

Финансовый обзор за неделю к 04 августа 2017 г.



индекс *	пункты		изм.
	04.08.17	28.07.17	
RTS	1 026.73	1 014.44	1.21% ▲
MICEX	1 953.49	1 916.75	1.92% ▲
S&P500	2 476.83	2 472.10	0.19% ▲
DJIA	22 092.81	21 830.31	1.20% ▲
Nasdaq	6 351.56	6 374.68	-0.36% ▼
DAX	12 297.72	12 162.70	1.11% ▲
FTSE100	7 511.71	7 368.37	1.95% ▲
CAC40	5 203.44	5 131.39	1.40% ▲
Nikkei	19 952.33	19 959.84	-0.04% ▼
SSE	3 262.08	3 253.24	0.27% ▲
HSI	27 562.68	26 979.39	2.16% ▲
KOSPI	2 395.45	2 400.99	-0.23% ▼

акции *	цена за 1 ао, руб.		изм.
	04.08.17	28.07.17	
Газпром	119.45	116.90	2.18% ▲
Лукойл	2 903.00	2 794.00	3.90% ▲
Сбербанк	169.73	165.40	2.62% ▲
ВТБ	0.06	0.06	-0.13% ▼
ММК	35.35	33.63	5.11% ▲
СевСталь	845.30	820.50	3.02% ▲
РусГидро	0.77	0.79	-2.43% ▼
ИнтерРАО	3.84	3.73	2.88% ▲
Ростел	66.20	66.10	0.15% ▲
Магнит	9 321.00	9 680.00	-3.71% ▼
Уралкалий	131.30	129.95	1.04% ▲
Система	11.84	11.11	6.57% ▲

вал. пара	курс		изм.
	04.08.17	28.07.17	
USD/RUB	59.97	60.36	-0.65% ▼
EUR/RUB	70.60	71.65	-1.46% ▼
Бив. корз.	64.75	65.44	-1.05% ▼
EUR/USD	1.1768	1.1750	0.15% ▲
GBP/USD	1.3035	1.3131	-0.73% ▼
USD/CHF	0.97	0.97	0.42% ▲
USD/JPY	110.67	110.65	0.02% ▲
AUD/USD	0.7922	0.7986	-0.80% ▼
USD/CAD	1.2650	1.2432	1.75% ▲
USD/CNY	6.73	6.74	-0.13% ▼
USD/HKD	7.82	7.81	0.12% ▲

драг. мет.	тройская унция, \$		изм.
	04.08.17	28.07.17	
Золото	1 257.85	1 268.75	-0.86% ▼
Серебро	16.23	16.66	-2.58% ▼

нефть	баррель, \$		изм.
	04.08.17	28.07.17	
Brent	52.42	52.52	-0.19% ▼
WTI	49.58	49.71	-0.26% ▼

гос. обл.	средняя УТМ, %		изм.
	04.08.17	28.07.17	
UST 10	2.26	2.29	-1.2% ▼
Russia 30	2.07	2.09	-1.0% ▼
Germ 10	0.47	0.54	-13.1% ▼

* 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. корз. указаны цены закрытия по данным Московской биржи).

Макроэкономическая статистика за неделю:

Дата	Время	Валюта	Название	Факт.	Ожидания	Пред.
Пн, 31.07.2017	04:00	CNY	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) (июль)	51.4	51.6	51.7
	12:00	EUR	Индекс потребительских цен (ИПЦ) (r/r) (июль)	1.30%	1.30%	1.30%
	17:00	USD	Индекс незавершенных продаж на рынке недвижимости (м/м) (июль)	1.50%	0.70%	-0.70%
Вт, 01.08.2017	04:45	CNY	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) (июль)	51.1	50.4	50.4
	10:55	EUR	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) Германии (июль)	58.1	58.3	58.3
	10:55	EUR	Изменение количества безработных в Германии (июль)	-9K	-5K	6K
	11:30	GBP	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) (июль)	55.1	54.4	54.2
Ср, 02.08.2017	17:00	USD	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) от ISM (июль)	56.3	56.5	57.8
	11:30	GBP	Индекс деловой активности в строительном секторе (июль)	51.9	54.5	54.8
	15:15	USD	Изменение числа занятых в несельскохозяйственном секторе от ADP (июль)	178K	185K	191K
	17:30	USD	Запасы сырой нефти	-1.527M	-2.957M	-7.208M
Чт, 03.08.2017	11:30	GBP	Индекс деловой активности в секторе услуг (июль)	53.8	53.6	53.4
	14:00	GBP	Решение по процентной ставке (июль)	0.25%	0.25%	0.25%
	17:00	USD	Индекс деловой активности в непромышленном секторе (PMI) от ISM (июль)	53.9	57	57.4
Пт, 04.08.2017	15:30	USD	Изменение числа занятых в несельскохозяйственном секторе (июль)	209K	183K	231K
	15:30	USD	Уровень безработицы (июль)	4.30%	4.30%	4.40%

Фондовый рынок:

Российский рынок акций закрыл неделю ростом на 1.92% по индексу ММВБ и 1.21% по индексу РТС. Американский фондовый рынок закрылся разнонаправлено: DJIA, установивший новый максимум, подорожал на 1.2%, S&P500 вырос лишь на 0.19%, а Nasdaq и вовсе закрыл неделю падением на 0.36%. В пятницу сильные макроэкономические данные по рынку труда поддержали рынки. Безработица в США в июле упала до 4.3% с 4.4% в июне. Число рабочих мест в американской экономике в июле выросло на 209 тыс. при ожиданиях 180 тыс. При этом цифры за июнь также были пересмотрены в сторону увеличения с 222 тыс. до 231 тыс. Позитивная статистика по рынку труда, возможно, позволит ФРС США объявить в сентябре о начале сокращения активов, находящихся на балансе, а также может стать еще одним аргументом в пользу третьего за этот год повышения процентных ставок на заседании регулятора в декабре. По данным FedWatch от CME Group, вероятность повышения ставки до конца года составляет 50 процентов. Европейский рынок акций также продемонстрировал позитивную динамику: DAX вырос на 1.11%, CAC40 – на 1.4%. Почти две трети компаний, входящих в индекс MSCI Europe, уже отчитались о финансовых результатах: больше половины из них либо превзошли прогнозы, либо совпали с ними.

Валютный рынок:

Валютный рынок не остался в стороне от пятничной статистики: индекс доллара прервал свое падение и закрыл неделю ростом на 0.3%. При этом российская валюта укрепилась по отношению к доллару и евро на 0.65% и 1.46% соответственно. Рубль сохраняет позитивную динамику, несмотря на укрепление доллара и неопределенность на рынке нефти. В качестве позитивного фактора можно отметить закрытие длинных позиций по валюте, набравшиеся на ожиданиях реакции рубля на новый пакет антироссийских санкций. Банк России принял решение об осуществлении эмиссии первого выпуска купонных облигаций Банка России (КОБР) в объеме 150 млрд. руб. по номиналу с погашением 15 ноября 2017 года. Ставка купонной доходности будет привязана к ключевой ставке Банка России.

Британский фунт стерлингов снизился после подведения итогов заседания Банка Англии. За прошедшую неделю котировки GBP/USD снизились на 0.73%. Банк Англии сохранил все параметры денежно-кредитной политики, включая процентную ставку на уровне 0.25%.

Нефть и драгметаллы:

Котировки нефти за прошедшую неделю почти не изменились. В США добыча нефти увеличилась на 20 тысяч баррелей в сутки, что является очередным максимумом. При этом запасы нефти снизились на 1.53 млн. баррелей, а число эксплуатируемых нефтяных буровых установок снизилось на 1 единицу согласно отчету Baker Hughes. Основным фактором, оказывающим давление на нефтяной рынок, стала информация о том, что в июле увеличился экспорт нефти ОПЕК, превысив уровень экспорта в июне. В основном это стало следствием наращивания поставок из африканских стран, в особенности из Ливии, экспорт которой обновил трёхлетние максимумы.

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.