

Индикаторы рынка акций

	Закр.	Изм.	Изм.	
		день, %	нед., %	
ММВБ	1528,11	2,32%	2,62%	
PTC	1604,86	3,09%	1,13%	
MSCI Russia	847,433	2,63%	0,74%	
MSCI EM	1106,23	0,45%	-1,86%	
S&P 500	1180,26	0,18%	0,55%	
VIX	19,27	-2,63%	-3,07%	
DJ Euro Stoxx 600	279,86	0,80%	0,14%	
FTSE 100	5757,86	0,50%	0,54%	
DAX 30	6611,01	1,33%	2,41%	
NIKKEI 225	9441,13	0,69%	-0,62%	
SSE Composite (на 09:00 MCK)	2977,45	-0,20%	0,21%	

	Закр.	Изм.	Изм.	
		день, б.п.	нед., б.п.	
UST 2 YTM, %	0,36	0,52	-3,09	
UST 10 YTM, %	2,55	6,66	4,00	
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,16	4,38	-0,37	
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	335,23	0,00	8,55	
Russia 30 YTM, %	4,15	0,60	14,00	
Russia 5Y CDS, б.п.	139,83	0,00	5,67	
Libor 3m USD, %	0,2884	0,00	-0,06	
Libor 12m USD, %	0,7654	-0,01	-0,11	
USD/RUB NDF 3m, %	2,99	-4,00	14,00	
USD/RUB NDF 12m, %	4,17	1,00	2,00	
RUB overnight, %	2,25	25,00	15,00	
Mosprime 3 m, %	3,74	0,00	0,00	

	Закр.	Изм.	Изм.	
		день, %	нед., %	
USD Index	77,63	0,28%	0,98%	
EUR/USD	1,3920	-0,32%	-1,12%	
USD/JPY	81,34	0,27%	-0,12%	
GBP/USD	1,5706	-0,88%	-1,88%	
AUD/USD	0,978	-0,87%	-1,64%	
USD/CAD	1,0264	0,50%	2,24%	
USD/CNY	6,6502	-0,02%	0,00%	
корзина (EUR+USD)/RUB	36,13	-0,27%	1,56%	
USD/RUB ЦБ	30,80	1,25%	2,22%	
EUR/RUB ЦБ	42,44	0,34%	0,94%	

	Закр.	Изм.	Изм.	
		день, %	нед., %	
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	80,56	-2,40%	-2,58%	
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	81,83	-2,12%	-3,19%	
нат. газ, USD/BTU (ICE)	3,368	-4,83%	-7,90%	
золото, USD/ун.	1324,5	-1,55%	-4,04%	
серебро, USD/ун.	23,110	-3,26%	-6,02%	
алюминий, USD/т. (LME)	2350	-0,51%	-2,61%	
медь, USD/т. (LME)	8307	-0,40%	-1,11%	
никель, USD/т. (LME)	23550	-1,65%	-3,11%	

Моисеев Алексей

+7 (812) 329 8181 (доб. 1286)

a.moiseev@bfa.ru

Микрюкова Мария

+7 (812) 329 8181 (доб. 1105)

m.mikryukova@bfa.ru Железняк Максим

+7 (812) 329 8181 (доб. 1154)

m.zheleznyak@bfa.ru

Прогноз

День начинается с локальной фиксации прибыли, однако в течение сессии рост может возобновиться. Пока внешние рынки ожидают итогов саммита G-20, индекс ММВБ попытается достигнуть апрельского максимума на отметке 1540 пунктов

Сегодня

- Встреча G20 в Кенджу (южная Корея)
- Статистика: публикации важных макроэкономических новостей не ожидается
- Корпоративная отчетность: публикации важных корпоративных отчетов также не ожидается

Зарубежные рынки

Американский фондовый рынок вчера немного прибавил на фоне выхода сильной корпоративной отчетности и хороших статданных. Открытие торгов проходило на крайне позитивном настрое: хорошая отчетность Ebay и McDonald's, а также данные о сокращении числа заявок на пособие по безработице (-23 тыс. вместо ожидавшихся -7 тыс. за неделю) и росте индекса опережающих индикаторов в сентябре +0,3 %) вызвали волну покупок, а индексы DJIA и S&P500 обновили локальные максимумы. Но вскоре на рынке начались продажи без особых видимых причин, по-видимому, технического характера, и на закрытие прирост индексов оказался достаточно скромным (DJIA +0,35 %, S&P500 +0,18 %, NASDAQ +0,09 %). Торги в Европе вчера также завершились в плюсе (FTSE100 +0,5 %, CAC40 +0,55 %, DAX +0,52 %).

С утра ситуация на рынках выглядит умеренно позитивной: в Азии, за исключением Китая (-0,2 %), преобладают покупки (индексы до +1 %) на фоне позитивного закрытия в США; цены на нефть, стремительно падавшие вчера на негативной китайской статистике (-2,5 %), развернулись вверх на позитивных данных из США и демонстрируют подъем уже почти на 1 %; фьючерсы на индексы США также смотрят вверх (+0,3 %).

В отсутствие выхода статданных и в преддверии заседания ФРС США ничего важного на американском рынке сегодня, скорее всего, не произойдет. Фондовые индексы США, вероятно, предпримут попытку к пробитию вчерашних максимумов, но без дополнительной поддержки она вряд ли завершится успехом

Российский рынок

В четверг, 21 октября, российский рынок получил мощный внутренний драйвер в виде озвученных накануне первым вице-премьером Шуваловым деталей предстоящей приватизации госактивов. Бумаги крупнейших компаний, попавших в список приватизируемых активов, росли на максимальных за последнее время оборотах во главе с акциями Сбербанка (обыкновенные +5,74 %, привилегированные +3,61 %), ВТБ +5,98 % и Роснефти (+4,37 %). Не попавшие в перечень, вопреки ожиданиям рынка, префы Транснефти, напротив, оказались аутсайдером дня (-5,62 %). За пределами «приватизационного списка» преобладала разнонаправленная динамика, исключением стала металлургия (ММК +3,33 %, Северсталь +2,99 %). Внеочередное собрание ГМК Норильский Никель (+1,34 %) не одобрило предложение о смене совета директоров.

Сегодня «приватизационная» тема может остаться драйвером для российского рынка, индекс ММВБ попытается дотянуться до апрельского максимума на отметке 1540 пунктов. Однако дальнейшие перспективы во многом будут зависеть от итогов саммита G-20, итогов которого ждут мировые рынки: если ослабление доллара остановится и на сырьевых площадках оформится разворот вниз, российский рынок не останется в стороне от коррекции

research@bfa.ru Стр. 2 из 4

25 окт 18:00

US

Источник: Reuters

Макроэкономическая статистика

wanp	intro-service transfer in the control of the contro							
Дата	Время	Страна	Показатель	Период	Факт	Прогноз	Пред.	Пересм.
21 окт	6:00	CN	ВВП г/г, % (GDP y/y)	3 кв.	9,6	9,5	10,3	
21 окт		FR	Индекс деловой активности в пром. предварит. (PMI Manufacturing A)	Окт	55,2	55,3	56,0	
21 окт	10:58	FR	Индекс деловой активности в сфере услуг предварит. (PMI Services A)	Окт	55,3	57,5	58,2	
21 окт		DE	Индекс деловой активности в пром. предварит. (PMI Manufacturing A)	Окт	56,1	54,6	55,1	
21 окт		DE	Индекс деловой активности в сфере услуг предварит. (PMI Services A)	Окт	56,6	54,8	54,9	
	11:58	EZ	Индекс деловой активности в пром. предварит. (PMI Manufacturing A)	Окт	54,1	53,2	53,7	
21 окт		EZ	Индекс деловой активности в сфере услуг предварит. (PMI Services A)	Окт	53,2	53,7	54,1	
21 окт		EZ	Индекс деловой активности композитн. предварит. (PMI Composite A)	Окт	53,4	53,6	54,1	
21 окт	12:30	GB	Роз. продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Сен	-0.2	0,4	-0,5	-0,7
	12:30	GB	Роз. продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Сен	0,5	1,0	0,4	0,8
21 окт	15:00	BR	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Сен	6,2	6,5	6,7	
21 окт	16:30	US	Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims)	до 19 окт.	452	455	462	475
21 окт	16:30	US	Длящаяся безработица, млн. (Continuing claims)	до 12 окт.	4,441	4,410	4,399	4,450
21 окт	18:00	US	Индекс опереж. индикаторов м/м, % (Leading indicators m/m)	Сен	0,3	0,3	0,3	0,1
21 окт		US	Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas)	до 18 окт.	93	89	91	
22 окт	12:00	DE	Индекс экон. ожиданий IFO (IFO expectations)	Окт		102,8	103,9	
22 окт	12:00	DE	Индекс делового климата IFO (IFO business climate)	Окт		106,5	106,8	
22 окт	12:00	DE	Индекс текущих условий IFO (IFO current conditions)	Окт		110,0	109,7	
22 окт	15:00	CA	Индекс потребит. цен м/м, % (CPI m/m)	Сен		0,1	-0,1	
22 окт	15:00	CA	Индекс потребит. цен г/г, % (СРІ у/у)	Сен		1,9	1,7	
22 окт	15:00	CA	Индекс потребит. цен базовый м/м, % (CPI core m/m)	Сен		0,3	0,1	
22 окт	15:00	CA	Индекс потребит. цен базовый г/г, % (CPI core y/y)	Сен		1,6	1,6	
22 окт	15:30	IN	Денежный агрегат M3 2 нед.г/ 2 нед.г, % (M3 money supply)			•	14,7	
22 окт	15:30	IN	Золотовалютн. резервы, \$ млрд. (Foreign reserves)	до 18 окт.			295,79	
22 окт	16:30	CA	Розничные продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Авг			-0,1	
22 окт	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI (ECRI U.S. Weekly Leading Index)	до 18 окт.			122,4	
22 окт	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI г/г, % (ECRI Weekly Leading Index y/y)	до 18 окт.			-6,9	
25 окт	3:50	JP	Торговый баланс, млрд. иен (Trade balance total)	Сен			103,2	
25 окт	3:50	JP	Объем экспорта г/г, % (Exports y/y)	Сен			15,8	
25 окт	3:50	JP	Объем импорта г/г, % (Imports y/y)	Сен			17,9	
25 окт	4:30	AU	Индекс цен производит. кв/кв, % (PPI q/q)	3 кв.		0,5	0,3	
25 окт	4:30	AU	Индекс цен производит. г/г, % (РРГу/у)	3 кв.		1,4	1,0	
25 окт	13:00	EZ	Заказы пром. предпр-ий м/м, % (Industrial new orders m/m)	Авг			-2,4	
25 окт	13:00	EZ	Заказы пром. предпр-ий г/г, % (Industrial new orders y/y)	Авг			11,2	
25 окт	16:30	BR	Счет текущих операций, \$ млрд. (Current account)	Сен			-2,9	
25 окт	18:00	US	Продажи на вторичном рынке жилья, млн. (Existing home sales)	Сен		4,30	4,13	

Сен

5,3

7,6

Продажи на вторичном рынке жилья м/м, % (Existing home sales m/m)

research@bfa.ru Стр. 3 из 4

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство»

197198, Санкт-Петербург, Большой пр. ПС, д. 48-А

Тел.: +7 (812) 329-8181 (основной)

Факс: +7 (812) 329-8180

info@bfa.ru www.bfa.ru

Офисы:

Петроградская наб., д. 36, лит. А, б/ц «Линкор» Средний пр. В.О., д. 48/27

Управление продаж

прямой +7 (812) 611 0064, доб. 1032 Тапинов Петр p.tapinov@bfa.ru старший специалист

Отдел рынков акций

прямой +7 (812) 329 8194, доб. 1075 Мун Михаил m.mun@bfa.ru начальник отдела прямой +7 (812) 611 0063, доб. 1010 Сергеев Владимир v.sergeev@bfa.ru старший трейдер

Отдел структурных продуктов

Малев Всеволод прямой +7 (812) 322 5899, доб. 1293 v.malev@bfa.ru начальник отдела прямой +7 (812) 329 8198, доб. 1168 Народовый Роман старший трейдер r.narodovyy@bfa.ru Пашков Алексей доб. 1147 a.pashkov@bfa.ru аналитик

Аналитический отдел	<u>research@bfa.ru</u>
Дзугаев Роман	доб. 1284
начальник отдела	<u>r.dzugaev@bfa.ru</u>
Моисеев Алексей	доб. 1286
заместитель начальника отдела	a.moiseev@bfa.ru
Микрюкова Мария	доб. 1105
ведущий аналитик	m.mikryukova@bfa.ru
Казанцев Сергей	доб. 1281
аналитик	s.kazantsev@bfa.ru
Железняк Максим	доб. 1105

прямой +7 (812) 329 8199 Отдел брокерских операций

информационно-техническая поддержка

специалист

прямой +7 (812) 329 8195, доб. 1195 Шевцов Павел p.shevtsov@bfa.ru начальник отдела Мишарев Андрей доб. 1199 a.misharev@bfa.ru

m.zheleznyak@bfa.ru

client@bfa.ru Управление по работе с клиентами

прямой +7 (812) 329 8191, доб. 1191 Константинова Виктория v.konstantinova@bfa.ru начальник управления прямой +7 (812) 329 8196, доб. 1196 Кукушкина Екатерина e.kukushkina@bfa.ru начальник клиентского отдела

Настоящий документ 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.

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 его сотрудники не несут ответственности за прямой или косвенный ущерб, наступивший в результате использования настоящей публикации или ее содержания.

© Закрытое акционерное общество «Балтийское Финансовое Агентство»