

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1950,82	1,23	4,73	
Dow Jones	16677,90	1,32	3,48	
NASDAQ	4452,79	1,60	5,58	
S&P фьючерс		-0,45		

## Индексы фондовых рынков Европы

Eurostoxx 600	328,26	0,66	5,88	
FTSE 100	6419,15	0,30	3,60	
DAX	9047,31	1,20	5,41	
CAC 40	4157,68	1,28	6,10	

## Остальной мир

MSCI World	407,38	0,63	2,62	
MSCI Emerging Markets	981,75	-0,54	0,51	
Bovespa	50713,26	-3,24	-6,60	
Nikkei 225	15270,08	0,87	5,08	
Shangh Composit	2308,88	0,28	-1,38	
Hang Seng	23300,08	-0,14	1,20	

## Россия

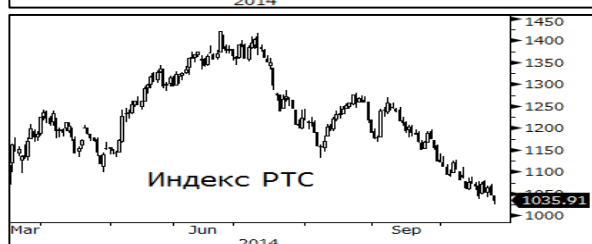
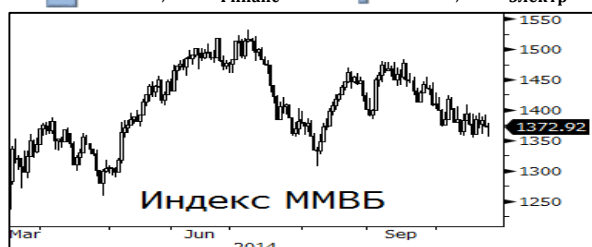
MMББ	1372,92	-0,09	0,93	
PTC	1035,91	-1,10	-3,45	
Индекс АДР Нью-Йорк	73,22	0,45	0,40	

## Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
М.Видео	190,20	4,62	АФК Система	13,01	-5,72
ФосАгро	1358,00	2,41	ММК	7,65	-4,09
ТМК	79,80	2,31	Аэрофлот	37,23	-3,30
Дикси	381,10	2,17	ФармСтанд	1135,00	-2,99
ИнтерРАО	0,01	2,14	Мечел	21,99	-2,79

## Отраслевая динамика индекса ММББ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
0,66	Химпром	4,12	Телеком
0,60	Метал	2,68	Метал
0,21	Потреб	1,23	Машин
0,06	Нефтегаз	1,15	Химпром
-0,44	Телеком	-0,07	Нефтегаз
-0,84	Электр	-1,00	Финанс
-1,03	Машин	-1,26	Потреб
-1,11	Финанс	-1,41	Электр



## Фондовый рынок

- В Америке торги завершились уверенным ростом биржевых индексов, а индекс S&P 500 закрылся выше 1950 пунктов впервые с 8 октября. Главными драйверами роста вчера стали хорошие макро данные из США и Европы, а также сильные квартальные результаты американских компаний. Рынок труда в США продолжает укрепляться – число повторных заявок на пособие по безработице продолжает стремительно сокращаться и последним данным их объем сократился до минимального значения за последние 14 лет. К слову, скорректированное на сезонность число первичных обращений за пособием также опустилось до минимумов с 2000 года. Индекс ведущих индикаторов в США в сентябре показал рост на 0,8% - выше прогнозов и лучше, чем в августе.
- К концу торгового дня американский рынок потерял примерно треть своего дневного роста из-за новой волны «Эбола-истерии»: в NY Post, незадолго до конца торгов, опубликовали статью о якобы госпитализированном в Нью-Йорке враче, с соответствующими симптомами, который занимался уходом за больными этим вирусом в Африке, что вызвало легкий приступ паники и на фондовом рынке, видимо из-за опасений, что Эбола такими темпами и до офисов на Уолл-Стрит доберется...
- В Европе торговый день был весьма волатильным – рынок менял направление движения несколько раз за день, но во второй половине дня он все-таки смог перейти к уверенному росту и индексы Старого Света закрылись на положительной территории. Инвесторы отыгрывали позитивную макро статистику по региону: производственная активность в Германии, после нескольких месяцев непрерывного падения, продемонстрировала сильный рост в октябре, вернувшись на положительную территорию. Композитный PMI Германии растет второй месяц подряд, даже несмотря на то, что сфера услуг в октябре замедлила темпы роста. Эти данные полностью перекрыли негатив от публикации французских индикаторов – судя по ним, вторая по величине экономика Еврозоны продолжает чувствовать себя очень плохо, все сильнее скатываясь в рецессию.
- Хороших показателей Германии хватило для того, чтобы общеевропейские индикаторы остановили свое падение, которое длилось все последние месяцы. Слегка порадовала в этот раз и Испания – уровень безработицы опустился до минимальных отметок за последние 2,5 года – 23,67%.
- В России торги практически весь шли на отрицательной территории из-за опасений снижения кредитного рейтинга РФ агентством S&P, о котором может быть объявлено сегодня. Если S&P все-таки решится на рейтинговое действие, то Россия потеряет инвестиционную категорию, что может привести к существенным распродажам российских активов иностранными фондами, которым нельзя работать со спекулятивными инструментами, например, пенсионным фондам. Разные неприятные сюрпризы в текущей ситуации возможны, но мы бы пока что ставили на то, что S&P не решится на столь радикальный шаг.
- Несмотря на весь негатив, рынок продолжает ощущать сильную поддержку в диапазоне 1355-1360 пунктов по индексу ММББ, где силы «быков» заметно превосходят давление «медведей». Индекс PTC вчера по ценам закрытия обновил многолетние минимумы, но внутридневной нижний экстремум (1016 пунктов), достигнутый 14 марта, пока что продолжает оставаться непокоренным.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	86,44	-0,45	0,32	
Индекс Метал.	1344,42	-0,07	2,67	
Золото	1229,40	0,07	-0,72	
Серебро	17,23	0,42	-0,58	
Индекс Зерн	340,95	1,74	2,95	

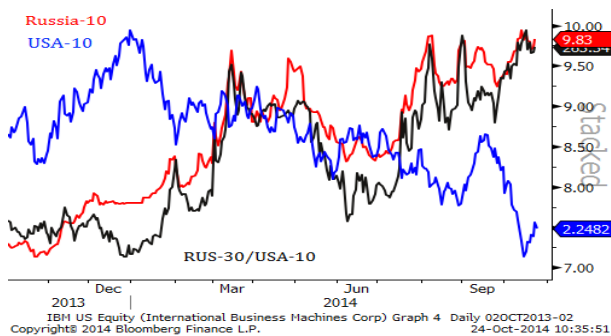
## Товарный рынок

- Цены на нефть вчера отскочили вверх на фоне появившихся в СМИ новостей о том, что Саудовская Аравия в сентябре сократила свое предложение на внешние рынки, хотя многие эксперты пока что скептически относятся к вероятности сокращения квоты на добычу со стороны стран ОПЕК. Тем не менее, ценам удалось вновь вернуться выше уровня 86 долларов за баррель.
- Цены на золото вчера упали больше чем на 1,3% на фоне выхода сильной макро статистики из США, которая продолжила оказывать поддержку росту курса доллара к мировым валютам. Цены на промышленные металлы стабильны.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,266	0,07	-0,83	
USDJPY	108,01	-0,24	1,05	
Индекс \$	85,78	-0,07	0,79	
EURRUB	52,76	0,75	0,66	
USDRUB	41,73	0,92	2,07	
Корзина ЦБ	46,69	0,84	1,44	

## Валютный рынок

- Рубль вчера продолжил падать ускоренными темпами – за два дня «деревянный» упал на 85 копеек к доллару и на 66 копеек к евро, обновив исторические максимумы к обоим валютам. Опасения понижения кредитного рейтинга РФ со стороны агентства S&P оказывают давление на национальную валюту.
- Доллар продолжил крепнуть ко всем мировым валютам на фоне выхода сильной макро статистики из США.



## Долговой рынок

- Ослабление рубля и негативные ожидания по кредитному рейтингу РФ вчера увеличив котировки российских облигаций вниз, а доходности выросли, приблизившись к локальным максимумам.
- Доходности «надежных» гособлигаций (США, Германия) растут уже вторую неделю кряду, на фоне возвращения аппетита к риску у инвесторов по всему миру, корректируясь после сильного падения, которое произошло ранее.

## Взгляд на рынок

Сегодня внешний фон для российского рынка нейтрален: торги в Америке завершились уверенным ростом, но вот с утра фьючерсы на американские индексы несут потери, из-за чего и в Азии наблюдается разнонаправленная динамика. Открытие торгов скорее всего пройдет вблизи уровней закрытия, а дальнейшая динамика вполне может быть отрицательной: многие участники рынка предпочтут закрыть свои «длинные» позиции в ожидании рейтингового решения от S&P, результаты которого будут объявлены уже после закрытия основных торгов в России.

Из экономических событий сегодня стоит обратить внимание на публикацию данных по потребительскому климату в Германии от GfK, новую оценку ВВП Великобритании, а также на статистику по продажам нового жилья в США.

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

[client@custom-capital.com](mailto: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.