

| | Закр. | Изм. день, % | Изм. нед., % |
|------------------------------|---------|-----------------|-----------------|
| MMVB | 1524,83 | -0,22% | 2,30% |
| PTC | 1609,79 | -0,66% | 2,50% |
| MSCI Russia | 851,324 | -0,59% | 3,21% |
| MSCI EM | 1116,61 | 0,12% | 1,73% |
| S&P 500 | 1185,64 | 0,00% | 1,69% |
| VIX | 20,22 | 1,86% | -1,99% |
| DJ Euro Stoxx 600 | 276,46 | -0,98% | 1,21% |
| FTSE 100 | 5707,30 | -0,78% | 0,06% |
| DAX 30 | 6613,8 | -0,38% | 1,90% |
| NIKKEI 225 | 9366,22 | -0,12% | -0,16% |
| SSE Composite (на 09:00 МСК) | 3033,97 | -0,25% | 1,00% |

| | Закр. | Изм. день, б.п. | Изм. нед., б.п. |
|----------------------------------|--------|--------------------|--------------------|
| UST 2 YTM, % | 0,40 | 3,65 | 3,13 |
| UST 10 YTM, % | 2,64 | 7,55 | 16,51 |
| UST 10 - TIPS 10, б.п. | 2,28 | 11,01 | 19,43 |
| iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п. | 313,74 | 0,02 | -24,45 |
| Russia 30 YTM, % | 4,16 | -4,50 | 9,80 |
| Russia 5Y CDS, б.п. | 141,66 | 1,50 | 3,50 |
| Libor 3m USD, % | 0,2884 | 0,00 | -0,06 |
| Libor 12m USD, % | 0,7653 | 0,00 | -0,02 |
| USD/RUB NDF 3m, % | 3,03 | 1,00 | -1,00 |
| USD/RUB NDF 12m, % | 4,03 | -1,00 | -8,00 |
| RUB overnight, % | 2,25 | -51,00 | 5,00 |
| Mosprime 3m, % | 3,75 | 0,00 | 1,00 |

| | Закр. | Изм. день, % | Изм. нед., % |
|-----------------------|--------|-----------------|-----------------|
| USD Index | 77,91 | 0,79% | -0,65% |
| EUR/USD | 1,3859 | -0,74% | 0,92% |
| USD/JPY | 81,4 | 0,77% | -0,20% |
| GBP/USD | 1,5840 | 0,69% | 0,80% |
| AUD/USD | 0,9855 | -0,58% | 1,70% |
| USD/CAD | 1,0235 | 0,44% | -0,84% |
| USD/CNY | 6,6625 | 0,07% | 0,27% |
| корзина (EUR+USD)/RUB | 35,74 | 0,06% | -0,38% |
| USD/RUB ЦБ | 30,23 | -0,89% | -0,98% |
| EUR/RUB ЦБ | 42,50 | -0,09% | 0,33% |

| | Закр. | Изм. день, % | Изм. нед., % |
|------------------------------|--------|-----------------|-----------------|
| нефть WTI, USD/барр. (ICE) | 82,55 | 0,04% | 3,85% |
| нефть Brent, USD/барр. (ICE) | 83,66 | 0,14% | 3,16% |
| нат. газ, USD/BTU (ICE) | 3,354 | 1,12% | -4,53% |
| золото, USD/ун. | 1339,5 | 0,00% | 0,37% |
| серебро, USD/ун. | 23,800 | 0,85% | 2,06% |
| алюминий, USD/т. (LME) | 2390 | 0,72% | 1,46% |
| медь, USD/т. (LME) | 8510 | -0,09% | 3,03% |
| никель, USD/т. (LME) | 23300 | -1,17% | -0,75% |

Прогноз

Российский рынок продолжит умеренное снижение вслед за азиатскими индексами и сырьевыми площадками

Сегодня

- Статистика: денежный агрегат M3 в еврозоне, заказы на товары длительного пользования, продажи нового жилья и запасы нефти и нефтепродуктов в США
- Корпоративная отчетность: ConocoPhillips (3 кв. 2010 г.), Volkswagen (3 кв. 2010 г.)

Зарубежные рынки

Американский фондовый рынок завершил вчерашний день в незначительном плюсе (DJIA +0,05 %, S&P500 0 %, NASDAQ +0,26 %), несмотря на негативное начало торгов на фоне выхода слабого отчета US Steel и негативного прогноза по выручке от Texas Instruments. Особого влияния на рынок вчерашняя макроэкономическая статистика не оказала: публикация данных о хорошем индексе потребительского доверия (в сентябре 50,2 пункта против ожидавшихся 49,9 пункта) не смогла поддержать покупки на рынке в начале торгов. Настрой участников рынка переменялся на позитивный несколько позднее, когда вышло сообщение о buyback акций IBM и была опубликована позитивная отчетность Ford. Европейские инвесторы не успели отыграть небольшой вечерний подъем в США, и основные индексы Европы закрылись в минусе (FTSE100 - 0,78 %, CAC40 -0,45 %, DAX -0,38 %) на фоне выхода слабой отчетности UBS и ArcelorMittal.

С утра ситуация на рынках несколько ухудшилась: под влиянием падающего евро, а вслед за ним и цен на сырье (нефть -0,5 % с утра, в т.ч. и на ожиданиях увеличения запасов нефти в США; предварительные данные от API: +6,4 млн. баррелей по нефти) снижаются и азиатские индексы (до -0,5-1,5 %), и фьючерсы на американские индексы (-0,5 %).

Падение волатильности, которое наблюдается в последние дни на американском рынке, естественно в преддверии обнародования решения ФРС по монетарным стимулам. Вполне вероятно, что движение в боковом диапазоне на рынке продолжится вплоть до заседания ФЕДа, после завершения которого может произойти резкий выход из диапазона (1170-1190 пунктов по S&P500)

Российский рынок

На российском рынке накануне большую часть сессии преобладали коррекционные настроения, однако после открытия торгов в США часть потерь удалось отыграть, и итоговые потери оказались небольшими. Индекс ММВБ, в течение дня терявший более 0,7 %, к закрытию снизился на 0,22 %, до 1524,83 пунктов. Наибольшие потери понесли лидеры недавнего роста, акции Сбербанка (-0,86 % обыкновенные, -0,9 % привилегированные) и ВТБ (-1,82 %). Акции Роснефти резкий отскок в конце сессии позволил выйти на положительную территорию (+0,76 %).

Сегодня на фоне торгующихся в «минусе» азиатских площадок и находящихся под давлением из-за укрепления доллара commodities российский рынок снова будет снижаться, однако преобладать в ближайшие сессии, вероятно, будет боковая динамика в преддверии заседания ФРС

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

Макроэкономическая статистика

Источник: Reuters

| Дата | Время | Страна | Показатель | Период | Факт | Прогноз | Пред. | Пересм. |
|--------|-------|--------|--|------------|--------|---------|--------|---------|
| 26 окт | 10:00 | DE | Индекс потребит. доверия GfK (GfK consumer sentiment) | Ноя | 4,9 | 5,1 | 4,9 | |
| 26 окт | 10:00 | DE | Цены импорта м/м, % (Import prices m/m) | Сен | 0,3 | 0,1 | 0,2 | |
| 26 окт | 10:00 | DE | Цены импорта г/г, % (Import prices y/y) | Сен | 9,9 | 9,7 | 8,6 | |
| 26 окт | 12:30 | GB | ВВП предварит. кв/кв, % (GDP q/q A) | 3 кв. | 0,8 | 0,4 | 1,2 | |
| 26 окт | 12:30 | GB | ВВП предварит. г/г, % (GDP y/y A) | 3 кв. | 2,8 | 2,4 | 1,7 | |
| 26 окт | 15:45 | US | Розничные продажи сети ICSC нед/нед, % (ICSC chain store sales w/w) | до 24 окт. | 0,3 | | -0,7 | |
| 26 окт | 15:45 | US | Розничные продажи сети ICSC г/г, % (ICSC chain store sales y/y) | до 24 окт. | 1,9 | | 1,7 | |
| 26 окт | 16:55 | US | Redbook: розничные продажи м/м, % (Redbook m/m) | до 24 окт. | 0,3 | | 0,2 | |
| 26 окт | 16:55 | US | Redbook: розничные продажи г/г, % (Redbook y/y) | до 24 окт. | 2,8 | | 2,7 | |
| 26 окт | 17:00 | US | Индекс цен на жилье S&P/Case-Shiller 20 м/м, % (S&P/Case-Shiller 20 m/m) | Авг | -0,2 | 0,2 | 0,6 | |
| 26 окт | 18:00 | US | Индекс потреб. доверия (Consumer confidence) | Окт | 50,2 | 49,2 | 48,5 | 48,6 |
| 26 окт | 18:00 | US | Индекс цен на жилье м/м, % (FHFA home price m/m) | Авг | 0,4 | | -0,5 | -0,7 |
| 26 окт | 18:00 | US | Индекс цен на жилье г/г, % (FHFA home price y/y) | Авг | -2,4 | | -3,3 | |
| 27 окт | 0:30 | US | Запасы нефти API: нед/нед, млн. барр. (API weekly crude stocks) | до 23 окт. | 6,432 | 1,100 | 2,315 | |
| 27 окт | 0:30 | US | Запасы бензина API: нед/нед, млн. барр. (API weekly gasoline stocks) | до 23 окт. | -1.805 | 0,200 | -0,083 | |
| 27 окт | 0:30 | US | Запасы дистилл. API: нед/нед, млн. барр. (API weekly dist stocks) | до 23 окт. | 0,818 | -1,500 | -0,854 | |
| 27 окт | 4:30 | AU | Индекс потребит. цен кв/кв, % (CPI q/q) | 3 кв. | 0,7 | 0,9 | 0,6 | |
| 27 окт | 4:30 | AU | Индекс потребит. цен г/г, % (CPI y/y) | 3 кв. | 2,8 | 2,9 | 3,1 | |
| 27 окт | 10:45 | FR | Потреб. расходы м/м, % (Consumer spending m/m) | Сен | | 0,5 | -1,6 | |
| 27 окт | 12:00 | EZ | Денежный агрегат М3 г/г, % (M3 money supply y/y) | Сен | | 1,3 | 1,1 | |
| 27 окт | 16:30 | US | Заказы на товары длит. польз. м/м, % (Durable goods orders m/m) | Сен | | 2,0 | -1,5 | |
| 27 окт | 16:30 | US | Заказы на тов. длит. польз. без. трансп. м/м, % (Durable goods extrasp) | Сен | | 0,5 | 1,7 | |
| 27 окт | 18:00 | US | Продажи нового жилья, млн. (New home sales) | Сен | | 0,300 | 0,288 | |
| 27 окт | 18:00 | US | Продажи нового жилья м/м, % (New home sales m/m) | Сен | | | | |
| 27 окт | 18:30 | US | Запасы нефти: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude stocks) | до 23 окт. | | 1,100 | 0,700 | |
| 27 окт | 18:30 | US | Запасы бензина: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly gasoline stocks) | до 23 окт. | | 0,200 | 1,200 | |
| 27 окт | 18:30 | US | Запасы дистилл.: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly dist stocks) | до 23 окт. | | -1,500 | -2,200 | |
| 27 окт | 18:30 | US | Запасы нефти в Кушинге: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude Cushing) | до 23 окт. | | | -1,051 | |
| 27 окт | - | DE | Индекс потребит. цен предварит. м/м, % (CPI m/m P) | Окт | | 0,1 | -0,1 | |
| 27 окт | - | DE | Индекс потребит. цен предварит. г/г, % (CPI y/y P) | Окт | | 1,3 | 1,3 | |
| 28 окт | 3:50 | JP | Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y) | Сен | | 3,0 | 4,3 | |
| 28 окт | 10:00 | GB | Индекс цен на жилье Nationwide м/м, % (Nationwide house price m/m) | Окт | | -0,4 | 0,1 | |
| 28 окт | 10:00 | GB | Индекс цен на жилье Nationwide г/г, % (Nationwide house price y/y) | Окт | | 2,3 | 3,1 | |
| 28 окт | 10:45 | FR | Индекс цен производит. м/м, % (Producer prices m/m) | Сен | | 0,2 | 0,1 | |
| 28 окт | 12:00 | DE | Уровень безработицы, % (Unemployment rate) | Окт | | 7,4 | 7,5 | |
| 28 окт | 12:00 | DE | Число безработных м/м, тыс. (Unemployment change m/m) | Окт | | -30,0 | -40,0 | |
| 28 окт | 13:00 | EZ | Индекс экон. ожиданий (Economic Sentiment) | Окт | | 103,2 | 103,2 | |
| 28 окт | 16:30 | US | Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims) | до 24 окт. | | 453 | 452 | |
| 28 окт | 16:30 | US | Длющаяся безработица, млн. (Continuing claims) | до 17 окт. | | 4,400 | 4,441 | |
| 28 окт | 18:30 | US | Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas) | до 23 окт. | | | 93 | |
| 28 окт | - | JP | Ставка Банка Японии (BoJP rate decision) | - | | | 0,10 | |

