

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2104,05	1,19%	1,39%	2,19%
Dow Jones	17828,76	0,94%	1,03%	0,03%
NASDAQ	5127,15	1,45%	1,89%	8,26%
S&P фьючерс	2095,70	0,01%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6361,80	0,01%	-1,28%	-3,11%
DAX	10950,67	0,93%	1,45%	11,68%
CAC 40	4916,21	0,38%	-0,15%	15,31%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	45868,82	0,53%	-3,63%	-8,28%
Nikkei 225	18678,48	-2,12%	-1,74%	6,98%
Shangh Composite	3325,67	0,02%	-3,24%	2,81%
Hang Seng	22676,17	1,37%	-2,28%	-3,94%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1735,75	1,42%	0,60%	24,28%
РТС	853,77	0,97%	-2,19%	7,98%
ММВБ-10	4029,57	1,38%	1,29%	32,55%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ЛУКОЙЛ	2412,00	4,00%	ЛСР ао	606,00	-2,10%
Сбербанк	93,65	3,45%	ММК	23,75	-1,33%
+МосЭнерго	0,85	3,35%	БСП ао	37,50	-1,06%
ИнтерРАОа	1,26	3,32%	СОЛЛЕРС	449,00	-1,00%
Россети ао	0,46	2,49%	ВСМПО-АВСМ	11550,00	-1,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,77%	Финансы	4,08%	Транспорт
1,73%	Энергетика	1,93%	Потреб.
1,34%	Нефть и газ	1,28%	Энергетика
1,05%	Телеком.	1,28%	Химпром
0,40%	Транспорт	0,77%	Металлургия
0,36%	Потреб.	0,63%	Телеком.
0,17%	Химпром	0,55%	Нефть и газ
-0,07%	Металлургия	0,21%	Финансы
-0,08%	Машиностр.	-1,90%	Машиностр.

Фондовый рынок

- Фондовые рынки за океаном начали первую неделю нового месяца ростом по всем основным индексам, отыгрывая в целом позитивные макростатистические данные. При этом индекс высокотехнологичных компаний NASDAQ достиг 15-летнего максимума в 5127,15 пунктов. В целом рынок поддержали компании из секторов нефти и газа, здравоохранения и финансов.
- Американский Институт управления поставками (ISM) вчера сообщил, что индекс деловой активности в промышленном секторе экономики страны в октябре хоть и снизился, по сравнению с сентябрем, с 50,2 пунктов до 50,1 пункта, превзошел ожидания аналитиков (50 пунктов). Таким образом, значение показателя говорит о том, что в США с июня 2013 года непрерывно наблюдается расширение производства. Рост производства также подтверждают значения индекса деловой активности в производственном секторе (PMI). Так, индекс в октябре составил 54,1 пункт, против сентябрьских 54 пунктов. Аналитики ожидали, что значение показателя не изменится.
- Лучше ожиданий аналитиков также оказался уровень расходов на строительство за сентябрь. Расходы выросли на 0,6%, хотя ожидался меньший рост – на 0,5%. Кроме того, инвесторы обратили внимание на новости корпораций. Французский концерн Alstom вчера закрыл сделку по продаже своего энергетического бизнеса американскому гиганту general Electric, а стоимость сделки составила более 12 миллиардов евро.
- Европейские биржи также начали новый месяц с небольшого повышения. Росту способствовали позитивные внутренние статданные, среди которых октябрьские индексы деловой активности в производственных секторах экономики (PMI) сразу нескольких стран: Германии, Великобритании, Италии, Испании и Франции. Кроме того, был опубликован композитный индекс деловой активности в производстве (PMI), который в октябре превысил ожидания аналитиков (52,3 пункта, против 52 пунктов).
- Что касается отдельных стран, то в Германии, Великобритании и Италии индексы оказались выше ожидаемых значений – в Германии 52,1 пункт, против ожидаемых 51,6 пунктов, в Великобритании индекс составил 55,5 пунктов, против ожидаемых 51,3 пунктов, а в Италии – 54,1 пункт, против ожидаемых 53 пунктов. В Испании и Франции индексы, увы, не дотянули до ожиданий аналитиков, однако сохранили свои значения выше 50 пунктов (50,6 пунктов для Франции и 51,3 для Испании), что говорит о расширении производства в странах и является позитивным сигналом.
- Российский рынок акций не отстал от западных рынков, закрывшись в «зеленой зоне» по итогам торговой сессии понедельника. Драйверами рынка стали акции финансового, энергетического и нефтегазового сектора. В итоге, индекс ММВБ вырос на 1,42% - до 1735,75 пунктов, а РТС увеличился на 0,97% и составил 853,77 пунктов. Объемы торгов по бумагам из базы расчета индекса ММВБ не сильно изменились по сравнению с пятницей и составили 27,52 млрд рублей.
- Вчера был опубликован индекс производственной активности (PMI) для нашей страны. Индекс превысил ожидания экспертов: 50,2 пункта, против 49 пунктов. При этом, индекс вернулся выше 50 пунктов впервые с конца 2014 года, что является позитивным знаком для нашей экономики.
- Очередной максимальной отметки смогли достичь бумаги «Сбербанка» (+3,4%), которые подошли к уровням конца

февраля 2014 года. Однако коренные причины роста бумаг крупнейшего российского банка пока остаются в тумане.

- Проигнорировали снижение котировок на нефть бумаги нефтегазовых компаний, которые в основном закрылись в плюсе: Лукойл прибавил 4%, Татнефть выросла на 2,25%, «Роснефть» - на 1,59%.
- Вчера также стало известно, что владелец S7 Владислав Филев отказался от приобретения «Трансаэро». Причина отказа оказалась такой же как в случае со срывом сделки с «Аэрофлотом» ранее этой осенью: у «Трансаэро» отсутствуют пакет из 51% необремененных акций.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,77	-1,57%	1,35%	-15,24%
Light	46,23	-0,30%	3,28%	-13,93%
Алюминий	1514,00	2,44%	0,93%	-18,27%
Золото	1135,20	-0,41%	-2,51%	-4,06%
Медь	5119,15	0,45%	-1,40%	-17,83%
Никель	10135,00	0,35%	-3,38%	-33,10%
Пшеница	507,00	-2,95%	1,89%	-14,01%
Серебро	15,42	-0,42%	-2,59%	-1,69%

- Мировые цены на нефть вчера снова немного «откатились» ниже уровня 49 долларов за баррель марки «Brent». Снижение котировок было вызвано слабыми статданными из Китая, которые были опубликованы в понедельник и на выходных. В частности, индекс деловой активности в промышленном секторе экономики (PMI) в октябре составил 49,8 пунктов, оставшись на сентябрьских значениях. Аналитики же ожидали роста до 50 пунктов. Таким образом, замедление экономики Поднебесной, являющейся крупнейшим потребителем топлива в мире, продолжается, что и оказало давление на цены «черного золота».
- Кроме того, Россия вчера объявила о рекордных объемах добычи нефти в октябре – 10,78 млн баррелей в сутки. Эта новость также оказала негативное влияние на котировки. Которые просели до 48,8 долларов за баррель марки «Brent».
- Котировки на Золото вчера слабо снижались из-за опасения игроков, касающихся вероятного повышения ключевой ставки ФРС уже в этом году, так как этому способствуют неплохая макростатистика.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	63,67	-0,46%	2,06%	7,48%
EUR/RUB	70,06	-0,43%	1,98%	-2,71%
Бивалютная корзина	67,10	-0,70%	2,66%	8,75%
EUR/USD	1,1017	-0,11%	-0,19%	-8,96%
GBP/USD	1,5425	-0,04%	0,57%	-1,03%
USD/JPY	120,64	0,27%	-0,39%	0,74%

- Рубль вчера смог удержать свои позиции к доллару и евро, несмотря на снижение мировых цен на нефть. В итоге, курс рубля вырос к доллару на 0,46% и составил 63,67 рублей за доллар. К евро рубль укрепился на 0,43% - до 70,06 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины снизилась на 0,7% и составила 67,1 рубль.
- Курс доллара к евро незначительно вырос на 0,1% и теперь за евро придется отдать 1,101 доллара. При этом, ранее, большую часть торгов понедельника доллар снижался к мировым валютам после выхода слабой статистики из Китая.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	124,25	0,02%	-0,18%	17,93%
США 10-летние, %	2,17	0,03	0,09	0,00
США 30-летние, %	2,94	0,03	0,05	0,19
Россия 10-летние, %	10,06	0,01	0,00	-4,03
Россия 15-летние, %	10,04	-0,03	0,00	-3,40

- «Сбербанк» разместил облигации на 18,5 млрд рублей в пользу своего Негосударственного Пенсионного Фонда (НПФ). Срок обращения бумаг составит 10,2 года. Процентная ставка первого купона составила 12,27% годовых.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно позитивный: фьючерсы на зарубежные индексы преимущественно в «зеленой зоне», демонстрируя положительную динамику. Площадки Азиатско-Тихоокеанского региона утром растут в рамках коррекции после вчерашнего закрытия в «красной зоне». Котировки на нефть марки «Brent» в утренние часы находятся на уровне чуть ниже 49 долларов за баррель, не предпринимая направленного движения вверх или вниз в ожидании данных от Американского института нефти.

Открытие рынка ожидаем в плюсе по РТС и примерно на том же уровне по ММВБ относительно вчерашних уровней закрытия. Индекс ММВБ вчера закрылся длинной белой свечой на уровне 1735,75 пунктов, что явило собой максимум по уровням закрытия за последние полгода. Индекс, при позитивном внешнем фоне, может отправиться тестировать сопротивление в районе 1740-1750 пунктов. Если уровень сопротивления будет взят «быками», то откроется возможность роста к 1800 пунктам и даже выше. Индекс РТС также закрылся вчера белой свечой на 853,77 пунктах, однако здесь наблюдается продолжение бокового движения, которое наметилось 5 торговых сессий назад. Уровень сопротивления остается в районе 855-860 пунктов. Пробой этого уровня откроет доступ к тестированию следующих отметок на 880 пунктах.

Сегодня большого объема статистических данных не ожидается. В фокусе инвесторов будут данные по изменению недельных запасов нефти от Американского Института нефти. Полученные данные могут задать направление движению котировок на «черное золото» на ближайшие дни.

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.

