

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1966,97	0,46%	0,71%	-4,47%
Dow Jones	16510,19	0,77%	0,85%	-7,37%
NASDAQ	4828,96	0,04%	0,48%	1,96%
S&P фьючерс	1958,80	-0,22%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6108,71	0,08%	0,40%	-6,97%
DAX	9948,51	0,33%	-1,81%	1,46%
CAC 40	4585,50	1,09%	1,49%	7,55%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46590,20	-1,43%	-1,46%	-6,83%
Nikkei 225	18070,21	-1,96%	-0,30%	3,49%
Shangh Composite	3177,02	0,65%	4,64%	-1,78%
Hang Seng	21913,70	0,72%	1,92%	-7,17%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1699,72	-0,65%	-1,74%	21,70%
РТС	808,78	-0,95%	0,02%	2,29%
ММВБ-10	3855,87	-1,15%	-0,32%	26,84%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Лутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ФСК ЕЭС ао	0,06	4,65%	СОЛЛЕРС	468,00	-5,00%
+МосЭнерго	0,82	3,47%	Башнефт ап	1460,00	-4,00%
Россети ао	0,44	3,33%	Э.ОНРоссия	2,80	-3,52%
КАМАЗ	35,90	2,57%	ЛУКОЙЛ	2331,10	-3,00%
СевСт-ао	732,90	2,20%	Татнефт Зап	179,40	-3,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
0,80%	Финансы	1,46%	Машиностр.
0,50%	Энергетика	-0,37%	Потреб.
0,42%	Потреб.	-0,61%	Энергетика
-0,09%	Телеком.	-0,63%	Телеком.
-0,18%	Химпром	-1,52%	Химпром
-0,21%	Металлургия	-1,65%	Транспорт
-0,95%	Машиностр.	-1,70%	Металлургия
-1,20%	Транспорт	-1,99%	Финансы
-1,40%	Нефть и газ	-2,38%	Нефть и газ

Фондовый рынок

- Американские рынки закончили первый день новой недели ростом в рамках коррекции и вопреки неопределенности и событиям прошлой недели, которые негативно были восприняты рынком в пятницу. Также рынок проигнорировал негативную макроэкономическую статистику, опубликованную вчера. Так данные по продажам жилья на вторичном рынке оказались ниже ожидаемых. Согласно отчету, показатель продаж за август неожиданно снизился с пересмотренных 5,58 млн до 5,31 млн, хотя эксперты ожидали уровень продаж в 5,5 млн. Таким образом объем продаж в августе в месячном выражении снизился на 4,8%, хотя ожидалось снижение всего лишь в 1,3%. Данное падение оказалось самым большим за последние 7 месяцев. Рост рынка связан вероятнее всего с укреплением секторов финансов, технологий и потребительских услуг. Кроме того, вероятно рынок, после некоторого раздумья, позитивно воспринял комментарии ФРС о том, что вероятно ставка все-таки будет поднята до конца 2015 года, что является неким сигналом о том, что в экономике США не все так плохо, как восприняли это инвесторы на первый взгляд прошлой неделе.
- Биржи Старого Света также вчера закрылись в зеленой зоне. По итогам сессии FTSE 100 вырос на 0,08% - до 6108,71 пунктов, DAX подрос на 0,33% и составил 9948,51 пункт, а CAC 40 подскочил на 1,09% до уровня 4685,50 пунктов. Рынок не отреагировал негативно на публикацию индекса цен производителей в Германии, который в августе составил в месячном выражении -0,5%, при ожидаемых -0,3% после предыдущего июльского нулевого значения. Акции немецкого автоконцерна Volkswagen вчера двигались против рынка и упали на 2,3% из-за новости из США о том, что управление охраны окружающей среды США может оштрафовать немецкую компанию на 18 миллиардов долларов из-за отключения на автомобилях программы по защите окружающей среды. Автопроизводителю придется отозвать около полумиллиона автомобилей из-за угрозы окружающей среде.
- Отечественный рынок акций вчера не поддержал положительных трендов с Запада и закрылся в красной зоне, следуя за динамикой нефтегазового сектора. Индексы ММВБ и РТС упали на 0,65% и 0,95% и составили 1699,72 и 808,78 пунктов соответственно. Дело в том, что акции сырьевых компаний вчера показали отрицательную динамику из-за возможного увеличения Налога на добычу полезных ископаемых (НДПИ) на нефть. Минфин на совещании у премьер-министра Дмитрия Медведева предложил в 2016 году в формуле расчёта НДПИ на нефть скорректировать коэффициент, который характеризует динамику цен на нефть в мире, рассчитывая его по фиксированному курсу доллара за 2014 году. Для рынка эта новость оказалась негативной, так как если НДПИ будет действительно пересчитан, то все ведущие экспортеры нефти потеряют девальвационные премии и станут еще менее привлекательными для инвестиций.
- Биржи Японии со вчерашнего дня и до среды будут закрыты из-за национального праздника. Азиатские площадки в данный момент торгуются положительно на фоне ожидания данных по срокам повышения базовой ставки ФРС США до 2015 года. Китайским рынкам также поддержка оказывается со стороны надежд на новые меры властей по поддержке экономики на фоне ее продолжающегося замедления и слабой внутренней статистики.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,41	1,19%	2,07%	-15,87%
Light	46,36	2,14%	3,92%	-13,68%
Алюминий	1611,50	-0,12%	-0,77%	-13,01%
Золото	1133,10	-0,33%	2,36%	-4,23%
Медь	5245,92	-0,02%	-1,53%	-15,80%
Никель	9800,00	0,41%	-1,41%	-35,31%
Пшеница	494,20	2,49%	-1,75%	-16,18%
Серебро	15,19	0,53%	5,63%	-3,19%

Товарный рынок

- Нефть марки Brent вчера подросла на 1,19% и теперь баррель «черного золота» стоит 48,41 доллара. Рост цен произошел на фоне публикации данных от нефтегазовой компании Baker Hughes о сокращении среднесуточной добычи нефти и числа работающих буровых установок в США. Общее число буровых установок по итогам завершившейся недели сократилось на 6 единиц (на 0,7%) и составило 842 единицы. В годовом выражении показатель снизился на 1089 единиц или на 56,3%. Это означает, что снижение цен на нефть заставляет компании корректировать свои планы по проектам и планы по добыче. По данным Минэнерго США добыча нефти в стране в августе сократилась до 9,1млн баррелей в день с пикового значения в 9,6млн в апреле. Минэнерго ожидает снижения показателя до 8,6 млн баррелей в день в середине 2016 года. Кроме того, росту цен на нефть способствует и ухудшение ситуации на Ближнем Востоке
- Золото наоборот дешевеет, на фоне неопределенности, которую снова внесли выступления различных членов ФРС, которые намекнули, что хотели бы увидеть повышение ставки до конца 2015 года.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	65,99	-0,77%	-2,23%	11,40%
EUR/RUB	73,98	-1,42%	-3,11%	2,74%
Бивалютная корзина	70,49	0,00%	-2,66%	14,25%
EUR/USD	1,1200	-1,03%	-1,05%	-7,45%
GBP/USD	1,5519	-0,12%	0,58%	-0,43%
USD/JPY	120,43	0,54%	0,32%	0,56%

Валютный рынок

- Курс рубля к доллару и евро вчера укрепился на 0,77% и 1,42% соответственно. По итогам торгов курс рубля к доллару остановился на отметке в 65,99 рублей за доллар, а курс к евро – 73,98 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины не изменилась и составила 70,49 рублей. Укрепление национальной валюты связано с ростом цен на нефть, а также с ожиданием пика налоговых выплат, что активизирует продажу валюты экспортерами.
- Вчера евро потеряло 1,03% к доллару и теперь за евро придется отдать 1,12 доллара.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	118,54	0,51%	1,47%	12,51%
США 10-летние, %	2,20	0,06	0,02	0,03
США 30-летние, %	3,02	0,08	0,06	0,27
Россия 10-летние, %	11,28	-0,10	-0,31	-2,81
Россия 15-летние, %	11,01	-0,17	-0,42	-2,43

Долговой рынок

- После победы Алексиса Ципраса и его партии СИРИЗА на вторых за последние 8 месяцев парламентских выборах в Греции, греческие двухлетние государственные облигации укрепились. 10-летние облигации продолжили рост последних 4 недель, а доходность упала до минимума в 2015 году.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно позитивен: западные фьючерсы на индексы торгуются преимущественно в зеленой зоне, хотя и без особой динамики. Азиатский рынок также показывает в целом позитивную динамику. Однако ложку дегтя вносят цены на нефть, которые, после роста накануне, сегодня с утра двигаются вниз на фоне опасений о сохранении переизбытка «черного золота» в мире.

Сегодня возможно углубление коррекции вниз по индексу РТС, этому способствует очередное выступление представителя ФРС (Д. Локхарта) за ужесточение денежной политики до конца года, что усиливает неопределенность на рынках. Индекс ММВБ вчера закрылся второй подряд черной свечой на уровне 1699 пунктов. Скорее всего ММВБ продолжит двигаться в боковом тренде в коридоре от 1735 до 1680 пунктов. Индекс РТС также показал третью подряд черную свечу, так что можно говорить о возможности дальнейшего снижения к уровню 800 пунктов. Однако сильное движение на рынке возможно лишь если РТС пробьет коридор 800-850 пунктов.

Сегодня ожидается публикация данных по недельным запасам сырой нефти от Американского института нефти, а также публикация индекса промышленных заказов в Великобритании.

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.

