

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2023,86	1,49%	0,52%	-1,70%
Dow Jones	17141,75	1,28%	0,53%	-3,82%
NASDAQ	4870,10	1,82%	1,23%	2,83%
S&P фьючерс	2018,00	-0,05%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6338,67	1,10%	-0,57%	-3,46%
DAX	10064,80	1,50%	0,72%	2,64%
CAC 40	4675,29	1,44%	-0,01%	9,66%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	47161,15	0,96%	-3,96%	-5,69%
Nikkei 225	18299,65	1,12%	-0,54%	4,81%
Shangh Composite	3348,58	0,31%	5,79%	3,52%
Hang Seng	23019,38	0,57%	1,24%	-2,48%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1731,91	0,52%	2,52%	24,01%
РТС	876,23	1,50%	2,31%	10,82%
ММВБ-10	3977,76	0,56%	2,82%	30,85%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
СевСт-ао	725,00	5,80%	МосБиржа	83,54	-2,52%
Аэрофлот	49,00	3,40%	Газпромнефть	148,20	-2,40%
Трансф ап	146500,00	3,00%	ЛСР ао	587,00	-2,00%
НЛМК ао	74,90	2,72%	АЛРОСА ао	57,96	-1,76%
ДИКСИ ао	347,00	2,50%	РусГидро	0,60	-1,55%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,58%	Транспорт	8,05%	Транспорт
0,84%	Телеком.	3,37%	Финансы
0,83%	Металлургия	2,78%	Телеком.
0,59%	Машиностр.	2,67%	Металлургия
0,35%	Потреб.	1,26%	Нефть и газ
0,33%	Нефть и газ	0,19%	Потреб.
-0,06%	Энергетика	0,01%	Энергетика
-0,06%	Химпром	-0,05%	Машиностр.
-0,32%	Финансы	-1,85%	Химпром

Фондовый рынок

- Американские рынки закончили вчерашние торги в «зеленой зоне» на фоне финансовых отчетов местных компаний.
- Чистая прибыль одной из крупнейших финансовых компаний Citigroup в третьем квартале 2015 года выросла на 51% и составила 4,291 миллиарда долларов. Чистая прибыль в расчете на одну акцию составила 1,35 доллара, против прошлого значения в 0,88 доллара за акцию. Аналитики же прогнозировали меньшие значения показателя чистой прибыли на акцию - 1,28 доллара. Чистая прибыль на акцию банковского гиганта Goldman Sachs Group в прошедшем квартале почти достигла ожидаемого аналитиками показателя в 2,91 доллара.
- С другой стороны были опубликованы и негативные отчеты, в частности отчет компаний Blackstone Group. Квартальный убыток инвестиционной компании составил 483,86 млн долларов, против прибыли в 553,862 млн долларов годом ранее. Убыток на акцию составил 0,4 доллара против прибыли 0,4 доллара на акцию в прошлом году. Аналитики ожидали в этом году убытка в 0,3 доллара на акцию.
- Кроме того, вчера вышла макростатистика по США, которая в целом оказалась смешанной, но больше негативной, чем позитивной. Уровень инфляции в стране, за исключением продуктов питания и энергии, в сентябре в годовом и месячном выражении оказался лучше ожидаемого: 0,2% против 0,1% в месячном выражении и 1,9% против 1,8% в годовом выражении. Однако, если же рассматривать инфляцию с учетом всех основных групп товаров и услуг, то здесь статистика, наоборот, показывает наличие дефляции в сентябре на уровне 0,2% в месячном выражении, чего также ожидали и аналитики.
- Число первичных заявок на пособия по безработице в США за прошлую неделю оказалось лучше ожидаемого: показатель вырос на 255 тысяч, хотя аналитики ожидали роста на 270 тысяч. Однако в то же время, индексы производственной активности NY Empire State и от ФРБ Филадельфии не оправдали ожиданий экспертов.
- Европейские площадки вчера также закрылись в плюсе, воодушевленные слабыми макроэкономическими данными из США, которые еще больше укрепили уверенность того, что ФРС США не повысит ключевую ставку в 2015 году. Кроме того, поддержку рынкам оказала публикация финансовых показателей за третий квартал текущего года местными компаниями. В частности, один из лидеров рынка FMCG, компания Unilever, объявила о росте выручки в третьем квартале на 9,4%, что привело к росту ее акций на 3,6%. Крупнейший из открытых хедж-фондов Man Group Plc объявил о 1,4 млн долларов чистых доходов в третьем квартале текущего года, при том, что последние два квартала фонд терпел убытки. Эта новость повысила его акции на 5,2%.
- Российский рынок акций вчера вырос на позитивном внешнем фоне и укреплении национальной валюты. Так, индекс ММВБ вырос на 0,52% и составил 1731,91 пунктов, а индекс РТС увеличился на 1,5% после трех дней снижения и остановился на уровне 876,23 пунктов.
- Акции нефтедобывающей компании «Башнефть» выросли (обыкновенные акции выросли на 0,22%, а префы – на 0,13%) на фоне улучшения операционных результатов компании за последние 9 месяцев текущего года, в частности компания продемонстрировала рост добычи на 12,1%. Акции НЛМК также выросли (2,72%) за счет роста операционных результатов по итогам трех кварталов этого года: выпуск стали вырос на 2% по сравнению с прошлым годом.

- Акции «АЛРОСА» упали на 1,76% после появления информации о том, что крупнейшая золотодобывающая компания в России «Polys Gold» может быть продана «АЛРОСА» после консолидации акций семьей Сулеймана Керимова.
- Также стала известна информация о том, что чистая прибыль «Уралкалия» по РСБУ по итогам трех кварталов выросла на 46% по сравнению с прошлым годом и составила 38,6 млрд рублей.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	50,16	0,78%	-6,23%	-12,83%
Light	47,44	0,74%	-4,99%	-11,67%
Алюминий	1571,00	-1,41%	-0,48%	-15,20%
Золото	1178,10	-0,48%	2,94%	-0,43%
Медь	5326,39	-0,49%	1,32%	-14,51%
Никель	10560,00	0,19%	2,18%	-30,30%
Пшеница	500,40	-1,53%	-2,87%	-15,13%
Серебро	16,05	-0,59%	1,97%	2,30%

- Котировки на «черное золото» в течение вчерашних торгов торговались в «красной зоне» отыгрывая ранее опубликованную информацию от Американского института нефти о том, что недельные запасы сырой нефти за прошлую неделю выросли на 9,3 млн баррелей, хотя ожидался рост на 1,8 млн баррелей. В добавок, ближе к вечеру появилась информация от Информационного Агентства энергетики США о том, что запасы сырой нефти в Америке, по данным источника, за неделю выросли на 7,562 млн баррелей, хотя ожидался рост лишь на 2,8 млн баррелей.
- Однако после 20.00 по московскому времени котировки развернулись вверх и в итоге к полуночи цены на нефть марки «Brent» выросли на 0,78% и составили 50,16 долларов за баррель. Получается, что рынок проигнорировал новые данные по росту запасов и отреагировал на новость о том, что добыча в стране сократилась, по данным Минэнерго США, которые также были стали известны вчера.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	61,40	-2,08%	0,05%	3,66%
EUR/RUB	69,82	-2,89%	0,87%	-3,04%
Бивалютная корзина	66,76	-1,24%	0,70%	8,21%
EUR/USD	1,1378	-0,91%	0,87%	-5,97%
GBP/USD	1,5471	-0,01%	0,68%	-0,74%
USD/JPY	119,10	0,07%	-0,72%	-0,55%

- Курс рубля продолжил укрепляться к доллару и к евро на фоне попыток нефтяных котировок удержаться в районе 49-50 долларов за баррель по марке «Brent». Кроме того, поддержку национальной валюте оказывает и октябрьский налоговый период в стране, а также высокий спрос на инфляционные ОФЗ. В итоге курс рубля к доллару упал на 2,08% и составил 61,40 рублей за доллар, а курс евро снизился на 2,89% и составил 69,82 рублей за евро. Бивалютная корзина подешевела на 1,24% - до 66,76 рублей.
- Курс доллара к евро вчера снизился и теперь за евро придется отдать 1,137 доллара, снижение составило 0,91%. Индекс доллара вчера вырос на 0,04% и составил 94,48 пунктов.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	122,92	0,62%	1,04%	16,67%
США 10-летние, %	2,01	0,02	-0,07	-0,16
США 30-летние, %	2,86	0,00	-0,07	0,11
Россия 10-летние, %	10,37	-0,09	-0,13	-3,72
Россия 15-летние, %	10,30	-0,02	-0,09	-3,14

- РЖД вчера разместили двадцатилетние облигации серии БО-08 общим объемом 20 млрд рублей. Ставка купона была установлена на уровне 11,44% годовых.
- ABInVev может продать облигации на сумму 55 млрд долларов для осуществления сделки по покупке SABMiller.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтральный: фьючерсы на западные индексы эти утром торгуются разнонаправленно и без особой динамики. Индексы площадок Азиатско-Тихоокеанского Региона торгуются утром также в плюсе. Котируются «черного золота» продолжают движения без ярко выраженной направленности.

Открытие рынка сегодня ждем немного выше уровней вчерашнего закрытия. Индекс ММВБ вчера закрылся белой свечой на уровне 1731,91 пунктов. Индекс в ходе торгов тестировал серьезный долгосрочный уровень сопротивления в районе 1730-1740 пунктов, однако пробить его не удалось, хотя ночью по фьючерсам индикатор формально закрылся выше. Закрытие сегодня хорошей белой свечой выше 1740-1750 пунктов может стать хорошим сигналом к дальнейшему движению рынка вверх в район 1800 пунктов. Индекс РТС вчера наконец закрылся белой свечой на 876,23 пунктах и с учетом динамики ночью, сегодня и в ближайшие дни может продолжиться движение вверх в район 900-920 пунктов. Надежных сигналов к развороту рынка вниз по-прежнему нет.

Сегодня ожидаются данные по инфляции в сентябре из Евросоюза, а также статистика по объемам промышленного производства США за сентябрь и предварительные данные по индексу ожиданий потребителей США за октябрь. Наконец, станут известны важные данные по количеству буровых установок в США от Baker Hughes.

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, опубликовать, 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.