

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1928,21	-2,07	-0,92	
Dow Jones	16659,25	-1,97	-0,84	
NASDAQ	4378,34	-2,02	-1,17	
S&P фьючерс		-0,18		

Индексы фондовых рынков Европы

Eurostoxx 600	326,67	-0,41	-1,62	
FTSE 100	6431,85	-0,78	-0,23	
DAX	9005,02	0,11	-4,02	
CAC 40	4141,45	-0,64	-2,39	

Остальной мир

MSCI World	407,02	-0,99	-1,07	
MSCI Emerging Markets	1008,33	0,96	1,11	
Bovespa	57267,53	0,37	7,00	
Nikkei 225	15326,67	-0,98	-2,43	
Shangh Composit	2375,06	-0,60	1,16	
Hang Seng	23170,30	-1,55	0,46	

Россия

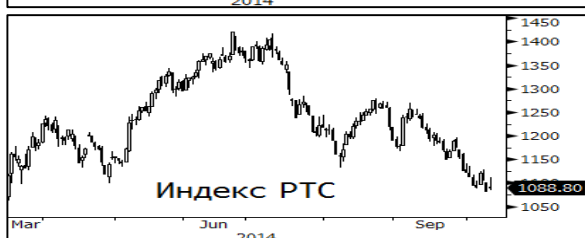
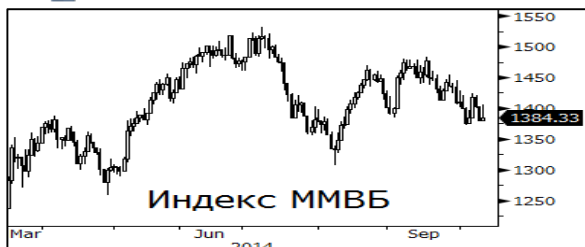
ММВБ	1384,33	0,33	0,58	
PTC	1088,80	0,57	-0,30	
Индекс АДР Нью-Йорк	75,17	-1,80	-2,07	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Магнит	10245,00	2,47	Башнфт ао	1095,00	-6,81
Транснфт ап	88000,00	2,08	ВСМПО	6450,00	-5,56
Алроса	38,67	1,92	Мечел	22,10	-4,62
ФосАгро	1341,00	1,82	АФК Система	14,60	-4,58
Соллерс	455,00	1,79	МТС	232,45	-3,79

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
0,48	Потреб	1,77	Химпром
0,47	Метал	1,71	Электр
0,29	Химпром	1,47	Финанс
0,28	Нефтегаз	1,42	Машин
0,10	Машин	1,36	Потреб
0,07	Электр	1,34	Нефтегаз
-0,52	Финанс	-0,76	Метал
-2,05	Телеком	-8,29	Телеком



Фондовый рынок

- Американский рынок рухнул сильнейшими темпами с апреля этого года, основные биржевые индексы потеряли в пределах 2-3%. Основной причиной для падения стало то, что еще накануне вызвало невероятный позитив на западных фондовых площадках: инвесторы неожиданно забеспокоились из-за торможения экономики Еврозоны, на фоне выступления Марио Драги в Вашингтоне, хотя еще в среду именно этот фактор стал поводом для бурного роста котировок - вероятность скорого повышения процентных ставок резко уменьшилась после публикации «минуток» ФРС в которых отмечались риски замедления темпов роста в Еврозоне. Объяснить такое резкое изменение настроения на рынке одним лишь выступлением главы ЕЦБ, довольно трудно.
- Главным аутсайдером торгов стал сектор энергетических компаний, упавший на 3,7% из-за резко снизившихся цен на нефть. Тем не менее, массивные распродажи прошли по всему спектру рынка и в солидном минусе оказались все остальные отрасли. Индикатор волатильности VIX взлетел до максимальных значений с февраля, когда на американском рынке прошла последняя более-менее сильная коррекция, вызванная тогда аномальной погодой, которая сильно ударила по деловой активности в стране.
- Европейские биржи также окрасились в красный цвет на фоне общемирового негатива. Торги в Европе стартовали очень неплохим ростом - инвесторы отыгрывали мощнейший рост котировок на биржах США в среду, однако позитив быстро выветрился с фондовых площадок. Британский индекс FTSE 100 опустился до минимальных за год значений. Основной причиной могла стать слабая макроэкономическая статистика из Германии: экспорт из страны рухнул на 5,8% в августе (сильнейшее падение с 2009 года) на фоне сильного сокращения объемов торговли с Китаем и Россией. Торговый баланс упал на 21% по сравнению с июлем. Добавив к этому слабейшие данные по промышленному производству, вышедшие ранее, становится ясно, что экономика Германии вполне может войти в рецессию. Торговый дефицит второй по величине экономики Еврозоны Франции, увеличился в августе, что также было воспринято без особого энтузиазма.
- В России торги также стартовали очень неплохим ростом - основные биржевые индикаторы росли в пределах 1,8-2,6%, однако, как и в случае с Европой, задержаться на вершине надолго не удалось. Негативных новостей к середине дня накопилось достаточно: цены на нефть продолжили пребывать в глубоком унынии, оказывая сильное давление на российский фондовый рынок. В лидерах падения оказались акции компаний, связанных с Системой: вчера прошло рассмотрение «дела Евтушенкова» судом на котором Следственный комитет РФ потребовал взыскать с компании 190 миллиардов рублей. Следующее заседание пройдет 23 октября.
- Не добавили позитива и новости с «газовых» переговоров: на этой неделе многие ждали какой-то подвижки в споре, но предложения российской стороны, сделанные еще на прошлой неделе, остались без внимания со стороны Киева, а позже Еврокомиссия предложила провести очередную встречу 21 октября - решения вопроса вновь откладывается, что совсем не радует инвесторов. Российский рынок по итогам торгов закрылся ниже сильных уровней поддержки, несмотря на то, что в течение дня котировки держались выше этих уровней.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	88,50	-1,72	-4,13	
Индекс Метал.	1351,73	0,92	2,55	
Золото	1223,50	-0,09	2,63	
Серебро	17,29	-0,76	2,73	
Индекс Зерн	323,32	-0,76	3,67	

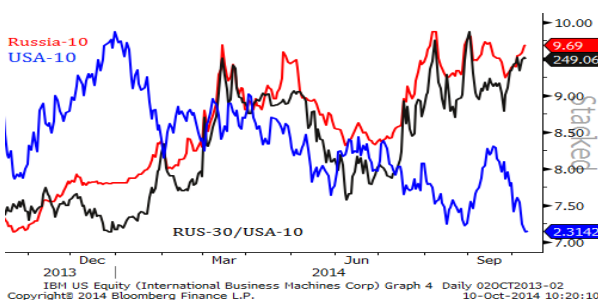
Товарный рынок

- Растущее предложение нефти со стороны ведущих мировых экспортеров на фоне усиливающихся беспокойств инвесторов за темпы роста мировой экономики и глобального спроса на сырье, вчера обвалили котировки нефтяных фьючерсов до новых минимумов: Brent торгуется в районе отметки 88,5 долларов за баррель, впервые с июня 2012 года, а внутри дня цена опускалась до минимальных значений с 2010 года.
- Несмотря на проблемы у других commodities, золото продолжает демонстрировать очень неплохую динамику – котировки торгуются выше уровня 1220 долларов за унцию, а отскок от локальных минимумов составил уже 3,5%.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,270	0,03	1,43	
USDJPY	107,81	-0,03	-1,81	
Индекс \$	85,52	0,00	-1,35	
EURRUB	50,89	-0,02	1,31	
USDRUB	40,11	-0,09	1,22	
Корзина ЦБ	44,96	-0,06	1,26	

Валютный рынок

- Рубль вчера попытался укрепиться до уровней 39,8 в паре с долларом, но эти попытки были сведены на нет ослаблением цен на нефть и негативной конъюнктурой российского рынка. Закрытие торгов вновь прошло выше отметки 40 рублей за доллар.
- Пара евро-рубль вчера вплотную приблизилась к историческому внутрисуточному максимуму на уровне 51,11 – локальное укрепление курса евро к доллару, который сейчас торгуется возле отметки 1,27, толкает единую валюту вверх и по отношению к рублю.



Долговой рынок

- Не слишком удовлетворительные результаты аукциона ОФЗ, растущая инфляция и растущие вместе с ней ожидания ужесточения ДКП, а также слабеющий рубль, в совокупности оказывают негативное влияние на отечественный долговой рынок: котировки вчера продолжили падать, а доходности по ОФЗ вновь приблизились к годовым максимумам.
- Доходности казначейских облигаций США упали до минимальных значений за более чем год.

Взгляд на рынок

Торги в РФ сегодня явно стартуют на отрицательной территории из-за сильнеешего падения на биржах США сегодня ночью. В азиатском регионе с утра также преобладают распродажи и повсеместное негативное настроение инвесторов. За несколько последних дней мы уже несколько раз увидели резкую смену настроения на мировых фондовых площадках и в текущей ситуации все говорит за то, что падение на российском рынке в краткосрочной перспективе продолжится, так как взаимосвязь отечественных акций с зарубежными сейчас очень высока. Ближайший уровень поддержки для российского рынка располагается в диапазоне 1300-1350 пунктов по индексу ММВБ. Важных экономических публикаций сегодня ждать не стоит.

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, опубликовывать, модифицировать, усовершенствовать, адаптировать, переводить на другие языки, использовать с другими произведениями, рекламировать, распространять, сублицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.