

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2017,46	0,13%	1,53%	-2,01%
Dow Jones	17131,86	0,28%	2,12%	-3,88%
NASDAQ	4838,64	0,17%	1,20%	2,17%
S&P фьючерс	2007,00	-0,19%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6371,18	-0,70%	1,15%	-2,97%
DAX	10119,83	0,23%	3,11%	3,21%
CAC 40	4688,70	-0,27%	1,56%	9,97%

Остальной мир

Bovespa	49338,41	0,47%	3,66%	-1,34%
Nikkei 225	18267,21	-0,93%	0,41%	4,62%
Shangh Composite	3277,66	-0,30%	7,37%	1,33%
Hang Seng	22619,83	-0,49%	3,37%	-4,17%

Россия

ММВБ	1710,60	-1,03%	3,52%	22,48%
РТС	876,42	-1,08%	8,86%	10,84%
ММВБ-10	3920,78	-1,28%	4,00%	28,97%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Распадская	40,15	7,18%	РусГидро	0,59	-4,65%
ПолюсЗолот	2770,00	3,60%	ММК	19,67	-4,56%
ТМК ао	50,50	3,30%	Трансф ап	140700,00	-4,00%
МосБиржа	88,20	3,28%	Э.ОНРоссия	2,89	-3,45%
ВТБ ао	0,08	2,76%	Русал рдр	270,00	-3,20%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,64%	Финансы	11,01%	Финансы
0,96%	Транспорт	6,37%	Транспорт
-0,15%	Телеком.	2,27%	Нефть и газ
-0,44%	Химпром	0,29%	Телеком.
-0,84%	Потреб.	0,03%	Энергетика
-1,11%	Машиностр.	-0,95%	Машиностр.
-1,24%	Металлургия	-1,24%	Потреб.
-1,90%	Нефть и газ	-2,20%	Металлургия
-2,04%	Энергетика	-2,85%	Химпром

Фондовый рынок

- Фондовые рынки за океаном в начале текущей недели продолжили умеренный рост в ожидании публикации финансовых отчетностей местными компаниями. Так, индекс S&P 500 подрос на 0,13% - до 2017,46 пунктов, индекс Dow Jones вырос на 0,28% и составил 17131,86 пунктов, а индекс NASDAQ показал 0,17% рост до уровня 4838,64 пунктов.
- Если финансовые отчеты американских компаний удовлетворят ожидания или вовсе покажут лучшие результаты, то возможно продолжение ростового тренда на местных площадках. Согласно прогнозам аналитиков, прибыль компаний S&P 500 в среднем в третьем квартале снизится на 7,2%. Алюминиевая компания Alcoa первой начала сезон отчетностей и предоставила отчеты, которые показали не совсем позитивные результаты. На этой неделе еще 35 компаний опубликуют финансовые отчеты. Такие компании как Johnson & Johnson, Intel Corp. и JPMorgan Chase & Co. опубликуют отчеты сегодня.
- Кроме того, участники рынков ожидают подсказок со стороны ФРС о потенциальных сроках повышения ставок. После публикации протоколов заседания ожидания повышения ставки в 2015 году понизились. Однако некоторые члены ФРС, в частности Стэнли Фишер и Деннис Локхарт, не исключают повышения и до конца текущего года.
- Европейские рынки вчера завершили шестидневный рост. Торги понедельника завершились преимущественно снижением, устоять смог лишь немецкий индекс DAX, который подрос на 0,23% - до 10119,83 пунктов. Немецкий индекс был поддержан местными электроэнергетическими компаниями. Индексы FTSE 100 и CAC 40 просели на 0,7% и 0,27% соответственно и составили 6371,18 пунктов и 4688,7 пунктов.
- При этом на открытии вчерашних торгов индексы показывали рост на фоне опубликованных протоколов заседания ЕЦБ, которые показали, что инфляционные риски этим летом повысились, а также, что банку необходимо время для оценки влияния волатильности на рынках и замедления экономики Китая. При этом руководство ЕЦБ сообщило о готовности увеличивать объемы программы стимулирования для решения проблемы низкой инфляции в Европе.
- Российский рынок акций вчера также показал снижение в рамках коррекции после мощного недельного роста, оказавшегося лучшим в текущем году. Индекс ММВБ откатился на 1,03% - до 1710,6 пунктов, неудачно попытавшись пробить уровень сопротивления в 1740 пунктов. Индекс РТС также понизился на 1,08% и составил 876,42 пункта. Объемы торгов по акциям из базы расчета индекса ММВБ снизились по сравнению с пятницей и составили 39,7 млрд рублей. Снижение на рынке произошло на фоне локальной перекупленности, а также негативной динамики котировок на «черное золото» во второй половине дня.
- Акции «Башнефти» вчера выросли (обыкновенные на 0,73%, префы на 0,75%) на сообщениях о том, что компания до 2020 года будет выплачивать дивиденды в размере не менее 20 млрд рублей и не менее 25% чистой прибыли по МСФО. По словам президента компании Александра Корсика, возможное увеличение налоговой нагрузки на нефтяные компании не окажет влияния на объемы инвестиций «Башнефти» и на объемы дивидендов в 2016 году.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	50,72	-4,32%	2,69%	-11,85%
Light	47,95	-4,23%	3,61%	-10,72%
Алюминий	1581,00	-1,98%	0,96%	-14,66%
Золото	1154,50	-0,20%	1,65%	-2,43%
Медь	5273,47	-1,24%	2,00%	-15,36%
Никель	10460,00	-0,76%	5,66%	-30,96%
Пшеница	506,00	-0,47%	-1,75%	-14,18%
Серебро	15,73	-0,47%	0,80%	0,26%

Товарный рынок

- Котировки на «черное золото» вчера в начале торгов показывали положительную динамику на фоне снижения количества буровых установок в США за прошлую неделю по данным Baker Hughes. Однако затем котировки перешли в «красную зону» на фоне сообщений о росте добычи нефти в странах ОПЕК. Цены на нефть марки «Brent» падали на 4,3% до уровня 50,7 доллара за баррель.
- Согласно докладу ОПЕК, в сентябре организация увеличивала добычу нефти на 0,11 баррелей в день, до 31,57 млн баррелей. Без учета данных по Ираку добыча в ОПЕК за прошлый месяц выросла на 29 тысяч баррелей в день. Доля ОПЕК в мировой добычи нефти в сентябре выросла на 0,2% (с 33,3% августа до 33,5%).

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	62,28	0,64%	-3,82%	5,14%
EUR/RUB	70,69	0,55%	-2,38%	-1,84%
Бивалютная корзина	65,35	0,04%	-6,25%	5,92%
EUR/USD	1,1360	-0,12%	1,56%	-6,12%
GBP/USD	1,5315	-0,10%	1,01%	-1,74%
USD/JPY	119,87	-0,24%	-0,47%	0,09%

Валютный рынок

- Рубль вчера приостановил укрепление своих позиций и немного отступил, хотя в течение торгов не оставлял попыток закрепиться ниже 61 доллара за рубль. Сильное влияние на движение курса рубля оказала просадка котировок на нефть. В итоге курс рубля к доллару повысился на 0,64% и составил 62,28 рублей за доллар, а курс евро повысился на 0,55% - до 70,69 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины выросла на 0,04% и составила 65,35 рублей.
- Доллар вчера снижался по отношению к большинству мировых валют на фоне ожиданий отсрочки повышения ключевой ставки ФРС США на 2016 год. Индекс доллара опускался на 0,04% - до 94,82 пунктов.
- Курс доллара к евро вчера установился на уровне 1,136 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	122,16	-0,22%	2,03%	15,95%
США 10-летние, %	2,06	-0,03	0,07	-0,11
США 30-летние, %	2,89	-0,04	0,06	0,14
Россия 10-летние, %	10,56	0,13	-0,64	-3,53
Россия 15-летние, %	10,44	0,07	-0,51	-3,00

Долговой рынок

- Увеличение долговой нагрузки Eurasia Drilling вследствие участия в выкупе собственных акций негативно скажется на облигациях компании. Агентство Fitch поместило рейтинг компании на пересмотр с целью понижения, указывая на риски, связанные с реализацией сделки.
- БИНБАНК разместит дополнительные выпуски №1-6 облигаций серии БО-05 на 9 млрд рублей 14 октября.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно негативный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются в «красной зоне», хотя и без особой динамики. Основные индексы площадок Азиатско-Тихоокеанского региона торгуются с утра также с негативной динамикой на фоне снижения объемов импорта в страну, которое оказалось хуже ожиданий аналитиков.

Открытие рынка сегодня ожидаем ниже уровней вчерашнего закрытия. Вчера индекс ММВБ закрылся черной свечой после пяти дней роста на уровне 1710.6 пунктов. Индекс не смог преодолеть полугодовой уровень сопротивления 1740 пунктов, что является достаточно сильным первичным сигналом к развороту индикатора вниз. РТС также не смог пробить уровень сопротивления в районе 890-900 пунктов и закрылся черной свечой на уровне 876,42 пунктов. С учетом негативного внешнего фона, сохраняется шанс на реализацию коррекционного сценария по основным фондовым индексам.

Сегодняшний день принесет нам информацию по индексам потребительских цен Германии и Великобритании за сентябрь. Также станут известны данные из Германии по текущим экономическим условиям ZEW и индексу

текущих экономических настроений ZEW за октябрь. Кроме того, сегодня будет опубликован отчет об исполнении федерального бюджета США за сентябрь.

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.