

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1994,65	0,62	2,25	
Dow Jones	17195,42	1,30	3,10	
NASDAQ	4566,14	0,37	2,55	
S&P фьючерс		0,10		

Индексы фондовых рынков Европы

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Eurostoxx 600	330,71	0,59	0,75	
FTSE 100	6463,55	0,15	0,69	
DAX	9114,84	0,35	0,75	
CAC 40	4141,24	0,74	-0,40	

Остальной мир

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
MSCI World	414,94	0,18	1,40	
MSCI Emerging Markets	1007,54	0,26	2,35	
Bovespa	52336,83	2,52	3,20	
Nikkei 225	15900,22	1,55	3,98	
Shangh Composit	2412,55	0,90	4,79	
Hang Seng	23916,54	0,90	2,64	

Россия

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
ММВБ	1452,89	0,92	5,82	
PTC	1098,68	3,69	5,98	
Индекс АДР Нью-Йорк	75,54	2,86	3,17	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Распадская	17,38	-1,86	АФК Система	15,55	11,87
ПИКК	149,10	-1,78	Башнфт ао	1165,00	10,01
Мечел	21,70	-1,72	Башнфт ап	815,00	6,12
ИнтерРАО	0,01	-1,61	ФармСтанд	1235,00	4,22
Сбер ап	56,65	-1,58	Мостотрест	87,40	3,80

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
2,18	Телеком	6,55	Нефтегаз
1,80	Финанс	5,78	Метал
1,19	Потреб	5,75	Потреб
1,02	Нефтегаз	5,61	Телеком
0,88	Химпром	5,09	Финанс
0,58	Метал	3,73	Электр
0,20	Электр	3,72	Химпром
-0,06	Машин	1,62	Машин



INDEXCF Index (MICEX Index) 2321 Daily 16MAR2014-12SEP2014
Copyright © 2014 Bloomberg Finance L.P. 31-Oct-2014 09:32:47



RTSIS Index (Russian Trading System Cash Index) research Daily 16MAR2014-12SEP2014
Copyright © 2014 Bloomberg Finance L.P. 31-Oct-2014 09:33:06

Фондовый рынок

- Вчерашние торги на мировых площадках характеризовались сильной волатильностью. В первой половине дня на рынках преобладало минорное настроение: накануне ФРС полностью свернула третью программу количественного смягчения, а Йеллен не сказала ничего приятного для инвесторов. Из Европы пришли новости о том, что один из старейших банков Еврозоны итальянский Monte Paschi ищет покупателей на свой контрольный пакет. После плохих результатов стресс-тестов, опубликованных в минувшие выходные, данная новость вызвала волну распродаж в банковском секторе периферийных стран. Выходившая вчера статистика по региону также не несла в себе позитива: потребительское доверие европейцев остается на низком уровне, безработица не сокращается желаемыми темпами.
- Однако преодолеть общий негативный настрой помогли данные по ВВП США, который в третьем квартале вырос на 3,5%, что оказалось лучше ожиданий аналитиков. По итогам дня индекс S&P500 прибавил 0,6%, преодолев сопротивление на уровне 1980 пунктов. Совокупный рост последних двух недель составил уже почти 10%, что не может не вызывать мысли о необходимости небольшого отката с целью снятия перекупленности. После чего можно было бы замахнуться и на новые максимумы.
- Европа в итоге вчера так же смогла выбраться в плюс, хотя и не такой заметный как Америка. Техническая картина в этом регионе не такая перспективная, как за океаном – среднесрочно индексы находятся в нисходящем тренде, однако пространство для краткосрочного роста присутствует.
- Торги на биржах в Азии открылись сегодня повышением основных показателей. В Лидерах роста Япония, прибавляющая более 3%. Помимо американского позитива этому способствует снижение курса иены и ожидания того, что пенсионный фонд Японии, управляющий активами в 1,2 трлн долларов США, сегодня объявит о решении увеличить долю акций в иностранных и японских компаниях до 25%.
- На российских площадках вчера был знаковый день, причем накал страстей на валютном рынке затмил рынок фондовый. В начале торгов мы наблюдали рост курса доллара, что вызвало переоценку рублевых активов и отражалось в росте индекса ММВБ. Однако на сильном проливе в валютной секции рублевые активы практически столь же резко развернулись вниз. Надо сказать, что на них также давил и внешний негатив из Европы и внутренний – вчера было принято решение о возврате акций Башнефти в собственность государства. Событие в целом ожидаемое, но в моменте оно спровоцировало резкие продажи. Однако во второй половине дня российский рынок вслед за мировыми площадками развернулся вверх и вернулся к отметке 1450 пунктов по ММВБ. А акции АФК Системы даже вырвались в лидеры роста на ожиданиях, что компании не придется возвращать в бюджет все полученные от Башнефти дивиденды.

Товарный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	85,87	-0,43	-0,30	
Индекс Метал.	1366,58	-0,46	1,65	
Золото	1198,60	0,00	-2,65	
Серебро	16,38	-0,27	-4,70	
Индекс Зерн	350,01	-0,79	4,51	

- Цены на нефть марки Brent вчера опять не смогли развить наметившийся было отскок. В целом динамика котировок сейчас отражает фазу консолидации после серьезного снижения, что не исключает еще одной попытки сходить к отметке 80 долларов за баррель.
- Золото вчера вновь тестировало уровень 1200 долларов за тройскую унцию. Если сегодня эта поддержка не устоит, стоит ждать котировки на отметке 1140-1150.

Валютный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,260	-0,10	-0,56	
USDJPY	109,36	0,14	1,10	
Индекс \$	86,21	0,07	0,56	
EURRUB	52,35	-4,41	-0,77	
USDRUB	41,50	-3,25	-0,54	
Корзина ЦБ	46,39	-3,77	-0,64	

- С открытия торгов мы наблюдали практически панику среди валютных спекулянтов, котировки на пару доллар/рубль в первый час обновили исторический максимум, вплотную подобраться к отметке 43,65 руб. Объемы торгов также были впечатляющими и сопоставимы разве что с оборотами 3 марта. Однако уже через несколько часов в рынок начали продавать большие объемы валюты, в результате чего у многих игроков в лонг начали срабатывать стопы и курс рухнул на 2 рубля менее чем за час. Слухов о причинах столь резкого разворота ходит много: достижение договоренностей по газу, достижение договоренностей по Крыму, интервенции ЦБ с целью не повышать ставку на сегодняшнем заседании... Однако учитывая сильную перепроданность рубля за последнее время и большое количество спекулянтов в нем, вполне может оказаться, что никаких тайных причин и не было. А вот что теперь ждать от сегодняшнего заседания ЦБ – большой вопрос, ведь необходимость резкого повышения ставки уже не так очевидна.



Долговой рынок

- Российский долговой рынок на фоне вчерашнего укрепления национальной валюты продемонстрировал положительную динамику. Кривая ОФЗ снизилась на 5-10 базисных пунктов перекрыв почти все потери среды. Евробонды при этом продолжили топтаться на месте под давлением новостей от ФРС и отсутствия решения по газу. Сегодня динамика будет определяться решениями ЦБ РФ, публикация которых ожидается в 13:30 МСК.

Взгляд на рынок

Внешний фон для российского рынка сегодня позитивен: на вечерней сессии фьючерс на индекс ММВБ удержал уровни закрытия, а фьючерс на индекс РТС прибавил еще 0,12%. Азиатские игроки настроены более оптимистично и продолжают разгонять мировые фьючерсы.

Из новостного фона сегодня будем отыгрывать долгожданное соглашения по газу. Результатом двухдневных переговоров стало подписание документов стоимостью \$4,6 млрд. Согласно договоренностям, Украина начнет получать российский газ после более чем четырехмесячного перерыва в обмен на частичную выплату долгов. В ближайшие дни Украина должна погасить \$1,4 млрд долга за поставки российского газа в ноябре и декабре прошлого года. В общей сложности до конца года "Газпром" получит от "Нафтогаза Украины" \$3,1 млрд в счет выплаты долгов. "Жители Европы не будут мерзнуть этой зимой благодаря достигнутым соглашениям", - обозначил главный итог договоренностей для Евросоюза председатель Еврокомиссии Жозе Мануэл Баррозу. С технической точки зрения индекс ММВБ уже начинает понемногу перегреваться, однако среднесрочный потенциал для роста сохраняется. Рекомендуем начать сокращать длинные позиции на росте, который высоковероятен сегодня, с целью переоткрыть их ниже.

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, сублицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.