

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2052,23	0,23%	0,13%	-0,32%
Dow Jones	17574,75	0,47%	0,56%	-1,39%
NASDAQ	5045,17	0,44%	0,15%	6,53%
S&P фьючерс	2049,00	0,34%		

Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	6088,05	-0,63%	-2,98%	-7,28%
DAX	10598,93	0,06%	-1,76%	8,09%
CAC 40	4635,06	-0,05%	-2,01%	8,71%

Остальной мир

Bovespa	45630,71	-1,04%	-1,64%	-8,75%
Nikkei 225	19232,42	0,98%	-1,36%	10,15%
Shangh Composite	3426,23	-0,85%	-3,27%	5,92%
Hang Seng	21555,90	-0,69%	-2,75%	-8,68%

Россия

ММВБ	1732,89	-0,01%	-3,04%	24,08%
РТС	792,78	0,05%	-4,13%	0,26%
ММВБ-10	3906,71	-0,74%	-3,89%	28,51%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
БСП ао	43,80	5,04%	ММК	18,80	-5,65%
ЛУКОЙЛ	2445,00	2,50%	Сургутнефтегаз-п	42,40	-3,20%
НЛМК ао	65,90	2,49%	СОЛЛЕРС	414,00	-2,00%
Аэрофлот	59,84	2,47%	Yandex cIA	1030,30	-1,90%
Мечел ао	63,99	2,06%	Система ао	16,96	-1,65%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,29%	Транспорт	2,33%	Транспорт
0,17%	Финансы	-0,08%	Химпром
-0,03%	Нефть и газ	-0,15%	Телеком.
-0,06%	Потреб.	-1,47%	Энергетика
-0,14%	Химпром	-1,52%	Машиностр.
-0,22%	Телеком.	-2,32%	Потреб.
-0,29%	Металлургия	-2,50%	Финансы
-0,43%	Энергетика	-2,73%	Нефть и газ
-0,52%	Машиностр.	-3,66%	Металлургия

Фондовый рынок

- Американские рынки в четверг продемонстрировали небольшой рост в преддверии заседания ФРС США, которое состоится уже на следующей неделе. Согласно ожиданиям, регулятор наконец-то поднимет ключевую ставку, которая оставалась на рекордно низком уровне с 2008 года. Позитив в настроениях инвесторов не удалось сбить даже опубликованной внутренней статистике, которая в целом не оправдала ожиданий аналитиков.
- Так, число первичных заявок на пособие по безработице за прошедшую неделю составило 282 тысячи, тогда как неделей ранее показатель составлял 269 тысяч. Эксперты же прогнозировали, что количество заявок останется на прежнем уровне. Кроме того, индекс цен на экспорт в ноябре составил -0,6% м/м, тогда как прогнозировалось -0,3% м/м. При этом индекс цен на импорт оказался лучше ожиданий: -0,4% м/м против ожидаемых -0,7% м/м.
- Европейские площадки единой динамики вчера не показали: британский FTSE 100 снизился на -0,63%, французский CAC 40 – на 0,05%, а немецкий DAX вырос на 0,06%. Настроения инвесторов во время торгов в большей степени находились под влиянием внутренней статистики, которая в большинстве случаев не оправдала ожиданий. Отметим также, что вчера Банк Англии сохранил процентную ставку на прежнем уровне 0,5%, что и ожидалось экспертами.
- Также вчера вышла некоторая статистика по Великобритании. В частности, баланс цен на жилье от RICS в ноябре составил 49%, тогда как эксперты прогнозировали, что показатель составит 50%. Сальдо торгового баланса страны также разочаровало: в октябре дефицит составил 11,83 млрд фунтов стерлингов, тогда как ожидалось, что дефицит составил 9,7 млрд.
- Во Франции число занятых в несельскохозяйственном секторе в 3 квартале не изменилось, в то время, как консенсус-прогноз предполагал рост числа занятых на 0,1% кв/кв. Индекс цен потребителей в ноябре также разочаровал: -0,2% м/м, тогда как ожидалось, что показатель примет нулевое значение.
- Российский рынок акций вчера почти яркой динамики по итогам торгов вчера не продемонстрировал. В качестве поддержки для индексов выступал укреплявшийся рубль. Однако в итоге давление нефтяных котировок, снижавшихся ниже 40 долларов за баррель, сыграло свое дело, и индекс ММВБ закрылся в «красной» зоне, потеряв 0,01% и остановившись на отметке 1732,89 пунктов. Индекс РТС при этом смог удержаться в «зеленой» зоне и прибавил 0,05%, закрывшись на уровне 792,78 пунктов. Объемы торгов снизились до 30,034 млрд рублей.
- Международные резервы ЦБ РФ за прошедшую неделю сократились до 364,4 млрд долларов, тогда как ожидалось, что резервы вырастут до 365 млрд долларов. Недель ранее объем резервов составлял 364,9 млрд долларов.
- Акции металлургической компании «Мечел» вчера продемонстрировали рост: префы - на 6%, обыкновенные – на 2,06%. Бумаги были поддержаны сообщениями о том, что на внеочередном собрании акционеров будут рассмотрены сделки с крупнейшими кредиторами компании.
- В лидерах роста также оказался «Лукойл» (+2,5%), НЛМК (+2,49%) и «Аэрофлот» (+2,47%). Лидерами падения стали «ММК» (-5,65%), «Сургутнефтегаз» (-3,2%) и «Соллерс» (-2%).

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	39,48	-2,40%	-10,46%	-31,39%
Light	38,17	1,98%	-7,58%	-28,93%
Алюминий	1490,00	0,64%	0,88%	-19,57%
Золото	1066,40	-0,72%	0,48%	-9,87%
Медь	4606,57	0,99%	1,83%	-26,06%
Никель	8610,00	-0,69%	-2,49%	-43,17%
Пшеница	492,60	0,86%	2,50%	-16,45%
Серебро	14,04	-0,85%	-0,21%	-10,49%

Товарный рынок

- Цены на нефть все еще продолжают отыгрывать решение ОПЕК сохранить добычу на текущих уровнях. Не помогли даже позитивные данные от Американского института нефти и Минэнерго США, которые показали снижение запасов «черного золота». Цены на нефть марки «Brent» вчера падали ниже критической отметки в 40 долларов за баррель.
- Котировки золота под давлением грядущего собрания ФРС США вчера торговались в негативном ключе, теряя до 0,8%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	69,15	-0,31%	2,43%	16,74%
EUR/RUB	75,63	-1,06%	2,41%	5,03%
Бивалютная корзина	72,64	0,34%	4,14%	17,74%
EUR/USD	1,0933	-0,69%	0,04%	-9,65%
GBP/USD	1,5139	-0,28%	0,09%	-2,87%
USD/JPY	122,11	0,38%	-0,38%	1,96%

Валютный рынок

- Национальная валюта, несмотря на падение нефтяных котировок, укрепилась к доллару и евро. Поддержку «деревянному» оказали слова министра финансов «Антоня Силуанова о том, что Россия не намерена выходить из участников МВФ из-за изменения политики фонда, позволяющей Украине получать кредиты от организации при дефолте по долгу перед Россией на 3 млрд долларов. Кроме того, Силуанов заявил, что чистый отток капитала из страны составит 60 млрд долларов, что в два раза меньше первоначальных оценок.
- Доллар вчера демонстрировал рост к мировым валютам на фоне ожидания повышения ставки ФРС США на следующей неделе. Индекс доллара прибавил 0,45% и составил 97,77 пунктов. К евро доллар укрепился на 0,69% - до 1,0933 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,32	0,23%	-0,25%	18,94%
США 10-летние, %	2,23	0,01	-0,06	0,06
США 30-летние, %	2,96	-0,02	-0,07	0,21
Россия 10-летние, %	9,91	-0,02	0,03	-4,18
Россия 15-летние, %	9,56	-0,05	-0,05	-3,88

Долговой рынок

- Позитивные настроения в ходе вчерашних торгов также сказались на российских ОФЗ, доходности которых снизились на 0,02% для 10-летних ОФЗ и на 0,05% - для 15-летних ОФЗ.
- В целом серьезных событий на долговом рынке не происходило.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются разнонаправленно, без выраженной динамики. Площадки АТР также торгуются разнонаправленно. Падение йены поддерживает фондовые площадки Японии. Нефть марки «Brent» продолжает торговаться ниже 40 долларов за баррель.

Открытие рынка сегодня ожидаем в нейтральном ключе. Индекс ММВБ вчера в ходе торгов рос до 1745 пунктов, однако в итоге «нарисовал» крестообразную белую свечу, закрывшись на 1732,89 пунктах. Ближайший уровень поддержки по индексу лежит в районе 1705-1710 пунктов. Индекс РТС также вчера в ходе сессии тестировал отметку 800 пунктов, однако неудачно. В итоге индекс закрылся на 792,78 пунктах «белой» свечой. Снижение в район 760-770 пунктов по-прежнему выглядит реальным. Скорее всего, сегодня не стоит ждать серьезной динамики до объявления итогов заседания ЦБ РФ. В целом техническая картина указывает на возможность продолжения снижения по основным фондовым индексам.

Главное событие сегодняшнего дня – это собрание ЦБ РФ, на котором регулятор примет решение по ключевой ставке, впрочем, аналитики предполагают, что изменять ставку Центральный Банк не станет. Также большой объем данных сегодня будет опубликован в США. В частности, индекс розничных продаж, индекс цен производителей, объем розничных продаж. Кроме того, станут известны индексы ожиданий и настроений потребителей от Мичиганского университета.

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.