

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2013,43	0,88%	4,66%	-2,21%
Dow Jones	17050,75	0,82%	4,79%	-4,33%
NASDAQ	4810,79	0,41%	3,97%	1,58%
S&P фьючерс	2003,50	-0,15%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6374,82	0,61%	4,98%	-2,91%
DAX	9993,07	0,23%	5,09%	1,91%
CAC 40	4675,91	0,18%	5,63%	9,67%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	49106,56	0,39%	8,37%	-1,80%
Nikkei 225	18399,08	1,42%	3,75%	5,38%
Shangh Composite	3165,26	0,70%	3,68%	-2,15%
Hang Seng	22738,36	1,72%	6,21%	-3,67%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1689,32	0,59%	3,83%	20,96%
РТС	856,44	1,46%	9,57%	8,31%
ММВБ-10	3868,69	0,95%	4,62%	27,26%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Сбербанк	83,11	4,34%	ВСМПО-АВСМ	12060,00	-7,00%
Сбербанк-п	64,24	3,95%	ЧеркизГ-ао	875,00	-4,00%
ВТБ ао	0,07	3,64%	Ростел-ао	87,62	-2,54%
НЛМК ао	72,75	3,46%	Фармстанд	1050,00	-2,00%
Русал рдр	268,50	3,10%	Татнефть Зао	323,20	-1,73%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,78%	Финансы	6,30%	Финансы
1,72%	Транспорт	4,20%	Транспорт
0,66%	Энергетика	4,11%	Нефть и газ
0,43%	Телеком.	1,63%	Энергетика
0,06%	Химпром	0,43%	Телеком.
-0,01%	Нефть и газ	-0,30%	Машиностр.
-0,27%	Машиностр.	-0,59%	Химпром
-0,31%	Металлургия	-0,69%	Потреб.
-0,49%	Потреб.	-1,12%	Металлургия

Фондовый рынок

- Фондовые рынки США в четверг закрылись ростом после публикации протоколов предыдущего заседания ФРС США. Согласно информации из протоколов, для того чтобы Регулятор повысил ставку необходимо достичь уровня инфляции в стране равного 2%. Еще одной причиной сохранения ключевой ставки стал фактор неопределенности касательно мировых экономик, в частности ФРС принял по внимание не самое позитивное состояние экономики Китая.
- Кроме того, стали известны данные по количеству первичных заявок на пособие по безработице за прошедшую неделю. Согласно данным, количество заявок снизилось по сравнению с предыдущим значением на 13 тысяч: с 276 тысяч (показатель был пересмотрен в сторону понижения с 277 тысяч) до 263 тысяч. Аналитики же ожидали падение показателя до 274 тысяч, так что фактическое значение оказалось лучше ожидаемого.
- Позитивная внутренняя статистика отправила фондовые индексы в «красную зону», так как инвесторы снова забеспокоились о том, что Регулятор может задуматься о повышении ставки уже в этом году. Однако финальное слово все-таки осталось за протоколом заседания ФРС, о котором было написано выше.
- Рынки Европы вчера продолжали показывать позитивный тренд в ожидании информации от ФРС и ЕЦБ. В целом динамика по итогам вчерашнего дня оказалась довольно слабой, так как инвесторы ожидали протокола заседания Регулятора США, который был опубликован уже после закрытия торгов в Европе и который помог бы прояснить будущие шаги ФРС США по дальнейшей кредитно-денежной политике. Кроме того, участники рынка ждали сообщений от Европейского Центрального Банка о расширении программы количественного смягчения.
- Кроме того, стала известной некоторая внутренняя статистика. Так, профицит торгового баланса Германии в августе снизился с пересмотренных в сторону повышения июльских 22,4 млрд евро до 19,6 млрд евро, хотя эксперты ожидали роста профицита до 22,5 млрд евро. Банк Англии принял решение о сохранении параметров монетарной политики и сохранил базовую процентную ставку на рекордно низком уровне 0,5%, а также подтвердил объем выкупа активов с рынка объемом 375 млрд фунтов стерлингов.
- Таким образом данные по торговому балансу Германии внесли порцию негатива в ход вчерашних торгов, однако решение Банка Англии поддержало европейские индексы.
- Российский фондовый рынок вчера снова закрылся в «зеленой зоне», однако при повышенной волатильности. Индексы в ходе торгов двигались в негативном направлении в рамках коррекции, однако во второй половине дня вернулись к росту и смогли превысить значения открытия. Основным драйвером индексов стали котировки на нефть марки «Brent», которые вчера смогли сохраниться выше уровня в 50 долларов за баррель, тестируя уровень сопротивления в 53 доллара за баррель. Кроме того, поддержку рынкам оказало укрепление национальной валюты и увеличение объемов международных резервов ЦБ РФ.
- Арбитражный суд Москвы зарегистрировал еще один иск Сбербанка к угольной компании «Южный Кузбасс», которая входит в «Мечел», о взыскании 1,7 млрд рублей. Иск поступил 6 октября, однако к производству еще не принят. Однако акции «Мечела» пока проигнорировали эту новость.

- Рост рубля оказал поддержку компаниям банковского сектора. Так, акции «Сбербанка» вчера выросли (на 4,34% обыкновенные и на 3,95% префы). Акции «ВТБ» подросли на 3,64%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	53,49	3,94%	11,39%	-7,04%
Light	49,93	4,11%	10,46%	-7,04%
Алюминий	1578,50	0,54%	0,64%	-14,79%
Золото	1144,40	0,10%	3,02%	-3,28%
Медь	5256,94	1,53%	3,52%	-15,62%
Никель	10335,00	2,12%	2,63%	-31,78%
Пшеница	515,20	-0,73%	-0,81%	-12,62%
Серебро	15,74	0,45%	8,59%	0,32%

Товарный рынок

- Котировки «черного золота» вчера торговались в плюсе на текущей геополитической ситуации, слабом долларе и в целом сокращении добычи нефти в США. Так, нефть марки «Brent» тестировала уровень в 53 доллара за баррель и в итоге даже немного пробила его (53,49 доллара за баррель). Теперь рынку нужны новые движущие факторы, в числе которых могут быть данные по количеству буровых установок в США.
- Золото вчера дешевело в ожиданиях публикации протоколов ФРС США. Кроме того, позитивная внутренняя статистка в Америке также оказала давление на драгоценный металл.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	61,37	-2,07%	-6,52%	3,61%
EUR/RUB	69,22	-1,76%	-5,73%	-3,88%
Бивалютная корзина	66,30	-0,44%	-3,58%	7,46%
EUR/USD	1,1280	0,21%	0,92%	-6,78%
GBP/USD	1,5367	0,42%	1,49%	-1,41%
USD/JPY	119,97	0,08%	-0,02%	0,17%

Валютный рынок

- Рубль в четверг от наметившейся тенденции обновления максимумов не отошел и продолжил свое укрепление к евро и доллару. Национальная валюта закрепилась ниже 70 рублей за евро. Так, курс рубля к евро упал на 1,76% - до 69,22 рублей за евро. Курс рубля к доллару также снизился на 2,07% - до 61,37 рублей за доллар. Стоимость бивалютной корзины снизилась на 0,44% и составила 66,3 рублей.
- Доллар усилил снижение к мировым валютам после публикации протокола заседания ФРС США. Индекс доллара упал на 0,54% - до 95,06 пунктов.
- Курс доллара к евро вырос на 0,21% - до 1,128 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	121,65	-0,33%	1,95%	15,46%
США 10-летние, %	2,09	0,04	0,04	-0,08
США 30-летние, %	2,92	0,04	0,07	0,18
Россия 10-летние, %	10,50	-0,02	-0,64	-3,59
Россия 15-летние, %	10,39	-0,10	-0,55	-3,05

Долговой рынок

- Газпром размещает трехлетние еврооблигации объемом 1 млрд евро. Финальный ориентир доходности составил 4,625% годовых. Выручка от размещения будет направлена на погашение кредита компании.
- На рынке государственных облигаций серьезных изменений не происходило.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно позитивный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются в умеренном плюсе. Площадки Азиатско-Тихоокеанского региона также с утра растут на публикации протокола заседания ФРС США, который снизил ожидания повышения ставки в 2015 году. Кроме того, нефть с утра продолжает торговаться в «зеленой зоне», WTI и вовсе впервые с июля превысила отметку 50 долларов за баррель, а Brent приближается к 54 долларам за баррель.

Открытие рынка сегодня ожидаем выше вчерашнего закрытия на внешнем позитиве и растущих ценах на нефть. Индексы ММВБ и РТС оба закрылись четвертой подряд белой свечой на уровнях 1689,32 пунктов и 856 пунктов соответственно. РТС пробил уровень сопротивления в 845 пунктов и теперь может направиться дальше вверх в район 865 пунктов. ММВБ может отправиться тестировать уровень 1700 пунктов, а если пройдет и его, то и дальше вверх. Технических сигналов на разворот рынка вниз по-прежнему нет.

Сегодняшний день будет не слишком богат на важную информацию. Важной можно выделить публикацию данных от компании Baker Hughes об изменении числа буровых установок в США. Эта информация может оказать серьезное влияние на направление котировок на «черное золото» в ближайшем отрезке времени. Кроме того, интересными могут оказаться данные по сальдо торгового баланса Великобритании за август, а также индексу цен на экспорт и импорт в США в сентябре.

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