Индикаторы рынка акций

РОССИЯ / РЫНОК АКЦИЙ
12.07.2011

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
ММВБ	1701,48	-1,34%	-0,27%
РТС	1919,08	-2,01%	-1,51%
MSCI Russia	1003,277	-2,40%	-2,22%
MSCI EM	1142,82	-1,81%	-2,28%
S&P 500	1343,8	0,00%	0,31%
VIX	15,95	0,00%	#ЗНАЧ!
DJ Euro Stoxx 600	282	-3,27%	-5,57%
FTSE 100	5929,16	-1,03%	-1,47%
DAX 30	7230,25	-2,33%	-2,86%
NIKKEI 225	9927,99	-1,41%	-0,45%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2764,34	-1,37%	-1,85%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,36	-3,59	-11,49
UST 10 YTM, %	2,92	-10,62	-25,80
UST 10 - TIPS 10, б.п.		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	392,65	29,16	63,98
Russia 30 YTM, %	4,44	3,70	-1,60
Russia 5Y CDS, б.п.	154,42	10,93	15,43
Libor 3m USD, %	0,2461	0,00	0,03
Libor 12m USD, %	0,7348	-0,10	0,02
USD/RUB NDF 3m, %	3,92	7,00	-6,00
USD/RUB NDF 12m, %	4,52	5,00	-2,00
RUB overnight, %	3,55	15,00	55,00
Mosprime 3m, %	4,25	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	76,37	1,14%	2,42%
EUR/USD		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
USD/JPY		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
GBP/USD		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
AUD/USD		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
USD/CAD		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
USD/CNY		#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
корзина (EUR+USD)/RUB	33,35	-0,13%	-0,35%
USD/RUB ЦБ	28,18	0,00%	0,00%
EUR/RUB ЦБ	40,05	0,00%	0,00%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	95,15	-1,09%	#ЗНАЧ!
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	117,24	-0,92%	5,25%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,288	1,97%	-0,53%
золото, USD/ун.	1553,6	0,74%	3,88%
серебро, USD/ун.	35,750	-2,40%	4,90%

Прогноз

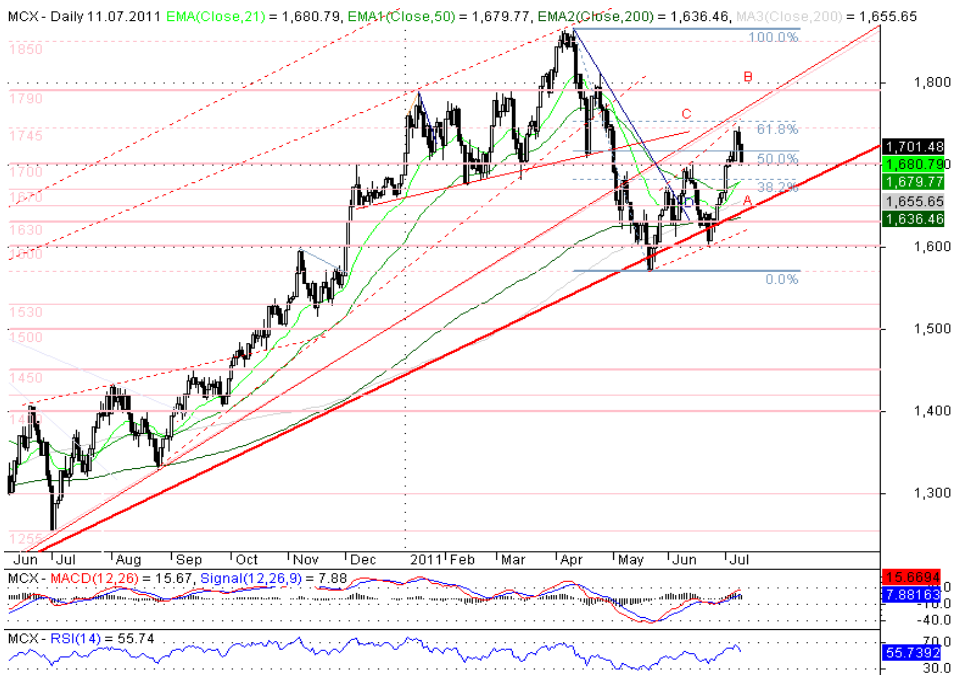
Финансовые рынки второй день подряд остаются под давлением страхов распространения острой фазы долгового кризиса на Италию. На этом фоне индекс ММВБ продолжает коррекцию, следующая поддержка – 1670 пунктов.

Российский рынок

В понедельник, 11 июля, российский рынок акций с утра попытался удержаться на уровнях закрытия пятницы. Однако сугубо негативные настроения на внешних рынках не позволили этого сделать, и отечественные индексы в течение большей части сессии планомерно снижались, индекс ММВБ к вечеру снизился до 1701,48 пунктов (-1,34 %). Опережающими темпами снижались котировки Сбербанка (-2,67 % обычка, -1,67 % префы) и Газпрома (-1,7 %). Впрочем, отдельные бумаги в разных секторах оказались по итогам дня в «плюсе» - выделим обычку и префы Ростелекома (+3,36 % и +1,05 % соответственно), ГМК Норильский Никель (+0,57 %) и ВТБ (+0,5 %).

Основным негативным драйвером для мировых рынков стали опасения дальнейшего обострения долгового кризиса в Еврозоне: в фокусе внимания оказалась Италия после ряда статей в СМИ, высказавших сомнения в способности банков страны пройти стресс-тесты. На этом фоне пара евро-доллар ушла в крутое пике, сегодня ночью опустившись ниже отметки 1,40, европейские индексы потеряли в среднем более 2 %. Общемировой негативный настрой в полной мере отразился и на ходе торгов в США, индексы понесли существенные потери: DJIA -1,2 %, S&P 500 -1,81 %, NASDAQ Composite -2,0 %.

После закрытия американской сессии с финансовых результатов Alcoa за второй квартал начался сезон отчетностей в США. Чистая прибыль алюминиевого гиганта выросла в 2,4 раза по сравнению с аналогичным периодом прошлого года, совпав с ожиданиями аналитиков. На настроения рынка эти результаты существенно не повлияли, сегодня фьючерсы на американские индексы вновь снижаются, теряя более полупроцента. Российский рынок открылся ниже 1700 пунктов по индексу ММВБ, и продолжает коррекцию, ожидаем увидеть его в районе 1670 пунктов.



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.
11 июл	9:00	JP	Индекс потребит. доверия (Consumer confidence)	Июн	35,3		34,2	
11 июл	10:45	FR	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Май	2,0	0,5	-0,3	-0,5
12 июл	7:30	JP	Ставка Банка Японии (BoJP rate decision)	-	0-0.1		0,10	
12 июл	9:30	IN	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Май		8,2	6,3	
12 июл	10:00	DE	Индекс потребит. цен окончат. м/м, % (CPI m/m F)	Июн		0,1	0,1	
12 июл	10:00	DE	Индекс потребит. цен окончат. г/г, % (CPI y/y F)	Июн		2,3	2,3	
12 июл	10:45	FR	Счет текущих операций, млрд. евро (Current account)	Май			-4,8	
12 июл	12:30	GB	Индекс потребит. цен м/м, % (CPI m/m)	Июн		0,2	0,2	
12 июл	12:30	GB	Индекс потребит. цен г/г, % (CPI y/y)	Июн		4,5	4,5	
12 июл	12:30	GB	Торговый баланс, £ млрд. (Trade balance)	Май		-7,370	-7,390	
12 июл	12:30	GB	Торговый баланс без стран ЕС, £ млрд. (Non-EU trade balance)	Май		-4,300	-4,340	
12 июл	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC нед/нед, % (ICSC chain store sales w/w)	до 09 июл.			1,5	
12 июл	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC г/г, % (ICSC chain store sales y/y)	до 09 июл.			3,5	
12 июл	16:00	BR	Розничные продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Май		0,5	-0,2	
12 июл	16:30	US	Торговый баланс, $ млрд. (Trade balance)	Май		-44,00	-43,70	
12 июл	16:30	CA	Объем экспорта, C$ млрд. (Exports)	Май		36,50	36,30	
12 июл	16:30	CA	Объем импорта, C$ млрд. (Imports)	Май		37,20	37,20	
12 июл	16:30	CA	Торговый баланс, C$ млрд. (Trade balance)	Май		-0,70	-0,92	
12 июл	16:55	US	Redbook: розничные продажи м/м, % (Redbook m/m)	до 09 июл.			0,9	
12 июл	16:55	US	Redbook: розничные продажи г/г, % (Redbook y/y)	до 09 июл.			5,2	
12 июл	-	CN	Денежный агрегат M2 г/г, % (M2 money supply y/y)	Июн	15,9	15,2	15,1	
12 июл	-	CN	Золотовалютн. резервы, $ млрд. (Foreign reserves)	2 кв.	3,20	3,22	3,05	
12 июл	-	RU	Торговый баланс ЦБ, $ млрд. (Trade balance)	Май	16,60		19,30	
13 июл	0:30	US	Запасы нефти API: нед/нед, млн. барр. (API weekly crude stocks)	до 08 июл.		-2,000	-3,172	
13 июл	0:30	US	Запасы бензина API: нед/нед, млн. барр. (API weekly gasoline stocks)	до 08 июл.		0,400	-1,914	
13 июл	0:30	US	Запасы дистилл. API: нед/нед, млн. барр. (API weekly dist stocks)	до 08 июл.		0,600	-1,625	
13 июл	6:00	CN	ВВП г/г, % (GDP y/y)	2 кв.		9,4	9,7	
13 июл	6:00	CN	Пром. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Июн		13,1	13,3	
13 июл	6:00	CN	Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Июн		17,0	16,9	
13 июл	8:30	JP	Загрузка произв. мощностей м/м, % (Capacity utilization m/m)	Май			-1,1	
13 июл	8:30	JP	Пром. производство окончат. м/м, % (Industrial production m/m F)	Май			5,7	
13 июл	10:00	DE	Оптовые цены м/м, % (Wholesale price index m/m)	Июн		-0,4		
13 июл	10:00	DE	Оптовые цены г/г, % (Wholesale price index y/y)	Июн		8,7	8,9	
13 июл	12:30	GB	Уровень безработицы, % (ILO Unemployment rate, 3M)	Май		7,7	7,7	
13 июл	12:30	GB	Число безработных м/м, тыс. (Jobless claims change m/m)	Июн		15,0	19,6	
13 июл	13:00	EZ	Промышл. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Май		0,5	0,2	
13 июл	13:00	EZ	Промышл. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Май		4,8	5,2	
13 июл	16:30	US	Цены экспорта м/м, % Export prices m/m)	Июн		0,2	0,2	
13 июл	16:30	US	Цены импорта м/м, % (Import prices m/m)	Июн		-0,6	0,2	
13 июл	18:30	US	Запасы нефти: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude stocks)	до 08 июл.		-2,000	-0,900	
13 июл	18:30	US	Запасы бензина: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly gasoline stocks)	до 08 июл.		0,400	-0,600	
13 июл	18:30	US	Запасы дистилл.: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly dist stocks)	до 08 июл.		0,600	-0,200	
13 июл	18:30	US	Запасы нефти в Кушинге: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude Cushing)	до 08 июл.			-0,460	
13 июл	22:00	US	Государств. бюджет, $ млрд. (Federal Budget)	Июн		-65,00	-57,64	

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»