

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1660,64	0,64%	1,73%
PTC	1710,77	0,97%	2,70%
MSCI Russia	906,27	0,74%	2,22%
MSCI EM	1116,57	0,12%	0,23%
S&P 500	1233	0,38%	0,94%
VIX	17,25	-2,76%	-11,04%
DJ Euro Stoxx 600	271,55	0,06%	1,65%
FTSE 100	5807,96	0,23%	0,70%
DAX 30	6964,16	-0,17%	0,09%
NIKKEI 225	10235,97	-0,49%	0,57%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2818,70	0,28%	-0,83%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,63	-0,50	7,72
UST 10 YTM, %	3,21	-6,58	21,28
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,24	-23,15	-4,10
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	338,51	0,00	-19,52
Russia 30 YTM, %	4,75	14,70	-6,20
Russia 5Y CDS, б.п.	145,16	0,00	-15,34
Libor 3m USD, %	0,3022	0,00	-0,12
Libor 12m USD, %	0,7825	0,00	-0,75
USD/RUB NDF 3m, %	3,67	-10,00	0,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,70	-3,00	5,00
RUB overnight, %	1,5	-150,00	-50,00
Mosprime 3m, %	4,03	6,00	2,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	80,09	0,10%	-0,31%
EUR/USD	1,3242	-0,11%	0,14%
USD/JPY	83,68	-0,42%	-0,23%
GBP/USD	1,5768	-0,23%	1,05%
AUD/USD	0,9843	0,58%	0,89%
USD/CAD	1,0101	-0,10%	0,67%
USD/CNY	6,6549	-0,10%	-0,09%
корзина (EUR+USD)/RUB	35,43	-0,48%	-1,16%
USD/RUB ЦБ	31,24	0,06%	-0,68%
EUR/RUB ЦБ	41,27	-0,91%	0,51%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	88,37	0,10%	0,42%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	90,99	0,24%	0,33%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,435	-3,71%	2,12%
золото, USD/ун.	1387,3	0,40%	0,22%
серебро, USD/ун.	28,710	1,41%	0,74%
алюминий, USD/т. (LME)	2259	0,00%	0,00%
медь, USD/т. (LME)	8250	0,00%	0,00%
никель, USD/т. (LME)	22500	0,00%	0,00%

Прогноз

Фондовые рынки остаются в вялой консолидации, сегодня существенного изменения российских индексов не ожидаем

Сегодня

- Статистика: индекс цен производителей в Великобритании, торговый баланс в США, индекс потребительского доверия Мичиганского университета, индекс цен на жилье и дефицит государственного бюджета США

Зарубежные рынки

Индекс S&P500 вчера еще на шаг приблизился к недавнему локальному максимуму в районе 1235 пунктов на фоне публикации позитивных данных с рынка труда (число заявок на пособие по безработице снизилось за неделю на 17 тыс. против ожидавшего сокращения на 11 тыс.). По итогам дня индексы S&P500 и NASDAQ прибавили +0,38 % и +0,29 % соответственно, индекс DJIA закрылся на уровне предыдущего дня (-0,2 %). Торги в Европе завершились смешанной динамикой (FTSE100 +0,23 %, SAC40 +0,68 %, DAX -0,17 %).

Азиатские рынки с утра преимущественно минусуют (до -0,5 %) в ожидании повышения на выходных ставки в Китае, исключение составляют китайский и индийский рынки, которые растут (в среднем +1 %) на фоне выхода позитивных статданных (промпроизводство В Индии выросло в октябре на 10,8 %; экспорт в Китае в ноябре увеличился на 35 %, импорт – на 38 %). Цены на нефть, которые вчера практически не изменились, с утра подрастают (до +0,5 %) на информации об увеличении импорта нефти в Китае (в ноябре +26 %). Фьючерсы на индексы США также торгуются в плюсе (+0,3 %).

Напомним, что в выходные с высокой долей вероятности, после публикации данных по потребительской инфляции, будет повышена ставка ЦБ Китая. Поскольку ожидания этого события лишь отчасти заложены в цены, то реакция фондовых и особенно товарных рынков может оказаться на следующей неделе достаточно сильной. Но сегодня, вероятно, рынки предпримут попытку для продолжения роста, если, конечно, настрой инвесторам не подпортит публикация целого блока макростатистики из США

Российский рынок

В четверг динамичный рост российского рынка, наблюдавшийся в начале сессии, вскоре был остановлен продажами в акциях Лукойла (+0,32 %), причиной которых, видимо, стала новость о размещении конвертируемых бондов на сумму 1,5 млрд. долл. Дневной прирост индекса ММВБ в итоге составил 0,64 % (до 1660,64 пункта), более 1 % прибавили котировки Газпрома (+1,01 %), ГКМ Норильский Никель (+1,35 %), в то время как банки выглядели хуже рынка (Сбербанк -0,04 %, ВТБ -0,59 %).

Российский рынок, как и большинство зарубежных фондовых площадок, последние несколько сессий остается в консолидации, явных негативных драйверов пока нет, но и оптимизма, необходимого для возобновления ралли, стало несколько меньше. Сегодня существенного итогового изменения индексов мы также не ожидаем, так как инвесторы будут ожидать развязки ситуации в Китае, где после публикации в субботу статистики (в фокусе внимания - данные по инфляции) возможно повышение учетной ставки

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.
9 дек	2:50	JP	ВВП окончат. кв/кв, % (GDP q/q F)	3 кв.	1,1	1,0	0,9	
9 дек	2:50	JP	ВВП окончат. г/г, % (GDP y/y F)	3 кв.	4,5	4,1	3,9	
9 дек	3:30	AU	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Ноя	5,2		5,4	
9 дек	3:30	AU	Число занятых м/м, тыс. (Employment change m/m)	Ноя	54 600		29 000	
9 дек	9:30	FR	Новые раб. места в нес/х секторе пересм. м/м, % (Non-farm payrolls rev)	3 кв.	0,2		0,3	
9 дек	10:00	DE	Индекс потребит. цен окончат. м/м, % (CPI m/m F)	Ноя	0,1	0,1	0,1	
9 дек	10:00	DE	Индекс потребит. цен окончат. г/г, % (CPI y/y F)	Ноя	1,5	1,5	1,5	
9 дек	11:00	GB	Индекс цен на жилье Halifax м/м, % (Halifax house price index m/m)	Ноя	-0,1	-0,5	1,8	
9 дек	11:00	GB	Индекс цен на жилье Halifax 3 мес. г/3 мес. г, % (Halifax house price index)	Ноя	-0,7	-0,7	1,2	
9 дек	12:30	GB	Торговый баланс, £ млрд. (Trade balance)	Окт	-8,529	-8,050	-8,230	-8,390
9 дек	12:30	GB	Торговый баланс без стран ЕС, £ млрд. (Non-EU trade balance)	Окт	-5,004	-4,500	-4,590	-4,550
9 дек	13:00	BR	Индекс потреб. цен м/м, % (IPCA - Extended National CPI m/m)	Ноя	0,83		0,83	
9 дек	14:00	BR	ВВП кв/кв, % (GDP q/q)	3 кв.	0,5	0,4	1,2	1,8
9 дек	14:00	BR	ВВП г/г, % (GDP y/y)	3 кв.	6,7	6,6	8,8	9,2
9 дек	15:00	GB	Ставка Банка Англии, % (BoE rate decision)	-	0,50		0,50	
9 дек	16:30	US	Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims)	до 07 дек.	421	425	436	438
9 дек	16:30	US	Длющаяся безработица, млн. (Continuing claims)	до 30 ноя.	4,086	4,250	4,270	4,277
9 дек	18:00	US	Оптовые запасы м/м, % (Wholesale inventories m/m)	Окт	1,9	0,9	1,5	2,1
9 дек	18:00	US	Оптовые продажи м/м, % (Wholesale sales m/m)	Окт	2,2	0,6	0,4	0,5
9 дек	18:30	US	Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas)	до 06 дек.	-89	-84	-23	
10 дек	2:50	JP	Индекс цен на корп. товары (оптовые цены) м/м, % (Corp goods price m/m)	Ноя	0,1	0,1	0,2	0,1
10 дек	2:50	JP	Индекс цен на корп. товары (оптовые цены) г/г, % (Corp goods price y/y)	Ноя	0,9	1,0	0,9	0,8
10 дек	3:00	RU	Торговый баланс ЦБ, \$ млрд. (Trade balance)	Окт			10,41	
10 дек	8:00	JP	Индекс потребит. доверия (Consumer confidence)	Ноя	40,4		40,9	
10 дек	8:30	IN	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Окт	10,8	8,5	4,4	
10 дек	10:00	DE	Оптовые цены м/м, % (Wholesale price index m/m)	Ноя			-0,3	
10 дек	10:00	DE	Оптовые цены г/г, % (Wholesale price index y/y)	Ноя			7,7	
10 дек	10:45	FR	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Окт		0,3	0,1	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. м/м, % (PPI output m/m)	Ноя		0,4	0,6	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. г/г, % (PPI output y/y)	Ноя		4,1	4,0	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. базовый м/м, % (PPI core output m/m)	Ноя		0,3	0,4	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. базовый г/г, % (PPI core output y/y)	Ноя		3,5	3,3	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. на факторы произв-ва м/м, % (PPI input m/m)	Ноя		0,8	2,1	
10 дек	12:30	GB	Индекс цен производит. на факторы произв-ва г/г, % (PPI input y/y)	Ноя		8,5	8,0	
10 дек	14:30	IN	Золотовалютн. резервы, \$ млрд. (Foreign reserves)	до 06 дек.	293,98		293,97	
10 дек	16:30	US	Торговый баланс, \$ млрд. (Trade balance)	Окт		-43,60	-44,00	
10 дек	16:30	US	Цены экспорта м/м, % (Export prices m/m)	Ноя		0,6	0,8	
10 дек	16:30	US	Цены импорта м/м, % (Import prices m/m)	Ноя		0,8	0,9	
10 дек	16:30	CA	Объем экспорта, C\$ млрд. (Exports)	Окт		33,50		
10 дек	16:30	CA	Объем импорта, C\$ млрд. (Imports)	Окт		35,70		
10 дек	16:30	CA	Торговый баланс, C\$ млрд. (Trade balance)	Окт		-2,10		
10 дек	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. предв. (U. of Michigan Conf, A)	Дек		72,5	71,6	
10 дек	17:55	US	Индекс цен на жилье м/м, % (FHFA home price m/m)	Дек		72,5	71,6	
10 дек	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECR I WLI (ECRI U.S. Weekly Leading Index)	до 06 дек.			125,4	
10 дек	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECR I WLI г/г, % (ECRI Weekly Leading Index y/y)	до 06 дек.			-2,4	
10 дек	22:00	US	Государств. бюджет, \$ млрд. (Federal Budget)	Ноя		-132,00	-120,30	
10 дек	-	CN	Торговый баланс, млрд. юаней (Trade balance)	Ноя	22,9	22,0	27,1	
10 дек	-	CN	Объем экспорта г/г, % (Exports y/y)	Ноя	34,9	22,5	22,9	
10 дек	-	CN	Объем импорта г/г, % (Imports y/y)	Ноя	37,7	24,2	25,3	

