

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1921,22	-1,53%	-3,40%	-6,69%
Dow Jones	16102,38	-1,66%	-3,25%	-9,65%
NASDAQ	4683,92	-1,05%	-2,99%	-1,10%
S&P фьючерс	1936,10	0,75%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6042,92	-2,44%	-3,28%	-7,97%
DAX	10038,04	-2,71%	-2,53%	2,37%
CAC 40	4523,08	-2,81%	-3,25%	6,09%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46497,72	-1,83%	-1,39%	-7,02%
Nikkei 225	17867,56	0,42%	-4,71%	2,33%
Shangh Composite	3187,82	0,88%	1,26%	-1,45%
Hang Seng	20885,74	0,22%	-2,60%	-11,52%

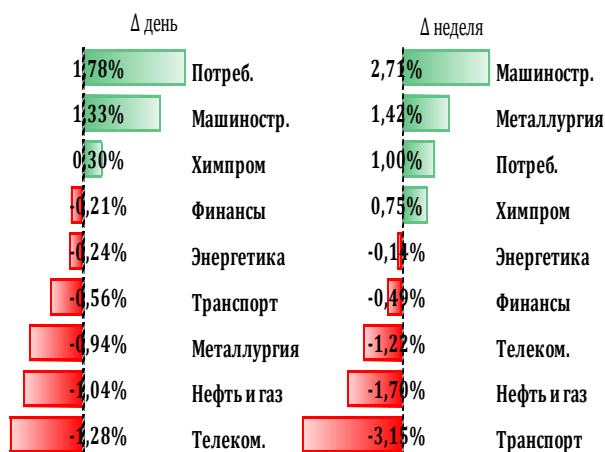
Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
MMVB	1698,16	-0,73%	-1,22%	21,59%
PTC	793,65	-1,44%	-4,37%	0,37%
MMVB-10	3811,06	-0,68%	-1,64%	25,37%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Фармстанд	1175,00	12,00%	Распадская	40,97	-3,42%
Мечел ао	71,67	3,29%	Polymetal	479,00	-3,00%
СОЛЛЕРС	425,00	3,00%	Аэрофлот	34,85	-2,38%
НМТП ао	3,08	2,16%	МОЭСК	0,86	-2,27%
РусГидро	0,55	1,72%	Трансф ап	150400,00	-2,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- В минувшую пятницу фондовый рынок США отметил закрытие торгов движением в отрицательном направлении. Этому способствовал выход данных по количеству занятых в несельскохозяйственном секторе США, которые оказались ниже прогнозируемого значения - 173 тысяч против ожидаемых 220 тысяч, согласно национальному докладу о занятости. Тем не менее, уровень безработицы в целом по стране снизился на 0,1% (с 5,2% до 5,1%). Также стоит отметить, что количество спекулятивных чистых «шортовых» позиций по индексу S&P 500 выросло с 75,7 до 180,5, что составило максимальное количество с начала этого года.
- Негативные данные по рынку труда оказывают давление на американский рынок на фоне неопределенности с заседанием ФРС США: несмотря на слабую макро статистику, инвесторы не уверены, что регулятор отложит первое за несколько лет повышение процентной ставки. Масла в огонь добавил глава ФРБ Ричмонда Джеффри Лэкер, отметивший, что ФРС стоит «завершить эпоху рекордно низких процентных ставок в США».
- Азиатский рынок отметил сегодняшнее открытие небольшим падением, так Японский индекс Топик продолжает снижаться (в этот раз на 0,7%, также как Южнокорейский и Австралийский индексы Kospi и S&P/ASX 200 (оба на 0,2%).
- Европейский рынок в пятницу также показал отрицательные результаты. Объем производственных заказов в Германии снизился -1,4% вместо ожидаемых -0,6%, что оказало негативное влияние на состояние европейского рынка. Также свой вклад в падение рынка в пятницу внес Португальский рынок, где индекс PSI в ходе пятничных торгов упал на 2,1%. Снижение Португальского рынка вызвано негативной динамикой со стороны секторов финансов, потребительских товаров и коммунальных услуг.
- Российский рынок в пятницу снизился по основным индексам на фоне ослабления рубля и падения цены на нефть по марке Brent ниже 50 долларов за баррель. Индекс ММВБ снизился на 0,73% - до 1698,16 пунктов, а индекс РТС упал на 1,44% до 793 пунктов.
- Бумаги «Мечела» росли против рынка на ожиданиях подписания между компанией и ВТБ в пятницу соглашения о реструктуризации долга. Обыкновенные акции «Мечела» поднялись на 3,29%, а привилегированные на 2,63%. Также росли акции «Русгидро» на фоне подписания соглашения с ВТБ о сделке на 85 млрд рублей, которое предусматривает, в частности рефинансирование кредитного портфеля «РАО ЭС Востока», повышение инвестиционной привлекательности «Русгидро» и поиск стратегических инвесторов для компании.
- Акции «Трансаэро» и «Аэрофлота» к концу торгов упали на 1,32% и 2,38% соответственно, несмотря на то, что в течение торгов акции «Трансаэро» поднимались на 23,8% на фоне новостей о санации перевозчика. Акции «Распадской» упали на 3,42%, после роста в четверг а 6,61%, в ожидании публикации отчетности по МСФО за первое полугодие, где выяснилось, что чистый убыток компании за первое полугодие 2015 года сократился в 8 раз. В целом отчет показывает позитивное направление в развитии компании. В целом лидерами Российского рынка стали акции «Фармстандарта» (+11,9%), Соллерса (+2,66%), НМТП (2,16%). Лидеры снижения «Polymetal» (-3,04%), МТС (-2,12), Роснефть (-1,89%), Мототрест (-1,84%)

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	49,41	-2,18%	0,90%	-14,13%
Light	45,89	-1,44%	3,50%	-14,56%
Алюминий	1614,50	-0,65%	0,59%	-12,85%
Золото	1122,10	-0,17%	-1,04%	-5,16%
Медь	5127,97	-1,38%	-0,02%	-17,69%
Никель	9915,00	0,41%	-1,44%	-34,55%
Пшеница	468,00	0,78%	-3,31%	-20,62%
Серебро	14,61	-1,08%	0,79%	-6,85%

Товарный рынок

- Цена на нефть марки Brent на момент закрытия торгов в пятницу упала на 2,18 процентов до 49,41 доллара за баррель на фоне публикации от Baker Hughes данных о количестве буровых установок в США: их число снизилось за неделю на 13 штук, что, однако было проигнорировано рынком. Колебания курса доллара на фоне выхода статистики по рынку труда в США также оказали слабое влияние на цены «черного золота». Цены на другие товарные фьючерсы, такие как золото, серебро, медь и алюминий также снизились в ходе пятничных торгов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	68,42	1,82%	4,61%	15,51%
EUR/RUB	76,30	2,02%	4,19%	5,96%
Бивалютная корзина	71,54	0,01%	1,10%	15,96%
EUR/USD	1,1142	0,12%	-0,92%	-7,92%
GBP/USD	1,5190	-0,27%	-1,56%	-2,54%
USD/JPY	119,42	0,15%	-1,31%	-0,28%

Валютный рынок

- Доллар в пятницу немного укрепился по отношению к другим валютам на фоне публикации данных, касающихся безработицы в США. Индекс USD, показывающий отношение доллара против корзины шести основных валют вырос на 0,13% до 96,44.
- Отношение доллара к рублю также выросло на 1,82% до 68,42, чему поспособствовало снижение цен на нефть, а также увеличение чистых «шортовых» спекулятивных позиций по рублю у Американских инвесторов до 3,4 тысяч, что оказалось максимальным значением с конца прошлого года.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	116,82	0,32%	0,33%	10,88%
США 10-летние, %	2,13	0,00	-0,03	-0,04
США 30-летние, %	2,89	-0,02	0,01	0,14
Россия 10-летние, %	11,75	0,05	0,03	-2,34
Россия 15-летние, %	11,54	0,00	0,06	-1,90

Долговой рынок

- Котировки российских облигаций на прошлой неделе консолидировались после значительного роста на предыдущей неделе. Динамика отечественных облигаций продолжает сильно зависеть от динамики курса рубля и дальнейшее ослабление нацвалюты может оказать давление на котировки ОФЗ.

Взгляд на рынок

Российский рынок сегодня открылся на положительной территории при в целом позитивном внешнем фоне: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются на положительной территории, что оказывает поддержку российскому рынку.

Индекс ММВБ в пятницу закрылся черной свечой, опустившись ниже 1700 пунктов, что является негативным сигналом. Тем не менее, падение оказалось не столь ярко выраженным – индикатор удержал уровень поддержки в районе 1690 пунктов, а сегодня мы увидели отскок от этого уровня и попытки пробиться к верхней границе диапазона 1690-1715 пунктов. По-прежнему необходимо дожидаться уверенного выхода за границы боковика, чтобы дождаться сильного движения в ту или иную сторону. На фоне ослабления рубля индекс РТС сегодня выглядит слабее, чем индекс ММВБ.

Важной макро статистики сегодня будет немного, при этом биржи США сегодня закрыты из-за праздника. В совокупности эти два фактора могут оказать давление на активность торгов во всем мире.

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, сублицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.