

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1970,89	-3,19%	-5,77%	-4,27%
Dow Jones	16459,75	-3,12%	-5,82%	-7,65%
NASDAQ	4706,04	-3,52%	-6,78%	-0,63%
S&P фьючерс	1915,80	-2,82%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6187,65	-2,83%	-5,54%	-5,76%
DAX	10124,52	-2,95%	-7,83%	3,25%
CAC 40	4630,99	-3,19%	-6,57%	8,62%

Остальной мир

Bovespa	45719,64	-1,99%	-3,77%	-8,57%
Nikkei 225	18663,82	-3,97%	-9,24%	6,89%
Shangh Composite	3211,20	-8,45%	-18,92%	-0,73%
Hang Seng	21357,57	-4,69%	-10,09%	-9,52%

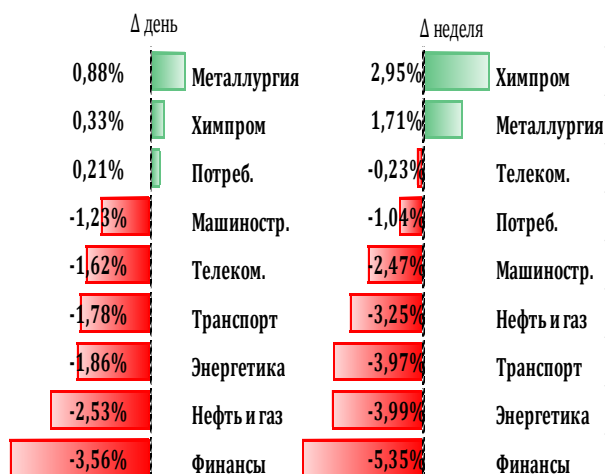
Россия

ММВБ	1663,31	-1,90%	-2,87%	19,10%
РТС	762,38	-4,16%	-8,72%	-3,58%
ММВБ-10	3718,35	-1,45%	-3,37%	22,32%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Polymetal	524,50	6,10%	Система ао	19,12	-6,18%
ПолюсЗолот	2315,00	2,90%	Татнефт 3ао	293,60	-4,98%
ЧеркизГ-ао	891,00	2,00%	ИнтерРАОао	1,05	-4,93%
Акрон	2852,00	1,00%	Новатэк ао	564,00	-3,80%
ФосАгро ао	2954,00	1,00%	МосБиржа	71,80	-3,65%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Американские фондовые индексы завершили торги в пятницу мощным падением на фоне сообщений о сокращении темпов роста фондового рынка Китая. Индекс DJIA упал на 3,1%, индекс S&P 500 рухнул на 3,1%, индекс NASDAQ потерял 3,5%. Падение индекса широкого рынка S&P 500 за неделю составило 5,8%, что является худшим показателем с 2011 года. На прошлой неделе Китай шокировал рынки девальвацией своей валюты на более чем 4%. Данный шаг был направлен на стимуляцию экономического роста страны, но многие наблюдатели рынка опасаются, что он сигнализировал о более выраженном спаде в экономике, который на данный момент продолжается. По итогам торгов пятницы, индекс Шанхайской фондовой биржи Shanghai Composite упал на 4,3%.
- Опасения инвесторов вызвала статистика из Китая. Предварительный показатель индекса деловой активности PMI в промышленном секторе экономики КНР в августе снизился до минимального за 6,5 лет уровня в 47,1 пункта. Предварительные данные оказались заметно ниже ожиданий аналитиков, которые прогнозировали PMI на уровне 47,7 пункта. Инвесторы и аналитики также опасаются отсрочки повышения процентной ставки ФРС США на фоне замедления китайской экономики. Индекс волатильности VIX Чикагской биржи за пятницу подскочил на 47%, а за неделю — почти на 120%. Это является рекордным недельным ростом индикатора в процентном выражении.
- Основные фондовые индексы Европы закрыли торги последнего рабочего дня недели в значительном минусе вслед за биржами Азиатско-Тихоокеанского региона на статистике из Китая, вызвавшей сомнения среди инвесторов относительно состояния мировой экономики. Британский индекс FTSE 100 опустился на 2,83%, немецкий DAX 30 - на 2,95, французский CAC 40 - на 3,19%. Греческий композитный индекс Athens по итогам торгов потерял 2,49%. За прошедшую неделю индекс FTSE 100 снизился почти на 6%, DAX 30 упала более чем на 8%, а CAC 40 - потерял почти 7%.
- Негативному настроению европейских инвесторов также способствовала китайская статистика по индексу деловой активности PMI в промышленном секторе, который оказался значительно ниже ожиданий аналитиков. Статистика вызвала опасения инвесторов относительно состояния мировой экономики. Опубликованные на этом фоне вполне позитивные данные по промышленным индексам PMI Германии и Еврзоны остались без внимания. Индекс деловой активности в производственном секторе Германии составил 53,2 против прогнозов в 51,7. Индекс деловой активности в производственном секторе Еврзоны составил 52,4 против ожиданий в 52,2.
- Российский рынок акций в пятницу упал по основным индексам на фоне дешевой нефти марки Brent и вслед за мировыми фондовыми площадками. Индекс ММВБ к закрытию упал на 1,9%, а индекс РТС обвалился на 4,16%. В числе немногих лидеров роста на рынке РФ особенно отличились Polyus Gold и Polymetal, акции которых выросли более чем на 6% на фоне роста цены золота. На этом же фоне выросли котировки "Полюс Золота" и "Лензолота". Также среди лидеров роста - акции "Черкизова", ВСМПО-АВИСМА, "Акрона", ММК, "Фосагро", "М.Видео". Среди лидеров снижения - акции АФК "Система", обыкновенные акции "Татнефти", "Интер РАО", НОВАТЭКа, "Аптечной сети 36 и 6", Московской биржи, "Сургутнефтегаза", "Мечела" и Сбербанк. Среди отраслевых индексов наибольшее падение показали компании финансового сектора.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	44,57	-3,36%	-8,35%	-22,54%
Light	39,49	-3,38%	-7,17%	-26,48%
Алюминий	1531,50	-2,64%	-2,76%	-17,33%
Золото	1158,70	-0,40%	3,86%	-2,07%
Медь	4942,78	-3,05%	-3,74%	-20,67%
Никель	9735,00	-5,85%	-8,12%	-35,74%
Пшеница	494,60	-2,83%	-3,10%	-16,11%
Серебро	15,10	-2,93%	-0,69%	-3,73%

Товарный рынок

- Мировые цены на нефть резко упали в пятницу, пробив впервые с февраля 2009 года психологическую отметку в 40 долларов за баррель по марке WTI на фоне статистики из Китая. Стоимость октябрьских фьючерсов на легкую нефть WTI падала на 3,19%, до 40 долларов за баррель. Цена октябрьских фьючерсов на североморскую смесь Brent опускалась на 3,08% - до 45,2 доллара за баррель. В понедельник утром стоимость нефти Brent опускалась на 2,09% - до 44,51 доллара за баррель.
- Золото дорожает в пятницу на фоне слабых статистических данных из Китая и сомнений инвесторов относительно возможности повышения базовой ставки в США в сентябре. Декабрьский фьючерс на золото рос на 0,36% - до 1157,4 доллара за тройскую унцию.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	69,11	1,69%	6,32%	16,67%
EUR/RUB	78,64	2,95%	8,95%	9,21%
Бивалютная корзина	72,40	0,02%	5,46%	17,34%
EUR/USD	1,1455	1,58%	3,35%	-5,34%
GBP/USD	1,5682	-0,04%	0,25%	0,62%
USD/JPY	121,02	-1,61%	-2,71%	1,05%

Валютный рынок

- Доллар в пятницу находился в минусе по отношению к мировым валютам на опасениях инвесторов, что первое с декабря 2008 года повышение процентной ставки будет отложено ФРС США на более поздний срок. Индекс доллара опускался на 0,58%. Курс евро к доллару рос до 1,1317 доллара. Курс доллара к иене снижался до 122,43 иены за доллар.
- Курс рубля в течение торгов пятницы торговался в ощутимом минусе. Основное давление на рубль продолжило исходить от нефтяных котировок. Стоимость нефти приблизилась к 45 долларам за баррель сорта Brent, обновляя многолетние минимумы и задавая тренд к падению рубля. Курс доллара рос до 68,76 рубля, курс евро - до 78,17 рубля. Доллар практически достиг первых целей роста в районе отметки 70 рублей, однако с такой динамикой девальвация может продолжиться и доллар вполне может подняться значительно выше этой отметки.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	116,37	-0,91%	-2,30%	10,45%
США 10-летние, %	2,00	-0,06	-0,19	-0,17
США 30-летние, %	2,70	-0,04	-0,13	-0,05
Россия 10-летние, %	11,95	0,43	0,82	-2,14
Россия 15-летние, %	11,78	0,41	0,75	-1,66

Долговой рынок

- Минфин России предлагает юридическим и физическим лицам обменять облигации федерального займа с амортизацией долга на портфель из пяти облигаций федерального займа с постоянным купонным доходом.
- Группа компаний "ПИК" успешно разместила облигации трех серий на 15 миллиардов рублей. Группа компаний "ПИК" успешно разместила облигации трех серий на 15 миллиардов рублей. Количество размещаемых облигаций трех выпусков составило 15 миллионов штук, срок обращения - 10 лет. Ставка купона на первые три года обращения установлена в размере 14,25%.

Взгляд на рынок

Внешний фон за выходные стал только хуже: опасения мировых инвесторов за экономику Китая продолжают давить на мировые финансовые рынки и сегодня утром обвал продолжился. Китайский рынок с утра теряет больше 8%, Япония падает на 4%, Гонконг теряет больше 5%. Фьючерсы на западные индексы также торгуются в очень большом минусе – Германия в минусе на 3%, Франция падает больше чем на 6%, чуть лучше себя чувствуют Великобритания и США, где падение составляет «всего лишь» около 2,5%. На фоне продолжающегося падения цен на нефть, стоит ожидать негативного открытия торгов в России.

Индекс ММВБ закрылся солидной черной свечой и несмотря на отскок четверга, инициатива на рынке вновь перешла на сторону «медведей». Техническая картина по индексу ММВБ явно остается негативной и ситуация с каждым днем лишь ухудшается – ближайшими целями падения может стать диапазон 1620-1630 пунктов и есть вероятность, что он будет протестирован уже сегодня. Индекс РТС также продолжил свое падение, закрывшись очередной черной свечой – ближайшими целями падения может стать диапазон 720-740 пунктов.

Важных событий и публикаций сегодня не будет, однако стоит внимательно следить за динамикой иностранных фондовых рынков, где сейчас царит крайне пессимистичное настроение инвесторов.

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