

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1964,58	0,71	4,12	
Dow Jones	16805,41	0,76	2,59	
NASDAQ	4483,72	0,69	5,29	
S&P фьючерс		0,07		

Индексы фондовых рынков Европы

Eurostoxx 600	327,17	-0,33	2,66	
FTSE 100	6388,73	-0,47	1,24	
DAX	8987,80	-0,66	1,55	
CAC 40	4128,90	-0,69	2,37	

Остальной мир

MSCI World	409,23	0,45	2,32	
MSCI Emerging Markets	984,38	0,27	0,29	
Bovespa	51940,73	2,42	-6,79	
Nikkei 225	15388,72	0,63	1,84	
Shangh Composit	2289,83	-0,54	-2,84	
Hang Seng	23126,56	-0,75	0,24	

Россия

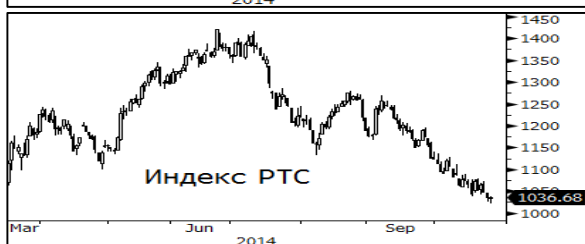
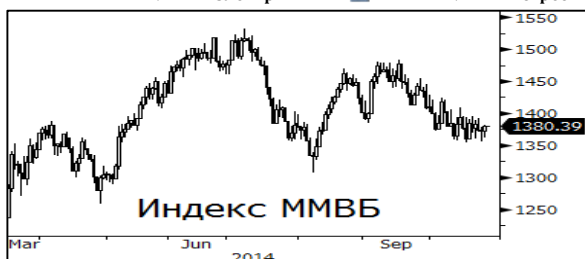
ММВБ	1380,39	0,00	0,29	
PTC	1036,68	0,07	-1,90	
Индекс АДР Нью-Йорк	73,51	0,40	-0,65	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
ММК	7,96	3,95	Мечел	21,10	-4,05
Дикси	393,00	3,12	АФК Система	12,50	-3,92
НЛМК	50,62	3,10	ФармСтанд	1105,00	-2,64
Э.ОН	2,33	2,59	Башнфт ап	683,00	-1,73
Мегафон	979,00	2,41	Распадская	15,63	-1,33

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
0,00	Машин	2,04	Метал
0,00	Химпром	1,34	Телеком
0,00	Телеком	-0,36	Химпром
0,00	Финанс	-0,50	Нефтегаз
0,00	Потреб	-1,27	Электр
0,00	Метал	-1,56	Машин
0,00	Нефтегаз	-1,71	Финанс
0,00	Электр	-2,84	Потреб



Фондовый рынок

- Американский фондовый рынок продолжил свое ралли, поднявшись до максимальных отметок с 8 октября этого года. Индекс S&P 500 закончил свою лучшую неделю с начала 2013 года, показав роста на 4,1%, а всего, с локальных минимумов, американский рынок вырос уже на 7,9%. В пятницу настроение инвесторов поддержали хорошие квартальные результаты компаний, в частности, сильные результаты продемонстрировали Microsoft и Procter & Gamble. Макро статистика особого внимания не была удостоена, а, между тем, продажи нового жилья в сентябре не дотянули до прогнозных значений, показав рост всего с 466 до 467 тысяч домов.
- Подведем итоги очередной недели квартальных финансовых отчетов в США, по 41,6% отчитавшихся компаний из состава индекса S&P 500: выручка американских компаний в среднем растет на 4,9%, а чистая прибыль на 8,8%, при этом, 61% компаний превосходит первоначальные прогнозы экономистов по выручке, а 79% опережают прогнозы по чистой прибыли. Результаты очень хорошие и у фондового рынка пока что есть вполне очевидные фундаментальные причины для совершения новой попытки закрепиться выше 2000 пунктов по индексу S&P 500.
- В Европе последний торговый день прошлой недели завершился на минорной ноте на фоне слабых макро данных из США и на негативных ожиданиях результатов стресс-тестов банковской системы Еврозоны. В воскресенье были объявлены окончательные итоги тестирования 130 крупнейших банков Еврозоны, которое проводил ЕЦБ последние 12 месяцев: 25 банков региона не прошли стресс-тесты, при этом 13 банкам предстоит принять незамедлительные меры для создания и принятия плана по наращиванию собственного капитала. Остальные 12 банков пока что также не соответствуют необходимым требованиям, но уже находятся «на пути» к решению своих проблем.
- Внутренняя макро статистика в регионе особого влияния на ход торгов не оказала: индекс потребительского климата в Германии (по версии GfK) неожиданно вырос после двух месяцев снижения, но вот данные по розничным продажам в Италии разочаровывают – падение на 3,1% в годовом выражении по результатам августа. В одной Великобритании все относительно спокойно – ВВП в годовом выражении растет на 3%, что соответствует прогнозам экономистов.
- В России торги на фондовом рынке практически весь день шли на отрицательной территории в условиях низкой активности инвесторов: участники рынка вели себя очень сдержано, не решаясь на активные действия в ожидании рейтингового решения от S&P и в преддверии парламентских выборов на Украине, которые прошли в эти выходные. Негатива добавила Европа, которая весь день провела на отрицательной территории из-за негативных ожиданий результатов стресс-тестов. Данные от EPFR также оказались весьма слабыми – очередной отток в размере 139 миллионов долларов.
- К концу торгов биржевые индексы РФ резко взмыли вверх на фоне выступления президента России на «Валдае»: речь Путина хоть и оказалась сильно «антиамериканской», в которой упор был сделан на внешнюю политику России, инвесторы все же смогли найти в ней некоторые позитивные моменты – многие эксперты отмечают, что несмотря на достаточно «жесткий» характер высказываний президента, Москва все же не хочет огораживать себя от внешнего мира, и она готова идти на диалог с западными партнерами.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	85,94	-0,22	0,63	
Индекс Метал.	1336,66	-0,58	0,05	
Золото	1230,20	-0,08	-1,11	
Серебро	17,17	-0,07	-1,06	
Индекс Зерн	334,90	-1,77	1,47	

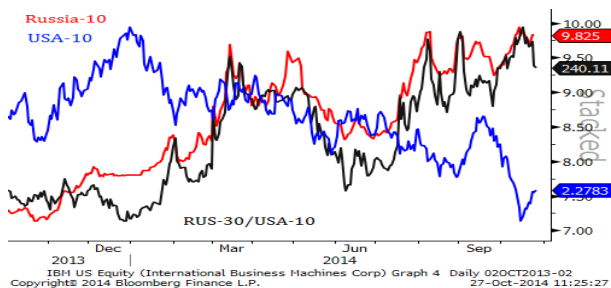
Товарный рынок

- Цены на нефть продолжают держаться в диапазоне 85-86 долларов за баррель. Сырье продолжает оставаться под давлением ожиданий того, что страны-члены ОПЕК не будут сокращать квоту на добычу нефти.
- Спрос на золото резко упал после того, как на мировые финансовые рынки вернулся спрос на рискованные активы. Цена держится в районе 1230 долларов за унцию. Укрепление доллара на прошлой неделе остановило коррекционный рост цен commodities.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,270	0,21	-0,80	
USDJPY	107,97	-0,18	0,94	
Индекс \$	85,50	-0,27	0,64	
EURRUB	53,15	0,41	1,39	
USDRUB	41,87	0,14	2,16	
Корзина ЦБ	46,94	0,26	1,81	

Валютный рынок

- Рубль в ходе вчерашних торгов продолжил обновлять свои исторические минимумы к мировым валютам: в течение дня курс доллар-рубль впервые в истории поднимался выше 42 рублей, хотя закрытие торгов прошло ниже этой отметки. Курс евро-рубль поднимался в течение дня выше отметки 53 рубля, также впервые в истории. «Деревянный» находился под давлением ожиданий рейтингового решения от S&P.
- Доллар за неделю укрепился к мировым валютам на фоне выхода ряда сильной макро статистики по США. Евро ослабло на фоне активных спекуляций на тему того, что ЕЦБ уже запустил программу выкупа активов с рынка.



Долговой рынок

- Доходности ОФЗ в пятницу по отдельным выпускам выросли до новых многолетних максимумов. Облигации РФ находились под давлением снижающихся цен на нефть, подающего рубля и ожиданиях снижения кредитного рейтинга РФ со стороны агентства S&P.

Взгляд на рынок

После закрытия основных торгов в России, появились новости от рейтингового агентства Standard & Poor's – Россия сохранила за собой инвестиционную категорию, рейтинг не был понижен, хотя прогноз остается негативным. На этом фоне фьючерсы на российские индексы резко выросли на вечерней сессии так что сегодня с открытия также стоит ждать положительной динамики.

На этой неделе нас ждет целый набор важных событий: завтра должно пройти заседание ЕК, на котором будет решаться вопрос антироссийских санкций, но уже сейчас понятно, что отмены их пока что ждать не приходится. В среду пройдет очередной этап переговоров по газовому вопросу между РФ и Украиной, также в этот же день будут объявлены официальные итоги парламентских выборов на Украине. Также в среду будут объявлены итоги заседания ФРС в США. Помимо этого, следим за выходом макро статистики на Западе и за продолжением сезона корпоративных отчетов.

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.