

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О
ГЛАВНОМ

1

Валютный рынок

Доллар продолжает рост против евро на FOREX, составив по итогам сегодняшнего дня 1,3975. Сегодня запланировано заседание и решение по ставке ЕЦБ. С вероятностью 60% предполагается, что ставка останется неизменной на уровне 4,25%.

ВАЛЮТНЫЙ И
ДЕНЕЖНЫЙ
РЫНКИ

2

ВАЛЮТНЫЕ
ОБЛИГАЦИИ

3

Денежный рынок

Сегодня мы не ждем каких-либо изменений ситуации. Месяц только начался, и хотя, как мы полагаем, средства в рамках ежемесячных расходов бюджета уже поступили, мы не исключаем, что какая-то небольшая оставшаяся часть из них может подойти в ближайшие дни.

НОВОСТИ

5

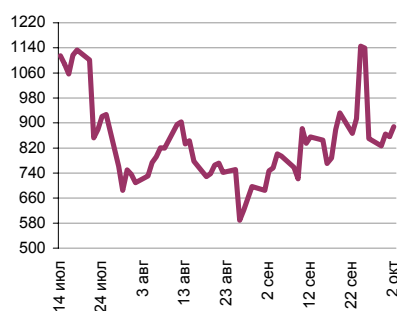
ИТОГИ ТОРГОВ
ЗА ДЕНЬ

6

Казначейские облигации

Доходность десятилетней ноты практически не изменилась по итогам вчерашнего дня, составив 3,74% несмотря на то, что Сенат одобрил план Буша. Впрочем, камень преткновения по-прежнему в Конгрессе, который будет заседать завтра повторно по этому же вопросу.

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.

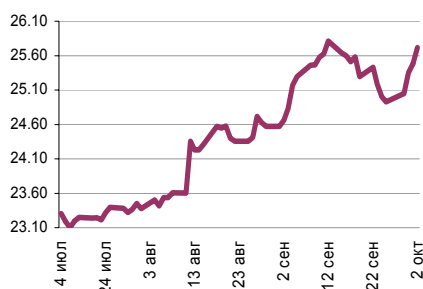


Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.3975	-0.0118	-0.07
Нефть Brent, IPE	95.33	-2.89%	-7.52%
S&P 500	1,161.06	-0.32%	-2.29%
Libor(6M) (%)	4.04	0.06	0.57
MOSPRIME(3M) (%)	9.10	-0.01	0.08
UST10 (%)	3.74	-0.08	-0.06
RusGLB30	102.75	2.25	0.25
Доллар (ТОМ)	25.72	0.24	0.72
Евро (ТОМ)	36.11	-0.28	-0.77
Индекс РТС	1189.06	-1.88%	-6.53%
Индекс ММВБ	1017.17	-1.02%	-5.04%
ЗВР (млрд. долл)	559.40		-0.90
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	4459.10		-96.70

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

Курс рубль-доллар



Источник: ММВБ, Банк Спурт

Валютный рынок

Доллар продолжает рост против евро на FOREX, составив по итогам сегодняшнего дня 1,3975. Сегодня запланировано заседание и решение по ставке ЕЦБ. С вероятностью 60% предполагается, что ставка останется неизменной на уровне 4,25%.

Если же ставка все-таки будет понижена то, на наш взгляд, это даст мощный импульс для продолжения роста доллара против евро.

Завтра нас ожидает еще один мощный новостной пакет, включающий в себя заседание Конгресса по вопросу выделения финансовой помощи, а также публикацию данных по американской безработице за сентябрь.

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

Источник: Банк Спурт

Денежный рынок

На денежном рынке без изменений. Межбанковского рынка в прежнем понимании не существует, а есть несколько титанов, которые по государственной разрядке кто-то более, а кто-то менее охотно поддерживают менее крупные банки.

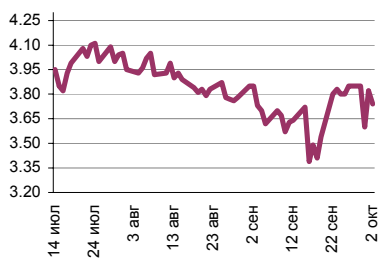
Сегодня мы не ждем каких-либо изменений ситуации. Месяц только начался, и хотя, как мы полагаем, средства в рамках ежемесячных расходов бюджета уже поступили, мы не исключаем, что какая-то небольшая оставшаяся часть из них может подойти в ближайшие дни.

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

Источник: Банк Спурт

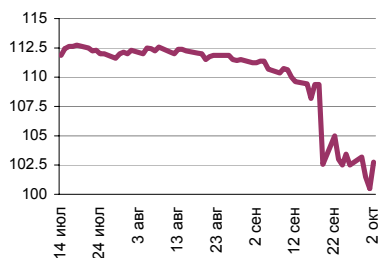
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Казначейские облигации (UST10)

Доходность десятилетней ноты практически не изменилась по итогам вчерашнего дня, составив 3,74% несмотря на то, что Сенат одобрил план Буша. Впрочем, камень преткновения по-прежнему в Конгрессе, который будет заседать завтра повторно по этому же вопросу.

На наш взгляд, сегодня доходность десятилетней ноты значительно не изменится, зато завтра возможна высокая волатильность на рынке UST10.

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0035	0.00500	0.0025	0.0027	632 899 968
EURRUB_TOD	36.1525	36.18000	36.1	36.2	70 008 000
EURRUB_TOM	36.1702	36.16000	36.0601	36.11	162 743 008
USD_TODTOM	0.0012	0.00150	-0.0001	0	6 297 200 128
USDRUB_TOD	25.6023	25.62000	25.57	25.595	964 238 016
USDRUB_TOM	25.6388	25.63250	25.5775	25.72	2 666 855 936

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU46021RMFS0	898 922 601	98.85	3.89	6.38	9	0
SU46003RMFS8	302 307 429	103.31	-0.43	7.35	10	0
SU25063RMFS7	248 554 885	98.65	0.25	6.85	6	248 554 906
SU25060RMFS3	141 734 115	99.75	0.06	6.39	15	0
SU25057RMFS9	18 147 177	100.75	-0.19	6.97	8	0
SU46020RMFS2	15 862 729	79.10	-3.38	9.18	7	-239 074 515
SU25059RMFS5	14 712 300	98.08	-0.31	7.20	3	0
SU26198RMFS0	13 536 000	90.24	-5.71	8.95	2	0
SU25062RMFS9	9 710 000	97.10	-1.79	7.22	1	0
SU46018RMFS6	5 131 145	90.02	-6.34	9.06	3	0
SU26199RMFS8	4 705 080	94.10	-1.87	8.16	3	0
Итого	1 674 122 369				76	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор38-об	90 007 090	100.00	-6.20	8	0	213 384 000
СамарОбл 5	12 377 480	82.50	-0.71	4	113 040 000	286 868 600
МГор47-об	8 893 494	98.52	-0.30	16	669 800 000	4 440 230
ЯрОбл-07	542 600	90.43	2.18	3	59 725 000	40 696 530
Мос.обл.8в	179 367	85.01	-2.26	5	229 043 900	241 532 400
МГор45-об	1 990	99.50	-1.75	1	0	781 694 500
Казань06об	990	99.00	4.00	1	0	132 645 600
ВолгогрОб7	0			0	80 516 340	451 830 000
ВоронежОб4	0			0	52 973 500	176 454 100
КраснодКр2	0			0	0	118 506 600
МГор39-об	0			0	0	108 071 400
МГор44-об	0			0	689 320	1 924 770 000
МГор50-об	0			0	0	346 651 900
Мос.обл.6в	0			0	0	477 551 100
Итого	131 591 300			68	1 275 332 000	6 853 644 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
Мосэнерго1	248 976 800	94.06	-1.20	11	380 985 000	12 700 990
ГАЗПРОМ А4	107 979 500	99.54	0.64	102	0	0
ЕврокомФК2	88 738 080	97.94	-0.29	14	0	0
ТГК-10 об2	66 550 360	96.72	0.58	16	0	0
ГидроОГК-1	65 537 690	79.92	-5.33	56	420 075 000	521 037 000
Альянс-01	49 152 540	88.85	-7.68	9	25 949 140	154 739 300
ЮТК-04 об.	48 005 560	92.53	-1.47	16	34 302 600	76 639 630
ЦентрТел-4	35 858 200	94.51	-0.82	13	0	119 546 500
РусСтанд-8	27 720 000	99.00	-0.37	2	0	220 162 300
ВК-Инвест1	27 515 740	90.21	0.00	7	287 650 000	166 297 700
ЕБРР 01обл	22 838 100	100.17	-0.08	8	400 350 000	0
РЕТАЛ-1	19 614 640	90.34	3.32	16	106 313 600	0
Магнезит 1	17 578 180	97.22	-0.28	6	0	102 370 800
АИЖК 10об	15 557 660	72.81	0.41	6	0	120 236 100
7Контин-02	14 173 470	90.03	-2.81	11	93 250 220	0
ПромТр02об	13 867 500	91.08	-6.29	8	0	43 986 520
Атлант-М 1	11 024 610	95.15	2.32	15	147 786 500	0
ЕБРР 02обл	10 023 500	100.23	-0.17	6	400 380 000	0
МОИА 02	9 601 680	100.02	0.02	5	1 600 000	79 533 180
Магнезит 2	9 333 310	92.58	-3.65	6	0	46 953 200
ИжАвто 02	9 325 850	93.25	-1.00	3	0	51 859 840
РусСтанд-6	9 148 785	91.00	1.14	9	64 818 800	0
СуварКаз-1	8 815 500	97.95	-0.02	1	48 865 500	0
ВлгТлкВТ-4	7 976 059	94.80	-0.11	5	0	56 105 560
УРСАБанк 7	7 701 000	77.01	0.01	2	0	61 370 400
Итого	1 441 213 000			1406	6 345 505 000	15 250 250 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	8 319 223 000	199.28	0.00%	44 849	474 446 800	11 304 320 000
Сбербанк	4 626 945 000	42.53	-3.85%	36 419	37 764 750	5 058 223 000
ЛУКОЙЛ	2 394 590 000	1517.25	-1.30%	16 421	42 325 210	1 289 909 000
Роснефть	2 327 049 000	171.69	-2.96%	19 641	302 383 700	885 692 500
ГМКНорник	2 184 251 000	3553.27	1.83%	12 371	3 329 400	2 398 919 000
ВТБ ао	1 203 795 000	0.0504	-0.40%	15 357	17 191 100	1 613 565 000
Сургнфгз	835 701 400	13.817	3.16%	7 003	90 788 000	586 274 300
ПолюсЗолот	821 923 600	708.35	-14.81%	15 965	77 417 300	150 795 100
МТС-ао	462 357 000	230.24	4.65%	4 033	535 900	1 120 581 000
Итого	25 627 940 000			234 218	1 718 920 000	32 890 040 000

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
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. 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.