

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1942,74	-1,23%	-1,79%	-5,64%
Dow Jones	16330,47	-1,09%	-1,62%	-8,37%
NASDAQ	4756,72	-1,50%	-2,14%	0,44%
S&P фьючерс	1914,90	-0,89%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5935,84	-2,83%	-3,29%	-9,60%
DAX	9570,66	-3,80%	-6,06%	-2,40%
CAC 40	4428,51	-3,42%	-3,08%	3,87%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46264,61	-0,70%	-2,32%	-7,48%
Nikkei 225	18070,21	-1,96%	-0,56%	3,49%
Shangh Composite	3116,90	-2,16%	3,57%	-3,64%
Hang Seng	21146,31	-2,98%	-2,43%	-10,42%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
MMBB	1664,25	-2,09%	-3,03%	19,16%
PTC	789,56	-2,38%	-2,22%	-0,15%
MMBB-10	3768,49	-2,27%	-2,24%	23,97%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ЧеркизГ-ао	900,00	2,00%	Yandex clA	775,00	-6,00%
Система ао	18,64	1,58%	СОЛЛЕРС	443,00	-5,00%
Polymetal	553,00	1,20%	ЛУКОЙЛ	2225,90	-4,50%
ЛСР ао	547,00	1,00%	Татнефт Зап	171,30	-4,50%
ДИКСИ ао	307,00	0,30%	НЛМК ао	77,43	-3,87%

Отраслевая динамика индекса ММБВ

Δ день	Отрасль	Δ неделя	Отрасль
-0,44%	Телеком.	-0,04%	Телеком.
-0,48%	Потреб.	-0,22%	Потреб.
-0,84%	Финансы	-1,05%	Машиностр.
-1,11%	Химпром	-1,22%	Химпром
-1,72%	Машиностр.	-1,69%	Энергетика
-1,88%	Энергетика	-1,90%	Финансы
-1,97%	Металлургия	-2,92%	Транспорт
-1,98%	Транспорт	-3,09%	Металлургия
-2,14%	Нефть и газ	-3,40%	Нефть и газ

Фондовый рынок

- Рынки Нового Света закончили торги вторника снижением в районе 1% на фоне падения котировок на акции сырьевых компаний, ослабления биотехнологического сектора и скандала вокруг крупного автоконцерна Volkswagen. Давление на рынки оказало также падение цен на медь, которые достигли трехнедельного минимума. Негативная динамика в сырьевом секторе вызвана опасениями, касающихся состояния экономики Китая, являющегося крупнейшим потребителем сырьевых товаров. Именно на Китай приходится 40% мирового спроса на промышленный металл. В августе объем импорта в Поднебесную вырос на 12%, однако при этом суммарный объем за первые 8 месяцев оказался на 7% ниже, чем за аналогичный период 2014 года. Инвесторы ожидают сегодняшней публикации предварительной оценки индекса деловой активности в промышленности КНР за сентябрь. Таким образом, мировые аналитики считают, что волатильность на американских рынках сохранится до прояснения ситуации с экономикой Китая и с дальнейшими действиями ФРС США.
- Европейские рынки рухнули вчера еще сильнее, обновив локальные минимумы: FTSE 100 упал на 2,83% и составил 5935,84 пунктов, DAX опустился почти на 4% - до 9570,66 пунктов, а CAC 40 снизился на 3,42% до 4428,51 пунктов. На падение рынка оказал влияние развернувшийся скандал вокруг немецкого автоконцерна Volkswagen, что привело к столь серьезному снижению немецкого индекса DAX. Напомним, что США может наложить внушительный штраф на автопроизводителя и уже обязало отозвать 482 тысячи автомобилей марок Volkswagen и Audi. Причиной для разбирательства стали махинации немецкой компании при порождении проверок на выброс CO2 - компания занижала реальные показатели. Штраф может составить 18 миллиардов долларов. Сам Volkswagen сообщил, что неисправным программным обеспечением могут быть снабжены около 11 миллионов автомобилей концерна.
- Российский рынок акций также закрылся в красной зоне потеряв в среднем 2% и обновив локальные минимумы. Индексы ММБВ и РТС упали на 2,09% и 2,38% и составили 1664,25 пунктов (обновил минимум с 26 августа) и 789,56 пунктов соответственно (обновил минимум с 8 сентября). Рынок продолжает отыгрывать новость о том, что в 2016 году может быть повышен НДС на нефть, что крайне негативно было воспринято сырьевыми экспортерами. Владимир Путин поручил правительству РФ проработать вопрос о том, чтобы направить в бюджет дополнительные доходы экспортёров от девальвации. Ранее Минфин предложил не только повысить НДС на нефть, но и не снижать экспортную пошлину как было предусмотрено налоговым маневром. Дальнейшее обсуждение касательно возможных реформ в области налогообложения нефтяных компаний будет продолжено на следующей неделе. На этих новостях акции нефте- и газодобывающих компаний упали: «ЛУКОЙЛ» потерял около 4,5%, привилегированные бумаги «Татнефти» снизились на 4,5%, обыкновенные на 3%. Акции «Роснефти» и «Газпрома» упали на 1,7% и на 2,2% соответственно.
- Из корпоративных новостей можно отметить то, что «Мечел» и ВТБ заключили мировое соглашение по иску банка взыскании с компании 2,7 миллиарда рублей, но в соглашении прописано отлагательное условие. Следующее слушание арбитражного суда Москвы назначено на 18 ноября. Однако обыкновенные акции «Мечела» вчера упали на 3,6%, а привилегированные снизились на 3,2%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,79	0,78%	1,92%	-15,21%
Light	46,23	-0,28%	1,92%	-13,93%
Алюминий	1583,00	-1,77%	-1,98%	-14,55%
Золото	1123,80	-0,82%	1,77%	-5,02%
Медь	5061,83	-3,51%	-5,12%	-18,75%
Никель	9690,00	-1,12%	-2,81%	-36,04%
Пшеница	497,00	0,57%	1,10%	-15,71%
Серебро	14,72	-3,06%	2,69%	-6,15%

Товарный рынок

- В течении вчерашних торгов нефть марки «Brent» дешевела и опускалась ниже 48 долларов за баррель на фоне опасений о сохранении больших запасов в США. Кроме того, участники торгов обратили внимание на сообщение Азиатского банка развития, который понизил прогноз по ВВП Китая на 2015 год с 7,2% до 6,8%. Однако затем публикация данных от Американского института нефти немного повысила цены на «черное золото» до 48,79 долларов за баррель. Дело в том, что согласно отчету за прошедшую неделю запасы нефти упали на 3,7 миллиона, хотя ожидалось снижение на 0,7 миллиона.
- Медь, как уже было сказано ранее, достигла трехнедельного минимума, потеряв 3,5%.
- Золото также вчера подешевело на 0,82% на укреплении доллара.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	66,02	0,05%	-1,02%	11,46%
EUR/RUB	73,49	-0,67%	-2,26%	2,05%
Бивалютная корзина	70,07	-0,01%	-2,05%	13,57%
EUR/USD	1,1132	-0,61%	-1,43%	-8,01%
GBP/USD	1,5348	-1,10%	-0,01%	-1,53%
USD/JPY	119,82	-0,51%	-0,33%	0,05%

Валютный рынок

- Курс рубля в первой половине торговой сессии вторника снижался на фоне дешевающей нефти. Кроме того, пик налогового периода прошел и следующие выплаты состоятся лишь 25 сентября, поэтому сейчас с этой стороны серьезной поддержки рублю не оказывается, хотя спрос на рубли сохраняется и ставка MosPrime overnight вчера выросла до максимума за последние недели в 11,81% годовых.
- В итоге в конце торгов курс рубля к доллару вырос на 0,05% и составил 66,02 рубля за доллар. Курс евро составил 73,49 рубля за евро (снизился на 0,67%). Стоимость бивалютной корзины почти не изменилась и составила 70,07 рублей.
- Курс евро к доллару упал на 0,61% и теперь за 1 евро придется отдать 1,11 доллара.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	118,73	0,16%	1,20%	12,69%
США 10-летние, %	2,13	-0,07	-0,13	-0,04
США 30-летние, %	2,94	-0,07	-0,11	0,19
Россия 10-летние, %	11,34	0,06	-0,10	-2,75
Россия 15-летние, %	11,08	0,07	-0,29	-2,36

Долговой рынок

- Правительство Украины предложило реструктуризацию своих облигаций на 3 миллиарда долларов со сроком погашения в 2015 году, выкупленных у России. Держатели долговых бумаг приглашены на собрание в Лондон, которое состоится 14 октября.
- Стало известно, что «Бинбанк» 24 сентября соберет заявки на 8 дополнительных выпусков облигаций общей суммой на 16 млрд. рублей.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативный: западные фьючерсы на индексы торгуются с отрицательной динамикой. Индексы Азиатско-Тихоокеанского Региона также демонстрируют движение в негативном направлении, после того как были опубликованы разочаровывающие предварительные данные по индексу деловой активности в производственном секторе Китая за сентябрь. Данные подогрели опасения инвесторов за состоянием экономики Поднебесной. Кроме того, негативные новости из Китая привели к началу снижения цен на нефть сегодня утром. Однако снижение ограничено позитивными новостями накануне о снижении недельных запасов в США.

Индекс ММВБ вчера закрылся очередной длинной черной свечой на уровне 1664,25 пунктов, подтвердив, тем самым, наметившийся разворот вниз. Ближайшим уровнем поддержки индексу будет служить теперь уровень 1650 пунктов, если индекс пробьет и его, то рынок получит очередной сильный «медвежий сигнал». В случае, если снижение рынка продолжится, падение может усилиться до района 1570-1600 пунктов. РТС вчера также закрылся очередной черной свечой на уровне 789,56 пунктов. Скорее всего индекс, пробив накануне уровень 800 пунктов, может продолжить движение вниз на фоне слабых внешних сигналов. Открытие ожидаем в районе 1660 пунктов по ММВБ.

Сегодня ожидается публикация данных по недельным запасам сырой нефти в США от агентства EIA. Кроме

того, ожидается публикация ряда индексов деловой активности в промышленности Франции и Германии, индексы деловой активности в промышленности Еврозоны и США. Данная статистика может оказать серьезное влияние на ход торгов сегодня.

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.