

РЫНОЧНЫЕ ИНДИКАТОРЫ

	ЗАКРЫТИЕ	ИЗМЕНЕНИЕ	
		1 день	С начала года
<b>Валютный рынок</b>			
USD/RUB	66,2660	-0,93% ▼	15,77% ▲
EUR/RUB*	76,6419	-0,28% ▼	9,95% ▲
EUR/USD*	1,1595	0,01% ▲	-3,47% ▼
<b>Товарные рынки</b>			
Brent*, \$/барр.	81,10	0,92% ▲	21,86% ▲
Gold*, \$/унц.	1219,07	-0,43% ▼	-7,48% ▼
<b>Фондовый рынок</b>			
Индекс МосБиржи	2366,47	-2,12% ▼	9,92% ▲
PTC	1124,08	-1,69% ▼	-4,99% ▼
DJIA	25052,83	-2,13% ▼	0,92% ▲
S&P 500	2728,37	-2,06% ▼	1,21% ▲
NASDAQ Comp.	7329,06	-1,25% ▼	4,60% ▲
FTSE 100	7006,93	-1,94% ▼	-8,38% ▼
DAX	11539,35	-1,48% ▼	-10,35% ▼
Nikkei 250*	22673,84	0,37% ▲	-3,54% ▼
Shanghai Comp.*	2592,72	0,36% ▲	-22,57% ▼
<b>Криптовалюта</b>			
Bitcoin*	6206,06	0,03% ▲	-54,45% ▼
Ethereum*	193,27	-2,22% ▼	-74,52% ▼
Ripple*	0,44	8,86% ▲	-77,30% ▼
Litecoin*	51,94	0,08% ▲	-77,06% ▼

\* на 8:00 Msk

Источник: Bloomberg

КАЛЕНДАРЬ СОБЫТИЙ

Макроэкономические события

пн	8 октября	
вт	9 октября	
ср	10 октября	
чт	11 октября	
пт	12 октября	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ ЕС: промышленное производство</li> <li>✓ Россия: торговый баланс</li> <li>✓ США: количество буровых установок</li> </ul>

Корпоративные события

КОММЕНТАРИИ ПО РЫНКУ

Зарубежные рынки

Американские индексы упали вторую сессию подряд на волатильных торгах по мере того, как казначейские облигации США подскочили после сильных итогов аукциона 30-летних бумаг. «Защитное» золото показало самый большой рост за более чем два года. Бенчмарки ATP торговались в плюсе.

Нефть

По данным DOE, запасы сырой нефти в США за прошедшую неделю выросли на 6,0 млн барр. – намного сильнее, чем ожидал консенсус. Запасы бензина увеличились на 1,0 млн барр., запасы дистиллятов сократились на 2,7 млн барр. На фоне опубликованной статистики, а также общего ухода глобальных инвесторов из рискованных активов, нефть торговалась в минусе.

Российский рынок

Российский рынок, открывшийся в четверг «гэпом» вниз, во второй половине дня нащупал локальную поддержку и замедлил падение. Падение рынка на старте торгов (основные индексы теряли около -2%) случилось вслед за снижением американских индексов накануне на фоне роста доходностей казначейских облигаций США (доходность десятилетних бумаг поднималась до максимума с 2011 года). Стабилизация рынка после обеда наблюдалась на фоне наблюдающейся нисходящей коррекции доходностей американских гособлигаций. Тем не менее, несмотря на послеобеденную попытку отыграть часть снижения, к закрытию рынок всё-таки ушёл ниже: **Индекс МосБиржи** потерял -2,12%, **PTC** снизился на -1,7%.

В лидерах роста были **Полиметалл** (+5,0%), **Башнефть** (ao +2,9%), **Полюс** (+2,7%), **Лента** (+1,6%) и **ММК** (+0,4%).

Бумаги **НЛМК** (-5,2%), **Татнефти** (ao -5,5%, ап -3,1%), **ВСМПО-Ависма** (-4,0%) и **ФосАгро** (-2,0%) торговались в четверг без дивидендов. Также в минусе были **ТГК-1** (-5,0%) и **ОГК-2** (-4,4%).

Новости

**Северсталь** опубликовала операционные результаты за 3К18. Объем производства чугуна достиг 3,06 млн т, стали – 2,3 млн т, прирост производства составил 2% к/к для обоих сегментов. Консолидированные продажи стальной продукции снизились на 5% к/к до 2,71 млн. тонн из-за проведения краткосрочных ремонтных работ на прокатных станах. Доля продаж на внутренний рынок немного выросла - 65% по сравнению с 64% во 2К18. Доля продукции с высокой добавленной стоимостью возросла на 2 п.п. до 48%. Средние цены реализации большей части стальной продукции снижались в 3К18 на 2-8% к/к, следуя мировым трендам.

Группа компаний **ПИК** опубликовала операционные результаты за 3К18 и 9М18. За 9М18 объем реализации недвижимости увеличился на 6,4% г/г до 1 309 тыс. кв. м, стоимость заключённых договоров увеличилась на 10,1% до 139,6 млрд руб., общий объем поступлений денежных средств увеличился на 15,2% г/г до 156,6 млрд руб. В 3К18 темпы роста были более низкими: объем реализации недвижимости вырос на 1,3% г/г, стоимость заключённых договоров +7,7% г/г. Продажи в Москве и Подмоскowie в 3К18 демонстрировали отрицательную динамику по объёмам и увеличение стоимости заключённых договоров на 5-5,5%. Существенный рост показали продажи в регионах: +50% по объёмам и +69% по стоимости, хотя их доля в общих продажах остаётся невысокой (6% от общей суммы заключённых договоров за 9М18). Группа ПИК прогнозирует основные операционные показатели по итогам 2018 г. на уровнях прошлого года: реализация 1,7-1,9 млн кв. м жилья и общий объем поступлений денежных средств в размере 180-200 млрд руб.

Совет директоров **ЛУКОЙЛа** 19 октября обсудит дивиденды за 9М18.

**Тандер** 10 октября купил 65 627 акций **Магнита** (0,064396%) в рамках buyback. Всего с начала программы было приобретено 1 381 150 акций (1,355246%). При этом **Магнит** также объявил, что в период с 4 по 10 октября **Ренессанс Брокер** купил в общей сложности 418 479 акций ритейлера в рамках buyback с учётом изменений, внесённых в программу для финансирования приобретения «СИА Групп». Акции были или будут проданы **Ренессансом Тандеру** по цене, привязанной к средней цене на бирже за период осуществления обратного выкупа, определённой в соответствии с условиями, согласованными между **Ренессансом** и **Тандером**.

**VEON** объявил об отзыве предложения по приобретению активов **ГТН** в Пакистане и Бангладеш в связи с недавними событиями вокруг пакистанской рупии и реакцией миноритариев **ГТН**, которая указывала на то, что одобрение сделки было маловероятным.

## Криптовалюты

Компания Pundi X представила блокчейн-смартфон. Биржа Gemini наняла функционера ведущей опционной биржи США для операционного управления. **Биткоин** вырос до 6313 долл. Уровень доминирования **биткоина** составляет 54,2%. Капитализация криптовалютного рынка повысилась до 202 млрд долл.

## ПОРТФЕЛЬ "ВЫБОР ЛОКАЛЬНЫХ ОБЛИГАЦИЙ"

Портфель демонстрирует возможности рынка локальных облигаций. Цель моделирования — получение привлекательной доходности в рублях

[Подробнее](#)

## ПОРТФЕЛЬ "ЕВРООБЛИГАЦИИ"

Портфель демонстрирует возможности рынка валютных облигаций. Цель моделирования — получение привлекательной доходности в валюте.

[Подробнее](#)

## ПОРТФЕЛЬ АКЦИЙ "ВЫБОР ITI CAPITAL - 2018"

Эксперты ITI Capital отобрали акции с хорошей перспективой роста цены

[Подробнее](#)

## ПОРТФЕЛЬ АКЦИЙ "ДИВИДЕНДНЫЙ-2018"

Наш выбор дивидендных акций на начало 2018 года.

[Подробнее](#)

## ОПЦИОННЫЕ СТРАТЕГИИ И ТОРГ. РЕКОМЕНДАЦИИ

С. Елисеев, разработчик системы трейдинга для торговли опционами и фьючерсами ПО Option-lab делится рекомендациями и стратегией по торговле опционами и волатильностью.

[Состояние на 08.10.18](#)

## СТРУКТУРНЫЕ НОТЫ

Предложение на Октябрь 2018 года.

[Подробнее](#)

ДИВИДЕНДНЫЙ КАЛЕНДАРЬ

Компания	Тикер	Сектор	Валюта	DPS*	Период	Последний день торгуется с дивидендами	Дата закрытия реестра	Дивидендная доходность
НЛМК	NLMK RX	Добывающий и металлургия	Р	5,24	2К18	10.10.2018	12.10.2018	2,97%
НЛМК	NLMK LI	Добывающий и металлургия	\$	0,83	2К18	10.10.2018	12.10.2018	3,18%
Татнефть	TATN RX	Нефтегазовый	Р	30,27	1П18	10.10.2018	12.10.2018	3,67%
Татнефть	TATNP RX	Нефтегазовый	Р	30,27	1П18	10.10.2018	12.10.2018	5,24%
Татнефть	ATAD LI	Нефтегазовый	\$	2,66	1П18	10.10.2018	12.10.2018	3,60%
ВСМПО-АВИСМА	VSMO RX	Промышленный	Р	756,00	1П18	10.10.2018	12.10.2018	4,54%
ФосАгро	PHOR RX	Химический	Р	45,00	НП	10.10.2018	12.10.2018	1,81%
ФосАгро	PHOR LI	Химический	\$	0,22	НП	10.10.2018	12.10.2018	1,68%
АЛРОСА	ALRS RX	Добывающий и металлургия	Р	5,93	1П18	11.10.2018	15.10.2018	5,87%
Полюс	PLZL RX	Добывающий и металлургия	Р	131,11	1П18	16.10.2018	18.10.2018	3,11%
Полюс	PLZL LI	Добывающий и металлургия	\$	0,96	1П18	16.10.2018	18.10.2018	2,98%
Акрон	AKRN RX	Химический	Р	40,00	НП	26.10.2018	30.10.2018	0,87%

\* Дивиденд на акцию

\*\* Нераспределённая прибыль

ОТДЕЛ ПРОДАЖ

тел: 8 (495) 933 32 35

для звонков из регионов 8 800 200 32 35

123317 г. Москва, Пресненская набережная д.8, стр.1 к.12



ЮРИДИЧЕСКАЯ  
ИНФОРМАЦИЯ

Представлена в настоящем документе информация подготовлена АО «ИТ-Капитал Инвест» (далее – Компания) и предназначена исключительно для ознакомления. Компания не гарантирует полноту, достоверность, действительность, корректность и актуальность любых сведений, представленных выше. Любое использование информации, представленной в данном документе, включая любые части/разделы документа, допускается только на собственный страх и риск пользователя. Любое копирование и воспроизведение информации, представленной в данном документе, как в устной, так и в письменной форме, допускается только при условии предварительного разрешения [согласия] Компании. Настоящий документ, включая любые его части и отдельные положения настоящего документа не могут рассматриваться в качестве оферты (включая публичную оферту), приглашения сделать оферту, коммерческого предложения Компании заключить сделку на условиях, изложенных в документе, а также гарантий Компании в отношении последствий заключения какой-либо сделки и/или использования какого-либо инструмента. Компания не гарантирует и не может гарантировать финансовый результат, налоговые и иные последствия, а также риски любого финансового инструмента. Все последствия и риски должны быть Вами рассмотрены и оценены самостоятельно либо с привлечением любых профессиональных консультантов, которых Вы сочтете нужными, до заключения сделки / использования продукта. Все расчеты, котировки, процентные ставки в документе являются индикативными, представляют собой образец и скорее всего не будут использованы при заключении сделки с Компанией. Все расчеты могут быть подвержены существенным изменениям в связи изменением рыночной конъюнктуры, что, в свою очередь, может негативно влиять на доходность / финансовый результат инструмента / сделки и привести к тому, что Ваши финансовые ожидания не смогут быть реализованы. Никакие положения настоящего документа не заменяют и не дополняют договор, который будет заключен Компанией с Вами при использовании данного или любого другого финансового инструмента. Содержание договора (формирующий) может частично или полностью отличаться от настоящего документа. Дополнительно любые параметры финансового инструмента могут быть изменены по согласованию между Вами и Компанией. При использовании любых материалов в данном документе, Вам следует обратиться за помощью, консультациями, разъяснениями к независимому профессиональному советнику, квалификации и мнению которого Вы доверяете. Настоящий документ, включая любые его части и положения, а также любые комментарии Компании и ее работников в отношении данного документа не могут рассматриваться в качестве консультации, совета, разъяснений Компании в отношении рассматриваемого или любых других финансовых инструментов и сделок. Компания вправе в любое время по своему усмотрению изменять содержание настоящего документа. При этом, Компания не несет ответственность по поддержанию документа в актуальном виде или по информированию Вас или любых третьих лиц об изменениях и дополнениях, которые могут быть внесены в данный документ. Настоящие положения являются неотъемлемой частью документа. Документ может толковаться и применяться исключительно целиком, включая настоящие положения.