

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1841,40	-0,03	1,76	
S&P фьючерс		-0,03		
Eurostoxx	327,68	1,07	4,36	
Bovespa	51266,56	0,09	1,39	
Nikkei 225	16276,01	0,63	2,56	
Shangh Composit	2101,74	1,38	0,58	
MMVB	1494,53	-0,46	-0,86	
PTC	1445,94	-0,16	-0,49	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Магнит	9225,000	1,26	Новатэк	399,6000	-1,22
Уркалий	173,09	1,22	Мечел	64,9000	-0,92
ММК	7,4	0,97	Татнефт Зао	207,0300	-0,71
Аэрофлот	85,3500	0,77	МТС	325,34	-0,69
Сургут-п	25,87	0,68	Трансфлп	86705,0000	-0,68

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
0,21	Машин	4,47	Электр
0,15	Электр	4,05	Химпром
0,08	Телеком	3,20	Финанс
0,04	Метал	2,03	Метал
-0,05	Потреб	1,68	Нефтегаз
-0,07	Нефтегаз	1,13	Телеком
-0,45	Химпром	0,41	Машин
-0,52	Финанс	-0,03	Потреб

Фондовый рынок

- Американские фондовые индексы в течение пятничных торгов слабо изменялись в отсутствие каких-либо серьезных новостей и данных. Индекс S&P 500, в течение последних торговых сессий, мало того, что каждый день обновлял исторический максимум, так еще и фактически добрался до верхней границы длинного восходящего канала, который тянется аж с 2009 года. В таких условиях продолжать рост без существенной коррекции практически невозможно. Рынок может пробить верхнюю планку на 1-1,5%, но затем скорее всего пойдет вниз. Конечно в последнюю торговую сессию года, вряд ли произойдет сильное движение, тем более в красной зоне, поэтому сильная динамика скорее всего придется на первые недели нового года.
- Европейский индекс Eurostoxx в конце прошлой недели добавил еще около процента и закрылся на самой высокой отметке с первой половины 2008 года. Росту способствовало хорошее настроение инвесторов на западных площадках, сохранившееся и после рождественских праздников. Ближайшие сопротивления индекса находятся на уровнях 331 и 334 пунктов, это значит, что потенциал роста европейских рынков можно оценить примерно в 1-2%. После этого может начаться достаточно сильная коррекция, которая может обвалить рынки в пределах 4-7% за достаточно короткий промежуток времени.
- Фондовая Россия провела торги пятницы в достаточно спокойном ключе, отметившись умеренным снижением на фоне не самых лучших новостей и данных. Во-первых, последняя неделя этого года отметилась очередным оттоком средств из фондов, ориентированных на РФ, а совокупный отток за год составил более 3 млрд. долларов – это самое большое значение за все время наблюдений. Во-вторых, не порадовала инвесторов статистика по индексу PMI в обрабатывающей промышленности РФ, показатель оказался хуже ожиданий, и по-прежнему остается ниже 50 пунктов, что означает спад в отрасли. Кроме того, далекой от идеала остается ситуация и на денежном рынке, банки все еще испытывают дефицит ликвидности.
- Сегодня от отечественного фондового рынка можно ожидать некоторого повышения: индексы ММВБ и РТС умеренно снижались в течение последних четырех торговых сессий, создав неплохую базу для дальнейшего витка роста, правда не стоит исключать, что до конца года сильного движения уже не будет. Помочь подрасти могут и остающиеся на высоких уровнях цены на нефть.

Товарный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	112,37	0,35	0,54	
Индекс Метал.	1378,91	1,70	2,65	
Золото	1209,00	-0,42	0,32	
Серебро	19,83	-0,30	2,10	
Индекс Зерн	403,50	0,43	-1,18	

- Нефть в пятницу дорожала преимущественно на статистике от американского института нефти: запасы сырья в США сократились сильнее ожиданий аналитиков, и, кроме того, сокращение идет уже четвертую неделю подряд, что оказывает сильную поддержку котировкам. Brent закрепилась выше 112 долларов за баррель и теоретически ещё может подорожать до 113-114 долларов. WTI, в свою очередь, поднялась выше 100 долларов и ближайшая цель для цены – 102 доллара за баррель.
- Сильное ослабление доллара к евро в пятницу, помогло драг металлам немного подрасти, золото немного отступило от минимумов, вновь закрепившись выше 1200 долларов за унцию.

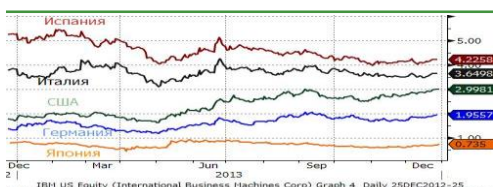
Валютный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,374	0,32	0,28	
USDJPY	105,31	0,47	1,14	
Индекс \$	80,39	-0,11	-0,23	
EURRUB	44,81	-0,09	0,24	
USDRUB	32,62	0,13	-0,03	
Корзина ЦБ	38,11	0,03	0,09	

- Курс евро к доллару в течение торгов пятницы подскакивал до 1,39 на заявлениях члена управляющего совета ЕЦБ Йенса Вайдмана о том, что мягкая монетарная политика ставит под угрозу экономический рост в долгосрочной перспективе и что низкая инфляция не может служить для этого оправданием.
- Штурм высоты 105 йен за доллар, в пятницу закончился успехом долларовых «быков». В понедельник с утра эта валютная пара продолжает свой рост, хотя в ближайшее время она может немного и откорректироваться.
- Курс доллара к рублю в пятницу снижался на фоне сохраняющегося высокого спроса на рубли, а к евро рубль падал, отыгрывая динамику валютной пары EUR-USD.

Долговой рынок

- Ожидания дальнейшего ужесточения монетарной политики со стороны ФРС в следующем году, основанные на сильной макро статистике США, продолжают оказывать давление на казначейские облигации. Десятилетние treasuries отметились первым с 2009 годовым снижением котировок.



Взгляд на рынок

Сегодня уже вряд ли произойдет какое-то сильное движение как на западе, так и в России. Новый год уже стучится в двери и у инвесторов сейчас есть более интересные и важные дела, поэтому закрытие года скорее всего пройдет около текущих уровней. Да и достаточно спокойный на различные события понедельник не обещает сильной волатильности рынков. Из интересных событий, которые могут повлиять сегодня на движение котировок, можно выделить, пожалуй, только публикацию данных по незавершенным продажам на рынке недвижимости в США.

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, опубликовывать, 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.