

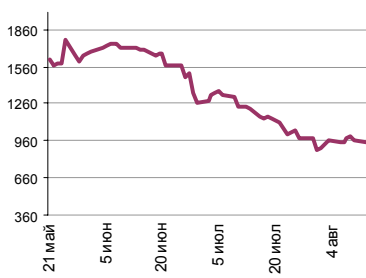
Еженедельный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

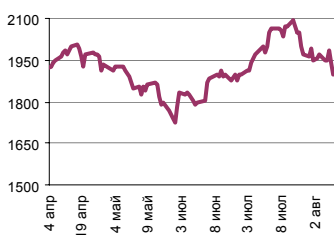
<p>КОРОТКО О ГЛАВНОМ 1</p> <p>ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ 2</p> <p style="padding-left: 20px;">ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК</p> <p style="padding-left: 20px;">ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК</p> <p>РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ 3</p> <p style="padding-left: 20px;">КАЗНАЧЕЙСКИЕ ОБЛИГАЦИИ</p> <p style="padding-left: 20px;">РОССИЙСКИЕ</p> <p style="padding-left: 20px;">ЕВРООБЛИГАЦИИ</p> <p>РУБЛЕВЫЕ ОБЛИГАЦИИ 4</p> <p>АКЦИИ 5</p> <p>НЕФТЬ 6</p> <p>НОВОСТИ 7</p> <p>ИТОГИ ТОРГОВ ЗА ДЕНЬ 8</p>	<p>Денежный и валютный рынок Номинальный курс доллара по итогам недели составил 25,4755 рублей (-10 копеек). Мы полагаем, что на предстоящей неделе внутренний валютный рынок стабилизируется, существенных изменений не ждем. Мы считаем, что на предстоящей неделе ставки на денежном рынке снизятся, поскольку до начала уплаты крупных налогов еще есть время, при этом сумма остатков средств на корсчетах и депозитах все еще находится на очень высоком уровне.</p> <p>Еврооблигации Russia30 за неделю, несмотря на драматизм происходящих на мировых рынках событий, потеряла в цене всего 6 б.п., достигнув 109,94% от номинала. Инвесторы предпочитают не предпринимать каких-либо действий пока не увидят стабилизации на рынке.</p> <p>Рублевые облигации Мы полагаем, что на предстоящей неделе ситуация на рынке рублевых долгов стабилизируется. Рынок корпоративных облигаций и ОФЗ уже достаточно перепродан в длинном сегменте, учитывая фоновое укрепление рубля и ожидаемые низкие ставки МБК.</p> <p>Акции Рынок акций упал на прошлой неделе, вместе с остальными Emerging Markets, реагируя на ухудшение инвестиционной конъюнктуры. Мы надеемся, что период «risk aversion» не продлится долго и ждем восстановления российского рынка акций в среднесрочной перспективе.</p> <p>Нефть За прошедшую неделю котировки нефтяных фьючерсов упали более чем на 5%, следуя динамике фондовых и товарных рынков. Индикативные контракты ICE Brent снизились до \$70,39/b (-5,8%), NYMEX WTI - до \$71,47/b (-5,3%). Мы полагаем, что цены достигли локального «дна» и должны скорректироваться уже на этой неделе.</p>
---	--

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.



Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индекс РТС



Источник: ФБ РТС, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.3692	0.0021	-0.0081
Нефть Brent, IPE	70.39	0.26%	-5.83%
S&P 500	1 453.64	0.04%	1.44%
Libor (6M) (%)	5.4013	0.0125	0.0869
MOSPRIME(3M) (%)	4.7500	0.0100	-0.0700
UST10 (%)	4.7900	-0.0216	0.0729
RusGLB30	109.94	-0.50	-0.06
Доллар (ММВБ USD/RUB_UTS_TOM),Bid	25.5115	0.0581	-0.0945
Евро (ММВБ EUR/RUB_UTS_TOD)	34.8850	-0.2825	-0.1125
Остатки на корсчетах в ЦБ (млрд. руб.)	438.3	-0.3	-43.6
Депозиты банков в ЦБ (млрд. руб.)	514.8	-18.4	33.8
Индекс РТС	1 897.2	-2.2%	-3.7%
Индекс ММВБ	1 644.13	-1.9%	-4.2%
ЗВР (млрд. долл.)	416.8	0.0	-0.5
Денежная база узкое опр. (млрд. руб.)	3 577.6	0.0	1.7

Главные события и факты прошедшей недели

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что на Московской межбанковской валютной бирже 15 августа 2007 года состоится аукцион по размещению облигаций федерального займа с амортизацией долга дополнительного выпуска № **46021RMFS**.

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что объем золотовалютных резервов Российской Федерации по состоянию на 3 августа 2007 года составлял **\$416,8** млрд., против **\$417,3** млрд. на 27 июля 2007 года.

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что объем денежной базы в узком определении на 6 августа 2007 года составил **3 577,6** млрд. рублей против **3 575,9** млрд. рублей на 30 июля 2007 года.

Банк России 9 августа, разместил бескупонные краткосрочные облигации второго выпуска с погашением 15 января 2008 года и встроенным опционом "пут" со средневзвешенной доходностью в **4,22%** годовых. Об этом говорится в сообщении ЦБ. Объем привлеченных средств – **1,36** млрд. руб., цена отсечения - **98,564%** к номиналу, ставка отсечения – **4,25%**, средневзвешенная цена выпуска – **98,574%** к номиналу. Объем спроса по рыночной стоимости составил **1,550** млрд. руб.

Кассовый профицит федерального бюджета в январе-июле 2007 года составил **1,233** трлн. руб. Такая предварительная оценка исполнения федерального бюджета дается в сообщении пресс-службы Министерства финансов. Доходы федерального бюджета составили **3,873** трлн. руб., или **76,3%** к утвержденной росписи поступлений доходов на 9 месяцев 2007 года. Расходы по финансированию равнялись почти **3,553** трлн. руб., или **85,4%** к бюджетной росписи расходов на 9 месяцев 2007 года с изменениями.

По материалам ИА АКМ, Банка России, РБК, ФСГС, Ведомости, МЭРит, ММВБ, Прайм-ТАСС

[Вернуться к оглавлению](#)

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

Курс рубль-доллар



Источник: ММВБ, Банк Спурт

Индекс рубля к корзине валют (50% \$, 50% €)



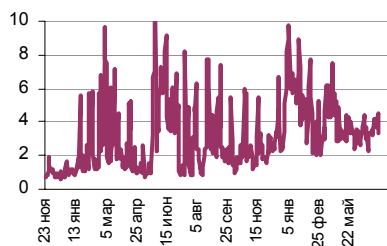
Источник: Банк Спурт

Индекс рубля к корзине валют (0,6 \$, 0,4 €)



Источник: Банк Спурт

MIACR, overnight



Источник: Банк России, Банк Спурт

Валютный рынок

На FOREX по итогам недели евро упал по отношению к доллару почти на цент, составив 1,3692. Рост американской валюты произошел из-за проблем в финансовой системе Еврозоны, вызванных замораживанием французским банком BNP Paribas выплат по некоторым своим фондам, инвестировавшим в американский фондовый рынок. Впрочем, ЕЦБ достаточно быстро накачал банковскую систему ликвидностью, предотвратив возникновение «кризиса доверия».

Мы полагаем, что на предстоящей неделе опасения, изначально спровоцированные проблемами на американском рынке низкокачественной ипотеки, и перенесшиеся в Европу, сохранятся. Пара евро-доллар может колебаться в достаточно узком ценовом диапазоне – 1,3650-1,3750. В долгосрочной перспективе у нас позитивный взгляд по паре евро-доллар.

На внутреннем валютном рынке рубль рос в первой половине недели по отношению к корзине валют 50/50, а во второй – снижался, наполовину нивелировав предыдущее достижение. Номинальный курс доллара по итогам недели составил 25,4755 рублей (-10 копеек).

Снижение индекса рубля во второй половине недели, на наш взгляд, стало свидетельством оттока капитала. Мы полагаем, что на предстоящей неделе внутренний валютный рынок стабилизируется, существенных изменений не ждем.

Денежный рынок

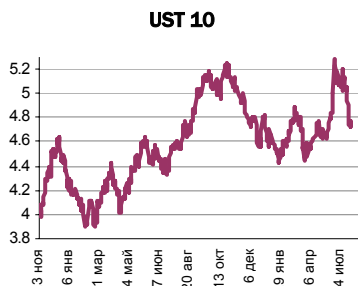
На денежном рынке на прошлой неделе стоимость коротких денег колебалась в диапазоне 2,93-3,41% (MIACR, overnight). Уровень банковской ликвидности за неделю снизился до 953,1 (-9,8 млрд. рублей) что, как мы полагаем, является следствием оттока капитала с российского фондового рынка.

Мы полагаем, что на предстоящей неделе ставки на денежном рынке снизятся, поскольку до начала уплаты крупных налогов еще есть время, при этом сумма остатков средств на корсчетах и депозитах все еще находится на очень высоком уровне.

[Вернуться к оглавлению](#)

РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Казначейские облигации

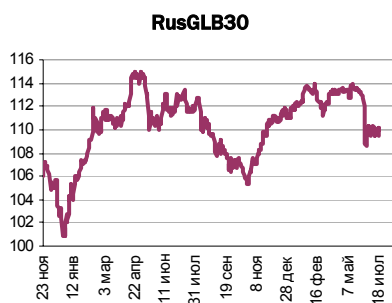


Источник: Reuter, Банк Спурт

За минувшую нелегкую для мировых финансовых рынков неделю доходность UST10 выросла на 13 б.п. – до 4,81%. Уверенное снижение доходностей казначейских облигаций всю позапрошлую неделю на волне flight to quality сменилось во вторник 7 августа резкой коррекцией (с отметки 4,74% накануне до максимума недели 4,86%, достигнутого в среду), спровоцированной итогами заседания FOMC. Напомним, что денежные власти США, оставив без изменения базовую ставку – 5,25%, в своем комментарии назвали инфляционные риски единственной потенциальной угрозой для экономики США, не выразив ни малейшего беспокойства по поводу сложившегося в стране кризиса subprime ипотеки. Инвесторы, успокоенные мнением ФРС, мгновенно обратили свой взор на рынки акций и Emerging Markets, в свою очередь, рынок US Treasuries, капитал с которого уходил в высокорисковые активы, стал падать. Оптимизм игроков, однако, уже в четверг омрачило напоминание о не пережитом еще кредитном кризисе: очередной инвестор в subprime mortgage – на этот раз французский банк BNP Paribas – сообщил о проблемах в нескольких фондах. Новость вызвала паническое бегство капиталов с развивающихся и фондовых рынков всего мира обратно в Treasuries. Доходность последних стала снижаться. На этот раз инвесторов стали тревожить опасения того, что ипотечный кризис в Штатах перекинется на весь мир – ведь в американские долговые бумаги, обеспеченные ипотекой, в том числе, низкого качества, инвестируют крупные европейские и азиатские игроки – фонды, банки и проч., а значит, проблемы в этом секторе с большой вероятностью могут стать «достоянием» всей мировой экономики.

Ко всему прочему, в СМИ появились обвинения в адрес ФРС США – в том, что власти недооценили глубину ипотечного кризиса и ошиблись в выборе тона и риторики FOMC Statement. Тем не менее, Федрезерв с целью предотвращения кризиса ликвидности в стране, вызванного банкротствами ряда игроков рынка subprime, увеличил резервы банковской системы посредством сделок репо на \$68,5млрд. за неделю (максимум вливаний после 19 сентября 2001). Аналогичные действия по поддержанию ликвидности банковской системы были приняты ЕЦБ и Банком Японии.

Мы полагаем, что кризис не вечен, и надеемся скоро увидеть признаки выздоровления. Очевидно, что центральным банкам удастся держать под контролем ликвидность системы – пока. С настроениями участников – сложнее, они еще слишком чувствительны к новостям с ипотечного рынка, а таковые, вероятно, еще будут поступать. Эта неделя богата публикациями макроэкономических индикаторов, начиная с понедельника, самые важные из них: розничные продажи (сегодня), PPI (вторник), CPI (среда), первичный рынок недвижимости (четверг). Вполне возможно, сильные данные по американской экономике окажут благотворное влияние на мировые рынки, хотя вряд ли денежные власти США, Европы и Азии пустят на самотек развитие ситуации. На этой неделе уверенной стабилизации мы не ожидаем, прогнозировать поведение UST в текущих условиях затруднительно.



Источник: Reuter, Банк Спурт

Российские еврооблигации

Russia30 за неделю, несмотря на драматизм происходящих на мировых рынках событий, потеряла в цене всего 6 б.п., достигнув 109,94% от номинала. Внутри недельного отрезка волатильность была невысока, да и активность тоже. На все движения базового актива наша «тридцатка» реагировала корректировкой спреда, весьма несущественно меняясь в цене.

Суверенный спред сократился на 13п. до 126п. Спред EMBI+ в свою очередь сузился на 12п. – до 207п. Сейчас развивающиеся рынки смотрят только на Штаты – развитие ипотечного кризиса и действия властей по сдерживанию панических настроений. Инвесторы предпочитают не предпринимать каких-либо действий пока не увидят стабилизации на рынке.

[Вернуться к оглавлению](#)

РУБЛЕВЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Не успел рынок рублевых долгов оправиться после распродаж в конце июля, как его постигла новая напасть. В результате осторожного отношения инвесторов к риску, возникшего после повсеместного роста ставок на денежных рынках Америки, Европы и Азии, под прессом вновь оказались активы Emerging Markets.

Под горячую руку попали, в основном, длинные облигации – ОФЗ 46017, 46021, 46018 и 46020 – в государственном секторе и выпуски первого эшелона – ГАЗПРОМ-8,9, ЛУКОЙЛ-3,4, АИЖК-7,8,9 – в корпоративном.

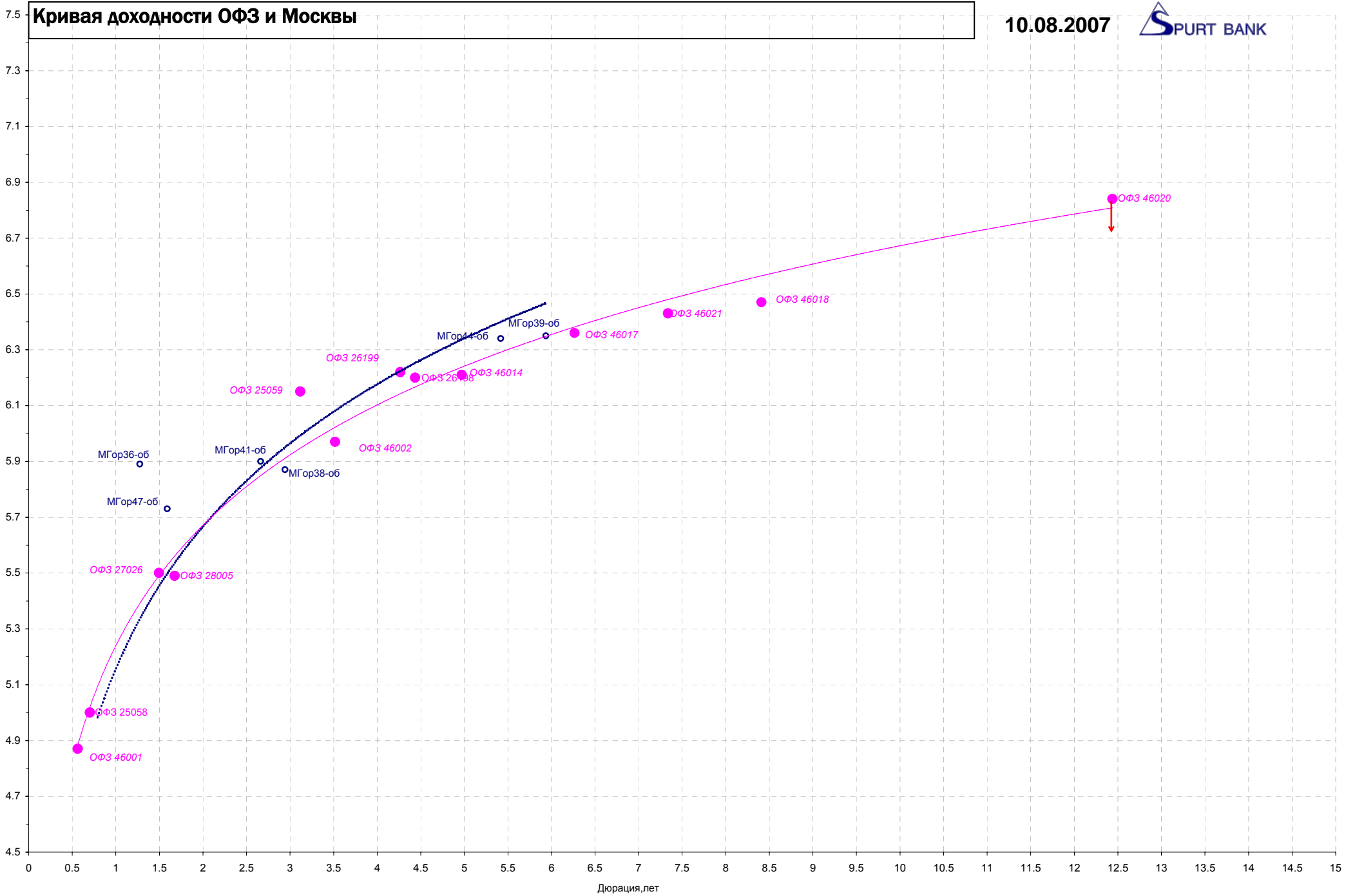
Активность инвесторов на первичном рынке была минимальной, что неудивительно – никому не хочется размещаться в период «risk aversion».

Мы полагаем, что на предстоящей неделе ситуация на рынке рублевых долгов стабилизируется. Рынок корпоративных облигаций и ОФЗ уже достаточно перепродан в длинном сегменте, учитывая фоновое укрепление рубля и ожидаемые низкие ставки МБК.

[Вернуться к оглавлению](#)

Кривая доходности ОФЗ и Москвы

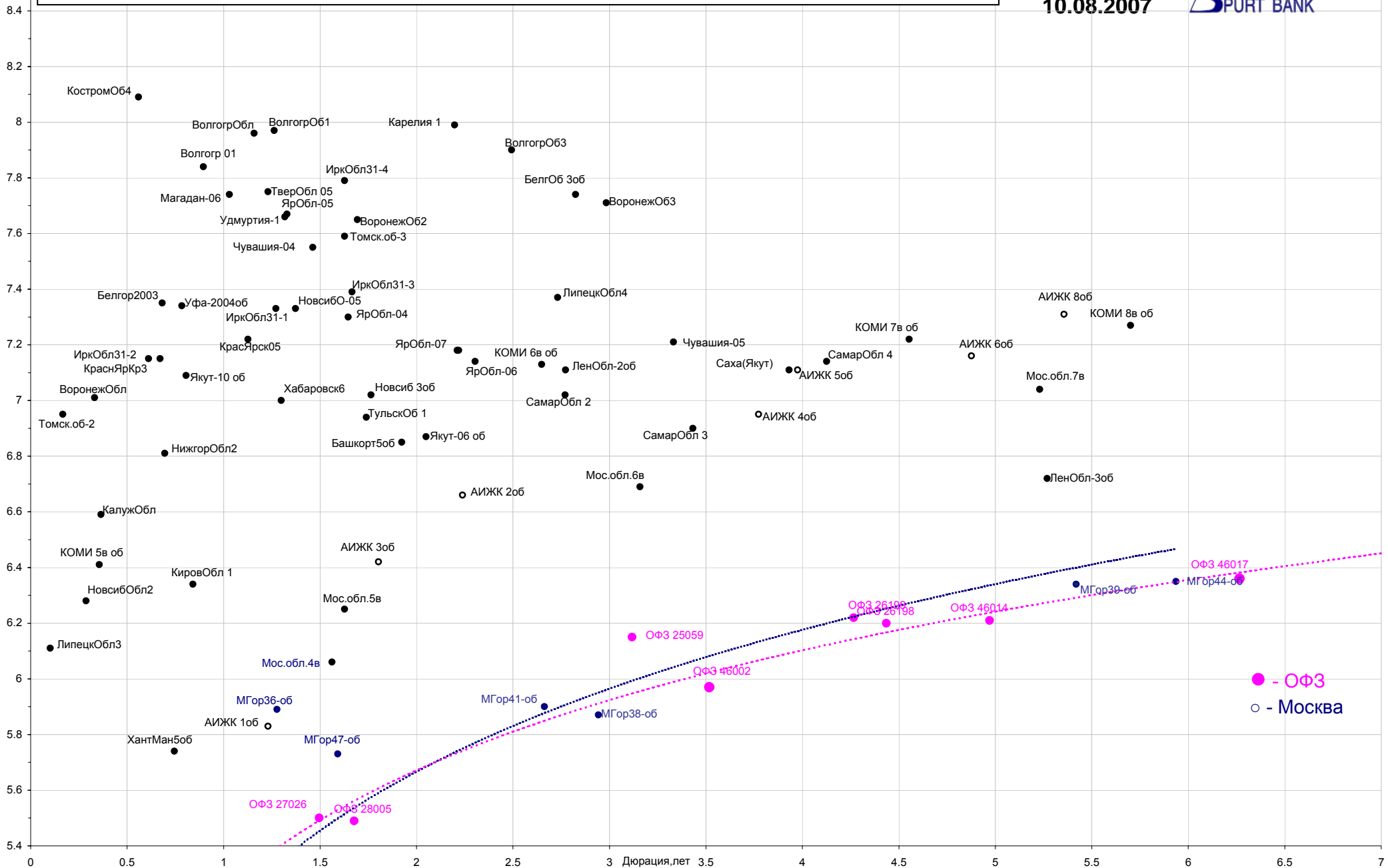
10.08.2007



Дюрация, лет

Кривая доходности региональных долгов

10.08.2007



АКЦИИ

Рынок акций упал на прошлой неделе, вместе с остальными Emerging Markets, реагируя на ухудшение инвестиционной конъюнктуры. Индекс РТС снизился на 3,73% до 1 897,2 п., индекс ММВБ потерял 4,16%, составив 1 644,13 п. Российские голубые фишки потеряли от 2 до 4%.

Мы надеемся, что период «risk aversion» не продлится долго и ждем восстановления российского рынка акций в среднесрочной перспективе.

[Вернуться к оглавлению](#)

НЕФТЬ

За прошедшую неделю котировки нефтяных фьючерсов упали более чем на 5%, следуя динамике фондовых и товарных рынков. Индикативные контракты ICE Brent снизились до \$70,39/b (-5,8%), NYMEX WTI - до \$71,47/b (-5,3%).

Увы, факторы сугубо нефтяного рынка перестали оказывать привычное влияние на движение цен нефтяных фьючерсов. Нефть теперь, как и прочие commodities, стала заложником ситуации на мировых фондовых и долговых рынках: credit crunch fears, risk aversion и иже с ними. И, следовательно, ведет себя аналогичным образом – как любой другой высокорисковый актив, из которого выходят крупные хедж-фонды чтобы переждать ненастье в «тихой гавани» US Treasuries. Падение нефтяных бумаг продолжается с позапрошлой недели, когда и разразился кредитный кризис в США, единственным днем роста на этом рынке стал вторник – день заседания ФРС. Основным фактором падения, похоже, являются опасения игроков, что намечающееся замедление роста в США станет причиной снижения спроса на сырье в будущем. Позитива рынку не добавила даже публикация слабых данных по запасам нефти в США.

Итак, в результате внушительного падения на минувшей неделе, фьючерсы потеряли всю спекулятивную составляющую в своих ценах, сложившуюся в результате повышенной активности фондов на этом рынке. Цены достигли локального «дна» и должны скорректироваться уже на этой неделе.

[Вернуться к оглавлению](#)

НОВОСТИ

Акционеры банка «Зенит» на внеочередном собрании акционеров приняли решение увеличить уставный капитал на 1,65 млрд руб, передает «Прайм-ТАСС». Это 12,5% капитала. Акции будут размещены по открытой подписке. В «Зените» получить комментарии пока не удалось. Это не первая продажа акций «Зенита» сторонним инвесторам. А несколько инвестбанкиров считают, что осенью он первым из частных банков проведет IPO. Один из них говорил, что мандат может достаться UBS, а сроки размещения — октябрь-ноябрь. А другой называл вторым организатором размещения J. P. Morgan. В конце марта «Зенит» сообщил, что владельцем 11,4% его акций стала Gatehill Ltd. «Татнефть» снизила долю с 33,2% до 28,4%, а ее швейцарская «дочка» и рассталась с пакетом в 6,5%. Это преобразование в банке не комментировали, отмечая лишь, что реальная структура собственности осталась неизменной. В конце июня «Зенит» продал 15% уставного капитала. Практически весь выпуск достался компании Mardea Holding Ltd. А банк получил 3,1 млрд руб. (2 руб. за каждую акцию).

Наперекор остальным «голубым фишкам» вели себя в пятницу акции «Сургутнефтегаза». На высоких оборотах они подорожали почти на 2% — при том что фондовые индексы упали на 2%. Эксперты теряются в догадках, кто скупает бумаги «Сургута». В пятницу российский фондовый рынок потерял еще 2% своей капитализации, а основные «голубые фишки» подешевели на 2-4% (см. статью на стр. БЗ). Исключением стал «Сургутнефтегаз». На ММВБ его обыкновенные акции подорожали на 1,9%, в РТС — на 1,15%. Привилегированные акции прибавили 0,3% на ММВБ, а в РТС потеряли 1,85%. ADR на обыкновенные акции «Сургута» на Лондонской фондовой бирже подешевели на 0,4%. Велик был и объем торгов бумагами «Сургутнефтегаза». На ММВБ оборот — 4,3 млрд руб. (0,36% акций) — не был рекордным, зато число сделок с акциями «Сургута» было самым высоким с середины марта — 17 700, примерно вдвое больше обычного, оценивает главный трейдер «Тройки Диалог» Тимур Насардинов. На классическом рынке РТС объем торгов был самым высоким с начала лета — \$4,7 млн.

Рост цен на нефть позволит «Газпрому» заработать в 2007 г. больше, чем он рассчитывал еще несколько месяцев назад. Монополия в третий раз переписала бюджет на этот год и сейчас ждет, что выручит от продаж в Европе 970 млрд руб. — меньше, чем в 2006 г. Совет директоров «Газпрома» утвердил в новой редакции бюджет монополии на 2007 г., сообщила пресс-служба концерна. Прогноз по доходам вырос почти на \$1,3 млрд (подробнее см. таблицу). План по займам, большую часть которых «Газпром» потратил на покупку доли в проекте «Сахалин-2», акций «Мосэнерго» и «Белтрансгаза», почти не изменился (более 370 млрд руб.). Капвложения выросли, в результате инвестпрограмма достигла \$30 млрд. Монополия переписывает бюджет-2007 третий раз. Самым пессимистичным был проект, который правление утвердило в мае. Из-за аномально теплой зимы и рекордно низких продаж в I квартале концерн прогнозировал, что головная компания в 2007 г. поставит в Европу 147 млрд куб. м газа (в декабре 2006 г. предполагалось поставить 157,8 млрд куб. м). Цена ожидалась на 8% ниже прошлогодней и на 18% меньше, чем в декабрьском прогнозе — \$241,5 за 1000 куб. м, — из-за подешевевших за полгода до этого мазута и дизтоплива: цена европейских контрактов повторяет динамику цен на нефтепродукты с отсрочкой в 6-9 месяцев.

По материалам Рейтер, ИА АКМ, Банка России, РБК, ФСГС, Ведомости, МЭРиТ, РИА Новости, Время Новостей, ПРАЙМ-ТАСС, Популярная механика

[Вернуться к оглавлению](#)

Итоги торгов за неделю

ETC

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Опен	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	-0.0027	-0.00220	-0.002	-0.0025	325 100 000
EURTOTD_UTS	34.8924	-0.30020	35	34.895	148 724 000
EURTOM_UTS	34.8727	-0.31130	34.845	34.8475	108 655 000
USD_TODTOM	-0.0068	-0.00510	-0.0064	-0.007	11 760 900 096
USDOTD_UTS	25.5051	0.04920	25.4	25.4825	5 560 894 016
USDOTM_UTS	25.4941	0.03400	25.4885	25.4755	14 469 708 160

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU25061RMFS1	3 701 773 072	100.00	-0.10	5.93	78	0
SU46018RMFS6	3 308 099 647	111.15	-0.48	6.47	176	0
SU46021RMFS0	2 593 052 627	99.91	-0.44	6.43	38	0
RU000A0JPAD7	1 360 488 832	98.57	0.08	4.22	22	0
SU46020RMFS2	1 163 154 512	102.22	-0.67	6.84	134	0
SU46014RMFS5	381 069 940	109.18	0.08	6.21	28	0
SU26199RMFS8	318 543 201	100.10	-0.16	6.22	27	0
SU46001RMFS2	310 155 641	102.97	-0.03	4.90	10	0
SU46017RMFS8	284 565 746	106.25	-0.45	6.36	30	0
SU46002RMFS0	252 353 647	109.70	0.00	5.97	7	0
SU46003RMFS8	234 270 937	109.80	0.00	5.70	9	0
Итого	14 308 112 690				638	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
Мос.обл.6в	505 988 828	107.80	-0.04	23	756 458 008	7 846 900 736
Мос.обл.7в	330 109 195	105.68	-0.35	50	1 970 437 344	8 864 006 144
МГор29-об	160 404 480	104.43	-0.67	1	159 728 640	315 607 920
Мос.обл.5в	148 819 789	106.28	-0.06	55	149 816 448	2 792 914 368
ЯрОбл-07	109 436 910	101.52	0.06	46	365 567 128	1 129 317 232
ЯНАО-1 об	80 129 345	100.91	-1.13	9	18 986 250	319 657 464
КОМИ 8в об	76 041 162	100.44	-0.36	7	24 668 950	0
КОМИ 5в об	73 837 716	102.40	0.02	9	0	419 844 792
СамарОбл 4	70 951 782	100.09	0.04	21	295 342 496	1 520 531 552
НовсибОбл2	66 088 372	102.08	-0.08	15	162 287 504	148 424 718
МГор44-об	65 851 482	110.31	-0.25	28	332 168 192	6 215 433 728
КалужОбл-2	52 716 921	102.48	-0.41	14	30 780 000	322 462 320
ХантМан5об	52 360 004	104.72	-0.38	2	81 666 000	0
Новсиб0-05	51 612 000	101.20	-0.60	2	0	234 286 201
Итого	2 493 220 891			668	6 668 899 058	52 833 096 463

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МОЭСК-01	385 630 237	101.40	0.01	353	1 064 137 102	1 803 245 176
ФСК ЕЭС-05	368 509 070	101.16	-0.08	274	289 905 023	4 579 576 960
РЖД-05обл	306 168 710	100.70	-0.35	76	1 197 574 432	2 787 199 288
УРСАБанк 5	292 937 208	106.07	-0.21	71	506 016 496	617 032 048
ТГК-8 01	284 578 103	100.56	0.03	19	380 021 508	407 090 687
7Контин-02	258 457 866	99.90	-0.01	18	355 172 600	1 169 710 976
Мосэнерго1	256 077 060	101.34	-0.06	112	385 222 000	1 334 127 392
ПромТр02об	241 837 400	102.99	-0.01	43	378 666 912	406 758 848
ГидроОГК-1	232 836 404	103.86	-0.29	54	510 275 992	2 314 012 736
Евросеть-2	217 517 234	98.19	-2.02	110	578 540 784	667 695 584
Черкизово1	213 038 573	100.10	-0.01	11	230 680 004	151 667 832
РЖД-06обл	207 836 700	102.40	-0.09	172	1 626 407 552	5 066 679 552
ФСК ЕЭС-02	193 470 312	103.20	-1.12	78	245 004 508	4 770 973 376
КОПЕЙКА 02	167 906 625	99.96	0.50	22	128 629 000	468 819 076
СатурнНПОЗ	165 259 186	100.02	0.02	23	265 961 800	481 498 264
ОГК-6 01об	163 652 563	100.10	0.00	13	726 147 000	3 788 648 384
Ленэнерго3	155 110 153	100.00	-0.40	55	190 530 000	472 544 648
ИнкомЛада3	140 809 641	100.24	0.09	20	306 161 284	285 091 880
КИТФинБ-02	140 426 332	102.39	-0.08	28	447 311 500	525 146 172
АИЖК 7об	137 953 777	102.85	-1.03	38	347 574 575	2 572 475 680
СанИнтБрю2	132 478 000	101.13	0.13	13	303 150 000	875 802 512
ГАЗПРОМ А9	130 755 326	102.60	-0.43	140	4 226 344 928	6 298 764 160
Русфинанс4	130 139 664	99.80	0.10	21	449 220 000	998 014 528
ПромТр01об	122 069 242	100.21	-0.06	30	80 132 000	228 807 194
ТМК-02 обл	121 823 803	100.98	0.00	123	61 131 600	800 257 472
Итого	13 101 135 364			6 318	42 486 315 868	121 942 186 324

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	71 270 938 624	265.99	-3.80%	140 612	4 478 045 248	123 572 487 120
РАО ЕЭС	59 335 491 584	33.95	-2.99%	124 049	2 334 914 816	64 971 040 550
ГМКНорник	30 680 337 408	5186.09	-6.70%	78 856	1 544 502 040	19 961 402 753
ЛУКОЙЛ	26 567 484 672	1918.90	-5.48%	85 126	2 188 956 208	26 770 062 351
Сбербанк	21 107 474 432	96.23	-6.71%	61 603	785 591 776	35 153 144 653
Сургнфгз	14 251 482 112	28.71	0.00%	54 575	389 963 488	11 150 661 076
Роснефть	5 551 755 520	206.01	-2.20%	22 148	553 011 344	10 190 724 401
ПолусЗолот	5 460 816 128	1024.85	-7.49%	32 031	328 466 100	1 485 854 396
ВТБ-001Дао	4 266 350 976	0.13	-6.23%	24 145	64 552 264	3 674 700 547
Итого	260 162 097 644			838 642	15 394 998 750	346 408 171 492

Источник: ММВБ, Банк Спурт
[Вернуться к оглавлению](#)

Управление Казначейства АКБ «Спурт»

Директор Казначейства
+7 843 291 50 02

Шайхутдинов Кирилл Владимирович
kirill@spurtbank.ru

Отдел торговых операций на финансовых рынках

Долговые инструменты, МБК, валюта
+7 843 291 51 41

Шамарданов Адель Ильич
ashamardanov@spurtbank.ru

Отдел доверительного управления

Начальник отдела
+7 843 291 50 29

Хайруллин Айбулат Рашитович
aybulat@spurtbank.ru

Отдел анализа финансовых рынков

Аналитик
+7 843 291 50 27

Родченко Марина Викторовна
mrodchenko@spurtbank.ru

Аналитик
+7 843 291 51 27

Галеев Тимур Равилевич
tgaleev@spurtbank.ru

Отдел расчетов и корреспондентских отношений

Зам. Директора Казначейства. Начальник отдела
+7 843 291 50 60

Угарова Татьяна Алексеевна
tugarova@spurtbank.ru

Валютные корр. счета
+7 843 291 50 61

Журавлев Сергей Александрович
sjouravlev@spurtbank.ru

Рублевые корр. счета
+7 843 291 50 62

Лаврова Жанна Юрьевна
jlavrona@spurtbank.ru

Бэк-офис МБК
+7 843 291 50 64

Сафина Гузелия Зиннуровна
gsafina@spurtbank.ru

SWIFT
+7 843 291 50 66

Анцис Рузалия Рашитовна
rancis@spurtbank.ru

Расчеты РКЦ
+7 843 291 50 65

Каштанова Валентина Ефимовна
vkashtanova@spurtbank.ru

Настоящий информационный обзор рынка ценных бумаг содержит оценки и прогнозы Управления Казначейства Акционерного коммерческого Банка «Спурт» (открытое акционерное общество) (далее – «Банк») касательно будущих событий и/или действий, перспектив развития ситуации на рынке ценных бумаг, вероятности наступления определенных событий и совершения определенных действий на рынке ценных бумаг. Инвесторы не должны полностью полагаться на оценки и прогнозы, содержащиеся в настоящем обзоре, так как фактическое положение дел на рынке ценных бумаг в будущем может отличаться от прогнозируемых результатов по многим причинам.

Настоящий информационный обзор не является офертой - предложением купить или продать какие-либо ценные бумаги или связанные с ними финансовые инструменты либо принять участие в какой-либо стратегии торговли. Описание любой компании или компаний, или их ценных бумаг, или рынков, или направлений развития, упомянутых в данном обзоре, не предполагают полноты их описания. Представленная информация и мнения не были специально подготовлены для конкретной операции любых третьих лиц и не представляют детальный анализ конкретной ситуации, сложившейся у третьих лиц.

Информация и заключения, изложенные в настоящем обзоре, не заменяют независимую оценку инвестиционных потребностей и целей какого-либо лица.

Данный обзор может использоваться только для информационных целей. Цитирование или использование всей или части информации, содержащейся в настоящем отчете, допускается только с прямо оговоренного разрешения Банка.