

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ	1
ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК	2
АКЦИИ, US TREASURIES	3
Новости	4
ИТОГИ ТОРГОВ ЗА ДЕНЬ	5

Акции, Казначейские облигации (UST): На западном фронте без перемен

Ликвидные активы банков в ЦБ, млрд. руб.



Источник: ЦБ РФ, Банк Спурт

Индикаторы	Сегодня	Изменения	
		за день	за неделю
EUR/USD	1.2691	0.0123	0.00
Нефть Brent, IPE	44.13	1.12%	-5.12%
S&P 500	676.53	-0.88%	-10.14%
Libor(6M) (%)	1.92	0.08	0.12
MOSPRIME(3M) (%)	21.50	-0.50	-1.83
UST10 (%)	2.85	0.04	-0.14
RusGLB30	87.13	-0.38	-0.88
Доллар (ТОМ)	35.66	-0.29	0.05
Евро (ТОМ)	45.36	0.34	-0.19
Индекс РТС	576.39	3.09%	5.27%
Индекс ММВБ	688.87	2.52%	2.46%
ЗВР (млрд. долл)	384.30		2.40
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	3715.90		-25.30

ВАЛЮТНЫЙ И ДЕНЕЖНЫЙ РЫНКИ

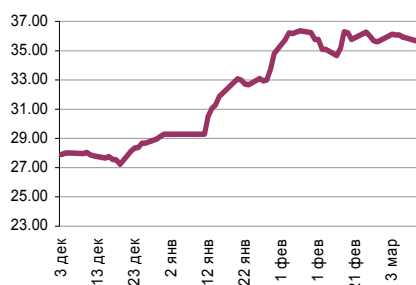
Денежный рынок:

На прошлой неделе банки частично погасили задолженность по операциям прямого РЕПО с Банком России, проводимого на аукционной основе.

Сумма остатков средств на корсчетах и депозитах снизилась на 43,2 млрд. рублей до 544,8 млрд. рублей.

Кредитные организации, однако, предъявили достаточно высокий спрос на деньги, размещаемые посредством беззалоговых аукционов. Всего на прошлой неделе Банк России предоставил 122,2 млрд. рублей из этого источника.

Курс рубль-доллар



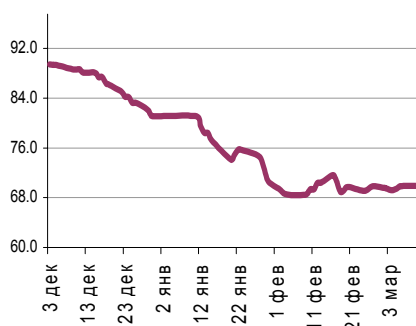
Источник: ММВБ, Банк Спурт

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



Источник: Банк Спурт

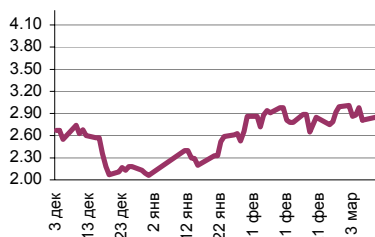
Индекс рубля к корзине валют (0,55 \$, 0,45 €)



Источник: Банк Спурт

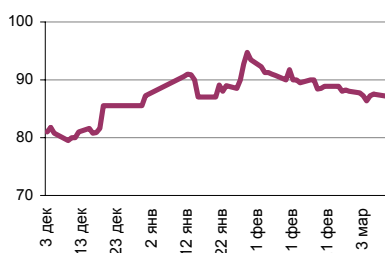
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

Ставка десятилетней ноты снизилась за неделю на 14 б.п., составив 2,85%. На этот раз «risk aversion» спровоцировал страховщик AIG, который понес колоссальные убытки в 4 квартале.

Опубликованные на прошлой неделе данные о числе увольнений в несельскохозяйственном секторе США, наоборот, не оказали сильного влияния на рынок. Цифры практически совпали с ожиданиями инвесторов - 651 тыс.

На предстоящей неделе запланировано размещение коротких Treasuries, совокупным объемом \$182 млрд. Мы более склоняемся к тому варианту, что размещения не окажут серьезного воздействия на длинный конец кривой UST. Спрос на защитные активы сейчас велик и абсорбирует предложение.

НОВОСТИ

Члены правительственной комиссии, контролирующей реструктуризацию автомобильной отрасли США, в понедельник впервые встретились с лидерами Объединенного профсоюза автомобильных рабочих в Детройте (UAW), куда они приехали, чтобы продолжить совместную работу с руководством General Motors Corp и Chrysler. Согласно сообщению администрации США, президент UAW Рон Геттельфингер встретился с представителями комиссии Стивеном Рэттнером и Роном Блумом. Детали неизвестны, однако эксперты ожидают от профсоюза существенных уступок во имя спасения автомобильных компаний GM и Chrysler, входящих в "большую детройтскую тройку". "Правительственная комиссия продолжает консультировать все заинтересованные компании...", - сообщили представитель администрации США. GM и Chrysler хотят, чтобы могущественный профсоюз пошел на уступки с зарплатой рабочим и медицинскими услугами. В понедельник рабочие, трудящиеся на условиях почасовой оплаты в компании Ford Motor Co, проголосовали за то, чтобы согласиться на подобные уступки.

Генеральным директором ТГК-4 стал представитель основного акционера компании - заместитель исполнительного директора группы Онэксим Евгений Абрамов, следует из сообщения компании. Ранее компанию возглавлял Геннадий Кочетков, который руководил ею и в момент ее продажи, оставаясь до сегодняшнего дня практически единственным гендиректором генерирующей компании, не лишившимся поста после прихода стратегического инвестора. ТГК-4 обслуживает регионы к югу от Москвы. Установленная тепловая мощность - 17.700 гигакалорий в час.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0419	0.04400	0.0391	0.0419	4 636 800 000
EURRUB_TOD	45.3344	45.29500	45.265	45.3375	72 871 000
EURRUB_TOM	45.3309	45.32250	45.2	45.36	108 585 000
USD_TODTOM	0.0316	0.03200	0.0285	0.0285	4 225 499 904
USDRUB_TOD	35.7011	36.60000	35.63	35.675	903 715 968
USDRUB_TOM	35.7191	35.75000	35.63	35.66	2 074 338 944

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
RU000A0JQ144	500 655 874	97.55	0.19	9.00	5	0
SU26198RMFS0	40 003 025	80.01	1.72	13.20	4	0
SU46003RMFS8	27 720 982	99.00	0.96	11.55	5	0
SU25060RMFS3	20 418 600	99.60	-0.07	8.73	4	0
SU27026RMFS2	134 998	100.00	0.08	6.21	1	0
SU25057RMFS9	970	97.00	-0.50	11.48	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
Итого	588 934 448				20	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
Мос.обл.6в	39 686 180	62.50	0.19	23	0	13 936 530
Мос.обл.8в	16 130 990	57.47	-0.29	30	0	170 158 000
Мос.обл.4в	6 670 920	98.04	-0.35	23	29 535 000	41 716 300
Томск.об-4	1 289 100	85.94	0.17	2	0	149 840 600
МГор46-об	600 932	99.00	-0.20	3	148 428 000	0
МГор45-об	86 218	78.38	-0.81	2	0	671 258 600
МГор44-об	49 600	62.00	-13.00	3	0	119 308 300
ВоронежОб4	950	95.00	0.00	1	0	140 167 900
ВолгогрОб3	0	0.00	0.00	0	0	119 256 000
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
0	0	0.00	0.00	0	0	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
Итого	80 518 230			175	177 964 000	1 948 209 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор59-об	441 632 200	95.22	0.00	67	0	16 237 550
САНОС-02об	321 281 300	92.97	-0.13	18	158 150 000	70 894 850
ГАЗПРОМ А4	136 209 800	97.27	-0.26	86	48 525 000	0
ЦентрТел-4	101 236 900	99.25	0.02	8	79 625 000	55 348 140
УралсибЛК2	70 497 820	76.48	0.67	16	68 850 000	18 104 100
ОГК-6 01об	56 106 000	90.49	0.04	4	52 374 000	0
СЗТелек5об	53 679 240	97.65	1.35	10	0	19 241 500
АИЖК 9об	42 380 000	65.20	7.04	1	16 300 000	5 015 020
ТГК-10 об1	27 665 590	97.76	-0.09	11	29 310 000	0
РосселхБ 3	26 882 100	95.33	0.08	4	0	128 150 000
Тюменэнрг2	24 853 090	88.82	0.57	6	62 075 000	34 991 100
ЕБРР 02обл	16 990 660	106.18	-0.73	8	106 125 000	0
ОГК-2 01об	12 932 310	84.75	0.18	8	0	66 757 600
Мечел 2об	12 246 760	80.62	0.11	14	0	153 653 100
НОМОС 7в	10 685 270	98.39	-0.11	18	29 475 000	23 495 880
ТатфондБ 3	7 989 186	97.97	-0.05	18	0	72 446 000
ТМК-03 обл	7 339 900	89.39	-0.02	5	0	75 422 880
ТрансКред3	3 858 662	96.25	0.75	11	48 074 040	0
АИЖК 10об	2 967 637	63.96	-0.04	4	24 945 470	27 149 000
СтрТрГаз03	2 713 775	97.62	0.25	9	0	268 863 200
ВТБ - 6 об	1 575 141	98.75	0.01	3	0	86 867 260
ТатфондБ 4	906 135	96.50	0.51	1	0	154 395 000
ФСК ЕЭС-05	969	96.93	0.27	1	0	187 782 100
АВТОВАЗ6о4	0	0.00	0.00	0	0	292 595 400
ВК-Инвест1	0	0.00	0.00	0	0	117 075 200
Итого	1 858 482 000			1439	1 153 488 000	3 387 611 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	6 331 909 000	112.59	-2.21%	57 391	555 164 200	8 808 571 000
Сбербанк	6 261 176 000	15.93	-4.66%	62 627	313 160 600	2 044 638 000
ЛУКОЙЛ	3 529 318 000	1160.45	-1.05%	43 910	39 767 750	1 381 030 000
Роснефть	2 283 583 000	126.98	-4.71%	28 015	882 641	1 725 123 000
Сургнфгз	2 146 335 000	22.541	0.07%	24 966	51 037	990 716 500
ГМКНорНик	2 071 586 000	1706.63	-3.74%	32 589	6 901 859	1 750 787 000
ВТБ ао	1 259 582 000	0.0216	0.00%	15 269	0	837 713 600
ПолюсЗолот	652 242 200	1174.65	2.54%	11 974	31 340 000	147 538 700
Сургнфгз-п	581 181 000	8.466	-1.65%	8 529	12 846 530	2 397 178 000
Итого	27 168 600 000			356 915	1 007 753 000	40 733 580 000

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.