

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1561,97	1,63%	1,83%
PTC	1600,50	1,72%	1,90%
MSCI Russia	843,055	1,96%	1,99%
MSCI EM	1096,72	0,62%	0,26%
S&P 500	1198,35	1,49%	1,68%
VIX	19,56	-5,19%	-10,11%
DJ Euro Stoxx 600	266,36	0,71%	-1,47%
FTSE 100	5657,10	1,36%	-0,62%
DAX 30	6823,8	1,77%	1,85%
NIKKEI 225	10079,76	0,50%	2,73%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2889,51	1,03%	0,84%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,55	8,55	5,17
UST 10 YTM, %	2,91	13,84	3,23
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,24	4,66	7,11
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	353,98	0,00	14,95
Russia 30 YTM, %	4,60	-0,80	13,30
Russia 5Y CDS, б.п.	154,00	0,00	5,34
Libor 3m USD, %	0,2875	0,31	0,31
Libor 12m USD, %	0,7665	0,34	0,40
USD/RUB NDF 3m, %	3,52	7,00	19,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,45	-1,00	13,00
RUB overnight, %	2	0,00	-10,00
Mosprime 3m, %	3,75	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	79,94	0,22%	0,92%
EUR/USD	1,3329	-0,31%	-1,40%
USD/JPY	83,55	0,47%	0,37%
GBP/USD	1,5777	-0,01%	-0,74%
AUD/USD	0,9822	1,00%	0,40%
USD/CAD	1,0107	-1,20%	-1,41%
USD/CNY	6,6529	0,14%	0,17%
корзина (EUR+USD)/RUB	36,08	-0,33%	-0,64%
USD/RUB ЦБ	31,26	0,87%	0,67%
EUR/RUB ЦБ	42,40	-0,55%	0,44%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	83,86	3,21%	4,25%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	85,84	3,11%	3,07%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,267	0,07%	5,88%
золото, USD/ун.	1374,5	-0,17%	2,82%
серебро, USD/ун.	27,580	0,25%	7,73%
алюминий, USD/т. (LME)	2259	0,18%	-0,73%
медь, USD/т. (LME)	8250	1,35%	0,73%
никель, USD/т. (LME)	22500	4,17%	4,41%

Прогноз

В условиях отсутствия торгов в США, отмечающих сегодня День Благодарения, от российского рынка акций ожидаем продолжения вчерашней позитивной динамики и пониженной активности

Сегодня

- Выходной в США: празднование Дня Благодарения
- Статистика: публикации важных макроэкономических новостей не ожидается

Зарубежные рынки

Американский фондовый рынок вчера с легкостью отыграл падение предыдущего дня (DJIA +1,37 %, S&P500 +1,49 %, NASDAQ +1,93 %) и вернулся в район 1200 пунктов по S&P500. Публикация позитивных статданных по безработице (число заявок на пособие по безработице снизилось за неделю на 34 тыс. до 407 тыс. – минимума с июля 2008 г.) и потребительскому доверию (соответствующий индекс вырос в ноябре до 71,6 пункта против ожидавшегося увеличения до 69,5 пункта), а также продолжающийся спад опасений по Ирландии вызвали вчера активизацию «быков» на рынке. В Европе торги также завершились в хорошем плюсе (FTSE100 +1,36 %, CAC40 +0,62 %, DAX +1,77 %) на ожиданиях скорого получения Ирландией помощи от ЕС в связи с обнародованием плана сокращения бюджетного дефицита Ирландии (на 15 млрд. евро к 2014 г.).

С утра внешний фон также носит позитивный характер: цены на нефть за вчерашний день взлетели вверх более чем на 3 % (на хорошей статистике по экономике США и данных о росте импорта нефти и спроса на дистилляты в США за неделю), даже, несмотря на публикацию данных об увеличении запасов нефти и бензина в США (+1 и +2 млн. баррелей соответственно); азиатские индексы с утра подрастают в пределах +1 % на позитиве из США. Сегодняшний день вряд ли принесет какие-либо сюрпризы инвесторам. В отсутствие торгов в США активность на остальных фондовых площадках будет вялой. Но если сегодня не появятся какие-либо негативные новости по Европе или Китаю, то рынки, вероятно, продолжат подрастать

Российский рынок

В среду внешние рынки взяли передышку после падения накануне. Начиная с азиатской сессии фондовые индексы находились преимущественно на положительной территории, а во второй половине дня важным позитивным драйвером стала неожиданно сильная статистика по рынку труда США. На этом фоне индекс ММВБ, с утра протестировав минимумы предыдущей сессии, уже после полудня уверенно развернулся вверх, и в итоге прибавил 1,63 % (1561,97 пунктов на закрытие). Возглавили рост акции Сбербанка (+2,85 % обыкновенные, +3,67 % привилегированные) и ГКМ Норильский Никель (+3,05 %), «голубые фишки» нефтегазового сектора прибавили по 1,5 %.

Резкий рост цен на нефть накануне вечером, находящиеся на положительной территории азиатские площадки и отсутствие торгов в США, где сегодня празднуют День Благодарения, делают наиболее вероятным сценарием продолжение вчерашних тенденций. Таким образом, российские индексы сегодня продолжают рост, при этом активности, видимо, будет пониженной

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.
24 ноя	0:30	US	Запасы нефти API: нед/нед, млн. барр. (API weekly crude stocks)	до 21 ноя.	5,189	-2,100	-7,652	
24 ноя	0:30	US	Запасы бензина API: нед/нед, млн. барр. (API weekly gasoline stocks)	до 21 ноя.	-0.499	-0,600	-1,653	
24 ноя	0:30	US	Запасы дистилл. API: нед/нед, млн. барр. (API weekly dist stocks)	до 21 ноя.	-0.311	-1,200	0,222	
24 ноя	12:00	DE	Индекс экон. ожиданий IFO (IFO expectations)	Ноя	106,3	104,7	105,1	105,2
24 ноя	12:00	DE	Индекс делового климата IFO (IFO business climate)	Ноя	109,3	107,4	107,6	107,7
24 ноя	12:00	DE	Индекс текущих условий IFO (IFO current conditions)	Ноя	112,3	110,3	110,2	
24 ноя	12:30	GB	ВВП пересмотр. кв/кв, % (GDP q/q P)	3 кв.	0,8	0,8	0,8	
24 ноя	12:30	GB	ВВП пересмотр. г/г, % (GDP y/y P)	3 кв.	2,8	2,8	2,8	
24 ноя	13:00	EZ	Заказы пром. предпр-ий м/м, % (Industrial new orders m/m)	Сен	-3.8	-2,5	5,3	5,1
24 ноя	13:00	EZ	Заказы пром. предпр-ий г/г, % (Industrial new orders y/y)	Сен	13,5	14,7	24,4	24,7
24 ноя	16:30	US	Базовый индекс потреб. расходов м/м, % (Core PCE price index m/m)	Окт	0,0			
24 ноя	16:30	US	Базовый индекс потреб. расходов г/г, % (Core PCE price index y/y)	Окт	0,9		1,2	
24 ноя	16:30	US	Дефлятор потреб. расходов г/г, % (PCE price index y/y)	Окт	1,3		1,4	
24 ноя	16:30	US	Заказы на товары длит. польз. м/м, % (Durable goods orders m/m)	Окт	-3.3		3,5	5,0
24 ноя	16:30	US	Заказы на тов. длит. польз. без. трансп. м/м, % (Durable goods extrasp)	Окт	-2.7	0,6	-0,4	1,3
24 ноя	16:30	US	Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims)	до 22 ноя.	407		439	441
24 ноя	16:30	US	Длительная безработица, млн. (Continuing claims)	до 15 ноя.	4,182		4,295	4,324
24 ноя	16:30	US	Личные доходы м/м, % (Personal income m/m)	Окт	0,5	0,4	-0,1	
24 ноя	16:30	US	Личные расходы м/м, % (Personal spending m/m)	Окт	0,3		0,1	0,2
24 ноя	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. окончат. (U. of Michigan Conf, F)	Ноя	71,6	69,5	69,3	
24 ноя	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. предв. (U. of Michigan Conf, A)	Ноя	71,6	69,5	69,3	
24 ноя	18:00	US	Индекс цен на жилье м/м, % (FHFA home price m/m)	Сен	-0.7		0,4	
24 ноя	18:00	US	Индекс цен на жилье г/г, % (FHFA home price y/y)	Сен	-3.4		-2,4	
24 ноя	18:00	US	Продажи нового жилья, млн. (New home sales)	Окт	0,283	0,310	0,307	0,308
24 ноя	18:00	US	Продажи нового жилья м/м, % (New home sales m/m)	Окт	-8.1		6,6	12,0
24 ноя	18:30	US	Запасы нефти: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude stocks)	до 21 ноя.	1,029	-2,100	-7,300	
24 ноя	18:30	US	Запасы бензина: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly gasoline stocks)	до 21 ноя.	1,913	-0,600	-2,700	
24 ноя	18:30	US	Запасы дистилл.: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly dist stocks)	до 21 ноя.	-0.541	-1,200		
24 ноя	18:30	US	Запасы нефти в Кушинге: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude Cushing)	до 21 ноя.	0,560		1,266	
24 ноя	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI (ECRI U.S. Weekly Leading Index)	до 21 ноя.	126,4		124,3	124,2
24 ноя	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI г/г, % (ECRI Weekly Leading Index y/y)	до 21 ноя.	-3.1		-4,5	
24 ноя	20:00	US	Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas)	до 21 ноя.	-6	-4	3	
25 ноя		US	Thanksgiving Day					
25 ноя	2:50	JP	Торговый баланс, млрд. иен (Trade balance total)	Окт	821,9	870,0	797,0	
25 ноя	2:50	JP	Объем экспорта г/г, % (Exports y/y)	Окт	7,8	10,6	14,4	
25 ноя	2:50	JP	Объем импорта г/г, % (Imports y/y)	Окт	8,7	11,2	9,9	
25 ноя	14:00	BR	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Окт		6,1	6,2	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен г/г, % (National CPI y/y)	Окт			-0,6	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен базовый г/г, % (National CPI y/y)	Окт		-0,6	-1,1	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен в Токио г/г, % (Tokyo CPI y/y)	Ноя			0,3	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен базовый в Токио г/г, % (Tokyo CPI y/y)	Ноя		-0,5	-0,5	
26 ноя	10:00	DE	Цены импорта м/м, % (Import prices m/m)	Окт		0,1	0,3	
26 ноя	10:00	DE	Цены импорта г/г, % (Import prices y/y)	Окт		9,4	9,9	
26 ноя	10:45	FR	Потреб. расходы м/м, % (Consumer spending m/m)	Окт			1,5	
26 ноя	12:00	EZ	Денежный агрегат М3 г/г, % (M3 money supply y/y)	Окт		1,3	1,0	
26 ноя	14:30	IN	Золотовалютн. резервы, \$ млрд. (Foreign reserves)	до 21 ноя.			298,31	
26 ноя	-	DE	Индекс потребит. цен предварит. м/м, % (CPI m/m P)	Ноя		-0,1	0,1	
26 ноя	-	DE	Индекс потребит. цен предварит. г/г, % (CPI y/y P)	Ноя		1,3	1,3	

