

Основные показатели

индекс	изменение	пункты	
		07.09.2012	31.08.2012
PTC	5,91% ↑	1471,80	1389,72
MMBE	3,67% ↑	1474,55	1422,38
S&P 500	2,23% ↑	1437,92	1406,58
Dow Jones	1,65% ↑	13306,64	13090,84
Nikkei	0,36% ↑	8871,65	8839,91
DAX	3,50% ↑	7214,50	6970,79

"Голубые фишки"	изменение	цена за 1 акцию, руб.	
		07.09.2012	31.08.2012
Газпром	3,71% ↑	163,2400	157,4000
Лукойл	4,82% ↑	1926,0000	1837,4000
Сбербанк	0,75% ↑	93,8600	93,1600
ВТБ	6,16% ↑	0,0567	0,0534
Интер рао	3,63% ↑	0,0269	0,0259

валютная пара	курс		изменение
	07.09.2012	31.08.2012	
USD/RUB	31,6500	32,2500	-1,86% ↓
EUR/RUB	40,5170	40,5370	-0,05% ↓
EUR/USD	1,2804	1,2576	1,81% ↑
Бив.корз.	35,6765	36,0985	-1,17% ↓
AUD/USD	1,0395	1,0329	0,64% ↑
USD/JPY	78,2700	78,2800	-0,01% ↓

нефть	баррель, \$		изменение
	07.09.2012	31.08.2012	
brent	113,82	114,92	-0,96% ↓
urals	111,79	111,41	0,34% ↑

драг. металл	тройская унция, \$		изменение
	07.09.2012	31.08.2012	
золото	1737,60	1692,60	2,66% ↑
серебро	33,73	31,79	6,09% ↑

гос. облигации	доходность, %		изменение
	07.09.2012	31.08.2012	
UST 10	1,68	1,62	3,37% ↑
Россия 30	2,91	3,08	-5,66% ↓

Нефть и драг.металлы

По данным EIA, запасы нефти в США снизились за неделю, завершившуюся 31 августа, на 7,4 млн. баррелей до 357,1 млн. баррелей (прогноз -5,3), запасы бензина – на 2,3 млн. – до 198,9 млн. баррелей (прогноз -3,6). Компании Vitol и Glencore укрепили позиции на рынке нефти Urals, получив по итогам тендера Роснефти доступ к значительным ее ресурсам. Положительно на нефтяные цены повлияли предотвращение новой забастовки нефтяников в Норвегии, надежды на стимулирующие меры ЕЦБ и ФРС, медленное возобновление добычи в Мексиканском заливе, снижение запасов нефти, напряжение между Ираном и Израилем, отрицательно – продолжающееся замедление экономики Китая, плохие производственные данные США в августе. Запасы обеспеченных золотом фондов ETF ко вторнику достигли рекордного уровня 71,889 млн. унций (2.038 тонн), а запасы крупнейшего ETF SPDR Gold Trust GLD составили 1.293 тонны. Запасы обеспеченных серебром ETF снизились до 501,503 млн. унций с 504,431 млн. в конце августа.

Николаев Степан, e-mail: nikolaev@russobank.com, тел/факс.: +7(499) 241-39-86

Новости

США

Расходы на строительство снизились на 0,9% в июле и составили \$834,4 млрд., в июне расходы выросли на 0,4%. Индекс подачи заявок на ипотечные кредиты за неделю, завершившуюся 31 августа, снизился и составил 178,4 пункта. Стоимость 30-летних ипотечных кредитов с фиксированной ставкой на прошлой неделе составляла 3,78% годовых по сравнению с 3,80% неделей ранее. Сводный индекс PMI вырос до 51,5 пункта с 51,4 пункта в июле. Число обращений за пособием по безработице за неделю сократилось с 377 тыс. (пересмотр.) до 365 тыс., при прогнозе до 370 тыс. Общее число безработных составило 3,322 млн. чел. при прогнозе 3,315 млн. Число рабочих мест в частном секторе в августе выросло на 201 тыс. после увеличения на пересмотренные 173 тыс. в предыдущем месяце. Число занятых без учета сельскохозяйственного сектора в августе увеличилось на 96 тыс., при прогнозе +125 тыс. Число запланированных увольнений снизилось в августе на 12,5% по сравнению с предыдущим месяцем. В августе увольнения составили 32239 человек против 36900 в июле.

Еврозона

Агентство Moody's снизило прогноз рейтинга ЕС до негативного и предупредило о возможности снижения самого рейтинга, находящегося на уровне "Aaa". ВВП II квартал по сравнению с I -0,2% (прогноз -0,2%), II квартал 12/11 -0,5% (-0,4%). Инфляция ускорилась до 2,6% в авг. с 2,4% в июле. Сводный индекс PMI составил в августе 46,3 пункта после 46,6 в июле. при прогнозе 46,6. Индекс PPI в июле вырос на 0,4% в месячном исчислении (прогноз 0,2%) и увеличился на 1,8% (прогноз 1,6%) - в годовом. ЕЦБ в четверг оставил без изменений ключевую ставку 0,75% годовых, депозитную ставку 0% и кредитную ставку 1,5% и согласовал новую программу покупки облигаций, но детали даст позже. При этом ЕЦБ будет на равных с частными кредиторами. У новой программы ЕЦБ не будет количественных ограничений, она будет прекращена после достижения поставленных целей или в результате несоблюдения страной-участницей условий. Доп. ликвидность после выкупа облигаций будет полностью стерилизована. Действия ЕЦБ будут сосредоточены на коротком конце кривой доходности, от 1 до 3 лет. Испания детально проанализирует условия программы покупки бондов прежде чем обращаться за финансовой помощью, заявила в пятницу вице-президент Испании.

Россия

ВВП за II квартал 4%, в I квартале +4,9%, во II квартале 2011 г. +3,4%. Инфляция в августе достигла 5,9% по сравнению с 5,6% в июле и 8,2% за аналогичный период 2011 г. Инфляция ускорилась за период с 28 ав. по 3 сен. до 0,2% после нулевого прироста неделей ранее на фоне индексации тарифов ЖКХ. Индекс потребительских цен вырос с начала сентября на 0,2% по сравнению с нулевой инфляцией на весь сентябрь 2011 г. С начала 2012 г. инфляция составила 4,8%, обогнав аналогичной показатель 2011 г. на 0,1%. Индекс PMI снизился в авг. до 51 пункта с 52 – в июле. Резервный фонд на 1 сен. составил 1,953 трлн. руб. (\$60,48 млрд.), месяцем ранее 1,927 трлн. руб. (\$59,87 млрд.). Остатки на корр.счетах в ЦБ на 07 сен. составили 469,5 млрд.руб. по сравнению с 774,4 млрд. руб. на 31 авг. Остатки на депозитных счетах в ЦБ на 07 сен. составили 95,9 млрд.руб. по сравнению с 90,2 на 31 авг. Сальдо торговли в янв-июл +\$129 млрд. (янв-июл 11г +\$120 млрд.) по данным ФТС.

Китай

Индекс PMI для производственного сектора от HSBC упал до 47,6 пункта с 49,3 в июле. Официальный индекс PMI снизился до 49,2 пункта в августе. Промпроизводство в авг. +8,9% (прогноз +9,1%). Инвестиции в основной капитал в янв-авг +20,2% (прогноз +20,4%). Розничные продажи в авг. +13,2% (прогноз +13,2%). Инфляция в авг. +2,0% (прогноз +2,0%). Цены производителей в авг. -3,5% (прогноз -3,3%). Китай одобрил 60 инфраструктурных проектов, общая стоимость которых, по оценкам аналитиков, превышает 1 трлн. юаней (\$157 млрд.) или 2,1% ВВП.

Акции и валюта

Американские, европейские и российские рынки находились в ожидании совещания ЕЦБ, результаты которого привели к их росту в четверг. На американские рынки отрицательно повлияли сокращение производства в США в августе, речь Бернанки в прошлую пятницу, положительно – трудовая статистика США. Евро рос к доллару благодаря надеждам на новые меры ЕЦБ в борьбе с долговым кризисом. Рубль подорожал к корзине валют, отразив рост нефти на фоне ожиданий стимулирующих мер от мировых центробанков.

Гособлигации

Средневзвешенная доходность на аукционе по размещению выпуска ОФЗ-ПД 26209 составила 8,01% годовых, объем размещения по номиналу - 23,97 млрд. руб. при эмиссии в 25,0 млрд., спрос составил 36,74 млрд. руб. по верхней границе диапазона доходности в 7,95-8,02% годовых.