

Основные показатели

индекс	пункты		изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
PTC	1432,87	1462,92	-2,05% ↓
MMBB	1472,49	1477,85	-0,36% ↓
S&P 500	1691,75	1709,91	-1,06% ↓
Dow Jones	15258,24	15451,09	-1,25% ↓
Nikkei	14760,07	14742,42	0,12% ↑
DAX	8661,51	8675,73	-0,16% ↓

"Голубые фишки"	пункты		изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
Газпром	145,0700	147,7100	-1,79% ↓
Лукойл	2083,0000	2025,0000	2,86% ↑
Сбербанк	98,5900	102,3600	-3,68% ↓
ВТБ	0,0431	0,0436	-1,19% ↓
Интер рао	0,0115	0,0119	-3,53% ↓

валютная пара	курс		изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
USD/RUB	32,3300	31,8600	1,48% ↑
EUR/RUB	43,6620	43,0768	1,36% ↑
EUR/USD	1,3521	1,3523	-0,01% ↓
Бив.корз.	37,4805	36,8916	1,60% ↑
AUD/USD	0,9315	0,9408	-0,99% ↓
USD/JPY	98,2260	99,3210	-1,10% ↓

нефть	баррель, \$		изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
brent	108,43	109,35	-0,84% ↓
WTI	102,32	103,87	-1,49% ↓

драг. металл	тройская унция, \$		изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
золото	1336,30	1325,60	0,81% ↑
серебро	21,77	21,79	-0,09% ↓

гос. облигации	доходность, %		абсолютное изменение
	27.09.2013	20.09.2013	
UST 10	2,63	2,74	-0,11% ↓
Россия 30	3,97	3,85	0,12% ↑

Государственные облигации

Минфин РФ разместил 25 сент. офз с погашением в дек. 2019 г. на 2,96 млрд. руб. (\$93 млн.) при объеме предложения в 16 млрд., средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 26210 составила 6,95% годовых. Минфин РФ разместило 25 сент. офз с погашением в мае 2016 г. на 5,42 млрд. руб. (\$169 млн.) при объеме предложения в 7,56 млрд. руб., средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 25082 составила 6,41% годовых.

Нефть

Запасы нефти в США за неделю, заверш. 20 сент., увеличились на 2,6 млн. барр. (прогноз был +1,5), или на 0,7% - до 358,3 млн. барр. Запасы бензина выросли на 0,2 млн. барр., или на 0,1%, и составили 216,2 млн. барр. Запасы дистиллятов уменьшились на 0,2 млн. барр., или на 0,2%, составив 130,9 млн. барр. Цены на нефть снизились из-за снижения опасений по поводу Сирии и Ирана.

Драгоценные металлы

Цены на золото держались выше \$1.320 за унцию из-за неуверенности инвесторов в денежно-кредитной политике США и споров о бюджете в Вашингтоне.

Новости

США

Окончательный ВВП США (кв/кв) в годовом исчисл. во 2 кв. 13 г. вырос на 2,5% (прогноз был +2,7%), в 1 кв. ВВП вырос на 2,5%. Число обращений за пособием по безработице за неделю к 28 сентября составило 308 тыс. (прогноз был 315), неделей ранее оно составляло 307 тыс. (пересм. с 305). Продажи новых домов в годовом исчисл. в авг. составили 421 тыс. (прогноз был 422), в июле – составили 390 тыс. (пересм. с 394). Незавершенные продажи на вторичном рынке недвижимости (м/м) в авг. снизились на 1,6% (прогноз был -0,9%), в июле было снижение на 1,4% (пересм. с -1,3%). Индекс цен на дома (м/м) увеличился в июле на 1,0% (прогноз был +0,9), в июле было увеличение на 0,7%. Индекс запросов на ипотечное кредитование за неделю, окончившуюся 27 сент., сократился на 0,4%, на предыдущей неделе было увеличение на 5,5%. Предварит. PMI в производств. секторе от Markit составил в сент. 52,8 пункта (прогноз был 54,2), в авг. – 53,1 пункта (пересм. с 53,9). Индекс PMI в производств. секторе Ричмонда в сент. упал до 0 пунктов (прогноз был рост до 17), в авг. был рост индекса до 14 пунктов. Индекс потребительского доверия от Conference Board составил в сент. 79,7 пункта (прогноз был 79,9), в авг. – 81,8 пункта (пересм. с 81,5). Окончательный индекс потребительского доверия в сент. составил 77,5 пункта (прогноз был 78,2), в авг. индекс составил 76,8 пункта. Объем заказов на товары длительного пользования (м/м) в авг. увеличился на 0,1% (прогноз был 0,0), в июле было уменьшение на 7,4% (пересм. с -7,3%). Ценовой индекс базовых расходов на личное потребление (м/м) в авг. вырос на 0,2% (прогноз был +0,1%), в июле был рост на 0,1%. Личные расходы потребителей (м/м) в авг. увеличились на 0,3% (совпало с прогнозами), в июле было увеличение на 0,2% (пересм. с +0,1%). Личные доходы потребителей (м/м) в авг. увеличились на 0,4% (прогноз был +0,5%), в июле было увеличение на 0,2% (пересм. с +0,1%).

Еврозона

Денежная масса M3 в Еврозоне (г/г) в авг. увеличилась на 2,3% (совпало с прогнозом), в июле было увеличение на 2,2%. Индекс деловой активности в розничном секторе еврозоны в сент. составил 48,6 пунктов против 50,3 в авг. Индекс настроений в деловых кругах Германии от Ifo составил в сент. 107,7 пункта (прогноз был 108,4) против 107,6 пункта в авг. (пересм. с 107,5). Индекс потребительского доверия в Германии от GfK составляет в окт. 7,1 пункта (совпало с прогнозом) против 7,0 пункта в сент. (пересм. с 6,9). Розничные продажи в Италии (м/м) в июле уменьшились на 0,3% (прогноз был +0,3), в июле было уменьшение на 0,2%. Предварит. PMI в производств. секторе Еврозоны составил в сент. 51,1 пункта (прогноз был 51,8), в авг. – 51,4 пункта (пересм. с 51,3). Предварит. PMI в сфере услуг Еврозоны составил в сент. 52,1 пункта (прогноз был 51,1), в авг. – 50,7 пункта (пересм. с 51). Предварит. индекс потребительских цен Германии (м/м) в сент. к авг. не изменился, составив 0% и совпав с прогнозами, в авг. к июлю изменение также составило 0%.

Россия

Денежная база в узком определении на 23 сент. 7899,2 млрд. руб. против 7880,1 млрд. руб. на 16 сент. Инфляция за период с 16 по 23 сент. составила 0,1%, с начала месяца цены выросли на 0,2%. С начала 2013 г. инфляция составила 4,7%. Российские страновые фонды зафиксировали приток в \$57 млн., или 0,49% от активов под управлением, за неделю к 25 сент. Положительной динамики средств удалось добиться благодаря спекулятивным фондам ETF, получившим \$82 млн., тогда как традиционные фонды снова показали отток в размере \$25 млн.

Китай

Предварит. PMI в производств. секторе от HSBC составил в сент. 51,2 пункта (прогноз был 50,9), в авг. – 50,1 пункта.

Валютный и фондовый рынки

Относительно прошлой пятницы российские биржевые индикаторы продвинулись недалеко, испытывая дискомфорт из-за нерешенного вопроса увеличения объема заимствования правительства США. Японский индекс Nikkei вырос за неделю, но снизился в пятницу из-за фиксации прибыли и нежелания инвесторов открывать новые позиции накануне объявления стратегии правительства в отношении экономического роста и налогообложения. Южнокорейский индекс KOSPI поднялся за неделю: помогли новости о снижении числа обращений за пособием по безработице в США и о твердом профиците текущего счета Южной Кореи. Европейские акции снижаются на фоне переговоров о бюджете США и политического противостояния в Италии. Американские акции подешевели в пятницу, а индексы S&P 500 и Dow Jones испытали первое недельное снижение за месяц, поскольку республиканцы и демократы так и не пришли к компромиссу по поводу повышения лимита госдолга в оставшиеся до крайнего срока дни. Курс рубля показал при открытии торгов в пятницу отрицательную динамику, которая сменилась затем незначительными колебаниями к доллару и бивалютной корзине. Накануне рубль подешевел до уровня увеличенных интервенций ЦБ. Рубль вернулся к уровням до того момента, когда ФРС решила не менять программу количественного смягчения, отыграв укрепление, чрезмерное по сравнению с валютами других развивающихся рынков. После того, как курс рубля к корзине опустился в четверг ниже 37,25 рубля, объем продаж ЦБ РФ увеличивается до \$200 млн. Доллар вырос к иене в четверг на фоне надежд рынка на новые шаги японского правительства по реформированию корпоративного налогообложения, однако споры о финансировании государственных расходов США ограничили движение доллара.

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.