

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	2 067,03	-0,12		
Dow Jones	17 814,94	-0,02		
NASDAQ	4 758,25	0,07		
S&P фьючерс	2 071,40	0,18		

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
FTSE 100	6 731,14	0,02		
DAX	9 861,21	0,77		
CAC 40	4 382,31	0,32		

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Bovespa	55 560,81	0,28		
Nikkei 225	17 411,10	0,02		
Shangh Composit	2 067,03	-0,12		
Hang Seng	23 868,35	0,10		

Россия

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
ММВБ	1 529,57	0,00		
РТС	1 054,38	-2,02		
Индекс АДР Нью-Йорк	3 364,89	0,09		

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
ПолюсЗолот	656,50	13,20	МосБиржа	61,60	-2,37
Распадская	25,06	4,00	ТМК ао	71,10	-2,11
+МосЭнерго	0,72	3,01	Галс-Девел	1 365,0	-2,02
Э.ОНРоссия	2,51	2,90	ФосАгро ао	1 495,0	-1,51
ДИКСИ ао	430,00	2,76	Татнефть Зап	147,30	-1,50

Отраслевая динамика индекса ММВБ

	Δ 1D, %		Δ 1W, %
	1,63	Телеком	Машин
	0,90	Метал	Химпром
	0,81	Потреб	Телеком
	0,59	Машин	Финанс
	0,11	Химпром	Потреб
	-0,36	Нефтегаз	Метал
	-0,39	Электр	Нефтегаз
	-0,51	Финанс	Электр

Фондовый рынок

- Торги в США завершились разнонаправленным изменением основных биржевых индикаторов, которые в течение дня топтались возле уровней открытия. Удивительно сдержанной оказалась реакция инвесторов на публикацию новой оценки ВВП, который в третьем квартале вырос сильнее прогноза и выше, чем по предыдущей оценке – на 3,9% по сравнению со вторым кварталом. Сильны оказались и потребительские расходы, увеличившиеся на 2,2% в третьем квартале, хотя экономисты прогнозировали рост только на 1,9%. Ценовой индекс ВВП, являющийся одним из индикаторов инфляции, также подрос – с 1,3% до 1,4%, что свидетельствует о немного ускорившемся темпе роста цен.
- Данные оказались очень сильными и даже если они и не смогли вызвать позитив на рынке, они могли бы в тоже время привести к распродажам, ведь укрепление экономики способствует более скорому повышению процентных ставок в США, но ничего подобного не произошло – инвесторы отреагировали очень вяло. Возможно потенциальный позитивный эффект от этих публикаций был нивелирован новым витком падения цен на нефть и выходом негативного отчета по потребительскому доверию от Conference Board: индикатор потребительского доверия в ноябре неожиданно резко снизился до минимальных значений с июня этого года, хотя аналитики ожидали роста показателя до новых многолетних максимумов. Этот фактор мог стать сигналом для инвесторов о том, что хоть текущая ситуация в экономике более чем позитивна, потенциальные риски замедления темпов роста в будущем по-прежнему сохраняются.
- В Европе торги завершились повышением основных биржевых индикаторов: инвесторы из Старого Света не испугал неоднозначный характер макроэкономической статистики США, а также падение цен на нефть. В СМИ пишут о том, что европейские инвесторы продолжили отыгрывать позитивные ожидания от дальнейших действий ЕЦБ – рассчитывают на запуск масштабной программы QE. В тоже время поддержку оказывала внутренняя макро статистика: ВВП Германии оказался неплох, оправдав прогнозы экономистов – рост на 0,1% в квартал и на 1,2% в годовом выражении. Порадовала в этот раз и Франция – опросный индикатор деловой активности растет уже второй месяц кряду и в этот раз он добрался уже до майских отметок, что дает инвесторам небольшую надежду на потенциальное улучшение экономической ситуации во второй по величине экономике Еврозоны.
- Российский рынок на вчерашних торгах себя чувствовал не слишком уверенно: с утра торги открылись заметным падением индекса ММВБ и нейтрально по индексу РТС, но в течение дня динамика торгов изменилась: долларový индикатор перешел к снижению на фоне падения цен на нефть и последовавшего за ними вниз рубля, а индекс ММВБ в тоже время стал выбираться на положительную территорию, так как девальвация для него является скорее плюсом, чем минусом. Тем не менее, к концу торгового дня весь рост по индексу ММВБ был нивелирован неоднозначной реакцией американских инвесторов на локальную макро статистику, так что рублевый индикатор фондового рынка фактически не изменился по сравнению с предыдущим днем.
- В лидерах роста вчера были акции Полюс Золота, которые растут уже вторую неделю подряд без каких-либо очевидных драйверов и новостей – всего за шесть торговых дней капитализация компании взлетела почти на 40%.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	78,55	0,28		
Пшеница	559,60	0,36		
Золото	1 197,70	0,05		
Серебро	16,57	0,10		
Алюминий	2 055,50	0,32		

Товарный рынок

- Цены на нефть в течение первой половины вчерашнего дня торговались совсем неплохо – баррель марки Brent поднялся и пытался закрепиться выше отметки 80 долларов. Тем не менее, по итогам встречи представителей России, Саудовской Аравии, Мексики и Венесуэлы в Вене, стало ясно, что добиться какого-то консенсуса по вопросу снижения квоты на добычу сторонам не удалось. Перед грядущим заседанием ОПЕК (четверг) инвесторы кажется потеряли последнюю надежду на возможность роста цен в ближайшее время и нефть на этом фоне разом улетела на 2 доллара вниз.
- Драгоценные и промышленные металлы вчера в целом слабо изменялись.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EUR/USD	1,247	-0,02		
USD/JPY	117,83	0,12		
GBP/USD	1,57	-0,05		
EUR/RUB	57,54	-0,39		
USD/RUB	46,30	0,03		
Корзина ЦБ	51,36	-0,16		

Валютный рынок

- Падение нефтяных котировок вчера критичным образом отразилось на рубле – национальная валюта резко просела, потеряв больше рубля и к доллару, и к евро, нивелировав при этом большую часть своего роста последних дней. Если цены на сырье продолжают снижение, от рубля также вряд ли стоит ждать позитивной динамики.
- Евро-доллар вчера продолжил корректироваться вверх после солидного падения на пятничных торгах: единой валюте помогают неплохие макро данные по странам Еврозоны.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Корп. Бонды ММВБ	99,59	-0,05		
Гос. Бонды ММВБ	119,72	-0,58		
Россия - 10	10,32	1,28		
США -10	2,25	-0,33		

Долговой рынок

- Долговой рынок не смог проигнорировать падение рубля и цен на нефть – доходности всех выпусков ОФЗ выросли, прибавляя в среднем по 10 б.п. Несмотря на это, Минфин сегодня планирует провести аукцион по предложению ОФЗ: ведомство предложит 10-летние бумаги на общую сумму 5 миллиардов рублей, а также трехлетние бонды на тот же объем.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: в Азии торги идут разнонаправленно и с небольшими колебаниями. Фьючерсы на американские индексы с утра немного подрастают, но этот фактор вряд ли сможет помочь индексу РТС – с утра по этому индикатору возможно сильное падение вслед за котировками фьючерсов на вечерней сессии вчера. Индекс ММВБ скорее всего откроется вблизи уровней вчерашнего закрытия.

Техническая картина по-прежнему не обещает ничего катастрофического: индекс РТС, пробив на торгах понедельника уровень диагонального сопротивления, вчера оттестировал его сверху и если сегодня он сможет удержаться выше этой отметки (примерно диапазон 1050-1055 пунктов) то это станет позитивным сигналом для индикатора, хотя уход вниз станет негативным сигналом.

Сегодня нас вновь ждет достаточно богатый список экономических публикаций: выйдет новая оценка ВВП Великобритании, статистика по заказам на товары длительного пользования в США, личным доходам и расходам там же, а также продажам жилья – тоже в Америке. На последок нас ждет традиционный еженедельный отчет по рынку труда в США – он выйдет сегодня, а не в четверг из-за праздничного дня завтра, а также новая оценка потребительского настроения от Мичиганского Университета.

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.