

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	2072,83	0,28	0,98	
Dow Jones	17827,75	0,07	0,61	
NASDAQ	4787,32	0,61	1,82	
S&P фьючерс	2073,30	0,05		

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
FTSE 100	6729,17	-0,03	0,75	
DAX	9915,56	0,55	4,55	
CAC 40	4373,42	-0,20	3,29	

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Bovespa	55098,47	-0,83	-1,79	
Nikkei 225	17272,99	-0,64	-0,49	
Shangh Composit	2615,79	0,44	5,19	
Hang Seng	24010,92	-0,42	2,47	

Россия

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
ММВБ	1537,43	0,51	0,46	
РТС	1027,61	-2,54	-1,23	
ММВБ-10	3382,02	0,51	0,70	
РТС-2	803,47	-2,14	-0,50	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
ПолюсЗолот	759,00	15,60	Э.ОНРоссия	2,50	-4,00
ФосАгро ао	1525,00	5,89	Распадская	26,40	-3,79
Фармстанд	1195,00	5,35	Галс-Девел	1346,00	-2,54
ВТБ ао	0,05	3,00	МосБиржа	60,34	-2,14
Yandex clA	1235,00	2,41	М.видео	216,20	-1,83

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
1,54	Метал	1,61	Машин
0,86	Химпром	1,61	Финанс
0,61	Нефтегаз	1,44	Метал
0,46	Машин	0,85	Химпром
0,20	Финанс	0,80	Потреб
0,05	Электр	0,12	Телеком
-0,26	Потреб	-0,56	Электр
-0,62	Телеком	-1,12	Нефтегаз

Фондовый рынок

- Американские фондовые рынки продолжают бить свои многолетние и исторические рекорды: все три основных биржевых индикатора в США вчера выросли на фоне сохраняющихся оптимистичных ожиданий от дальнейших перспектив развития экономики. Тем не менее, вышедший вчера большой блок макро статистики носил совсем не однозначный характер и в целом нельзя сказать, что данные оказались очень уж сильными. Число заказов на товары длительного пользования в октябре неожиданно выросло на 0,4%, однако за вычетом заказов на транспортные средства эта цифра оказалась в минусе на 0,9% при прогнозе роста на 0,5%. Не слишком порадовали личные доходы и расходы населения, синхронно прибавившие по 0,2% в октябре, хотя экономисты прогнозировали +0,4%. Зато порадовали данные по ценовому индексу потребительских расходов – здесь +1,6% в годовом выражении, что свидетельствует о небольшом ускорении инфляции.
- А вот остальные данные оказались совсем слабыми: число заявок на пособие по безработице неожиданно выросло за неделю на 21 тысячу, продажи нового жилья и незавершенные продажи на рынке недвижимости оказались хуже прогнозов. Наконец, не удалось порадоваться и публикации индекса потребительского настроения от Мичиганского Университета – после нескольких подряд месяцев роста, в ноябре индикатор неожиданно снизился, хоть и не сильно.
- В Европе торги шли разнонаправленно: в общем и целом, динамика была нейтральной или умеренно-негативной, но на этом фоне выделялся фондовый рынок Германии. Основной индикатор Франкфуртской биржи DAX вырос уже в десятый день кряду, добравшись до максимумов с июля этого года. Спрос на немецкие акции поддерживается со стороны крупных инвесторов, которые сейчас активно скупают бумаги крупнейших экспортёров (вроде Daimler и Siemens), которые выиграют от будущего ослабления евро, которое в свою очередь должно быть спровоцировано запуском полноценной программы количественного смягчения от ЕЦБ.
- Региональная европейская макро статистика носила смешанный характер: ВВП Великобритании оправдал прогноз, здесь без сюрпризов. Вновь неожиданно порадовала Франция, где индикатор потребительского доверия неожиданно вырос в ноябре до максимумов с марта этого года. В Италии аналогичный индикатор падает второй месяц кряду и не растёт уже полгода.
- На российском фондовом рынке вчера вновь наблюдалась разнонаправленная динамика по основным биржевым индикаторам: долларовой индекс РТС открыл торги гэпом вниз и весь день провел на отрицательной территории, потеряв с максимальных отметок понедельника уже больше 5% на фоне девальвации рубля. Индекс ММВБ же наоборот в первой половине торгового дня болтался в боковике, но в последние несколько часов смог вырваться на положительную территорию, чему как раз-таки помог падающий рубль.
- В лидерах роста уже который день акции Полюс Золота – за эту неделю капитализация компании взлетела уже на 43%. Вчера появилась хоть какая-то информация: в СМИ просочились слухи о начале обсуждения законопроекта об ограничении экспорта золота, в результате которого Минфин возможно будет обязан выкупать невостребованные на внутреннем рынке излишки производства золотодобывающих компаний. Акции Полиметалла также взбодрились: +11,5% с начала недели.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	76,60	-1,48	-4,00	
Пшеница	562,60	0,90	1,92	
Золото	1192,60	-0,33	0,08	
Серебро	16,30	-1,50	0,56	
Алюминий	2060,25	-0,04	1,34	
Никель	16429,00	0,00	0,61	
Медь	6554,38	0,44	-1,67	

Товарный рынок

- Цены на нефть вчера и сегодня продолжили валиться на фоне разочаровавших результатов переговоров между Россией Саудовской Аравией Венесуэлой и Мексикой, а также на фоне вышедших вчера негативных данных по запасам сырья в США, вновь сигнализирующих о слабом спросе на «черное золото». Сегодня нефть марки Brent торгуется на уровне 76,6 долларов за баррель – новые четырёхлетние минимумы.
- Цены на золото сегодня с утра резко снизились с уровней 1095 долларов за унцию до 1085 долларов на фоне поступивших новостей об очередном сокращении активов в управлении крупнейшего мирового ETF, обеспеченного золотом.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EUR/USD	1,251	0,01	-0,29	
USD/JPY	117,40	0,27	0,55	
GBP/USD	1,58	0,01	0,61	
EUR/RUB	59,26	-0,05	2,48	
USD/RUB	47,40	-0,05	2,73	
Корзина ЦБ	52,74	-0,05	2,61	

Валютный рынок

- Рубль вчера не смог остаться в стороне от динамики цен на нефть – «деревянный» потерял больше 100 копеек и к доллару, и евро. Укрепления нацвалюты на прошлой неделе, которая к слову оказалась одной из лучших в истории для рубля, как не бывало – всего за пару дней рубль растерял весь рост.
- Все основные мировые валюты на этой неделе укрепляются к доллару США в рамках коррекции к прошедшему падению, хотя фундаментальных причин для такой динамики не так уж много – экономика США по-прежнему сильна и макро статистика, выходящая на этой неделе, этот фактор в целом подтверждает.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Гос. Бонды ММВБ	119,40	-0,27		
Россия - 10	10,41	0,87		
Россия-15	10,41	0,87		
США-10	2,25	-0,72		
США-30	2,95	-0,36		

Долговой рынок

- Негативная рыночная конъюнктура, выражающаяся в падении цен на нефть и девальвации рубля, не позволила Минфину вчера провести сколь-нибудь успешный аукцион по размещению ОФЗ. Ведомство разместило всего лишь 1,4% от предложенных 3-летних ОФЗ, и лишь 12% от предложенных 10-летних бумаг.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня вновь нейтрален: в Азии торги идут разнонаправленно, фьючерсы на американские индексы с утра слабо изменяются. Если судить по динамике фьючерсов на российские индексы на вчерашней вечерней сессии, то сегодня можно ждать нейтрального открытия по индексу ММВБ и нового снижения индекса РТС, видимо, из-за падения рубля, которое имеет все шансы на продолжение. До какого момента оно продолжится сказать трудно, и в этой связи стоит вспомнить про обещания ЦБ устроить нелегкую жизнь спекулянтам в случае продолжения игры против рубля. Что ж – сейчас отличный момент для того, чтобы неожиданно выйти на рынок с интервенциями и окончательно продемонстрировать, что все под контролем, или же окончательно подтвердить тот факт, что удержание нацвалюты от падежа не входит в текущие планы регулятора, несмотря на все последние заявления.

Главное событие сегодняшнего дня – ключевой этап переговоров стран-членов ОПЕК, по итогам которого картель должен прийти к какому-то конкретному решению по объемам добычи «черного золота». В текущих ценах на сырье сейчас явно не закладывается вариант с заметным снижением квоты на добычу для поддержания котировок, так что вряд ли цены на нефть сильно упадут, если ОПЕК не станет ничего делать. А вот неожиданное решение о сокращении добычи наоборот может позитивно сказаться на ценах и, соответственно, на рубле, хотя этот сценарий сейчас не является основным – уж слишком сильно разногласия в рядах картеля, а в таких ситуациях трудно прийти вообще хоть к какому-то конкретному соглашению.

Кроме того, необходимо отметить, что сегодня в честь Дня Благодарения будут закрыты торги на фондовых рынках США, что будет оказывать сдерживающее влияние на активность инвесторов во всем мире, в том числе и в России. Из статистики сегодня ждем публикацию большого блока данных по странам Еврозоны.

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.