

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
MMVB	1735,01	-0,94%	-0,71%
PTC	1885,53	-1,36%	0,04%
MSCI Russia	976,278	-1,72%	-0,04%
MSCI EM	1126,29	-1,36%	-0,91%
S&P 500	1276,34	-1,79%	-0,55%
VIX	20,04	24,09%	8,50%
DJ Euro Stoxx 600	285,38	-1,63%	0,01%
FTSE 100	5881,37	-1,40%	-0,25%
DAX 30	7102,8	-0,74%	0,57%
NIKKEI 225	10237,92	-1,18%	-1,04%
SSE Composite (на 09:00 МСК)	2779,54	0,97%	3,11%

	Закр.	Изм. день, б.п.	Изм. нед., б.п.
UST 2 YTM, %	0,55	-4,03	-6,01
UST 10 YTM, %	3,33	-6,08	-8,26
UST 10 - TIPS 10, б.п.	2,36	-6,82	-3,69
iTraxx Crossover Europe 5Y, б.п.	299,65	0,00	12,48
Russia 30 YTM, %	4,90	9,30	3,40
Russia 5Y CDS, б.п.	143,17	0,00	2,00
Libor 3m USD, %	0,3044	0,00	0,12
Libor 12m USD, %	0,7806	-0,06	0,00
USD/RUB NDF 3m, %	3,63	1,00	24,00
USD/RUB NDF 12m, %	5,00	1,00	15,00
RUB overnight, %	2,5	50,00	50,00
Mosprime 3m, %	4,00	0,00	0,00

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
USD Index	78,28	0,55%	-0,11%
EUR/USD	1,3613	-0,82%	-0,01%
USD/JPY	82,1	-0,92%	-0,58%
GBP/USD	1,5860	-0,38%	-0,88%
AUD/USD	0,9931	0,18%	0,40%
USD/CAD	1,0001	0,70%	0,63%
USD/CNY	6,5819	0,00%	-0,02%
корзина (EUR+USD)/RUB	34,64	0,19%	-0,24%
USD/RUB ЦБ	29,67	-0,35%	-0,81%
EUR/RUB ЦБ	40,62	-0,24%	1,02%

	Закр.	Изм. день, %	Изм. нед., %
нефть WTI, USD/барр. (ICE)	89,34	4,32%	0,26%
нефть Brent, USD/барр. (ICE)	99,42	2,08%	1,86%
нат. газ, USD/BTU (ICE)	4,323	0,16%	-8,72%
золото, USD/ун.	1334,8	1,81%	-0,54%
серебро, USD/ун.	27,960	4,02%	1,90%

Прогноз

Ожидаем на российском рынке продолжение снижения котировок вслед за мировыми фондовыми индексами, которое частично будет демпфироваться ростом цен на нефть

Сегодня

- Статистика: оценка индекса потребительских цен в еврозоне, личные доходы-расходы в США, чикагский индекс деловой активности

Зарубежные рынки

В пятницу на американском фондовом рынке произошел настоящий обвал (DJIA -1,39 %, S&P500 -1,79 %. NASDAQ -2,48 %), вызванный не столько публикацией слабых данных по ВВП США (в 4 кв. +3,2 % вместо ожидаемых +3,5 %), сколько усилением политической нестабильности в Египте и опасениями возникновения возможных конфликтов и на соседнем Ближнем Востоке. В Европе продажи на фондовых рынках носили менее массовый характер (FTSE100 -1,4 %, CAC40 -1,41 %, DAX -0,74 %) в силу временной разницы с США. Рост в пятницу наблюдался только на товарных рынках: цены на европейскую нефть подскочили почти до 100 долл. за баррель (+2 %), на американскую – почти до 90 долл. за баррель (+4,5 %), где игроки отыгрывали возможную угрозу сокращения поставок нефти с Ближнего Востока в случае перекидывания волнений в регион с африканского континента.

С утра азиатские индексы вслед за США демонстрируют сильное снижение (-1-2 %), за исключением китайского SSE COMPOSITE (+1 %). Фьючерсы на американские пока стоят в нулях, а цены на нефть немного корректируются вниз (до -0,3 %) после пятничного ралли.

Сейчас развитие событий на мировых фондовых рынках во многом будет зависеть от ситуации в Египте. Реакция инвесторов на новостной фон из Египта может быть очень разной: сильное падение в любой момент может смениться ростом, а может вылить и в существенную коррекцию

Российский рынок

В пятницу российский рынок долго балансировал в небольшом минусе, индекс ММВБ изменялся в диапазоне 1740 – 1748 пунктов. К вечеру падение ускорилось, после того как мировые фондовые индексы устремились вниз на фоне восстания в Египте. Впрочем, второе прямое следствие нестабильности в Северной Африке – взлет цен на нефть – частично поддержало котировки российских бумаг. В итоге к концу сессии индекс ММВБ снизился до 1735,01 пунктов (-0,94 %).

Сегодня ожидаем на российском рынке продолжения снижения котировок, которое, однако, как и в пятницу будет демпфироваться ростом цен на нефть. Ближайшей поддержкой остается отметка 1700 пунктов по индексу ММВБ. Увидим ли мы попытку пробить ее – будет зависеть как от развития ситуации в Египте, так и от сегодняшнего заседания ЦБ РФ. Довольно вероятное решение о повышении ставок стало бы дополнительным негативом для рынка

Моисеев Алексей

+7 (812) 329 8181 (доб. 1286)

a.moiseev@bfa.ru

Микрюкова Мария

+7 (812) 329 8181 (доб. 1105)

m.mikryukova@bfa.ru

Железняк Максим

+7 (812) 329 8181 (доб. 1154)

m.zheleznyak@bfa.ru

Макроэкономическая статистика

Источник: Reuters

Дата	Время	Страна	Показатель	Период	Факт	Прогноз	Пред.	Пересм.
31 янв	2:50	JP	Пром. производство предварит. м/м, % (Industrial production m/m P)	Дек	3,1	2,9	1,0	
31 янв	8:00	JP	Заказы на строительство г/г, % (Construction orders y/y)	Дек	13,1		-5,3	
31 янв	8:00	JP	Новое строительство г/г, % (Housing starts y/y)	Дек	7,5	4,6	6,8	
31 янв	10:00	DE	Розничные продажи м/м, % (Retail sales m/m)	Дек		2,0		
31 янв	10:00	DE	Розничные продажи г/г, % (Retail sales y/y)	Дек		1,1		
31 янв	13:00	EZ	Оценка индекса потребит. цен г/г, % (CPI estimate y/y)	Янв		2,3	2,2	
31 янв	16:30	US	Базовый индекс потреб. расходов м/м, % (Core PCE price index m/m)	Дек		0,1	0,1	
31 янв	16:30	US	Базовый индекс потреб. расходов г/г, % (Core PCE price index y/y)	Дек			0,8	
31 янв	16:30	US	Дефлятор потреб. расходов г/г, % (PCE price index y/y)	Дек			1,0	
31 янв	16:30	US	Личные доходы м/м, % (Personal income m/m)	Дек		0,4	0,3	
31 янв	16:30	US	Личные расходы м/м, % (Personal spending m/m)	Дек		0,5	0,3	
31 янв	16:30	CA	Индекс цен производит. м/м, % (PPI m/m)	Дек		0,6	0,5	
31 янв	16:30	CA	Индекс цен производит. г/г, % (PPI y/y)	Дек			2,1	
31 янв	16:30	CA	ВВП м/м, % (GDP m/m)	Ноя		0,3	0,2	
31 янв	17:45	US	Чикагский индекс деловой активности (Chicago PMI)	Янв		65,0	66,8	
1 фев	6:30	AU	Ставка Банка Австралии, % (RBA Cash Target Rate)	-		4,75	4,75	
1 фев	9:30	IN	Дефицит торг. баланса, \$ млрд. (Trade deficit)	Дек			8,90	
1 фев	10:00	GB	Индекс цен на жилье Nationwide м/м, % (Nationwide house price m/m)	Янв		-0,4	0,4	
1 фев	10:00	GB	Индекс цен на жилье Nationwide г/г, % (Nationwide house price y/y)	Янв		-1,0	0,4	
1 фев	10:45	FR	Индекс цен производит. м/м, % (Producer prices m/m)	Дек		0,6	0,4	
1 фев	11:48	FR	Индекс деловой активности в пром. окончат. (PMI Manufacturing F)	Янв		54,3	54,3	
1 фев	11:53	DE	Индекс деловой активности в пром. окончат. (PMI Manufacturing F)	Янв		60,2	60,2	
1 фев	11:58	EZ	Индекс деловой активности в пром. окончат. (PMI Manufacturing F)	Янв		56,9	56,9	
1 фев	12:00	DE	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Янв		7,5	7,5	
1 фев	12:00	DE	Число безработных м/м, тыс. (Unemployment change m/m)	Янв		-10,0	3,0	
1 фев	12:28	GB	Индекс деловой активности в промышл. (PMI Manufacturing)	Янв		57,9	58,3	
1 фев	12:30	GB	Потреб. кредитование, £ млрд. (BoE consumer credit)	Дек			-0,120	
1 фев	12:30	GB	Чистое кредит-ие на покупку жилья, £ млрд. (Mortgage lending)	Дек		0,600	0,800	
1 фев	12:30	GB	Одобр. заявки на жилищные кредиты, тыс. (Mortgage approvals)	Дек		47,00	48,02	
1 фев	13:00	EZ	Уровень безработицы, % (Unemployment rate)	Дек		10,1	10,1	
1 фев	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC нед/нед, % (ICSC chain store sales w/w)	до 29 янв.			-1,2	
1 фев	15:45	US	Розничные продажи сети ICSC г/г, % (ICSC chain store sales y/y)	до 29 янв.			2,8	
1 фев	16:55	US	Redbook: розничные продажи м/м, % (Redbook m/m)	до 29 янв.			-0,7	
1 фев	16:55	US	Redbook: розничные продажи г/г, % (Redbook y/y)	до 29 янв.			2,3	
1 фев	18:00	US	Индекс деловой активности ISM в произв. секторе (ISM Manufacturing)	Янв		58,0	57,0	
1 фев	18:00	US	Индекс цен в произв. секторе ISM (ISM Mfg Prices Paid)	Янв		73,2	72,5	
1 фев	18:00	US	Расходы на строительство м/м, % (Constriction spending m/m)	Дек			0,4	
2 фев	0:30	US	Запасы нефти API: нед/нед, млн. барр. (API weekly crude stocks)	до 28 янв.			2,120	
2 фев	0:30	US	Запасы бензина API: нед/нед, млн. барр. (API weekly gasoline stocks)	до 28 янв.			1,720	
2 фев	0:30	US	Запасы дистилл. API: нед/нед, млн. барр. (API weekly dist stocks)	до 28 янв.			-5,022	
2 фев	13:00	EZ	Индекс цен производит. м/м, % (PPI m/m)	Дек		0,7	0,3	
2 фев	13:00	EZ	Индекс цен производит. г/г, % (PPI y/y)	Дек		5,2	4,5	
2 фев	14:00	BR	Пром. производство м/м, % (Industrial production m/m)	Дек			-0,1	
2 фев	14:00	BR	Пром. производство г/г, % (Industrial production y/y)	Дек			5,3	
2 фев	16:15	US	Новые рабочие места в нес/х секторе - ADP, тыс. (ADP National Empl Report)	Янв		148	297	
2 фев	18:30	US	Запасы нефти: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude stocks)	до 28 янв.			4,800	
2 фев	18:30	US	Запасы бензина: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly gasoline stocks)	до 28 янв.			2,400	
2 фев	18:30	US	Запасы дистилл.: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly dist stocks)	до 28 янв.			-0,100	
2 фев	18:30	US	Запасы нефти в Кушинге: нед/нед, млн. барр. (EIA weekly crude Cushing)	до 28 янв.			0,862	

