

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

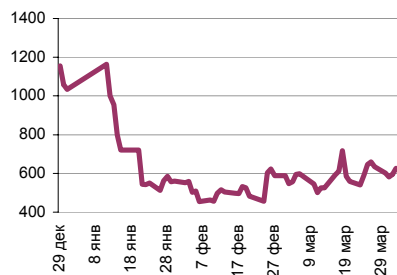
КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ	1
ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ	2
ВАЛЮТНЫЕ ОБЛИГАЦИИ	3
Новости	4
ИТОГИ ТОРГОВ ЗА ДЕНЬ	5

Валютный и денежный рынки: Минфин возобновляет размещение средств на банковские депозиты.

Валютные облигации: В преддверии G20.

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.

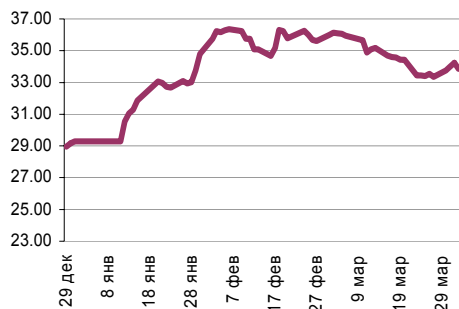


Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.3274	0.0072	-0.02
Нефть Brent, IPE	48.44	-1.60%	-9.46%
S&P 500	811.08	1.66%	0.60%
Libor(6M) (%)	1.72	-0.02	-0.06
MOSPRIME(3M) (%)	16.53	0.03	-0.01
UST10 (%)	2.65	-0.03	-0.05
RusGLB30	93.88	0.19	0.63
Доллар (ТОМ)	33.86	-0.39	0.47
Евро (ТОМ)	44.96	-0.02	-0.24
Индекс РТС	685.51	-0.60%	-5.01%
Индекс ММВБ	787.22	1.85%	-3.50%
ЗВР (млрд. долл)	385.30		9.20
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	3759.60		8.10

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

Курс рубль-доллар



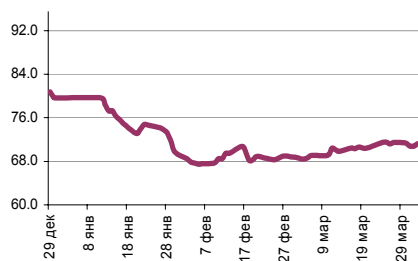
Источник: ММВБ, Банк Спурт

Сумма остатков средств на корсчетах и депозитах составила по итогам вчерашнего дня: 626.6 млрд. рублей. (32.4 млрд. рублей). Сальдо операций с банковским сектором на сегодняшнее утро -70,0 млрд. рублей.

Новостной фон вчера был бедным за исключением, пожалуй, одной новости: по сообщению Рейтерс, Минфин планирует на следующей неделе провести аукцион по размещению на депозитах банков бюджетных средств объемом до 50 млрд. рублей и сроком до 6 месяцев.

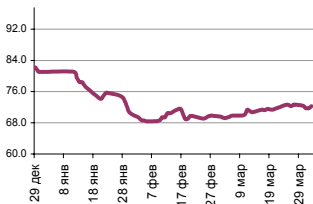
В принципе, на наш взгляд, этот аукцион можно рассматривать как своеобразное «замещение» беззалогового аукциона на длинный срок.

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



Источник: Банк Спурт

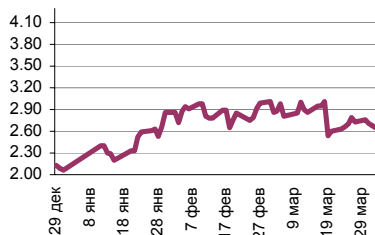
Индекс рубля к корзине валют (0,55 \$, 0,45 €)



Источник: Банк Спурт

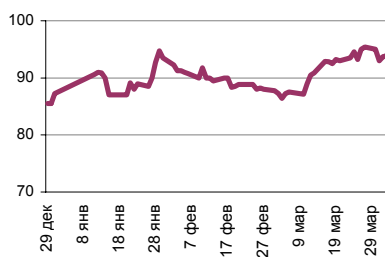
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

Ставка десятилетней ноты составила по итогам вчерашнего дня 2.65 % (-0.030 пп.). Промышленный индекс Dow Jones по итогам вчерашнего дня - 7,761.60 п. (2.01%). Расширенный индекс фондового рынка S&P 500 составил 811.08 п. (1.66%).

Вчера имела место достаточно редкая ситуация: одновременно снижались ставки UST и росли фондовые рынки.

Росту ставки UST препятствует выкуп Казначейством США длинных бумаг в противовес макроконъюнктуре – появлению у иностранных инвесторов аппетита к риску.

Сегодня и завтра определяющими событиями для фондовых рынков будут: саммит G20, а также публикация данных по американской безработице в несельскохозяйственном секторе Nonfarm Payrolls.

НОВОСТИ

Объем резервного фонда РФ на 1 апреля 2009 года составил 4.117,67 миллиарда рублей (\$121,06 миллиарда), фонда национального благосостояния (ФНБ) - 2.915,21 миллиарда рублей (\$85,71 миллиарда), говорится в сообщении на сайте Министерства финансов (www.minfin.ru). Размер резервного фонда РФ на 1 марта 2009 года составлял 4.869,74 миллиарда рублей (\$136,33 миллиарда), ФНБ - 2.995,51 миллиарда рублей (\$83,86 миллиарда). Минфин РФ в марте 2009 года начал перечислять средства из Резервного фонда в Федеральное казначейство для финансирования дефицита федерального бюджета. На 23 марта Резервный фонд сократился на 300 миллиардов рублей. Предполагалось, что в марте на покрытие кассового разрыва из фонда будет перечислено 600 миллиардов рублей, в апреле - еще 600 миллиардов рублей, в мае - 400 миллиардов рублей. Минфин сообщил, что он продал в марте \$7,95 миллиарда, 5,97 миллиарда евро и 1,23 миллиарда фунтов стерлингов, находящихся на счетах в Банке России, и приобрел 600,00 миллиардов рублей, которыми и закрыли "дыру" в бюджете. "Конверсионные операции со средствами Резервного фонда были осуществлены согласно утвержденной ранее валютной структуре по официальным курсам иностранных валют, установленным Банком России на дату их проведения, и не оказали влияние на конъюнктуру валютного рынка", - пишет Минфин.

Крупнейший частный банк России Альфа-банк готов отдать государству любую долю, за исключением контрольного пакета, поскольку нуждается в капитале на развитие, при этом речь о выживании не идет, сказал глава банка Петр Авен в интервью газете "Ведомости". "Единственным новым инвестором на сегодняшний день может стать лишь государство. Мне кажется, что вхождение государства в капитал частных банков сегодня почти неизбежное зло. Надо готовиться к тому, что это может произойти", - сказал Авен. "И это не так страшно - мы сами такой вариант предлагали... Нам от этого плохо не станет - нам нужны деньги в капитал. И государство как партнер здесь не представляется проблемой. Вплоть до контрольного пакета - но не трогая его - мы готовы уступить государству в обмен на внесение денег в капитал. Для нас это не вопрос выживаемости - это вопрос развития". С началом кризиса власти РФ решили поддержать банковскую систему субординированными кредитами и разрешили госкорпорации ВЭБ взять на эти цели из Фонда национального благосостояния 450 миллиардов рублей. На сегодняшний день лишь 257 миллиардов рублей выданы, при этом львиную долю - 225 миллиардов рублей - получили государственные ВТБ и Россельхозбанк, еще 15 миллиардов рублей привлек Газпромбанк, а частные Альфа, Ханты-Мансийский банк и Номос-банк получили на троих всего 17 миллиардов рублей, из которых 10 миллиардов достались Альфе. Крупнейший в стране Сбербанк получил 500 миллиардов рублей от основного акционера - Центробанка.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0112	0.01150	0.0088	0.01	526 100 000
EURRUB_TOD	44.7979	44.88000	44.68	44.86	104 699 000
EURRUB_TOM	44.8697	44.80250	44.7	44.96	199 223 008
USD_TODTOM	0.0082	0.00910	0.006	0.007	5 242 699 776
USDRUB_TOD	33.9398	34.03950	33.88	33.915	794 968 000
USDRUB_TOM	33.933	34.05000	33.85	33.86	2 255 300 096

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU25060RMFS3	11 276 444	99.81	0.01	8.54	3	0
SU46017RMFS8	4 800 000	80.00	-0.45	11.64	1	0
SU46018RMFS6	1 067 304	71.15	-17.95	12.60	2	0
SU46003RMFS8	74 999	100.00	0.00	10.21	1	0
SU25057RMFS9	982	98.23	-0.06	10.07	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	17 219 730				8	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор46-об	202 091 800	98.58	-1.00	4	0	234 324 700
Мос.обл.4в	135 400 400	99.04	-0.16	58	0	0
МГор59-об	90 447 380	96.74	0.11	29	228 062 000	44 473 360
МГор50-об	85 440 500	82.95	-0.43	5	40 768 000	578 510 900
Мос.обл.8в	80 074 580	74.52	-3.66	29	0	393 795 800
ВоронежОбЗ	59 840 100	83.29	-5.61	4	0	20 779 200
Мос.обл.7в	22 685 240	58.43	-0.58	24	3 643 449	0
Мос.обл.6в	17 153 090	80.94	1.59	6	0	19 102 560
МГор45-об	8 339 485	79.50	0.01	14	0	1 305 141 000
СамарОбл 5	2 415	80.50	-1.26	1	0	172 411 800
МГор44-об	0	0.00	0.00	0	0	232 737 800
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	810 425 900			266	283 972 400	3 449 999 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ЦентрТел-4	183 576 600	99.62	0.42	11	39 954 120	0
МГор58-об	134 496 200	89.49	89.49	28	53 636 000	260 740 700
АИЖК 10об	95 439 430	71.16	3.73	18	0	103 301 600
ГАЗПРОМ А4	75 681 460	97.85	0.14	75	3 904 000	0
Петрокомб2	58 867 500	97.46	-0.04	6	0	27 762 420
ГЭС 02	48 487 400	94.70	1.45	4	139 725 000	15 838 200
Синергия-2	47 450 000	94.90	4.92	1	271 014 300	0
ВТБ - 5 об	45 919 200	99.82	0.01	10	49 910 000	7 083 203
ТГК-10 об1	24 551 520	98.52	-0.02	11	0	156 798 000
ОГК-2 01об	22 566 490	89.84	0.52	16	0	68 888 570
ЕБРР 01обл	20 823 620	102.75	-0.02	13	51 398 970	0
ВТБ - 6 об	20 315 660	99.05	-0.02	19	0	67 644 170
ТрансКред3	15 294 980	96.63	0.00	3	0	87 713 040
ЮЛКФИН1	14 188 690	99.85	0.00	1	51 947 960	0
УралсиБЛК2	13 864 820	80.35	0.56	19	34 274 340	19 001 610
МТС 03	11 005 800	98.43	-0.57	5	0	39 000 000
Система-01	10 185 750	100.75	0.00	4	141 010 600	81 209 040
САНОС-02об	9 543 955	95.43	-0.02	2	0	72 690 900
СтрТрГаз03	8 067 830	97.13	-0.49	18	101 696 000	194 207 800
ТрансКред2	6 548 850	99.23	0.03	2	0	117 997 800
ВК-Инвест1	5 255 199	94.45	0.05	3	13 688 000	85 886 380
Росселб 3	5 133 146	96.05	-0.03	7	479 369 200	59 116 050
Метрострой	950 000	95.00	-3.68	8	1 441 142 000	0
АВТОВАЗбо4	475 300	97.00	0.75	3	37 471 250	291 599 700
ИтераФ-1	441 225	98.05	-0.35	1	0	206 671 400
Итого	1 477 468 000			1397	3 417 175 000	4 646 521 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	10 017 430 000	127.77	3.77%	74 455	1 028 949 000	8 528 262 000
Сбербанк	9 480 913 000	20.73	1.04%	82 951	793 722 400	1 444 268 000
ЛУКОЙЛ	3 252 430 000	1276.71	2.61%	38 456	82 500 660	1 619 700 000
Роснефть	1 940 271 000	148.67	3.21%	24 783	81 235 920	1 991 229 000
ГМКНорник	1 764 409 000	2063.89	0.86%	29 416	200 228	1 175 738 000
Уркалий-ао	1 005 987 000	80.13	2.65%	20 203	0	9 695 959
ВТБ ао	902 653 600	0.028	2.78%	10 312	2 050 766	369 686 400
ФСК ЕЭС ао	815 934 700	0.163	15.82%	8 405	0	531 041 400
Сургнфгз	787 024 400	21.207	0.61%	13 633	80 052 700	851 893 500
Итого	33 978 500 000			407 295	2 304 303 000	35 238 450 000

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.