

Основные показатели

| индекс | пункты | | изменение |
|--------------------|------------|------------|-----------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| PTC | 1437,54 | 1477,61 | -2,71% ↓ |
| MMBB | 1489,32 | 1515,15 | -1,70% ↓ |
| S&P 500 | 1770,61 | 1761,64 | 0,51% ↑ |
| Dow Jones | 15761,78 | 15615,55 | 0,94% ↑ |
| Nikkei | 14086,80 | 14201,57 | -0,81% ↓ |
| DAX | 9078,28 | 9007,83 | 0,78% ↑ |

| "Голубые фишки" | пункты | | изменение |
|------------------|------------|------------|-----------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| Газпром | 147,5500 | 150,4400 | -1,92% ↓ |
| Лукойл | 2064,1000 | 2112,0000 | -2,27% ↓ |
| Сбербанк | 101,8600 | 103,6500 | -1,73% ↓ |
| ВТБ | 0,0455 | 0,0447 | 1,74% ↑ |
| Интер рао | 0,0084 | 0,0093 | -9,86% ↓ |

| валютная пара | курс | | изменение |
|------------------|------------|------------|-----------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| USD/RUB | 32,6700 | 32,4100 | 0,80% ↑ |
| EUR/RUB | 43,5980 | 43,6930 | -0,22% ↓ |
| EUR/USD | 1,3354 | 1,3488 | -0,99% ↓ |
| Бив.корз. | 37,5746 | 37,4982 | 0,20% ↑ |
| AUD/USD | 0,9374 | 0,9434 | -0,64% ↓ |
| USD/JPY | 99,1400 | 98,7540 | 0,39% ↑ |

| нефть | баррель, \$ | | изменение |
|--------------|-------------|------------|-----------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| brent | 105,04 | 106,05 | -0,95% ↓ |
| WTI | 91,00 | 91,36 | -0,39% ↓ |

| драг. металл | тройская унция, \$ | | изменение |
|----------------|--------------------|------------|-----------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| золото | 1289,00 | 1315,50 | -2,01% ↓ |
| серебро | 21,50 | 21,86 | -1,62% ↓ |

| гос. облигации | доходность, % | | абсолютное изменение |
|------------------|---------------|------------|----------------------|
| | 08.11.2013 | 01.11.2013 | |
| UST 10 | 2,75 | 2,62 | 0,13% ↑ |
| Россия 30 | 4,01 | 3,87 | 0,15% ↑ |

Нефть

Запасы нефти в США от EIA за неделю, заверш. 1 нояб., выросли на 1,6 млн. барр. (прогноз был +2,1), или на 0,4%, - до 385,4 млн. барр. Запасы бензина снизились на 3,8 млн. барр. (прогноз был -400 тыс. барр.), или на 1,8%, и составили 210 млн барр. Запасы дистиллятов снизились на 4,9 млн. барр. (прогноз был -1,5), или на 4%, составив 117,8 млн. барр. Цены на нефть Brent держались около \$104 за баррель – миним. с начала июля - на фоне переговоров Ирана с Западом. Китай в октябре снизил импорт нефти до 13-месячного минимума в связи с праздничной неделей и ремонтом на двух крупных НПЗ, что стало причиной снижения цен на нефть. Однако поддержку ценам на нефть также оказывала беспокойная обстановка в Ливии.

Драгоценные металлы

Рынок золота близок к трехнедельному минимуму и снижается вторую неделю подряд, т.к. стабильный экономический рост США указывает на возможность сокращения стимулирующей программы ФРС в этом году. Запасы крупнейшего в мире обеспеченного золотом биржевого фонда (ETF) SPDR Gold Trust в среду выросли на 2,1 тонны до 868,42 тонны, поднявшись впервые с 22 окт. С начала года запасы фонда сократились на 450 тонн, упав до миним. с начала 2009 г.

Новости

США

PMI в непромышленном секторе от ISM в окт. составил 55,4 пункта (прогноз был 54,2), в сент. индекс составил 54,4 пункта. Индекс запросов на ипотечное кредитование за неделю к 1 ноября снизился на 7,0%, за неделю к 25 окт. индекс снизился на 6,4%. Индекс опережающих экономических индикаторов (м/м) в сент. увеличился на 0,7%, что совпало с прогнозами и изменением авг. к июлю. Предварит. ВВП с учётом инфляции (кв./кв.) в годовом. исчисл. в III кв. увеличился на 2,8% (прогноз был +2,0%), во II кв. к I кв. было увеличение на 2,5% (пересм. с +1,7%). Число рабочих мест вне сельскохозяйственного сектора в окт. выросло на 204 тыс. (прогноз был +121), в сент. было увеличение на 163 тыс. (пересм. с +148). Уровень безработицы в окт. составил 7,3% (совпало с прогнозами), в сент. уровень был 7,2%. Личные расходы потребителей (м/м) в сент. увеличились на 0,2% (прогноз был +0,3%), в авг. было увеличение на 0,3%. Личные доходы потребителей (м/м) в сент. увеличились на 0,5% (прогноз был +0,3%), в авг. было увеличение на 0,5% (пересм. с +0,4%).

Еврозона

Окончательный PMI в производственном секторе Еврозоны в окт. составил 51,3 пункта, что совпало с прогнозами и сентябрьским значением. Индекс доверия инвесторов в Еврозоне Sentix в нояб. составил 9,3 пункта (прогноз был 6,6), в окт. индекс составил 6,1 пункта. Число безработных в Испании в окт. увеличилось на 87 тыс. (прогноз был +31,3), в сент. было увеличение на 25,6 тыс. Индекс цен производителей Еврозоны (м/м) в сент. увеличился на 0,1% (прогноз был +0,3%), в авг. к июлю индекс не изменялся. Окончательный PMI в сфере услуг Еврозоны в окт. составил 51,6 пункта (прогноз был 50,9), в сент. индекс составил 50,9 пункта. Розничные продажи в Еврозоне (м/м) в сент. уменьшились на 0,6% (прогноз был -0,3%), в авг. было увеличение на 0,5% (пересм. с +0,7%). Объем промышленного производства в Германии (м/м) в сент. упал на 0,9% (прогноз был +0,2%), в авг. было повышение на 1,6% (пересм. с +1,4%). Агентство S&P снизило долгосрочный кредитный рейтинг Франции в иностранной и местной валюте до "AA" с "AA+" и изменило прогноз рейтинга на «стабильный» с «негативного».

Россия

Денежная база РФ в узком определении на 5 нояб. 7806,3 млрд. руб. против 7846 млрд. руб. на 28 окт. Потребительские цены в РФ выросли за период с 29 окт. по 5 нояб. на 0,1%, как и неделей ранее. С начала нояб. цены выросли на 0,1% - так же как и за аналогичный период 2012 г. С начала 2013 г. инфляция составила 5,4% по сравн. с 5,7% годом ранее. В окт. 2013 г. индекс потребит. цен вырос на 6,3% по сравн. с окт. 2012 г. и на 0,6% - сентябрем 2013 г. Российские страновые фонды потеряли \$53 млн., или 0,44% от активов под управлением, за неделю к 6 нояб. Недель ранее потери составили \$30 млн. ЦБ РФ сохранил ключевую процентную ставку на уровне 5,50% годовых.

Китай

Сальдо торгового баланса составило в окт. \$31,1 млрд. (прогноз был 23,5), в сент. сальдо составляло \$15,2 млрд. Индекс цен производителей (г/г) в окт. упал на 1,5% (прогноз был -1,3%), в сент. было падение на 1,3%. Объем промышленного производства (г/г) в окт. увеличился на 10,3% (прогноз был +10,1%), в сент. было увеличение на 10,2%. Объем инвестиций в основные средства (г/г) в окт. увеличился на 20,1% (прогноз был +20,2%), в сент. было увеличение на 20,2%. Розничные продажи (г/г) в окт. увеличились на 13,3% (прогноз был +13,4%), в сент. было увеличение на 13,3%.

Валютный и фондовые рынки

ЕЦБ в четверг сократил ключевую ставку до нового рекордного минимума 0,25% в ответ на неожиданное замедление инфляции в окт. до 0,7%. ЕЦБ также сократил ставку кредитования до 0,75% с 1,0% и оставил на уровне 0,0% депозитную ставку. Евро резко снизился к доллару после этого решения. Рубль резко подорожал к бивалютной корзине и евро после неожиданного решения ЕЦБ, однако публикация данных о росте ВВП США выше прогнозов остановила укрепление российской валюты. Доллару помогла и неожиданно сильная американская статистика. Внешние факторы затмили комментарии главы Минэкономразвития РФ о прогнозируемом замедлении роста российской экономики в долгосрочной перспективе. Распродажи на зарубежных площадках, ожидания сворачивания стимулов ФРС США раньше сроков, исключение нескольких компаний из индекса MSCI Russia и трудовая статистика США привели к падению российских акций в пятницу. Европейские фондовые рынки снижались, поскольку инвесторы опасались, что сильные экономические показатели США позволят ФРС раньше начать сокращение стимулов. Инвесторов также огорчило решение S&P снизить рейтинг Франции.

Государственные облигации

Минфин РФ разместил в среду офз с погашением в мае 2016 г. на 1,39 млрд. руб. при объеме предложения в 10 млрд. и спросе по верхней границе ориентира также на уровне 1,39 млрд. руб., средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 25082 составила 6,42% годовых, по цене отсечения - 6,43%. Минфин РФ разместил в среду офз с погашением в мае 2020 г. на 8,73 млрд. руб. (\$270 млн.) при объеме предложения в 20 млрд. руб., средневзвеш. доходность на аукционе ОФЗ 26214 составила 7,05% годовых.

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.