

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1556,43	-1,16%	1,06%
PTC	1629,37	-0,47%	1,67%
MSCI Russia	861,883	-0,70%	0,76%
MSCI EM	1138,84	-0,79%	-1,06%
S&P 500	1213,54	-0,42%	-0,62%
VIX	18,64	0,92%	0,65%
DJ Euro Stoxx 600	277,06	-0,24%	-3,70%
FTSE 100	5815,23	-0,03%	-0,81%
DAX 30	6723,41	0,05%	-0,17%
NIKKEI 225	9724,81	-1,39%	1,03%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	3043,69	-3,31%	-2,74%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,43	0,00	9,14
UST 10 YTM, %	2,65	0,00	16,22
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,21	0,00	10,79
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	333,95	4,91	37,32
Russia 30 YTM, %	4,25	0,00	22,20
Russia 5Y CDS, б.п.	146,20	3,54	15,87
Libor 3m USD, %	0,2856	0,00	0,00
Libor 12m USD, %	0,7591	0,00	0,31
USD/RUB NDF 3m, %	3,21	5,00	-6,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,20	15,00	-8,00
RUB overnight, %	2,55	15,00	30,00
Mosprime 3m, %	3,75	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	78,36	0,75%	3,10%
EUR/USD	1,3663	-0,86%	-3,77%
USD/JPY	82,49	0,24%	2,21%
GBP/USD	1,6116	-0,04%	-0,90%
AUD/USD	0,9977	-0,81%	-1,62%
USD/CAD	1,0027	0,27%	0,04%
USD/CNY	6,6240	-0,14%	-0,55%
корзина (EUR+USD)/RUB	35,68	-0,50%	-1,79%
USD/RUB ЦБ	30,69	-0,55%	-0,25%
EUR/RUB ЦБ	42,30	-1,12%	-2,00%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	87,81	0,00%	1,53%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	88,81	-0,17%	0,92%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	3,927	-2,94%	1,84%
золото, USD/ун.	1408,9	0,40%	1,20%
серебро, USD/ун.	27,690	1,76%	5,17%
алюминий, USD/т. (LME)	2457	0,37%	-0,04%
медь, USD/т. (LME)	8830	0,80%	2,69%
никель, USD/т. (LME)	24000	-0,64%	-2,04%

Прогноз

Если индекс ММВБ не удержится выше трендовой линии сентября-октября в районе 1540 пунктов, целью на ближайшие несколько сессий может стать отметка 1500 пунктов

Сегодня

- Продолжение саммита G20 в Южной Корее
- Статистика: индекс потребительского доверия Мичиганского университета предварительный, индекс цен на жилье в США

Зарубежные рынки

Коррекция на американском рынке вчера продолжилась, хоть и с вечерним отскоком вверх (DJIA -0,65 %, S&P500 -0,42 %, NASDAQ -0,9 %). Инвесторы продолжили распродавать акции на фоне усиления опасений по Ирландии, а также на фоне выхода ряда неблагоприятных корпоративных новостей (слабый прогноз от Cisco, плохой отчет Walt Disney). В Европе продажи были более скромными (FTSE100 -0,03 %, CAC40 -0,54 %, DAX +0,05 %), поскольку сообщения о том, что большинство инвесторов ждут усиления долговых проблем в Ирландии и необходимости привлечения страной дополнительных средств в МВФ появились уже поздно вечером.

С утра внешний фон совсем испортился: заявления G20 об обеспокоенности ситуацией в Ирландии (сегодня должно будет опубликовано заявление Германии, Франции и Великобритании по этой проблеме) и дисбалансами во внешней торговле и на валютном рынке, падение курса евро, резкий рост опасений скорого повышения ставок в Китае толкают вниз котировки на большинстве рынков. Цены на нефть с утра потеряли уже по 1,5-2 % - основное влияние здесь оказывает китайский фактор. Фьючерсы на американские индексы падают уже более чем на 1 %. А в Азии вообще наблюдается сильнейший откат китайского индекса (-5 % в моменте) и существенная просадка по индексам других стран (до 1-1,5 %).

Если в ближайшее время продолжится игра против евро на фоне роста опасений повторения истории с Грецией, в которой главной участницей теперь станет Ирландия, а это очень вероятно, и китайский рынок продолжит падать на ожиданиях введения очередных ужесточений в экономике страны, что тоже вполне возможно, то коррекция на фондовых, и особенно сырьевых рынках может усилиться. По индексу S&P500 ближайшая цель – в районе 1195-1190 пунктов (линия краткосрочного растущего тренда), по нефти марки WTI – 84 долл. за баррель

Российский рынок

В четверг, 11 ноября, российский рынок акций с утра попытался развернуться наверх, однако еще до полудня это движение выдохлось вместе с питавшей его очередной попыткой цен на нефть подняться к 90 долл. за баррель. С середины дня вектор движения был устойчиво направлен вниз, совпадая с продолжающейся коррекцией на внешних рынках, и к закрытию индекс ММВБ потерял 1,16 % (1556,43 пунктов). Аутсайдером дня стали акции Ростелекома (обыкновенные -2,68 %, привилегированные -7,28 %) после того как стало известно, что внеочередное общее собрание акционеров не поддержало внесение в устав компании поправок, которые должны были поднять дивидендную доходность префов. Существенно лучше рынка

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

выглядели префы Транснефти (+6,83 %), включенные агентством MSCI Barra в базу расчета индекса MSCI Russia.

Внешний фон сегодня сугубо негативен. Проблемы Еврозоны, несколько месяцев пребывавшие в забвении, но никуда от этого не девшиеся, снова находятся в фокусе внимания, что чревато сменой недавних трендов на валютном рынке. Добавляют масла в огонь ожидания новых шагов по ужесточению денежно кредитной политики в Китае. На этом фоне индекс ММВБ начал день «гэпом» вниз, открывшись вблизи трендовой линии сентября-октября, находящейся в районе 1540 пунктов. Если удержаться на этом уровне индексу не удастся, целью на ближайшие несколько сессий может стать отметка 1500 пунктов

Макроэкономическая статистика

Источник: Reuters

Дата	Время	Страна	Показатель	Период	Факт	Прогноз	Пред.	Пересм.
11 ноя		CA	Remembrance Day					
11 ноя		US	Veterans' Day					
11 ноя	2:50	JP	Индекс цен на корп. товары (оптовые цены) м/м, % (Corp goods price m/m)	Окт	0,2	-0,2		
11 ноя	2:50	JP	Индекс цен на корп. товары (оптовые цены) г/г, % (Corp goods price y/y)	Окт	0,9	0,5	-0,1	
11 ноя	3:30	AU	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Окт	5,4	5,0	5,1	5,1
11 ноя	3:30	AU	Число занятых м/м, тыс. (Employment change m/m)	Окт	29 700	20 000	49 500	
11 ноя	5:00	CN	Пром. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Окт	13,1	13,5	13,3	
11 ноя	5:00	CN	Индекс цен производит. г/г, % (PPI y/y)	Окт	5,0	4,6	4,3	
11 ноя	5:00	CN	Индекс потребит. цен г/г, % (CPI y/y)	Окт	4,4	4,0	3,6	
11 ноя	5:00	CN	Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Окт	18,6	18,7	18,8	
11 ноя	-	CN	Денежный агрегат М2 г/г, % (M2 money supply y/y)	Окт	19,3	19,1	19,0	
11 ноя	-	RU	Международн. резервы, \$ млрд. (Central Bank reserves)	до 08 ноя.	499,2		495,6	
12 ноя	8:30	IN	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Сен	4,4	7,0	5,6	
12 ноя	9:30	FR	ВВП предварит. кв/кв, % (GDP q/q P)	3 кв.		0,5	0,7	
12 ноя	10:00	DE	ВВП предварит. кв/кв, % (GDP q/q P)	3 кв.		0,7	2,2	
12 ноя	10:00	DE	ВВП предварит. г/г, % (GDP y/y P)	3 кв.		3,7	4,1	
12 ноя	13:00	EZ	ВВП предварит. кв/кв, % (GDP q/q P)	3 кв.		0,4	1,0	
12 ноя	13:00	EZ	ВВП предварит. г/г, % (GDP y/y P)	3 кв.		1,9	1,9	
12 ноя	13:00	EZ	Промышл. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Сен		0,3	1,0	
12 ноя	13:00	EZ	Промышл. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Сен		7,1	7,9	
12 ноя	14:00	BR	Розничные продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Сен		0,2	2,0	
12 ноя	14:30	IN	Золотовалютн. резервы, \$ млрд. (Foreign reserves)	до 08 ноя.			297,96	
12 ноя	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. предв. (U. of Michigan Conf, A)	Ноя		69,0	67,7	
12 ноя	17:55	US	Индекс цен на жилье м/м, % (FHFA home price m/m)	Ноя		69,0	67,7	
12 ноя	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI (ECRI U.S. Weekly Leading Index)	до 08 ноя.			123,2	
12 ноя	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI г/г, % (ECRI Weekly Leading Index y/y)	до 08 ноя.			-6,5	
15 ноя	2:50	JP	ВВП предварит. кв/кв, % (GDP q/q P)	3 кв.		0,6	0,4	
15 ноя	2:50	JP	ВВП предварит. г/г, % (GDP y/y P)	3 кв.		2,5	1,5	
15 ноя	7:30	JP	Загрузка произв. мощностей м/м, % (Capacity utilization m/m)	Сен			-0,9	
15 ноя	7:30	JP	Пром. производство окончат. м/м, % (Industrial production m/m F)	Сен			-0,5	
15 ноя	10:45	FR	Счет текущих операций, млрд. евро (Current account)	Сен			-4,0	
15 ноя	13:00	EZ	Торговый баланс, млрд. евро (Trade balance)	Сен			-4,3	
15 ноя	16:30	US	Индекс произв. активности в Нью-Йорке (New York Fed Manufacturing)	Ноя		15,00	15,73	
15 ноя	16:30	US	Розничные продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Окт		0,6	0,6	
15 ноя	16:30	US	Розничные продажи без автомобилей м/м, % (Retail sales ex autos m/m)	Окт		0,4	0,4	
15 ноя	18:00	US	Произв. запасы м/м, % (Business Inventories m/m)	Сен		0,6	0,6	

