Индикаторы рынка акций

РОССИЯ / РЫНОК АКЦИЙ
17.06.2011

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
ММВБ	1671,10	-0,46%	-1,26%
РТС	1896,72	-1,16%	-2,28%
MSCI Russia	998,704	-1,21%	-2,99%
MSCI EM	1107,43	-1,81%	-3,05%
S&P 500	1267,64	0,18%	-1,66%
VIX	22,73	6,61%	27,91%
DJ Euro Stoxx 600	281,71	-1,50%	-4,32%
FTSE 100	5698,81	-0,76%	-2,69%
DAX 30	7110,2	-0,07%	-0,69%
NIKKEI 225	9329,89	-0,86%	-1,94%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2670,38	0,23%	-1,29%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед, б.п.
UST 2 YTM, %	0,38	0,39	-3,69
UST 10 YTM, %	2,93	-4,17	-7,11
UST 10 - TIPS 10, б.п.		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	350,88	12,28	25,64
Russia 30 YTM, %	4,43	0,80	10,60
Russia 5Y CDS, б.п.	145,19	4,50	8,04
Libor 3m USD, %	0,2465	0,15	-0,30
Libor 12m USD, %	0,7273	0,60	0,47
USD/RUB NDF 3m, %	3,98	8,00	23,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,50	5,00	15,00
RUB overnight, %	3	-40,00	-20,00
Mosprime 3m, %	4,21	0,00	1,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	76,22	0,20%	2,73%
EUR/USD	1,4210	0,31%	-2,05%
USD/JPY	80,6	-0,53%	0,39%
GBP/USD	1,6160	-0,10%	-1,26%
AUD/USD	1,0556	-0,08%	-0,68%
USD/CAD	0,9818	0,30%	0,87%
USD/CNY	6,4746	-0,10%	-0,02%
корзина (EUR+USD)/RUB	33,42	0,12%	-0,01%
USD/RUB ЦБ	27,90	-0,01%	0,76%
EUR/RUB ЦБ	40,13	-0,38%	-1,23%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	94,95	0,15%	-6,85%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	114,02	-2,63%	-4,64%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,412	-3,60%	-5,61%
золото, USD/ун.	1528,4	-0,12%	-0,91%
серебро, USD/ун.	35,480	-0,78%	-5,49%

Прогноз

Российский рынок акций сохраняет определенную устойчивость, сильных распродаж не наблюдается, однако в условиях сугубо негативных настроений на внешних рынках и на отскок наверх рассчитывать трудно. В связи с этим ожидаем сегодня умеренного снижения российских индексов.

Российский рынок

В четверг, 16 июня, торги на российском рынке акций начались с «гэпа» вниз на фоне снижения на внешних рынках рисковых активов, в середине дня индекс ММВБ опускался ниже 1655 пунктов, теряя в моменте около 1,5 %. Однако превысившая ожидания статистика в США и последовавший отскок на американском рынке акций способствовал внутридневному развороту наверх и у нас. К закрытию индекс ММВБ сократил свои потери до -0,46 % (1671,10 пунктов). Среди наиболее ликвидных бумаг вышли в «плюс» акции Роснефти (+0,78 %), Северстали (+0,49 %) и ВТБ (+0,17 %).

Американский рынок акций вчера получил опору в виде оказавшихся лучше ожиданий данных с рынка труда (число первичных заявок на пособие по безработице снизилось на 16 тыс., ожидалось снижение на 7 тыс.). Количество домов, начатых постройкой выросло в мае на 3,5 % м/м, а разрешений на строительство – на 8,7 % м/м, также заметно превысив прогнозы. Впрочем, за последние 2 года в новом строительсвте неоднократно наблюдались подобные «отскоки», но продолжения они не получали, и в абсолютных цифрах оба показателя по-прежнему остаются недалеко от «дна». Индекс DJIA в итоге вырос на 0,54 %, S&P 500 прибавил 0,18 %, а Nasdaq Composite снизился на 0,3 %.

Вчерашняя динамика российского рынка акций показала, что он сохраняет определенную устойчивость, сильных распродаж не наблюдается. Однако в условиях сохраняющихся сугубо негативных настроений на внешних рынках (азиатские индексы, фьючерсы на американские индексы и котировки большинства сырьевых активов дружно снижаются) на отскок наверх рассчитывать трудно. В связи с этим ожидаем сегодня дальнейшего умеренного снижения российских индексов.



Моисеев Алексей
+7 (812) 329 8181 (доб. 1286)
a.moiseev@bfa.ru

Макроэкономическая статистика

Источник: Reuters

Дата	Время	Страна	Показатель	Период	Факт	Прогноз	Пред.	Пересм.
16 июн	12:30	GB	Роз. продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Май	-1.4	-0,6	1,1	
16 июн	12:30	GB	Роз. продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Май	0,2	1,5	2,8	2,4
16 июн	13:00	EZ	Индекс потребит. цен м/м, % (CPI m/m)	Май	0,0		0,6	
16 июн	13:00	EZ	Индекс потребит. цен г/г, % (CPI y/y)	Май	2,7	2,7	2,7	
16 июн	13:00	EZ	Индекс потребит. цен без продов./энер. м/м, % (CPI ex food / energy m/m)	Май	0,1	0,1	0,5	
16 июн	13:00	EZ	Индекс потребит. цен без продов./энер. г/г, % (CPI ex food / energy y/y)	Май	1,7	1,6	1,8	
16 июн	16:00	RU	Пром. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Май	4,1	4,2	4,5	
16 июн	16:30	US	Первичная безработица, тыс. (Initial jobless claims)	до 11 июн.	414	420	427	430
16 июн	16:30	US	Длящаяся безработица, млн. (Continuing claims)	до 04 июн.	3,675	3,650	3,676	3,696
16 июн	16:30	US	Разрешения на строительство, млн. (Building permits)	Май	0,612	0,558	0,563	
16 июн	16:30	US	Разрешения на строительство м/м, % (Building permits m/m)	Май	8,7		-1,9	
16 июн	16:30	US	Новое строительство, млн. (Housing starts)	Май	0,560	0,540	0,523	0,541
16 июн	16:30	US	Новое строительство м/м, % (Housing starts m/m)	Май	3,5		-10,6	-8,8
16 июн	16:30	US	Счет текущих операций, $ млрд. (Current account)	1 кв.	-119.3	-126	-113	-112
16 июн	18:30	US	Запасы газа: нед/нед, млрд. куб. ф (EIA weekly natural gas)	до 10 июн.	69	70	80	
16 июн	-	RU	Международн. резервы, $ млрд. (Central Bank reserves)	до 10 июн.	528,0		522,8	
17 июн	13:00	EZ	Торговый баланс, млрд. евро (Trade balance)	Апр		-2,1	2,8	
17 июн	15:30	IN	Денежный агрегат М3 2 нед.г/ 2 нед.г, % (M3 money supply)				16,8	
17 июн	15:30	IN	Золотовалютн. резервы, $ млрд. (Foreign reserves)	до 10 июн.			312,90	
17 июн	16:30	CA	Оптовые продажи м/м, % (Wholesale trade m/m)	Апр		-0,2	0,1	
17 июн	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. окончат. (U. of Michigan Conf, F)	Июн		74,0	74,3	
17 июн	17:55	US	Индекс потреб. доверия Мичиг. универ. предв. (U. of Michigan Conf, A)	Июн		74,0	74,3	
17 июн	18:00	US	Индекс опереж. индикаторов м/м, % (Leading indicators m/m)	Май		0,2	-0,3	
17 июн	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI (ECRI U.S. Weekly Leading Index)	до 10 июн.			127,7	
17 июн	18:30	US	Индекс опереж. индикаторов ECRI WLI г/г, % (ECRI Weekly Leading Index y/y)	до 10 июн.			4,1	
20 июн	3:50	JP	Торговый баланс, млрд. иен (Trade balance total)	Май			-463,7	
20 июн	3:50	JP	Объем экспорта г/г, % (Exports y/y)	Май			-12,5	
20 июн	3:50	JP	Объем импорта г/г, % (Imports y/y)	Май			8,9	
20 июн	10:00	DE	Индекс цен производит. м/м, % (Producer prices m/m)	Май		0,2	1,0	
20 июн	10:00	DE	Индекс цен производит. г/г, % (Producer prices y/y)	Май		6,3	6,4	
20 июн	12:00	EZ	Счет текущих операций сезонно скоррект., млрд. евро (Current account sa)	Апр		-6,6	-4,7	
20 июн	12:00	EZ	Счет текущих операций сезонно нескоррект., млрд. евро (Current account nsa)	Апр		-6,6	-3,8	

Инвестиционная компания БФА

197101, Санкт-Петербург, Петроградская наб., д. 36, лит. А, б/ц «Линкор»

Тел.: +7 (812) 329 8181 (основной)
Факс: +7 (812) 329 8180

info@bfa.ru
www.bfa.ru

Аналитический отдел research@bfa.ru

Дёмин Денис доб. 1284
начальник отдела d.demin@bfa.ru

Моисеев Алексей доб. 1286
заместитель начальника отдела a.moiseev@bfa.ru

Куриленко Кирилл доб. 1280
ведущий аналитик k.kurilenko@bfa.ru

Казанцев Сергей доб. 1281
аналитик s.kazantsev@bfa.ru

Дорофейкин Олег доб. 1222
аналитик o.dorofeykin@bfa.ru

Иванова Ольга доб. 1241
аналитик o.ivanova@bfa.ru

Управление продаж

Думчева Анна прямой +7 (812) 326 9361, доб. 1088
начальник управления a.dumcheva@bfa.ru

Тапинов Петр прямой +7 (812) 611 0064, доб. 1032
старший специалист p.tapinov@bfa.ru

Виноградов Кирилл доб. 1144
специалист k.vinogradov@bfa.ru

Отдел структурных продуктов

Малев Всеволод прямой +7 (812) 322 5899, доб. 1293
начальник отдела v.malev@bfa.ru

Народовый Роман прямой +7 (812) 329 8198, доб. 1168
старший трейдер r.narodovyy@bfa.ru

Деордиев Александр доб. 1092
трейдер a.deordiev@bfa.ru

Пашков Алексей доб. 1147
аналитик a.pashkov@bfa.ru

Отдел рынков акций

Мун Михаил прямой +7 (812) 329 8194, доб. 1051
начальник отдела m.mun@bfa.ru

Анастасов Антон доб. 1052
трейдер a.anastasov@bfa.ru

Широков Станислав доб. 1053
помощник трейдера s.shirokov@bfa.ru

Отдел брокерских операций прямой +7 (812) 329 8199

Иванов Николай прямой +7 (812) 329 8195, доб. 1235
Начальник отдела n.ivanov@bfa.ru

Мишарев Андрей прямой +7 (812) 329 8195, доб. 1199
заместитель начальник отдела a.misharev@bfa.ru

Управление по работе с клиентами client@bfa.ru

Константинова Виктория прямой +7 (812) 329 8191, доб. 1191
начальник управления v.konstantinova@bfa.ru

Настоящий документ подготовлен аналитическим отделом ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и носит исключительно информационный характер. Все оценки и мнения, высказанные в отчете, представляют собой независимое суждение аналитиков на дату выхода отчета. Вознаграждение авторов отчета ни прямым, ни косвенным образом не увязано с представленными в отчете точками зрения. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» оставляет за собой право изменять высказанные оценки и мнения в любое время без предварительного уведомления.
Информация, содержащаяся в отчете, получена из источников, признаваемых нами достоверными, однако не существует никаких гарантий, что указанная информация является полной и точной и, соответственно, она не должна рассматриваться как полная и точная. Мы оставляем за собой право не обновлять информацию на основе новых данных либо полностью отказаться от ее освещения.
ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и его сотрудники могут инвестировать, выступать маркет-мейкером или совершать иные сделки в качестве принципала с инвестиционными инструментами, упомянутыми в настоящем отчете. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» проводит внутреннюю политику, направленную на предотвращение потенциальных конфликтов интересов.
ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и его сотрудники не несут ответственности за прямой или косвенный ущерб, наступивший в результате использования настоящей публикации или ее содержания.

© Закрытое акционерное общество «Балтийское Финансовое Агентство»