

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1571,31	0,60%	1,23%
PTC	1618,55	1,13%	1,25%
MSCI Russia	851,658	1,02%	0,89%
MSCI EM	1099,06	0,21%	-1,07%
S&P 500	1198,35	0,00%	0,14%
VIX	19,56	0,00%	4,32%
DJ Euro Stoxx 600	267,38	0,38%	-2,93%
FTSE 100	5698,93	0,74%	-1,21%
DAX 30	6879,66	0,82%	0,70%
NIKKEI 225	10039,56	-0,40%	0,26%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2871,70	0,18%	-0,44%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,54	0,00	3,10
UST 10 YTM, %	2,92	0,00	1,57
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,26	0,00	5,78
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	339,03	0,00	0,00
Russia 30 YTM, %	4,60	0,00	11,60
Russia 5Y CDS, б.п.	144,00	0,00	2,25
Libor 3m USD, %	0,2919	0,44	0,75
Libor 12m USD, %	0,7803	1,38	1,70
USD/RUB NDF 3m, %	3,4	-12,00	11,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,40	-5,00	0,00
RUB overnight, %	2,75	75,00	25,00
Mosprime 3m, %	3,75	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	79,70	-0,31%	1,23%
EUR/USD	1,3361	0,24%	-2,07%
USD/JPY	83,57	0,02%	0,08%
GBP/USD	1,5759	-0,11%	-1,78%
AUD/USD	0,9803	-0,19%	-0,91%
USD/CAD	1,0094	-0,13%	-1,07%
USD/CNY	6,6495	-0,05%	0,25%
корзина (EUR+USD)/RUB	35,93	-0,40%	-0,38%
USD/RUB ЦБ	31,29	0,09%	-0,18%
EUR/RUB ЦБ	41,92	-1,15%	-0,87%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	84,24	0,45%	2,92%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	86,10	0,30%	1,23%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,267	0,00%	6,49%
золото, USD/ун.	1374,1	-0,03%	1,53%
серебро, USD/ун.	27,540	-0,15%	2,34%
алюминий, USD/т. (LME)	2259	0,00%	-2,12%
медь, USD/т. (LME)	8250	0,00%	-2,08%
никель, USD/т. (LME)	22500	0,00%	2,97%

Прогноз

Внешний новостной фон сегодня снова преимущественно негативен, что не позволит российскому рынку продолжить рост: фондовые индексы вернутся в торговый диапазон предыдущих сессий

Сегодня

- Статистика: публикации важных макроэкономических новостей не ожидается

Зарубежные рынки

В отсутствие торгов в США активность на других фондовых площадках вчера была низкой. Торги в Европе завершились умеренным ростом (FTSE100 +0,74 %, S&P500 +0,34 %, DAX +0,82 %) на фоне заявлений представителей ЕС о том, что в случае необходимости фонд помощи проблемным странам может быть расширен.

С утра внешний фон ухудшился: курс доллара растет на ожиданиях скорого начала войны на корейском полуострове, а вслед за этим снижаются фондовые индексы и цены на товары. Заявление КНДР о том, что в случае любой эскалации конфликта, в т.ч. и проведении планируемых совместных учений Южной Кореи и США, начнется война, вызвало снижение азиатских индексов в пределах 1 -1,5 %, цен на нефть – до -0,5 %.

Ожидания развития военного конфликта с участием США будут сегодня оказывать давление на фондовые рынки. Индекс S&P500 не сможет сегодня удержаться вблизи отметки в 1200 пунктов, а это, означает, что возможный поход к локальному максимуму в районе 1225 пунктов, как минимум, откладывается, а как максимум, вообще не состоится в ближайшей перспективе

Российский рынок

В четверг активные покупки в акциях Сбербанка (обыкновенные +1,27 %, привилегированные +2,96 %), Газпрома (+1,34 %) и ГКМ Норильский Никель (+1,59 %) позволили российским индексам показать позитивную динамику, индекс ММВБ прибавил 0,6 % и закрылся на отметке 1571,31 пункта, немного не достигнув локального максимума начала недели (1574 пункта). Внешний новостной фон в условиях отсутствия торгов в США, отмечавших День Благодарения, был весьма скуден и не препятствовал позитивной динамике.

Сегодня, впрочем, внешняя конъюнктура изменилась, долговые проблемы Еврозоны и напряженность на Корейском полуострове вновь давят на рынки, вызвав снижение фондовых индексов в Азии и возобновление укрепления доллара против основных валют, что, в свою очередь, станет негативным драйвером для цен сырьевых товаров. Поэтому предполагаем, что сегодня российский рынок не сможет продолжить рост, индексы вернутся в торговый диапазон предыдущих сессий

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.
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	6,1	6,2	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен г/г, % (National CPI y/y)	Окт	0,2		-0,6	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен базовый г/г, % (National CPI y/y)	Окт	-0,6	-0,6	-1,1	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен в Токио г/г, % (Tokyo CPI y/y)	Ноя	0,2		0,3	
26 ноя	2:30	JP	Индекс потребит. цен базовый в Токио г/г, % (Tokyo CPI y/y)	Ноя	-0,5	-0,5	-0,5	
26 ноя	10:00	DE	Цены импорта м/м, % (Import prices m/m)	Окт	-0,2	0,1	0,3	
26 ноя	10:00	DE	Цены импорта г/г, % (Import prices y/y)	Окт	9,2	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 22 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	
29 ноя	2:50	JP	Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Окт		0,7	1,2	
29 ноя	12:30	GB	Потреб. кредитование, £ млрд. (BoE consumer credit)	Окт			0,260	
29 ноя	12:30	GB	Чистое кредит-ие на покупку жилья, £ млрд. (Mortgage lending)	Окт			0,100	
29 ноя	12:30	GB	Одобр. заявки на жилищные кредиты, тыс. (Mortgage approvals)	Окт			47,47	
29 ноя	13:00	EZ	Индекс экон. ожиданий (Economic Sentiment)	Ноя		104,5	104,1	
29 ноя	16:30	CA	Счет текущих операций, C\$ млрд. (Current account)	3 кв.			-11,02	
29 ноя	16:30	CA	Индекс цен производит. м/м, % (PPI m/m)	Окт			0,2	
29 ноя	16:30	CA	Индекс цен производит. г/г, % (PPI y/y)	Окт			1,4	

