

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|-------------|------------|--------|----------|---------------|
| S&P 500 | 2030,77 | -0,14% | 1,35% | -1,37% |
| Dow Jones | 17217,11 | -0,08% | 0,79% | -3,40% |
| NASDAQ | 4880,97 | -0,50% | 1,76% | 3,06% |
| S&P фьючерс | 2028,90 | 0,41% | | |

Индексы фондовых рынков Европы

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|----------|------------|--------|----------|---------------|
| FTSE 100 | 6345,13 | -0,11% | 0,04% | -3,37% |
| DAX | 10147,68 | -0,16% | 1,14% | 3,49% |
| CAC 40 | 4673,81 | -0,64% | 0,66% | 9,62% |

Остальной мир

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|------------------|------------|--------|----------|---------------|
| Bovespa | 47076,55 | -0,78% | -0,60% | -5,86% |
| Nikkei 225 | 18494,54 | 1,58% | 3,17% | 5,92% |
| Shangh Composite | 3438,78 | 0,39% | 4,36% | 6,31% |
| Hang Seng | 22976,94 | -0,43% | 2,25% | -2,66% |

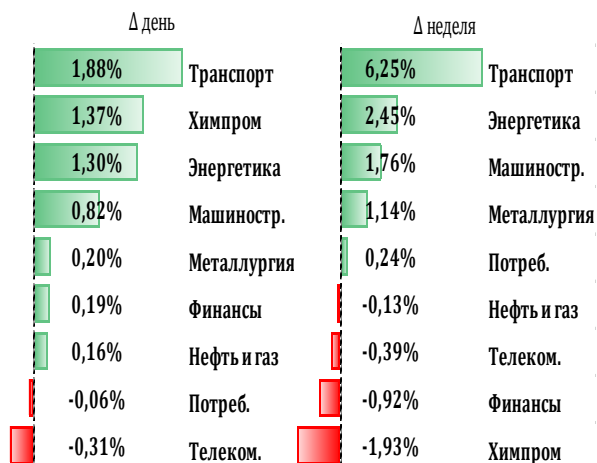
Россия

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|---------|------------|--------|----------|---------------|
| MMVB | 1722,62 | 0,38% | 0,11% | 23,34% |
| PTC | 875,55 | 0,79% | 1,04% | 10,73% |
| MMVB-10 | 3970,37 | 0,49% | 0,61% | 30,61% |

Лидеры роста/падения

| Лидеры | Цена закр. | Δ день | Аутсайдеры | Цена закр. | Δ день |
|------------|------------|--------|------------|------------|--------|
| РусГидро | 0,67 | 4,98% | Новатэк ао | 589,50 | -1,60% |
| ММК | 21,74 | 4,47% | МТС-ао | 214,25 | -1,54% |
| Уркалий-ао | 165,10 | 3,38% | АЛРОСА ао | 56,00 | -1,41% |
| МегаФон ао | 802,00 | 3,00% | Мостотрест | 76,00 | -1,20% |
| Аэрофлот | 49,31 | 2,49% | Мечел ао | 59,61 | -1,05% |

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Американские фондовые рынки торги минувшего вторника завершили в «красной зоне» на фоне не удовлетворивших ожидания финансовых отчетов местных компаний. Напомним, что в данный период в США проходит сезон публикации компаниями своих квартальных финансовых отчетов.
- Согласно отчету, чистая прибыль финансово-промышленного гиганта UTC по итогам третьего квартала упала на 18,7% - до 1,426 млрд долларов, а выручка снизилась на 5,6% - до 13,788 млрд долларов. Также, по итогам прошедшего квартала, сократились прибыль и выручка крупной финансовой компании BNY Mellon, на 25,2% и 20,8% в годовом выражении соответственно. С другой стороны, одна из крупнейших телекоммуникационных компаний Verizon Communications Inc. объявила о росте чистой прибыли на 9,9% по итогам третьего квартала - до 4,171 млрд долларов. Операционная выручка компании в том же периоде выросла на 5% - до 33,158 млрд долларов.
- Также вчера стали известны и некоторые внутренние статистические данные, которые в целом оказались лучше, чем ожидалось, что в свою очередь, подогрело ожидания повышения ключевой ставки в 2015 году. В частности, объем строительства новых домов в сентябре в США превысил ожидания аналитиков, которые рассчитывали на 1,14 млн новых домов. Фактически, количество новых домов в сентябре составило 1,206 млн, против пересмотренного показателя августа в 1,132 млн домов, то есть рынок нового жилья показал 6,5% роста в месячном выражении, тогда как аналитики ожидали роста всего на 1,9%.
- Рынки Старого Света вчера также закрылись в негативном направлении, продолжая отыгрывать опубликованную в начале недели статистику из Китая, которая вызвала опасения у инвесторов за перспективы роста второй экономики мира. Напомним, что согласно опубликованным данным, ВВП Китая в 3 квартале вырос на 6,9%, против прогнозных 6,8%, однако рост ВВП демонстрирует самые медленные темпы с 2009 года. Также не оправдали ожиданий данные по росту промышленного производства в сентябре (5,7% роста в годовом выражении, против ожидаемых 6% и августовских 6,1% роста).
- Кроме того, воздействие на местные рынки оказал факт того, что Европейский Центральный Банк вряд ли расширит программу количественного смягчения (QE) на предстоящем заседании, которое произойдет в четверг, ввиду того, что кредитные стандарты банков еврозоны заметно снизились, согласно квартальным кредитным данным ЕЦБ.
- Российский рынок акций вчера наоборот закрылся в «зеленой зоне». В ходе торгов наблюдалось в основном боковое движение, так как инвесторы предпочли пока подождать новостей с сегодняшней встречи ОПЕК и заседания ЕЦБ, которое, как говорилось ранее, пройдет в четверг. Новостной фон также не оказал серьезного давления на индексы. В итоге индекс ММВБ подрос на 0,38% и составил 1722,62 пункта, а индекс РТС увеличился на 0,79% - до 875,55 пунктов. Объемы торгов по бумагам из базы расчета индекса ММВБ вчера были незначительно выше объемов понедельника - 34,615 млрд рублей.
- Среди лидеров роста оказались акции «Русгидро» (4,98%), ММК (4,47%) и ценные бумаги Уралкалия, которые выросли на 3,38% после резкого падения ранее на фоне новости о том, что MSCI исключит акции компании из расчета индекса MSCI Russia из-за низкого показателя free-float.

- Вчера после закрытия торгов также стало известно, что акционер S7 Владислав Филев подписал соглашение о покупке 51% акций авиаперевозчика «Трансаэро», который находится на грани банкротства. Новый владелец попытается избежать банкротства перевозчика и «монополизации авиарынка». Посмотрим, к чему в итоге это приведет, пока делать какие-либо выводы рано.

Товарный рынок

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|----------|------------|--------|----------|---------------|
| Brent | 48,61 | -0,41% | -2,39% | -15,52% |
| Light | 46,04 | -0,88% | -2,62% | -14,28% |
| Алюминий | 1533,00 | -0,26% | -3,52% | -17,25% |
| Золото | 1178,10 | 0,82% | 0,51% | -0,43% |
| Медь | 5199,62 | 0,15% | -1,61% | -16,54% |
| Никель | 10395,00 | 0,92% | -0,67% | -31,39% |
| Пшеница | 491,40 | 1,28% | -5,24% | -16,66% |
| Серебро | 15,87 | 0,32% | -0,72% | 1,18% |

- Котировки на «черное золото» стабилизировались после «просадки» на негативных новостях с Востока в минувший понедельник, однако в течение торгов находились в районе минимумов за две недели на опасениях роста запасов в Америке. В итоге, эти опасения подтвердились: согласно данным Американского института нефти, за прошедшую неделю запасы сырой нефти выросли на 7,1 млн баррелей, хотя аналитики ожидали роста лишь на 3,5 млн баррелей. Однако данная новость не оказала существенного влияния на движение котировок. Скорее всего инвесторы сейчас находятся в ожидании новостей со встречи ОПЕК, поэтому серьезных движений не наблюдается.

Валютный рынок

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|--------------------|------------|--------|----------|---------------|
| USD/RUB | 62,12 | -0,24% | -1,47% | 4,87% |
| EUR/RUB | 70,49 | -0,01% | -1,88% | -2,11% |
| Бивалютная корзина | 66,35 | 1,12% | -0,32% | 7,54% |
| EUR/USD | 1,1360 | 0,24% | -0,22% | -6,12% |
| GBP/USD | 1,5444 | -0,22% | 1,03% | -0,91% |
| USD/JPY | 119,98 | 0,42% | 0,25% | 0,18% |

- На фоне колебаний котировок на «черное золото» национальная валюта демонстрирует неплохую устойчивость. Так, при ценах на нефть марки «Brent» в районе 48-49 долларов за баррель, рубль продолжает упорно укрепляться к доллару и евро. Рублю продолжает помогать налоговый период в стране. Курс доллара к рублю упал на 0,24% и составил 62,12 рублей за доллар, а курс евро снизился на 0,01% - до 70,49 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины выросла на 1,12% и составила 66,35.
- Евро вчера укрепился к доллару на ожидании отсрочки расширения программы количественного смягчения (QE) ЕЦБ. В итоге курс доллара к евро вырос на 0,24% и составил 1,136 доллара за евро. Индекс доллара снижался на 0,16% - до 94,76 пунктов.

Долговой рынок

| | Цена закр. | Δ день | Δ неделя | Δ с нач. года |
|---------------------|------------|--------|----------|---------------|
| Индекс ОФЗ | 123,66 | -0,11% | 1,39% | 17,37% |
| США 10-летние, % | 2,07 | 0,05 | 0,02 | -0,10 |
| США 30-летние, % | 2,92 | 0,04 | 0,03 | 0,17 |
| Россия 10-летние, % | 10,18 | 0,03 | -0,37 | -3,91 |
| Россия 15-летние, % | 10,14 | 0,05 | -0,34 | -3,30 |

- Держатели евробондов «Русского стандарта» на 550 млн долларов одобрили схему реструктуризации долга. Схема предполагает досрочную выплату держателям облигаций в размере 18% от номинала наличными плюс накопленные проценты и выпуск на оставшийся долг двух новых эмиссий евробондов (2020 и 2024 годы погашения), обеспеченных миноритарным пакетом акций банка «Русский Стандарт».
- Минфин в среду проведет аукционы по размещению ОФЗ-ПД (погашение в мае 2020 года) и ОФЗ-ПК (погашение в декабре 2017 года) общим объемом в 25 млрд рублей.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня позитивный: фьючерсы на западные индексы утром торгуются преимущественно в позитивном ключе. Индекс площадок Азиатско-Тихоокеанского региона с утра также в основном в «зеленой зоне». Котировки на «черное золото» продолжают колебаться в районе 48-49 долларов за баррель марки «Brent».

Открытие рынка сегодня ждем в районе закрытия вторника. Внешний фон на рынок пока давления не оказывает. Индекс ММВБ вчера закрылся белой свечой на уровне 1722,62 пунктов. Серьезных сигналов к развороту вниз по индексу пока не наблюдается. Индекс РТС также нарисовал вчера белую свечу, закрывшись на уровне 875,55,

продолжая демонстрировать боковую динамику. Пока четких сигналов к развороту также не видно. Рынок будет ждать новых драйверов, одними из которых могут стать новости касающиеся нефтяного рынка.

Сегодня большого объема важных статистических данных не ожидается, однако внимание могут привлечь новости с встречи ОПЕК, которые могут спровоцировать более внятные движения нефтяных котировок. Кроме того, будут опубликованы недельные данные по запасам сырой нефти от Информационного Агентства Энергетики США.

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.