

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2099,93	-0,11%	0,46%	1,99%
Dow Jones	17863,43	-0,02%	0,47%	0,23%
NASDAQ	5127,74	-0,29%	0,63%	8,27%
S&P фьючерс	2092,00	-0,10%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6364,90	-0,75%	-1,13%	-3,06%
DAX	10887,74	0,39%	0,51%	11,04%
CAC 40	4980,04	0,64%	1,83%	16,81%

Остальной мир

Bovespa	48046,76	0,71%	2,79%	-3,92%
Nikkei 225	19196,03	0,42%	1,87%	9,94%
Shangh Composite	3541,02	0,52%	4,78%	9,47%
Hang Seng	22861,20	-0,82%	-0,03%	-3,15%

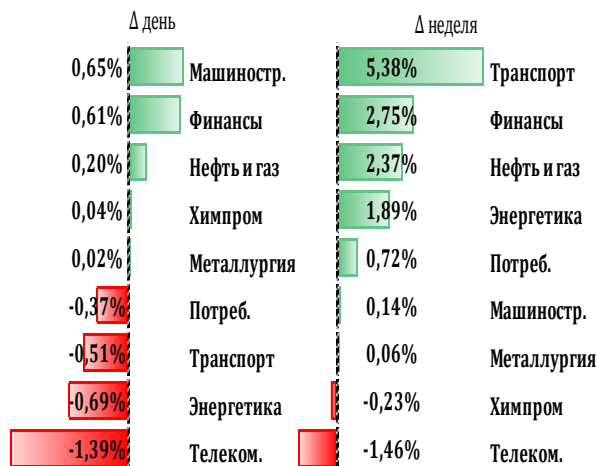
Россия

ММВБ	1766,28	0,15%	2,30%	26,47%
РТС	877,26	-1,03%	2,63%	10,95%
ММВБ-10	4084,48	-0,04%	2,81%	34,36%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ЧеркизГ-ао	900,00	3,00%	МТС-ао	202,00	-3,44%
ВТБ ао	0,08	2,96%	Yandex clA	980,00	-3,10%
Ростел -ап	63,50	2,50%	КАМАЗ	35,80	-2,85%
ФосАгро ао	2633,00	2,00%	Россети ао	0,46	-2,66%
СевСт-ао	750,00	1,50%	НЛМК ао	75,68	-2,66%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Фондовые рынки за океаном по итогам торгов четверга закрылись в «красной зоне», однако без ярко выраженной отрицательной динамики. Сдерживающими факторами здесь оказались намеки Джанет Йеллен и Уильяма Дадли на то, что регулятор, вероятно, может поднять ключевую ставку уже в декабре текущего года, а также внутренние статистические данные, опубликованные накануне.
- Число первичных обращений за пособиями по безработице в США за прошедшую неделю составило 276 тысяч, что на 16 тысяч больше, чем неделей ранее. Эксперты ожидали роста заявок, однако до 262 тысяч. Таким образом, показатель не добавил позитивных настроений на рынки. Также не оправдала ожиданий аналитиков предварительная оценка затрат на рабочую силу по итогам 3 квартала. Показатель вырос на 1,4%, тогда как аналитики ожидали 2,3% роста. Данный показатель отражает изменение общей стоимости найма рабочей силы и дает представление о тенденциях в инфляции и издержках производства за отчетный период.
- Рынки Старого Света закрылись разнонаправленно, преимущественно небольшим ростом. Опустился только Британский индекс FTSE 100 (-0,75%). Банк Англии, в частности, понизил прогноз роста экономики Великобритании на 2015 и 2016 годы на 0,1-0,2 процентного пункта на фоне замедления темпов роста развивающихся рынков. Регулятор также принял решение сохранить базовую процентную ставку на текущем уровне в 0,5%.
- Разочаровал аналитиков объем розничных продаж в Еврозоне за сентябрь. Показатель продемонстрировал снижение на 0,1% в месячном выражении, тогда как прогнозировался рост на 0,2%, что может сигнализировать о том, что темпы развития экономики Еврозоны на данный момент не оправдывают ожиданий экспертов. Кроме того, объемы производственных заказов в Германии по итогам сентября упали на 1,7% в месячном выражении, демонстрируя снижение третий месяц подряд. Аналитики, наоборот, ожидали, что объемы вырастут в сентябре на 1%.
- Однако оптимизма на Европейские рынки добавила отчетность банка Societe Generale, чистая прибыль которого по итогам трех кварталов выросла в полтора раза в годовом выражении, а по итогам только 3 квартала прибыль выросла более чем на 30%. Наконец, текущие негативные статистические показатели не столь сильно повлияли на местные индексы, так как ранее глава ЕЦБ Марио Драги сообщил, что в случае необходимости, регулятор примет меры по стимулированию экономики в ближайшее время.
- Российский фондовый рынок также не смог продемонстрировать единой динамики и закрылся разнонаправленно, отыгрывая несколько подешевевшую в среду нефть и ослабление, по этой причине, национальной валюты. Индекс ММВБ по итогам торгов вырос на 0,15% - до 1766,28 пунктов, а РТС, наоборот, упал почти на 1% - до 877,26 пунктов. При этом объем торгов бумагами из базы расчета индекса ММВБ, по сравнению с предыдущей торговой сессией, выросли до 39,011 млрд рублей.
- Вчера также были опубликованы некоторые статистические данные по нашей стране. В частности, индекс деловой активности в секторе услуг по итогам октября составил 47,8 пунктов, тогда как аналитики ожидали 50 пунктов. Месцем ранее показатель составил 51,3 пункт. Уровень инфляции в стране по итогам прошедшего месяца совпал с прогнозами и

составил 0,7% в месячном выражении и 15,6% в годовом выражении. Наконец, международные резервы ЦБ по итогам прошедшей недели снизились с 374Ю,6 млрд долларов до 369,2 млрд долларов, тогда как прогнозировался рост резервов до 375 млрд долларов.

- Акции банка «Уралсиб» вчера подскочили почти в полтора раза на новостях о том, что Банк России и Агентство по страхованию вкладов (АСВ) приняли ряд мер по восстановлению финансового положения банка. Кроме того, 82% акций перейдет под контроль бизнесмена Владимира Когана. «Уралсибу» будет предоставлен 81 млрд рублей в рамках санации.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,20	-1,09%	-1,39%	-16,23%
Light	45,41	-2,15%	-0,81%	-15,45%
Алюминий	1504,00	0,23%	2,31%	-18,81%
Золото	1106,80	-0,24%	-4,60%	-6,46%
Медь	4989,08	-2,50%	-3,80%	-19,92%
Никель	9780,00	-1,11%	-6,77%	-35,45%
Пшеница	523,40	-0,30%	3,23%	-11,23%
Серебро	15,00	-0,43%	-5,60%	-4,37%

- Мировые цены на нефть вчера демонстрировали снижение на фоне данных Минэнерго США, которые продемонстрировали рост запасов «черного золота», что ведет к переизбытку сырья на рынке. Отметим, что рост запасов нефти в США наблюдается уже шестую неделю подряд. Котировки на нефть марки «Brent» колебались в районе 48-48,5 долларов за баррель.
- В четверг цены на золото серьезно не менялись, находясь на минимумах семи недель. Инвесторы ждут данных по рынку труда, которые будут опубликованы сегодня в США. А пока что, укрепляющийся после заявлений Джанет Йеллен доллар, оказывает давление на котировки драгоценного металла.
- Также под давлением оказалась медь. Кроме вероятного повышения ставки ФРС США, на металл оказало давление падение объема промышленных заказов в Германии.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	63,45	1,31%	-0,78%	7,12%
EUR/RUB	68,96	0,42%	-1,24%	-4,24%
Бивалютная корзина	66,11	-1,46%	-3,81%	7,16%
EUR/USD	1,0885	0,12%	-0,36%	-10,05%
GBP/USD	1,5214	-1,10%	-0,30%	-2,39%
USD/JPY	121,67	0,17%	0,81%	1,60%

- Рубль вчера немного сдал позиции перед долларом и евро, потеряв поддержку от «черного золота». В итоге курс рубля к доллару упал на 1,31% и составил 63,45 рублей за доллар, а к евро рубль ослаб на 0,42% - до 68,96 рублей за евро.
- Курс доллара вчера рос к большинству мировых валют на заявлениях главы ФРС США о возможном скором повышении ключевой ставки. Индекс доллара рос до 98,99 пунктов, прибавляя 0,09%. Курс евро к доллару при этом немного рос (+0,12%) - до 1,088 доллара за евро.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,93	0,76%	1,20%	19,52%
США 10-летние, %	2,23	0,00	0,15	0,06
США 30-летние, %	3,00	0,00	0,14	0,25
Россия 10-летние, %	9,68	-0,09	-0,34	-4,41
Россия 15-летние, %	9,61	-0,14	-0,38	-3,83

- На долговом рынке в целом серьезных событий в четверг не наблюдалось.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются разнонаправленно, без серьезной динамики. Биржи АТР утром преимущественно растут, ожидая статистики по рынку труда из США, а котировки на «черное золото» также перешли к росту.

Открытие рынка сегодня ожидаем чуть выше уровней закрытия четверга. Индекс ММВБ вчера «нарисовал» белую свечу, похожую на «крест». Индекс пробовал подняться и закрепиться выше 1780 пунктов, однако неудачно. Сильных сигналов к развороту пока нет, поэтому пока что исключать дальнейший рост рынка нельзя. В случае движения вниз, уровень поддержки будет находиться в районе 1735-1745 пунктов. Индекс РТС вчера закрылся небольшой черной свечой, по-прежнему оставаясь ниже уровней сопротивления в районе 880-890 пунктов. Сигналов к направленному движению в любую из сторон пока нет, однако в среднесрочной перспективе может наблюдаться повышательный тренд. Если индекс сможет пробить сопротивление, то возможен выход к новым «высотам» в районе 920-940 пунктов.

Сегодня инвесторы уделят внимание данным по рынку труда США, так как полученная статистика будет важна для ФРС, касательно будущего решения по изменению ключевой ставки. Не останутся без внимания и данные по промышленному производству в сентябре из Великобритании. Наконец, американская компания Baker Hughes сообщит об изменении числа буровых установок в стране, что может повлиять на динамику цен на нефть.

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.

