

Основные показатели

индекс	пункты		изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
PTC	1477,61	1495,36	-1,19% ↓
MMBB	1515,15	1505,39	0,65% ↑
S&P 500	1761,64	1759,77	0,11% ↑
Dow Jones	15615,55	15570,28	0,29% ↑
Nikkei	14201,57	14088,19	0,80% ↑
DAX	9007,83	8985,74	0,25% ↑

"Голубые фишки"	пункты		изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
Газпром	150,4400	150,0800	0,24% ↑
Лукойл	2112,0000	2094,0000	0,86% ↑
Сбербанк	103,6500	102,9900	0,64% ↑
ВТБ	0,0447	0,0426	4,98% ↑
Интер рао	0,0093	0,0097	-4,11% ↓

валютная пара	курс		изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
USD/RUB	32,4100	31,7900	1,95% ↑
EUR/RUB	43,6930	43,8600	-0,38% ↓
EUR/USD	1,3488	1,3807	-2,31% ↓
Бив.корз.	37,4982	37,2295	0,72% ↑
AUD/USD	0,9434	0,9585	-1,58% ↓
USD/JPY	98,7540	97,3740	1,42% ↑

нефть	баррель, \$		изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
brent	106,05	107,06	-0,94% ↓
WTI	91,36	95,55	-4,39% ↓

драг. металл	тройская унция, \$		изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
золото	1315,50	1352,30	-2,72% ↓
серебро	21,86	22,59	-3,25% ↓

гос. облигации	доходность, %		абсолютное изменение
	01.11.2013	25.10.2013	
UST 10	2,62	2,51	0,11% ↑
Россия 30	3,87	3,80	0,07% ↑

Валютный и фондовые рынки

ФРС США сохранила диапазон ключевой процентной ставки в пределах 0,00-0,25% годовых и объем выкупа активов на уровне \$85 млрд. в месяц, как и ожидали участники рынка. Однако ФРС не выразила столь сильной обеспокоенности состоянием экономики, как прогнозировали некоторые аналитики. Доллар США находился в районе двухнедельного максимума к корзине валют после заседания ФРС. Рубль снизился против доллара и вырос к евро после заседания ФРС и статистики из еврозоны, а за счет продаж экспортёрами подорожавшей валюты США он стабилизировался ниже границы валютных интервенций к бивалютной корзине. Европейские фондовые рынки в пятницу снижались из-за слабых квартальных отчетов ряда крупных компаний. Азиатские фондовые рынки завершили неделю ростом за счет макроэкономической статистики и квартальных отчетов компаний. Российский фондовый рынок оказался в четверг под давлением продавцов вместе с остальными развивающимися площадками после заседания ФРС США. Американские фондовые индикаторы упали в среду, и индекс S&P 500 прервал четырехдневное ралли после того, как ФРС США понизила прогноз роста экономики.

Новости

США

Объем пром. производства (м/м) в сент. увеличился на 0,6% (прогноз был +0,5%), в авг. было увеличение на 0,4%. Незавершенные продажи на вторичном рынке недвижимости (м/м) в сент. снизились на 5,6% (прогноз был +0,5%), в авг. было снижение на 1,6%. Розничные продажи за искл. продаж автомобилей (м/м) в сент. увеличились на 0,4% (совпало с прогнозами), в авг. было увеличение на 0,1%. Базовый индекс цен производителей (м/м) в сент. вырос на 0,1% (совпало с прогнозами), в авг. к июлю изменения составили 0,0%. Товарно-материальные запасы компаний (м/м) в авг. увеличились на 0,3% (совпало с прогнозами), в июле было увеличение на 0,4%. Индекс потребительского доверия от Conference Board в окт. составил 71,2 пункта (прогноз был 75,2), в сент. составил 80,2 пункта (пересм. с 79,7). Индекс запросов на ипотечное кредитование за неделю к 01 нояб. уменьшился на 7%, за предыдущую неделю индекс увеличился на 6,4%. Базовый индекс потребительских цен (м/м) в сент. вырос на 0,1% (прогноз был +0,2%), в авг. был рост на 0,1%. Число обращений за пособием по безработице за неделю ко 2 ноября составило 336 тыс. (совпало с прогнозами), неделей ранее оно составило 345 тыс. (пересм. с 340). PMI в производственном секторе от Markit в окт. составил 51,8 пункта (прогноз был 51,1), в сент. индекс составил 51,1 пункта.

Еврозона

Индекс деловой активности в розничном секторе еврозоны в окт. составил 47,7 пункта, в сент. составил 48,6 пункта. Предварит. индекс потребительских цен в Еврозоне (r/r) в окт. увеличился на 0,7% (прогноз был +1,1%), в сент. было увеличение на 1,1%. Уровень безработицы в Еврозоне в сент. составил 12,2% (прогноз был 12,0%), в авг. безработица составила 12,2% (пересм. с 12,0%). Предварит. ВВП Испании (кв/кв) в III кв. увеличился на 0,1% (совпало с прогнозами), во II кв. по сравн. с I кв. было падение на 0,1%. Число безработных в Германии в окт. увеличилось на 2 тыс. (прогноз был +1 тыс.), в сент. было увеличение на 24 тыс. (пересм. с 25 тыс.). Уровень безработицы в Германии с учетом сезонных поправок в сент. составил 6,9% (совпал с прогнозами), в авг. уровень составил также 6,9%. Розничные продажи в Германии (м/м) в сент. уменьшились на 0,4% (прогноз был +0,5%), в авг. было снижение на 0,2% (пересм. с +0,5%). Индекс потребительского доверия в Германии от GfK в нояб. составил 7,0 пункта (прогноз был 7,3), в окт. индекс составил 7,1 пункта. Уровень безработицы в Италии в сент. составил 12,5% (прогноз был 12,4%), в авг. безработица составила 12,4% (пересм. с 12,2%).

Россия

Денежная база в узком определении на 28 окт. 7846 млрд. руб. против 7923,9 млрд. руб. на 21 окт. Индекс потребительских цен на 28 окт. составил с начала года 5,3%, с начала месяца 0,5%. Российские страновые фонды потеряли \$30 млн., или 0,25% от активов под управлением, за неделю к 30 окт., тогда как неделей ранее был зафиксирован рекордный приток средств с середины мая, в размере \$115 млн.

Китай

PMI в производственном секторе в окт. составил 51,4 пункта (прогноз был 51,2), в сент. индекс составил 51,1 пункта.

Государственные облигации

Минфин РФ разместил 30 окт. офз с погашением в авг. 2023 г. на все предложенные 10 млрд. руб. (\$313 млн.) при объеме спроса по верхней границе ориентира на уровне 38,9 млрд. руб., средневзвеш. дох-ть на аукционе ОФЗ 26215 составила 7,29% годовых, по цене отсечения - также 7,29%. Минфин РФ разместил 30 окт. офз с погашением в янв. 2018 г. на все предложенные 25 млрд. руб. (\$782 млн.), средневзвеш. дох-ть на аукционе ОФЗ 25081 составила 6,73% годовых, по цене отсечения - 6,74%.

Нефть

Запасы нефти в США от EIA за неделю, заверш. 25 окт., выросли на 4,1 млн. барр. (прогноз был +2,4), или на 1,1%, - до 383,9 млн барр. Запасы бензина снизились на 1,7 млн. барр., или на 0,8%, и составили 213,8 млн. барр., запасы дистиллятов выросли на 3,1 млн. барр., или на 2,4%, составив 122,7 млн. барр. Цена нефти Brent поднялась за счет роста производственной активности в Китае. Brent поддерживали перебои в поставках из Ливии, а на WTI оказывал давление значительный рост запасов нефти в США.

Драгоценные металлы

Отток средств из крупнейшего в мире обеспеченного золотом ETF SPDR Gold Trust в этом году превысил \$20 млрд., и его запасы близки к минимуму четырех лет. Китай в сент. пятый месяц подряд купил свыше 100 тонн золота в Гонконге за счет высокого спроса на ювелирные изделия и слитки. Цены на золото близки к двухнедельному минимуму после резкого падения в четверг, вызванного фиксацией прибыли в конце месяца, сильными экономическими показателями США и укреплением 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.