

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1939,38	-0,04%	3,32%	-5,12%
Dow Jones	16449,18	-0,10%	3,55%	-5,60%
NASDAQ	4620,37	0,14%	2,25%	-7,73%
S&P фьючерс	1919,40	-0,62%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6060,10	-0,39%	3,12%	-2,92%
DAX	9757,88	-0,41%	0,22%	-9,17%
CAC 40	4392,33	-0,56%	1,88%	-5,28%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	40570,04	0,41%	6,68%	-6,41%
Nikkei 225	17791,29	-0,41%	6,11%	-6,53%
Shangh Composite	2752,22	2,36%	-4,34%	-22,97%
Hang Seng	19439,94	-0,79%	2,36%	-11,29%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1773,21	-0,66%	3,30%	0,67%
РТС	730,39	-2,00%	7,16%	-3,52%
ММВБ-10	3942,84	-0,52%	3,65%	-0,45%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Аэрофлот	54,77	8,46%	ПолюсЗолот	3152,00	-3,00%
Polymetal	648,00	4,50%	Татнефть Зао	332,00	-2,22%
Башнефть ап	1772,00	2,40%	ГМКНорник	8698,00	-2,00%
ПИКао	215,00	2,30%	Магнит ао	11270,00	-2,00%
СевСт-ао	635,00	2,20%	Фармстанд	1050,00	-2,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
4,23%	Транспорт	7,83%	Транспорт
1,00%	Металлургия	5,14%	Финансы
0,51%	Энергетика	4,96%	Телеком.
0,46%	Телеком.	3,06%	Нефть и газ
0,25%	Химпром	2,58%	Металлургия
0,16%	Машиностр.	1,29%	Энергетика
-0,01%	Финансы	0,43%	Машиностр.
-0,47%	Потреб.	0,27%	Химпром
-0,97%	Нефть и газ	-0,08%	Потреб.

Фондовый рынок

- Рынки Нового Света, после мощного роста в последний день прошедшей недели, первую торговую сессию недели новой закончили, почти не продемонстрировав динамики в основных индексах. Однако, индекс широкого рынка S&P 500, а также индекс Dow Jones закрылись в «красной зоне», в позитивном ключе завершил торги лишь индекс NASDAQ.
- Вновь на настроения инвесторов начали влиять страхи и беспокойства, касающиеся глобального мирового роста. Виной всему статистика вышедшая из Поднебесной в ночь на понедельник. Согласно полученным данным, деловая активность в секторе производства Китая развивается не так, как хотелось бы экспертам. Индекс PMI в январе по-прежнему находится ниже 50 пунктов, сигнализируя о проблемах в производственном секторе экономики.
- Не обрадовали инвесторов также снижавшиеся цены на нефть, которые снова надавили на энергетические компании США, которые за январь и так вдоволь пострадали. Также плохо себя чувствовали банки. Некоторый позитив на настроения инвесторов внесли компании высокотехнологичного сектора американской экономики. В частности, финансовые результаты «Google» в 4 квартале 2015 года превысили ожидания аналитиков. Кроме того, материнская компания «Google» «Alphabet» вытеснила «Apple» с первой строчки рейтинга самых дорогих компаний мира, согласно информации от BBC.
- Внутренняя статистика, опубликованная в понедельник снова оказалась неоднозначной. Так, расходы физических лиц в декабре не изменились, тогда как аналитики прогнозировали рост на 0,1% в месячном выражении. Разочаровали также данные по индексу занятости в производственном секторе, который в январе составил 45,9 пунктов, при прогнозируемых 48 пунктах. Индекс упал до минимумов с июля 2009 года.
- Позитивными лишь оказались данные по индексу деловой активности в производстве от ISM, который в январе составил 48,2 пунктов, хотя ожидалось значение 48,1 пунктов. Однако и здесь индекс принял значение ниже 50 пунктов, что является тревожным сигналом для производственного сектора экономики США.
- Торговые площадки Европы также поддались тревожным настроениям из-за слабой макростатистики из Китая и снижающихся цен на «черное золото». Негативно восприняты также были разочаровывающие данные по занятости в производственном секторе экономики США. Европейские энергетические компании также пострадали от снижения цен на нефть. Кроме того, рейтинговое агентство «S&P» поместило рейтинги шести нефтегазовых компаний Европы в список на пересмотр с понижением.
- Макростатистика по Европе, которая была опубликована вчера, радикально настроения инвесторов не поменяла, поскольку оказалась смешанной. Индексы деловой активности в производственном секторе PMI в январе оказались лучше ожидаемого в Испании, Германии, а также в Великобритании. Совпал с прогнозами индекс во Франции и в целом по еврозоне. Хуже ожиданий экспертов оказались индексы деловой активности PMI для Швейцарии и Италии.
- Российский фондовый рынок не смог отвернуться от негативных настроений, царивших на мировых рынках. Также давление на отечественные индексы оказало снижение цен на нефть. В итоге, индекс ММВБ потерял 0,66%, снизившись до 1773,21 пунктов, а индекс РТС упал на 2% - до 730,39 пунктов.

Объемы торгов в понедельник оказались существенно ниже пятничных: 31,043 млрд рублей.

- Индекс производственной активности PMI в январе составил 49,8 пунктов, тогда как ожидалось значение 47,5 пунктов, что является хорошим сигналом. Однако полученные данные были проигнорированы инвесторами.
- Разговоры о приватизации ряда компаний в 2016 году позитивно сказались на акциях «Аэрофлота», которые выросли вчера на 8,5%. Кроме крупнейшей российской авиакомпания в списке на потенциальную приватизацию находится ряд компаний, включая «Роснефть», «Транснефть», «Ростелеком», «ВТБ» и др.
- Польская компания «PGNiG» подала судебный иск против «Газпрома» в Арбитражный суд в Стокгольме из-за цен на газ. Акции «Газпрома» вчера снизились на 2%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	33,62	-1,81%	12,78%	-9,82%
Light	30,94	-2,15%	4,56%	-16,47%
Алюминий	1518,00	-0,20%	2,50%	1,13%
Золото	1125,80	-0,20%	1,11%	6,16%
Медь	4527,21	-0,10%	2,75%	-3,82%
Никель	8510,00	1,00%	-0,70%	-3,51%
Пшеница	475,20	0,00%	-1,41%	1,11%
Серебро	14,29	-0,37%	-0,14%	3,36%

Товарный рынок

- Слабые статистические данные по сектору производства Китая негативно повлияли на сырьевой рынок, где котировки на «черное золото» снова начали снижение. Кроме того, влияние разговоров по поводу вероятного собрания ОПЕК со странами, не входящими в картель с целью переговоров по снижению добычи, постепенно ослабевает. По данным агентства Bloomberg, никакой встречи в феврале вовсе не планируется. По данным Саудовской Аравии, превышение предложения над спросом сейчас составляет около 2 млн баррелей в сутки. Кроме того, на рынок выходит Иранская нефть, что только усугубляет ситуацию.
- На фоне негативных настроений на мировых фондовых рынках, а также слабых макростатистических данных из Китая и США, котировки золота вчера росли с 1116 до 1128 долларов за тройскую унцию. Традиционно негативные настроения на фондовых рынках подогревают интерес к золоту, как к менее рисковому активу.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	77,31	2,49%	-3,41%	5,91%
EUR/RUB	84,26	3,08%	-3,08%	6,28%
Бивалютная корзина	79,57	1,32%	-1,74%	5,15%
EUR/USD	1,0902	0,14%	0,47%	0,39%
GBP/USD	1,4415	-0,11%	1,33%	-1,94%
USD/JPY	120,72	-0,21%	2,23%	0,33%

Валютный рынок

- Негативное движение мировых цен на нефть, соответственно, привело к ослаблению национальной российской валюты. Рубль сдал позиции перед долларом и евро на 2,5-3%. Курс доллара приблизился к отметке 77 рублей за доллар, а курс евро – к 84 рублям за единицу «единой валюты». Центробанк РФ в пятницу в своем сообщении заявил, что готов повысить ключевую ставку в случае угроз со стороны инфляции и чрезмерного ослабления рубля к мировым валютам.
- Ослабление доллара к мировым валютам вчера было довольно ощутимым из-за разочаровывающей макростатистики в США. Индекс доллара упал с 99,63 пунктов до 98,8 пунктов. Пара евро/доллар выросла с 1,083 до 1,091 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	123,84	-0,37%	1,14%	-1,82%
США 10-летние, %	1,94	0,02	-0,06	-0,33
США 30-летние, %	2,75	0,01	-0,04	-0,27
Россия 10-летние, %	10,40	0,10	-0,21	0,66
Россия 15-летние, %	10,26	0,10	-0,30	0,67

Долговой рынок

- Негативные настроения на российском фондовом рынке немного ослабило спрос на ОФЗ, в частности, доходности 10- и 15-летних облигаций выросли на 0,1%.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня умеренно негативный: фьючерсы на зарубежные индексы утром торгуются большей частью в «красной» зоне с умеренной отрицательной динамикой. В «плюсе» в основном торгуются фьючерсы на Азиатские индексы. Китайские фондовые индексы с утра демонстрируют позитивную динамику. Другие азиатские индексы, однако, проводят сессию в «красной» зоне на фоне снижения цен на нефть.

Открытие рынка сегодня ожидаем немного ниже уровней вчерашнего закрытия. Индекс ММВБ вчера закрылся черной свечой на 1773,21 пунктах в ходе торгов пытаюсь закрепиться ниже отметки 1765 пунктов. Если негативные настроения на мировых рынках, пришедшие вчера из Китая, сохранятся, то можно ожидать «просадки» индекса ММВБ в район 1730-1750 пунктов. Для «пробоя» отметки 1800 пунктов индексу ММВБ требуется мощная поддержка со стороны позитивных настроений мировых инвесторов, а также ростовой динамики нефтяных котировок, что сейчас выглядит маловероятным. Индекс РТС также закрылся черной свечой на отметке 730,39 пунктов. Опуститься ниже уровня поддержки в районе 725 пунктов у индекса не получилось, но скорее всего, если снижение цен на нефть продолжится, а это очень вероятно, индекс РТС опустится обратно к отметке 700 пунктов, а вероятно и еще ниже.

Сегодняшний день будет не столь богат на важную макростатистику. Интересными могут быть лишь данные по безработице Испании и Германии. Также будет опубликован уровень безработицы по еврозоне в целом. Наконец, будут обнародованы данные по изменению запасов сырой нефти за прошедшую неделю от Американского института нефти.

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, 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.