

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1819,20	-1,26	-0,41	
S&P фьючерс		-0,02		
Eurostoxx	330,72	0,23	1,14	
Bovespa	49426,90	-0,54	-3,03	
Nikkei 225	15402,44	-3,01	-3,18	
Shangh Composit	2020,44	0,35	-1,31	

MMVB	1459,96	-0,63	-0,42	
PTC	1384,41	-0,82	-0,28	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Магнит	8091,000	-2,48	РосСети	#N/A N/A	#N/A N/A
ИнтРАО	0,01	-1,66	Акрон	1110,0000	-0,44
СевСт	305,5	-1,55	ММК	7,3010	-0,46
РусГидро	0,5654	-1,45	Трансфип	82663,00	-0,53
Сургут	27,51	-1,43	Ростел	111,0500	-0,58

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
0,90	Электр	0,17	Потреб
0,74	Финанс	0,13	Электр
0,32	Потреб	-0,53	Машин
-0,21	Телеком	-1,39	Финанс
-0,41	Машин	-1,56	Метал
-0,69	Метал	-2,76	Химпром
-0,71	Нефтегаз	-2,98	Телеком
-0,76	Химпром	-3,14	Нефтегаз

Фондовый рынок

- Американский фондовый рынок вчера показал сильнейшее падение с ноября 2013 года. Индекс S&P 500 упал на 1,3%, снижение шло почти непрерывно в течение всего торгового дня. Поводом для коррекции скорее всего стала сильная перегретость американского рынка – котировки находятся вблизи верхней границы длинного восходящего канала, который берет свое начало еще в 2009 году. Растить дальше и без перерыва очень трудно, поэтому снятие напряженности с котировок сейчас, кажется, очень к месту. Ближайшие поддержки индекса находятся на уровнях 1810 и 1792 пунктов. На сегодняшние торги будет непосредственно влиять статистика по розничным продажам в США, которая выйдет как раз незадолго до начала торгов.
- Торги в Европе днем проходили в более позитивном ключе, индекс Eurostoxx колебался в течение дня, но размах движений был небольшой и рынку удалось закрыть день выше уровней понедельника. Причиной хорошего настроения инвесторов вероятно стали новости от Базельского комитета по банковскому надзору, который принял решение смягчить требования к размеру задолженности кредитных организаций. Потенциал роста у европейских рынков пока что выше чем у американского, однако, учитывая, что котировки сейчас также вплотную приблизились к сопротивлению на уровне 332 пунктов и тот факт, что торги в США прошли не самым лучшим образом, сегодня фондовая Европа имеет все шансы оказаться в красной зоне. Инвесторы также обратят внимание на данные по инфляции в Великобритании и на статистику по промышленному производству в Еврозоне.
- Российский фондовый рынок завершил ростом третий день подряд, объемы торгов понемногу начинают расти. К концу дня рост замедлился из-за достаточно сильно и резко просевшего рубля. Пока что на отечественном рынке сохраняется достаточно позитивная атмосфера, мы ожидаем возврата индекса ММВБ к локальным максимумам на уровне 1507 пунктов на следующей неделе, хотя сегодня, возможно, рынок просядет под давлением внешних негативных факторов: падение американского рынка ночью, не самая позитивная обстановка на других развивающихся рынках в последние дни, хотя сегодня с утра Китай в плюсе, что может удержать отечественные акции от сильного падения.
- В лидерах роста вчера оказались ГК (+4,7%), Северсталь (+1,3%), НЛМК также растет уже третий день подряд. Положение металлургических компаний кажется достаточно стабильным и после распродажи 6 января, которая задела и их, котировки быстро вернулись к первоначальным уровням. Аэрофлот продолжил свой рост после «праздничной» консолидации, акции компании подросли на 6,6% на корпоративных новостях.

Товарный рынок

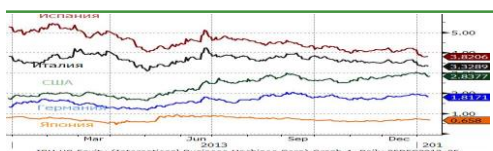
	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	106,73	-0,48	-0,58	
Индекс Метал.	1358,84	0,89	0,41	
Золото	1252,20	0,43	1,84	
Серебро	20,36	3,55	1,41	
Индекс Зерн	395,74	0,66	-0,69	

- Прогресс в переговорах Ирана и «шестёрки» продолжает оказывать сильное давление на рынок нефти. Первый транш из замороженных иранских активов поступит уже в начале февраля. Однако, необходимо отметить, что по действующим договорённостям, предусмотрена лишь разморозка иранских средств в международных банках, а не отмена всех санкций, таким образом, иранская нефть сможет появиться на рынке не раньше чем через полгода, когда будут решены все вопросы. Тем временем, рыночные котировки нефти находятся под сильным давлением, но снижение скорее всего будет носить краткосрочный характер, и до тех пор, пока иранская нефть действительно не вернется на мировой рынок, ждать сильного падения цен не стоит.

Валютный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,366	-0,04	0,35	
USDJPY	103,34	-0,81	-1,22	
Индекс \$	80,60	-0,08	-0,29	
EURRUB	45,39	-0,05	0,57	
USDRUB	33,22	-0,18	0,23	
Корзина ЦБ	38,70	-0,12	0,38	

- Рубль достаточно сильно просел к доллару и евро на фоне заявлений ЦБ РФ о том, что регулятор собирается и дальше сокращать валютные интервенции и планирует к концу этого года полностью перейти к режиму плавающего валютного курса.
- Появившиеся у инвесторов сомнения в дальнейшем продолжении «tapering» оказывают давление на американскую валюту. Йена укрепилась к доллару до уровня 103 йен, предлагая отличную возможность для формирования длинной позиции в этой паре.



Долговой рынок

- Котировки американских казначейских облигаций укрепились на фоне слабой статистики по изменению числа занятых в США.

Взгляд на рынок

Российский рынок сегодня может оказаться под давлением из-за негативного характера вчерашних торгов в США и низких цен на нефть. Тем не менее, в среднесрочной перспективе мы сохраняем позитивный взгляд на отечественный рынок. Фондовая Европа также может оказаться под властью заокеанского негатива. Сегодня ждем достаточно большой блок важной макро статистики из Европы и США, который, скорее всего, и будет определять характер торгов.

Данный отчет подготовлен отделом управления активами 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 управления активами 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.

© 2013, 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.