

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2089,17	0,38%	3,27%	1,47%
Dow Jones	17823,81	0,51%	3,35%	0,00%
NASDAQ	5104,92	0,62%	3,59%	7,79%
S&P фьючерс	2088,10	-0,03%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6334,63	0,07%	3,54%	-3,53%
DAX	11119,83	0,31%	3,84%	13,40%
CAC 40	4910,97	-0,08%	2,14%	15,18%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	48138,89	1,48%	3,49%	-3,74%
Nikkei 225	19879,81	0,10%	2,52%	13,86%
Shangh Composite	3644,70	0,39%	2,31%	12,68%
Hang Seng	22748,63	-0,03%	3,26%	-3,63%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1826,72	0,86%	5,70%	30,80%
РТС	888,36	0,51%	9,01%	12,35%
ММВБ-10	4122,95	0,28%	3,10%	35,63%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Трансф ап	165000,00	5,00%	ИнтерРАОао	1,21	-3,45%
ПИКао	225,10	3,20%	Сургнифгз-п	42,00	-2,24%
Магнит ао	11819,00	3,00%	Polymetal	549,00	-2,10%
НМТП ао	3,55	2,75%	БСП ао	39,85	-2,09%
Аэрофлот	57,86	2,50%	Сургнифгз	34,91	-1,15%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
3,13%	Транспорт	9,66%	Телеком.
1,47%	Телеком.	9,30%	Транспорт
0,77%	Потреб.	7,42%	Финансы
0,66%	Нефть и газ	4,74%	Нефть и газ
0,65%	Финансы	3,27%	Энергетика
0,37%	Машиностр.	2,94%	Машиностр.
0,16%	Химпром	2,91%	Химпром
-0,14%	Энергетика	2,08%	Потреб.
-0,28%	Металлургия	0,54%	Металлургия

Фондовый рынок

- В последний день минувшей недели Американские рынки продемонстрировали рост на 0,38-0,62% в отсутствие значимой макростатистики. Отметим, что вероятность повышения ключевой ставки ФРС США в декабре текущего года, по мнению большинства аналитиков, составляет уже около 70%. При этом фондовые рынки продолжили расти, а индекс широкого рынка S&P 500 продемонстрировал лучшую неделю в 2015 году (+3,3%).
- Инвесторы похоже свыклись с тем, что ключевая ставка все-таки будет поднята в конце этого года, и теперь фондовые рынки не реагируют на подобные перспективы негативными движениями, как это было ранее. Успокаивает игроков рынка факт того, что, по мнению большинства членов ФРС, экономика США достаточно окрепла для новых действий регулятора, а также, что повышение ставки будет производиться постепенно, при тщательной оценке ситуации в экономике.
- Позитива на рынки принесли корпоративные новости. В частности, «Nike» продемонстрировала рост почти на 5% после того, как представители всемирно известной компании сообщили об увеличении дивидендов на 14% и планах по выкупу акций на 12 млрд долларов. Также о повышении дивидендов объявила компания «PepsiCo». Прибыль за третий квартал таких компаний, как «Autodesk» и «Abercrombie & Fitch» превысила ожидания аналитиков.
- Рынки Старого Света закрылись разнонаправленно, преимущественно ростом. Инвесторы, после позитивной недели, решили зафиксировать прибыль, что оказало небольшое давление на рынки. Протоколы октябрьского заседания ФРС США добавили позитива на рынки, немного ослабив беспокойство касательно глобального экономического роста.
- Кроме того, глава ЕЦБ Марио Драги заявил, что в декабре регулятор пересмотрит параметры программы стимулирования и сделает все возможное для стимулирования роста экономики Европы. Инвесторы ожидают, что программа количественного смягчения QE будет расширена с целью роста инфляции в Еврозоне к целевым уровням в 2% годовых.
- Немного негатива на рынки добавили внутренние статистические данные. Индекс цен производителей (PPI) в октябре составил -0,4% в месячном выражении, тогда как аналитики ожидали -0,2%. Показатель является опережающим индикатором потребительской инфляции и находится в «отрицательной» зоне уже третий месяц подряд.
- Российский рынок акций в пятницу снова закрылся ростом на фоне роста нефтяных котировок и оптимизме инвесторов, который царил на мировых рынках на протяжении большей части недели. В итоге, индекс ММВБ вырос на 0,86% и составил 1826,72 пункта, а РТС прибавил 0,51% и закрылся на уровне 888,36 пунктов. Объем торгов по бумагам из базы расчета индекса ММВБ снизился и составил 34,54 млрд рублей.
- Акции «Дикси», одного из крупнейших ритейлеров страны, выросли на 0,51% несмотря на то, что компания продемонстрировала отрицательные результаты по итогам третьего квартала 2015 года по МСФО.
- Акции «Сбербанка» продолжили рост, прибавив по итогам пятницы 2,32% по обыкновенным акциям и 0,97% по привилегированным. Сбербанк за первые три квартала 2015 года получил 178,35 млрд рублей прибыли, что составляет

около трети всей прибыли банковского сектора за этот же период (605,94 млрд рублей).

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	44,18	-0,25%	-1,78%	-23,22%
Light	41,10	-1,98%	-2,97%	-23,48%
Алюминий	1442,00	-1,90%	-3,29%	-22,16%
Золото	1070,20	-1,18%	-2,03%	-9,55%
Медь	4436,82	-3,15%	-6,79%	-28,79%
Никель	8335,00	-6,08%	-11,80%	-44,98%
Пшеница	491,20	-0,16%	-0,57%	-16,69%
Серебро	14,00	-1,55%	-2,30%	-10,74%

- Мировые цены на нефть в пятницу немного выросли на фоне публикации данных от компании Baker Hughes, согласно которым, количество нефтяных буровых установок на территории США по итогам прошедшей недели снизилось на 10 штук, или на 1,74%. Сейчас в США действует 564 нефтяных буровых установок. Котировки нефти марки «Brent» на данных новостях росли выше 45 долларов за баррель.
- Цены на золото, наоборот, демонстрировали негативную динамику. Инвесторы оценивали факторы скоро повышения ключевой ставки ФРС США.
- Также упали цены на такие металлы, как медь, алюминий, никель. При этом никель подешевел до уровней 2003 года

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	64,75	0,20%	-3,04%	9,31%
EUR/RUB	68,94	-0,60%	-3,95%	-4,27%
Бивалютная корзина	67,13	0,00%	-3,03%	8,80%
EUR/USD	1,0614	-0,97%	-1,03%	-12,29%
GBP/USD	1,5170	-0,77%	-0,28%	-2,67%
USD/JPY	123,16	0,21%	0,59%	2,84%

- Рубль, по итогам пятницы укреплялся к единой валюте и терял к доллару в преддверии пика налогового периода. К евро рубль укрепился на 0,6% - до 68,94 рублей за евро. На евро также давление оказали слова Марио Драги о грядущем расширении программы стимулирования экономики Еврозоны. К доллару рубль ослаб на 0,2% и составил 64,75 рублей за доллар.
- Единая валюта, на комментариях главы ЕЦБ, дешевела к доллару на 0,97%. Курс евро к доллару составлял 1,0614 долларов за евро. Индекс доллара рос на 0,39% - до 99,38 пунктов.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	126,91	0,63%	1,37%	20,45%
США 10-летние, %	2,26	0,01	0,02	0,09
США 30-летние, %	3,02	0,01	-0,01	0,27
Россия 10-летние, %	9,59	0,06	-0,35	-4,50
Россия 15-летние, %	9,40	0,02	-0,34	-4,04

- «Полус Золото» планирует разместить облигации на 5-10 млрд рублей. Срок обращения бумаг составит 5 лет. Ориентир ставки 1 купона – 11,65-11,95% годовых, а доходность к погашению – 11,99-12,31% годовых.
- «Ютэйр-Финанс» допустил дефолт по выплате 12 купона по облигациям серий БО-09 и БО-10 на сумму 48,615 млн рублей по каждому из выпусков.

Взгляд на рынок

Внешний фон этим утром нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются в основном в «зеленой зоне», однако ярко-выраженной динамики не демонстрируют. Площадки Азиатско-Тихоокеанского региона преимущественно «в плюсе» на фоне пятничного оптимизма на мировых рынках, при этом биржи Японии сегодня закрыты из-за праздника. Котировки нефти с утра торгуются в негативном направлении ниже 44 долларов за баррель.

Открытие рынка сегодня ожидаем в нейтральном ключе. Индекс ММВБ в пятницу закрылся неплохой «белой» свечой на уровне 1826,72 пунктов. При этом в первой половине торгов индекс протестировали уровень поддержки в районе 1800 пунктов и отскочил от него. Если индекс сумеет удержаться выше 1800 пунктов – это будет хорошим сигналом к продолжению роста, а ближайший уровень сопротивления расположится в районе 1830-1840 пунктов. Индекс РТС также закрылся «белой» свечой на уровне 888,36 пунктов. Индекс продолжал тестировать сопротивление в районе 890-900 пунктов, однако удачей это не завершилось. Если индексу удастся пробить сопротивление и закрепится выше 890-900 пунктов, то возможен дальнейший рост в район 920-940 пунктов. В целом, несмотря на позитивную картину на фондовом рынке, фундамент для роста ослабевает. Для продолжения позитивной динамики необходима поддержка со стороны такого драйвера, как мировые цены на нефть, которые пока что выглядят слабовато.

Сегодня ожидаются данные по деловой активности в Еврозоне за ноябрь, кроме того, будет опубликована статистика по продажам на вторичном рынке жилья в США. Кроме того, финансовые результаты сегодня раскроют такие Российские компании, как «Уралкалий», «Газпром нефть» и «Русарго».

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.