

Основные показатели

индекс	пункты		изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
PTC	1429,91	1391,85	2,73% ↑
MMBB	1496,35	1450,20	3,18% ↑
S&P 500	1818,32	1775,32	2,42% ↑
Dow Jones	16221,14	15755,36	2,96% ↑
Nikkei	15870,42	15403,11	3,03% ↑
DAX	9400,18	9006,46	4,37% ↑

"Голубые фишки"	пункты		изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
Газпром	141,5000	133,3800	6,09% ↑
Лукойл	2033,0000	1998,3000	1,74% ↑
Сбербанк	102,2000	98,9400	3,29% ↑
ВТБ	0,0485	0,0463	4,88% ↑
Интер рао	0,0100	0,0086	15,74% ↑

валютная пара	курс		изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
USD/RUB	32,9800	32,8500	0,40% ↑
EUR/RUB	45,0781	45,1130	-0,08% ↓
EUR/USD	1,3673	1,3734	-0,44% ↓
Бив.корз.	38,4342	38,3592	0,20% ↑
AUD/USD	0,8917	0,8962	-0,50% ↓
USD/JPY	104,0350	103,1690	0,84% ↑

нефть	баррель, \$		изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
brent	111,84	108,30	3,27% ↑
WTI	97,67	93,05	4,97% ↑

драг. металл	тройская унция, \$		изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
золото	1202,80	1238,00	-2,84% ↓
серебро	19,40	19,66	-1,35% ↓

гос. облигации	доходность, %		абсолютное изменение
	20.12.2013	13.12.2013	
UST 10	2,89	2,87	0,02% ↑
Россия 30	4,13	4,14	-0,02% ↓

Новости

США

Окончат. ВВП в годовом исчисл. (кв/кв) в 3 кв. увеличился на 4,1% (прогноз был +3,6%), во 2 кв. к 1 кв. было увеличение на 3,6%. Число первичных обращений за пособием по безработице за неделю к 14 дек. составило 379 тыс. (прогноз был 336), за предыдущую неделю число составило 369 тыс. (пересм. с 368). Окончат. производительность труда вне сельскохозяй. сектора в годовом исчисл. (кв/кв) в 3 кв. выросла на 3,0% (прогноз был +2,9%), во 2 кв. к 1 кв. был рост на 1,9%. Индекс запросов на ипотечное кредитование за неделю к 13 дек. снизился на 5,5%, неделей ранее был рост на 1,0%. Продажи домов на вторичном рынке недвижимости в годовом исчисл. в нояб. составили 4,9 млн. (прогноз был 5,04), в окт. было 5,12 млн. Число выданных разрешений на строительство нового дома в годовом исчисл. в нояб. составило 1,01 млн. (прогноз был 0,99), в окт. число составляло 1,04 млн. (пересм. с 1,03). Число закладок новых домов в годовом исчисл. составило в нояб. 1,09 млн. (прогноз был 0,95), в сент. было 0,89 млн. Объем пром. производства (м/м) в нояб. вырос на 1,1% (прогноз был +0,6%), в окт. был рост на 0,1% (пересм. с -0,1%). Коэффициент загрузки производственных мощностей в нояб. составил 79,0% (прогноз был 78,5%), в окт. коэффициент был 78,2% (пересм. с 78,1%). Индекс потребительских цен (м/м) в нояб. по сравн. с окт. не изменился (прогноз был +0,1%), в окт. было уменьшение на 0,1%. Отрицательное сальдо платёжного баланса в 3 кв. составило 95 млрд. долл. (прогноз был -101), во 2 кв. отрицательное сальдо составило 97 млрд. долл. (пересм. с -99). Чистый объем покупок долгосрочных ценных бумаг США иностранными инвесторами в окт. составил 35,4 млрд. долл. (прогноз был 31,4), в сент. объем составлял 31,3 млрд. долл. (пересм. с 25,5).

Еврозона

Индекс потребительского доверия в Еврозоне в нояб. составил -14 пунктов (прогноз был -15), в окт. индекс составлял -15 пунктов. Сальдо торгового баланса Еврозоны в окт. составило 14,5 млрд. евро (прогноз был 15,2), в сент. сальдо составляло 12,4 млрд. евро (пересм. с 14,3). Положительное сальдо платёжного баланса Еврозоны в окт. составило 21,8 млрд. евро (прогноз был 14,2), в сент. положительное сальдо составляло 14,9 млрд. евро (пересм. с 13,7). Индекс настроений в деловых кругах Еврозоны от ZEW составил в дек. 68,3 пункта (прогноз был 60,9), в нояб. индекс составлял 60,2 пункта. Индекс потребительских цен Еврозоны (г/г) в нояб. вырос на 0,9%, что совпало с прогнозом и ростом в окт. Индекс цен производителей Германии (м/м) в нояб. снизился на 0,1% (прогноз был 0,0%), в окт. было снижение на 0,2%.

Россия

Потребительские цены за неделю, заверш. 16 дек. выросли на 0,1%, с начала года цены выросли на 6,2%, а с начала месяца – выросли на 0,2%. Денежная база РФ в узком определении на 16 дек. 8124,0 млрд. руб. против 7981,1 млрд. руб. на 09 дек.

Китай

Предварит. индекс PMI в производственном секторе от HSBC составил в дек. 50,5 пункта (прогноз был 51), в нояб. индекс составлял 50,8 пункта (пересм. с 50,4). Объем прямых иностранных инвестиций в Китай (г/г) в нояб. увеличился на 5,5%, в окт. было увеличение на 5,8%. Индекс опережающих экономических индикаторов Китая (м/м) в нояб. увеличился на 1,4%, в окт. было увеличение на 0,7% (пересм. с 0,6%).

Валютный и фондовые рынки

На неделе российские акции пошли вверх после новости об освобождении самого известного в России заключенного Михаила Ходорковского. Ключевая ставка денежного рынка Китая в пятницу поднялась до полугодового максимума, т.к. инвесторы боятся дефицита наличности, несмотря на вливание денег ЦБ. Несмотря на это и фиксацию прибыли в конце года, европейские фондовые рынки завершают лучшую неделю за восемь месяцев. Также настроение европейских фондовых рынков подняла ФРС США, которая в среду лишь незначительно сократила закупку активов и пообещала удерживать процентные ставки около нуля на протяжении длительного периода. Котировки японских акций выросли на фоне ослабления иены после объявления ФРС о начале сокращения стимулирующей программы. Банк Японии в пятницу сохранил денежно-кредитную политику неизменной. Рубль по итогам недели подорожал. Против рубля, формируя спрос на валюту, выступала необходимость выплатить до конца декабря около 32 млрд. долл. внешних займов российских корпораций и банков. Однако внешние движения до и после решения ФРС снизить денежные стимулы компенсировались корпоративными продажами валюты в налоговый период в РФ.

Нефть

Запасы нефти в США от EIA за неделю, заверш. 13 дек., упали на 2,9 млн. барр. (на 0,8%) до 372,3 млн. барр. при прогнозе сокращения на 2,3 млн. барр. Общие запасы бензина выросли на 1,3 млн. барр. (на 0,6%) до 220,5 млн. барр. Запасы дистиллятов снизились на 2,1 млн. барр. (на 1,8%) до 116 млн. барр. Цены на нефть Brent поднялись выше \$110 за баррель и выросли за неделю за счет сокращения поставок нефти из Ливии и оптимистичного прогноза потребления в США.

Драгоценные металлы

Цены на золото близки к минимуму шести месяцев из-за сокращения стимулов ФРС. С начала года котировки снизились на 29%. Запасы крупнейшего в мире обеспеченного золотом биржевого фонда (ETF) SPDR Gold Trust в четверг снизились на 3,9 тонны до 808,72 тонны - минимальной отметки почти за пять лет. За год отток из восьми крупнейших "золотых" ETF мира составил 720 тонн, т.к. инвесторы предпочитают акции.

Государственные облигации

Минфин РФ разместил 18 дек.: 1) офз с погашением в авг. 2023 г. на 19 млрд. руб. при объеме предложения в 21,5 млрд. руб. и спросе по верхнему ориентиру, совпавшему с объемом размещения, средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 26215 составила 7,83% годовых, по цене отсечения - также 7,83%; 2) офз с погашением в мае 2016 г. на 350 млн. руб. при объеме предложения в 19,6 млрд. руб. и спросе по верхнему ориентиру, равному объему размещения, средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 25082 составила 6,67% годовых, по цене отсечения - также 6,67%, объем спроса по номиналу составил 450 млн. руб.

Николаев Степан, nikolaev@russobank.com; тел: +7(499) 241-39-86

© ОАО АКБ «РУССОБАНК» - генеральная лицензия № 2313 от 23.04.1993 г., тел.: +7(499) 248-55-85, факс: +7(499) 241-39-86

Данный обзор предназначен исключительно для информационных целей. ОАО АКБ «РУССОБАНК» не дает никаких прямых или косвенных заверений или гарантий в отношении достоверности и полноты включенной в обзор информации. Ни ОАО АКБ «РУССОБАНК», ни агенты компании или аффилированные лица не несут никакой ответственности за любые прямые или косвенные убытки от использования настоящего обзора или содержащейся в нем информации.