

ВНЕШНИЕ РЫНКИ И ПРОГНОЗ НА ОТКРЫТИЕ

ТОВАРНЫЕ РЫНКИ: НЕФТЬ

Нефть торгуется практически без изменения к закрытию пятницы: по WTI снижение порядка 0,05 %

Спотовый рынок: США

Драйвером снижения американского рынка в пятницу выступили негативные статданные по числу новых рабочих мест в несельскохозяйственном секторе. Хотя предварительная оценка, рассчитываемая институтом ADP и публикуемая по вторникам в неделю опубликования официального показателя, традиционно оказалась максимально приближенной к фактической цифре официальной статистики (-254 тыс., в пятницу был обнаружен уровень -263), инвесторов все же застали врасплох. В итоге S&P 500 -0,45 %, DJIA -0,23 %, NASDAQ -0,46 %, при этом индексы начинали торговый день гораздо более существенным снижением

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК: КОРЗИНА

На сформировавшейся негативной динамике на западных фондовых площадках и в нефтяных фьючерсах бивалютная корзина продемонстрировала рост – закрытие прошло на цене 36,39 руб. (+0,15 руб. к уровню четверга)

СРОЧНЫЙ РЫНОК: ФЬЮЧЕРСЫ

Фьючерсы на американские индексы прибавляют в пределах 0,2 %

Спотовый рынок: Азия

Рынки Азии к открытию российского рынка в красной зоне, торги в Китае возобновятся лишь в пятницу

ОСНОВНЫЕ ИНДИКАТОРЫ, ЗАКРЫТИЕ

	Закр.	Изм., %
Россия		
MMBБ	1 175,83	-2,94
PTC	1 224,80	-3,32
США		
S&P 500	1 025,21	-0,45
DJIA	9 487,67	-0,23
NASDAQ Comp.	2 048,11	-0,46
Европа		
FTSE 100	4 988,70	-1,17
DAX	5 467,90	-1,56
CAC 40	3 649,90	-1,90
Азия		
Nikkei 225	9 684,09	-0,49
SSE Comp.* (на 30.09)	2 779,426	0,90
KOSPI	1 610,72	-2,06
Hang Seng *	20 340,08	-0,17
Капитализация		
MSCI Emerging Markets	901,39	-1,08
MSCI BRIC	297,88	-1,03
MSCI Russia	701,36	-3,14
ТОВАРНЫЕ РЫНКИ		
Нефть Brent	68,07	-1,62
Нефть WTI	69,95	-1,23
Золото	1 003,20	0,37
Серебро	16,42	-1,31
Алюминий	1 819,00	0,83
Медь	5 920,51	0,15
Никель	17 375,00	0,52
Цинк	1 851,80	-1,81
	Знач.	Изм., %
Курсы ЦБ		
EUR/RUR	43,8154	-0,02
USD/RUR	30,1240	0,21
	УТМ, %	Изм., б.п.
Долговой рынок		
UST 10	3,223	3,60
Россия 30	5,906	-3,00
Россия 30 / UST 10, б.п.	268,30	-6,60

* на 09.00 МСК, аналогично для графиков

ВАЖНЕЙШИЕ СОБЫТИЯ СЕГОДНЯ:

СТАТИСТИКА

- Еврозона: индекс деловой активности в промышл. за сентябрь окончат. (12.00 МСК)
- Еврозона: индекс деловой активности в сфере услуг за сентябрь окончат. (12.00 МСК)
- Великобрит.: индекс деловой активности в сфере услуг за сентябрь (12.30 МСК)
- Еврозона: розничные продажи за август (13.00 МСК)
- США: индекс деловой активности ISM в непроизв. сфере за сентябрь (18.00 МСК)

ПРОГНОЗ НА ОТКРЫТИЕ:

Полагаем, что у «быков» сегодня есть шанс удержать рынок на сложившихся уровнях, однако более вероятным развитием событий представляется углубление нисходящей коррекции. **Ожидания по отдельным рынкам – в соответствующих разделах**

ИНФОРМАЦИОННЫЙ ФОН ПРЕДЫДУЩЕГО ДНЯ

- **Экономика** – объем денежной базы в узком определении на 28 сентября составил 4 026,8 млрд. руб. против 4 055,4 млрд. руб. на 21 сентября, снижение на 28,6 млрд. руб.

Новости ИК БФА

Приглашаем к сотрудничеству агентов по привлечению клиентов.
 Подробная информация – по телефону (812) 329-81-74

ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ: РОССИЯ

РЫНОК АКЦИЙ

В пятницу российский рынок с открытия последовал за снизившимися накануне на 2-3% американскими индексами и торгующимися в красной зоне азиатскими площадками. Уже за первый час торгов индексы ММВБ и РТС потеряли порядка 2,5 %, после чего временно перешли в консолидацию, однако внешний фон ни давал никаких поводов для отскока, и после середины сессии снижение возобновилось, резко ускорившись после опубликованных в США неожиданно слабых данных по рынку труда. Впрочем, после того как индексы опустились к локальным минимумам двухнедельной давности и теряли по 4,5 – 5 % к предыдущему закрытию, «быкам» все-таки удалось организовать "контратаку", и в результате по итогам сессии потери основных индексов оказались более умеренными, индекс **ММВБ** потерял **-2,94 %** и составил 1 175,83 пункта, индекс **РТС** снизился на **-3,32 %**, до 1 224,80 пунктов.

Среди ликвидных бумаг аутсайдером в течение всей сессии оставались акции ГМК Норильский Никель (- 5,29 %), негативное влияние на котировки оказывало снижение цен на никель на LME. Акции банков в первой половине сессии также выглядели хуже рынка на фоне слабости финансового сектора на внешних рынках, однако в итоге именно акции ВТБ (+0,89 %) оказались единственной из «голубых фишек», завершившей сессию в плюсе. Во «втором эшелоне» в лидерах снижения – бумаги электроэнергетического сектора, желание инвесторов при ухудшении общерыночного фона зафиксировать прибыль в секторе после стремительного ралли в совокупности с низкой ликвидностью бумаг привело к снижению котировок ФСК ЕЭС на 5,37 %. МРСК в начале сессии теряли 6 – 12 %, и только к вечеру потери немного сократились, но все равно по отдельным бумагам достигли -9 %.

Ожидания на сегодня: отчет по рынку труда в США оказался значительно хуже ожиданий: число рабочих мест в сентябре снизилось на 263 тыс., в то время как прогнозировалась потеря всего 175 тыс. В то же время, после просадки в начале сессии американские индексы сумели вернуться на нейтральную территорию, динамика азиатских индексов сегодня преимущественно негативная, но снижение умеренное. Полагаем, что у «быков» сегодня есть шанс удержать рынок на сложившихся уровнях, однако более вероятным развитием событий представляется углубление нисходящей коррекции

Торговая сессия (время МСК):

ММВБ: 10.30 – 18.45

РТС (КЛАССИЧЕСКИЙ И БИРЖЕВОЙ РЫНКИ):
10.30 – 18.45

РТС (ФЬЮЧЕРСЫ И ОПЦИОНЫ):

10.30 – 18.45 – основная сессия
19.00 – 23.50 – вечерняя сессия

ЭКОНОМИЧЕСКИЙ КАЛЕНДАРЬ: ТЕКУЩАЯ НЕДЕЛЯ

ВРЕМЯ, МСК	РЕГИОН	СОБЫТИЕ	ЗА ПЕРИОД	ЕДИНИЦА ИЗМЕРЕНИЯ, БАЗА ДЛЯ СРАВНЕНИЯ	ФАКТ	ПРОГНОЗ*	ПРЕДЫДУЩЕЕ (ЗА ПЕРИОД)	ПЕРЕСМОТР
5 ОКТЯБРЯ (ПОНЕДЕЛЬНИК)								
12:00	Еврозона	Индекс деловой активности в промышленности окончат. (Euro-Zone Purchasing Manager Index Manufacturing, F)	сентябрь	пункты		50,6	50,6 (предварит.)	
12:00	Еврозона	Индекс деловой активности в сфере услуг окончат. (Euro-Zone Purchasing Manager Index Services, F)	сентябрь	пункты		50,9	50,8 (предварит.)	
12:30	Великобр.	Индекс деловой активности в сфере услуг (Purchasing Manager Index Services)	сентябрь	пункты		54,5	54,1 (август)	
13:00	Еврозона	Розничные продажи (Euro-Zone Retail Sales, MoM)	август	прирост к пред. месяцу, %		-0,5	-0,2 (июль)	
13:00	Еврозона	Розничные продажи (Euro-Zone Retail Sales, YoY)	август	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-2,4	-1,8 (июль)	
18:00	США	Индекс деловой активности ISM в непроизводственной сфере (ISM Non-Manufacturing Composite)	сентябрь	пункты		50,0	48,4 (предварит.)	
6 ОКТЯБРЯ (ВТОРНИК)								
7:30	Австралия	Решение Банка Австралии по процентной ставке (Reserve Bank of Australia Interest Rate Decision)	-	процентные пункты, %		3,00	3,00 (тек. уровень)	

ВРЕМЯ, МСК	РЕГИОН	СОБЫТИЕ	ЗА ПЕРИОД	ЕДИНИЦА ИЗМЕРЕНИЯ, БАЗА ДЛЯ СРАВНЕНИЯ	ФАКТ	ПРОГНОЗ*	ПРЕДЫДУЩЕЕ (ЗА ПЕРИОД)	ПЕРЕСМОТР
12:30	Великобр.	Промышленное производство (Industrial Production, MoM)	август	прирост к пред. месяцу, %		0,2	0,5 (июль)	
12:30	Великобр.	Промышленное производство (Industrial Production, YoY)	август	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-8,7	-9,3 (июль)	
7 ОКТЯБРЯ (СРЕДА)								
13:00	Евროзона	ВВП окончат. (Euro-Zone Gross Domestic Product, QoQ, F)	2 квартал	прирост к пред. кварталу, %		-0,1	-0,1 (пересмотр.)	
13:00	Евროзона	ВВП окончат. (Euro-Zone Gross Domestic Product, YoY, F)	2 квартал	прирост к соотв. кварталу пред. года, %		-4,7	-4,7 (пересмотр.)	
14:00	Германия	Заказы промышленных предприятий (German Factory Orders, MoM)	август	прирост к пред. месяцу, %		1,1	3,5 (июль)	
14:00	Германия	Заказы промышленных предприятий (German Factory Orders, YoY)	август	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-20,0	-19,8 (июль)	
18:30	США	Запасы нефти: абсолютное значение (EIA Crude Oil Stocks)	Неделя до 2 октября	млн. барр.		-	338,404 (неделя до 25 сентября)	
18:30	США	Запасы нефти: изменение за неделю (EIA Crude Oil Stocks, WoW)	Неделя до 25 сентября	млн. барр.		-	2,796 (неделя до 25 сентября)	
8 ОКТЯБРЯ (ЧЕТВЕРГ)								
14:00	Германия	Промышленное производство (German Industrial Production, MoM)	август	прирост к пред. месяцу, %		1,8	-0,9 (июль)	
14:00	Германия	Промышленное производство (German Industrial Production, YoY)	август	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-17,0	-17,0 (июль)	
15:00	Великобр.	Решение Банка Англии по процентной ставке (Bank of England Interest Rate Decision)	-	процентные пункты, %		0,50	0,50 (тек. уровень)	
15:45	Евросоюз	Решение ЕЦБ по процентной ставке (European Central Bank Interest Rate Decision)	-	процентные пункты, %		1,00	1,00 (тек. уровень)	
16:30	США	Количество первичных обращений за пособиями по безработице (первичная безработица) (Initial Jobless Claims)	Неделя до 3 октября	тыс. заявок		540	551 (неделя до 26 сентября)	
16:30	США	Количество последующих обращений за пособиями по безработице (длящаяся безработица) (Continuing Claims)	Неделя до 26 сентября	тыс. заявок		6133	6 090 (неделя до 19 сентября)	
18:00	США	Оптовые запасы (Wholesale Inventories, MoM)	август	прирост к пред. месяцу, %		-1,0	-1,4 (июль)	
9 ОКТЯБРЯ (ПЯТНИЦА)								
10:00	Германия	Торговый баланс (German Trade Balance)	август	млрд. евро		12,0	13,9 (июль)	
10:00	Германия	Индекс потребительских цен окончат. (German Consumer Price Index, MoM, F)	сентябрь	прирост к пред. месяцу, %		-0,4	-0,4 (предварит.)	
10:00	Германия	Индекс потребительских цен окончат. (German Consumer Price Index, YoY, F)	сентябрь	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-0,3	-0,3 (предварит.)	
12:30	Великобр.	Индекс цен производителей на факторы производства (Producer Price Index Input, MoM)	сентябрь	прирост к пред. месяцу, %		-0,8	2,2 (август)	
12:30	Великобр.	Индекс цен производителей на факторы производства (Producer Price Index Input, YoY)	сентябрь	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-6,8	-7,5 (август)	
12:30	Великобр.	Индекс цен производителей (Producer Price Index Output, MoM)	сентябрь	прирост к пред. месяцу, %		0,1	0,2 (август)	
12:30	Великобр.	Индекс цен производителей (Producer Price Index Output, YoY)	сентябрь	прирост к соотв. месяцу пред. года, %		-0,1	-0,4 (август)	
12:30	Великобр.	Торговый баланс (Total Trade Balance)	август	млрд. ф. ст.		-2,300	-2,447 (июль)	
12:30	Великобр.	Торговый баланс без учета услуг (Visible Trade Balance)	август	млрд. ф. ст.		-6,300	-6,479 (июль)	
18:00	США	Торговый баланс (Trade Balance)	август	млрд. долл.		-33,0	-32,0 (июль)	

* Прогнозные значения экономических показателей могут изменяться по мере приближения даты обнародования

КОНТАКТЫ

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство»
197198, Санкт-Петербург, Большой пр. ПС, д. 48-А
Тел.: +7 (812) 329-81-81
Факс: +7 (812) 329-81-80
info@bfa.ru
www.bfa.ru

Офисы:

- Петроградская наб., д. 34, лит. А, б/ц «Линкор»
- Средний пр. В.О., д. 48/27
- ул. Малая Конюшенная, д. 5

УПРАВЛЕНИЕ ПО РАБОТЕ С КЛИЕНТАМИ

client@bfa.ru

Константинова Виктория
начальник управления

+7 (812) 329-81-91
v.konstantinova@bfa.ru

Кукушкина Екатерина
начальник клиентского отдела

+7 (812) 329-81-96
e.kukushkina@bfa.ru

Щекина Елена
специалист клиентского отдела

+7 (812) 329-81-73
e.schekina@bfa.ru

Песчанская Ирина
специалист клиентского отдела

+7 (812) 329-81-71
i.peschanskaya@bfa.ru

ОТДЕЛ БРОКЕРСКИХ ОПЕРАЦИЙ

+7 (812) 329-81-99

Шевцов Павел
начальник отдела

+7 (812) 329-81-95
p.shevtsov@bfa.ru

Тураев Дмитрий
заместитель начальника отдела

d.turaev@bfa.ru

Мишарев Андрей
специалист

a.misharev@bfa.ru

АНАЛИТИЧЕСКИЙ ОТДЕЛ

analitik@bfa.ru

Дзугаев Роман
начальник отдела

r.dzugaev@bfa.ru

Моисеев Алексей
заместитель начальника отдела

a.moiseev@bfa.ru

Микрюкова Мария
ведущий аналитик

m.mikryukova@bfa.ru

ОТДЕЛ ДИЛИНГА

Моржаков Вадим
ведущий специалист по дилерской деятельности

v.morzhakov@bfa.ru

Пашков Алексей
управляющий портфелем

a.pashkov@bfa.ru

Настоящий аналитический отчет подготовлен аналитическим отделом ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и носит исключительно информационный характер. Все оценки и мнения, высказанные в отчете, представляют собой независимое суждение аналитиков на дату выхода отчета. Вознаграждение авторов отчета ни прямым, ни косвенным образом не увязано с представленными в отчете точками зрения. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» оставляет за собой право изменять высказанные оценки и мнения в любое время без предварительного уведомления.

Содержащиеся в отчете информация и выводы ни в коей мере не выступают рекомендацией, офертой или приглашением делать оферты на покупку или продажу инвестиционных инструментов, упомянутых в нем. Отчет не является рекомендацией в отношении инвестирования и не принимает во внимание инвестиционные цели, финансовые обстоятельства и специальные требования какого-либо конкретного лица, которое может выступить пользователем данного отчета. Информация предоставляется без каких-либо гарантий по состоянию на текущий момент времени и не может служить заменой частной консультации. Инвесторам необходимо принимать во внимание, что цена или стоимость инвестиционных инструментов может меняться. Соответственно, финансовый результат от инвестирования может оказаться меньше первоначально инвестированных средств. Результаты инвестирования в прошлом не гарантируют доходов в будущем.

Информация, содержащаяся в отчете, получена из источников, признаваемых нами достоверными, однако не существует никаких гарантий, что указанная информация является полной и точной и, соответственно, она не должна рассматриваться как полная и точная. Мы оставляем за собой право не обновлять информацию на основе новых данных либо полностью отказаться от ее освещения.

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и его сотрудники могут инвестировать, выступать маркет-мейкером или совершать иные сделки в качестве принципала с инвестиционными инструментами, упомянутыми в настоящем отчете. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» проводит внутреннюю политику, направленную на предотвращение потенциальных конфликтов интересов.

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и ее сотрудники не несут ответственности за прямой или косвенный ущерб, наступивший в результате использования настоящей публикации или ее содержания.

© Закрытое акционерное общество «Балтийское Финансовое Агентство»