

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ	1	Акции, Казначейские облигации (UST) Ночь не будет спокойной...
АКЦИИ, US TREASURIES	2	
РУБЛЕВЫЕ ДОЛГИ	3	Облигации «Рост» на рынке рублевых долгов.
Новости	4	
ИТОГИ ТОРГОВ ЗА ДЕНЬ	5	

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.

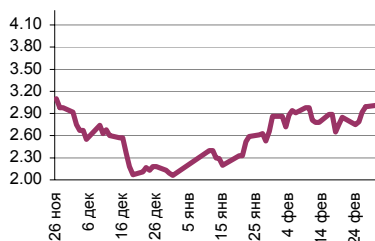


Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.2579	-0.0153	0.00
Нефть Brent, IPE	46.35	-0.34%	17.19%
S&P 500	735.09	-2.36%	-6.76%
Libor(6M) (%)	1.80	0.01	0.02
MOSPRIME(3M) (%)	22.75	-0.58	-1.75
UST10 (%)	3.01	0.02	0.26
RusGLB30	87.75	-0.25	-0.75
Доллар (ТОМ)	35.99	0.39	-0.24
Евро (ТОМ)	45.38	-0.17	-0.24
Индекс РТС	544.58	-0.54%	3.88%
Индекс ММВБ	666.05	-0.93%	6.07%
ЗВР (млрд. долл)	381.90		-4.70
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	3781.80		26.40

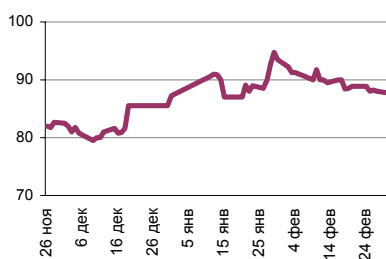
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

Мы приносим извинения за столь длительный перерыв в написании «дейли».

Итак, в пятничной макростатистике, несмотря на удручающие данные по ВВП США за четвертый квартал, все же мелькнуло весеннее настроение. Мы говорим о Chicago PMI, а также PMI России. Американский PMI оказался выше прогнозов, составив 34,2 п. против 33,3 п. в январе. Рост индекса произошел главным образом за счет увеличения его производственной составляющей до 34,7 с 29,7 п.

Российский индекс, рассчитываемый ВТБ Европа, по информации Рейтерс вырос до 40,6 с 34,4 п., показав замедление спада в отечественной промышленности.

Но, отдавая дань справедливости, мы должны сообщить о том, что: составляющая занятости в Chicago PMI снизилась до 26,2 с 34,8 п., а по мнению коллег из ВТБ Европа, текущее значение российского индекса PMI говорит о том, что мы вступаем в период падения промышленности еще более выраженного, чем в 1998 году.

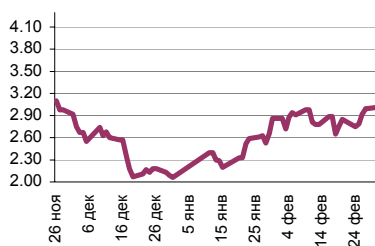
Ночь не будет спокойной ...

Настроения у западных инвесторов остаются негативными. Их пугает плачевное состояние дел в странах Восточной Европы, особенно после того, как на днях руководители стран Евросоюза на саммите в Брюсселе отказались выделить им помощь в размере €180 млрд. Что произойдет с рынками EM в случае дефолта одной из стран постсоветского лагеря, пока лучше не думать.

На этой неделе запланирован выход пула очень важной макроэкономической статистики, включая CPI, ISM, Nonfarm payrolls в США, а также заседание ЕЦБ в Европе.

Рублевые долги

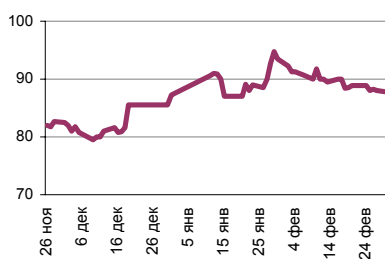
UST10



Источник: Reuters

На рынке рублевых долгов пятничный день прошел довольно ярко. Несмотря на низкую активность, цены большинства выпусков выросли. «Ярче остальных» вел себя рынок государственных облигаций: ОФЗ 46017 прибавила 2,4 фигуры при обороте 11,4 млн. рублей, ОФЗ 46018 – 13 фигур, правда, при низком обороте – 300 тыс. рублей. В итоге сводный ценовой индекс рынка государственных бумаг, рассчитываемый ММВБ, вырос более чем на 6 фигур.

RUSGLB30



Источник: Reuters

Очевидно, пятничная переоценка была связана с календарным окончанием месяца и квартала. По всей вероятности, сегодня цены восстановятся к прежним уровням.

НОВОСТИ

Дефицит федерального бюджета РФ в 2010 году составит 5 процентов ВВП, а в 2011 году сократится до 3 процентов ВВП, сказал журналистам министр финансов РФ Алексей Кудрин. В 2009 году дефицит бюджета РФ ожидается на уровне 8 процентов ВВП, напомнил Кудрин. Минфин также прогнозирует в 2010 году рост ВВП на 2-3 процента по сравнению со спадом экономики на 2,2 процента в текущем году, сказал Кудрин. По словам Кудрина государство сейчас усиливает свое присутствие в ряде отраслей, в том числе, в оборонно-промышленном комплексе. В другие частные отрасли государство не входит, лишь в случае необходимости оно может увеличить свою долю в банковском секторе. "Когда восстановятся рынки и когда рынки будут ликвидными, государство снизит свою долю в экономике", - сказал Кудрин.

Российские фондовые биржи с понедельника будут приостанавливать торги ценными бумагами, ориентируясь на динамику основных, а не технических фондовых индексов. Соответствующий приказ ФСФР был опубликован в конце января, однако регулятор дал биржам время до марта, чтобы изменить свои правила проведения торгов.

Центробанк РФ начал проводить сделки репо с акциями на фондовой бирже ММВБ - первые сделки прошли в пятницу под залог акций ЛУКОЙЛа и Газпрома. "С 26 февраля 2009 года Банк России приступил к проведению операций прямого репо на фондовой бирже ММВБ с акциями, включенными в ломбардный список Банка России", - сообщил к концу дня пятницы регулятор. ЦБР планировал запустить новый инструмент рефинансирования в конце февраля, включив в ломбардный список с 11 февраля акции крупнейших компаний.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0353	0.03500	0.0315	0.0408	4 678 199 808
EURRUB_TOD	45.2797	45.40750	45.1625	45.28	160 174 000
EURRUB_TOM	45.3687	45.41000	45.2001	45.38	206 000 000
USD_TODTOM	0.0313	0.22000	0.024	0.0305	5 549 199 872
USDRUB_TOD	35.7191	35.68000	35.61	35.76	1 640 278 016
USDRUB_TOM	35.8329	35.72000	35.63	35.99	2 620 390 912

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU25060RMFS3	40 471 525	99.45	-0.08	9.44	4	0
SU46017RMFS8	11 371 100	87.47	2.40	9.77	1	0
SU25063RMFS7	10 908 000	99.16	10.26	6.70	11	0
SU27026RMFS2	4 692 010	99.83	-0.07	11.65	3	0
SU46002RMFS0	4 451 395	89.01	-1.99	13.63	2	0
SU46003RMFS8	1 975 000	98.75	0.25	11.86	1	0
XS0114288789	1 592 857	91.00	1.50	9.18	10	0
SU46020RMFS2	564 225	70.09	0.09	10.45	5	0
RU000A0GRAN8	330 702	99.91	0.00	8.22	1	0
RU000A0GRKE6	301 500	90.00	0.00	15.12	1	0
SU46018RMFS6	300 390	93.00	13.00	8.54	10	0
Итого	77 283 825				69	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
Мос.обл.6в	45 198 850	81.15	12.51	21	8 482 400	0
Башкорт5об	44 739 340	96.95	-0.05	5	29 070 000	0
Мос.обл.8в	12 759 690	60.53	-0.03	24	0	183 257 100
СамарОбл 5	8 190 000	81.90	6.90	1	0	76 029 900
ИркОбл31-3	5 538 765	98.90	13.51	5	0	33 254 820
Мос.обл.7в	5 272 859	51.82	3.34	13	18 558 000	526 965 000
МГор46-об	1 983 294	99.12	-0.11	5	698 458 200	0
МГор45-об	1 979 750	79.19	0.18	2	0	787 167 600
МГор44-об	290 845	72.53	11.79	5	0	106 542 600
ВоронежОб4	0	0.00	0.00	0	0	140 379 100
Томск.об-4	0	0.00	0.00	0	0	149 985 900
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	168 087 700			153	755 068 900	2 459 133 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
СЗТелек5об	111 814 900	96.97	1.47	20	48 350 000	0
ГЭС 02	89 673 770	81.71	3.30	42	171 398 800	16 581 190
МГор59-об	89 600 550	95.13	0.00	57	0	0
ГидроОГК-1	71 606 310	80.33	0.90	10	259 865 000	28 478 970
ИКС5Фин 01	70 909 800	83.42	2.12	8	39 375 000	0
ВК-Инвест1	57 804 080	93.19	0.19	7	0	0
Зенит 5обл	55 789 400	95.99	2.49	13	19 798 000	8 804 050
Вагонмаш 2	55 162 260	78.88	-0.42	17	12 218 300	0
САНОС-02об	52 222 500	93.25	0.31	3	88 820 500	70 847 580
УРСАБанк 7	47 029 240	88.35	0.52	7	0	24 707 980
РосселхБ 3	47 000 000	94.00	0.00	2	46 950 000	0
УралсибЛК2	44 804 540	76.02	0.18	29	43 173 680	18 124 140
ГАЗПРОМ А4	38 036 380	97.37	0.06	39	32 653 350	0
ТГК-10 об1	30 161 520	97.78	0.00	16	160 779 000	34 263 140
ОГК-2 01об	26 491 800	83.31	0.79	7	98 282 200	108 565 600
ВТБ - 6 об	23 026 700	98.61	0.04	12	0	31 710 490
ЛР-Инвест1	21 552 000	100.00	-0.01	11	0	34 453 440
ВТБ-ЛизФ02	19 710 770	98.48	-0.02	3	54 098 000	76 006 020
ТрансКред2	18 282 890	98.70	0.51	9	54 089 520	0
ДГК-01	14 037 350	73.83	12.69	27	160 767 700	37 634 460
УрСИ сер07	9 989 475	99.83	0.43	4	71 685 930	8 310 991
ТрансКред3	9 825 000	98.25	-0.55	2	0	42 070 730
РосселхБ 7	6 930 000	99.00	-0.10	2	99 090 000	0
НаукаСв01	6 572 000	100.00	0.00	1	66 572 000	0
РусСтанд-5	6 501 357	92.76	0.01	15	0	135 950 600
Итого	1 661 832 000			1819	5 735 165 000	3 694 318 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	7 421 849 000	116.07	-2.40%	63 042	6 443 380	9 670 573 000
ГМКНорНик	4 256 839 000	1722.27	-0.70%	54 492	30 757 860	1 600 191 000
ЛУКОЙЛ	4 229 656 000	1151.33	-2.86%	42 856	23 236 480	1 729 371 000
Сбербанк	3 438 388 000	14.33	-2.94%	39 451	14 439 720	1 829 555 000
Роснефть	2 956 291 000	124.64	1.28%	32 071	5 621 938	1 439 420 000
Сургнфгз	1 984 968 000	19.95	4.50%	23 078	24 358 040	997 778 200
Сургнфгз-п	1 201 987 000	8.424	2.57%	13 987	55 434 430	2 151 731 000
ФСК ЕЭС ао	788 391 400	0.131	9.70%	7 742	108 834 600	305 166 200
ПолюсЗолот	545 301 200	1204.45	1.88%	10 379	54 661 990	171 298 500
Итого	29 068 760 000			366 024	606 265 100	38 015 030 000

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 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

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