

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|-------------|------------|--------|----------|---------------|
| S&P 500 | 2079,36 | -0,48% | 1,31% | 0,99% |
| Dow Jones | 17663,54 | -0,52% | 1,00% | -0,90% |
| NASDAQ | 5053,75 | -0,40% | 2,72% | 6,71% |
| S&P фьючерс | 2065,80 | -0,38% | | |

Индексы фондовых рынков Европы

| | | | | |
|----------|----------|--------|--------|--------|
| FTSE 100 | 6361,09 | -0,54% | -0,24% | -3,12% |
| DAX | 10850,14 | 0,46% | 3,41% | 10,65% |
| CAC 40 | 4897,66 | 0,24% | 1,99% | 14,87% |

Остальной мир

| | | | | |
|------------------|----------|--------|--------|--------|
| Bovespa | 45868,82 | 0,53% | -3,98% | -8,28% |
| Nikkei 225 | 18687,25 | -2,07% | -0,97% | 7,03% |
| Shangh Composite | 3381,82 | -0,02% | 0,37% | 4,55% |
| Hang Seng | 22504,08 | -0,60% | -2,80% | -4,66% |

Россия

| | | | | |
|---------|---------|-------|--------|--------|
| ММВБ | 1711,53 | 0,17% | -0,03% | 22,55% |
| РТС | 845,54 | 0,71% | -1,77% | 6,93% |
| ММВБ-10 | 3974,84 | 0,61% | 0,55% | 30,75% |

Лидеры роста/падения

| Лидеры | Цена закр. | Δ день | Аутсайдеры | Цена закр. | Δ день |
|----------|------------|--------|--------------|------------|--------|
| Мечел ао | 64,79 | 8,16% | Фармстанд | 1085,00 | -3,00% |
| ММК | 24,07 | 5,89% | БСП ао | 37,90 | -2,70% |
| ЛСР ао | 619,00 | 4,00% | АЛРОСА ао | 51,40 | -2,47% |
| Аэрофлот | 49,00 | 3,29% | Россети ао | 0,45 | -2,16% |
| НЛМК ао | 78,20 | 2,76% | Татнефть Зао | 328,80 | -1,84% |

Отраслевая динамика индекса ММВБ

| Δ день | | Δ неделя | |
|--------|-------------|----------|-------------|
| 1,55% | Транспорт | 1,93% | Транспорт |
| 0,84% | Металлургия | 1,81% | Потреб. |
| 0,31% | Машиностр. | 1,72% | Металлургия |
| 0,26% | Финансы | 1,00% | Финансы |
| -0,10% | Нефть и газ | 0,60% | Химпром |
| -0,22% | Энергетика | 0,42% | Телеком. |
| -0,39% | Потреб. | -0,12% | Нефть и газ |
| -0,45% | Телеком. | -0,26% | Энергетика |
| -0,93% | Химпром | -0,72% | Машиностр. |

Фондовый рынок

- Американские фондовые индексы в последний торговый день октября закрылись небольшим снижением, в среднем на 0,5%, на неопределенности, вызванной слабыми статистическими данными и в целом позитивными финансовыми отчетами местных компаний.
- Давление на рынки оказали данные по расходам физических лиц на потребление, которые в сентябре выросли на 0,1% в месячном выражении, хотя аналитики прогнозировали рост на 0,2%. Не оправдал ожиданий индекс ожиданий потребителей от Мичиганского университета. Эксперты ожидали значение в 83,1 пункт, однако в итоге в октябре индекс составил 82,1 пункт, против сентябрьских 82,7 пунктов. Индекс потребительского доверия от Мичиганского университета также не удовлетворил ожиданий в октябре (90 пунктов, против ожидаемых 92,5 и сентябрьских 92,1 пунктов).
- Среди опубликованных финансовых отчетностей, которые оказались во внимании игроков, компания «Chevron», прибыль которой по итогам прошедшего квартала хоть и снизилась более чем в два раза (с 5,6 млрд долларов, до 2,04 млрд долларов), все же оказалась лучше ожиданий аналитиков: итоговое значение прибыли на акцию составило 1,1 доллара, против ожидаемых 76 центов за бумагу. Также не разочаровала экспертов Bloomberg крупнейшая частная энергетическая компания «ExxonMobil»: прибыль на акцию по итогам третьего квартала составила 1,01 доллара, против ожидаемых 89 центов за бумагу. Таким образом, финансовые отчетности, в целом, оказали поддержку рынкам США.
- Рынки Старого Света закрыли последнюю сессию октября разнонаправленно, преимущественно небольшим ростом. В минусе оказался только Британский индекс FTSE 100 (-0,54%). На индекс «надавили» финансовые отчетности таких компаний, как IAG SA («дочка» British Airways), чья операционная прибыль не удовлетворила ожиданий аналитиков, и «Royal Bank of Scotland Group», прибыль которого, по итогам третьего, квартала сократилась почти вдвое.
- Объемы розничных продаж в Германии по итогам сентября не изменились, хотя аналитики прогнозировали рост на 0,4% в месячном выражении. Также не удовлетворили ожиданий и потребительские расходы во Франции, которые также, как и в Германии остались на уровне августа, при прогнозируемом росте на 0,2%. Полученные данные могут подстегнуть ЕЦБ к расширению мер стимулирования экономики, тем более, что уровень инфляции по Еврозоне в целом, в октябре, по предварительным оценкам составил 0%, по сравнению с октябрём 2014 года, хотя ожидалась инфляция на уровне 0,1%. Наконец, стали известны данные по безработице в Еврозоне в сентябре: 10,8%, против ожидаемых 11% и пересмотренного в сторону понижения показателя августа - 10,9%.
- Отечественный фондовый рынок закончил месяц на позитивной ноте ростом по обоим индексам на фоне роста нефтяных котировок, которые пробивались выше уровня в 49 долларов за баррель по марке «Brent». Индекс ММВБ подрос на 0,17% - до 1711,53 пунктов, а РТС увеличился на 0,71% и составил 845,54 пунктов. Объемы торгов бумагами из базы расчета индекса ММВБ выросли относительно четверга до 26,56 млрд рублей. При этом ММВБ по итогам октября вырос на 5,2%, а РТС вырос на 8,17% за этот же период.
- Центральный Банк РФ в пятницу принял решение сохранить ключевую ставку на прежнем уровне 11%, что оказало поддержку национальной валюте. Сам факт сохранения

ключевой ставки, в принципе, вряд ли удивил рынок, так как это ожидалось и прогнозировалось аналитиками. Однако регулятор сообщил о возможном снижении ставки на ближайших заседаниях.

- Акции «Мечела» в пятницу показали рост более чем на 8% на фоне новостей о возможной продаже «Эльгаугля». От 50% до 100% «Эльгаугля» может быть продано крупнейшему кредитору «Мечела» «Газпромбанку». Вырученную от продажи сумму компания планирует потратить на частичное погашение основного долга и выплату процентов перед Сбербанком.
- Акции «Трансаэро», после ралли на фоне новостей о заинтересованности перевозчиком малазийскими инвесторами, немного корректировались вниз - примерно на 3%.

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|----------|------------|--------|----------|---------------|
| Brent | 49,55 | 1,75% | 2,29% | -13,89% |
| Light | 46,37 | 1,16% | 1,76% | -13,67% |
| Алюминий | 1478,00 | 0,20% | -0,54% | -20,22% |
| Золото | 1139,90 | -0,58% | -2,49% | -3,66% |
| Медь | 5096,00 | -0,64% | -2,80% | -18,21% |
| Никель | 10100,00 | -1,70% | -2,98% | -33,33% |
| Пшеница | 522,40 | 0,62% | 6,57% | -11,40% |
| Серебро | 15,49 | -0,58% | -2,49% | -1,28% |

Товарный рынок

- Нефтяные котировки в пятницу росли на фоне данных от Baker Hughes о сокращении числа буровых установок в США с 594 до 578 (на 2,7%). Таким образом, количество нефтяных буровых установок упало до минимума с июня 2010 года. Стоимость барреля нефти марки «Brent» достигало 49,5 долларов за баррель, приближаясь к психологически значимому уровню 50 долларов.

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|--------------------|------------|--------|----------|---------------|
| USD/RUB | 63,96 | -0,69% | 2,18% | 7,98% |
| EUR/RUB | 70,37 | -0,44% | 1,16% | -2,28% |
| Бивалютная корзина | 67,56 | 0,60% | 0,93% | 9,51% |
| EUR/USD | 1,1029 | 0,47% | -0,78% | -8,86% |
| GBP/USD | 1,5431 | 0,71% | 0,14% | -0,99% |
| USD/JPY | 120,32 | -0,23% | -0,29% | 0,47% |

Валютный рынок

- Национальная валюта в пятницу получила поддержку от дорожающей нефти и решения ЦБ РФ сохранить ключевую ставку. Так, курс доллара к рублю упал на 0,69% и составил 63,96 рублей за доллар, а курс евро к рублю снизился на 0,44% и составил 70,37 рублей за евро.
- Доллар в пятницу дешевел к большинству мировых валют на слабых внутренних статистических данных. Индекс доллара падал на 0,32% - до 96,91 пунктов. Курс доллара к евро упал на 0,47% и за евро теперь придется отдать 1,102 доллара.

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|---------------------|------------|--------|----------|---------------|
| Индекс ОФЗ | 124,23 | -0,06% | 0,30% | 17,91% |
| США 10-летние, % | 2,14 | -0,01 | 0,10 | -0,03 |
| США 30-летние, % | 2,92 | -0,03 | 0,05 | 0,17 |
| Россия 10-летние, % | 10,05 | -0,05 | -0,04 | -4,04 |
| Россия 15-летние, % | 10,07 | 0,02 | 0,03 | -3,37 |

Долговой рынок

- Банк Интеза в пятницу утвердил программу биржевых облигаций до 50 млрд рублей. Максимальный срок обращения бумаг составит 10 лет.
- В целом серьезных событий на долговом рынке не происходило.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются в «красной зоне». Площадки Азиатско-Тихоокеанского региона также утром демонстрируют негативное движение на сообщениях из Китая о том, что индекс деловой активности (PMI) в Поднебесной уже 8 месяц подряд находится ниже 50 пунктов, что говорит о замедлении местной промышленности. Нефтяные котировки ярко выраженного движения не демонстрируют.

Открытие фондового рынка сегодня ожидаем немного ниже закрытия пятницы на негативном внешнем фоне. Индекс ММВБ в пятницу закрылся белой свечой на уровне 1711,53 пунктов, при этом демонстрируя широкие колебания в ходе торгов от 1695 пунктов до 1725 пунктов. Всю прошедшую неделю индекс демонстрировал боковое движение с уровнем поддержки в районе 1700-1705 пунктов и уровнем сопротивления в районе 1725-

1730 пунктов. Направление дальнейшего движения пока неясно. Ждем новых сигналов. Индекс РТС, на фоне укрепления рубля, «нарисовал» белую свечу до 845,54 пунктов и пока находится ниже уровня 850 пунктов, который был пробит индексом в середине прошлой недели. Ослабление рубля на неделе может отправить индекс в негативное движение, однако если нефтяные котировки окажут поддержку и состоится уверенный пробой уровня 850 пунктов, то индекс может направиться и к 880 пунктам.

Сегодня ожидается пул статистических данных по индексам деловой активности в производственном секторе (PMI) в октябре сразу из нескольких стран: России, Испании, Италии, Германии, Великобритании и США.

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, опубликовывать, 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.