

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1994,24	-0,47%	-0,08%	-3,14%
Dow Jones	16924,75	-0,92%	0,07%	-5,04%
NASDAQ	4782,85	-0,29%	-0,17%	0,99%
S&P фьючерс	1996,90	0,65%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6269,61	-1,15%	-1,05%	-4,52%
DAX	9915,85	-1,17%	-0,55%	1,12%
CAC 40	4609,03	-0,74%	-1,25%	8,10%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46710,44	-1,38%	-4,51%	-6,59%
Nikkei 225	18145,13	1,42%	-0,38%	3,92%
Shangh Composite	3308,24	1,40%	4,40%	2,27%
Hang Seng	22925,64	2,16%	2,53%	-2,88%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1723,01	0,13%	2,59%	23,37%
РТС	863,31	-0,37%	2,27%	9,18%
ММВБ-10	3955,79	0,24%	3,22%	30,13%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Аэрофлот	47,39	5,55%	ФосАгро ао	2495,00	-2,00%
ДИКСИ ао	338,50	3,80%	Русал рдр	265,00	-1,90%
МОЭСК	0,82	3,17%	ФСКЭС ао	0,06	-1,78%
Сбербанк	86,81	2,13%	НМТП ао	2,83	-1,74%
Polymetal	577,00	2,10%	Сургнфгз	35,27	-1,69%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
2,46%	Транспорт	8,21%	Транспорт
1,04%	Потреб.	5,55%	Финансы
0,72%	Металлургия	2,37%	Телеком.
0,02%	Телеком.	1,51%	Металлургия
0,02%	Машиностр.	0,91%	Нефть и газ
-0,21%	Финансы	0,74%	Энергетика
-0,27%	Энергетика	-0,64%	Потреб.
-0,34%	Химпром	-0,91%	Машиностр.
-0,39%	Нефть и газ	-1,74%	Химпром

Фондовый рынок

- Фондовые рынки за океаном второй день подряд демонстрируют нисходящую динамику на фоне публикации финансовых отчетов местными компаниями и внутренней макростатистики. В частности, американские инвесторы были обеспокоены данными от Wal-Mart Stores Inc. и JP Morgan Chase&Co. По итогам торгов индекс широкого рынка S&P 500 снизился на 0,47% и составил 1994,24 пункта, промышленный индекс Dow Jones упал на 0,92% - до 16924,75 пунктов, а индекс высокотехнологичных компаний NASDAQ понизился на 0,29% и остановился на уровне 4782,85 пунктов.
- Падение Wal-Mart оказалось самым большим за последние 27 лет, после того, как стали известны прогнозы о том, что ежегодная прибыль гиганта в сфере ритейла в будущем будет снижаться. Эта информация в итоге вызвала беспокойство инвесторов за состояние экономики в стране в целом и в частности за потенциал ее будущего роста. Также потеряли более 2% акции JPMorgan Chase&Co на фоне публикации финансовой отчетности банка, согласно которой в третьем квартале прибыль на акцию не дотянула до прогнозных 1,37\$ и составила 1,32\$.
- Также стали известны внутренние макроэкономические данные. В частности, индекс цен производителей упал на 0,5% в сентябре в месячном выражении, хотя ожидалось падение на 0,2%. Рост объема розничных продаж в стране в сентябре не дотянул до прогнозных 0,2% и вырос на 0,1% в месячном выражении.
- Европейские фондовые индексы вчера также снизились на фоне опасений за рост экономики Китая, крупнейшего потребителя европейских товаров, в первую очередь автомобилей и предметов роскоши. Давление на рынки оказали данные по инфляции, опубликованные в Поднебесной. В частности, индекс потребительских цен в сентябре в месячном выражении составил 0,1%, против августовских 0,5% и ожидаемых аналитиками 0,5%. В годовом выражении инфляция также не оправдала ожиданий экспертов, составив 1,6%, хотя ожидалось 1,8%. Замедление инфляции может оказать давление на темпы роста второй крупнейшей экономики мира.
- Кроме того, свое воздействие на рынки оказали и внутренние данные из Великобритании, где в сентябре значительно выросло количество заявок на пособие по безработице (+4,6 тысяч, против августовских +1,2 тысячи, хотя аналитики ожидали снижение числа заявок на 2,1 тысячу). Рост среднего уровня заработной платы в стране с учетом премий в сентябре хоть и увеличился по сравнению с августом, но опять же не дотянул до ожиданий экспертов (3% роста в месячном выражении в сентябре, против 2,9% августа и ожидаемых 3,1%). Однако в целом по стране уровень безработицы в августе упал до 5,4%, что является лучшим значением показателя с 2008 года.
- Российский фондовый рынок вчера закрылся разнонаправленно на фоне волатильности нефтяных котировок. Так индекс ММВБ немного подрос на 0,13% и составил 1723,01 пункта, а РТС снизился на 0,37% до уровня 863,31 пунктов. Разнонаправленное движение индексов наблюдается второй торговый день подряд. Объемы торгов при этом по сравнению со вчерашним днем выросли до 31,76 млрд рублей.
- Акции компании «Дикси» - одного из крупнейших российских ритейлеров вчера подросли на 3,8% после публикации операционных результатов за 9 месяцев текущего года. Согласно отчету, розничная выручка выросла на 17,1% по

сравнению с 2014 годом, а рост продаж по сравнению с августом ускорился, когда выручка ритейлера увеличилась на 12,9%.

- Акции «Аэрофлота» вчера стали лидерами рынка, поднявшись на 5,55% и обновив максимум 2015 года.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	49,77	-0,06%	-3,28%	-13,50%
Light	47,09	-0,40%	-1,81%	-12,33%
Алюминий	1593,50	0,28%	1,50%	-13,98%
Золото	1183,80	1,00%	3,54%	0,05%
Медь	5352,84	1,29%	3,39%	-14,08%
Никель	10540,00	0,72%	4,15%	-30,43%
Пшеница	508,20	-2,01%	-2,08%	-13,81%
Серебро	16,14	0,97%	3,03%	2,90%

Товарный рынок

- Котировки на «черное золото» в течение вчерашней торговой сессии колебались в районе 49,6 долларов за баррель «Brent» при повышенной волатильности. В итоге к полуночи котировки остановились на отметке в 49,7 долларов за баррель марки «Brent». Вчера стали известны данные от Американского института нефти, согласно которым недельные запасы сырой нефти в США выросли на 9,3 млн баррелей, хотя аналитики ожидали роста на 1,8 млн баррелей. Игроки рынка также продолжают оценивать данные от ОПЕК по добычи нефти, а также возвращение на рынок иранской нефти.
- Котировки на золото вчера росли на 1% на фоне негативной статистики с Востока, а также на фоне снижения фондовых индексов в США и Европе.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	62,71	-0,52%	0,07%	5,87%
EUR/RUB	71,90	0,08%	2,04%	-0,16%
Бивалютная корзина	67,59	1,54%	1,50%	9,55%
EUR/USD	1,1482	0,85%	2,01%	-5,12%
GBP/USD	1,5472	1,22%	1,10%	-0,73%
USD/JPY	119,02	-0,55%	-0,71%	-0,62%

Валютный рынок

- Курс рубля вечером среды снижался к доллару и повышался к евро на фоне колебаний цен на нефть вокруг 49 долларов за баррель марки «Brent». Поддержку рублю оказывал начавшийся октябрьский налоговый период, который простимулировал спрос на национальную валюту. Геополитическая обстановка пока на рубль влияния не оказывает. В итоге курс рубля к доллару снизился на 0,52% и составил 62,71 рублей за доллар, а курс рубля к евро вырос на 0,08% - до 71,9 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины выросла на 1,54% и составила 67,59 рублей.
- Курс доллара вчера снижался по отношению к мировым валютам на фоне роста спроса на безопасные активы из-за не самого позитивного внешнего фона. Индекс доллара упал на 0,24% и составил 94,54 пункта.
- Курс доллара к евро вырос на 0,85% - до 1,148 долларов за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	122,16	0,16%	0,09%	15,95%
США 10-летние, %	2,00	-0,05	-0,05	-0,17
США 30-летние, %	2,85	-0,03	-0,03	0,10
Россия 10-летние, %	10,46	-0,09	-0,06	-3,63
Россия 15-летние, %	10,32	-0,16	-0,17	-3,12

Долговой рынок

- Минфин РФ в среду провел очередной аукцион ОФЗ, где разместил облигации федерального займа с индексируемым номиналом с погашением в августе 2023 года. Общий объем размещения составил 20,222 млрд рублей. Объем спроса составил 92,616 млрд рублей, цена отсечения составила 95,6% от номинала, а доходность по цене отсечения - 3,28% годовых. Реальная средневзвешенная доходность составила 3,27% годовых.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня позитивный: фьючерсы на западные индексы утром торгуются в «зеленой зоне» с неплохой динамикой. Фондовые индексы площадок Азиатско-Тихоокеанского региона также демонстрируют позитивную динамику. Котировки на нефть с утра продолжают колебания на том же уровне, что и вчера.

Открытие рынка сегодня ждем примерно там же, где он закрылся вчера. Вчера индекс ММВБ закрылся небольшой белой свечой на уровне 1723,01 пунктов. Индекс РТС второй день подряд снижается, однако вчера индекс весь день отыгрывал 2% падение при открытии торгов, однако в итоге превзойти цену предыдущего

закрытия не получилось, и индекс остановился на уровне 863,31 пунктов. Большой тяги к падению у рынка не чувствуется и, судя по динамике отдельных бумаг, есть шанс на еще одну волну роста в район 1740-1750 пунктов по ММВБ и 890-900 пунктов по РТС. Отмена ростового сценария в случае закрытия большой черной свечой ниже минимумов вторника.

Сегодня ожидается информация по международным резервам ЦБ РФ. Кроме того, будут опубликованы данные по рынку труда и производственной активности в США. Наконец, станут известны изменения запасов сырой нефти в США по данным Информационного Агентства энергетики.

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.