

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1923,82	0,20%	-0,44%	-6,56%
Dow Jones	16272,01	-0,08%	0,44%	-8,70%
NASDAQ	4627,08	0,15%	-2,27%	-2,30%
S&P фьючерс	1916,10	-0,04%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6072,47	0,18%	1,86%	-7,52%
DAX	9509,25	-1,57%	0,87%	-3,02%
CAC 40	4426,54	-0,65%	1,82%	3,82%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	45313,27	0,56%	0,05%	-9,39%
Nikkei 225	17733,70	0,06%	0,60%	1,57%
Shangh Composite	3052,78	0,48%	-1,12%	-5,62%
Hang Seng	21408,78	2,70%	1,98%	-9,30%

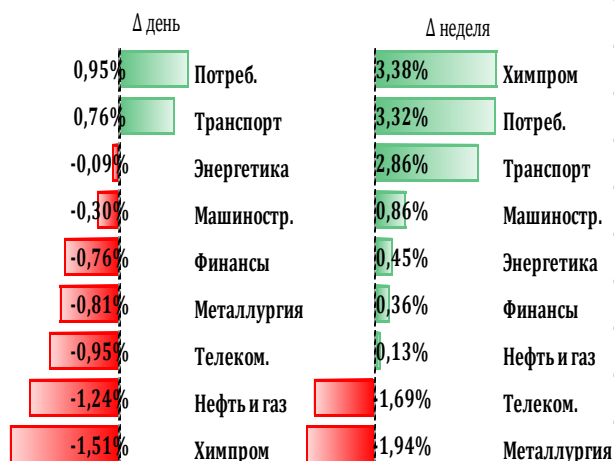
Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1626,97	-0,97%	0,34%	16,49%
РТС	781,65	-1,02%	1,59%	-1,15%
ММВБ-10	3697,76	-0,49%	0,86%	21,64%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Аэрофлот	36,10	2,47%	Акрон	2950,00	-3,00%
ФСК ЕЭС ао	0,06	1,71%	НЛМК ао	72,92	-2,85%
Мечел ао	63,27	1,64%	Уркалий-ао	188,50	-2,61%
ДИКСИ ао	315,50	1,40%	ЛУКОЙЛ	2184,00	-2,60%
Ростел-ап	58,10	1,04%	Роснефть	237,90	-2,08%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Рынки за океаном начали месяц в основном ростом в ожидании данных по рынку труда США, которые будут опубликованы сегодня. Так, индекс S&P 500 вырос на 0,2% - до 1923,82 пунктов, NASDAQ немного вырос на 0,15% и составил 4627,08 пунктов, а индекс Dow Jones наоборот снизился на 0,08% - до 16272,01 пунктов. Позитивное влияние на торги оказывала информация из Поднебесной, где индекс деловой активности в производственном секторе PMI за сентябрь составил 49,8 пунктов, что превысило как значение августа (49,7 пунктов), так и ожидаемое экспертами значение в 49,6 пунктов.
- Вчера стал известен индекс деловой активности в производственном секторе PMI в США, который в сентябре превысил ожидания аналитиков (53,1 пунктов, против ожидаемых 53 пунктов и августовского значения в 53 пункта). Индекс деловой активности в производственном секторе США от ISM в сентябре наоборот оказался ниже ожидаемого уровня (50,5 пунктов против 50,7 пунктов ожидаемых и 51,2 пунктов августа. Однако оба индекса пока еще превышают значение 50, что говорит о расширении производства, однако индекс от ISM упал более значительно, что может служить негативным сигналом для экономики.
- Также стало известно количество первичных заявок на получение пособий по безработице за прошлую неделю. Было подано 277 тысяч заявок на пособие, что на 10 тысяч больше значения, зарегистрированного неделей ранее. Значение оказалось хуже прогнозируемых аналитиками 270 тысяч заявок.
- Рынки Европы вчера закрылись разнонаправленно, преимущественно падением на фоне противоречивой внутренней статистики. Так, индексы DAX и CAC 40 упали на 1,57% и 0,65% и составили 9509,25 и 4426,54 пунктов соответственно. Британский индекс FTSE 100 наоборот подрос на 0,18% - до 6072,47 пунктов.
- Индекс деловой активности в производственном секторе PMI в Германии за сентябрь составил 52,3 пункта, снизившись с 52,5 пунктов августа. Аналитики же ожидали сохранения августовского значения показателя в 52,5 пунктов. Британский индекс был поддержан новостью о индексе деловой активности в производственном секторе PMI Великобритании, который в сентябре составил 51,5 пункта, что оказалось выше ожидаемого экспертами значения в 51,3 пункта.
- Российский фондовый рынок завершил вчерашние торги в красной зоне на фоне ослабления рубля и снижения цен на нефть. Индекс ММВБ упал на 0,97% - до 1626,97 пунктов, а РТС снизился на 1,02% - до 781,65 пунктов. Акции «Трансаэро» продолжили падение на новостях о вероятном банкротстве перевозчика. Бумаги упали на 11,9%. Глава Сбербанка Герман Греф заявил, что «Трансаэро» спасти скорее всего не удастся. Первый вице-премьер РФ Игорь Шувалов накануне также сообщил о вероятности банкротства авиакомпании. Кроме того, Арбитражный суд Москвы назначил на 16 ноября предварительные слушания по иску Альфа-Банка к «Трансаэро» о взыскании более 11,3 млн долларов.
- Также вчера стали известны данные по международным резервам Центробанка, которые в сентябре снизились с 369 миллиардов до 368,5 млрд. Кроме того, индекс производственной активности PMI в России в сентябре вырос до 49,1 пункта с августовских 47,9 пунктов и достиг максимума за последние 6 месяцев, что является позитивным сигналом для экономики страны.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,02	-1,50%	-0,44%	-16,55%
Light	45,20	-1,07%	0,42%	-15,84%
Алюминий	1568,50	-0,85%	-0,73%	-15,33%
Золото	1110,90	-0,31%	-3,10%	-6,11%
Медь	5078,37	-3,03%	-0,17%	-18,49%
Никель	10070,00	-3,36%	1,82%	-33,53%
Пшеница	519,40	1,33%	4,47%	-11,91%
Серебро	14,49	-0,55%	-3,91%	-7,62%

Товарный рынок

- Нефть марки «Brent» вчера в начале торгов укреплялась на фоне сильной статистики из Китая, однако вечером «черное золото» перешло к снижению из-за слабой макроэкономической статистики из США, которая поумерила оптимизм инвесторов. В первую половину торгов нефть подогрели и увеличившиеся геополитические опасения, которые выросли после начала операции ВВС РФ в Сирии. В итоге котировки на «Brent» упали на 1,5% и составили 48,02 доллара за баррель.
- Стоимость золота по состоянию на вчерашний вечер падала на фоне слабых данных из Америки. Рынок золота будет ждать данных по рынку труда в США, которые будут опубликованы сегодня.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	65,65	0,40%	-0,68%	10,83%
EUR/RUB	73,43	0,36%	-1,01%	1,97%
Бивалютная корзина	68,76	-0,01%	-2,51%	11,45%
EUR/USD	1,1177	0,27%	0,07%	-7,64%
GBP/USD	1,5142	0,07%	-0,47%	-2,85%
USD/JPY	119,99	-0,18%	-0,09%	0,19%

Валютный рынок

- Рубль к закрытию торгов ослаб по отношению к доллару и евро после нескольких дней роста. Так курс рубля к доллару вырос на 0,4% и составил 65,65 рублей за доллар. Курс рубля к евро также вырос на 0,36% и составил 73,43 рубля за евро. Стоимость бивалютной корзины снизилась на 0,01% и составила 68,76 рублей. На ослабление национальной валюты оказало влияние снижение цен на нефть, а также геополитические факторы.
- Курс доллара снижался по отношению к большинству мировых валют на слабой статистике из США. Индекс доллара опускался на 0,26% - до 96,04 пунктов.
- Курс доллара к евро вчера также вырос на 0,27% - до 1,117 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	119,32	0,39%	0,73%	13,25%
США 10-летние, %	2,05	-0,02	-0,10	-0,12
США 30-летние, %	2,85	-0,02	-0,06	0,11
Россия 10-летние, %	11,14	-0,15	-0,27	-2,95
Россия 15-летние, %	10,94	-0,11	-0,20	-2,50

Долговой рынок

- Вчера была зарегистрирована программа биржевых облигаций «РГС Недвижимость» объемом 30 млрд рублей. Номинальная стоимость облигации составила 1000 рублей. Максимальный срок до погашения - 10 лет.
- Доходность российских 10- и 15-летних облигаций вчера незначительно снизилась.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтральный: фьючерсы на западные индексы торгуются без особой динамики. Площадки АТР сегодня с утра показывают незначительное снижение в рамках коррекции после укрепления накануне. Цены на нефть однако демонстрируют незначительный рост с утра на фоне опасений, касательно того, что ураган «Хоакин» на восточном побережье США может нанести ущерб нефтяным установкам.

Открытие рынка сегодня ожидаем на уровне закрытия вчерашних торгов или небольшим снижением. Индекс ММВБ вчера закрылся черной свечой на уровне 1626,97 пунктов. РТС также закрылся черной свечой на уровне 781,65 пунктов. Пока что вероятность разворота рынка вверх сохраняется, однако для этого котировкам было бы неплохо закрыть последний день этой недели хорошей белой свечой. В тоже время закрытие сегодня сильным падением и пробой уровней 1610 пунктов по индексу ММВБ и 765 пунктов по индексу РТС может стать сигналом к дальнейшему падению рынка еще на 3-6% вниз.

Сегодня рынки будут ожидать публикации важных данных по рынку труда США за сентябрь, а также информацию по объемам промышленных заказов в США за август. Кроме того, будет обнародован индекс деловой активности в строительном секторе в Великобритании за сентябрь.

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.