

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

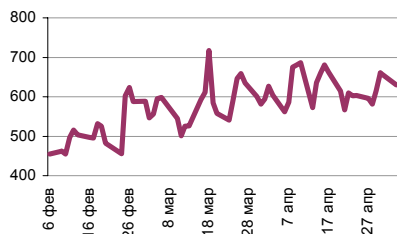
КОРОТКО О ГЛАВНОМ

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

Валютный и денежный рынки: Ждем поступления бюджетных средств.

Акции и валютные облигации: Данные макростатистики принесли оптимизм.

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.



Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.3318	0.0044	0.03
Нефть Brent, IPE	52.85	4.08%	6.10%
S&P 500	877.52	0.44%	4.03%
Libor(6M) (%)	1.55	-0.03	-0.11
MOSPRIME(3M) (%)	16.04	-0.12	-0.36
UST10 (%)	3.15	0.06	0.21
RusGLB30	97.63	0.94	0.88
Доллар (ТОМ)	33.11	-0.06	-0.88
Евро (ТОМ)	43.81	-0.09	-0.23
Индекс РТС	832.87	2.22%	6.08%
Индекс ММВБ	920.35	-0.18%	1.70%
ЗВР (млрд. долл)	380.60		-3.40
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	3820.90		48.90

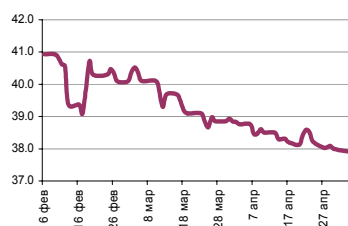
ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

Курс рубль-доллар



Источник: ММВБ, Банк Спурт

Индекс рубля к корзине валют



Источник: Банк Спурт

Сумма остатков средств на корсчетах и депозитах составила по итогам вчерашнего дня: 630.2 млрд. рублей. (-30.5 млрд. рублей). Сальдо операций с банковским сектором на сегодняшнее утро: -32,0 млрд. рублей.

Хотя уровень банковской ликвидности и снизился на 30 млрд. рублей, фактически в четверг произошло поступление денег в банковскую систему (около 40 млрд. рублей) от продаж долларов Банку России.

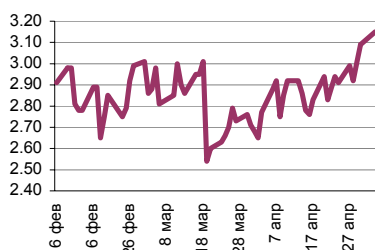
За счет этих средств, а также собственных ресурсов кредитные организации погасили часть задолженности по операциям прямого РЕПО перед ЦБ на сумму 74 млрд. рублей.

Мы полагаем, что с началом нового месяца в банковскую систему возобновится поступление бюджетных средств. Кроме этого, сегодня и завтра Банк России проводит беззалоговые аукционы на 5 недель и 3 месяца совокупным объемом 15 млрд. рублей.

Бивалютная корзина в четверг продолжила снижение и составила 37.92 рублей.

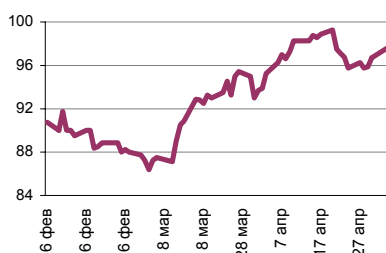
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

Ставка десятилетней ноты составила по итогам вчерашнего дня 3.15 % (0.060 пп.). Промышленный индекс Dow Jones - 8,212.41 п. (0.33%). Расширенный индекс фондового рынка S&P 500 составил 877.52 п. (0.44%).

В пятницу, когда российские игроки отдыхали, западные инвесторы возобновили покупки. Оптимизм базировался на публикации благоприятных данных американской макростатистики – индекса Мичиганского университета, составившего 65,1 против прогнозного значения 64, а также индекса ISM, составившего 40,1 при ожиданиях 39,5.

Сегодня будут объявлены результаты стресс-тестирования 19 крупнейших американских банков. Позже на этой неделе внимание инвесторов будет обращено на заседание ЕЦБ в Европе, а также выход новостей Nonfarm Payrolls в США.

НОВОСТИ

Добыча газа в России сократилась в апреле 2009 года почти на четверть по сравнению с апрелем прошлого года, а добыча нефти выросла, свидетельствуют данные министерства энергетики. Добыча газа составила в апреле 1,47 миллиарда кубометров в сутки по сравнению с 1,92 миллиарда в апреле 2008 года, а добыча нефти выросла на 1,3 процента до 9,85 миллиона баррелей в сутки. Добыча газового монополиста Газпром снизилась на 28 процентов к апрелю прошлого года и на 7 процентов к марту 2009 года до 1,15 миллиарда кубометров в сутки. Это самый низкий уровень добычи за последнее десятилетие, говорят аналитики, предсказывая рост добычи во втором полугодии, когда цена газа снизится вслед за нефтью. Пока этого не произошло, клиенты откладывают приобретение газа, отдавая предпочтение более дешевым энергоносителям. Газпром - крупнейший в мире производитель газа - добывает около 80 процентов российского газа и на четверть обеспечивает потребности Европы в этом виде топлива. Добыча второго крупнейшего производителя газа в России Новатэк <NVTК.ММ> в апреле составила 2,5 миллиарда кубометров в сутки, что равняется показателю апреля прошлого года и чуть ниже, чем в марте этого года. Ранее компания планировала повысить добычу в этом году на 10 процентов. Газпром ранее сообщал, что будет просить других производителей сократить добычу в связи со снижением спроса.

Российский Норильский никель, крупнейший в мире производитель никеля и палладия, хочет реструктурировать в западных банках часть кредита в размере \$6,4 миллиарда, взятого в 2007 году на покупку канадской LionOre, сообщила в воскресенье газета Independent on Sunday. По ее данным, Норникель хочет облегчить для себя условия этого кредита. Для помощи в переговорах привлечены инвестбанки Rothschild и Lazard. Представитель Норникеля отказался комментировать эту информацию. Крупнейшими акционерами Норникеля являются бизнесмен Владимир Потанин и компания Русал, контролируемая Олегом Дерипаской. Им принадлежит по блоку пакету акций Норникеля.

Четвертый по размеру активов в Казахстане Альянс-банк начал переговоры с кредиторами о реструктуризации долгов и создал координационный комитет, в который вошли семь международных банков, сообщил банк в понедельник. "По итогам предварительных консультаций с кредиторами по двусторонним и синдицированным займам завершается формирование Координационного комитета для ведения переговоров в рамках плана реструктуризации и рекапитализации Альянс-банка. В состав комитета войдут семь международных банков, которые будут представлять интересы более шестидесяти кредиторов банка", - говорится в сообщении банка. В конце апреля Альянс-банк предложил кредиторам реструктурировать средне- и долгосрочные долги.

Bank of America Corp выработывает план привлечения более \$10 миллиардов свежего капитала, пытаясь убедить правительство в том, что ему не нужна помощь, сообщает газета Financial Times. Со ссылкой на осведомленные источники газета сообщает, что Citibank, Bank of America, и еще по крайней мере два банка в понедельник попытаются убедить Министерство финансов и ФРС, что оценки, которые они получили за "стресс-тест", чересчур пессимистичны. Bank of America, который уже получил от правительства \$45 миллиардов, по результатам стресс-теста нуждается более чем в \$10 миллиардах, пишет газета со ссылкой на источники. Региональные банки Wells Fargo и PNC Financial также оказались в числе банков, которым потребуется привлечение капитала, если они не смогут убедить власти в том, что результаты стресс-теста некорректны, сообщает газета. Власти США проводят стресс-тест для 19 крупнейших банков, чтобы определить их устойчивость в случае, если финансовая ситуация будет ухудшаться. Банки получили предварительные результаты теста на прошлой неделе и сейчас ведут переговоры с Минфином о достаточном размере реального акционерного капитала, который является показателем устойчивости капитала. По мнению аналитиков, все 19 банков по результатам стресс-теста будут признаны состоятельными, однако некоторым банкам потребуется привлечь больший объем капитала, чтобы пережить более суровую рецессию. Среди этих банков называют Citibank и Bank of America. Получить комментарии представителей Министерства финансов и Bank of America не удалось.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0494	0.06000	0.0375	0.0375	480 100 000
EURRUB_TOD	43.981	44.85000	43.849	44	73 989 000
EURRUB_TOM	43.9033	43.91500	43.77	43.81	147 687 008
USD_TODTOM	0.0335	0.04000	0.0175	0.0175	6 044 299 776
USDRUB_TOD	32.9394	33.00000	32.895	33.005	1 450 493 056
USDRUB_TOM	32.9878	33.04000	32.91	33.105	3 556 222 976

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
RU000A0JQ4H7	626 094 482	96.71	0.40	8.99	5	0
SU25064RMFS5	360 690 000	100.19	0.04	12.35	17	350 670 950
SU25059RMFS5	130 219 898	93.10	-0.14	10.95	2	0
SU26199RMFS8	31 450 001	85.00	-2.50	12.33	2	0
SU25057RMFS9	11 868 000	98.90	-0.32	9.29	2	0
XS0114288789	2 346 855	98.03	2.98	7.84	15	0
SU25062RMFS9	963 200	96.32	-2.78	8.03	11	0
SU46018RMFS6	300 900	93.45	15.91	8.45	11	0
SU46002RMFS0	973	97.25	4.35	9.59	1	0
SU26198RMFS0	870	86.99	1.19	10.60	1	0
0	0	0.00	0.00	0.00	0	0
Итого	1 163 935 178				67	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор54-об	459 468 000	79.47	0.08	117	117 341 800	807 947 400
МГор45-об	226 615 800	81.58	0.13	53	42 328 000	1 534 427 000
МГор50-об	113 611 400	84.53	0.07	12	46 454 000	722 224 000
МГор59-об	108 930 700	97.65	0.09	18	195 240 000	237 748 000
МГор58-об	84 407 150	91.52	0.12	18	114 375 000	1 106 004 000
Саха(Якут)	48 688 420	81.08	-0.13	5	24 570 000	52 535 790
Якут-07 об	35 978 970	86.83	8.83	4	0	0
Казань06об	29 719 190	99.06	-0.19	4	29 703 000	12 604 190
СамарОбл 5	23 875 210	85.15	0.15	3	23 879 960	72 167 200
Мос.обл.8в	20 024 500	81.55	-0.14	16	584 620 900	414 430 600
Карелия 2	19 893 000	99.47	8.97	2	0	37 621 800
Белгор2006	18 792 500	93.96	5.96	3	9 400 000	0
ИркОбл31-5	15 680 800	99.57	9.57	4	0	53 637 080
ИркОбл31-6	15 200 760	100.01	0.01	3	0	521 887 600
Итого	1 306 287 000			341	1 199 708 000	7 674 050 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ВТБ - 5 об	350 652 800	101.45	0.06	55	128 580 400	463 266 200
ФинБизГр 1	268 602 000	100.60	0.60	1	0	0
НацКап-01	260 036 000	100.40	0.40	1	0	0
ТКФинанс 2	259 287 300	100.89	0.89	1	0	0
ТрансФинМ1	246 254 800	103.07	3.07	2	0	0
ХКФ Банк-5	217 965 200	98.85	-0.99	19	491 599 000	0
ЕБРР 01обл	120 981 300	103.28	0.23	14	0	0
Усть-Луга1	113 500 000	90.05	5.05	16	80 576 060	0
МТС ОЗ	105 720 700	99.71	6.21	6	100 480 800	84 466 220
ДальСвз2об	93 950 000	93.95	2.91	13	129 752 900	0
Система-01	78 561 580	100.96	0.08	35	245 730 000	254 290 000
ОГК-2 01об	69 388 310	91.85	0.40	13	0	0
ЕБРР 03обл	66 934 600	103.37	0.39	10	51 660 000	0
ВК-Инвест1	62 948 600	96.09	0.19	4	62 477 500	279 013 000
ТГК-10 об1	55 916 420	99.27	0.27	16	0	221 634 200
ИКС5Фин 01	55 002 500	90.47	1.46	6	27 144 000	28 202 570
ДМЦЕНТРоб1	52 268 200	74.14	8.39	9	51 920 480	34 029 760
ВТБ - 6 об	51 934 760	99.64	0.04	19	298 995 000	333 351 500
ВлгТлкВТ-4	49 708 740	98.92	-0.43	7	29 639 010	0
ТГК-4 об.1	49 498 900	98.98	0.06	9	19 798 000	19 338 590
УрСИ сер07	48 013 300	100.44	-0.06	4	50 250 000	0
ЦентрТел-4	47 687 050	100.11	0.02	7	0	121 497 200
ИтераФ-1	44 710 990	99.36	0.10	7	0	19 047 400
ВТБ-ЛизФ01	44 513 780	98.92	-0.02	14	273 831 700	40 976 350
ГЭС 01	43 278 140	88.44	16.24	9	57 572 500	0
Итого	3 742 447 000			1974	14 218 580 000	9 899 483 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
Сбербанк	11 876 070 000	27.82	2.48%	76 889	53 551 360	2 828 409 000
ГАЗПРОМ ао	10 404 140 000	150.27	-0.80%	63 473	85 373 070	9 713 870 000
ГМКНорНик	3 201 020 000	2778.15	3.14%	32 486	1 771 292	2 538 704 000
Роснефть	3 178 384 000	179.12	-0.12%	24 721	90 792 020	3 547 788 000
ЛУКОЙЛ	3 072 720 000	1516.34	-1.82%	35 442	87 065 460	2 268 871 000
Сбербанк-п	2 451 452 000	15.43	5.86%	35 480	30 245 750	627 463 600
ВТБ ао	966 699 300	0.0321	-0.63%	9 500	0	820 264 600
Сургнфгз	681 287 200	24.141	-2.29%	10 041	120 310	1 376 753 000
ФСК ЕЭС ао	604 083 500	0.218	4.98%	5 046	2 110 000	529 194 000
Итого	41 097 100 000			423 298	404 379 000	45 512 600 000

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.