

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ	1	
ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК	2	Денежный рынок: Где деньги?
АКЦИИ, US TREASURIES	3	Акции, Казначейские облигации (UST): Дальновидные Treasuries.
Новости	4	
ИТОГИ ТОРГОВ ЗА ДЕНЬ	5	

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.

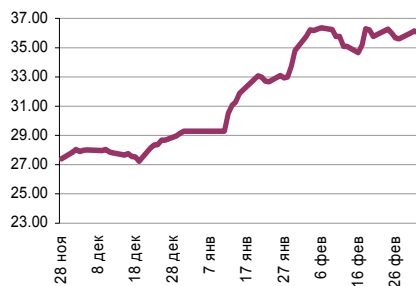


Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

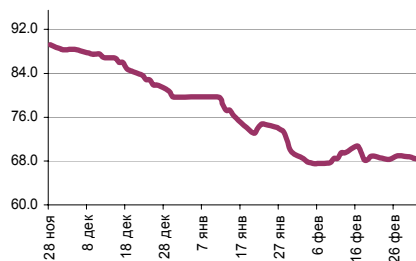
Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.2493	-0.0131	-0.02
Нефть Brent, IPE	43.70	3.53%	6.61%
S&P 500	696.33	-0.64%	-6.32%
Libor(6M) (%)	1.81	0.01	0.06
MOSPRIME(3M) (%)	22.62	-0.13	-1.55
UST10 (%)	2.88	0.02	0.13
RusGLB30	86.38	-0.88	-2.50
Доллар (ТОМ)	36.09	-0.05	-0.17
Евро (ТОМ)	45.70	0.11	0.02
Индекс РТС	540.74	0.25%	4.55%
Индекс ММВБ	654.14	1.14%	3.56%
ЗВР (млрд. долл)	381.90		-4.70
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	3781.80		40.60

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

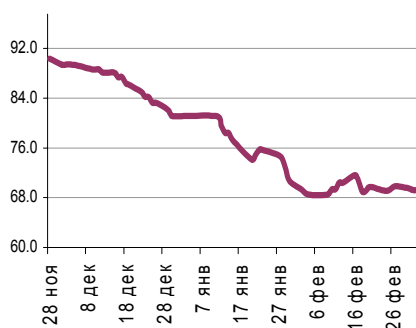
Курс рубль-доллар



Источник: ММВБ, Банк Спурт

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

Источник: Банк Спурт

Индекс рубля к корзине валют
(0,55 \$, 0,45 €)

Источник: Банк Спурт

Денежный рынок:

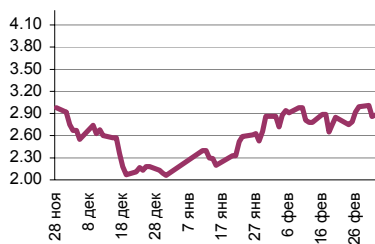
Вчера банки увеличили задолженность по операциям прямого РЕПО с ЦБ на 79 млрд. рублей. Банковская ликвидность должна была бы вырасти на эти 79 млрд. рублей, однако этого не произошло. Сумма остатков средств на корсчетах и депозитах за увеличилась только на 10 млрд. рублей до 556,2 млрд. рублей.

Возможно, что здесь имели место расчеты с бюджетом, хотя обычно подобные события проходят в конце месяца. Не исключено, что деньги были выведены для платежей по внешнему долгу, но большинство компаний сделало это уже в прошлом году.

Сегодняшний день обещает быть спокойным. Несмотря на то, что банки возвращают ЦБ 77,4 млрд. рублей; поступления по беззалоговым аукционам, пошедшим в понедельник и вторник на общую сумму 89,3 млрд. рублей, перекроют этот отток.

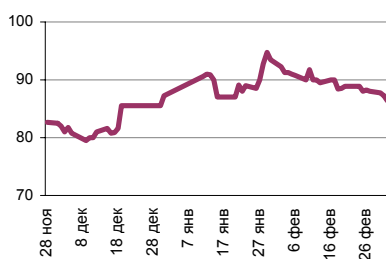
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

Новостей макростатистики вчера публиковалось немного. Внимание инвесторов было обращено на выступление главы ФРС Б. Бернанке. Он в открытую заявил о том, что придется увеличивать уровень государственного долга. Treasuries на эту новость не отреагировали. Спрос на защитные активы все еще велик, да и иное развитие событий было маловероятно. Ставка десятилетней ноты составила 2,88%.

Сегодня будут опубликованы данные по безработице от ADP (прогноз: минус 610 тыс. рабочих мест). Финальный же аккорд недели ждем от Nonfarm Payrolls.

НОВОСТИ

Спад деловой активности в российском секторе услуг в феврале 2009 года замедлился по сравнению с предыдущими месяцами, свидетельствуют данные VTB Capital. Индекс PMI для сектора услуг (ИМС-Сервис) вырос в феврале до 40,0 пункта с 36,8 в январе и рекордно низкого значения декабря на уровне 36,4 пункта. Значение индекса выше 50 пунктов указывает на рост активности, ниже - на спад.

Федеральная служба по финансовым рынкам (ФСФР) России обвинила инвесткомпанию Финам, одного из лидеров по объему торгов акциями на фондовой бирже ММВБ, в совершении запрещенных коротких продаж и может предъявить аналогичные претензии другим брокерам по результатам проверок. Финам, между тем, считает обвинения регулятора "досадным недоразумением". Запрет на "короткие" продажи, под которыми подразумевается совершение необеспеченных сделок, был введен в РФ осенью прошлого года для защиты фондового рынка от резких колебаний в условиях финансового кризиса. "ФСФР России была проведена камеральная проверка по факту возможного нарушения со стороны ЗАО Финам предписания службы о запрете совершения "коротких" продаж. В ходе проверки было установлено, что Финам не соблюдался указанный запрет: в интересах некоторых клиентов обществом, в том числе Finam Limited и Parlock Investments Limited, были совершены многочисленные "короткие" продажи", - говорится в пресс-релизе ФСФР.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0145	0.01400	0.0135	0.016	4 612 199 936
EURRUB_TOD	45.807	45.76000	45.7375	45.84	121 203 000
EURRUB_TOM	45.7898	45.79000	45.64	45.7	185 308 992
USD_TODTOM	0.0102	0.01000	0.0075	0.0078	4 763 400 192
USDRUB_TOD	36.2133	36.14750	36.1225	36.29	868 476 992
USDRUB_TOM	36.2287	36.16000	36.0888	36.0888	2 429 922 048

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU25060RMFS3	72 780 557	99.64	0.02	8.35	7	0
SU25057RMFS9	10 397 846	97.36	-1.54	10.99	9	0
SU25059RMFS5	1 810 000	90.50	0.17	12.33	1	0
SU46003RMFS8	1 961	98.04	-0.71	12.86	2	0
SU27026RMFS2	999	99.93	0.03	9.52	1	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
Итого	84 991 363				20	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор45-об	82 792 390	79.19	0.95	7	0	707 327 200
МГор41-об	34 962 840	92.00	-8.00	2	0	0
Мос.обл.7в	4 040 000	50.50	-1.32	2	0	93 868 690
Мос.обл.6в	1 815 890	67.23	-0.42	6	30 792 170	176 838 600
Мос.обл.8в	1 276 217	59.72	1.29	18	0	366 655 000
ВолгогрОБЗ	1 000	100.00	15.52	1	0	119 295 200
ВоронежОБ4	0	0.00	0.00	0	0	140 237 800
МГор44-об	0	0.00	0.00	0	0	114 979 500
СамарОБл 5	0	0.00	0.00	0	0	152 643 300
Томск.об-4	0	0.00	0.00	0	0	149 923 700
0	0	0.00	0.00	0	0	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
Итого	139 107 000			98	70 440 410	2 628 993 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ДГК-01	170 829 400	94.97	18.43	118	115 138 100	0
ОГК-6 01о6	90 345 000	89.85	0.94	6	0	56 328 000
Система-01	66 863 260	99.88	0.03	5	28 221 260	0
СахаЯкут-8	66 341 340	87.87	1.75	8	0	0
ГАЗПРОМ А4	65 201 260	97.33	0.03	36	0	0
МТС ОЗ	50 307 260	89.72	0.61	21	19 963 230	4 092 950
ИКС5Фин 01	46 947 790	80.39	-2.61	16	30 800 000	0
УралсибЛК2	46 873 280	75.52	-0.77	13	46 776 780	18 273 950
УРСАБанк 7	26 878 000	89.00	0.65	6	0	24 677 580
ОГК-2 01о6	24 957 340	84.14	0.27	8	0	66 872 420
ТГК-10 об1	10 619 410	97.83	0.08	5	97 545 120	47 890 270
Русфинанс4	6 991 250	87.39	1.72	3	61 473 080	49 567 220
Мечел 2о6	5 561 468	81.42	0.15	9	0	46 051 770
РосселхБ 3	2 717 932	94.90	-1.90	2	112 454 100	0
ВК-Инвест1	2 552 832	93.17	-0.08	5	0	94 794 900
ВТБ24 ОЗ	1 233 125	98.65	-0.15	1	0	91 701 420
АиФМПфин 1	1 145 251	95.36	1.79	10	50 220 000	15 233 700
АИЖК 10о6	19 840	64.00	9.00	4	6 790 000	101 571 100
ТрансКред2	13 742	98.16	-0.08	2	0	227 965 500
ТрансКред3	955	95.50	-2.75	1	47 749 040	65 288 960
АВТОВАЗ6о4	0	0.00	0.00	0	0	292 618 300
ВИА АИЖК А	0	0.00	0.00	0	0	444 498 700
КалужОбл-4	0	0.00	0.00	0	0	120 498 000
НОМОС-Лиз1	0	0.00	0.00	0	0	3 792 667 000
САНОС-02о6	0	0.00	0.00	0	46 525 000	70 700 620
Итого	1 265 794 000			1795	894 807 800	7 115 758 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	8 521 043 000	110.98	-0.48%	71 295	33 528 920	9 237 946 000
Сбербанк	6 468 658 000	14.74	4.66%	59 657	35 380 220	1 864 044 000
ЛУКОЙЛ	3 265 198 000	1115.1	0.99%	40 035	195 351 700	1 959 766 000
Роснефть	2 331 713 000	122.69	3.49%	26 896	79 305 590	1 316 741 000
ГМКНорНик	1 631 884 000	1632.11	2.39%	26 134	10 009 300	1 570 000 000
Сургнфгз	1 047 647 000	19.984	3.62%	13 081	14 928 630	748 170 200
ПолюсЗолот	920 238 500	1157.82	-7.04%	20 320	124 769 800	213 990 000
ВТБ ао	489 039 100	0.0197	2.50%	8 297	13 584 260	877 714 400
Сургнфгз-п	347 065 900	8.157	0.23%	5 432	13 313 450	2 298 138 000
Итого	26 722 120 000			334 123	603 623 600	38 033 500 000

Источник: ММВБ

[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 41Шамарданов 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

Старший аналитик
+7 843 291 50 27Галеев 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.ruВалютные корр. счета
+7 843 291 50 61Журавлев Сергей Александрович
sjouravlev@spurtbank.ruРублевые корр. счета
+7 843 291 50 62Лаврова Жанна Юрьевна
jlavrona@spurtbank.ruБэк-офис МБК
+7 843 291 50 64Сафина Гузелия Зиннуровна
gsafina@spurtbank.ruSWIFT
+7 843 291 50 66Анцис Рузалия Рашитовна
rancis@spurtbank.ruРасчеты РКЦ
+7 843 291 50 65Каштанова 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.