

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

1

Валютный рынок

На FOREX евро частично отыграл вчерашнее падение (1,4483, +0,5 цента). Сегодня запланировано заседание ЕЦБ. Предполагается, что европейский Центробанк не изменит уровень ключевой ставки (4,25%), однако инвесторы будут внимательно читать комментариев, а также следить за последующей пресс конференцией главы ЕЦБ Ж.-К. Трише.

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

2

ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Денежный рынок

Вчера на денежном рынке обстановка была достаточно спокойной в противовес валютному рынку. Мы полагаем, что сегодня конъюнктура существенно не изменится – индикативная ставка межбанковского рынка MIACR (overnight), скорее всего, стабилизируется около 5,5%.

РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

3

Казначейские облигации

Доходность десятилетней ноты продолжила снижение, составив 3,70% (-3 б.п.). На наш взгляд, ставка UST10 может стабилизироваться около 3,70% до выхода завтрашних Nonfarm Payrolls.

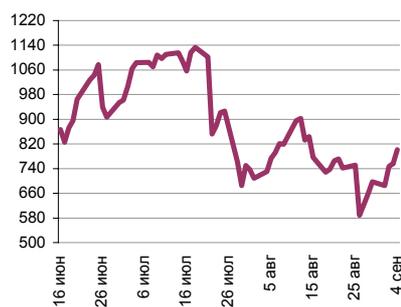
НОВОСТИ

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	1.4483	0.0052	-0.02
Нефть Brent, IPE	108.06	-0.26%	-5.73%
S&P 500	1,274.98	-0.20%	0.27%
Libor(6M) (%)	3.11	-0.01	-0.01
MOSPRIME(3M) (%)	7.80	-0.02	0.07
UST10 (%)	3.70	-0.03	-0.07
RusGLB30	111.38	0.00	-0.13
Доллар (ТОМ)	25.17	0.34	0.45
Евро (ТОМ)	36.38	0.42	0.24
Индекс РТС	1589.19	-4.25%	0.64%
Индекс ММВБ	1324.99	-3.21%	2.48%
ЗВР (млрд. долл)	581.50		0.40
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	4559.70		20.60

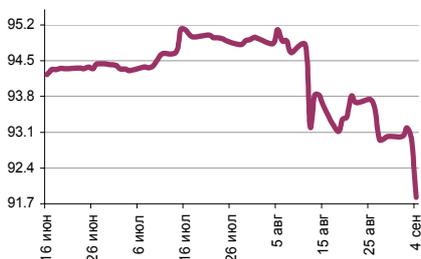
ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

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

Валютный рынок

На FOREX евро частично отыграл вчерашнее падение (1,4483, +0,5 цента).

Инвесторы обратили внимание на новую разбушевавшуюся стихию под именем Аик, а также ураган Ханна. Поскольку есть вероятность, что ураганы пройдут вблизи юго-восточного побережья США, где располагается много добывающих нефть вышек, то цены на черное золото вновь поползли вверх, увлекая за собой и пару евро-доллар.

Во вчерашнем обзоре была допущена неточность – запасы по нефти будут опубликованы именно сегодня, поскольку в понедельник в США был выходной. Помимо данных по запасам нефти, сегодня запланировано еще одно очень важное событие – заседание ЕЦБ. Предполагается, что европейский Центробанк не изменит уровень ключевой ставки (4,25%), однако инвесторы будут внимательно читать комментарий, а также следить за последующей пресс конференцией главы ЕЦБ Ж.-К. Трише.

Что касается вчерашних данных макростатистики Еврозоны, то пересмотренный ВВП за второй квартал ожидаемо снизился на 0,2%, а данные по розничным продажам оказались ниже прогнозов, упав на 0,4%.

Денежный рынок

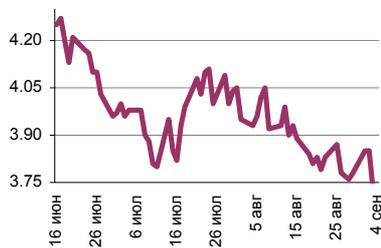
Вчера на денежном рынке обстановка была достаточно спокойной в противовес валютному рынку. В банковскую систему поступило около 50 млрд. рублей от аукциона по размещению средств бюджета.

Сумма остатков средств на корсчетах и депозитах подросла на 45,5 млрд. рублей до 801,6 млрд. рублей. Объем операций прямого РЕПО с Банком России снизился до 68 млрд. рублей (-56 млрд. рублей).

Мы полагаем, что сегодня конъюнктура денежного рынка существенно не изменится – индикативная ставка межбанковского рынка MIACR (overnight), скорее всего, стабилизируется около 5,5%.

РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

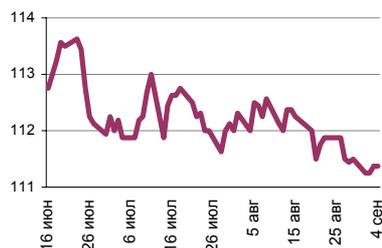
Казначейские облигации (UST10)

Доходность десятилетней ноты продолжила снижение, составив 3,70% (-3 б.п.). Если верить данным ценового индекса ISM, измеряющего инфляцию в производственном секторе, то падение цен на нефть уже дошло до производителей в США, и потому рынок с энтузиазмом воспринимает каждое новое «соскальзывание» котировок энергоносителей.

Сегодня запланирована публикация данных индекса ISM в секторе услуг, занятость от ADP, еженедельные заявки по пособиям по безработице в Штатах.

На наш взгляд, ставка UST10 может стабилизироваться около 3,70% до выхода завтрашних Nonfarm Payrolls.

RUSGLB30



Источник: Reuters

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0016	0.00200	0.0006	0.0022	326 200 000
EURRUB_TOD	35.9338	36.05600	35.865	35.97	61 512 000
EURRUB_TOM	36.1021	35.89000	35.89	36.375	411 748 000
USD_TODTOM	0.0022	0.00240	0.0017	0.0028	4 014 400 000
USDRUB_TOD	24.9555	24.86000	24.8325	25.239	1 397 517 952
USDRUB_TOM	25.0798	24.87000	24.8351	25.17	5 847 684 096

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
RU000A0JPTD7	982 963 801	98.27	-0.05	6.25	2	0
SU46020RMFS2	591 707 925	80.99	-1.05	8.94	20	0
SU25060RMFS3	181 614 359	99.49	-0.20	6.77	13	0
SU25057RMFS9	153 090 514	100.39	-0.30	7.29	16	0
SU26198RMFS0	85 296 101	93.92	-0.85	7.76	7	0
SU46021RMFS0	58 094 846	89.38	1.38	7.93	6	0
SU26200RMFS4	28 744 733	95.79	0.69	7.32	6	0
SU46017RMFS8	14 981 760	96.00	-4.20	7.95	1	0
SU46014RMFS5	2 009 996	100.50	1.00	7.66	3	0
SU25059RMFS5	1 778 366	98.09	-0.11	7.16	2	0
SU46018RMFS6	291 931	96.99	4.59	8.03	2	0
Итого	2 100 585 336				82	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор47-об	585 610 800	99.36	-0.61	88	129 275 000	967 233 900
КостромОб5	47 780 000	90.15	-4.75	3	0	39 871 300
МГор44-об	40 270 720	89.86	0.23	13	0	469 158 200
Мос.обл.8в	28 037 570	94.56	-0.94	6	303 760 000	3 381 408 000
Мос.обл.6в	15 348 090	97.76	-0.25	11	33 027 150	1 708 269 000
Мос.обл.5в	12 662 500	101.30	-0.70	1	0	274 335 700
ИркОбл31-3	12 064 000	97.05	-0.18	1	0	129 260 400
СамарОбл 3	10 805 200	94.95	-2.77	5	0	226 582 400
МГор39-об	8 818 935	92.82	-0.18	8	0	262 608 500
НижгорОбл3	6 827 658	97.92	0.02	8	97 785 000	66 968 240
СамарОбл 5	983 000	98.30	-0.05	1	0	1 151 574 000
БелОб 3об	440 100	97.80	-4.93	1	0	198 783 600
КОМИ 7в об	392 600	98.15	1.25	2	0	134 535 700
Мос.обл.7в	11 460	88.15	-5.47	4	0	1 411 049 000
Итого	806 924 400			182	817 620 500	16 812 890 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ А4	235 736 900	99.68	0.00	97	374 362 500	128 183 400
РазгуляйФ2	232 062 100	100.00	-3.00	20	0	1 060 463 000
РазгуляйФ4	137 000 000	100.00	0.25	12	0	601 931 900
РЖД-06обл	79 377 740	97.26	-0.47	29	174 970 000	254 320 400
ЦентрТел-4	65 975 490	103.32	-0.60	6	63 165 500	1 765 498 000
РусАлФ-3в	59 211 680	99.95	-0.04	36	334 787 500	190 710 200
ЧТПЗ 01об	55 827 080	98.76	-0.09	15	39 474 000	106 134 900
МОЭСК-01	55 478 980	97.33	0.13	9	97 275 000	351 187 100
ЮТК-04 об.	52 550 200	99.90	-0.40	3	67 652 500	419 594 800
Трансмаш-2	48 630 800	99.25	-0.05	7	0	395 751 300
Мечел 2об	47 361 350	94.16	-0.26	31	141 750 000	161 329 100
АИЖК Алтай	45 900 000	102.00	1.98	1	0	30 383 780
ОГК-5 об-1	30 982 220	98.85	-0.13	13	74 162 500	133 728 900
НИКОСХИМ 2	29 763 090	95.98	0.43	4	37 371 950	9 421 197
РЖД-03обл	27 091 000	100.43	-1.32	5	199 250 000	300 099 700
КОПЕЙКА 02	26 488 580	97.10	0.00	22	131 165 000	278 737 400
ДжейЭфСиГ1	26 110 180	99.35	-0.14	5	0	36 879 440
ЛукойлЗобл	25 794 000	94.14	-0.66	7	28 200 000	9 070 340
ИнкомЛада3	24 545 200	97.29	-0.71	5	68 891 000	217 277 500
Зенит Зобл	21 230 570	100.15	-0.14	5	0	184 760 100
УралВагЗФ2	19 930 000	99.65	-0.35	3	0	196 438 500
ВТБ - 5 об	19 926 990	99.63	-0.17	3	49 825 000	747 380 700
Зенит 5обл	19 792 580	99.46	-0.14	2	29 916 000	802 363 300
ДальСвз2об	19 602 000	99.00	0.00	4	10 098 000	223 020 900
МоскомцБ-3	19 100 000	95.50	0.00	1	0	63 139 900
Итого	2 352 930 000			1151	6 537 255 000	61 839 820 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	11 973 700 000	240.1	-4.45%	40 005	2 328 545 000	25 629 780 000
Сбербанк	8 065 624 000	59.99	-3.05%	41 379	518 246 900	14 762 920 000
ЛУКОЙЛ	5 053 417 000	1745.99	-3.52%	25 467	210 291 600	4 125 239 000
ГМКНорник	3 392 019 000	4576.72	-3.90%	15 126	147 407 100	7 015 771 000
ВТБ ао	2 255 809 000	0.0698	-3.36%	14 871	124 089 500	3 750 823 000
Роснефть	1 890 877 000	210.44	-3.69%	14 331	38 406 660	5 256 196 000
Сургнфгз	1 032 644 000	17.951	-3.29%	10 220	73 842 140	2 271 693 000
Ростел -ао	667 228 400	279.49	-0.61%	1 823	1 925 755	7 914 493 000
Полиметал	431 120 500	165.35	-0.29%	1 046	343 255 100	78 318 320
Итого	37 927 530 000			217 410	3 999 137 000	90 203 590 000

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.ruЭкономист
+7 843 291 50 20Мартынов Сергей Андреевич
smartynov@spurtbank.ru

Отдел доверительного управления

Начальник отдела
+7 843 291 50 29**Хайруллин Айбулат Рашитович**
aybulat@spurtbank.ru

Отдел анализа финансовых рынков

Ведущий экономист
+7 843 291 50 27Родченко Марина Викторовна
mrodchenko@spurtbank.ruСтарший аналитик
+7 843 264 48 63Галеев 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
ilavrona@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. Представленные 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.