

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2023,04	-1,12%	-3,63%	-1,74%
Dow Jones	17245,24	-1,16%	-3,71%	-3,24%
NASDAQ	4927,88	-1,54%	-4,26%	4,05%
S&P фьючерс	2008,50	-0,50%		

## Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6118,28	-0,98%	-3,71%	-6,82%
DAX	10708,40	-0,69%	-2,54%	9,21%
CAC 40	4807,95	-1,00%	-3,54%	12,77%

## Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46517,04	-0,78%	-0,86%	-6,98%
Nikkei 225	19391,92	-1,05%	-1,12%	11,06%
Shangh Composite	3562,54	-0,51%	-2,35%	10,14%
Hang Seng	22031,16	-1,63%	-3,77%	-6,67%

## Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1728,17	-0,68%	-1,49%	23,74%
РТС	814,93	-2,05%	-4,61%	3,06%
ММВБ-10	3998,93	-0,43%	-1,20%	31,55%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Сургутнефтегаз-п	44,00	4,79%	СОЛЛЕРС	404,00	-6,00%
МегаФон ао	868,00	2,00%	ПИК ао	220,10	-5,40%
Ураллий-ао	164,50	1,73%	РусГидро	0,57	-4,54%
Сбербанк-п	69,37	1,57%	ММК	21,36	-4,07%
ДИКСИ ао	314,50	1,50%	Трансф ап	145500,00	-4,00%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ



## Фондовый рынок

- Фондовые рынки США в последний день прошедшей недели потеряли от 1,1% до 1,54% по основным индексам на фоне публикации внутренней статистики по розничным продажам и потребительским настроениям.
- Публикация слабой статистики по продажам в стране «направила» индексы в «красную» зону. Так, слабее, чем ожидалось, выросли объемы розничных продаж: в октябре рост составил 0,1% в месячном выражении, при ожидаемом росте на 0,3%. Без учета выручки от продаж автомобилей и бензина, продажи выросли в октябре на 0,3% в месячном выражении, хотя консенсус-прогноз предполагал рост на 0,4%. Кроме того, объем товарно-материальных запасов в США в сентябре, по сравнению с августом, вырос на 0,3%, хотя ожидался рост на 0,1%. В целом, приведенные данные сигнализируют о повседневном снижении потребительской активности в стране.
- Не дотянул до ожидаемых уровней и индекс цен производителей, который в октябре упал на 0,4% в месячном выражении, хотя ожидалось повышение на 0,2%. Базовый индекс цен производителей, без учета продуктов питания и энергоносителей, снизился на 0,3% при прогнозируемых 0,1% роста.
- Однако падение индексов приостановили позитивные предварительные данные по индексам ожиданий потребителей и настроений потребителей от Мичиганского университета за ноябрь. Согласно предварительным оценкам, в текущем месяце индекс ожиданий потребителей вырос на 3,5 пункта, по сравнению с октябрем, и составил 85,6 пунктов (ожидался рост до 84 пунктов). Индекс настроения потребителей в ноябре, по предварительным оценкам, составил 93,1 пункт, против ожидаемых 91,5 пунктов и октябрьских 90 пунктов. Таким образом, данная статистика говорит о сохранении доверия местных домохозяйств к экономике страны и их готовности к будущему усилению покупательской активности.
- Европейские индексы в прошедшую пятницу также продемонстрировали снижение на слабой внутренней статистике. Так, согласно предварительным оценкам статистического агентства Евростат, ВВП 19 стран еврозоны по итогам третьего квартала текущего года вырос на 0,3% в квартальном выражении и на 1,6% в годовом выражении. Консенсус-прогноз аналитиков предполагал рост ВВП на 0,4% в квартальном и на 1,7% в годовом выражении.
- При этом, рост ВВП Франции и Германии в третьем квартале совпал с ожиданиями экспертов. ВВП Франции, согласно предварительным оценкам, по итогам квартала увеличился на 0,3% в квартальном выражении. ВВП Германии, также по предварительным оценкам, в третьем квартале вырос на 0,3% в квартальном и на 1,8% в годовом выражении. Снижение экономического роста в Еврозоне укрепляет ожидания увеличения мер по стимулированию экономики в декабре этого года на заседании ЕЦБ.
- Отечественный фондовый рынок в последний день недели также закрылся падением, на фоне обвала нефтяного рынка и негативного внешнего фона. К закрытию торгов индекс ММВБ потерял 0,68% и составил 1728,17 пунктов, а индекс РТС упал на 2,05% - до 814,93 пунктов. Объем торгов по бумагам из базы расчета индекса ММВБ вырос, по сравнению с четвергом, до 30,42 млрд рублей.
- Лидером рынка оказались акции «Сургутнефтегаз», которые выросли почти на 5% на фоне новостей о том, что компания сохранит объемы вложений в геологоразведку. Вячеслав

Чирков, главный геолог компании, сообщил в четверг о том, что компания до 2018 года будет вкладывать в геологоразведку около 16 млрд рублей ежегодно.

- Упали на 1,22% акции «Русала» на фоне пересмотра прогноза по росту спроса на алюминий в текущем году. Как отметил генеральный директор компании Владислав Соловьев, снижение цен на алюминий связано с профицитом на рынке, который вызван ростом производства на Ближнем Востоке, в Индии и Китае и замедлением спроса в развивающихся странах.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	44,98	-0,60%	-5,94%	-21,83%
Light	42,36	-1,17%	-5,15%	-21,13%
Алюминий	1491,00	-0,53%	-2,10%	-19,51%
Золото	1092,40	0,91%	-0,04%	-7,67%
Медь	4759,80	-0,16%	-3,92%	-23,60%
Никель	9450,00	-0,37%	-2,33%	-37,62%
Пшеница	494,00	-0,60%	-5,07%	-16,21%
Серебро	14,33	0,56%	-2,75%	-8,64%

## Товарный рынок

- Нефтяные котировки в пятницу продолжали «пробиваться» к минимуму августа. В пятницу вышли очередные данные от «Baker Hughes» об изменении количества буровых установок в США по итогам недели. Так, за прошедшую неделю в США количество нефтяных буровых установок выросло на 2 штуки – до 574 единиц. Данная новость не добавила позитива на рынок, на фоне сохраняющегося переизбытка нефти. В итоге, котировки пробили уровень в районе 45 долларов за баррель по марке «Brent».
- Цены на такие металлы, как медь, алюминий и никель продолжают снижаться на фоне продолжавшегося ослабления экономики Китая, одного из крупнейших потребителей ресурсов. При этом, негативная динамика фондового рынка США вызвала небольшой рост в котировках на золото.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	66,78	0,21%	3,37%	12,74%
EUR/RUB	71,77	-0,32%	3,41%	-0,33%
Бивалютная корзина	69,23	1,96%	4,15%	12,21%
EUR/USD	1,0725	-0,60%	-0,39%	-11,37%
GBP/USD	1,5212	0,01%	0,96%	-2,40%
USD/JPY	122,44	-0,14%	-0,73%	2,24%

## Валютный рынок

- Падение цен на нефть ниже 45 долларов за баррель марки «Brent» давит на рубль, однако, «деревянный» в пятницу довольно-таки стойко держался против доллара, уступив лишь 0,21%. При этом, рубль даже смог укрепится на 0,32% по отношению к евро. В итоге курс доллара составил 66,78 рублей за доллар. А курс евро – 71,77 рублей за евро.
- Евро в пятницу проложил снижение к доллару на слабой внутренней статистике и комментариях главы ЕЦБ Марио Драги о том, что регулятор готов пересмотреть параметры стимулирования экономики в декабре. Так, курс евро к доллару снизился на 0,6% и составил 1,072 доллара за евро. Индекс доллара в пятницу рос на 0,57% - до 99,12 пунктов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,19	-0,22%	-0,18%	18,82%
США 10-летние, %	2,24	-0,08	-0,10	0,07
США 30-летние, %	3,04	-0,05	-0,06	0,29
Россия 10-летние, %	9,94	0,12	0,14	-4,15
Россия 15-летние, %	9,74	0,01	0,01	-3,70

## Долговой рынок

- АФК «Система» разместила облигации серии 001P-02 на 1,7 млрд рублей. Ставка 1-8 купонов составит 10,9% годовых. Срок обращения – 10 лет.
- «МТС» выкупил по оферте 12,89 млн десятилетних облигаций серии 08, выплатив накопленный купонный доход на общую сумму 7,6 млн рублей.

## Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативный: фьючерсы на зарубежные индексы утром понедельника торгуются в «красной зоне». Стоит отметить, что наибольшее снижение демонстрирует фьючерс французского индекса CAC 40, что неудивительно, ввиду трагичных событий в Париже, произошедших в эти выходные. Площадки ATP утром также демонстрируют негативную динамику. Котировки «Brent» растут на 1%.

Открытие рынка ожидаем на уровнях закрытия пятницы. Индекс ММВБ в последний день прошедшей недели закрылся очередной «черной» свечой на уровне 1728,17 пунктов. Сильный уровень поддержки теперь находится в районе 1690-1700 пунктов, поэтому индекс в ближайшее время, с учетом негативной динамики цен на нефть, вполне может снизиться до этого уровня. Индекс РТС также «нарисовал» в пятницу «черную» свечу, закрывшись на 814,93 пунктах. В среднесрочной перспективе, тем не менее, сохраняется ростовой тренд, однако если индекс пробьет уровень поддержки в данном тренде в районе 800-810 пунктов, то возможно дальнейшее снижение индекса.

Сегодня внимание инвесторов, в отсутствии другой значимой информации, могут привлечь квартальные данные по ВВП Японии, а также индекс производственной активности NY Empire State в США. Также в эти дни в Турции проходит Саммит G20.

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.