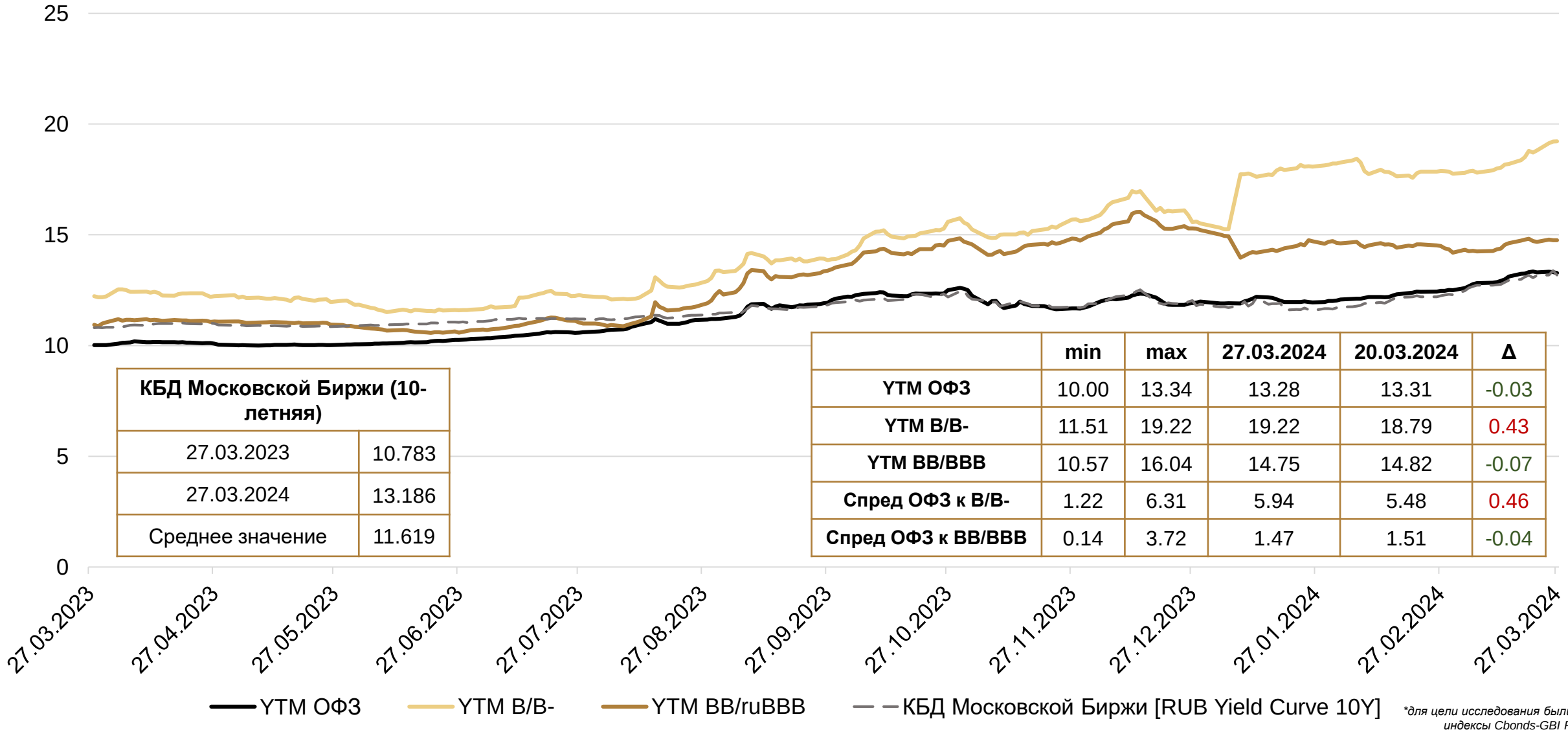
IVA PARTNERS

ОФЗ И ОБЛИГАЦИИ МСП*

ДИНАМИКА СПРЕДА В ГОДОВОМ РАЗРЕЗЕ



КБД Московской Биржи (10-летняя)	
27.03.2023	10.783
27.03.2024	13.186
Среднее значение	11.619

	min	max	27.03.2024	20.03.2024	Δ
YTM ОФЗ	10.00	13.34	13.28	13.31	-0.03
YTM B/B-	11.51	19.22	19.22	18.79	0.43
YTM BB/BBB	10.57	16.04	14.75	14.82	-0.07
Спред ОФЗ к B/B-	1.22	6.31	5.94	5.48	0.46
Спред ОФЗ к BB/BBB	0.14	3.72	1.47	1.51	-0.04

**для цели исследования были взяты индексы Cbonds-GBI RU YTM, Cbonds-CBI RU B/ruB- adj YTM, Cbonds-CBI RU BB/ruBBB YTM, RUB Yield Curve 10Y*