

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2081,72	0,15%	-1,06%	1,11%
Dow Jones	17758,21	0,16%	-0,40%	-0,36%
NASDAQ	5083,24	-0,24%	-0,86%	7,33%
S&P фьючерс	2080,00	0,09%		

## Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6275,28	-0,32%	-1,36%	-4,43%
DAX	10832,52	0,16%	-1,08%	10,47%
CAC 40	4912,16	0,02%	-0,08%	15,21%

## Остальной мир

Bovespa	46206,57	0,03%	0,74%	-7,60%
Nikkei 225	19685,25	0,07%	5,39%	12,74%
Shangh Composite	3625,12	-0,42%	9,00%	12,07%
Hang Seng	22397,04	-0,02%	-1,23%	-5,12%

## Россия

ММВБ	1746,94	-0,26%	0,64%	25,08%
РТС	854,08	-0,14%	0,04%	8,01%
ММВБ-10	4025,21	-0,42%	-0,11%	32,41%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ФСКЕЭС ао	0,06	2,11%	НЛМКао	75,58	-3,70%
БСП ао	38,10	1,74%	МТС-ао	194,70	-2,89%
Новатэк ао	616,00	1,60%	Система ао	17,04	-2,68%
Polymetal	564,00	1,60%	Татнефть Зап	191,80	-2,40%
Сбербанк	94,35	1,51%	ММК	22,47	-2,30%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ



## Фондовый рынок

- Американские рынки во вторник не нашли единой динамики и закрылись разнонаправленно, преимущественно ростом, снизился лишь индекс высокотехнологичных компаний NASDAQ (-0,24%). В целом рынки США сейчас колеблются без единой динамики в условиях неопределенности, касающейся повышения ключевой ставки ФРС США, которое может произойти уже в декабре.
- Напомним, что в минувшую пятницу была опубликована довольно-таки сильная статистика по рынку труда, что увеличило вероятность повышения ставки в декабре. Однако, затем были опубликованы данные из Китая, которые оказались хуже консенсус-прогнозов, что, в свою очередь, усилило неопределенность среди инвесторов, так как ФРС может принять к сведению опасения за перспективы развития второй крупнейшей экономики мира и снова отложить решение о повышении ставки.
- Так, на выходных стало известно, что «не дотянули» до прогнозов данные по экспорту и импорту Поднебесной, а вчера были опубликован индекс потребительских цен за октябрь, который показал, что в Китае в отчетном месяце наблюдалась месячная дефляция на уровне 0,3%, при прогнозируемой месячной дефляции на уровне 0,2%. Годовая инфляция же составила 1,3% против ожидаемых 1,5%. Данные говорят о том, что вторая крупнейшая экономика мира продолжает испытывать проблемы.
- Рынки Европы также, как и американские рынки, во вторник закрылись преимущественно ростом, без единой динамики. Британский индекс FTSE 100 продолжает нисходящее движение уже четвертую торговую сессию к ряду, в этот раз опустившись на 0,32%. На индекс повлияли данные по объему розничных продаж от BRC, которые сообщили нам о снижении продаж в октябре на 0,2% в месячном выражении. Консенсус-прогноз по показателю предполагал рост на 0,7% в месячном выражении.
- В целом, на индексы продолжает давить высокая вероятность увеличения ключевой ставки ФРС США. Кроме того, негатива на рынки внесли, данные из Китая, о которых было уже сказано выше. Игроки сейчас не рискуют принимать серьезных долгосрочных решений и пытаются угадать, какие решения в декабре примут Американский и Европейский регуляторы.
- Российский фондовый рынок во вторник снова двигался в «боксовике» и закрылся в «красной» зоне, продемонстрировав незначительное снижение по обоим индексам на фоне волатильности нефтяных котировок и негативного внешнего фона. Индекс ММВБ снизился на 0,26% - до 1746,94 пунктов, а индекс РТС закрылся на 854,08 пунктах (-0,14%). Объемы торгов бумагами из расчета индекса ММВБ остались на низких уровнях 24,785 млрд рублей.
- Привилегированные акции банка «Возрождение» выросли почти на 40%, а обыкновенные - на 18,4% на сообщениях о назначении председателем правления Константина Басманова, который с 2008 по 2015 год курировал малый и средний бизнес в должности заместителя председателя правления «Промсвязьбанка».
- Акции «Аптечной сети 36,6» второй день подряд росли (вчера прибавили почти 10%) после сообщения об отказе Банка России в регистрации дополнительного выпуска акций.
- Акции «Трансаэро» снизились на 13,26% на сообщениях о том, что арбитражный суд Москвы назначил на 3 декабря основные слушания по иску дочернего предприятия «Роснефти» - ООО

«РН-Аэро», которое занимается поставками авиатоплива, к проблемному перевозчику взыскании более 3 млрд рублей.

## Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	47,25	-0,32%	-3,12%	-17,88%
Light	43,78	-0,86%	-5,30%	-18,49%
Алюминий	1492,00	-0,07%	-1,45%	-19,46%
Золото	1091,50	-0,07%	-3,85%	-7,75%
Медь	4898,69	-0,16%	-4,31%	-21,37%
Никель	9565,00	1,06%	-5,62%	-36,86%
Пшеница	494,00	-1,87%	-2,56%	-16,21%
Серебро	14,45	-0,38%	-6,32%	-7,91%

- В нефтяных котировках вчера наблюдалась волатильность в диапазоне от 47,7 долларов до 48,5 долларов за баррель марки «Brent». Большую часть дня котировки демонстрировали рост на фоне доклада от Международного Энергетического Агентства, в котором прогнозируется рост «черного золота» до 80 долларов за баррель к 2020 году, несмотря на снижение инвестиций на 20%.
- Вечером Минэнерго США понизило прогнозы по стоимости «Brent» на текущий год до 53,96 долларов за баррель. Министерство почти не изменило прогнозы по добыче «черного золота» в США в 2015-16 годах. (9,29 млн баррелей в сутки в этом году и 8,77 млн баррелей в сутки в 2016 году).
- Кроме того, согласно Американскому институту нефти запасы за прошлую неделю выросли на 6,3 млн баррелей (ожидался рост на 0,5 млн), при этом рост продолжается уже седьмую неделю подряд.
- Золото торгуется близко к трехмесячному минимуму под давлением вероятного повышения ставки ФРС США в декабре этого года.

## Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	64,56	-0,05%	1,41%	8,99%
EUR/RUB	69,20	-0,39%	-1,23%	-3,90%
Бивалютная корзина	66,82	-0,48%	-0,42%	8,30%
EUR/USD	1,0762	0,11%	-2,31%	-11,07%
GBP/USD	1,5170	0,38%	-1,65%	-2,67%
USD/JPY	122,87	-0,20%	1,85%	2,60%

- Несмотря на высокую волатильность в нефтяных котировках, рубль довольно крепко держится против доллара и евро. Поддержку «деревянному» оказывает спрос на рубли в преддверии ноябрьского налогового периода. Остатки на корсчетах банков в ЦБ снизились до минимума текущего месяца – 1,3 трлн рублей, а ставка MosPrime overnight превышает ключевую ставку ЦБ более чем на 0,5 процентного пункта. В итоге курс рубля к доллару вырос на 0,05% - до 64,56 рублей за доллар, а курс рубля к евро укрепился на 0,39% - до 69,2 рублей за евро.
- Доллар во вторник немного снижался к мировым валютам на слабых данных из Китая. Индекс доллара упал на 0,36% - до 98,86 пунктов. Евро также смог отыграть у доллара 0,11%. Теперь за 1 евро придется отдать 1,0762 доллара.

## Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,59	0,19%	1,08%	19,20%
США 10-летние, %	2,34	0,00	0,17	0,17
США 30-летние, %	3,11	0,00	0,17	0,36
Россия 10-летние, %	9,71	-0,09	-0,35	-4,38
Россия 15-летние, %	9,59	-0,05	-0,45	-3,85

- В среду Минфин проведет аукцион по продаже 8-летних ОФЗ-ИН (индексированный номинал) на сумму 30,5 млрд рублей. Дата погашения бумаг: 16 августа 2023 года.

## Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня вновь нейтральный: серьезной динамики во фьючерсах на зарубежные индексы в утренние часы не наблюдается. Площадки АТР в основном торгуются в «плюсе» в ожидании статистики из Китая. Котируются на «черное золото» консолидируются в районе 47,9 долларов за баррель марки «Brent»

Открытие рынка сегодня ждем чуть ниже уровня закрытия вторника. Динамика рынка будет зависеть от внешнего фона, в первую очередь от данных из Китая. Вчера же индекс ММВБ закрылся третьей подряд «черной» свечой, которая напоминает «крест», сигнализирующий о неопределенности на рынке. При этом индекс «застрял» в районе уровней поддержки 1745-1750 пунктов. Текущее нисходящее движение индекса скорее выглядит как коррекция, нежели зарождение негативного тренда. В случае уверенного пробития поддержки в районе 1740 пунктов можно будет говорить о развороте «вниз». Ждем дальнейших сигналов. Индекс РТС продолжает «боковик», на сей раз закрывшись на 854,08 пункта. Индекс продолжает «отскакивать» от уровня поддержки в районе 850 пунктов. Говорить о начале направленного движения по индексу пока рано, также ждем новых сигналов.

Сегодня инвесторы обратят внимание на новые данные из Китая, на сей раз станут известны объемы промышленного производства и инвестиций в основной капитал за октябрь. Кроме того, интересны могут быть данные по рынку труда Великобритании за октябрь.

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.