

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1964,82	-0,16	-0,66	
Dow Jones	16991,91	-0,10	-0,46	
NASDAQ	4454,80	-0,47	-1,13	
S&P фьючерс	0,00			

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Eurostoxx 600	336,00	0,24	-1,46	
FTSE 100	6563,65	0,55	-1,25	
DAX	9209,51	0,15	-2,96	
CAC 40	4286,52	0,11	-1,64	

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
MSCI World	413,00	0,38	-0,92	
MSCI Emerging Markets	1010,32	1,31	0,50	
Bovespa	57115,90	4,72	4,56	
Nikkei 225	15897,31	0,04	-1,71	
Shangh Composit	2363,87	0,26	2,34	
Hang Seng	23396,67	0,35	-1,19	

Россия

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
ММВБ	1418,15	2,42	0,70	
РТС	1120,20	2,57	-0,31	
Индекс АДР Нью-Йорк	78,05	1,44	-2,30	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
АФК Система	16,05	5,59	Мостотрест	86,50	-2,04
Мегафон	1052,00	4,68	Русал	212,90	-1,21
Соллерс	461,00	4,54	Мечел	25,09	-1,18
Татнефть ао	235,75	4,31	ТМК	84,00	-0,59
ИнтерРАО	0,01	4,02	Дикси	417,80	-0,26

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
3,49	Финанс	4,03	Финанс
2,55	Телеком	1,46	Химпром
2,30	Нефтегаз	1,15	Нефтегаз
1,77	Электр	0,93	Потреб
1,71	Машин	0,56	Машин
1,40	Химпром	0,48	Метал
1,23	Метал	-0,53	Электр
0,86	Потреб	-4,76	Телеком



Фондовый рынок

- Вчерашние торги в США завершили небольшим снижением биржевых индексов, несмотря на то, что старт торгов прошел с заметным повышением котировок. В качестве причин для снижения вновь отмечают продолжившиеся распродажи наиболее рискованных активов на фондовом рынке – акций высокотехнологичных компаний и компаний малой капитализации. На этом фоне, индекс Russell 2000, отражающий стоимость 2000 малых публичных компаний из США, снизился на 0,9%, продолжив снижаться уже шестую неделю кряду. От июльских максимумов индикатор находится в минусе почти на 10%.
- Техническая картина по индексу S&P 500 пока что совсем не исключает сценарий развития снижения еще на 3% вниз – до уровня 1900 пунктов, где располагается сразу несколько сильных поддержек. В случае пробоя и этой отметки, мы можем стать свидетелями первой 10%-ой коррекции на американском рынке за последние несколько лет.
- Главное событие ближайших недель, к которому будет приковано все внимание инвесторов в США – это сезон квартальных корпоративных отчетов. Традиционно он начнется с отчета Alcoa завтра, хотя формально, уже 22 компании из индекса S&P 500 на данный момент отчитались за третий квартал. Результаты весьма неплохи: выручка в среднем выросла на 6,3%, а прибыли на 13%, но делать далеко идущие выводы всего по 22 компаниям конечно не слишком корректно.
- В Европе торги прошли при умеренно позитивном настроении инвесторов, а отыграть ночное снижение на биржах США они полностью не успели, так что сегодня с утра фондовые индексы Старого Света скорее всего окрасятся в красный цвет. Рост сдерживался в основном слабой макростатистикой: в Германии производственные заказы в августе рухнули на 5,7% – это самые слабые темпы с рецессии 2009 года. Кроме того, продолжил снижаться и индекс доверия инвесторов от Sentix, снизившийся до минимумов за полтора года. Ухудшение экономической конъюнктуры в Европе продолжается.
- Российский рынок в понедельник с открытия начал отыгрывать позитивное настроение которое царило на западных биржах еще с пятницы – после публикации сильного отчета по рынку труда в США. Рост в течение всего дня только усиливался, при этом повышение котировок шло практически по всему спектру рынка и даже несмотря на то, что внешний фон в течение дня временами был не слишком позитивным: на юго-востоке Украины в последние дни явно наблюдается эскалация уже казалось бы затухшего конфликта. Рубль в течение вчерашних торгов впервые опускался ниже отметки 40 рублей за доллар, а цены на нефть продолжили плавно снижаться.
- Тем не менее, инвесторы предпочли обратить большее внимание на позитивные новости: переговоры по газу уже подходят к своему логическому завершению и окончательное решение по этому вопросу должно быть принято в течение этой недели, что безусловно является позитивным фактором, который поможет улучшить, пусть и немного, отношения России и Запада. Кроме того, инвесторы обратили внимание на заявления посла Франции в России, который отметил, что Париж надеется и самое главное ждет скорую отмену санкций против России. Наконец, последней хорошей новостью стало решение SWIFT не отключать российские банки от своих сервисов. На этом положительном фоне российские индексы продемонстрировали сильнейший дневной рост за месяц.

Товарный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	92,75	-0,04	-2,03	
Индекс Метал.	1345,11	1,04	-0,65	
Золото	1206,70	1,22	-0,89	
Серебро	17,28	0,32	1,31	
Индекс Зерн	319,09	2,32	3,24	

- Цены на нефть продолжают оставаться в рамках сильной нисходящей формации, однако уровень 92 доллара за нефть марки Brent пока что выступает хорошей поддержкой для цены: попытки преодолеть эту отметку уже третий день подряд встречают серьезное сопротивление со стороны «быков», так что закрытие все равно проходит выше этого уровня.
- Сильной оказалась поддержка на уровне 1180 долларов для золота, от которой цена вчера резко отскочила сразу выше 1200 долларов. Если рост в ближайшие дни продолжится, это станет хорошим сигналом для развития коррекционного роста до 1250 долларов, а в перспективе и до 1300 долларов.
- Цены на промышленные металлы, после пяти недель непрерывного снижения, корректируются вверх уже второй день кряду.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,261	-0,35	-0,16	
USDJPY	109,21	0,39	-0,40	
Индекс \$	86,03	0,12	0,11	
EURRUB	50,16	0,37	0,14	
USDRUB	39,83	-0,28	0,95	
Корзина ЦБ	44,48	0,01	0,59	

Валютный рынок

- Курс доллар-рубль вчера впервые в истории поднимался выше уровня 40 рублей, но задержаться на долго ему там не удалось – торги завершились возле отметки 39,8. Курс евро к рублю пока что держится выше отметки 50 рублей.
- Курс евро-доллар вчера резко отскочил от многомесячных минимумов, вернувшись выше отметки 1,26, где он сейчас и торгуется.



Долговой рынок

- Доходности ОФЗ вчера продолжили слегка подрастать на фоне роста курса доллара выше отметки 40 рублей. Сегодня Минфин должен сообщить параметры завтрашнего аукциона по размещению ОФЗ, вполне возможно, что аукцион может не состояться, хотя тогда ведомству будет трудно выполнить квартальный план по привлечению внутренних займов.

Взгляд на рынок

Вечерняя сессия на срочном рынке в России завершилась очередным витком роста индексных фьючерсов, так что сегодня с утра мы можем увидеть продолжение вчерашней позитивной динамики. С технической точки зрения, в случае закрепления рынка на текущих уровнях или даже продолжении роста, сценарий с падением в район 1300 пунктов по индексу ММВБ и 1000 пунктов по индексу РТС придется на время отложить. Сильных драйверов для роста пока нет, но не забываем про «газовые» переговоры и вероятность завершения коррекции на западных фондовых площадках. В совокупности эти факторы могут помочь рынку восстановиться хотя бы до отметок 1450 пунктов по индексу ММВБ и 1150 пунктов по индексу РТС. О большем пока что говорить рано – нужно дождаться снятия хотя бы части санкций, но этот вариант развития событий пока что не кажется очевидным.

Если Вы больше не хотите получать свежую рассылку,
отправьте пустое письмо на почту

client@custom-capital.com

Данный отчет подготовлен отделом доверительного управления ООО «ИК «Кастом Кэпитал». В процессе отбора наиболее актуальной информации по мировым рынкам были тщательно изучены и проработаны следующие источники информации:

Bloomberg News
Bloomberg News Russia
Прайм-Тасс
Ведомости
Интерфакс
Коммерсантъ

* Настоящий аналитический отчет подготовлен отделом доверительного управления ООО ИК «Кастом Кэпитал» только в информационных целях. Ни информация, ни мнения не должны рассматриваться как предложение, рекомендация или оферта на покупку или продажу каких-либо финансовых инструментов. Этот отчет также не является ни инвестиционным, ни налоговым советом, ни консультацией, и он не учитывает особенности инвестиционной стратегии, склонность к риску и финансового положения тех, кто может получить этот отчет. Инвесторам следует самим принимать решения об обоснованности инвестиций в каждый финансовый инструмент или инвестиционных стратегий, упомянутых в данном отчете. ООО «ИК «Кастом Кэпитал» не берет на себя никакой ответственности за любые прямые или косвенные убытки, затраты или ущерб, понесенные в связи с использованием информации, размещенной в настоящем документе, включая представленные данные.

© 2014, ООО «ИК «Кастом Кэпитал». Без разрешения Общества запрещается воспроизводить, адаптировать, передавать по различным каналам, транслировать в эфир, доводить до общего сведения, публично показывать, преобразовывать в цифровую форму, синтезировать, опубликовать, модифицировать, усовершенствовать, адаптировать, переводить на другие языки, использовать с другими произведениями, рекламировать, распространять, публицизировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.