

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1874,74	-1,65	-4,58	
Dow Jones	16321,07	-1,35	-3,95	
NASDAQ	4213,66	-1,46	-5,41	
S&P фьючерс	0,50			

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Eurostoxx 600	321,56	-0,02	-4,30	
FTSE 100	6366,24	0,41	-3,01	
DAX	8812,43	0,27	-4,31	
CAC 40	4078,70	0,12	-4,85	

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
MSCI World	397,66	-0,70	-2,77	
MSCI Emerging Markets	991,49	0,16	-1,92	
Bovespa	57956,53	4,78	1,47	
Nikkei 225	15017,47	-1,85	-5,50	
Shangh Composit	2368,80	0,12	0,21	
Hang Seng	23294,66	0,65	-0,55	

Россия

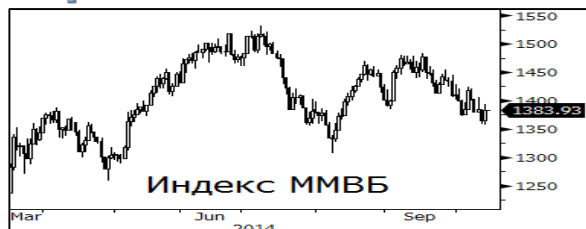
	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
ММВБ	1383,93	0,00	-1,39	
PTC	1076,58	1,15	-2,73	
Индекс АДР Нью-Йорк	73,99	0,01	-5,20	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Мечел	23,61	15,17	Башнфт ао	1038,00	-2,99
ФосАгро	1385,00	5,73	М.Видео	187,00	-2,65
ПИКК	114,80	4,84	МТС	221,00	-2,34
ОГК-2	0,18	4,72	Соллерс	435,00	-2,25
Акрон	1294,00	3,94	МОЭК	0,91	-2,16

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
2,57	Химпром	0,56	Химпром
1,90	Метал	0,11	Метал
1,86	Нефтегаз	-0,33	Потреб
1,66	Финанс	-1,72	Электр
0,71	Электр	-1,86	Нефтегаз
0,14	Потреб	-3,71	Финанс
-0,51	Телеком	-4,74	Машин
-0,85	Машин	-8,67	Телеком



Фондовый рынок

- На американском фондовом рынке коррекция продолжает набирать обороты: индекс S&P 500 опустился ниже уровня сильной поддержки 1900 пунктов впервые с мая этого года, а ниже своей 200-дневной средней впервые с ноября 2012 года. Ближайшие цели снижения фондового рынка США – уровни 1850 пунктов по индексу S&P 500, но не стоит исключать вероятность падения к отметке 1800 пунктов, где будут выполнены цели такой долгожданной 10%-ой коррекции. Тем не менее, сейчас также не стоит исключать возможность небольшого коррекционного отскока – все-таки рынок падает чересчур резко.
- Индекс «страха» VIX подскочил на вчерашних торгах до максимальных уровней с середины 2012 года. Настроение на фондовых площадках США продолжает оставаться негативным, хотя каких-то новых сильных сигналов инвесторы пока что не получили.
- Тем временем, квартальные финансовые результаты компаний оказываются достаточно неплохими: по 30 отчитавшимся компаниям из индекса S&P 500, средний рост выручки составил 6,45%, а рост прибыли составил 14,8%. Крупнейшие компании из США еще пока что не отчитались, но если «earnings season» продолжится в том же духе, серьезного падения на американских биржах мы все же вряд ли увидим.
- В Европе вчерашний торговый день прошел под знаком сильной волатильности, рыночные индикаторы несколько раз в течение дня меняли направление движения, но по итогам торгов сводный европейский индекс Eurostoxx 600 закрылся вблизи уровней закрытия пятницы. Инвесторов в Европе немного подбодрили макроэкономические новости из Китая с утра, но негатив, пришедший из-за океана вечером, все-таки перевесил. Инвесторы, тем временем, продолжают беспокоиться за судьбу стимулирующих программ ЕЦБ, ведь немецкая сторона выступает резко против покупки на баланс евро-регулятора рискованных активов.
- Развивающиеся рынки отскочили после сильного провала на торгах пятницы, за счет сильного роста на бразильском фондовом рынке: все внимание инвесторов в этой южноамериканской стране в этом году приковано к президентским выборам, так что даже результаты общественных опросов могут взывать сильное движение котировок. По последним данным, действующий президент Дилма Русеф уступает своему оппоненту, что очень радует деловое сообщество.
- Российский рынок провел вчерашний день на положительной территории, практически полностью нивелировав падение пятничных торгов. С утра позитивным фактором выступили макро данные из Китая: экспорт и импорт в «Поднебесную» в сентябре взлетели сильнейшими темпами за последние месяцы, что является хорошим сигналом для сырьевых цен и для российской экономики. Позже инвесторы обратили внимание на геополитику: приказ президента Путина о завершении военных учений в Ростовской области и о возвращении войск в места их постоянной дислокации был воспринят инвесторами с оптимизмом, что свидетельствует о деэскалации «украинского» кризиса.
- В лидерах роста вчера оказались обыкновенные акции Мечела, взлетевшие на 15% после появления новостей о том, что правительство может помочь банкам-кредиторам Мечела, что может поспособствовать решению накопившихся проблем.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	88,17	-0,81	-4,28	
Индекс Метал.	1347,31	0,81	0,16	
Золото	1235,90	0,54	2,00	
Серебро	17,44	0,55	1,16	
Индекс Зерн	326,97	2,39	0,55	

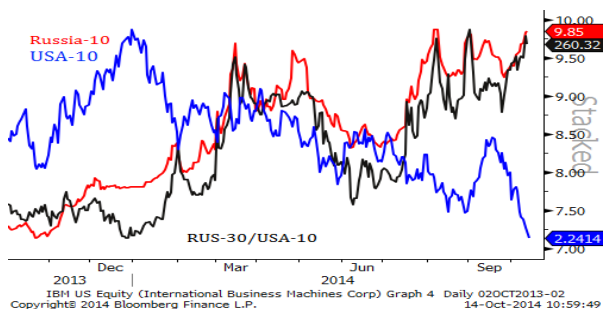
Товарный рынок

- Цены на нефть в понедельник продолжили снижаться, баррель нефти марки Brent торгуется вблизи отметки 88 долларов за баррель. Цены продолжают оказываться под давлением из-за сообщений о том, что все больше стран-членов ОПЕК ввязываются в ценовую войну, что может привести к падению рыночных котировок до уровня 80 долларов за баррель. При этом, Саудовская Аравия и ОАЭ отказались от идеи провести внеочередное собрание стран картеля, что указывает на то, что по их мнению ситуация на нефтяном рынке сейчас не критична.
- Золото и промышленные металлы вчера отреагировали ростом на позитивную макростатистику из Китая.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,272	-0,24	0,41	
USDJPY	107,12	0,24	-0,85	
Индекс \$	85,35	-0,22	-0,38	
EURRUB	51,30	0,56	2,23	
USDRUB	40,50	0,34	1,67	
Корзина ЦБ	45,36	0,44	1,92	

Валютный рынок

- Рубль вчера обновил исторические минимумы одновременно и к доллару и к евро и к бивалютной корзине. Глава ЦБ РФ Эльвира Набиуллина вчера заявила, что регулятор потратил на интервенции 6 миллиардов долларов за последние две недели, что однако мало повлияло на курсообразование. При этом, глава ЦБ отметила, что ситуация остаётся под контролем, а менять действующие параметры монетарной политики регулятор не намерен.
- Доллар, тем временем, после почти непрерывного трехмесячного роста ко всем мировым валютам, продолжает корректироваться вниз на ожиданиях продолжения периода низких процентных ставок в США.



Долговой рынок

- Слабый рубль, низкие цены на нефть и неблагоприятный внешний фон продолжают давить на котировки российских облигаций. Доходности ОФЗ скоро могут перевалить за двухзначный рубеж. Тем временем, вышедшая недавно статистика от ЦБ, свидетельствует о том, что нерезиденты продолжают держать свои вложения в ОФЗ, что является слабым, но все же немного позитивным сигналом.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативен: торги в США вчера завершились заметным снижением индексных котировок, а с утра негатив перекинулся на биржи Азии, так что с открытия торгов в РФ сегодня можно ждать небольшого снижения котировок. Тем не менее, фьючерс на индекс S&P 500 сегодня утром показывает положительную динамику, прибавляя больше 0,5%, что может оказать поддержку российскому рынку.

Вчерашний рост пока что вписывается в рамки обычного коррекционного отскока в рамках действующего «даунтренда». Для подтверждения разворота необходимо дождаться новых позитивных сигналов.

Сегодня ждем публикацию экономических индикаторов от ZEW и статистику по промышленному производству в Еврозоне.

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.