

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2090,35	1,18%	2,93%	1,53%
Dow Jones	17779,52	1,13%	3,27%	-0,24%
NASDAQ	5095,69	1,30%	4,40%	7,59%
S&P фьючерс	2079,20	-0,25%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6437,80	1,14%	1,46%	-1,95%
DAX	10831,96	1,31%	6,74%	10,47%
CAC 40	4890,58	0,90%	4,64%	14,71%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	46740,85	-0,64%	-0,71%	-6,53%
Nikkei 225	18843,70	-0,31%	1,89%	7,92%
Shangh Composite	3379,38	0,12%	-1,73%	4,47%
Hang Seng	22869,14	-0,38%	-0,47%	-3,12%

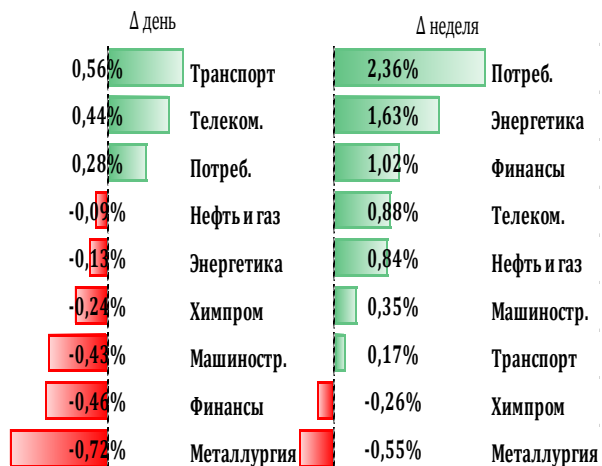
Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1726,61	0,04%	0,23%	23,63%
РТС	854,74	1,84%	-2,38%	8,10%
ММВБ-10	3972,65	0,58%	0,06%	30,68%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Yandex clA	1002,00	7,00%	СевСт-ао	717,00	-2,40%
ЧеркизГ-ао	881,00	4,00%	НМТП ао	3,08	-2,38%
ЛСР ао	608,00	4,00%	ВТБ ао	0,07	-2,33%
Сбербанк-п	67,05	2,84%	Новатэк ао	601,30	-2,10%
Башнефт ао	1908,00	2,00%	ДИКСИ ао	330,50	-1,90%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Фондовые рынки Америки в среду выросли более, чем на 1% на фоне решения ФРС США сохранить ключевую ставку на прежнем низком уровне 0-0,25%. Однако, регулятор на сей раз смягчил тон в отношении влияния ситуации на мировых рынках на местную экономику. Таким образом, большинство членов ФРС ожидают повышения ставки уже в декабре текущего года, но регулятор также сообщил, что хочет быть «достаточно уверен» в том, что уровень инфляции будет приближаться к целевому уровню в 2%.
- Из числа внутренней статистики, опубликованной вчера, стало известно сальдо внешней торговли товарами. Было зафиксировано снижение дефицита внешней торговли товарами в сентябре до 58,6 млрд долларов с августовских 67,19 млрд долларов. Эксперты прогнозировали снижение дефицита до 64,9 млрд долларов. Таким образом полученные результаты оказались лучше ожидаемых аналитиками.
- Кроме того, дополнительным драйвером рынка стал рост местных компаний. В частности, компания Apple, отчетность которой превысила ожидания аналитиков, выросла на 4,1%, продемонстрировав самый высокий прирост за 8 недель. В добавок, рост цен на нефть на 5-6% вызвал рост акций энергетических компаний.
- Площадки Европы вчера также продемонстрировали рост в среднем чуть более чем на 1% в ожидании итогов заседания ФРС, которые были оглашены уже после закрытия местных рынков. Кроме того, рынки отыгрывали статистическую информацию из Германии, где был опубликован индекс потребительского климата (Gfk), измеряющий уровень потребительского доверия в экономической деятельности. Данный индикатор является опережающим и предсказывает траты потребителей в отчетном месяце. Так, индекс Gfk на ноябрь составил 9,4 пункта и удовлетворил прогнозы экспертов, что стало позитивным сигналом для рынков.
- Поддержала рынки и финансовая отчетность британской компании Lloyds Banking Group, чистая прибыль которой, по итогам прошедшего квартала, составила 690 млн фунтов стерлингов, против прошлогодних 693 млн фунтов. Таким образом, показатель почти не изменился по сравнению с аналогичным периодом прошлого года.
- Отечественный рынок акций вчера также закрылся в плюсе по обоим индексам, продолжая боковое движение. Хотя индексы большую часть дня торговались в «красной зоне», рост нефтяных котировок во второй половине дня, который привел к укреплению национальной валюты, смог «вытянуть» индексы к концу торгов выше уровня вчерашнего открытия. Так, индекс ММВБ смог прибавил 0,04% и остановился на 1726,61 пунктах, а индекс РТС подрос на 1,84% - до 854,74 пунктов. Объемы торгов по бумагам из расчета индекса ММВБ вчера составили 33,845 млрд рублей, снизившись по сравнению с торговой сессией вторника более чем на 5 млрд рублей.
- Акции авиаперевозчика «Трансаэро» вчера выросли на 57% при рекордных объемах торгов в 300 млн рублей. Стало известно, что акционеры S7 планируют выкупить 19% акций «Трансаэро» до конца недели, после чего подадут ходатайство в ФАС РФ на согласование сделки. 30 октября состоится встреча кредиторов проблемной авиакомпании, на которой будет обсуждаться дальнейшая судьба перевозчика.
- Акции «Yandex» вчера прибавили почти 7% на сообщениях о начале переговорах с производителями мобильных устройств о

предустановке продуктов компании на устройства после решения ФАС РФ по делу Google.

- Ценные бумаги «РУСАЛ» снизились более чем на 3% после заявления руководства компании о том, что объем производства алюминия в текущем году останется на уровне 2014 года и запуск остановленных ранее в 2013 году заводов не планируется. Более того, компания рассматривает возможность сокращения производственных мощностей на 200 млн тонн в год. Акции «Новатэк» также продемонстрировали снижение более чем на 2% на фоне снижения чистой прибыли по МСФО за первые три квартала текущего года на 4,9% - до 59,6 млрд рублей.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	48,88	3,47%	0,56%	-15,05%
Light	45,78	5,27%	-0,56%	-14,76%
Алюминий	1470,00	-1,18%	-4,11%	-20,65%
Золото	1160,20	-0,34%	-1,52%	-1,94%
Медь	5186,39	-0,23%	-0,25%	-16,76%
Никель	10490,00	0,58%	0,91%	-30,76%
Пшеница	507,00	-0,51%	3,17%	-14,01%
Серебро	15,89	0,35%	0,13%	1,31%

Товарный рынок

- Цены на нефть вчера резко выросли более чем на 5% и смогли закрепиться в районе 49 долларов за баррель марки «Brent». В ходе торгов котировки «черного золота» марки «Brent» даже превышали уровень в 49 долларов на новостях о том, что запасы сырой нефти в США по итогам прошедшей недели, по данным Минэнерго, выросли на 3,376 млн баррелей вместо ожидаемых 3,417 млн баррелей, при сокращении добычи нефти на 16 тысяч баррелей в сутки (-0,17%).
- Запасы нефти на крупнейшем в стране терминале в Кушинге снизились на 0,8 млн баррелей – до 53,3 млн баррелей. Однако, вероятное повышение ключевой ставки ФРС США в декабре этого года, оказало небольшое давление на котировки «Brent» вернув их под уровень 49 долларов.
- После заявления ФРС о сохранении ключевой ставки и вероятности ее повышения в декабре, котировки на золото и медь перешли в «красную зону». Вероятное повышение ключевой ставки окажет поддержку доллару и еще больше надавит на стоимость золота.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	63,95	-1,46%	2,95%	7,96%
EUR/RUB	69,82	-2,52%	-0,94%	-3,04%
Бивалютная корзина	68,73	2,81%	3,60%	11,40%
EUR/USD	1,0924	-1,29%	-3,84%	-9,73%
GBP/USD	1,5260	-0,63%	-1,19%	-2,09%
USD/JPY	120,69	0,09%	0,59%	0,78%

Валютный рынок

- Рубль, по итогам торгов среды, сумел отбить большую часть потерянных во вторник позиций. Поддержку национальной валюте оказали растущие цены на нефть, а также высокий спрос на облигации федерального займа, размещенные Минфином РФ на вчерашнем аукционе. В итоге, курс рубля к доллару вырос на 1,46% и составил 63,95 рублей за доллар, а курс рубля к евро вырос на 2,52% - до 69,82 рублей за евро.
- Соотношение доллар евро впервые с 10 августа упало ниже 1,1 доллара за евро после решения ФРС США по ключевой ставке. Курс доллара к евро вырос на 1,29% и составил 1,09 доллара за евро. Индекс доллара рос на 0,53% - до 97,42 пунктов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	124,44	0,20%	0,63%	18,11%
США 10-летние, %	2,08	0,05	0,01	-0,09
США 30-летние, %	2,86	0,01	-0,06	0,11
Россия 10-летние, %	10,02	0,00	-0,16	-4,07
Россия 15-летние, %	9,99	-0,04	-0,15	-3,45

Долговой рынок

- Вчера Минфин РФ разместил облигации федерального займа на 20 млрд рублей при спросе, превышавшем предложение в 3 раза (60,7 млрд рублей). На первом аукционе были размещены ОФЗ 26207 (погашение в феврале 2027 года) на 15 млрд рублей. Цена отсечения составила 88,86% от номинала, а доходность по этой цене составила 10,02% годовых. На втором аукционе были размещены ОФЗ 29006 (погашение в январе 2025 года) на 5 млрд рублей. Цена отсечения составила 101,481% номинала, а доходность по цене отсечения – 14,68% годовых.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно отрицательный: фьючерсы на западные индексы утром торгуются в «красной зоне», однако сильного направленного движения пока не наблюдается. Площадки Азиатско-Тихоокеанского региона также демонстрируют преимущественно негативную динамику после заявлений ФРС США по процентной ставке. Котируются на нефть с утра торгуются ниже вчерашних уровней, продолжая умеренное снижение после итогов заседания регулятора в США.

Открытие рынка сегодня ожидаем на уровнях вчерашнего закрытия. Вчера индекс ММВБ «нарисовал» маленькую белую свечу с длинным «хвостом» и закрылся на 1726,6 пунктах. Индекс продолжает двигаться в «боквике» между краткосрочным уровнем поддержки в районе 1705 пунктов и 1725-1730 пунктами. Сигналов к направленному движению вверх или вниз пока не видно, хотя непробиваемость уровней поддержки может говорить о силе «быков» и возможном росте. Индекс РТС вчера также закрылся белой свечой, которая смогла перекрыть предыдущую черную, когда индекс пробил уровень поддержки в районе 850 пунктов. Вчера РТС смог отыграть потерянные ранее позиции и закрылся на 854,7 пунктах. Таким образом, первичный сигнал к развороту по индексу, который появился по итогам торгов вторника, вчера подтвержден не был.

Сегодня ожидается публикация пула данных из Германии, США и Великобритании, который будет включать в себя данные по рынку труда Германии и США за октябрь, данные с рынка недвижимости США и Великобритании за тот же месяц. Кроме того, станут известны уровни инфляции в октябре в Испании и Германии. Наконец, инвесторы узнают, как изменился ВВП США в 3 квартале.

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