

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1594,72	1,69%	3,74%
PTC	1659,45	1,91%	3,45%
MSCI Russia	882,411	1,88%	3,78%
MSCI EM	1154,62	0,04%	2,71%
S&P 500	1213,4	-0,81%	1,66%
VIX	19,08	4,32%	-11,54%
DJ Euro Stoxx 600	284,14	0,66%	1,41%
FTSE 100	5875,19	0,43%	2,05%
DAX 30	6787,81	0,55%	2,01%
NIKKEI 225	9830,52	1,40%	7,32%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	3099,54	-1,13%	2,26%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,45	4,60	9,67
UST 10 YTM, %	2,66	10,72	6,88
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,18	0,74	-1,25
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	300,46	-5,92	-10,99
Russia 30 YTM, %	4,04	-0,10	-8,60
Russia 5Y CDS, б.п.	136,00	0,34	-6,33
Libor 3m USD, %	0,2856	0,00	-0,03
Libor 12m USD, %	0,7588	0,32	-0,16
USD/RUB NDF 3m, %	3,21	-7,00	6,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,32	5,00	15,00
RUB overnight, %	2,26	1,00	-24,00
Mosprime 3m, %	3,75	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	77,58	0,54%	0,90%
EUR/USD	1,3777	-1,03%	-1,85%
USD/JPY	81,77	0,76%	1,43%
GBP/USD	1,5985	-0,95%	-0,36%
AUD/USD	1,0031	-0,98%	0,36%
USD/CAD	1,0071	0,37%	-0,11%
USD/CNY	6,6424	-0,55%	-0,53%
корзина (EUR+USD)/RUB	36,03	-0,63%	-0,90%
USD/RUB ЦБ	30,80	0,10%	0,09%
EUR/RUB ЦБ	42,99	-0,42%	0,00%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	86,72	-0,39%	3,36%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	88,33	-0,15%	3,42%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,21	2,98%	8,79%
золото, USD/ун.	1389,7	-1,37%	2,41%
серебро, USD/ун.	26,840	-3,00%	7,75%
алюминий, USD/т. (LME)	2469	1,60%	1,60%
медь, USD/т. (LME)	8858	2,29%	5,01%
никель, USD/т. (LME)	24620	2,05%	4,88%

Прогноз

Сегодня ожидаем снижения котировок на российском рынке, по итогам дня индексы могут потерять 1 – 1,5 %

Сегодня

- Статистика: первичная и длящаяся безработица, торговый баланс и запасы нефти и нефтепродуктов в США

Зарубежные рынки

Отрицательная коррекция на американском фондовом рынке вчера продолжилась: фондовые индексы по итогам сессии просели более чем на 0,5 % (DJIA -0,53 %, S&P500 -0,81 %, NASDAQ -0,66 %). Причиной продаж стало не только желание не успевших накануне участников рынка снять прибыль, заработанную в предыдущие дни, но и плохое размещение 10-летних US treasuries. Торги в Европе вчера завершились повышением (FTSE100 +0,43 %, CAC40 +0,82 %, DAX +0,55 %), поскольку инвесторы не успели отыграть ни вечернее падение в США, ни вечерний откат по евро (на 2 фигуры вниз), вызванных усилением роста CDS по облигация проблемных стран еврозоны.

С утра внешний фон неоднозначный. Цены на нефть, просевшие вчера вечером под давлением со стороны валютного рынка, ночью отыграли часть потерь на фоне выхода предварительных данных по запасам нефти от API (-7,4 млн. баррелей по нефти, -3,4 млн. баррелей по бензину и -4 млн. баррелей по дистиллятам), но с утра вновь демонстрируют снижение (до -0,1 %) на фоне негативных новостей из Китая (ЦБ Китая поднимает с 15 ноября нормы резервирования для ведущих банков на 50 б.п.; импорт нефти в Китай в октябре упал в октябре до 16,1 млн. т. – минимум за 18 месяцев). В минусе на этих новостях падает и сам китайский фондовый рынок (-1 %). Остальные азиатские рынки демонстрируют смешанную динамику (от -1 % до +1 %). Фьючерсы на индексы США с утра немного подрастают (+0,2 %).

Пока ситуация, сложившаяся на американском рынке напоминает май этого года, когда после обновления исторических максимумов, рынок развернулся вниз. Пока констатировать разворот рано. И кроме того, не стоит забывать, что в среднесрочной перспективе монетарная поддержка для рынка со стороны ФРС все же будет существовать. Поэтому мы сохраняем умеренно-позитивный взгляд по американскому рынку на среднесрочную перспективу, и умеренно-негативный – на краткосрочную. Сегодня динамику на рынке будет определять публикация целого блока важной макростатистики, и, прежде всего, данных по рынку труда

Российский рынок

Во вторник, 9 ноября, российский рынок после недолгой заминки на старте сессии продолжил обновлять двухлетние максимумы. Безоговорочным лидером роста оставался металлургический сектор: на фоне взлета котировок драгоценных и базовых металлов акции сектора прибавили 2,6 – 5,7 %, лидерами стали НЛМК (+5,68 %) и Полиметалл (+5,16 %). Среди «голубых фишек» в течение сессии опережающий рост демонстрировали акции Газпрома (+1,09 %) и ВТБ (+0,84 %), но в конце дня их опередили акции Лукойла (+1,58 %). Индекс ММВБ во второй половине дня вплотную приблизился к 1600 пунктам, на закрытие он составил 1594,72 пункта (+1,69 %) вернувшись, таким образом, на уровни июля 2008 года.

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

Ралли на сырьевых рынках вечером обернулось резкой коррекцией драгоценных металлов и очередным откатом нефти от уровня весенних максимумов на фоне продолжившегося укрепления доллара на валютном рынке. Впрочем, фондовые рынки отреагировали на это довольно спокойно, основные американские индексы потеряли в пределах 0,7 %, а в Азии сегодня динамика разнонаправленная. Российский рынок на этом фоне также начинает день на отрицательной территории, предполагаем, что по итогам дня индексы могут потерять 1 – 1,5 %

