

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2045,97	-1,40%	-2,57%	-0,63%
Dow Jones	17448,07	-1,44%	-2,33%	-2,10%
NASDAQ	5005,08	-1,22%	-2,39%	5,68%
S&P фьючерс	2041,20	0,03%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6178,68	-1,88%	-2,93%	-5,90%
DAX	10815,24	-0,85%	-0,67%	10,30%
CAC 40	4856,65	-1,94%	-2,48%	13,91%

Остальной мир

Bovespa	46883,58	-0,39%	-2,42%	-6,25%
Nikkei225	19580,97	-0,59%	2,01%	12,15%
Shangh Composite	3590,82	-1,16%	1,41%	11,01%
Hang Seng	22415,87	-2,07%	-1,95%	-5,04%

Россия

ММВБ	1739,96	-0,03%	-1,49%	24,58%
РТС	831,95	-1,63%	-5,16%	5,22%
ММВБ-10	4016,37	0,38%	-1,67%	32,12%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Полюзолот	2705,00	5,00%	МосБиржа	87,28	-4,09%
ММК	22,26	3,15%	Ростел -ао	88,51	-2,41%
Уркалий-ао	161,70	2,99%	СОЛЛЕРС	428,00	-2,00%
ФосАгро ао	2685,00	2,00%	Транснф ап	151500,00	-2,00%
Фармстанд	1084,00	2,00%	Yandex clA	1020,60	-1,90%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
0,98%	Химпром	3,21%	Транспорт
0,40%	Металлургия	0,68%	Химпром
0,24%	Транспорт	-0,37%	Потреб.
0,12%	Телеком.	-1,33%	Нефть и газ
-0,09%	Потреб.	-1,39%	Металлургия
-0,37%	Энергетика	-2,10%	Машиностр.
-0,47%	Нефть и газ	-2,92%	Финансы
-0,67%	Машиностр.	-3,43%	Телеком.
-1,42%	Финансы	-3,94%	Энергетика

Фондовый рынок

- Американские рынки закрыли вчерашнюю торговую сессию снижением на 1,2-1,4%. Член ФРС США Уиллиам Дадли вчера заявил, что экономика США демонстрирует положительные результаты, что позволяет регулятору «уже в скором времени» начать постепенно ужесточать монетарную политику, повышая ключевую ставку. При этом Дадли отказался ответить на вопрос, будет ли произведено повышение ставки в декабре текущего года или ФРС отложит решение на 2016 год.
- Падение мировых цен на нефть и слабое состояние экономики Китая поставило под давление акции сырьевых и энергетических компаний. В частности, акции Chevron Corp упали на 2,5%, а Freeport-McMoRan Inc снизились почти на 6%, ExxonMobil Corp. – на 2,7%. Отметим также падение акций GoPro, которые вчера упали ниже стоимости при IPO. За последние 3 месяца акции компании упали на 60%. Причинами падения стали низкий спрос на новые видеочкамеры и не оправдавшая ожиданий финансовая отчетность.
- Кроме того, вчера была опубликована внутренняя статистика по безработице, которая оказалась хуже ожиданий аналитиков. Так, число первичных заявок на пособие по безработице в стране, согласно министерству труда, за прошедшую неделю не изменилось и составило 276 тысяч. Эксперты же ожидали снижение показателя на до 270 тысяч. Однако в целом, число заявок на пособие по безработице растет низкими темпами, что сигнализирует об устойчивом улучшении ситуации на рынке труда.
- Европейские рынки также отметили вчерашний день падением по основным индексам. Давление на индексы оказало выступление Марио Драги. Глава ЕЦБ подтвердил намерение пересмотреть параметры монетарной политики в декабре, что усилило ожидания инвесторов расширения программы количественного смягчения QE с целью еще в большей степени стимулировать экономику. Драги также заявил о том, что программа стимулирования может быть продолжена и после сентября 2016 года, если уровень инфляции не достигнет целевых 2% годовых, при этом регулятор в следующем году может применить и другие инструменты стимулирования, помимо QE.
- Продолжает оказывать давление на рынки и слабая статистика по производству Китая, опубликованная ранее на неделе. Кроме того, не оправдало ожидание изменение объема промышленного производства в еврозоне. Объем промышленного производства в сентябре упал на 0,3% в месячном выражении, хотя консенсус-прогноз предполагал снижение на 0,1%.
- Российский фондовый рынок вчера вновь оказался в «красной зоне», обновив минимум с 28 октября по индексу РТС. Основной причиной падения стало снижение нефтяных котировок, что привело к ослаблению национальной валюты к доллару и евро. Рублевый индикатор ММВБ вчера потерял 0,03% и закрылся на уровне 1739,96 пунктов, а РТС упал на 1,63% - до 831,95 пунктов. Объемы торгов бумагами из базы расчета индекса ММВБ выросли до 28,87 млрд рублей.
- Вчера стали известны предварительные данные по ВВП за 3 квартал, которые оказались довольно-таки позитивными. Согласно этим данным, ВВП РФ, по предварительной оценке, в 3 квартале снизился на 4,1%. Консенсус-прогноз предполагал снижение на 4,4%.

- На 5,3% выросли акции «Русагро». Причиной роста стало заявление главы Минэкономразвития РФ о том, что Китай скорее всего пустит мясо из России на локальный рынок.
- В списке лидеров также акции «ММК» (3,2%), «Уралкалий» (3%), на акции которого наблюдается неплохой спрос из-за девальвации рубля. Также вырос на 1,41% «Газпром», у которого налаживается сотрудничество с Кувейтской нефтяной компанией в нефтегазовой сфере.

Товарный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	45,25	-3,54%	-6,12%	-21,36%
Light	42,86	-3,53%	-5,62%	-20,20%
Алюминий	1499,00	-0,60%	-0,33%	-19,08%
Золото	1082,50	-0,47%	-2,20%	-8,51%
Медь	4767,51	-2,50%	-4,44%	-23,48%
Никель	9485,00	-0,63%	-3,02%	-37,39%
Пшеница	497,00	0,00%	-5,04%	-15,71%
Серебро	14,25	-0,56%	-5,00%	-9,15%

- Мировые цены на нефть вчера рухнули второй раз подряд и снова более, чем на 3%. Вчера ОПЕК подтвердила, что никаких изменений в слабой картине мирового спроса на нефть не происходит, а избытки запасов находятся на максимуме почти за 10 лет. Негатива добавили данные от Минэнерго США о том, что запасы сырой нефти в стране выросли на 4,2 млн баррелей, тогда как ожидался рост на 1 млн баррелей. Таким образом, слабая экономика Китая и переизбыток предложения на рынке «экономического золота» отравили котировки к 45 долларам за баррель по марке «Brent».
- Негативно слабая статистика по экономике КНР сказалась и на котировках меди, так как Китай является одним из главных потребителей данного металла.
- Золото также вчера торговалось в минусе. Давление на котировки продолжает оказывать высокая вероятность ужесточения монетарной политики ФРС США в декабре этого года.

Валютный рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	66,64	1,87%	5,02%	12,50%
EUR/RUB	72,00	2,42%	4,41%	-0,01%
Бивалютная корзина	67,90	1,38%	2,70%	10,05%
EUR/USD	1,0790	0,23%	-0,87%	-10,83%
GBP/USD	1,5211	-0,12%	-0,02%	-2,41%
USD/JPY	122,61	-0,29%	0,78%	2,38%

- Обвал рынка нефти приводит к тому, что рубль второй день подряд отступал под натиском мировых валют. В частности, «деревянный» ослаб к доллару на 1,87% - до 66,64 рублей за доллар. Курс рубля к евро также упал - на 2,42% и составил 72 рубля за евро. Бивалютная корзина также «потяжелела» на 1,38% и составила 67,9 рублей.
- Доллар, после выступления представителей ФРС, дорожал к мировым валютам. Индекс доллара рос на 0,1% - до 98,66 пунктов. Также вчера, после выступления Марио Драги, к доллару ослаб евро. Курс евро к доллару составил 1,079 доллара за евро.

Долговой рынок

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,46	-0,64%	-0,37%	19,08%
США 10-летние, %	2,32	-0,01	0,09	0,15
США 30-летние, %	3,08	-0,04	0,09	0,33
Россия 10-летние, %	9,82	0,17	0,14	-4,27
Россия 15-летние, %	9,73	0,21	0,12	-3,71

- Вчера, на совещании у первого вице-премьера Игоря Шувалова, обсуждался вопрос передачи Внешэкономбанку пакета ОФЗ на 1,5 трлн рублей для финансового оздоровления банка. Однако решение пока не было принято, так как некоторые участники совещания опасаются, что докапитализация банка таким способом приведет к снижению рейтингов РФ.
- «Акрон», один из крупнейших производителей минеральных удобрений в нашей стране, разместит облигации общим объемом на 10 млрд рублей. Индикативная ставка купона составит 11,75-12,25%, при доходности к 1,5 летней оферте в 12,1-12,63%.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно негативный: фьючерсы на западные индексы с утра торгуются в «красной» зоне. Площадки АТР также демонстрируют негативную динамику на заявлениях представителей ФРС США. Нефтяные котировки утром продолжают свое движение в районе 45 долларов за баррель марки «Brent».

Открытие рынка сегодня ожиданием понижением по обоим индексам. Вчера индекс ММВБ закрылся ниже уровня закрытия среды, остановившись на 1739,96 пунктах. При этом, несмотря на провал нефтяного рынка, индекс существенной «просадки» не продемонстрировал. Среднесрочная техническая картина по-прежнему указывает нам на сохранение повышательного тренда. Стоит отметить то, что индекс нашел уровень поддержки в районе 1730 пунктов. В среднесрочной перспективе, по нашему мнению, индекс может направиться к 1800 пунктам. Индекс РТС вчера закрылся «черной» свечой на 831,95 пунктах. Ближайший уровень поддержки для индекса находится в районе 825 пунктов. Сегодня возможно движение вниз с тестированием сложившегося уровня поддержки, однако среднесрочная картина говорит скорее о сохранении повышательного тренда.

Сегодня внимание инвесторов могут привлечь данные по ВВП за 3 квартал из Германии и Франции. Кроме того, мы узнаем изменение ВВП еврозоны за 3 квартал. Также ожидается большой блок внутренней статистики из США, среди которой будет индексы настроений и ожиданий потребителей от Мичиганского университета. Наконец, компания Baker Hughes сообщит об изменении числа буровых установок в США за прошедшую 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, 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.