

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1932,24	-0,34%	-2,91%	-6,15%
Dow Jones	16201,32	-0,48%	-2,84%	-9,10%
NASDAQ	4734,48	-0,38%	-3,39%	-0,03%
S&P фьючерс	1920,80	0,10%		

## Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5961,49	-1,17%	-3,64%	-9,21%
DAX	9427,64	-1,92%	-7,84%	-3,85%
CAC 40	4347,24	-1,93%	-6,61%	1,96%

## Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	45291,97	-0,11%	-6,71%	-9,43%
Nikkei 225	17628,70	0,32%	-2,65%	0,97%
Shangh Composite	3087,32	-1,76%	-0,03%	-4,56%
Hang Seng	20992,54	-0,49%	-4,25%	-11,07%

## Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1621,43	-1,17%	-6,23%	16,10%
РТС	769,38	-1,62%	-6,53%	-2,70%
ММВБ-10	3666,23	-1,44%	-6,11%	20,60%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ММК	21,07	3,56%	ПолюсЗолот	2680,00	-9,20%
Распадская	37,75	2,08%	ГМКНорник	9662,00	-5,00%
Э.ОНРоссия	2,81	1,74%	Yandex clA	714,00	-5,00%
Татнефть Зап	171,50	1,70%	Уркалий-ао	181,35	-3,97%
Ростел -ао	90,17	1,43%	СОЛЛЕРС	427,00	-3,00%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ



## Фондовый рынок

- Торги четверга рынки Нового Света завершились снижением в ожидании новостей от главы ФРС Джанет Йеллен, а также под влиянием внутренней статистики, часть которой оказалась позитивной, однако были и существенные негативные моменты. По данным Бюро переписи населения министерства торговли США, число продаж новых домов в августе выросло на 5,7% в месячном выражении и составило 552 тысячи, хотя эксперты ожидали уровень продаж в 515 тысяч. Июльский показатель был пересмотрен с 522 тысяч до 507 тысяч. Однако хуже ожидаемого оказались данные по заказам на товары длительного пользования в США, которые в августе упали на 2%.
- Также, инвесторы в США не оставили без внимания негативные новости от крупной американской компании Caterpillar, которая объявила о реструктуризации с целью снижения операционных расходов. Также компания понизила прогноз по выручке на 2015 год на 1 млрд. долларов, а также может уволить свыше 10 тысяч человек.
- Европейские рынки также завершили вчерашние торги негативным движением на фоне продолжающегося скандала вокруг Volkswagen, который вызвал серьезные опасения, касательно других автопроизводителей в Германии. Напомним, что Volkswagen был обвинен в США в занижении показателей выбросов CO2 в атмосферу, за что может быть серьезно оштрафован. Рейтинговое агентство Moody's вчера ухудшило прогноз по долгосрочному приоритетному необеспеченному рейтингу до уровня «A2» и краткосрочному – до «Prime-1».
- В добавок к проблеме с Volkswagen, СМИ сообщили, что автомобили автоконцерна BMW выбросами в атмосферу наносят вред окружающей среде. На этих заявлениях акции компании BMW упали на 5%. Не спасли рынки от тени автомобильных скандалов даже позитивные макроэкономические новости из Германии, где индекс делового климата неожиданно вырос до 108,5 пунктов с пересмотренного ранее показателя августа, который был пересмотрен с 108,3 до 108,4 пунктов. Эксперты же ожидали снижения индекса до 107,9 пунктов.
- Российский фондовый рынок вчера также закрылся в красной зоне. Рынок продолжает опасаться увеличения фискальной нагрузки на сырьевые компании в 2016 году. Акции «Уралкалия» вчера показали негативную динамику и снизились на 4% на фоне окончания срока принятия заявок на обратный выкуп акций по объявленной программе buyback. Акции авиаперевозчика «Трансаэро» вчера также падали на 20%, а за год бумаги потеряли 88,5% своей стоимости. Падение продолжилось на сообщениях днем ранее об отзыве допусков на выполнение полетов по 14 международным направлениям.
- Акции Московской Биржи шли против рынка и выросли на 0,5% после заявления об утверждении новой дивидендной политики, по которой дивиденды будут выплачены в размере не менее 55% (ранее было 50%) чистой прибыли по МСФО. Также росли вчера акции «Ростелекома». Рост был вызван сообщением о том, что «дочка» оператора – ООО «Мобител» заключила договор с Kristlan Holdings Ltd о выкупе 1,2% обыкновенных акций материнской компании.

## Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,23	0,29%	-1,17%	-16,18%
Light	45,01	0,33%	-3,58%	-16,20%
Алюминий	1580,00	-0,19%	-2,89%	-14,71%
Золото	1146,40	1,08%	1,69%	-3,11%
Медь	5087,18	0,20%	-5,14%	-18,35%
Никель	9890,00	1,38%	-0,45%	-34,72%
Пшеница	497,20	-1,93%	2,90%	-15,67%
Серебро	15,08	1,75%	0,23%	-3,86%

- Котировки нефти марки «Brent» вчера показали умеренный рост на 0,29%, до 48,23 долларов за баррель после снижения в среду, вызванного заявлением об увеличении добычи нефти в США.
- Стоит отметить, что рейтинговой агентство S&P ухудшило прогноз по стоимости нефти «Brent» и «WTI» на 2015 год, а также обнародовала прогнозы на 206 – 2018 годы. По новому прогнозу баррель нефти «Brent» будет стоить 50 долларов, вместо предполагаемых ранее 55 долларов. «WTI» будет стоить 45 долларов за баррель, хотя ранее прогноз составлял 50 долларов. В 2016 году ожидаются цены в 55 и 50 долларов за баррель нефти «Brent» и «WTI» соответственно.
- Золото вчера резко подорожало на 1,08% на фоне ослабления фондового рынка США, усилившего спрос на защитные активы.

## Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	66,10	-0,48%	1,01%	11,59%
EUR/RUB	74,18	-0,05%	-0,87%	3,01%
Бивалютная корзина	70,53	0,01%	1,26%	14,32%
EUR/USD	1,1169	-0,19%	-1,99%	-7,70%
GBP/USD	1,5214	-0,29%	-2,33%	-2,39%
USD/JPY	120,09	0,00%	0,32%	0,28%

- Рубль вчера укрепился к доллару и евро вслед за ростом цен на нефть. Курс доллару к рублю снизился на 0,48% и составил 66,1 рублей за доллар. Курс евро к рублю немного понизился на 0,05% и составил 74,18 рублей за евро. Стоимость бивалютной корзины выросла на 0,01% и составила 70,53 рублей.
- Доллар вчера подешевел по отношению ко многим мировым валютам из-за негативной ситуации на фондовом рынке США. Индекс доллара (курс доллара к корзине валют шести стран – основных торговых партнеров США) снизился на 0,4% - до 95,81 пунктов.
- Однако курс доллара к евро снизился на 0,19%, и теперь евро стоит 1,117 доллар.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	118,45	-0,20%	0,51%	12,42%
США 10-летние, %	2,14	0,01	-0,04	-0,03
США 30-летние, %	2,91	-0,02	-0,08	0,17
Россия 10-летние, %	11,41	0,17	0,04	-2,68
Россия 15-летние, %	11,14	0,11	-0,09	-2,30

## Долговой рынок

- На долговых рынках вчера серьезных событий не происходило. Российские 10-летние облигации немного выросли в цене – на 0,17%, тогда как 15-летние отечественные облигации подросли на 0,11%. Американские казначейские облигации вчера почти не изменились в цене.

## Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: западные фьючерсы с утра торгуются разнонаправленно, нефть показывает разнонаправленную динамику на статистике из Японии, где годовая инфляция составила 0,2%, превзойдя ожидания экспертов, при этом базовый индекс потребительских цен снизился в годовом выражении на 0,1%, при том, что в августе базовый уровень инфляции составлял 0%. Азиатские фондовые индексы с утра демонстрируют снижение на заявлениях главы ФРС США.

Индекс ММВБ вчера в очередной раз закрылся очередной черной свечой достигнув уровня 1621 пунктов, продолжая движение в рамках негативного тренда к 1600 пунктам. Пока что надежных сигналов на разворот рынка вверх по-прежнему нет, поэтому снижение может продолжиться, хотя сильная локальная

перепроданность может на время приостановить этот процесс. Индекс РТС вчера также закрылся новой черной свечой на уровне 769,38 пунктов.

Сегодня ожидается публикация данных из США, а именно уровень ВВП за 2 квартал, информация по индексу потребительских ожиданий от Мичиганского университета и индекс деловой активности в секторе услуг. Также сегодня ожидается выступления президента Бундесбанка Йенса Вайдманна и члена ФРС США Джеймса Булларда. Наконец, важными будут данные от Baker Hughes об изменении числа буровых установок в США за текущую неделю.

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.