

Международные рынки

США

Минувшая торговая неделя характеризовалась выходом то в плюс, то в минус, но завершалась она на территории «красных». Вверх котировки подталкивали в основном корпоративные отчеты, в большей части своей оказавшиеся лучше ожиданий, сигналы от ФРС США, в виде выхода Бежевой книги, где сообщалось о наличии медленного, но верного выхода экономики страны из кризиса. Вниз тянуло понижение рекомендации по бумагам Wells Fargo и заявление об отсутствии улучшения положения в компании. Негативом также послужило увеличение числа закладок новых домов в США в сентябре лишь до 590 тыс., в то время как надеялись увидеть рост до 610 тыс. Как обычно, рынок труда добавил пессимизма - число первоначальных обращений за пособием по безработице за позапрошлую неделю выросло до 531 тыс., ожидания строились на уровне 517 тыс. К тому же слишком высокие ценовые уровни способствуют снятию сливок инвесторами.

В итоге ведущие индексы завершили неделю с отрицательными результатами: DJI потерял 0,20%, NASDAQ COMP снизился на 0,10%, S&P500 опустился на 0,70%. Индекс волатильности VIX в среду доходил до годовых минимумов – 20,00% но в пятницу вернулся к уровням начала недели 22,25%.

Нефть

Цены на «черное золото» продолжали восходящее движение на ожиданиях сохранения поддержки экономики Китая правительством и, как следствие, сохранении спроса на сырье с их стороны. Поддержку оказывал и слабеющий американский доллар, и регулярно выходящие данные по запасам сырья в США. За позапрошлую неделю коммерческие запасы сырой нефти выросли на 1,30 млн. барр., при ожиданиях роста на 2,30 млн. барр. Запасы бензина снизились на 2,30 млн. барр., дистилляторов – на 0,80 млн. барр. В итоге недельные результаты нефти марки Brent составили +1,46%, котировки тестировали уровень в 80 долл., Light Sweet подорожала на 1,43% и сумела удержать 80 долл. за барр.

Металлы

На рынке промышленных металлов рост также поддерживался на новостях из Китая. Медь прибавила в весе 6,63%, алюминий подорожал на 3,63%, никель подскочил на 3,29%. Золото внятной динамики не показывало, колеблясь около 1060 долл. за унцию, результаты недели также оказались невнятными +0,10%, покупатели в серебре были более активны, металл за неделю подорожал на 1,38%.

Валюты

Тенденция ослабления американской валюты по отношению к мировым «собратям» сохраняется, что вызывает зарождение панических настроений в тех странах, чья валюта крепнет. Валютная пара евро-долл. перешла рубеж в 1,50\$, за неделю первый ко второму прибавил 0,68%. Фунт также демонстрировал большую часть недели восходящее движение, к ее завершению обвалился с 1,6692\$ до 1,6304\$ на фоне выхода данных о сокращении ВВП страны шестой квартал подряд. На этот раз снижение составило 0,40%, хотя ожидали роста на 0,10%. Итог недельный в этой паре 0,29% в пользу «американца». Иена продолжила слабеть к доллару -0,95%. Российская валюта продолжила укрепляться, по отношению в американской валюте на 0,83%, к европейской – на 0,39%.

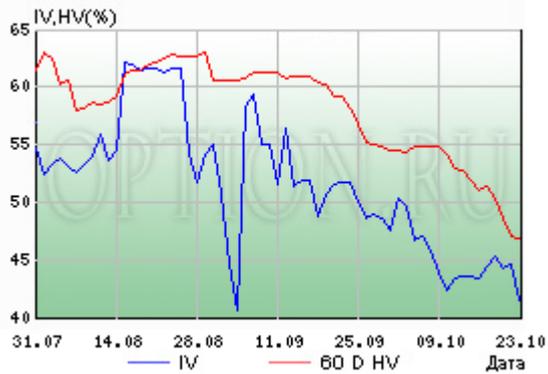
Российский рынок

ФОРТС

Торги на срочной секции РТС проходили в русле общих движений на глобальных рынках. Результаты торгов такие: SiZ9 -1,42%, GZZ9 -1,15%, VBZ9 -0,88%, EuZ9 -0,76%, EDZ9 +0,63%, RIZ9 +2,31%, LKZ9 +2,52%, GMZ9 +7,47%. Фьючерсы на индекс РТС ушли все глубже торговаться в бэквордацию. Индекс РТС в пятницу обновил годовой максимум, дойдя до 1467 п.

Обзор волатильности на рынке ФОРТС

РТС



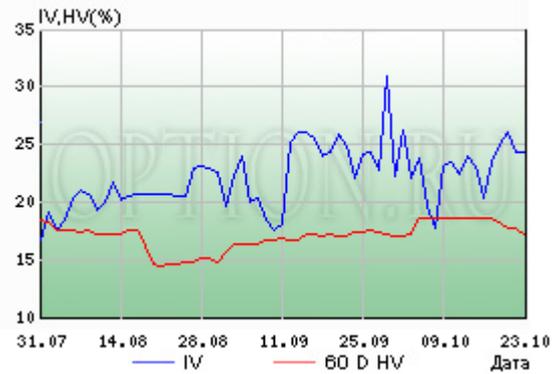
Газпром



Лукойл



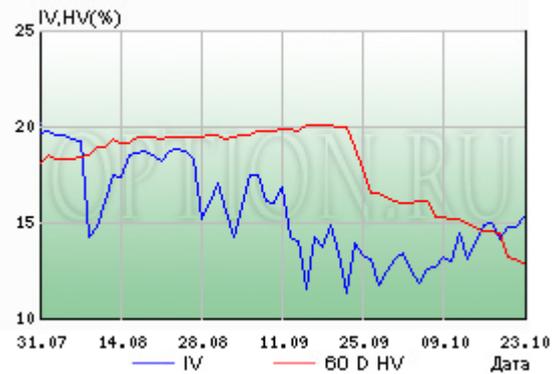
Золото



Норильский никель

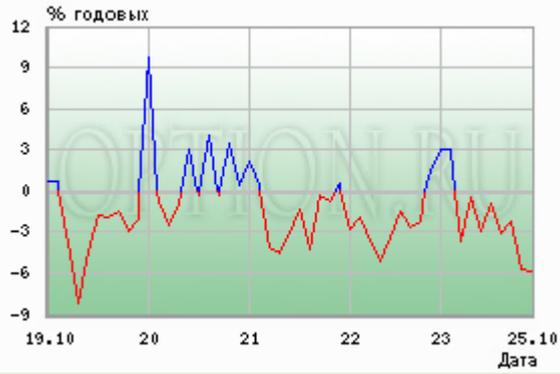


Доллар-рубль



Обзор доходности спот-фьючерс

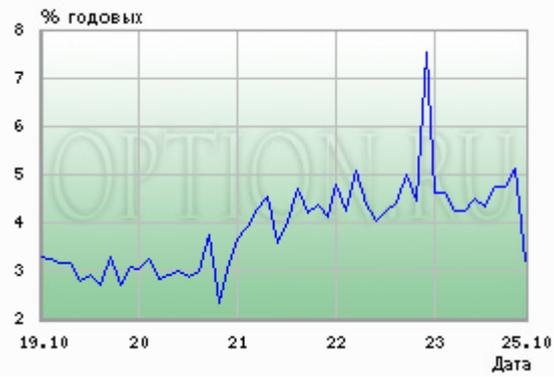
РТС



ГАЗПРОМ



Лукойл



Норильский никель

