

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	2052,75	0,20	0,66	
Dow Jones	17719,00	0,19	0,38	
NASDAQ	4701,87	0,56	0,46	
S&P фьючерс		0,06		

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Eurostoxx 600	338,28	-0,26	0,72	
FTSE 100	6678,90	-0,26	0,65	
DAX	9483,97	0,12	2,55	
CAC 40	4234,21	-0,75	1,10	

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
MSCI World	422,10	0,04	0,42	
MSCI Emerging Markets	990,10	0,02	-0,07	
Bovespa	53402,81	2,58	0,80	
Nikkei 225	17334,73	0,20	-0,89	
Shangh Composit	2465,00	0,50	-0,56	
Hang Seng	23400,37	0,22	-2,85	

Россия

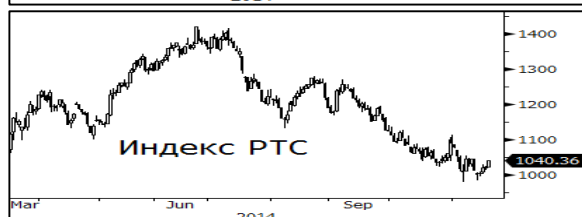
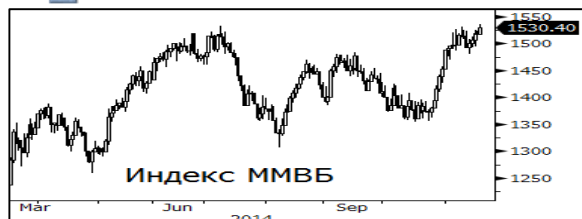
	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
MMББ	1530,40	0,82	2,56	
PTC	1040,36	1,88	3,99	
Индекс АДР Нью-Йорк	70,97	0,85	1,60	

Лидеры роста/падения

	Close P	Δ 1D, %		Close P	Δ 1D, %
▲ Аэрофлот	42,01	5,26	▼ ФосАгро	1451,00	-4,98
▲ ПИКК	164,70	4,04	▼ ВСМПО	6700,00	-4,29
▲ Уралкалий	133,90	3,72	▼ Соллерс	419,00	-4,12
▲ Татнефть ао	260,50	3,37	▼ ТМК	74,80	-4,10
▲ Трансфлг ап	108500,00	2,90	▼ Дикси	409,50	-3,15

Отраслевая динамика индекса ММББ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
1,36	Нефтегаз	5,07	Нефтегаз
0,93	Телеком	4,71	Метал
0,89	Финанс	0,96	Телеком
0,55	Электр	0,64	Финанс
0,05	Химпром	0,39	Потреб
-0,11	Потреб	-0,77	Электр
-0,17	Метал	-2,43	Химпром
-2,51	Машин	-3,31	Машин



Фондовый рынок

- Фондовые торги в США завершились очередным обновлением исторических максимумов индексами S&P 500 и Dow Jones Industrial Average. Инвесторы достаточно быстро закрыли отрицательный гэп, которым открылись вчерашние торги и помогла в этом сильная макро статистика, развеявшая на время опасения за судьбу высоких темпов роста американской экономики. Особенно инвесторов впечатлила статистика по продажам на вторичном рынке жилья – рост на 1,5% при прогнозе падения на 0,3%, а также взлетевший до максимумов с 2011 года индекс производственной активности Филадельфии – тоже значительно лучше консенсус-прогноза.
- Радовала и прочая статистика: инфляция потребителей в США оказалась выше ожиданий (1,7% в год против 1,6%), а базовый ИПЦ (исключающий инфляцию продуктов питания и энергии) и вовсе подрос с 1,7% до 1,8%, но здесь это уже было ожидаемо. На этой неделе это уже не первое подтверждение ускорения темпов роста цен в США – цель ФРС становится все ближе. Сократилось также и число повторных заявок на пособие по безработице в США, и на таком фоне индекс ведущих индикаторов от Conference Board (учитывает совокупность большого числа различных индикаторов деловой активности США) показал в октябре рост на 0,9%, что оказалось лучше прогнозов аналитиков. Остается лишь констатировать, что экономика США действительно чувствует себя очень неплохо, несмотря на фактическую стагнацию мировой экономики.
- В Европе торги прошли совсем не так позитивно: в течение дня европейские индексы торговались в заметном минусе, но к концу дня позитив из США смог вытащить котировки Старого Света поближе к нулевым уровням. Инвесторы негативно отреагировали на публикацию слабых данных по производственной активности в Еврозоне, а с утра давление на котировки оказывала статистика из Китая – индикатор деловой активности в производственном секторе от HSBC снизился сильнее ожиданий, опустившись до отметки 50 пунктов, что говорит о стагнации промышленного сектора.
- Региональная европейская статистика также не радовала: промышленный PMI Франции вновь снизился, он находится ниже отметки 50 пунктов (зона снижения активности) последние полгода, а PMI услуг хоть и подрос, но до зоны роста он также сильно не дотягивает. Сильно разочаровала Германия: промышленный PMI свидетельствует о стагнации (падение с 51,4 до 50 пунктов), индикатор сектора услуг также заметно снизился, опустившись до минимумов с лета 2013 года. На этом фоне общеевропейские индексы заметно просели: промышленный с 50,6 до 50,4 (фактическая стагнация), сектор услуг с 52,3 до 51,3 (еще ничего, но значительно хуже, чем полгода назад), а композитный с 52,1 до 51,4. Стоит отметить, что аналитики не прогнозировали такого ухудшения показателей, так что негативный эффект из-за этого только усилился.
- Российский рынок вчера чувствовал себя очень неплохо, хотя негатив из Китая и Европы оказывал определенное давление на котировки акций в рублях (индекс ММББ). В тоже время индекс PTC продемонстрировал более значительный рост на фоне заметного укрепления нацвалюты. По ценам закрытия рублевый индекс ММББ оказался на максимальных отметках с октября 2013 года, а внутри дня вплотную приближался к почти двухлетнему внутрисдневному экстремуму, который был зафиксирован 21 октября прошлого года – 1538,74 пунктов.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	79,63	0,38	0,28	
Индекс Метал.	1360,20	0,19	0,46	
Золото	1193,60	0,23	0,67	
Серебро	16,27	0,82	-0,27	
Индекс Зерн	351,03	2,25	-1,38	

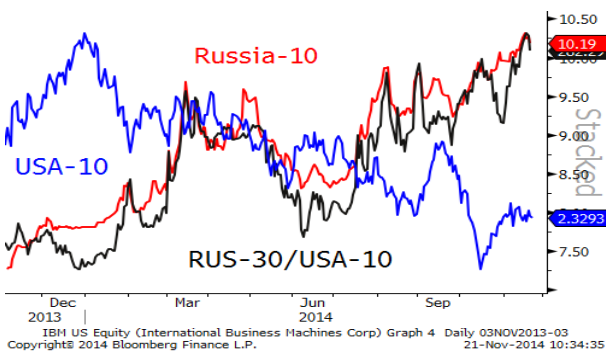
Товарный рынок

- Несмотря на то, что вчера инвесторы получили достаточно новых сигналов, свидетельствующих о возможности дальнейшего снижения темпов роста мировой экономики, цены на сырье, а в особенности цены на нефть, отреагировали на это совсем не негативно. Котировки «черного золота» вчера неплохо подросли без видимых на то причин – в СМИ пушит о возросших ожиданиях того, что ОПЕК примет меры для стабилизации цен на мировом рынке, но не совсем понятно, что же конкретно вчера привело к росту этих ожиданий.
- Цены на золото вчера также немного подросли, промышленные металлы смогли нивелировать потери первой половины торгового дня.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,255	0,11	0,22	
USDJPY	117,77	-0,37	1,26	
Индекс \$	87,57	-0,03	0,05	
EURRUB	57,93	-0,07	-2,03	
USDRUB	46,12	-0,37	-2,59	
Корзина ЦБ	51,43	-0,24	-2,34	

Валютный рынок

- Рубль, получив поддержку от налогового периода и от подросших цен на нефть, продолжил укрепляться к доллару и евро. К слову, нацвалюта растет уже четыре торговых дня подряд – невиданная для последнего времени серия, последний раз нечто подобное наблюдалось еще в июле.
- Несмотря на обилие важной макро статистики, которая вышла вчера, основная валютная пара евро-доллар практически никак на эти события не отреагировала, хотя стоило бы ожидать достаточно сильного роста доллара США, в условиях слабости экономики Еврозоны и силы экономики США.



Долговой рынок

- Доходности большинства выпусков ОФЗ вчера немного снизились на фоне укрепления курса рубля и роста цен на нефть. Доходности казначейских облигаций США последние пару недель консолидируются в узком диапазоне 2,3%-2,4% в отсутствии четких сигналов к дальнейшему движению и на фоне аналогичной консолидации, наблюдаемой по курсу доллара США.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно-позитивен: положительное закрытие торгов в США и выход большого числа сильной макро статистики оттуда же, с утра поддерживает умеренно-позитивное настроение на биржах Азии – там преимущественно рост, хотя и не очень сильный. Явных причин для негатива по российскому рынку сейчас нет, но фактор заметной локальной перекупленности акций, особенно по индексу ММВБ, и фактор пятницы возможно будут сдерживать рост на фондовом рынке сегодня. Не забываем и про то, что на следующей неделе состоится заседание членов картеля ОПЕК – чем ближе будет это событие, тем выше может вырасти волатильность цен на нефть и соответственно волатильность рубля, что в конечном итоге может очень неоднозначно отразиться на котировках акций.

Из важных событий сегодня можно отметить лишь запланированное выступление Марио Драги, которое должно пройти вскоре после открытия торгов в РФ.

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.