

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1961,05	0,45%	0,51%	-4,75%
Dow Jones	16433,09	0,63%	0,36%	-7,80%
NASDAQ	4822,34	0,54%	1,88%	1,82%
S&P фьючерс	1955,00	0,24%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6117,76	-0,62%	-1,23%	-6,83%
DAX	10123,56	-0,85%	-1,88%	3,24%
CAC 40	4548,72	-1,04%	-2,26%	6,69%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46400,51	-0,22%	-2,04%	-7,21%
Nikkei 225	17983,74	-1,54%	1,59%	3,00%
Shangh Composite	3097,71	-3,20%	-1,98%	-4,23%
Hang Seng	21482,22	-0,10%	3,23%	-8,99%

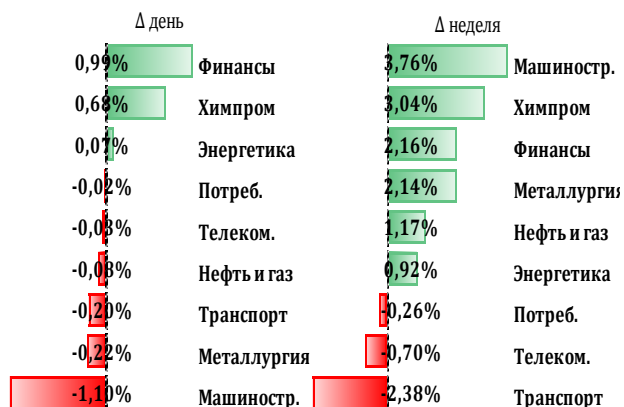
Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1718,06	-0,05%	0,44%	23,02%
РТС	799,10	-0,17%	-0,76%	1,06%
ММВБ-10	3831,54	-0,40%	-0,15%	26,04%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
МосБиржа	80,59	3,84%	Мечел ао	68,50	-3,75%
Башнефт ап	1470,00	2,00%	Yandex clA	760,00	-2,00%
ИнтерРАОа	1,11	1,69%	СОЛЛЕРС	459,00	-2,00%
НМТП ао	3,12	1,63%	Распадская	40,29	-1,73%
МОЭСК	0,87	1,17%	ФСК ЕЭС ао	0,06	-1,38%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Прошедшую неделю рынки Нового Света завершили в зеленой зоне на фоне ожиданий заседания комитета ФРС США. Рост был незначителен, фондовые индексы подросли в среднем примерно на 0,5%. Также стоит обратить внимание на внутреннюю статистику, которая оказала некоторое давление на рынки: фактический индекс цен производителей и базовый индекс цен производителей оказались выше ожидаемого уровня (0% против -0,1% и 0,3% против 0,1%). В свою очередь позитивным оказался отчет об исполнении федерального бюджета США (дефицит оказался равным 64,5 млрд. долл. против ожидаемых 81,5 млрд.). Однако рост индексов сдерживала информация о том, что индекс потребительских настроений Мичиганского университета, отражающий степень доверия домохозяйств к экономике США, в сентябре, по предварительной оценке, неожиданно упал до 85,7 пунктов с 91,9 пунктов в августе, в то время как аналитики ожидали падение до 91,2 пунктов. Кроме того, индекс текущих экономических условий в сентябре снизился до 100,3 пунктов со 105,1 пунктов в августе, а индекс экономических ожиданий упал с 83,4 пунктов до 76,4 пунктов.
- Рынки Европы в пятницу оказались в минусе на фоне прогнозов цен на нефть, а также на спорах о перспективах решения ФРС США касательно процентной ставки. Так, индекс FTSE 100 упал на 0,62% до 6117,76 пунктов, DAX снизился на 0,85% до 10123,56 пунктов, а французский CAC 40 остановился на 4548,72 пунктах, упав почти на 1 процент. Европейские инвесторы находятся в ожиданиях решения по ставке ФРС США, а также приняли во внимание отчет Международного Энергетического Агентства, согласно которому темпы роста мирового спроса на нефть в 2015 году ускорятся до пятилетнего максимума – на 1,7 миллиона баррелей в день, а ослабевать начнет лишь во второй половине 2016 года. Данное сообщение привело к падению акций Европейских энергетических и буровых компаний.
- Российский рынок акций в пятницу почти не отреагировал на итоги заседания Банка России, который решил оставить ключевую ставку на прежнем уровне в 11%. К концу дня отечественный рынок закрылся незначительным снижением на фоне низкого объема торгов и отсутствия значительных рыночных сигналов. Индекс ММВБ опустился на 0,05% - до 1718,06 пунктов, РТС – на 0,17%, до 799,1 пунктов. Влияние на рынок оказало лишь падение цен на нефть марки Brent, которое составило почти 3%.
- Лидерами роста стали акции Московской биржи (3,84%), префы «Башнефти» (2,15%), а также акции «Интер РАО» и НМТП (1,96% и 1,63% соответственно). Российские инвесторы не отреагировали на рост чистой прибыли компании «Мечел», акции которой оказались лидерами падения (-3,75%). Чистая прибыль компании оказалась положительной впервые с 2012 года и составила 34 миллиона долларов.
- Стоит принять во внимание также статистику, которая была опубликована на выходных в Китае. Согласно отчетам, объем инвестиций в основной капитал за первые 8 месяцев текущего года оказался ниже ожидаемых (10,9% против ожидаемых 11,1%), а объем промышленного производства в свою очередь также не оправдал ожиданий (6,1% против прогнозируемых 6,4%).

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,68	-2,07%	-3,62%	-15,40%
Light	45,03	-2,64%	-3,29%	-16,16%
Алюминий	1632,00	-0,24%	0,43%	-11,90%
Золото	1108,10	-0,26%	-1,41%	-6,35%
Медь	5367,17	-0,90%	3,22%	-13,85%
Никель	10160,00	-1,65%	2,89%	-32,94%
Пшеница	487,20	2,31%	4,91%	-17,37%
Серебро	14,56	-0,99%	-1,42%	-7,17%

Товарный рынок

- Цены на нефть марки Brent в ходе пятничных торгов снижались более чем на 3% на сообщениях МЭА и Goldman Sachs. Goldman Sachs снизил прогноз цен на американскую нефть в 2016 году до 45 долларов за баррель с 57 долларов, а на нефть марки Brent до 49,5 долларов с 62 долларов. Банк скорректировал прогнозы, ссылаясь на избыток нефти и проблемы в экономике Китая. Однако падение цен на нефть было немного сглажено сообщением Baker Hughes о том, что число буровых установок в США сократилось на прошлой неделе на 10 штук и составило 652. Сокращение количества буровых установок идет уже 2 неделю подряд. Таким образом, в конце дня цена на нефть марки Brent упала на 2% и составила 48,68 долларов за баррель.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	67,92	0,38%	1,08%	14,67%
EUR/RUB	77,00	0,85%	2,96%	6,93%
Бивалютная корзина	72,41	0,00%	1,79%	17,37%
EUR/USD	1,1349	0,58%	1,98%	-6,21%
GBP/USD	1,5444	-0,03%	1,40%	-0,91%
USD/JPY	120,33	-0,40%	0,91%	0,48%

Валютный рынок

- На фоне падения цен на нефть рубль в пятницу ослаб к доллару на 0,38% и теперь за доллар надо отдать 67,92 рубля. По отношению к евро рубль также показал негативную динамику (-0,85%) – евро стоит 77 рублей. Более сильная динамика евро к рублю обусловлена ростом единой валюты на форекс.
- Стоимость бивалютной корзины не изменилась и составила 72,41 рубля.
- Курс евро к доллару вырос на 0,58% и составил 1,13 долларов за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	116,73	0,09%	0,24%	10,79%
США 10-летние, %	2,19	-0,03	0,05	0,02
США 30-летние, %	2,94	-0,04	0,03	0,19
Россия 10-летние, %	11,75	0,14	0,05	-2,34
Россия 15-летние, %	11,45	0,00	-0,09	-1,99

Долговой рынок

- Американские казначейские облигации и российские облигации в пятницу показали разнонаправленную очень слабую динамику. Стоит отметить, что на фоне произошедших событий российские 10-летние облигации подросли на 0,14%.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются разнонаправленно, а вот в Азии с открытия сложился не самый лучший фон. Открытие торгов в РФ скорее всего пройдет вблизи уровней закрытия пятницы.

Индекс ММВБ в пятницу закрылся очередной нейтральной свечой – рынку не удалось закрепиться выше 1720 пунктов, но и сильного падения вновь удалось избежать. Техническая картина продолжает оставаться нейтральной, так что необходимо дожидаться более сильного сигнала, но на наш взгляд шансов на падение рынка в ближайшее время чуть больше, чем шансов на значительный рост выше локальных максимумов.

Выхода важной статистики сегодня не ожидается, внимание на этой неделе будет приковано к заседанию ФРС США, которое состоится 15-16 сентября. Инвесторы с одной стороны ждут повышения процентных ставок, но с другой стороны, неизвестно как рынки в действительности отреагируют на это событие, ведь последние пару лет инвесторы с явной опаской ждали начала ужесточения монетарной политики в США.

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.