

Ежедневный обзор финансовых рынков

ОГЛАВЛЕНИЕ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

КОРОТКО О ГЛАВНОМ

1

Акции, Казначейские облигации (UST)

События вчерашнего дня развивались в русле прежней тенденции «risk aversion».

Сегодня публикуются розничные продажи - важные данные, характеризующие потребительский спрос в США в декабре.

АКЦИИ, US TREASURIES

2

РУБЛЕВЫЕ ДОЛГИ

3

Облигации

На рынке без изменений. Активность остается низкой. Цены также тяготеют к снижению.

Сегодня основным событием может стать размещение облигационного займа Москвы 59.

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	1.3282	-0.0138	-0.08
Нефть Brent, IPE	42.91	-3.40%	17.21%
S&P 500	870.26	-2.26%	0.61%
Libor(6M) (%)	1.51	-0.09	-0.32
MOSPRIME(3M) (%)	21.67	0.00	-0.33
UST10 (%)	2.30	-0.10	0.12
RusGLB30	90.88	-0.13	5.38
Доллар (ТОМ)	31.05	0.52	2.37
Евро (ТОМ)	41.63	0.50	1.46
Индекс РТС	629.49	0.42%	-4.03%
Индекс ММВБ	653.28	2.81%	4.06%
ЗВР (млрд. долл)	438.20		-12.60
Денежная база узкое опр. (млрд. руб)	4283.10		89.50

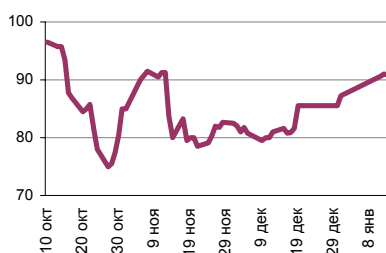
РЫНОК ВАЛЮТНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

UST10



Источник: Reuters

RUSGLB30



Источник: Reuters

Акции, Казначейские облигации (UST10)

События вчерашнего дня развивались в русле прежней тенденции «risk aversion». Скоро начнут публиковаться финансовые отчеты американских компаний за 3 квартал, от которых инвесторы не ждут ничего хорошего.

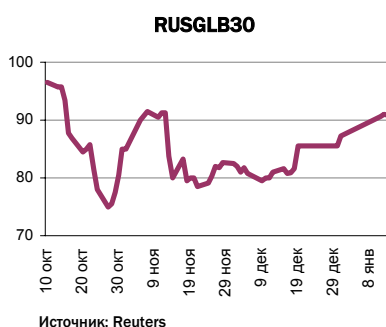
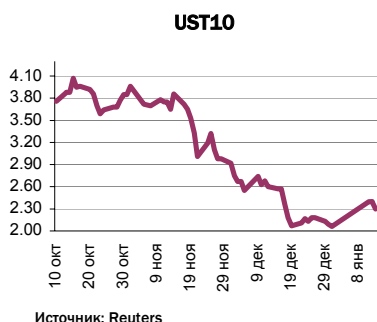
Вчера состоялись выступления советника нового президента США по экономическим вопросам, экс-главы ФРС Пола Волкера, а также действующего главы ФРС Бена Бернанке.

Речь Пола Волкера больше касалась вопросов качественного изменения финансовой системы. По его мнению, уроки кризиса должны вылиться в «новую финансовую архитектуру». Деталей он не назвал, но предположил, что изменения найдут отражение в американском законодательстве лишь в следующем году.

Бен Бернанке больше затрагивал «количественный» аспект проблемы. По мнению главы ФРС уже принятых мер достаточно, чтобы простимулировать экономику, однако необходимо продолжать рекапитализацию финансовых институтов.

Сегодня публикуются розничные продажи - важные данные, характеризующие потребительский спрос в США в декабре. Рынок ожидает падения розничных продаж на 1% по сравнению с предыдущим месяцем.

Рублевые долги



Основным событием на рынке рублевых долгов сегодня можно считать размещение облигационного займа Москвы 59. Эмитент позиционирует себя в качестве «ледокола». Срок обращения облигаций составляет чуть более года, ставка квартального купона – 10%. Ожидаемая доходность к погашению – 15%.

Сегодня в банковскую систему поступает около 200 млрд. рублей по ранее проведенным кредитными организациями беззалоговым аукционам с ЦБ, что может поддержать рынок. Банки хранят достаточно большой объем средств, взятых у ЦБ, на депозитах, теряя в разнице ставок, а займ Москвы мог бы стать одной из альтернатив размещения этих денег.

В то же время, определить справедливый уровень ставки по муниципальным рублевым долгам сейчас достаточно сложно. К тому же на рынке много более доходных альтернатив. Не исключено, что эмитенты затребуют большую премию «за объем» и «девальвацию». Что-ж, будет следить за итогами размещения.

В целом на рынке без изменений. Активность остается низкой. Цены также тяготеют к снижению.

НОВОСТИ

Министры финансов и главы центробанков стран "Большой семерки" проведут в Риме 13-14 февраля регулярное заседание, чтобы обсудить худший финансовый кризис за многие десятилетия. В этом году Италия вслед за Японией стала президентом "Большой восьмерки", в которую также входит Россия, и позже будет принимать у себя саммит лидеров государств. Дата встречи министров финансов и другие аспекты президентства Италии опубликованы на посвященном этому событию сайте www.g8italia2009.it. Великобритания в настоящий момент является президентом "Большой двадцатки", включающей Индию и Китай, и станет хозяйкой отдельного саммита в апреле.

Международный валютный фонд (МВФ) резко снизит прогноз мирового экономического роста на этот год, поскольку ситуация в экономике продолжает ухудшаться, сказал во вторник управляющий директор МВФ Доминик Стросс-Кан. "Через несколько дней мы опубликуем новые прогнозы, и они не будут оптимистичны", - сказал Стросс-Кан Рейтер во время визита в Будапешт. "Ситуация тяжелая во всей Восточной Европе", - добавил он, приведя в качестве примера Украину, Латвию, Белоруссию и Венгрию. Глава МВФ выразил озабоченность тем, что спад в мировой экономике усугубляется по сравнению с тем, что было несколько месяцев назад. В ноябре МВФ снизил прогноз мирового экономического роста на 2009 год на 0,8 процентных пункта до 2,2 процента и предсказал, что развитые экономики вступят в первую рецессию по итогам года со времен Второй мировой войны.

Citigroup Inc во вторник согласился объединить свою брокерскую компанию Smith Barney с подразделением по управлению активами Morgan Stanley's, и ожидается, что банк будет в дальнейшем продавать другие активы, чтобы увеличить капитал и отделить неликвидные активы. Совместное предприятие с Morgan Stanley станет крупнейшей в США брокерской компанией - Morgan Stanley Smith Barney, управляющей клиентским капиталом в размере \$1,7 триллиона. В ней будут работать более 20.000 брокеров, больше, чем в Bank of America Corp, который 1 января купил Merrill Lynch.

Источник: Рейтер

Итоги торгов за день

ЕТС

Инструмент	Ср-взв	Изм ср-взв	Open	Close	Объем торгов
EUR_TODTOM	0.0283	0.02750	0.015	0.015	4 529 299 968
EURRUB_TOD	41.5244	41.58000	41.445	41.5925	232 486 000
EURRUB_TOM	41.5871	41.60000	41.473	41.63	818 316 992
USD_TODTOM	0.0219	0.00750	0.0065	0.0075	5 982 099 968
USDRUB_TOD	31.0319	30.90000	30.9	31.0326	2 276 059 904
USDRUB_TOM	31.0517	31.00000	30.94	31.0525	10 260 432 896

ГЦБ

Инструмент	Оборот	Срвзв цена	Изм срвзв	Дох срвзв	Кол сделок	Доразмещ
SU25060RMFS3	53 295 430	99.10	-0.48	9.24	7	0
SU27026RMFS2	2 070 000	100.00	0.00	6.12	2	0
XS0114288789	1 301 626	87.00	3.00	9.99	10	0
SU26200RMFS4	93 000	93.00	0.50	8.20	1	0
SU46021RMFS0	983	98.30	11.49	6.41	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	56 761 039				21	

Региональные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
МГор45-об	319 369 800	78.06	-6.93	6	0	128 815 200
МГор47-об	25 743 920	99.28	-0.87	7	0	0
ЛипецкОблб	13 986 920	84.05	0.00	10	49 999 000	43 478 640
Мос.обл.8в	4 854 948	61.85	-5.54	11	0	177 425 000
Новсиб0-05	1 341 495	99.37	-0.53	1	78 502 300	0
Мос.обл.7в	959 787	46.52	-1.48	12	0	318 614 900
МГор44-об	1 600	80.00	-2.48	1	0	171 911 700
СамарОбл 5	630	63.01	3.10	1	0	114 707 200
ВоронежОб4	0	0.00	0.00	0	0	140 030 700
Мос.обл.6в	0	0.00	0.00	0	0	542 995 300
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	392 797 600			77	176 997 900	2 136 128 000

Корпоративные долги

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ЕБРР 02обл	55 977 240	103.03	-0.03	11	0	0
ТрансКред2	28 914 200	96.38	-1.11	6	32 708 000	138 055 800
ОГК-2 01об	13 436 290	76.64	-3.36	15	0	298 729 400
ТГК-10 об2	9 112 320	98.94	-0.06	11	3 952 000	74 599 040
Лукойл4обл	7 215 495	76.65	-7.35	7	0	50 895 050
ТехНикольФ	2 490 002	62.25	-0.29	4	0	60 322 600
ТГК-6Инв-1	1 276 235	97.57	-0.27	17	1 030 000 000	0
ДМЦЕНТРо61	808 701	47.15	0.60	10	72 799 630	45 665 240
Лукойл2обл	461 748	96.60	1.35	1	0	114 294 000
ЦентрТел-4	300 097	99.70	0.30	5	0	113 548 900
ВК-Инвест1	91 790	89.99	3.10	3	182 159 400	71 998 130
ГЭС 01	640	64.00	-16.00	1	0	113 698 600
АВТОВАЗ6о4	0	0.00	0.00	0	0	295 205 800
ВБД ПП 2об	0	0.00	0.00	0	19 838 100	117 721 300
ВТБ-ЛизФ01	0	0.00	0.00	0	0	685 027 600
ИтераФ-1	0	0.00	0.00	0	0	295 672 200
МБРР 03обл	0	0.00	0.00	0	0	328 653 200
НС-фин. 01	0	0.00	0.00	0	0	102 070 900
РМК-ФИН 01	0	0.00	0.00	0	435 000 000	0
СибТлк-8об	0	0.00	0.00	0	0	153 914 800
СтрТрГаз03	0	0.00	0.00	0	0	260 902 200
ТрансКред3	0	0.00	0.00	0	0	420 780 300
Тюменэнрг2	0	0.00	0.00	0	325 600 000	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
0	0	0.00	0.00	0	0	0
Итого	407 312 700			1251	2 254 691 000	5 362 781 000

Акции

Инструмент	Оборот осн	Ср-взвеш цена	Изм ср-взвеш	Кол сделок	Оборот РПС	Оборот РЕПО
ГАЗПРОМ ао	7 720 037 000	113.92	1.99%	70 550	38 451 480	6 289 820 000
ЛУКОЙЛ	2 048 452 000	1056.13	4.01%	29 029	37 978	1 106 607 000
Сбербанк	1 472 707 000	22.99	-0.83%	21 320	2 040 001	2 918 742 000
Роснефть	918 336 900	118.28	2.54%	13 538	0	1 058 597 000
Сургнфгз	750 994 400	15.819	-1.54%	12 916	141 453 500	694 385 300
ГМКНорНик	602 886 300	1943.55	-2.13%	16 952	22 955 500	2 153 379 000
ПолюсЗолот	470 788 900	811.6	4.27%	13 602	0	29 369 450
РусГидро	443 815 900	0.632	7.07%	6 749	0	439 862 700
Уркалий-ао	326 582 000	57.74	-0.41%	10 523	0	78 565 200
Итого	16 373 740 000			267 003	338 271 200	33 976 880 000

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.