

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1920,03	1,91%	-0,97%	-6,74%
Dow Jones	16284,70	1,47%	0,03%	-8,63%
NASDAQ	4620,17	2,28%	-2,79%	-2,45%
S&P фьючерс	1923,80	0,79%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6061,61	2,58%	0,49%	-7,68%
DAX	9660,44	2,22%	0,50%	-1,48%
CAC 40	4455,29	2,57%	0,51%	4,50%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	45059,34	2,10%	-0,62%	-9,89%
Nikkei 225	17770,74	2,20%	0,25%	1,78%
Shangh Composite	3052,78	0,48%	-2,29%	-5,62%
Hang Seng	20845,97	1,41%	-1,22%	-11,69%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1642,97	0,76%	0,14%	17,64%
РТС	789,73	0,72%	0,98%	-0,12%
ММВБ-10	3716,04	0,22%	-0,10%	22,24%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Э.ОНРоссия	2,85	5,92%	ПолюсЗолот	2900,00	-2,00%
АЛРОСА ао	57,97	5,84%	+МосЭнерго	0,81	-1,46%
ФосАгро ао	2790,00	5,00%	Уркалий-ао	193,55	-1,25%
МегаФон ао	815,00	5,00%	ТМК ао	50,90	-1,20%
ММК	20,40	4,38%	ИнтерРАО ао	1,05	-1,08%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
2,05%	Металлургия	2,53%	Химпром
1,95%	Машиностр.	1,88%	Потреб.
1,54%	Химпром	0,96%	Финансы
1,46%	Телеком.	0,28%	Энергетика
1,37%	Транспорт	0,18%	Нефть и газ
1,02%	Нефть и газ	0,02%	Машиностр.
0,76%	Финансы	-0,69%	Транспорт
0,49%	Энергетика	-1,57%	Телеком.
0,38%	Потреб.	-1,71%	Металлургия

Фондовый рынок

- Американские рынки в последний день сентября закрылись ростом на фоне опубликованных позитивных данных по рынку труда. Фондовые индексы прибавили в среднем 1,5% - 2%. Согласно данным от аналитической компании Automatic Data Processing, число занятых в несельскохозяйственном секторе США в сентябре выросло на 200 тысяч, в то время как аналитики ожидали роста лишь на 194 тысячи. Число занятых в строительных компаниях в этом же месяце выросло на 35 тысяч, а в производственных снизилось на 15 тысяч. Крупные компании создали 106 тысяч рабочих мест.
- Стоит отметить, что рынки проигнорировали ряд негативной внутренней статистики. В частности, значение индекса деловой активности (PMI) в Чикаго в сентябре оказалось на уровне 48,7 пунктов, что ниже ожидаемых экспертами 53 пунктов и предыдущего августовского значения 54,4 пунктов. Значение индекса оказалось меньше 50 пунктов, что сигнализирует на сокращение производственного сектора.
- Рынки Старого Света также завершили месяц на позитивной ноте, повысившись в среднем на 2-2,5% в ожидании стимулирования экономического роста еврозоны. Вчера агентство Евростат сообщило о годовой дефляции 0,1% в 10 странах еврозоны в сентябре, хотя в августе наблюдалась инфляция 0,1%. В сентябре эксперты прогнозировали нулевую инфляцию. Безработица в еврозоне по данным агентства осталась в августе на прежнем уровне 11%, показатель июля был пересмотрен с 10,9% до 11%.
- Рынки также проигнорировали некоторые негативные данные. Так, объем розничных продаж в Германии в августе упал на 0,4% в месячном выражении, хотя эксперты ожидали рост в 0,2%. Также, количество безработных в Германии в сентября выросло на 2 тысячи, хотя ожидалось снижение на 5 тысяч. Объем бизнес-инвестиций за 2 квартал текущего года вырос лишь на 1,6%, хотя аналитики ожидали рост в 2,9%.
- Отечественный фондовый рынок не отстал от Западных и также показал рост по итогам вчерашних торгов. Рост произошел на фоне повышающихся цен на нефть. Рынок также проигнорировал новость о том, что Совет Федерации одобрил использование ВВС РФ для нанесения ударов по позициям террористов в Сирии. Самолеты ВКС уже вчера приступили к бомбардировке позиций террористов.
- Акции авиаперевозчика «Трансаэро» вчера снова упали на 6,4%, опускавшись в ходе торгов даже до исторического минимума в 25 рублей на новостях о возможном банкротстве компании. Вице-премьер РФ И. Шувалов не исключил вариант банкротства перевозчика.
- Фондовые рынки Китая сегодня ушли на недельные каникулы из-за национальных праздников. Поэтому Китай пока перестанет оказывать влияние на мировые рынки. Стоит отметить, что для азиатских рынков завершившийся квартал стал одним из худших с начала финансового кризиса, а угроза замедления экономического роста Китая и возможное повышение ставки ФРС США скорее всего не облегчит начало октября. Пессимизма добавляют цены на промышленные металлы, включая медь и цинк, которые упали до многолетних минимумов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,75	1,97%	1,37%	-15,28%
Light	45,69	2,19%	1,85%	-14,93%
Алюминий	1582,00	0,76%	-0,06%	-14,60%
Золото	1114,30	-0,89%	-1,75%	-5,82%
Медь	5237,10	4,83%	3,15%	-15,94%
Никель	10420,00	5,36%	6,82%	-31,22%
Пшеница	512,60	1,59%	1,10%	-13,06%
Серебро	14,57	-0,07%	-1,69%	-7,11%

Товарный рынок

- Нефть марки «Brent» по итогам вчерашних торгов выросла почти на 2%. Стоимость барреля «черного золота» данной марки стала равна 48,75 долларам. Интересно, что нефть проигнорировала данные о том, что согласно Информационному Агентству энергетики (EIA) запасы сырой нефти за прошедшую неделю выросли на 3,955 млн баррелей, хотя аналитики ожидали роста лишь на 102 тысячи. При этом неделей ранее запасы снижались на 1,9 млн баррелей. Скорее всего нефть удержалась от снижения на информации о сокращении добычи «черного золота» в США на 40 тысяч баррелей в сутки или на 0,43%. Также запасы на крупнейшем в США терминале в Кушинге снизились на 1 млн баррелей – до 53 миллионов.
- Стоимость золота снизилась на 0,89% на фоне укрепления американской валюты из-за положительной статистики по рынку труда США.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	65,39	-0,52%	-1,55%	10,39%
EUR/RUB	73,17	-1,00%	-1,42%	1,60%
Бивалютная корзина	69,76	-0,01%	-0,05%	13,06%
EUR/USD	1,1147	-0,96%	-0,38%	-7,88%
GBP/USD	1,5131	-0,21%	-0,84%	-2,92%
USD/JPY	120,20	0,31%	0,10%	0,37%

Валютный рынок

- Рубль по итогам вчерашних торгов укрепился как к доллару и евро из-за дорожающей нефти. Рубль укрепился к доллару на 0,52% - до 65,39 рублей за доллар. Курс рубля к евро упал на 1% - до 73,17 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины снизилась незначительно до 69,76 рублей. Стоит отметить, что рубль двигался только вслед за котировками на нефть, игнорируя при этом геополитику, так как о действиях РФ в Сирии было известно заранее после переговоров президентов России и США.
- Курс доллара к евро вчера понизился на 0,96% из-за укрепления американской валюты. Теперь за евро придется отдать 1,11 доллара.
- Индекс доллара вчера поднимался на 0,48% - до 96,35 пунктов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	118,86	0,32%	0,14%	12,81%
США 10-летние, %	2,06	-0,01	-0,08	-0,11
США 30-летние, %	2,87	0,00	-0,06	0,12
Россия 10-летние, %	11,22	-0,07	-0,02	-2,87
Россия 15-летние, %	11,02	-0,03	-0,01	-2,42

Долговой рынок

- Минфин на вчерашнем еженедельном аукционе ОФЗ разместил облигаций серии 26214 и 29006 на 15 млрд рублей при спросе в 47,3 млрд рублей. Облигаций серии 26214 с погашением в мае 2020 года было размещено на 10 млрд рублей, цена отсечения составила 83,16% от номинала, а доходность по цене отсечения – 11,43% годовых. Облигаций серии 29006 со сроком погашения в январе 2025 года было размещено на 5 млрд рублей. Цена отсечения составила 100,9% номинала, а доходность по цене отсечения – 14,8% годовых.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня позитивный: фьючерсы на западные индексы торгуются с положительной динамикой. Кроме того, Азиатские биржи также растут на позитивной статистике из Китая: индекс деловой активности в промышленности в сентябре повысился с 49,7 пунктов до 49,9 пунктов, аналитики же ожидали значение на уровне 49,6 пунктов. Цены на нефть также продолжают с утра укрепляться.

Открытие рынка сегодня ожидаем выше вчерашних уровней открытия на фоне внешнего позитива. Индекс ММВБ вчера закрылся второй подряд белой свечой на уровне 1642,97 пунктов и ожидается продолжение роста в район 1660-1680 пунктов. РТС также закрылся белой свечой на уровне 789,73 пунктов продолжив рост. Сегодня можно ожидать позитивное направление индекса к 800-810 пунктам.

Сегодня ожидаем публикацию данных по России, а именно индекса производственной активности за сентябрь и объемов международных резервов ЦБ. Кроме того, станут известны индексы деловой активности в производственном секторе Германии и США и Еврозоны в целом за сентябрь.

Просим нас извинить, если данное письмо попало к Вам по ошибке или доставило неудобства. Если Вы не хотите получать подобные письма в дальнейшем, просьба воспользоваться [%ОТПИСАТЬСЯ ОТ РАССЫЛКИ ЕЖЕДНЕВНЫХ ОБЗОРОВ%](#)

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.

© 2015, 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.