

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2033,11	0,46%	0,90%	-1,25%
Dow Jones	17215,97	0,43%	0,77%	-3,41%
NASDAQ	4886,69	0,34%	1,16%	3,18%
S&P фьючерс	2020,80	-0,23%		

## Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6378,04	0,62%	-0,59%	-2,86%
DAX	10104,43	0,39%	0,08%	3,05%
CAC 40	4702,79	0,59%	0,03%	10,30%

## Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	47236,10	0,16%	-4,26%	-5,54%
Nikkei 225	18221,10	-0,39%	-1,18%	4,36%
Shangh Composite	3408,41	0,50%	3,58%	5,37%
Hang Seng	23021,73	-0,20%	1,13%	-2,47%

## Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
MMVB	1717,00	-0,86%	-0,66%	22,94%
PTC	881,19	0,57%	-0,54%	11,44%
MMVB-10	3934,86	-1,08%	-0,93%	29,44%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
РусГидро	0,64	6,21%	Уркалий-ао	175,35	-4,39%
ИнтерРАОа	1,18	3,32%	АЛРОСА ао	56,06	-3,28%
МосБиржа	85,90	2,82%	Магнит ао	11707,00	-3,00%
ТМК ао	53,70	2,50%	НЛМК ао	72,80	-2,80%
НМТП ао	2,86	1,78%	ВТБ ао	0,08	-2,71%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ



## Фондовый рынок

- Американские фондовые рынки закончили неделю небольшим ростом на фоне опубликованной внутренней статистики, которая оказалась неоднозначной. С одной стороны, индекс потребительских настроений Мичиганского университета, который отражает степень доверия домохозяйств к экономике страны, в октябре, по предварительным данным, увеличился с сентябрьских 87,2 пунктов до 92,1 пунктов, что превысило ожидания аналитиков (89 пунктов). Выше прогнозных 79 пунктов оказался и индекс ожиданий потребителей от Мичиганского университета, который, по предварительным данным, в октябре вырос до 82,7 пунктов с 78,2 пунктов сентября.
- С другой стороны, не оправдало ожиданий аналитиков количество открытых вакансий на рынке труда, которое в августе снизилось до 5,37 миллиона против пересмотренного в сторону понижения июльского показателя в 5,668 миллиона. Эксперты же ожидали 5,625 миллиона открытых вакансий. В добавок, были опубликованы финансовые показатели многоотраслевой корпорации General Electric за третий квартал. Прибыль на акцию за отчетный период составила 25 центов, что на 10 центов ниже показателя за тот же период прошлого года. Аналитики ожидали, что данный показатель будет равен 26 центам.
- Рынки Старого Света в пятницу также не продемонстрировали серьезной динамики, однако закрылись в «зеленой зоне» на ожиданиях, что ФРС США будет ужесточать монетарную политику только в 2016 году. Кроме того, участники торгов ожидают сохранения параметров текущей монетарной политики Европейского Центрального Банка и Банка Японии.
- Опубликованная внутренняя макростатистика ощутимого влияния на котировки оказать не смогла. Базовый уровень инфляции в еврозоне (без учета цен на продукты питания и энергию) в сентябре составил 0,9% в годовом выражении. Согласно общему индексу потребительских цен, в еврозоне в сентябре наблюдалась дефляция в 0,1% в годовом выражении и инфляция в 0,2% в месячном выражении. Стоит отметить, что все показатели по инфляции удовлетворили ожидания аналитиков.
- Отечественный фондовый рынок в пятницу вновь продемонстрировал разнонаправленную динамику в ожидании статистики по уровню ВВП Китая за третий квартал, которая выходит сегодня утром. Участники торгов в пятницу решили не рисковать и подождать пока обстановка более менее прояснится. В итоге, индекс ММВБ понизился на 0,86% и составил 1717 пунктов, а индекс РТС увеличился на 0,57% - до 881,19 пунктов.
- После закрытия пятничных торгов стало известно, что международное рейтинговое агентство Standard & Poor's сохранило долгосрочный суверенный рейтинг России в иностранной валюте на спекулятивном уровне «BB+» с негативным прогнозом. Другое международное агентство Fitch сохранило рейтинг России на инвестиционном уровне «BBB-» с негативным прогнозом.
- Поддержку рынку оказали котировки на нефть, которые большую часть торгов пятницы пребывали выше 50 долларов за баррель по марке «Brent». В то же время укрепление национальной валюты из-за роста цен на нефть, оказало давление на экспортеров, среди которых сильнее всех упали акции химических компаний: «Акрон» (-2,32%), «Уралкалий» (-4,39%), «Фосагро» (-1,68%).

- Стало известно, что MSCI исключит акции «Уралкалия» из индекса MSCI Russia с 21 октября. Решение было обосновано тем, что free float компании опустился ниже 15% с 23,35%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	50,26	0,20%	-5,19%	-12,65%
Light	47,55	0,23%	-5,03%	-11,47%
Алюминий	1564,50	-0,41%	-3,01%	-15,55%
Золото	1171,70	-0,54%	1,29%	-0,97%
Медь	5272,37	-1,01%	-1,26%	-15,38%
Никель	10495,00	-0,62%	-0,43%	-30,73%
Пшеница	488,00	-2,48%	-4,01%	-17,23%
Серебро	15,86	-1,15%	0,38%	1,12%

## Товарный рынок

- Цены на нефть в пятницу подросли выше 50 долларов за баррель марки «Brent», несмотря на то, что данные по запасам нефти в США за неделю должны были оказать давление на котировки. Поддержку нефти оказали данные от компании Baker Hughes, согласно которым количество буровых установок в Америке за предыдущую неделю снизилось с 605 до 595 штук. Кроме того, за прошедшую неделю добыча «черного золота» в США упала на 0,8%. Однако, в противовес этому, выросла добыча нефти картеля ОПЕК. На фоне всех приведенных данных котировки на нефть марки «Brent» продолжали колебаться на уровне 49-50 долларов за баррель.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	61,29	-0,19%	-0,96%	3,46%
EUR/RUB	69,59	-0,33%	-1,01%	-3,36%
Бивалютная корзина	65,56	-1,77%	0,37%	6,27%
EUR/USD	1,1359	-0,17%	-0,13%	-6,13%
GBP/USD	1,5439	-0,21%	0,70%	-0,94%
USD/JPY	119,42	0,27%	-0,61%	-0,28%

## Валютный рынок

- Национальная валюта в пятницу преимущественно сдавала позиции перед долларом и евро. Однако в итоге, благодаря дорожающей нефти, рубль смог немного укрепиться: на 0,19% к доллару и на 0,33% к евро. Курс доллара к рублю составил 61,29 рублей за доллар, а курс евро составил 69,59 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины снизилась на 1,77% - до 65,56 рублей.
- Доллар в пятницу демонстрировал рост по отношению к большинству мировых валют на данных статистики из США. Индекс доллара рос на 0,17% - до 94,6 пунктов. Курс доллара к евро также снизился на 0,17% и составил 1,135 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	123,52	0,49%	0,89%	17,24%
США 10-летние, %	2,04	0,02	-0,05	-0,14
США 30-летние, %	2,89	0,03	-0,04	0,14
Россия 10-летние, %	10,11	-0,26	-0,32	-3,98
Россия 15-летние, %	10,04	-0,26	-0,33	-3,40

## Долговой рынок

- Доходность российских 10- и 15-летних государственных облигаций снизилась на 0,26% в пятницу. Доходности американских государственных облигаций существенно не изменились. В целом, на долговом рынке серьезных событий в пятницу не происходило.

## Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно отрицательный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются преимущественно в «красной зоне», однако не демонстрируют ярко выраженной динамики. Котировки на нефть с утра также торгуются в незначительном минусе. Кроме того, начавшие выходить с утра данные по Китаю, оказались неоднозначными, что может оказать давление на мировые рынки в ходе сегодняшних торгов.

Открытие рынка сегодня ждем в районе уровней закрытия пятницы. Индекс ММВБ в пятницу, как и в четверг ранее, пытался пробить сильный уровень сопротивления в районе 1740 пунктов. Попытка снова оказалась неудачной, и в итоге индекс закрылся черной свечой на уровне в 1717 пунктов. Индекс РТС также не смог пробить уровень сопротивления в районе 890 пунктов, однако закрылся белой свечой на 881,19 пунктах. В целом факт того, что рынку в пятницу не удалось пробить сильное сопротивление, является умеренно-негативным сигналом, однако для подтверждения разворота вниз необходимо дождаться дополнительных сигналов.

Сегодня в центре внимания инвесторов находятся статданные из Китая, в частности данные по ВВП за 3 квартал, а также данные по объемам промышленного производства за сентябрь. Могут быть также интересны данные из России по уровню безработицы в сентябре.

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, лицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.