

Ежедневный обзор мирового рынка акций

15 ноября 2011 г.

На рынках акций США по итогам сессии наблюдалось снижение котировок. Хуже рынка были акции нефтегазового и финансового секторов. Индекс S&P 500 потерял 0.96%, индекс акций малой капитализации Russell 2000 – 1.58%. Индекс волатильности VIX повысился на 3.63% до 31.13 п. Грозные заявления Меркель относительно возможности «запуска» единых евробондов европейским антикризисным механизмом оказали давление на долговой рынок – доходность 5-летних итальянских облигаций вновь выросла до 6.29% с 5.32%. В Европе плохие данные по промышленному производству в преддверии выхода ВВП также придали уверенности пессимистам. Член ФРС Фишер выразил уверенность в том, что экономика США будет наращивать темпы роста в следующем году и сомнения в том, что есть необходимость идти на дальнейшее смягчение монетарной политики.

На политической арене тон задавали продолжающиеся дебаты относительно возможности установления жалования на уровне правительственных чиновников сотрудником ипотечных агентств Fannie Mae и Freddie Mac.

Из 430 компаний индекса S&P 500, представивших финансовую отчетность за III квартал, чистая прибыль 314 превысила оценки аналитиков. В Европе из 299 компаний отчетность по прибыли 143 оказалась лучше ожиданий, 131 – разочаровали инвесторов.

На азиатских биржах во вторник преобладал пессимизм – австралийский S&P/ASX 200 потерял 0.44% после публикации стенограмм ЦБ Австралии. Регулятор намерен придерживаться политики «осторожного смягчения» на фоне усилившихся рисков экономического замедления и слабой инфляции. Корейский Kospі потерял 1.03%, гонконгский Hang Seng – 1.09%. Японский Nikkei потерял 0.78%. Индексы шанхайской биржи в среднем не изменились – сообщение о продаже 10% акций China Construction Bank со стороны Bank of America не оказало влияния на финансовый сектор. МВФ призвал официальные власти Китая обратить внимание на «рост забалансового кредитования в условиях возможного снижения цен на недвижимость».

Основные индикаторы рынка		
CDS HY 5Y	718.91	-1.17%
ITX Crossover Euro	600.64	+2.97%
CDS Japan 5Y	109.58	-4.25%
CDS EM 5Y	108.84	-0.21%
CDS Russia 5Y	231.64	+2.85%
US Tsys 10Y	2.52%	+0.11%
US Tsys 5Y	1.22%	+0.04%
Brazil 10Y	3.12%	+0.00%
Germany 10Y	1.43%	+0.85%
EUR/USD	1.3603	-0.13%
USD/JPY	77.11	-0.08%
EUR/GBP	0.8566	+0.02%
Oil Brent	112.21	+0.29%
Gold	1770.6	-0.44%
Copper	7760	+1.58%
Nickel	17801	-1.49%
S&P 500	1248.25	-0.34%
Russell 2000	732.89	-1.58%
Bovespa	58258.23	-0.49%
Topix	732	-0.61%
Shanghai Comp	2,527.50	-0.05%
S&P/ASX 300	4,281.70	-0.53%
Sensex 30	17,107.49	-0.07%
Bovespa	58,258.23	-0.49%
DJ Euro Stoxx 50 Fu	2290	-1.29%
CAC Futures	3109	-1.18%
DAX Futures	6001	-0.79%
CBOE Put/Call	0.77	+2.67%
CBOE Buy/Write M	821.45	-0.11%
VIX	31.13	+3.63%
VSTOXX	40.1517	+1.57%

*На 10:00 мск, по данным Bloomberg

Сегодня в Европе интерес будет представлять аукцион по казначейским облигациям Испании, данные по ВВП Еврозоны за III квартал, индексам экономической уверенности ZEW Германии и Еврозоны за ноябрь, а также данные по внешнеторговому балансу Еврозоны за октябрь. В Еврокомиссии будет обсуждаться вопрос об ограничении «свободы слова» рейтинговых агентств с целью «предотвращения финансового хаоса» в определенных обстоятельствах.

В США выйдет статистика по индексу промышленных цен за октябрь, розничным продажам, индексу активности в производстве ФРБ Нью-Йорка Empire State Manufacturing, деловым запасам за сентябрь.

ФРС приобретет казначейских облигаций на \$5 млрд. Выступят члены ФРС Эванс и Фишер.

Кроме того, продолжится сезон отчетности – выпустят отчет 8 компаний индекса S&P 500 и 13 компаний индекса Bloomberg Europe 500.

Подиндекс		
S&P 500		Изм.
CONS DISCRET	309.21	+0.10%
CONS STAPLES	321.38	+0.02%
ENERGY	528.40	-0.67%
FINANCIALS	174.16	-2.94%
HEALTH CARE	390.74	+0.47%
INDUSTRIALS	289.11	-0.12%
INFO TECH	420.38	-1.01%
MATERIALS	218.95	-1.37%
TELECOM SERV	124.77	-0.80%
UTILITIES	176.72	-0.91%

Наиболее активные акции в США*		
VALERO ENERGY	24.43	-4.61%
QEP RESOURCES IN	34.21	-4.49%
FEDERATED INV-B	16.91	-3.32%
DR HORTON INC	11.28	-3.26%
TELLABS INC	4.23	-3.20%
REGIONS FINANCIA	4.02	-2.90%
TESORO CORP	27.18	-2.44%
DR PEPPER SNAPPL	36.53	-2.33%
CITRIX SYSTEMS	74.58	+4.91%
OWENS-ILLINOIS	20.77	+5.06%
CORNING INC	15.34	+5.28%
RYDER SYSTEM INC	52.99	+5.62%
STAPLES INC	15.37	+5.71%
AK STEEL HLDG	9.14	+6.90%
FORTUNE BRANDS	54.2	+29.36%

Ежедневный обзор

Eurostoxx 600		
SX3P	358.08	-0.25%
SX4P	490.33	-3.97%
SX6P	259.56	-3.55%
SX7P	130.04	-4.79%
SX86P	105.46	-1.01%
SX8P	197.57	-2.21%
SXAP	272.1	-5.68%
SXDP	394.3	-1.10%
SXEP	322.07	+0.05%
SXFP	210.3	-1.42%
SXIP	129.04	-6.00%
SXKP	248.14	-1.97%
SXMP	155.44	-2.64%
SXNP	265.9	-3.63%
SXOP	221.09	-4.62%
SXPP	455.71	-0.15%
SXQP	408.97	-1.13%
SXRP	244.03	-1.72%
SXTP	108.12	-2.40%
SXXP	236.34	-2.42%

Наиболее активные акции в Европе*

GALP ENERGIA-B	13.38	-9.90%
HOCHTIEF AG	45.55	-7.59%
CAMPARI GROUP	5.31	-5.68%
MARINE HARVEST	2.46	-5.38%
INDRA SISTEMAS	11.06	-4.66%
SGL CARBON SE	44.32	-3.93%
HOME RETAIL GROU	81.1	-3.68%
MEYER BURGER TEC	18.05	-3.22%
DANSKE BANK A/S	74.5	+6.20%
KBC GROEP	13.53	+6.29%
AKER SOLUTIONS A	70.2	+6.53%
HUSQVARNA-B SHS	33.62	+7.72%
UBI BANCA SCPA	2.806	+9.18%
GN STORE NORD	48.1	+9.32%
DEXIA SA	0.391	+10.14%

Календарь макроэкономической статистики*						
Date Time		Event		Survey	Prior	Revised
11/14/2011 10:00	EC	Euro-Zone Ind. Prod. wda (YoY)	SEP	--	5.3%	5.6%
11/14/2011 10:00	EC	Euro-Zone Ind. Prod. sa (MoM)	SEP	--	1.2%	1.3%
11/14/2011 14:30	EC	ECB Calls for Bids in 7-Day Main				
11/14/2011 16:00	US	U.S. Fed to Purchase USD2.25-2.75				
11/15/2011	EC	ECB's Praet Speaks at Pension				
11/15/2011 05:00	US	Chicago Fed Conference on				
11/15/2011 07:00	GE	GDP nsa (YoY)	3Q P	--	--	--
11/15/2011 07:00	GE	GDP s.a. (QOQ)	3Q P	--	0.1%	--
11/15/2011 07:00	GE	GDP wda (YoY)	3Q P	--	--	--
11/15/2011 09:30	UK	CPI (MoM)	OCT	--	0.6%	--
11/15/2011 09:30	UK	CPI (YoY)	OCT	--	5.2%	--
11/15/2011 09:30	UK	Core CPI YOY	OCT	--	3.3%	--
11/15/2011 09:30	UK	Retail Price Index	OCT	--	237,9	--
11/15/2011 10:00	EC	Euro-Zone GDP s.a. (QoQ)	3Q A	--	0.2%	--
11/15/2011 10:00	EC	Euro-Zone GDP s.a. (YoY)	3Q A	--	1.6%	--
11/15/2011 10:00	EC	ZEW Survey (Econ. Sentiment)	NOV	--	-51,2	--
11/15/2011 10:00	EC	Euro-Zone Trade Balance sa	SEP	--	-1.0B	--
11/15/2011 10:00	EC	Euro-Zone Trade Balance	SEP	--	-3.4B	--
11/15/2011 10:00	GE	Zew Survey (Current Situation)	NOV	--	38,4	--
11/15/2011 10:00	GE	ZEW Survey (Econ. Sentiment)	NOV	--	-48,3	--
11/15/2011 10:15	EC	ECB Announces Allotment in 7-Day				
11/15/2011 13:30	US	Producer Price Index (MoM)	OCT	-0.2%	0.8%	--
11/15/2011 13:30	US	PPI Ex Food & Energy (MoM)	OCT	0.2%	0.2%	--
11/15/2011 13:30	US	Producer Price Index (YoY)	OCT	--	6.9%	--
11/15/2011 13:30	US	PPI Ex Food & Energy (YoY)	OCT	--	2.5%	--
11/15/2011 13:30	US	Advance Retail Sales	OCT	0.4%	1.1%	--
11/15/2011 13:30	US	Retail Sales Less Autos	OCT	0.3%	0.6%	--
11/15/2011 13:30	US	Retail Sales Ex Auto & Gas	OCT	--	0.5%	--
11/15/2011 13:30	US	Empire Manufacturing	NOV	-3	-8,48	--
11/15/2011 15:00	US	Business Inventories	SEP	0.4%	0.5%	--
11/15/2011 15:08	US	Fed's Williams Speaks in				
11/15/2011 16:00	US	U.S. Fed to Purchase USD4.25-5.00				
11/15/2011 17:30	US	Fed's Fisher Speaks on Too Big to				
11/16/2011 05:00	US	New York Fed's Dahlgren to Speak				
11/16/2011 07:00	EC	EU 25 New Car Registrations	OCT	--	0.7%	--
11/16/2011 10:00	EC	Euro-Zone CPI - Core (YoY)	OCT	--	1.6%	--
11/16/2011 10:00	EC	Euro-Zone CPI (MoM)	OCT	--	0.8%	--

Ежедневный обзор

11/16/2011 10:00	EC	Euro-Zone CPI (YoY)	OCT	--	3.0%	--
11/16/2011 12:00	US	MBA Mortgage Applications	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 13:30	US	Consumer Price Index (MoM)	OCT	0.0%	0.3%	--
11/16/2011 13:30	US	CPI Ex Food & Energy (MoM)	OCT	0.2%	0.1%	--
11/16/2011 13:30	US	Consumer Price Index (YoY)	OCT	--	3.9%	--
11/16/2011 13:30	US	CPI Ex Food & Energy (YoY)	OCT	--	2.0%	--
11/16/2011 13:30	US	Consumer Price Index NSA	OCT	--	226,889	--
11/16/2011 13:30	US	CPI Core Index SA	OCT	--	226,137	--
11/16/2011 14:00	US	Net Long-term TIC Flows	SEP	--	\$57.9B	--
11/16/2011 14:00	US	Total Net TIC Flows	SEP	--	\$89.6B	--
11/16/2011 14:15	US	Industrial Production	OCT	0.5%	0.2%	--
11/16/2011 14:15	US	Capacity Utilization	OCT	77.7%	77.4%	--
11/16/2011 15:00	US	NAHB Housing Market Index	NOV	17	18	--
11/16/2011 15:30	US	DOE U.S. Crude Oil Inventories	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE Cushing OK Crude Inventory	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE U.S. Distillate Inventory	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE U.S. Gasoline Inventories	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE U.S. Refinery Utilization	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE Crude Oil Implied Demand	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE Distillate Implied Demand	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 15:30	US	DOE Gasoline Implied Demand	NOV 11	--	--	--
11/16/2011 16:00	US	U.S. Fed to Sell USD8.00-8.75 Bln				
11/17/2011 02:00	CH	Conference Board China				
11/17/2011 10:00	EC	Construction Output SA MoM	SEP	--	0.2%	--
11/17/2011 10:00	EC	Construction Output WDA YoY	SEP	--	2.5%	--
11/17/2011 13:30	US	Housing Starts	OCT	605K	658K	--
11/17/2011 13:30	US	Housing Starts MOM%	OCT	-8.1%	--	--
11/17/2011 13:30	US	Building Permits	OCT	603K	594K	589K
11/17/2011 13:30	US	Initial Jobless Claims	NOV 11	--	--	--
11/17/2011 13:30	US	Building Permits MOM%	OCT	2.3%	-5.0%	--
11/17/2011 13:30	US	Continuing Claims	NOV 4	--	--	--
11/17/2011 14:45	US	Bloomberg Economic Expectations	NOV	--	-45	--
11/17/2011 14:45	US	Bloomberg Consumer Comfort	NOV 13	--	--	--
11/17/2011 15:00	US	Philadelphia Fed.	NOV	10	8,7	--
11/17/2011 15:30	US	EIA Natural Gas Storage Change	NOV 11	--	--	--
11/17/2011 16:00	US	U.S. Fed to Purchase USD4.25-5.00				
11/17/2011 17:30	US	Fed's Pinalto Speaks on Economy				
11/17/2011 18:00	US	U.S. to Sell 10-Year TIPS Reopening				
11/18/2011 01:35	CH	MNI Novemeber Flash Business				
11/18/2011 07:00	GE	Producer Prices (MoM)	OCT	--	0.3%	--
11/18/2011 07:00	GE	Producer Prices (YoY)	OCT	--	5.5%	--
11/18/2011 15:00	US	Leading Indicators	OCT	0.3%	0.2%	--
11/18/2011 16:00	US	U.S. Fed to Purchase USD2.25-2.75				

Ежедневный обзор

11/21/2011 09:00	EC	Euro-Zone Current Account nsa	SEP	--	-6.3B	--
11/21/2011 09:00	EC	ECB Euro-Zone Current Account SA	SEP	--	-5.0B	--
11/21/2011 13:30	US	Chicago Fed Nat Activity Index	OCT	--	-0,22	--
11/21/2011 14:30	EC	ECB Calls for Bids in 7-Day Main				
11/21/2011 15:00	US	Existing Home Sales	OCT	--	4.91M	--
11/21/2011 15:00	US	Existing Home Sales MoM	OCT	--	-3.0%	--
11/21/2011 16:00	US	U.S. Fed to Sell USD8.00-8.75 Bln				
11/21/2011 18:00	US	U.S. to Sell 2-Year Notes				
11/21/2011 19:00	US	U.S. Fed to Sell USD8.00-8.75 Bln				
11-15 NOV	CH	New Yuan Loans	OCT	500.0B	470.0B	--
11-15 NOV	CH	Money Supply - M0 (YoY)	OCT	--	12.7%	--
11-15 NOV	CH	Money Supply - M1 (YoY)	OCT	9.3%	8.9%	--
11-15 NOV	CH	Money Supply - M2 (YoY)	OCT	13.0%	13.0%	--
14-17 NOV	CH	Actual FDI (YoY)	OCT	--	7.9%	--
14-18 NOV	US	Mortgage Delinquencies	3Q	--	8.44%	--
14-18 NOV	US	MBA Mortgage Foreclosures	3Q	--	4.43%	--
16-18 NOV	US	Nat'l HC anti-fraud assoc. annual				
17-20 NOV	EC	Euro-Zone Consumer Confidence	NOV A	--	-19,9	--

Ежедневный обзор

Календарь отчетности, Европа*						
Компания	Тиккер	Дата	Время	Период	Факт	Консенсус
Hochtief AG	HOT GR	11/14/2011	6:00	Q3 2011		-0.36
Electrocomponents PLC	ECM LN	11/14/2011	7:00	S1 2012		
Davide Campari-Milano SpA	CPR IM	11/14/2011	10:00	Q3 2011		
ACS Actividades de Construccion y	ACS SM	11/14/2011	17:00	Q3 2011		0.32
Bilfinger Berger SE	GBF GR	11/14/2011		Q3 2011		1.457
Banca Popolare dell'Emilia Romagna Scrl	BPE IM	11/14/2011		Q3 2011		
Unione di Banche Italiane SCPA	UBI IM	11/14/2011		Q3 2011		0.043
Telekom Austria AG	TKA AV	11/14/2011		Q3 2011		0.16
Lonmin PLC	LMI LN	11/14/2011		Y 2011		0.849
UniCredit SpA	UCG IM	11/14/2011		Q3 2011		0.02
British Land Co PLC	BLND LN	11/15/2011	6:00	S1 2012		0.174
Aveva Group PLC	AVV LN	11/15/2011	7:00	S1 2012		0.268
Bouygues SA	ENT FP	11/15/2011	16:45	Q3 2011		1.89
Vienna Insurance Group AG Wiener	VIG AV	11/15/2011		Q3 2011		
Tecnicas Reunidas SA	TRE SM	11/15/2011		Q3 2011		0.653
Distribuidora Internacional de	DIA SM	11/15/2011		Q3 2011		0.07
Topdanmark A/S	TOP DC	11/15/2011		Q3 2011		9.234
Kabel Deutschland Holding AG	KD8 GR	11/15/2011		Q2 2012		0.253
Sonova Holding AG	SOON VX	11/15/2011		S1 2012		1.555
Burberry Group PLC	BRBY LN	11/15/2011		S1 2012		0.253
Vivendi SA	VIV FP	11/16/2011	Bef-mkt	Q3 2011		0.453
Infineon Technologies AG	IFX GR	11/16/2011	6:30	Y 2011		0.615
Dufry AG	DUFN SW	11/16/2011		Q3 2011		
London Stock Exchange Group PLC	LSE LN	11/16/2011		S1 2012		0.401
ICAP PLC	IAP LN	11/16/2011		S1 2012		0.194
Koninklijke Ahold NV	AH NA	11/17/2011		Q3 2011		0.195
Voestalpine AG	VOE AV	11/17/2011		Q2 2012		0.71
Investec PLC	INVP LN	11/17/2011		S1 2012		0.217
SABMiller PLC	SAB LN	11/17/2011		S1 2012		1.07
Cable & Wireless Worldwide PLC	CW/ LN	11/17/2011		S1 2012		0.024
National Grid PLC	NG/ LN	11/17/2011		S1 2012		0.22
OPAP SA	OPAP GA	11/21/2011		Q3 2011		0.49

Календарь отчетности, США*				
Компания	Тиккер	Дата	Время	Консенсус

Ежедневный обзор

JC Penney Co Inc	JCP US	11/14/2011	Bef-mkt	Q3 2012		0.11
Urban Outfitters Inc	URBN US	11/14/2011	21:00	Q3 2012		0.342
Lowe's Cos Inc	LOW US	11/14/2011		Q3 2012		0.319
Jacobs Engineering Group Inc	JEC US	11/15/2011	Bef-mkt	Q4 2011		0.721
Covidien PLC	COV US	11/15/2011	Bef-mkt	Q4 2011		1.05
Wal-Mart Stores Inc	WMT US	11/15/2011	12:00	Q3 2012		0.975
TJX Cos Inc	TJX US	11/15/2011	14:30	Q3 2012		1.054
Agilent Technologies Inc	A US	11/15/2011	21:05	Q4 2011		0.806
Dell Inc	DELL US	11/15/2011	Aft-mkt	Q3 2012		0.469
Home Depot Inc	HD US	11/15/2011		Q3 2012		0.581
Staples Inc	SPLS US	11/15/2011		Q3 2012		0.468
Autodesk Inc	ADSK US	11/15/2011		Q3 2012		0.405
Abercrombie & Fitch Co	ANF US	11/16/2011	Bef-mkt	Q3 2012		0.723
Tyco International Ltd	TYC US	11/16/2011	Bef-mkt	Q4 2011		0.855
Target Corp	TGT US	11/16/2011	Bef-mkt	Q3 2012		0.738
Applied Materials Inc	AMAT US	11/16/2011	21:30	Q4 2011		0.196
NetApp Inc	NTAP US	11/16/2011	Aft-mkt	Q2 2012		0.594
Ltd Brands Inc	LTD US	11/16/2011	Aft-mkt	Q3 2012		0.239
Gap Inc/The	GPS US	11/17/2011	21:00	Q3 2012		0.355
Intuit Inc	INTU US	11/17/2011	Aft-mkt	Q1 2012		-0.123
JM Smucker Co/The	SJM US	11/17/2011		Q2 2012		1.398
Helmerich & Payne Inc	HP US	11/17/2011		Q4 2011		1.043
Ross Stores Inc	ROST US	11/17/2011		Q3 2012		1.24
GameStop Corp	GME US	11/17/2011		Q3 2012		0.393
HJ Heinz Co	HNZ US	11/18/2011		Q2 2012		0.801
Sears Holdings Corp	SHLD US	11/18/2011		Q3 2012		-2.135
Salesforce.com Inc	CRM US	11/18/2011		Q3 2012		0.307
Hewlett-Packard Co	HPQ US	11/21/2011		Q4 2011		1.131
Leucadia National Corp	LUK US	11/21/2011		Q3 2011		
Tyson Foods Inc	TSN US	11/21/2011		Q4 2011		0.311

Заявление об ограничении ответственности: Настоящие обзоры подготовлены в информационных целях. Они ни в коем случае не являются и не должны рассматриваться как предложение купить или продать соответствующие ценные бумаги. Информация, содержащаяся в данных обзорах, получена из вызывающих доверия открытых источников. Несмотря на то, что при подготовке обзоров были предприняты необходимые меры для получения достоверной информации, ИК РУСС-ИНВЕСТ не исключает возможность включения в обзор ошибочной информации, предоставленной соответствующими источниками, и не несет за это ответственности. ИК РУСС-ИНВЕСТ, его работники и клиенты могут быть заинтересованы в покупке или продаже ценных бумаг, упомянутых в обзорах.

www.russ-invest.com

Москва

Тел: +7(495) 363-93-80
Факс: +7(495) 363-93-90
E-mail: mail@russ-invest.com
Адрес: Москва, 119019, 5-3/12
Нащокинский переулок

Санкт-Петербург

Тел: +7(812) 337-55-37
Факс: +7(812) 337-55-37
E-mail: spb@russ-invest.com
Адрес: 190002, СПб, Набережная р.
Фонтанки, 52

Самара

Телефон: +7 (846) 262-75-52
Факс: +7 (846) 262-75-52
E-mail: sam@russ-invest.com
Адрес: 443067, Самара, ул. Гагарина,
дом 95

© 2007 | ОАО «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Лицензия ФСФР №077-08757-000100 и №077-08755-001000

Лицензия ФСФР №177-06310-100000 и №177-06312-010000

Лицензия ФСФР №906