

Финансовый обзор за неделю к 28 июля 2017 г.



индекс *	пункты		изм.
	28.07.17	21.07.17	
RTS	1 014.44	1 024.89	-1.02% ▼
MICEX	1 916.75	1 925.13	-0.44% ▼
S&P500	2 472.10	2 472.54	-0.02% ▼
DJIA	21 830.31	21 580.07	1.16% ▲
Nasdaq	6 374.68	6 387.75	-0.20% ▼
DAX	12 162.70	12 240.06	-0.63% ▼
FTSE100	7 368.37	7 452.91	-1.13% ▼
CAC40	5 131.39	5 117.66	0.27% ▲
Nikkei	19 959.84	20 099.75	-0.70% ▼
SSE	3 253.24	3 237.98	0.47% ▲
HSI	26 979.39	26 706.09	1.02% ▲
KOSPI	2 400.99	2 450.06	-2.00% ▼

акции *	цена за 1 ао, руб.		изм.
	28.07.17	21.07.17	
Газпром	116.90	118.95	-1.72% ▼
Лукойл	2 794.00	2 842.00	-1.69% ▼
Сбербанк	165.40	162.10	2.04% ▲
ВТБ	0.06	0.06	-4.44% ▼
ММК	33.63	34.47	-2.44% ▼
СевСталь	820.50	820.00	0.06% ▲
РусГидро	0.79	0.80	-2.29% ▼
ИнтерРАО	3.73	3.80	-1.89% ▼
Ростел	66.10	66.21	-0.17% ▼
Магнит	9 680.00	9 405.00	2.92% ▲
Уралкалий	129.95	131.45	-1.14% ▼
Система	11.11	11.22	-1.02% ▼

вал. пара	курс		изм.
	28.07.17	21.07.17	
USD/RUB	59.57	59.50	0.11% ▲
EUR/RUB	70.02	69.50	0.74% ▲
Бив.корп.	64.27	64.00	0.42% ▲
EUR/USD	1.1750	1.1661	0.76% ▲
GBP/USD	1.3131	1.2992	1.07% ▲
USD/CHF	0.97	0.95	2.44% ▲
USD/JPY	110.65	111.10	-0.41% ▼
AUD/USD	0.7986	0.7911	0.95% ▲
USD/CAD	1.2432	1.2537	-0.84% ▼
USD/CNY	6.74	6.77	-0.44% ▼
USD/HKD	7.81	7.81	0.00% ▼

др. мет.	тройская унция, \$		изм.
	28.07.17	21.07.17	
Золото	1 268.75	1 254.40	1.14% ▲
Серебро	16.66	16.47	1.15% ▲

нефть	баррель, \$		изм.
	28.07.17	21.07.17	
Brent	52.52	48.06	9.28% ▲
WTI	49.71	45.77	8.61% ▲

гос. обл.	средняя YTM, %		изм.
	28.07.17	21.07.17	
UST 10	2.29	2.24	2.4% ▲
Russia 30	2.09	2.11	-0.9% ▼
Germ 10	0.54	0.50	7.3% ▲

* В случае отсутствия цены закрытия актива за пятницу из-за нерабочего дня в таблице отражается цена закрытия такого актива за последний рабочий день недели.
 ** В таблицах «нефть», «драг.мет», «вал.пара» указаны последние цены BID (в usd/rub, eur/rub и Бивал.корп. указаны цены закрытия по данным Московской биржи).

Макроэкономическая статистика за неделю:

Время	Валюта	Название	Факт.	Ожидания	Пред.
<i>Понедельник, 24 июля 2017 г.</i>					
10:30	EUR	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) Германии (июль)	58.3	59.2	59.6
17:00	USD	Продажи на вторичном рынке жилья (июнь)	5.52M	5.58M	5.62M
<i>Вторник, 25 июля 2017 г.</i>					
11:00	EUR	Индекс делового климата IFO Германии (июль)	116	114.9	115.2
17:00	USD	Индекс доверия потребителей (июль)	121.1	116.5	117.3
<i>Среда, 26 июля 2017 г.</i>					
11:30	GBP	ВВП (г/г) (2 кв.)	1.70%	1.70%	2.00%
11:30	GBP	ВВП (кв/кв) (2 кв.)	0.30%	0.30%	0.20%
17:00	USD	Продажи нового жилья (июнь)	610K	615K	605K
17:30	USD	Запасы сырой нефти	-7,20M	-2,63M	-4,73M
21:00	USD	Решение по процентной ставке ФРС	1.25%	1.25%	1.25%
<i>Четверг, 27 июля 2017 г.</i>					
15:30	USD	Базовые заказы на товары длительного пользования (м/м) (июнь)	0.20%	0.40%	0.60%
<i>Пятница, 28 июля 2017 г.</i>					
13:30	RUB	Решение по процентной ставке (июль)	9.00%	9.00%	9.00%
15:30	USD	ВВП (кв/кв) (2 кв.)	2.60%	2.60%	1.20%

Фондовый рынок:

Рынок акций США продемонстрировал разнонаправленную динамику: DJIA достиг своего максимума в 21 830 пунктов и закрыл неделю ростом на 1.16%, в то время как S&P500 почти не изменился, а Nasdaq подешевел на 0.2%. Все внимание инвесторов было сосредоточено на заседании ФРС США, в ходе которого Комитет принял решение оставить процентную ставку без изменений на уровне 1.25%, подчеркнув замедление инфляции. Российский рынок акций остается под давлением, снизившись на 0.44% по индексу ММВБ и на 1.02% по индексу РТС. Основной причиной беспокойства игроков на рынке оказалось принятие американским парламентарием законопроекта о санкциях, основной вопрос которого заключается в ограничении торговли американскими резидентами российскими суверенными облигациями. ЦБ РФ также сохранил ключевую ставку на уровне 9%, ссылаясь на рост краткосрочных инфляционных рисков и ожиданий повышения цен продовольственных товаров. Минфин разместил ОФЗ серии 26214 с погашением в мае 2020 года на 15 млрд. рублей при спросе на 40 млрд. и доходности в 8.12% годовых. На втором аукционе было размещено ОФЗ серии 29012 с погашением в ноябре 2022 года на 15 млрд. рублей при спросе 29 млрд. и доходности 9.72% годовых.

Валютный рынок:

На прошлой неделе доллар продолжил снижение к корзине мировых валют, включая рубль. Пара EUR/USD продолжает пробивать новые локальные максимумы, закрыв неделю на уровне 1.1750 на фоне ожидания ужесточения денежно-кредитной политики ЕЦБ. Пара USD/RUB незначительно выросла на 0.11% и закрылась на уровне 59.57. Несмотря на слабость доллара и рост цен на нефть российский валютный рынок продолжает двигать рубль к новым минимумам на фоне ухудшения отношений с США, а также новым витком санкций.

Нефть и драгметаллы:

Котировкам нефти марки Brent удалось закрепиться выше уровня \$50, достигнув к концу неделю \$52.52. Рынок отреагировал на позитивные итоги заседания Комитета по мониторингу ОПЕК в Санкт-Петербурге. Помимо этого, по данным управления энергетической информации, из резервуаров ушло еще 7.2 млн. баррелей нефти, за месяц - 37 млн. баррелей. В результате давление на рынок с точки зрения хранения нефти сократилось до минимума с начала 2016 года. Котировки золота также закрыли неделю ростом на 1.14% на уровне 1 268.75 долларов за тройскую унцию. Согласно отчету Thomson Reuters GFMS мировой спрос на золото во втором квартале 2017 года вырос на 21%, до 957 тонн. Прежде всего, это произошло из-за роста спроса со стороны ювелирной промышленности: производство ювелирных изделий выросло на 24%, до 541 тонны. Закупки со стороны центробанков выросли в 2.6 раза, до 97 тонн.

Максим Козлов, kozlov@russobank.com; тел: +7(499) 241-39-86

АО 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. АО АКБ «РУССОБАНК» не дает никаких прямых или косвенных заверений или гарантий в отношении достоверности и полноты включенной в обзор информации. Ни АО 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.