

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1410,11	-0,60%	-1,66%
PTC	1483,68	-0,28%	0,37%
MSCI Russia	785,766	-0,12%	0,13%
MSCI EM	1061,32	-0,02%	1,66%
S&P 500	1147,7	0,49%	0,69%
VIX	22,60	0,27%	1,12%
DJ Euro Stoxx 600	265,42	0,34%	2,12%
FTSE 100	5578,44	0,09%	0,04%
DAX 30	6298,3	0,00%	0,36%
NIKKEI 225	9581,82	0,91%	-0,21%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2624,33	0,50%	0,99%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,44	0,28	0,85
UST 10 YTM, %	2,47	-6,06	-11,11
UST 10 - TIPS 10, б.п.	1,87	5,36	-1,78
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	392,82	4,80	9,97
Russia 30 YTM, %	4,38	2,50	-3,10
Russia 5Y CDS, б.п.	165,16	1,00	2,00
Libor 3m USD, %	0,2894	0,00	-0,03
Libor 12m USD, %	0,7785	-0,01	-1,49
USD/RUB NDF 3m, %	2,93	-6,00	-7,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,19	-3,00	-6,00
RUB overnight, %	2,25	-25,00	-25,00
Mosprime 3m, %	3,75	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	79,21	-0,43%	-1,81%
EUR/USD	1,3579	0,93%	2,48%
USD/JPY	83,88	-0,45%	-1,42%
GBP/USD	1,5797	-0,19%	1,21%
AUD/USD	0,9671	0,66%	1,45%
USD/CAD	1,0300	0,09%	0,37%
USD/CNY	6,6904	-0,01%	-0,23%
корзина (EUR+USD)/RUB	35,29	-0,06%	-0,39%
USD/RUB ЦБ	30,61	-1,09%	-1,19%
EUR/RUB ЦБ	41,22	-0,09%	1,68%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	76,18	-0,44%	1,61%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	78,71	0,18%	0,37%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	3,837	0,97%	-2,09%
золото, USD/ун.	1308,1	1,09%	1,80%
серебро, USD/ун.	21,700	1,45%	3,73%
алюминий, USD/т. (LME)	2309	0,70%	6,16%
медь, USD/т. (LME)	7951	0,52%	3,53%
никель, USD/т. (LME)	23175	0,37%	3,67%

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

Российский рынок продолжит ненаправленное движение, индекс ММВБ попытается вернуться выше 1420 пунктов

Сегодня

- Статистика: индекс экономических ожиданий в Еврозоне, запасы нефти и нефтепродуктов в США
- Корпоративная отчетность: Полиметалл отчитается по US GAAP за I полугодие 2010 г

Зарубежные рынки

На внешних рынках в понедельник большую часть дня наблюдались разнонаправленные колебания. Европейские индексы дважды – сначала в первые часы торгов, а затем в конце сессии – уходили в заметный минус, теряя более 1 % относительно предыдущего закрытия, но оба раза возвращались на нейтральную территорию, и по итогам дня показали несущественное изменение в пределах +/- 0,1 %. Из выходящей статистики можно выделить окончательные данные по ВВП Великобритании за 2 квартал, совпавшие с прогнозами: +1,2 % в квартальном исчислении и +1,7 % в годовом.

Американские индексы в начале сессии также оказались под давлением из-за более резкого, чем ожидалось, снижения индекса потребительского доверия за сентябрь, который составил 48,5 пунктов при прогнозе 52,1 и предыдущем значении 52,2. Впрочем, достаточно быстро потери были отыграны, и к концу сессии основные индексы прибавили 0,4 – 0,5 %, индекс S&P500 снова вплотную подошел к сопротивлению на отметке 1150 пунктов. Формальными поводами для возвращения к инвесторам оптимизма могли стать сообщения о новых слияниях и поглощениях. Также поддержать рынок мог фактор конца квартала.

Российский рынок

Вчера российский рынок акций повторял динамику зарубежных фондовых площадок. С утра умеренно негативный внешний фон не позволил «быкам» зацепиться за отметку 1420 пунктов по индексу ММВБ – нижнюю границу торгового диапазона предыдущих двух недель – и к полудню индекс терял порядка 1 %. Улучшение настроений на европейских рынках во второй половине дня позволило отыграть часть потерь, однако слабая статистика, вышедшая в США, предопределила очередное отрицательное изменение российских индексов по итогам дня, индекс ММВБ составил 1410,11 пунктов (-0,6 %).

В первом эшелоне среди аутсайдеров оказались акции ВТБ (-1,87 %) и Роснефти (-1,5 %). Акции Лукойла (-0,24 %), которые в первой половине дня также несли заметные потери, резко подскочили после заявления председателя совета директоров Лукойла Валерия Грайфера о намерении компании выкупить у CoposcoPhilips оставшуюся часть пакета собственных акций. Во втором эшелоне слабость была заметна в некоторых энергетических бумагах и акциях строителей. Сегодня на умеренно позитивном внешнем фоне российский рынок попытается вернуться выше 1420 пунктов по индексу ММВБ. При этом пока индекс находится выше зоны поддержки 1390 – 1400 пунктов, среднесрочные перспективы выглядят как минимум нейтрально.

Макроэкономическая статистика

Источник: Reuters

Дата	Время	Страна	Показатель	Период	Факт	Прогноз	Пред.	Пересм.
28 сен	10:00	DE	Индекс потребит. доверия GfK (GfK consumer sentiment)	Окт	4,9	4,2	4,1	4,3
28 сен	10:45	FR	Потреб. расходы м/м, % (Consumer spending m/m)	Июл	2,7	0,6	-1,4	-1,5
28 сен	12:30	GB	ВВП окончат. кв/кв, % (GDP q/q F)	2 кв.	1,2	1,2	1,2	
28 сен	12:30	GB	ВВП окончат. г/г, % (GDP y/y F)	2 кв.	1,7	1,7	1,7	
28 сен	12:30	GB	Счет текущих операций, € млрд. (Current account)	2 кв.	-7.383	-9,750	-9,630	-11,300
28 сен	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC нед/нед, % (ICSC chain store sales w/w)	до 26 сен.	0,4		-1,4	
28 сен	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC г/г, % (ICSC chain store sales y/y)	до 26 сен.	3,6		3,3	
28 сен	16:55	US	Redbook: розничные продажи м/м, % (Redbook m/m)	до 26 сен.	-0,4		-0,4	
28 сен	16:55	US	Redbook: розничные продажи г/г, % (Redbook y/y)	до 26 сен.	2,5		2,2	
28 сен	17:00	US	Индекс цен на жилье S&P/Case-Shiller 20 м/м, % (S&P/Case-Shiller 20 m/m)	Июл	0,6	0,4	1,0	
28 сен	18:00	US	Индекс потреб. доверия (Consumer confidence)	Сен	48,5	52,5	53,5	53,2
28 сен	-	DE	Индекс потребит. цен предварит. м/м, % (CPI m/m P)	Сен	-0,1	-0,2		
28 сен	-	DE	Индекс потребит. цен предварит. г/г, % (CPI y/y P)	Сен	1,3	1,2	1,0	
29 сен	0:30	US	Запасы нефти API: нед/нед, млн. барр. (API weekly crude stocks)	до 25 сен.	-2.415	-0,300	2,231	
29 сен	0:30	US	Запасы бензина API: нед/нед, млн. барр. (API weekly gasoline stocks)	до 25 сен.	3,018	0,500	2,422	
29 сен	0:30	US	Запасы дистилл. API: нед/нед, млн. барр. (API weekly dist stocks)	до 25 сен.	-2.814	0,400	2,509	
29 сен	12:30	GB	Потреб. кредитование, € млрд. (BoE consumer credit)	Авг		0,100	0,170	
29 сен	12:30	GB	Чистое кредит-ие на покупку жилья, € млрд. (Mortgage lending)	Авг		0,300	0,100	
29 сен	12:30	GB	Одобр. заявки на жилищные кредиты, тыс. (Mortgage approvals)	Авг		47,00	48,72	
29 сен	13:00	EZ	Индекс экон. ожиданий (Economic Sentiment)	Сен		101,2	101,8	
29 сен	16:30	CA	Индекс цен производит. м/м, % (PPI m/m)	Авг		0,2	0,1	
29 сен	16:30	CA	Индекс цен производит. г/г, % (PPI y/y)	Авг			1,0	
29 сен	18:30	US	Запасы нефти: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude stocks)	до 25 сен.		-0,300	1,000	
29 сен	18:30	US	Запасы бензина: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly gasoline stocks)	до 25 сен.		0,500	1,600	
29 сен	18:30	US	Запасы дистилл.: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly dist stocks)	до 25 сен.		0,400	0,300	
29 сен	18:30	US	Запасы нефти в Кушинге: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude Cushing)	до 25 сен.			-0,210	
30 сен	3:15	JP	Индекс деловой активности в промышл. (PMI Manufacturing)	Сен			50,1	
30 сен	3:50	JP	Пром. производство предварит. м/м, % (Industrial production m/m P)	Авг		1,1	0,3	
30 сен	3:50	JP	Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Авг		4,4	3,9	
30 сен	9:00	JP	Заказы на строительство г/г, % (Construction orders y/y)	Авг			-0,7	
30 сен	9:00	JP	Новое строительство г/г, % (Housing starts y/y)	Авг		10,4	4,3	
30 сен	10:00	GB	Индекс цен на жилье Nationwide м/м, % (Nationwide house price m/m)	Сен		-0,3	-0,9	
30 сен	10:00	GB	Индекс цен на жилье Nationwide г/г, % (Nationwide house price y/y)	Сен		2,5	3,9	
30 сен	10:45	FR	Индекс цен производит. м/м, % (Producer prices m/m)	Июл		0,3		
30 сен	12:00	DE	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Сен		7,6	7,6	
30 сен	12:00	DE	Число безработных м/м, тыс. (Unemployment change m/m)	Сен		-20,0	-17,0	
30 сен	13:00	EZ	Оценка индекса потребит. цен г/г, % (CPI estimate y/y)	Сен		1,8	1,6	
30 сен	16:30	US	ВВП предварит. г/г, % (GDP y/y A)	2 кв.		1,6	1,6	
30 сен	16:30	US	Дефлятор ВВП, % (GDP deflator)	2 кв.		1,9	2,0	
30 сен	16:30	US	Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims)	до 26 сен.		460	465	
30 сен	16:30	US	Длжащаяся безработица, млн. (Continuing claims)	до 19 сен.		4,480	4,489	
30 сен	16:30	CA	ВВП м/м, % (GDP m/m)	Июл		-0,1	0,2	
30 сен	17:45	US	Чикагский индекс деловой активности (Chicago PMI)	Сен		55,9	56,7	
30 сен	18:30	US	Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas)	до 25 сен.			73	

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство»

197101, Санкт-Петербург, Петроградская наб., д. 36, лит. А
Тел.: +7 (812) 329-8181
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 по работе с клиентамиclient@bfa.ru

Константинова Виктория +7 (812) 329 8191
начальник управления v.konstantinova@bfa.ru

Кукушкина Екатерина +7 (812) 329 8196
начальник клиентского отдела e.kukushkina@bfa.ru

Щекина Елена +7 (812) 329 8171
специалист клиентского отдела e.schekina@bfa.ru

Аналитический отделresearch@bfa.ru

Дзугаев Роман r.dzugaev@bfa.ru
начальник отдела

Моисеев Алексей a.moiseev@bfa.ru
заместитель начальника отдела

Микрюкова Мария m.mikryukova@bfa.ru
ведущий аналитик

Казанцев Сергей s.kazantsev@bfa.ru
аналитик

Железняк Максим m.zheleznyak@bfa.ru
информационно-техническая
поддержка

Отдел брокерских операций

+7 (812) 329 8199

Шевцов Павел +7 (812) 329 8195
начальник отдела p.shevtsov@bfa.ru

Мишарев Андрей a.misharev@bfa.ru
специалист

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.