

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2091,69	2,05%	0,08%	1,59%
Dow Jones	17847,63	2,12%	0,28%	0,14%
NASDAQ	5142,27	2,08%	0,29%	8,58%
S&P фьючерс	2087,80	-0,03%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6238,29	-0,59%	-2,15%	-4,99%
DAX	10752,10	-0,34%	-4,80%	9,65%
CAC 40	4714,79	-0,33%	-4,37%	10,58%

Остальной мир

Bovespa	45360,76	-2,23%	-1,12%	-9,29%
Nikkei 225	19757,11	1,30%	-0,06%	13,16%
Shangh Composite	3539,04	0,40%	4,85%	9,41%
Hang Seng	22327,99	0,41%	1,42%	-5,41%

Россия

MMVB	1755,22	-1,79%	-2,25%	25,68%
PTC	811,72	-1,84%	-5,21%	2,66%
MMVB-10	3988,04	-1,88%	-2,21%	31,19%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Башнефт ао	2088,00	2,80%	Мечел ао	65,36	-4,19%
Башнефт ап	1799,00	1,70%	Магнит ао	11799,00	-4,00%
Аэрофлот	57,33	1,45%	Новатэк ао	584,30	-3,90%
ТМК ао	50,00	1,42%	Э.ОНРоссия	3,06	-3,48%
М.видео	271,60	1,40%	НЛМК ао	67,77	-3,45%

Отраслевая динамика индекса ММVB



Фондовый рынок

- Американские рынки в последний день минувшей недели продемонстрировали рост по основным индексам на 2,05-2,12% на фоне опубликованной макростатистики, которая, в целом, превзошла ожидания аналитиков. Данная статистика будет учтена ФРС на грядущем заседании при принятии решения по изменению ключевой ставки. Позитивные данные еще больше упрочили ожидания ужесточения монетарной политики в середине декабря.
- В пятницу стало известно, что число занятых в несельскохозяйственном секторе экономики США в ноябре выросло на 211 тысяч, тогда как аналитики ожидали рост на 200 тысяч. При этом количество занятых в частном несельскохозяйственном секторе в ноябре выросло на 197 тысяч, против ожидаемых 190 тысяч. Доля экономически активного населения в стране в том же месяце составила 62,5%, что также превысило ожидания экспертов (62,4%). Средняя почасовая заработная плата в ноябре выросла на 0,2% м/м, что совпало с консенсус-прогнозом. Наконец, подтвердил ожидания уровень безработицы, который в ноябре составил 5%.
- Европейские рынки в пятницу продемонстрировали снижение на 0,33-0,59%, продолжая отыгрывать разочарования, касающихся ожидаемого расширения программы количественного смягчения ЕЦБ. Напомним, что регулятор в четверг сохранил ключевую ставку на уровне 0,05%, снизив ставку по депозитам с -0,2% до -0,3%. Однако, инвесторов удивило решение ЕЦБ не расширять программу количественного смягчения QE с целью стимулирования экономики еврозоны, а лишь продлить ее до марта 2017 года.
- Негативное влияние на рынки также оказало решение ОПЕК сохранить квоты добычи «черного золота» на текущем уровне – 30 млн баррелей в сутки. Также было решено сохранить текущие уровни добычи, которые превышают квоту на 1,5 млн баррелей в сутки. Позитива могла внести новость о том, что объем промышленных заказов в Германии в октябре вырос на 1,8% в месячном выражении, тогда как ожидался рост на 1,2%. Однако удержать от падения немецкий индекс DAX эта новость не смогла.
- Отечественный рынок акций в минувшую пятницу снова закрылся в «красной» зоне на фоне резкого падения цен на нефть ниже 43 долларов за баррель «Brent». В итоге, индекс ММVB упал на 1,79% - до 1755,22 пунктов, а индекс РТС снизился на 1,84% и составил 811,72 пунктов. Объемы торгов при этом выросли по сравнению с четвергом до 38,557 млрд рублей.
- В пятницу стали известны данные по индексу потребительских цен, который в ноябре составил 0,8% в месячном выражении и 15% в годовом выражении, тогда как аналитики ожидали значение индекса на уровне 0,7% в месячном и 14,9% в годовом выражении.
- Решение ОПЕК сохранить квоты добычи нефти серьезно ударило по нефтегазовому сектору, что привело к снижению большинства компаний этой отрасли. Акции «Газпрома» упали на 1,6%, «Лукойл» потерял 2,55%, «Роснефть» - 3,03%, а привилегированные акции «Транснефти» снизились на 1,41%. Закрыться в «плюсе» смогли лишь акции «Башнефти», которые прибавили 2,76%.
- Акции «Аэрофлота» выросли на 1,45%. Компания объявила, что выходит из Ассоциации Эксплуатантов Воздушного Транспорта, где являлась крупнейшим участником.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	42,66	-3,24%	-4,73%	-25,86%
Light	39,54	-4,26%	-5,38%	-26,38%
Алюминий	1503,50	1,79%	2,98%	-18,84%
Золото	1084,40	2,18%	2,81%	-8,35%
Медь	4602,17	1,73%	2,43%	-26,13%
Никель	9045,00	2,43%	3,49%	-40,30%
Пшеница	489,20	1,79%	2,34%	-17,03%
Серебро	14,55	3,38%	3,93%	-7,27%

Товарный рынок

- Итоги заседания ОПЕК, которое проходило в пятницу в Вене, опустили нефтяные котировки на 3-4%. Цена барреля нефти марки «Brent» падала до 42,5 долларов. Напомним, что картель решил сохранить текущие уровни добычи «черного золота» - 31,5 млн баррелей в сутки, что превышает квоты (30 млн баррелей в сутки). Не поддержали рынок данные от «Baker Hughes», согласно которым, за прошедшую неделю число нефтяных буровых установок в США сократилось на 10 единиц, до 545 штук.
- Укрепление доллара в ожидании повышения ключевой ставки ФРС США не помешало росту котировок золота в минувшую пятницу. Золото дорожало более чем на 2% - до 1084 долларов за тройскую унцию.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	68,14	0,93%	2,49%	15,03%
EUR/RUB	74,06	0,28%	5,18%	2,85%
Бивалютная корзина	70,67	1,27%	3,45%	14,55%
EUR/USD	1,0860	-0,63%	2,63%	-10,26%
GBP/USD	1,5098	-0,18%	0,47%	-3,13%
USD/JPY	123,28	0,57%	0,44%	2,94%

Валютный рынок

- Национальная валюта в пятницу продолжила снижение к доллару и евро на фоне падающих цен на нефть. К доллару рубль потерял 0,93%, а к евро - 0,28%. В итоге курс доллара составил 68,14 рублей, а курс евро - 74,06 рублей.
- Позитивная статистика, вышедшая в пятницу в США, привела к укреплению доллара к мировым валютам. Индекс доллара рос на 0,44% - до 98,3 пунктов. К евро доллар укрепился на 0,63% - до 1,0806 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,65	0,02%	0,28%	19,26%
США 10-летние, %	2,29	0,00	0,06	0,12
США 30-летние, %	3,02	-0,01	0,02	0,27
Россия 10-летние, %	9,85	-0,03	0,00	-4,24
Россия 15-летние, %	9,57	-0,04	-0,06	-3,87

Долговой рынок

- На долговых рынках серьезных событий в пятницу не происходило. Доходность 10-15 летних ОФЗ остались почти без изменений на уровнях 9,85 - 9,57% годовых.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтральный: фьючерсы на западные индексы утром торгуются разнонаправленно. Площадки АТР в первый день недели демонстрируют рост на фоне укрепления доллара. Нефть продолжает торговаться в районе 42,7 долларов за баррель.

Открытие рынка сегодня ожидаем немного выше уровней закрытия пятницы. Индекс ММВБ закрылся в последний день недели длинной «черной» свечой на уровне 1755,22 пунктов. Пока очень реальным выглядит снижение индекса в район 1730-1735 пунктов в ближайшие торговые сессии. Если данный рубеж будет уверенно пройден, можно ожидать и дальнейшего снижения. Индекс РТС в седьмой раз подряд закрылся «черной» свечой, которая оказалась длиннее предыдущих. Индекс остановился на 811,72 пунктах, пройдя уровень поддержки в районе 830 пунктов. Не исключено продолжение негативной тенденции и снижения в район 780-790 пунктов. Положительных факторов, которые могли бы развернуть рынок «вверх» пока не наблюдается, итоги заседания ОПЕК опустили нефтяные котировки, а сезон выплат по внешним долгам окажет еще большее давление на национальную валюту.

Грядущая неделя будет не такой обильной на события, как предыдущая. Инвесторы будут ждать заседание ФРС США, которое состоится в начале недели следующей. Сегодня же важной макростатистики не ожидается.

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.