

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закp.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2102,63	1,07%	0,65%	2,12%
Dow Jones	17888,35	0,95%	0,43%	0,37%
NASDAQ	5156,31	0,93%	1,05%	8,87%
S&P фьючерс	2099,40	-0,02%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6395,65	0,62%	1,89%	-2,60%
DAX	11261,24	-1,06%	2,99%	14,85%
CAC 40	4914,53	-0,87%	1,96%	15,27%

Остальной мир

Bovespa	45046,75	-0,16%	-6,70%	-9,92%
Nikkei 225	19962,49	-0,25%	0,54%	14,33%
Shangh Composite	3468,32	0,35%	-4,24%	7,22%
Hang Seng	22441,55	0,27%	-0,15%	-4,93%

Россия

ММВБ	1772,97	0,11%	-2,05%	26,95%
РТС	839,14	-0,94%	-3,27%	6,12%
ММВБ-10	4024,32	0,04%	-1,68%	32,38%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закp.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закp.	Δ день
М.видео	253,40	4,10%	Э.ОНРоссия	3,11	-6,32%
Транснф ап	156500,00	4,00%	ИнтерРАОао	1,14	-2,64%
Аэрофлот	61,00	3,55%	Сбербанк-п	74,50	-2,23%
ВТБ ао	0,07	3,21%	Новатэк ао	607,60	-2,20%
ЧеркизГ-ао	1010,00	3,00%	Акрон	3222,00	-2,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
2,69%	Транспорт	4,18%	Транспорт
1,27%	Потреб.	1,63%	Потреб.
0,81%	Финансы	1,09%	Телеком.
0,62%	Нефть и газ	0,51%	Химпром
0,12%	Машиностр.	-0,14%	Машиностр.
-0,11%	Металлургия	-0,26%	Финансы
-0,41%	Телеком.	-0,32%	Энергетика
-0,55%	Химпром	-1,59%	Металлургия
-1,82%	Энергетика	-2,74%	Нефть и газ

Фондовый рынок

- Биржи Нового Света торги первого дня зимы закрыли в плюсе на фоне неоднозначной внутренней статистики, а также в ожидании заседания регуляторов, а именно, ЕЦБ, которое состоится уже в четверг, а также ФРС, который соберется в середине декабря. Ожидается, что Европейский Центральный Банк расширит программу стимулирования экономики Еврозоны, тогда как ФРС США скорее всего наоборот ужесточит монетарную политику в Америке, подняв ключевую ставку.
- Внутренняя статистика из США не имела общей позитивной или негативной окраски. Так, индекс деловой активности в производственном секторе от института управления поставками (ISM) в ноябре снизился до минимума с 2009 года - 48,6 пунктов, тогда как аналитики ожидали рост показателя с октябрьских 50,1 пунктов, до 50,5 пунктов. Показатель опустился ниже 50 пунктов, что говорит об экономическом спаде в производственном секторе, что оказывает негативное влияние на рынки.
- Позитивными же оказались данные о расходах на строительство в октябре выросли на 1% в месячном выражении, тогда как эксперты ждали роста на 0,5% после 0,6% роста в сентябре. В годовом выражении расходы выросли на 13%, до максимума почти за 8 лет. Кроме того, выше ожиданий отметился индекс занятости в производственном секторе от ISM. Индекс в ноябре составил 51,3 пункта, против ожидаемых 48,4 пунктов.
- Рынки Европы вновь не продемонстрировали единой динамики, на сей раз, закрывшись преимущественно в минусе. Вырасти смог только британский FTSE 100, который прибавил 0,62%. В Европе инвесторы также не предпринимают каких-либо решительных действий до итогов собрания ЕЦБ и ФРС США. Кроме того, на рынки повлияла и вышедшая во вторник внутренняя статистика.
- Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) для 19 стран Еврозоны в ноябре составил 52,8, чего и ожидали аналитики. При этом индексы деловой активности в промышленности для таких стран, как Испания, Италия и Германия, в ноябре оказались выше ожиданий аналитиков. Кроме того, стал известен уровень безработицы по Еврозоне, который в октябре составил 10,7%, тогда как аналитики ожидали, что показатель не изменится и останется на сентябрьском уровне 10,8%.
- Что касается индексов PMI, то во Франции индекс в ноябре опустился с октябрьских 50,8 пунктов, до 50,6 пунктов, тогда как аналитики прогнозировали то, что показатель не изменится. В Великобритании индекс в ноябре составил 52,7 пунктов, тогда как ожидалось значение 53,6 пунктов. Однако все значения индексов в рассмотренных странах Европы все равно приняли значение выше 50 пунктов, что говорит о продолжении развития производственного сектора в экономиках стран.
- Российский фондовый рынок 1 декабря не продемонстрировал единой динамики. На рынок продолжает давить геополитика, кроме того, негативное влияние на рынок оказало снижение нефтяных котировок, что ослабило рубль и ударило по «валютному» индексу РТС, который «просел» на 0,94% и закрепился на уровне 839,14 пунктов. Индекс ММВБ смог незначительно прибавить (+0,11%) и закрепиться на уровне 1772,97 пунктов.
- Акции «Газпрома» продолжили снижение, опустившись на 0,4%, так как глава комитета Госдумы по энергетике Павел Завальный выступил за заморозку строительства «Турецкого потока» из-за кризиса в отношениях между Россией и Турцией.

- «Сбербанк» также продолжил снижение. Префы компании упали на 2,2%, обыкновенные акции – на 1,55%. При этом, зампред правления банка, Белла Златкис, сообщила, что «Сбербанк» не видит проблем, касательно своего бизнеса в Турции, несмотря на кризис в отношениях двух стран. Златкис отметила, что необходимо все-таки дождаться официальных новостей от правительства РФ, прежде чем делать какие-либо выводы.
- Лидером снижения стала компания «Э.ОН Россия», акции которой упали более чем на 6%. Отметим, что вчера компания запустила новый энергоблок на березовской ГРЭС в Красноярском крае. Сумма инвестиций в проект составила 1 млрд евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	44,31	-1,03%	-4,26%	-22,99%
Light	41,64	-0,69%	-3,10%	-22,47%
Алюминий	1474,00	1,34%	1,38%	-20,43%
Золото	1067,60	-0,22%	-0,97%	-9,77%
Медь	4562,48	0,02%	1,05%	-26,77%
Никель	9050,00	1,51%	2,72%	-40,26%
Пшеница	471,40	-1,09%	-4,03%	-20,05%
Серебро	14,17	0,04%	-0,25%	-9,66%

Товарный рынок

- Цены на нефть вчера продолжали колебаться, снижаясь к 44 долларам за баррель «Brent». Давление на цены оказывает переизбыток «черного золота» на мировом рынке. Кроме того, негативных настроений добавила слабая статистика про промышленному производству Китая. В фокусе внимания игроков сейчас собрание ОПЕК, которое состоится в пятницу. Однако аналитики считают, что страны картеля не согласятся снизить объемы добычи, что еще сильнее надавит на мировые цены «черного золота».
- Цены на золото демонстрировали слабый рост из-за снижения доллара, на который надавила опубликованная вчера неоднозначная статистика по деловой активности в производстве в США.
- Медь вчера росла на фоне сокращения производства металла в Китае. Десять ведущих производителей меди в Китае вчера пришли к соглашению о сокращении производства меди на 350 тысяч тонн в 2016 году.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	66,61	0,18%	1,77%	12,45%
EUR/RUB	70,88	0,88%	1,74%	-1,57%
Бивалютная корзина	68,69	0,56%	1,44%	11,34%
EUR/USD	1,0619	0,41%	-0,32%	-12,25%
GBP/USD	1,5068	-0,09%	-0,15%	-3,32%
USD/JPY	123,01	0,08%	0,45%	2,71%

Валютный рынок

- Рубль вчера ослаб перед долларом и евро на фоне снижающихся цен на нефть. Вечером, «деревянный» ослаб к евро на 0,88%, а к доллару – на 0,18%. Курс доллара составил 66,61 рублей за доллар, курс евро – 70,88 рублей за евро.
- Неоднозначная статистика из Америки привела к тому, что доллар немного ослаб перед мировыми валютами. Индекс доллара снижался на 0,33% - до 99,87 пунктов. Соответственно, курс евро к доллару вырос на 0,41% и составил 1,0619 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,75	0,16%	0,31%	19,35%
США 10-летние, %	2,17	-0,06	-0,07	0,00
США 30-летние, %	2,92	-0,07	-0,08	0,17
Россия 10-летние, %	9,80	-0,05	-0,13	-4,29
Россия 15-летние, %	9,55	-0,03	-0,17	-3,89

Долговой рынок

- Минфин РФ в среду проведет аукцион по размещению ОФЗ с постоянным купонным доходом с погашением в феврале 2027 года на сумму 7,2 млрд рублей. Кроме того, будут размещены ОФЗ с переменным купонным доходом на 7 млрд рублей с погашением в январе 2020 года.

Взгляд на рынок

Внешний фон нейтрален: фьючерсы на западные индексы утром не демонстрируют ярко-направленной динамики, торгуясь в «зелёной» зоне около «нуля». Слабая статистика из КНР продолжает давить на площадки АТР, которые утром снижаются. Котировки «Brent» продолжают двигаться в районе 44,3 долларов за баррель.

Открытие рынка ожидаем немного выше уровней закрытия вторника. Индекс ММВБ вчера закрылся похожей на «крест» «белой» свечой на уровне 1772,97 пунктов, предпосылок и сильных сигналов для разворота рынка «вверх» пока не наблюдается, хотя краткосрочно может наблюдаться небольшой коррекционный рост. Ближайшей поддержкой индекса остается диапазон 1730-1735 пунктов. Индекс РТС во вторник закрылся очередной, четвертой подряд, «черной» свечой на уровне 839,14 пунктов. Индекс «застрял» в уровне поддержки, который располагается в районе 835-840 пунктов. Пробой данного уровня может направить индекс еще ниже к 790-800 пунктам. В целом, на рынке пока сохраняется негативная картина. Не добавляют позитива цены на нефть, а также сохраняющаяся напряженность в отношениях России и Турции.

Сегодня внимание инвесторов привлечет пул данных по рынку труда из США, так как эти данные окажут влияние на принятие решения ФРС США, касательно изменения процентной ставки в декабре. Кроме того, сегодня ожидается выступление главы ФРС Джанет Йеллен. Наконец, сегодня станут известны предварительные данные по инфляции в Еврозоне за ноябрь.

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.