

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2003,69	-0,68%	1,20%	-2,68%
Dow Jones	17081,89	-0,29%	1,74%	-4,16%
NASDAQ	4796,61	-0,87%	1,02%	1,28%
S&P фьючерс	1994,70	0,04%		

## Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6342,28	-0,45%	0,25%	-3,41%
DAX	10032,82	-0,86%	1,31%	2,32%
CAC 40	4643,38	-0,97%	-0,37%	8,91%

## Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	47362,64	-4,00%	-0,78%	-5,29%
Nikkei 225	17926,32	-1,69%	-1,07%	2,67%
Shangh Composite	3295,20	0,06%	7,94%	1,87%
Hang Seng	22470,84	-0,57%	1,81%	-4,80%

## Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1720,81	0,60%	3,00%	23,21%
РТС	866,52	-1,13%	4,82%	9,59%
ММВБ-10	3946,45	0,65%	3,91%	29,82%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Yandex clA	814,00	10,00%	Распадская	38,00	-5,35%
РусГидро	0,61	3,46%	ФосАгро ао	2533,00	-2,00%
Уркалий-ао	186,90	2,69%	МосБиржа	86,95	-1,42%
АЛРОСА ао	59,00	2,52%	НМТП ао	2,88	-1,37%
Ростел-ао	90,30	2,35%	МОЭСК	0,79	-1,25%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,61%	Металлургия	8,52%	Финансы
1,39%	Химпром	5,88%	Транспорт
0,92%	Энергетика	1,38%	Нефть и газ
0,71%	Нефть и газ	0,86%	Телеком.
0,55%	Телеком.	0,41%	Энергетика
0,48%	Потреб.	-0,35%	Металлургия
0,33%	Транспорт	-1,21%	Машиностр.
-0,16%	Машиностр.	-2,24%	Химпром
-0,64%	Финансы	-2,55%	Потреб.

## Фондовый рынок

- Американские рынки закрыли вчерашние торги в «красной зоне» после нескольких дней роста. Индекс S&P 500 снизился на 0,68% - до 2003,69 пунктов, Dow Jones показал 0,29% снижения и составил 17081,89 пунктов, а NASDAQ упал на 0,87% - до 4796,61 пунктов. Давление на рынки в основном оказали слабые статистические данные из Китая.
- Так, объем импорта в Поднебесной в сентябре в годовом выражении упал на 20,4%, хотя аналитики ожидали снижение на 15%. Месяцем ранее снижение объемов импорта составляло 13,8%. Падение продолжается уже 11 месяц подряд. Данная информация послужила негативным сигналом для динамики американских рынков, в частности для акций промышленных компаний, так как Китай является одним из крупнейших мировых потребителей сырья и ресурсов.
- Однако позитива на рынки внесли некоторые данные из финансовой отчетности компании Johnson & Johnson. В частности, скорректированная прибыль компании на акцию составила 1,49\$, хотя эксперты ожидали значение в 1,45\$ на акцию. Поддержку также оказали сигналы от представителей ФРС США о том, что Регулятор вряд ли поднимет ключевую ставку в 2015 году.
- Рынки Старого Света вчера все закрылись в негативном направлении на фоне слабых сигналов с Востока, а также внутренней макростатистики. По итогам торгов Британский индекс FTSE 100 снизился на 0,45% и составил 6342,28 пунктов, немецкий DAX и французский CAC 40 упали на 0,86% и 0,97% и составили 10032,82 и 4643,38 пунктов соответственно.
- Давление на Европейские рынки, также, как и на Американские, оказали слабые данные по импорту из КНР. Кроме того, не обрадовала статистика из Германии и Великобритании. Согласно данным Центра исследований экономики Европы (ZEW), индекс доверия инвесторов к экономике Германии в октябре снизился до 1,9 пунктов с сентябрьских 12,1 пунктов, хотя аналитики прогнозировали снижение не столь значительное - до 6 пунктов. К тому же, индекс текущих экономических условий в стране в октябре довольно существенно снизился - с 67,5 пунктов в сентябре до 55,2 пунктов, при ожидаемом снижении до 64,7 пунктов.
- В Великобритании Бюро национальной статистики сообщило о том, что в сентябре в стране наблюдалась 0,1% дефляция в годовом выражении, хотя в предыдущем месяце инфляция была нулевой. Аналитики ожидали нулевую инфляцию, как в месячном, так и в годовом выражении.
- Отечественный фондовый рынок вчера закрылся разнонаправленно, хотя в течение большей части торгов оба индекса находились в «красной зоне». Индекс ММВБ по итогам торгов вырос на 0,6% - до 1720,81 пунктов, а индекс РТС наоборот упал на 1,13% и остановился на уровне 866,52 пунктов.
- Влияние на движение индексов оказала волатильность нефти. Котировки на черное золото, которые вечером перешли к росту, смогли «вытащить» индекс ММВБ в «зеленую зону». Индекс РТС вчера «утащил вниз» ослабевший рубль.
- Акции компании «Yandex» вчера стали лидером роста (+10%) на фоне новостей о том, что компания заключила соглашение о сотрудничестве с корпорацией «Microsoft». Соглашение предполагает предустановку российского поисковика в браузеры американской компании на устройства, которые работают на платформе Windows 10. Акции «Северстали» поднялись на 2,1% на сообщении о том, что компания по итогам

9 месяцев увеличила производство стали на 3%, по сравнению с тем же периодом предыдущего года.

- Выросли также акции крупнейшего российского гражданского авиаперевозчика «Аэрофлот» (1,1%) на фоне обсуждения на проблем «Трансаэро» на встрече президента РФ с правительством. Владимир Путин поручил Минтрансу оказать поддержку «Аэрофлоту» по перевозке пассажиров «Трансаэро».
- Наконец, стоит обратить внимание на Латинскую Америку, где Бразильский индекс Bovespa обрушился на 4%, что составило худшее падение с прошлого декабря. Падение произошло после девяти положительных торговых сессий и было вызвано снижением стоимости активов крупнейшей горнодобывающей компании Vale, а также крупной нефтяной компании Petrobras.

## Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	49,80	-1,81%	-4,96%	-13,45%
Light	47,28	-1,40%	-4,06%	-11,97%
Алюминий	1589,00	0,51%	2,02%	-14,22%
Золото	1172,10	1,52%	2,07%	-0,94%
Медь	5284,50	0,21%	1,16%	-15,18%
Никель	10465,00	0,05%	5,07%	-30,92%
Пшеница	518,60	2,49%	-1,41%	-12,04%
Серебро	15,99	1,65%	0,47%	1,91%

- После ощутимого роста накануне до 54 долларов за баррель, котировки марки «Brent» вчера вновь откатились к уровню в 50 долларов за баррель. Участники рынка находятся в ожидании данных от Минэнерго США по запасам и добыче нефти в стране, которая выйдет сегодня. Ожидается продолжение тренда снижения добычи «черного золота», несмотря на неожиданный рост добычи на прошлой неделе. Давление на котировки «черного золота» оказали расчеты Международного Экономического Агентства, согласно которым в 2016 году ожидается снижение темпов роста спроса на нефть до 1,2 млн баррелей в день с прироста в 1,8 млн баррелей в день в 2015 году.

## Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	63,04	1,23%	-0,46%	6,43%
EUR/RUB	71,84	1,63%	0,52%	-0,24%
Бивалютная корзина	66,56	1,84%	-3,57%	7,88%
EUR/USD	1,1385	0,22%	0,99%	-5,92%
GBP/USD	1,5286	-0,19%	0,25%	-1,92%
USD/JPY	119,68	-0,16%	-0,23%	-0,07%

- Рубль в ходе вчерашних торгов продолжал находиться в небольшом минусе в рамках коррекции на фоне дешевающей нефти. Стоит сразу заметить, что на национальную валюту не оказало серьезного влияния публикация отчета по крушению пассажирского Boeing-777, произошедшего в прошлом году. В итоге курс доллара к рублю вырос на 1,23% и составил 63,04 рубля за доллар, а курс евро подрос на 1,63% - до уровня в 71,84 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины выросла на 1,84% и составила 66,56 рублей.
- Курс доллара по отношению к мировым валютам снижался на фоне сообщений о том, что ФРС США скорее всего повысит ставку лишь в 2016 году. Индекс доллара опускался незначительно на 0,01% - до 94,87 пунктов.
- Курс доллара к евро вчера также вырос на 0,22% и составил 1,138 долларов за евро.

## Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	121,97	-0,16%	1,07%	15,76%
США 10-летние, %	2,05	-0,01	0,00	-0,12
США 30-летние, %	2,88	0,00	0,00	0,13
Россия 10-летние, %	10,55	-0,01	-0,05	-3,54
Россия 15-летние, %	10,48	0,04	-0,04	-2,96

- Минфин РФ сегодня проведет аукцион по размещению ОФЗ с индексируемым номиналом с датой погашения в августе 2023 года в объеме 20,22 млрд рублей.
- АФК «Система» разместила десятилетние облигации серии 001P-01 на 5 млрд рублей. Ставка купона была установлена на уровне 12,5% годовых.

## Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтральный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются хоть и в «красной зоне», но около нуля. Азиатские индексы утром показывают разнонаправленную динамику. Котировки на нефть с утра торгуются в «зеленой зоне».

Открытие рынка сегодня ждем на уровне вчерашнего значения закрытия по индексу ММВБ и небольшим снижением по индексу РТС. Индекс ММВБ вчера закрылся небольшой зеленой свечой на уровне 1720, 81 пунктов. РТС закрылся «звездой» на уровне 866,52 пунктов, оставляя шанс на продолжение позитивной тенденции. Пока что разворот вниз по индикаторам не подтверждается, однако в случае негативного внешнего фона и низких цен на нефть индексы могут направиться вниз к уровням 1690 пунктов и 840 пунктов.

Сегодня ожидается довольно-таки большой пул информации, в частности, станут известны данные по индексам потребительских цен за сентябрь из Франции, Испании и Италии. Также из Великобритании ожидаются данные по рынку труда за август и сентябрь, а в США станет известен индекс цен производителей и индекс розничных продаж за сентябрь. Кроме того, сегодня будет опубликована «Бежевая Книга» ФРС. Наконец, не останутся без внимания и данные Американского института нефти по недельным запасам сырой нефти в стране.

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.

