

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2089,14	0,12%	1,89%	1,47%
Dow Jones	17812,19	0,11%	1,85%	-0,06%
NASDAQ	5102,81	0,01%	2,34%	7,74%
S&P фьючерс	2083,00	-0,08%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6277,23	-0,45%	0,14%	-4,40%
DAX	10933,99	-1,43%	-0,34%	11,51%
CAC 40	4820,28	-1,41%	-2,37%	13,06%

Остальной мир

Bovespa	48284,19	0,28%	2,19%	-3,45%
Nikkei 225	19854,66	-0,35%	0,49%	13,71%
Shangh Composite	3621,90	0,16%	0,30%	11,97%
Hang Seng	22476,36	-0,49%	0,85%	-4,78%

Россия

ММВБ	1810,05	-3,11%	1,28%	29,60%
РТС	867,54	-3,34%	0,59%	9,72%
ММВБ-10	4093,27	-2,85%	0,17%	34,65%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
НМТП ао	3,54	1,87%	ВТБ ао	0,07	-4,55%
Уркалий-ао	173,00	1,73%	ФСК ЕЭС ао	0,06	-4,34%
Акрон	3188,00	1,00%	ГАЗПРОМ ао	145,65	-4,18%
ДИКСИ ао	316,20	0,30%	Сбербанк-п	76,35	-4,08%
М.видео	251,80	0,00%	Транснф ап	165900,00	-4,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Рынки Нового Света закрылись небольшим плюсом на фоне публикации внутренней статистики, хотя в первую половину торгов на рынках наблюдалось снижение после катастрофы в Сирии, где турецкий истребитель F-16 сбил российский бомбардировщик Су-24.
- Напомним, что вчера, на территории Сирии, вблизи от границы с Турцией был сбит российский бомбардировщик Су-24, который возвращался на базу после боевого вылета. Согласно сообщениям из Турции, бомбардировщик неоднократно нарушил границу, игнорируя предупреждения истребителей, в результате чего был сбит ракетами «воздух-воздух», оба пилота Су-24 успели катапультироваться, однако точной информации о их судьбе пока нет. Российская сторона выступила с заявлением, что самолет не пересекал турецкой границы, а президент РФ В. Путин назвал происшествие «ударом в спину от «пособников террористов». Данное происшествие оказало мощное давление на мировые рынки, и американские рынки исключением не стали.
- Однако позитивная внутренняя статистика обратила индексы рынков США в «зеленую» зону. Реальный рост ВВП США в третьем квартале текущего года, согласно вторым оценкам, составил 2,1% в годовом выражении, что совпало с ожиданиями аналитиков. Согласно первым оценкам, рост ВВП в третьем квартале составил 1,5%. Дефлятор ВВП за тот же период составил 1,3% в квартальном выражении, превысив ожидания аналитиков (1,2%). В текущей ситуации геополитической напряженности, инвесторы будут считать американские рынки относительно безопасными и этот факт непременно будет оказывать поддержку рынкам США.
- Рынки Европы вчера закрылись в «красной» зоне на фоне напряженности вокруг ситуации на Ближнем Востоке. В отличие от американских рынков, обострение геополитической ситуации из-за падения Су-24 оказало большее давление на европейские индексы, среди инвесторов резко повысилась неприязнь риска. В частности, серьезно пострадали акции авиакомпаний: «EasyJet» упала на 3,2%, а акции «IAG» снизились до минимумов сентября.
- При этом, внутренняя статистика, вышедшая по Европе, оказалась довольно-таки позитивной. ВВП Германии, по итогам 3 квартала, оправдал ожидания аналитиков: ВВП вырос на 0,3% в квартальном и на 1,8% в годовом выражении. При этом, индекс деловых ожиданий в стране в ноябре составил 104,7 пунктов, что также выше ожиданий аналитиков (104 пункта). Индекс делового климата IFO в ноябре составил 109 пунктов, превысив прогнозы на 0,8 пункта. Наконец, индекс текущей ситуации в Германии в ноябре составил 113,4 пункта, что оказалось лучше ожиданий на 1 пункт.
- Российский фондовый рынок вчера оказался под серьезным ударом из-за катастрофы в Сирии с российским бомбардировщиком Су-24. При этом, на рынке итак давно «назревала» коррекция, что усилило отрицательный эффект. В итоге индекс ММВБ продемонстрировал максимальное суточное падение за 8 месяцев, снизившись на 3,11% - до 1810,05 пунктов, а индекс РТС упал на 3,34% и составил 867,54 пункта. Объемы торгов по бумагам из базы расчета индекса ММВБ выросли до 54,471 млрд рублей.
- В лидерах снижения оказались акции «Газпрома», которые просели на 4,18%. Причиной давления оказалась угроза срыва проекта строительства газопровода «Турецкий поток».

- Под ударом также оказались акции «Аэрофлота», которые падали в цене на 9% в ходе торгов, а к закрытию оказались в минусе на 3%. Разговоры об отмене авиасообщения с Турцией оказали серьезное давление на бумаги авиаперевозчика.
- Лучше рынка закрылся «Уралкалий», акции которого выросли на 1,73% перед грядущим выкупом акций компанией.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	46,28	2,78%	5,28%	-19,57%
Light	42,97	2,38%	2,29%	-20,00%
Алюминий	1454,00	0,62%	-1,09%	-21,51%
Золото	1078,10	0,76%	1,17%	-8,88%
Медь	4515,08	1,24%	-1,28%	-27,53%
Никель	8810,00	6,27%	-3,03%	-41,85%
Пшеница	491,20	-0,97%	1,15%	-16,69%
Серебро	14,21	1,00%	0,74%	-9,44%

- Мировые цены на нефть вчера направились «вверх» на фоне роста геополитической напряженности на Ближнем Востоке после крушения Су-24 и ослабления доллара. Котировки нефти марки «Brent» прибавляли более 3% и выходили выше уровня 46 долларов за баррель. Однако данные от Американского института нефти свидетельствующие о росте запасов нефти за прошедшую неделю на 2,6 млн баррелей должны оказать давление на цены, так как аналитики прогнозировали снижение запасов на 200 тыс. баррелей.
- Золото вчера выросло в цене на 10 долларов после происшествия в Сирии ввиду возросшего геополитического напряжения, выступив в роли «безопасного» актива.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	65,45	-0,58%	0,47%	10,50%
EUR/RUB	69,67	-0,43%	0,46%	-3,25%
Бивалютная корзина	67,71	0,10%	0,12%	9,75%
EUR/USD	1,0653	0,19%	0,19%	-11,97%
GBP/USD	1,5090	-0,30%	-0,69%	-3,18%
USD/JPY	122,46	-0,23%	-0,73%	2,26%

- Рубль вчера, несмотря на геополитическую напряженность, смог укрепиться к доллару и евро. Помогли ему в этом рост цен на нефть и пик налогового периода в России. Спрос банков на аукционе РЕПО ЦБ превысил объем предложения в полтора раза, что говорит о сохраняющемся спросе на рублевую ликвидность. В итоге к доллару рубль укрепился на 0,58% и составил 65,45 рублей за доллар. Курс рубля к евро вырос на 0,43% - до 69,67 рублей за евро.
- Доллар вчера снижался к мировым валютам на фоне неопределенности по темпам повышения ключевой ставки ФРС США, а также в преддверии выходного дня в Америке. Индекс доллара падал на 0,18% - до 99,58 пунктов. К евро доллар снижался на 0,19% - до 1,0653 доллара за евро.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,36	-0,59%	-0,13%	18,98%
США 10-летние, %	2,24	-0,01	-0,03	0,07
США 30-летние, %	3,00	0,00	-0,05	0,25
Россия 10-летние, %	9,93	0,14	0,06	-4,16
Россия 15-летние, %	9,72	0,19	0,02	-3,72

- Из-за резкого ухудшения рыночной конъюнктуры «Полюс Золото» перенесли размещение облигаций на более поздний срок. Планировалось размещение 5-летних облигаций на сумму 5-10 млрд рублей.
- Доходности Российских 10- и 15-летних ОФЗ выросла на 0,14-0,19 процентного пункта ввиду падения спроса на бумаги из-за геополитической напряженности.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы с утра торгуются в основном в положительном направлении, однако без серьезной динамики. Площадки АТР в первой половине торгов в основном демонстрируют негативную динамику, отыгрывая геополитическую напряженность. Нефть с утра торгуются в положительном ключе, выше 46 долларов за баррель марки «Brent».

Открытие рынка ожидаем в небольшом плюсе, на фоне роста цен на нефть и нейтрального внешнего фона. Однако геополитика продолжит давить на российский рынок. Индекс ММВБ вчера «нарисовал» длинную «черную» свечу, перекрывшую телом предыдущую «белую» свечу, что является первым сигналом к развороту. Однако индекс закрылся на 1810,05 пунктах и пока находится выше психологической отметки в районе 1800-1810 пунктов, так что можно говорить пока что лишь о некотором коррекционном движении, но не о начале разворота. Несомненно, ощущается давление геополитической ситуации, но необходимо подождать более сильных сигналов. Индекс РТС вчера также закрылся длинной «черной» свечой на 867,54 пунктах, в ходе торгов тестируя уровень поддержки в районе 855-860 пунктов. О развороте по индексу также говорить пока рано и необходимо дождаться более сильных сигналов. Ближайшие торги определяют перспективы динамики фондового рынка.

Сегодня ожидается большой «пул» информации из США, в частности, октябрьские данные по динамике личных доходов и расходов, а также данные по заказам на товары длительного потребления. Кроме того, выйдет окончательный показатель ожиданий и настроений потребителей от Мичиганского университета за ноябрь. Наконец, выйдут важные данные для нефтяного рынка по недельному изменению запасов сырой нефти от Минэнерго США и по изменению количества буровых установок от Baker Hughes.

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, опубликовать, модифицировать, усовершенствовать, адаптировать, переводить на другие языки, использовать с другими произведениями, рекламировать, распространять, публиковать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.