

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1903,03	-1,87%	-0,03%	-6,89%
Dow Jones	16153,54	-1,80%	-0,08%	-7,30%
NASDAQ	4516,95	-2,24%	-1,11%	-9,79%
S&P фьючерс	1893,00	-0,23%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5922,01	-2,28%	0,18%	-5,13%
DAX	9581,04	-1,81%	-2,46%	-10,82%
CAC 40	4283,99	-2,47%	-1,67%	-7,61%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	38596,17	-4,87%	2,93%	-10,97%
Nikkei 225	17169,97	-3,27%	0,54%	-9,79%
Shangh Composite	2707,55	-1,53%	1,31%	-24,22%
Hang Seng	18896,22	-2,83%	-0,37%	-13,77%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1758,26	-0,84%	3,12%	-0,18%
РТС	701,21	-4,00%	2,66%	-7,37%
ММВБ-10	3898,15	-1,13%	3,31%	-1,57%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
АЛРОСА ао	64,81	4,53%	Э.ОНРРоссия	2,79	-6,79%
+МосЭнерго	0,88	3,46%	ВТБ ао	0,07	-3,76%
Русал рдр	234,60	3,30%	Сургнфгз-п	44,60	-2,41%
Polymetal	668,50	3,20%	Сбербанк-п	67,96	-2,22%
ГМКНорник	8924,00	3,00%	ЛУКОЙЛ	2491,00	-2,20%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
2,27%	Металлургия	4,56%	Телеком.
0,94%	Телеком.	4,08%	Металлургия
0,89%	Потреб.	3,72%	Финансы
0,21%	Машиностр.	3,39%	Нефть и газ
-0,75%	Химпром	3,16%	Транспорт
-0,89%	Нефть и газ	2,15%	Потреб.
-0,93%	Транспорт	0,54%	Машиностр.
-1,09%	Энергетика	0,52%	Химпром
-1,56%	Финансы	0,01%	Энергетика

Фондовый рынок

- Фондовые рынки США завершили торги вторника ощутимым снижением по основным индексам, продолжая реагировать на негативные новости из Поднебесной, а также продолжавшуюся нисходящую динамику цен на нефть. Отметим, что нефть сорта WTI моментами снижалась ниже 30 долларов за баррель, что оказывало серьезное давление на американские компании энергетического сектора, которые лидировали в снижении. Еще одними лидерами снижения стали компании банковского сектора.
- Не обрадовали также данные от финансовой отчетности компании «ExxonMobil», которая сообщила о двойном снижении чистой прибыли в 4 квартале 2015 года, а разводненная прибыль на акцию упала до 0,67 доллара, тогда как годом ранее этот показатель составлял 1,56 доллара. Фармацевтическая компания «Pfizer» также сообщила о снижении чистой прибыли по итогам 4 квартала на 50%. Разводненная прибыль на акцию составила 0,1 доллара, против прошлогодних 0,19 доллара.
- Рынки Европы также продолжили снижение, отыгрывая «фактор Китая», а также следуя за понижательным движением цен на нефть. Падение цен на «черное золото» привело к распродажам среди компаний энергетического и горнодобывающего секторов европейской экономики.
- Акции «BP» упали почти на 9% на новостях о том, что квартальные доходы компании не оправдали ожиданий аналитиков. Плохо чувствовали себя также европейские банки, акции которых продемонстрировали снижение, в частности, крупнейший швейцарский финансовый холдинг «UBS» потерял вчера 6,8%.
- Внутренняя макростатистика по Европе, которая вышла во вторник, оказалась неоднозначной. Так, количество безработных в Испании выросло на меньшее количество, чем прогнозировали эксперты. Позитивные данные по безработице пришли также из Германии: в январе безработица составила 6,2%, тогда как прогноз предполагал 6,3%. В целом уровень безработицы в еврозоне составил 10,4%, что также оказалось лучше прогнозируемых 10,5%.
- Негативной, однако, стала статистика по розничным продажам Швейцарии, которые упали на 1,6% годовых в декабре, хотя прогнозировалось падение на 1,3%. Разочаровал также индекс деловой активности в строительном секторе Великобритании, который в январе составил 55 пунктов, против ожидаемых 57,5 пунктов. Индекс опустился до минимумов июля 2013 года.
- Отечественный фондовый рынок закончил торги вторника снижением на фоне негативной динамики на рынке «черного золота», что вызвало также ослабление национальной валюты. Понижительная коррекция на российском рынке, начавшаяся в понедельник, продолжилась, и индекс ММВБ потерял 0,84%, опустившись до 1758,26 пунктов. Индекс РТС вовсе снизился на 4% - до 701,21 пунктов. Объемы торгов немного возросли - до 38,67 млрд рублей.
- Международное рейтинговое агентство «Fitch» понизило прогнозы по росту экономики РФ в 2016 году: снижение ВВП составит 1%, тогда как предыдущий прогноз предполагал рост на 0,5%.
- Ослабление рубля привело к распродажам в банковском секторе: «ВТБ» потерял 3,8%, «Сбербанк» - 2,2%. Под «раздачу» также попали и нефтегазовые компании. «Лукойл» стал дешевле на 2,2%, обыкновенные акции «Татнефть» упали на 2,1%, привилегированные - на 1,7%. В плюсе оказались лишь акции

«Роснефть», которые прибавили 0,7%, а также обыкновенные акции «Сургутнефтегаза» (+1,7%).

- Ослабление рубля, с другой стороны, поддержало российские металлургические и горнодобывающие компании. Акции «АЛРОСА» прибавили 4,5%, «Русал» стал дороже на 1,9%. Акции «НЛМК» выросли на 2,8%. «Полиметалл» подорожал на 3,2%, «Норникель» - на 2,6%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	32,61	-0,34%	4,15%	-12,53%
Light	29,77	-0,37%	-3,44%	-19,63%
Алюминий	1504,00	0,20%	0,74%	0,20%
Золото	1128,90	0,15%	0,77%	6,45%
Медь	4523,90	-0,15%	1,01%	-3,89%
Никель	8460,00	1,00%	-2,14%	-4,08%
Пшеница	476,00	0,17%	-1,77%	1,28%
Серебро	14,30	0,04%	-1,35%	3,40%

Товарный рынок

- Мировые цены на нефть во вторник продолжили снижение, продолжая отыгрывать опасения, касающиеся глобального мирового роста. Напомним, что спусковым крючком для возвращения негативных настроений на рынки стала публикация индекса деловой активности в Китае в ночь на понедельник, который не оправдал ожиданий инвесторов. Также давит на цены на нефть факт того, что вероятность того, что встреча картеля ОПЕК с другими нефтедобывающими странами состоится в феврале, крайне мала.
- Отметим, что снижение нефтяных котировок было немного приостановлено ночью новостями от Американского института нефти, который сообщил о росте запасов на 3,837 млн баррелей, тогда как ожидался рост на 4,8 млн баррелей.
- Котировки золота на фоне негатива на мировых рынках продолжали рост до 1130 долларов за тройскую унцию, однако к вечеру цены на золото немного снизились, потеряв дневной рост.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	79,76	3,16%	1,86%	9,25%
EUR/RUB	87,10	3,38%	2,42%	9,87%
Бивалютная корзина	81,45	2,36%	-4,58%	7,63%
EUR/USD	1,0913	-0,04%	0,47%	0,49%
GBP/USD	1,4405	-0,02%	0,45%	-2,01%
USD/JPY	119,58	-0,31%	1,18%	-0,62%

Валютный рынок

- Внешний негатив, а также отрицательная динамика в нефтяных котировках продолжают оказывать давление на национальную валюту, которая слабела к доллару и евро второй день подряд. Несмотря на то, что ЦБ РФ сократил до минимума лимиты по операциям аукционного РЕПО и трехмесячным кредитным аукционам под залог нерыночного обеспечения с целью сокращения предложения рублевой ликвидности, снижение цена на нефть не оставило шансов рублю на укрепление. Курс рубля приближался к отметке 79 рублей за доллар, а курс евро – до 86 рублей за евро.
- Евро во вторник демонстрировал небольшое укрепление к доллару. Пара евро/доллар достигала отметки 1,094 доллара за евро. Индекс доллара моментами снижался 98,78 пунктов, демонстрируя ослабление «зеленого» к мировым валютам.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	123,28	-0,45%	0,46%	-2,26%
США 10-летние, %	1,85	-0,09	-0,14	-0,42
США 30-летние, %	2,66	-0,09	-0,12	-0,36
Россия 10-летние, %	10,51	0,11	-0,10	0,77
Россия 15-летние, %	10,35	0,09	-0,21	0,76

Долговой рынок

- Минфин РФ на очередном аукционе ОФЗ в среду предложит облигации двух серий общим объемом на 27,082 млрд рублей. Будут предложены облигации на 12,082 млрд рублей с индексируемым номиналом с погашением в августе 2023 года. Кроме того, будут предложены облигации с постоянным купонным доходом на 15 млрд рублей с погашением в августе 2021 года.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативен: фьючерсы на зарубежные индексы утром торгуются с отрицательной динамикой. Индексы торговых площадок АТР первую половину торгов также находятся в «красной зоне» на фоне поражающегося снижения цен на нефть.

Открытие рынка ожидаем ниже уровней закрытия вторника. Индекс ММВБ вчера закрылся черной свечой на отметке 1758,26 пунктов. Уровнем поддержки по индексу является уровень 1750 пунктов, который вчера смог удержать индекс от дальнейшего снижения, однако в случае сохранения негативных настроений, индекс ММВБ может направиться ниже – в район 1710-1730 пунктов. Индекс РТС также закрылся черной свечой на 701,21 пунктах, моментами опускаясь в ходе торгов ниже «круглой» отметки 700 пунктов, однако в районе 700 пунктов находится сильный уровень поддержки. В середине января индексу потребовалось 4 торговых сессии, чтобы «продавить» отметку 700 пунктов, однако дальнейшее снижение было стремительным. Сейчас, если снижение цен на нефть продолжится, что будет ослаблять рубль, а уровень 700 пунктов не выдержит напора продавцов, то индекс РТС снова может упасть в район 620-630 пунктов. Пока картина по рынку в целом сохраняется негативная, так как снижение цен на «черное золото» продолжается, а «фактор Китая» продолжает наводить страх на мировых инвесторов.

Сегодня будут опубликованы данные по индексам деловой активности в секторе услуг за январь в ряде европейских стран. Также мы узнаем, как изменились розничные продажи в декабре в целом по еврозоне. Наконец, важные данные будут обнародованы в США. В частности, станут известны январские значения индекса деловой активности в секторе услуг, композитного индекса деловой активности от Markit, а также индекса деловой активности в непроизводственном секторе. Минэнерго США также опубликует данные по изменению еженедельных запасов сырой 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, сублицензировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.