

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2065,89	-0,26%	1,73%	0,34%
Dow Jones	17581,43	-0,24%	2,12%	-1,36%
NASDAQ	5030,15	-0,09%	3,06%	6,21%
S&P фьючерс	2063,60	0,16%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6365,27	-0,81%	0,32%	-3,06%
DAX	10692,19	-1,01%	5,37%	9,04%
CAC 40	4847,07	-1,02%	3,71%	13,69%

Остальной мир

Bovespa	47042,95	-0,35%	-0,07%	-5,93%
Nikkei 225	18862,80	0,46%	1,99%	8,03%
Shangh Composite	3413,73	-0,60%	-0,73%	5,54%
Hang Seng	23008,31	-0,58%	0,14%	-2,53%

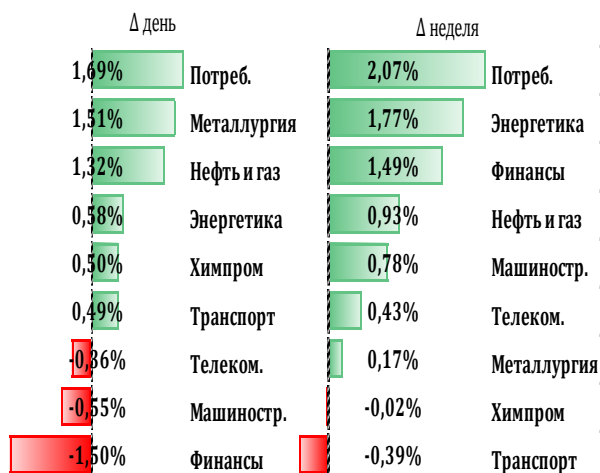
Россия

ММВБ	1725,89	0,80%	0,19%	23,58%
RTS	839,26	-2,19%	-4,14%	6,14%
ММВБ-10	3949,55	0,33%	-0,52%	29,92%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Yandex clA	940,00	12,00%	БСП ао	37,50	-6,13%
Магнит ао	11359,00	5,00%	Сбербанк	89,00	-3,58%
НМТП ао	3,15	4,31%	МосБиржа	92,05	-3,21%
НЛМК ао	73,68	3,48%	Сбербанк-п	65,20	-3,06%
Татнфт Зао	345,00	3,45%	ЛСР ао	586,00	-3,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Рынки Нового Света в минувший вторник закрылись в «красной зоне» на внутренней статистике и финансовых отчетностях. Кроме того, инвесторы находятся в ожидании итогов заседания ФРС США. Хотя, согласно мнению большинства экспертов, регулятор, вероятнее всего, сохранит текущее значение ключевой процентной ставки, игроки не спешат открывать длинные позиции в текущий момент.
- Также, инвесторы ожидали финансового отчета компании Apple, который вышел уже после закрытия рынка. Согласно отчету, чистая прибыль компании по итогам прошедшего квартала выросла на 30,6% - до 11, млрд долларов, что превысило прогнозы.
- Объем заказов на товары длительного пользования в стране в сентябре снизился на 1,2% в месячном выражении. Полученное значение показателя оправдало ожидания аналитиков. Однако базовый объем заказов на товары длительного пользования (без учета транспорта) в сентябре снизился на 0,4% по сравнению с августом, не оправдав ожидания экспертов, которые, наоборот, прогнозировали рост на 0.1%.
- Кроме того, не оправдали ожиданий индекс деловой активности (PMI) в секторе услуг и индекс доверия потребителей от компании Conference Board. Так, индекс деловой активности в сфере услуг, по предварительным оценкам, в октябре снизился с сентябрьских 55,1 пунктов, до 54,4 пунктов, аналитики же не ожидали изменения показателя. Таким образом, индикатор снизился почти до уровня февраля 2015 года. Индекс доверия потребителей также упал в октябре по сравнению с сентябрем с 102,6 пунктов до 97,6 пунктов. Эксперты же прогнозировали рост показателя до 103 пунктов.
- Рынки Европы во вторник также продемонстрировали снижение. Британский индекс FTSE 100 снизился на 0,81% - до 6365,27 пунктов, а немецкий DAX и французский CAC 40 оба упали на 1% - до 10692,19 пунктов и 4847,07 пунктов соответственно.
- Европейские инвесторы, как впрочем и все остальные, пока ждут итогов заседания ФРС, не предпринимая конкретных действий. Кроме того, давление на рынки оказали разочаровывающие данные по росту ВВП Великобритании в 3 квартале. Так, ВВП по итогам квартала вырос на 0,5%, хотя аналитики ожидали роста на 0,6%. В годовом выражении рост ВВП также не дотянул до прогнозов (2,3% против ожидаемых 2,4%). Полученные данные, вместе с падающими ценами на нефть и не оправдавшими ожиданий экспертов финансовыми отчетностями некоторых местных компаний, внесли долю негатива во вчерашние торги.
- Российский фондовый рынок вчера закрылся разнонаправленно. На рынок оказало давление снижение цен на нефть марки «Brent» ниже 47 долларов за баррель, которое привело к ослаблению национальной валюты. Так, индекс RTS упал на 2,19% - до 839,26 пунктов, а индекс ММВБ, наоборот, подрос на 0,8% и составил 1725,89 пунктов. Объем торгов бумагами, входящими в базу расчета индекса ММВБ по итогам вторника составили 38,39 млрд рублей, что не сильно отличалось от объемов понедельника.
- Лидером рынка стали бумаги «Yandex», которые выросли на 12% на фоне повышения прогноза компании по выручке в текущем году с 11-13% до 14-16%. Скорректированная чистая прибыль компании по МСФО в 3 квартале составила 3,51 млрд рублей, что превысило ожидания аналитиков (3,28 млрд рублей). При этом прибыль, по сравнению с тем же периодом

прошлого года, упала на 10%, однако давления на котировки это не оказало.

- Акции «НЛМК» выросли почти на 3,5% на сообщениях вице-президента компании Григория Федоришина о том, что компания планирует выплатить дивиденды по итогам трех кварталов текущего года.
- Акции «Газпрома» по итогам торгов динамики не продемонстрировали, хотя давление на бумаги могли оказать данные о том, что компания упала с 4 на 43 место в глобальном рейтинге энергетических компаний мира. Кроме того, Турция подала иск в арбитраж Стокгольма против «Газпрома» по поводу цен на российский газ. Однако, к иску в «Газпроме» отнеслись спокойно, не исключая досудебного решения спора.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	46,76	-1,02%	-3,81%	-18,73%
Light	43,22	-0,62%	-6,13%	-19,53%
Алюминий	1475,50	-0,81%	-3,75%	-20,35%
Золото	1168,00	0,34%	-0,86%	-1,28%
Медь	5194,11	-0,08%	-0,11%	-16,63%
Никель	10525,00	0,91%	1,25%	-30,53%
Пшеница	505,60	-0,78%	2,89%	-14,25%
Серебро	15,92	0,51%	0,28%	1,47%

- Нефтяные котировки вчера продолжали нисходящий тренд, пробив уровень в 47 долларов за баррель по марке «Brent», что негативно сказалось на мировых рынках.
- Вчера были опубликованы данные от Американского института нефти, согласно которым, запасы нефти в США по итогам прошедшей недели выросли на 4,1 млн баррелей, хотя аналитики ожидали роста запасов на 3 млн баррелей. Отметим, что неделей ранее запасы также выросли на 7,1 млн баррелей по данным института. Данная новость оказала негативное влияние на цены на нефть, ввиду сохранения опасений, касательно переизбытка «черного золота» в мире.
- Власти США сообщили, что намерены продать почти 8% от всего объема резервов страны с 2018 года по 2025 год – почти 58 млн баррелей нефти. Авторы законопроекта считают, что США стала самодостаточной в плане нефтедобычи и может направить нефть на продажу для финансирования бюджетного дефицита. Данная инициатива может привести к дальнейшему снижению цен на нефть. Однако рынок уже вчера отреагировал на эту новость ударом по котировкам в сторону понижения.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	64,90	2,98%	4,48%	9,57%
EUR/RUB	71,63	2,83%	1,62%	-0,53%
Бивалютная корзина	66,86	1,67%	0,77%	8,36%
EUR/USD	1,1035	-0,29%	-2,86%	-8,81%
GBP/USD	1,5306	-0,33%	-0,89%	-1,80%
USD/JPY	120,38	-0,17%	0,33%	0,52%

- Рубль вчера серьезно просел под ударом со стороны снижения нефтяных котировок. При этом пик налогового периода уже прошел, и поддержка национальной валюты ослабла, и корреляция между рублем и нефтью снова стала выше. Так, курс рубля обновил трехнедельный минимум. За доллар придется теперь отдать 64,9 рублей (падение рубля к доллару на 2,98%). К евро рубль ослаб на 2,83% и теперь евро стоит 71,63 рубля.
- Доллар перед итогами заседания ФРС США перешел к росту к мировым валютам. Индекс доллара повышался на 0,06% - до 96,96 пунктов. Курс доллара к евро также упал на 0,29% - до 1,103 долларов за евро.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	124,19	-0,22%	0,43%	17,87%
США 10-летние, %	2,04	0,00	-0,03	-0,13
США 30-летние, %	2,86	0,01	-0,06	0,11
Россия 10-летние, %	10,12	0,10	-0,06	-3,97
Россия 15-летние, %	10,11	0,08	-0,03	-3,33

- В эту среду Минфин РФ проведет аукцион по размещению ОФЗ-ПД (погашение в феврале 2027 года) на 15 млрд рублей по номинальной стоимости. Также будут размещены ОФЗ-ПК (погашение в январе 2025 года) в объеме 5 млрд рублей по номинальной стоимости.

Внешний фон сегодня нейтральный: фьючерсы на зарубежные индексы утром торгуются разнонаправленно, без ярко выраженной динамики в любую из сторон. Индексы площадок Азиатско-Тихоокеанского региона демонстрируют отрицательную динамику в преддверии заседания ФРС США, а также на негативных новостях из Японии, где не оправдали ожиданий объемы розничных продаж. Котировки на «черное золото» этим утром немного успокоились и двигаются без серьезной динамики.

Открытие рынка сегодня ожидаем в районе вчерашнего закрытия. Индекс ММВБ вчера закрылся белой свечой на уровне 1725,89 пунктов, хотя по ходу торгов снова тестировал уровень поддержки в районе 1700-1705 пунктов и снова неудачно. Пока наблюдаем боковую динамику в диапазоне 1700 – 1735 пунктов. Сильных сигналов к началу направленного движения в любую из сторон по-прежнему нет. Индекс РТС, наоборот, вчера закрылся черной свечой на 839,26 пунктах, пробив-таки краткосрочный уровень поддержки в районе 850 пунктов. Пробой уровня поддержки может стать первым сигналом к движению индекса вниз, но необходимо дождаться подтверждения, для чего индексу стоит задержаться ниже пробитого уровня в течение ближайших дней.

Сегодня инвесторы будут ждать результатов заседания ФРС США, которые будут опубликованы вечером. Кроме того, станут известны изменения запасов сырой нефти по данным Минэнерго США, что тоже является важной информацией, так как, скорее всего, окажет влияние на движение нефтяных котировок.

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