

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1893,21	-3,94%	-9,95%	-8,05%
Dow Jones	15871,35	-3,57%	-9,54%	-10,95%
NASDAQ	4582,78	-2,62%	-10,00%	-3,24%
S&P фьючерс	1914,00	2,29%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	5898,87	-4,67%	-9,95%	-10,16%
DAX	9648,43	-4,70%	-11,81%	-1,60%
CAC 40	4383,46	-5,35%	-12,06%	2,81%

Остальной мир

Bovespa	44336,47	-3,03%	-6,10%	-11,34%
Nikkei 225	18668,43	0,69%	-9,37%	6,92%
Shanghai Composite	3071,06	-4,33%	-21,96%	-5,06%
Hang Seng	21595,74	1,62%	-9,24%	-8,51%

Россия

ММВБ	1634,14	-1,75%	-4,32%	17,01%
РТС	724,73	-4,94%	-12,17%	-8,34%
ММВБ-10	3631,41	-2,34%	-5,22%	19,46%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Уркалий-ао	203,50	3,17%	Распадская	36,09	-5,28%
ВСМПО-АВС	11510,00	2,00%	Мечел ао	51,20	-5,10%
ГМКНорник	10215,00	2,00%	Россети ао	0,43	-5,03%
Галс-Девел	1670,00	2,00%	Башнефт ао	1764,00	-5,00%
Транснф ап	165200,00	2,00%	РусГидро	0,50	-4,82%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,29%	Химпром	3,06%	Химпром
-0,55%	Металлургия	0,77%	Металлургия
-1,58%	Нефть и газ	-2,93%	Телеком.
-2,13%	Телеком.	-3,09%	Потреб.
-2,13%	Финансы	-4,65%	Нефть и газ
-2,64%	Потреб.	-5,34%	Машиностр.
-3,26%	Машиностр.	-5,50%	Транспорт
-3,37%	Транспорт	-6,78%	Энергетика
-3,68%	Энергетика	-6,97%	Финансы

Фондовый рынок

- Американские фондовые индексы завершили торги понедельника снижением вслед за азиатскими и европейскими площадками на фоне опасений инвесторов относительно состояния мировой экономики. Индекс DJIA упал на 3,57%, индекс S&P 500 упал на 3,94%, индекс NASDAQ потерял 3,82%. Торги на Шанхайской фондовой бирже в понедельник закрылись рекордным с 2007 года падением, несмотря на попытки властей поддержать рынок, свидетельствуют данные торгов. Основной индекс Шанхайской фондовой биржи Shanghai Composite Index, который в течение дня опускался до 9%, просел на 8,49% и составил 3209,91 пункта. Шэньчжэньский индекс Shenzhen Composite Index снизился на 7,7%, составив 1882,46 пункта.
- Свежие признаки замедления второй по величине экономики мира - Китая - привели к падению азиатских и европейских индексов. Опасения инвесторов увеличились на фоне отсутствия новых действий со стороны китайских властей по спасению рынка от распродаж. Ситуация с экономикой Китая также вызвала сомнения инвесторов относительно вероятности повышения ставок ФРС США в сентябре 2015 года. Нью-Йоркская фондовая биржа предупредила, что приостановит торги на примерно 15 минут, если индекс S&P 500 продемонстрирует падение на 7%. Торги могут быть повторно приостановлены в случае падения на 13%. Если обвал составит 20%, биржа будет закрыта до конца торгового дня.
- Основные фондовые индексы Европы закрыли торги понедельника в значительном минусе вслед за биржами Азиатско-Тихоокеанского региона на волне распродаж акций на фондовых рынках по всему миру. Британский индекс FTSE 100 опустился на 4,67%, в ходе торгов он обновил минимум с 28 ноября 2012 года. Немецкий DAX 30 снизился на 4,7%, французский CAC 40 - на 5,35%. Греческий композитный индекс Athex по итогам торгов потерял 10,54%.
- Индекс Eurostoxx 600 упал на 5,3%. Акции сырьевых компаний Glencore и Anglo American падали более чем на 9%. Котировки компании LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton и Cie. Financiere Richemont падали пятый день подряд. Все западноевропейские рынки закрылись снижением. Новая волна распродаж на мировых рынках связана с продолжающимися опасениями замедления экономического роста Китая. Решение китайских властей разрешить инвестировать средства пенсионного фонда в акции не смогло поддержать фондовый рынок страны.
- Российский рынок акций в понедельник закрылся в "красной" зоне по основному индексу на фоне обвала рубля к основным валютам и нефтяных котировок по марке Brent, опускавшихся ниже 43 долларов за баррель. Индекс ММВБ к закрытию упал на 1,75%, индекс РТС - на 4,94%. Днем РТС падал на 7,1%, до 708,25 пункта, обновив минимум с 17 декабря 2014 года. Акции "Уралкалия" к закрытию поднялись на 3,73% в ожидании решения совета директоров о возможности проведения обратного выкупа своих ценных бумаг, что может привести к делистингу глобальных депозитарных расписок компании с Лондонской фондовой биржи. Акции ТМК снизились на 4,21%, несмотря на позитивную отчетность по МСФО за первое полугодие текущего года и на сообщение о том, что компания может выплатить дивиденды за этот же период. Большинство акций российских компаний закрылись на Московской бирже в "красной" зоне. Исключение составили акции Polyus Gold, ВСМПО-АВИСМА, "Норникеля", "Акрона", ЧТПЗ и "Фосагро". Среди лидеров снижения - бумаги "Мечела", "Распадской", "Россетей" и "Русгидро".

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	43,24	-2,98%	-11,05%	-24,85%
Light	38,78	-1,80%	-8,30%	-27,80%
Алюминий	1538,00	0,42%	-2,19%	-16,98%
Золото	1154,40	-0,37%	3,20%	-2,43%
Медь	5025,45	1,67%	-1,89%	-19,34%
Никель	9640,00	-0,98%	-8,71%	-36,37%
Пшеница	512,60	3,64%	1,38%	-13,06%
Серебро	14,85	-1,66%	-2,81%	-5,32%

Товарный рынок

- Стоимость октябрьских фьючерсов на североморскую смесь Brent опускалась вчера на 5,58% - до 42,92 доллара за баррель. В ходе торгов цена фьючерсов даже падала до 42,54 доллара за баррель, значение приблизилось к минимуму с 12 марта 2009 года в 42,19 доллара за баррель. Октябрьские фьючерсы на легкую нефть WTI дешевели на 5,19%, до 38,35 доллара за баррель. Снижение на нефтяном рынке продолжается на фоне опасений за экономику Китая.
- Декабрьский фьючерс на золото дорожал на 0,21% - до 1162 долларов за тройскую унцию. Ранее металл дорожал до 1165 долларов. Цена на золото растет на фоне роста спроса на безопасные активы в связи с замедлением китайской экономики.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	70,90	2,59%	8,23%	19,70%
EUR/RUB	82,26	4,60%	13,33%	14,23%
Бивалютная корзина	75,95	0,05%	10,01%	23,10%
EUR/USD	1,1543	0,77%	4,25%	-4,61%
GBP/USD	1,5766	0,54%	1,15%	1,15%
USD/JPY	119,98	-0,86%	-3,60%	0,18%

Валютный рынок

- Доллар в понедельник продолжил снижение к мировым валютам на фоне опасений о переносе повышения процентной ставки ФРС США. Курс евро к доллару рос до 1,1712 доллара за евро. Курс доллара к иене снижался до 116,17 иены за доллар.
- Курс рубля в течение торгов понедельника продемонстрировал сильнейшее падение за несколько месяцев. Основной импульс к падению сразу с утра задало очередное обвальное падение фондового рынка Китая. Курс евро в понедельник обновил максимум года - 83,628 рубля, курс доллара также приблизился к своему максимуму. Вечером курс рубля отошел немного вверх вслед за нефтяной ценой. Доллар вечером опустился к 71 рублю, а евро - ниже 82,5 рубля. Объем торгов на валютной секции Мосбиржи вчера оказался максимальным с декабря прошлого года.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	114,61	-1,51%	-3,56%	8,78%
США 10-летние, %	2,04	0,04	-0,12	-0,13
США 30-летние, %	2,76	0,06	-0,06	0,01
Россия 10-летние, %	12,24	0,29	1,08	-1,85
Россия 15-летние, %	12,12	0,34	1,11	-1,32

Долговой рынок

- Минфин РФ увеличивает объем облигаций федерального займа с постоянным купонным доходом выпуска N26215 с 250 млрд рублей до 260,9 млрд рублей. Согласно сообщению на сайте министерства, облигации дополнительного выпуска с 26 августа будут доступны для предложения на аукционах.
- 27 августа Минфин РФ планирует обменять облигации федерального займа с амортизацией долга на портфель из пяти выпусков ОФЗ с постоянным купонным доходом.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня позитивен: мировые фондовые индексы сегодня торгуются в значительном плюсе на фоне коррекции после сильнейшего падения в последние несколько дней. В заметном минусе торгуется лишь китайский рынок, который теряет сегодня около 4%, однако на общемировой фон этот фактор сейчас влияет слабо. Цены на нефть с утра неплохо корректируются после вчерашнего обвала. Открытие торгов в РФ стоит ждать на положительной территории.

Индекс ММВБ вчера закрылся достаточно оптимистичной свечой, удержав уровень поддержки 1630 пунктов. Краткосрочно рынок может получить положительный импульс, и мы можем увидеть рост в район 1660-1670 пунктов. Индекс РТС из-за доллара выглядит немного слабее, но и здесь с учетом сильнейшей перепроданности и того факта, что индикатор дошел до первых целей снижения в районе 720-730 пунктов, может состояться неплохой отскок вверх.

Однако положительная картина складывается лишь на краткосрочном горизонте инвестирования: начавшиеся в мире распродажи, падение цен на нефть, девальвация рубля, а также потенциальное ухудшение дел в экономике вполне может привести к дальнейшему падению фондового рынка в среднесрочной перспективе.

Сегодня будет достаточно много важной макро статистики по Германии и США, а кроме того, сегодня будет опубликован еженедельный отчет по рынку нефти в 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, сублицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.