

Обзор финансовых рынков

07 ноября 2016 г.

Нефть, выборы и Brexit

ЕЖЕНЕДЕЛЬНЫЙ ОТЧЕТ

МИРОВОЙ РЫНОК

На прошлой неделе фондовые площадки мира оставались в красной зоне, темпы падения индексов ускорились. Как и неделей ранее, падение цен на нефть имело негативное влияние на настроения инвесторов. Цены на нефть в течение недели опустились до месячных минимумов после выхода данных о росте добычи в США.

Рынки США лихорадит накануне президентских выборов, которые должны состояться 8 ноября. Новые опросы общественного мнения в США указывают на сокращение разрыва между кандидатами в президенты – Хиллари Клинтон от демократов и Дональдом Трампом от республиканцев. По данным опроса ABC News/Washington Post, Клинтон по-прежнему лидирует - 46%, но перевес минимален - у Трампа 45% голосов. Предвыборная гонка отодвинула на второй план новости, касающиеся финансовых показателей корпораций за третий квартал. Большинство участников рынка склонны считать, что Федеральная резервная система США поднимет базовую процентную ставку не ранее декабря.

Британский индекс FTSE 100 за прошедшую неделю потерял более 4%, вернувшись на позиции, наблюдаемые в середине сентября. 3 ноября Высокий суд Лондона объявил, что правительство Великобритании должно провести голосование в парламенте и заручиться его поддержкой, прежде чем начинать официальную процедуру выхода из Европейского союза (Brexit). Премьер-министр Тереза Мэй намеревалась начать этот процесс до конца марта 2017 года согласно статье 50 Лиссабонского договора, не вынося вопрос на рассмотрение парламента.

Предвыборные волнения, а также рост спроса на защитные активы привели к снижению стоимости доллара США. В пятницу 4 ноября торги по паре евро-доллар закрылись на отметке 1,1135 долл. США/евро.

ИНДЕКСЫ ФОНДОВЫХ РЫНКОВ

Индекс	посл. знач.	нед. изм.	мес. изм.	с нач. года
S&P 500 (США)	2085,2	-1,9%	-3,5%	2,0%
FTSE 100 (ВБ)	6693,3	-4,3%	-4,8%	7,2%
MSCI (Вост. Евр.)	127,1	-2,9%	-3,3%	15,2%
UX Index	836,3	-0,3%	1,0%	21,9%
RTS (Россия)	971,1	-2,2%	-2,6%	28,3%

СЫРЬЕВЫЕ РЫНКИ

Товар	посл. знач.	нед. изм.	мес. изм.	с нач. года
Пшеница, долл./т	167,0	1,2%	5,4%	-8,0%
Сталь, долл./т	318,0	0,0%	1,6%	25,7%
Нефть, долл./барр.	45,6	-8,3%	-12,1%	22,3%
Золото, долл./унц.	1303,8	2,2%	2,8%	22,9%

Источник: Thomson Reuters

www.pumb.ua

Департамент инвестиционного бизнеса
ул. Андреевская, 4, г. Киев, Украина 04070
тел. +38 044 231 7380

МАКРОЭКОНОМИКА

Оплата населением жилищно-коммунальных услуг

В сентябре 2016 года население страны уплатило за жилищно-коммунальные услуги 3,1 млрд грн, что составляет 74,1% от начисленной суммы, а за электроэнергию – 1,6 млрд грн (99,6% от начисленных за этот период сумм).

На конец сентября общая задолженность населения по оплате за коммунальные услуги и электроэнергию (за исключением газоснабжения) составила 12,7 млрд грн.

Средние начисления за жилищно-коммунальные услуги с учетом электроэнергии на одного собственника в сентябре составляли 526,3 грн.

РЫНОК ОБЛИГАЦИЙ

На прошлой неделе аукцион по первичной продаже ОВГЗ, проведенный 2 ноября, закончился безрезультатно. Минфин не удовлетворил единственную заявку участника, пожелавшего купить пятилетние ОВГЗ с доходностью 15,50% годовых на сумму 3 млн грн.

На текущей неделе Минфин планирует провести аукцион 9 ноября. К размещению будут предложены гривневые ОВГЗ со сроком обращения от четырех месяцев до двух лет.

ОПЕРАЦИИ НБУ

2 ноября НБУ удовлетворил две заявки на получение кредита рефинансирования сроком на 14 дней на общую сумму 720,2 млн грн. Кроме того, 1 и 2 ноября НБУ ежедневно выделял один кредит овернайт на сумму 24,0 млн грн. Процентная ставка по кредитам рефинансирования составляла 16,00% годовых.

Общая сумма депозитных сертификатов НБУ, размещенных на прошлой неделе, составила 54,4 млрд грн против 43,8 млрд грн, размещенных неделей ранее. Из них депозитные сертификаты овернайт составили 34,1 млрд грн. Процентная ставка по депозитным сертификатам, размещенным на срок 14 дней, составляла 14,00%, а по сертификатам овернайт – 12,00% годовых.

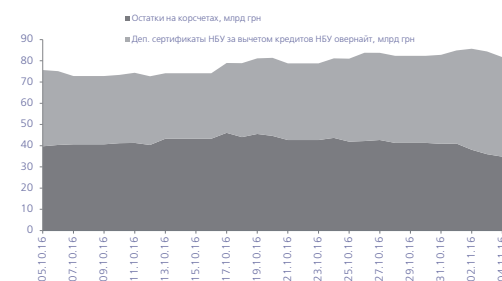
Общий уровень ликвидности банковской системы на прошлой неделе значительно не изменился: увеличение объема депозитных сертификатов, находящихся в обороте, была компенсирована снижением остатков на корсчетах банков.

РЫНОК АКЦИЙ

Украинский рынок акций на прошлой неделе был волатилен, но по итогу недели оказался в красной зоне. Индекс Украинской биржи (УБ) за неделю потерял 0,3% и закрылся в пятницу 4 ноября на отметке 836,30 пункта.

Рост индекса на месячном отрезке составляет 1%, а с начала года – 21,9%.

ЛИКВИДНОСТЬ БАНКОВСКОЙ СИСТЕМЫ



Источник: НБУ

ИНДЕКС УБ



Источник: Thomson Reuters

ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК

Постепенная ревальвация национальной валюты, продолжавшаяся в течение октября, приостановилась на прошлой неделе. В течение недели курс не опускался ниже отметке 25,50 грн/долл. США

В понедельник 31 октября межбанк торговался в диапазоне 25,48/25,58 грн/долл. США, во вторник 1 ноября – 25,57/25,67 грн/долл. США, в среду 2 ноября – 25,52/25,62 грн/долл. США, в четверг 3 ноября – 25,55/25,65 грн/долл. США, в пятницу 4 ноября – 25,54/25,64 грн/долл. США. Максимальные объемы продаж зафиксированы 31 октября – 0,282 млрд долл. США (все валюты), в том числе только американской валюты было продано на сумму 0,189 млрд долл. США.

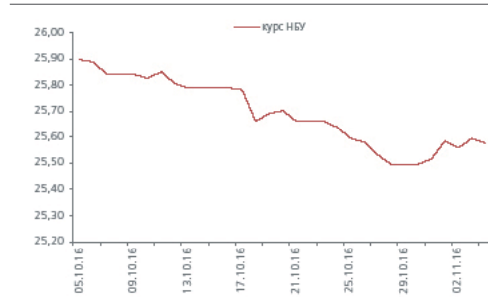
Общий объем продажи валюты за прошлую неделю составил 0,96 млрд долл. США против 1,6 млрд долл. США неделей ранее. На аукционах, проведенных 2 и 4 ноября, Нацбанк купил у участников рынка 29,2 млн долл. США. Средневзвешенный курс покупки поднялся с 25,55 грн/долл. США 2 ноября до 25,57 грн/долл. США 4 ноября. Недель ранее НБУ купил у участников рынка 105,8 млн долл. США.

МЕЖБАНКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ РЫНОК

Стоимость межбанковских кредитов на прошлой неделе снизилась. К концу недели кредиты овернайт выдавались под 12,0-13,0% недельные ресурсы стоили 13,0-14,0% а месячные – 13,0-15,0%.

Объем остатков на корреспондентских счетах банков на прошлой неделе опустился ниже уровня 40 млрд грн. По состоянию на утро пятницы 4 ноября остатки составляли 34,8 млрд грн.

ОБМЕННЫЙ КУРС (грн/долл. США)



Источник: НБУ

МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ УКРАИНЫ

Показатель	2014	2015	2016
ВВП, %	-6,8	-9,9	1,4 (второй квартал)
Промышленное производство, %	-10,1	-13,4	2,0 (сентябрь)
Инфляция потребительских цен, % год к году	24,9	43,3	7,9 (сентябрь)
Инфляция цен производителей, % год к году	31,8	25,4	19,6 (сентябрь)
Сальдо торгового баланса, млрд долл. США	-4,6	-1,7	-3,6 (январь-сентябрь)
Официальный обменный курс, средний за год, грн/долл. США	11,89		
Средневзвешенный межбанковский обменный курс, средний за год, грн/долл. США	11,89	21,85	25,51 (январь-октябрь)
Средневзвешенный межбанковский обменный курс, на конец года, грн/долл. США	15,77	24,00	25,58 (конец октября)
Активы банковской системы, % роста	3,0	-4,7	1,7 (январь-сентябрь)

Источник: Государственная служба статистики, НБУ

ДЕПАРТАМЕНТ ИНВЕСТИЦИОННОГО БИЗНЕСА

Стадник Антон
Руководитель департамента
+38 044 231 7046
anton.stadnik@fuib.com

Тимбай Марина
Управление торговых и брокерских операций
+38 044 231 7053
marina.timbay@fuib.com

Ахтырко Евгения
Аналитический отдел
+38 044 231 7380
evgeniya.ahtirko@fuib.com

УПРАВЛЕНИЕ ТРАНЗАКЦИОННЫХ УСЛУГ

Гурбан Антон
Начальник управления
+38 044 231 7530
anton.gurban@fuib.com

**УПРАВЛЕНИЕ МЕЖДУНАРОДНОГО
ФИНАНСИРОВАНИЯ И СТРУКТУРИРОВАНИЯ
ТРАНЗАКЦИЙ**

Зубро Сергей
Начальник управления
+38 044 231 7055
serhiy.zubro@fuib.com

СЛУЖБА КОММУНИКАЦИЙ

Кокоба Анна
+38 044 231 7252
anna.kokoba@fuib.com