

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1829,08	-1,23%	-4,51%	-10,51%
Dow Jones	15660,18	-1,60%	-4,61%	-10,13%
NASDAQ	4266,84	-0,39%	-5,27%	-14,79%
S&P фьючерс	1836,10	0,64%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5536,97	-2,39%	-6,13%	-11,30%
DAX	8752,87	-2,93%	-6,82%	-18,52%
CAC 40	3896,71	-4,05%	-7,85%	-15,97%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	39318,30	-2,62%	-3,68%	-9,30%
Nikkei 225	15125,37	-3,74%	-9,40%	-20,53%
Shangh Composite	2763,49	-0,63%	-0,52%	-22,65%
Hang Seng	18447,14	-0,53%	-4,38%	-15,82%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1711,58	-1,11%	-4,27%	-2,83%
РТС	671,34	-3,63%	-9,13%	-11,32%
ММВБ-10	3751,38	-1,49%	-4,96%	-5,28%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Polymetal	712,50	4,60%	МегаФон ао	824,00	-4,00%
АЛРОСА ао	64,00	2,73%	Аэрофлот	53,64	-3,87%
СевСт-ао	663,90	2,40%	Новатэк ао	597,00	-3,10%
ПолюсЗолот	3169,00	2,00%	Россети ао	0,46	-3,05%
НЛМК ао	72,30	1,83%	Татнефть Зао	313,00	-2,81%

Отраслевая динамика индекса ММВБ



Фондовый рынок

- Торговую сессию четверга американские биржи завершили очередным снижением на фоне растущих опасений за перспективы глобального экономического роста. Опасения инвесторов были подогреты выступлением главы ФРС США Джанет Йеллен перед Конгрессом в среду. Йеллен признала, что экономика США столкнулась с определенными трудностями, а финансовые условия для роста экономики стали менее благоприятными. Глава регулятора также не исключила введение отрицательных процентных ставок в случае, если экономика будет испытывать серьезные проблемы. Этот факт оказал серьезное давление на мировые финансовые рынки.
- Негативным фактором также остаются низкие цены на нефть, которые вчера вновь тестировали психологическую отметку в 30 долларов за баррель марки «Brent». Под давлением традиционно оказались акции сырьевых компаний, кроме того, серьезные потери несли банки, так как именно банковский сектор недополучает деньги по кредитам, выданным энергетическим и сырьевым компаниям, которые в свою очередь «страдают» из-за низких цен на нефть. Лидировали в снижении такие банки как «Citigroup» и «Bank of America».
- Акции крупнейшего авиастроительного концерна «Boeing» вчера упали почти на 7% на новостях о том, что Комиссия по Ценным Бумагам США решила провести проверку отчетности компании. Поддержали индексы в четверг лишь данные по числу новых первичных заявок на пособие по безработице. Количество заявок за прошедшую неделю составило 269 тысяч, что ниже ожидаемых 281 тысяч и 285 тысяч, зафиксированных недель ранее.
- Европейские фондовые рынки также оказались под давлением страхов за состояние мировой экономики, которые усилились после выступления главы ФРС. В целом инвесторов беспокоят действия центральных банков, которые пока не могут оказать должного влияния на динамику экономического роста, несмотря на все заявления о попытках его стимулирования. Кроме того, давление на рынки оказывала негативная динамика цен на «черное золото».
- Европейские индексы в итоге проббили минимумы с сентября 2013 года, и это, скорее всего, не конец. Слабые финансовые отчетности таких крупных компаний как «Societe Generale», «Rio Tinto Group» и «Zurich Insurance Group» добавили негатива в настроения инвесторов. Именно банковский сектор вышел на передовую вместо энергетических компаний в последнее время и принимает на себя самые сильные удары. Индекс Stoxx 600 Lenders опустился уже до минимумов 2012 года, а такие гиганты, как «Credit Suisse», «Deutsche Bank» и «Standard Chartered» вчера потеряли около 5-6%.
- Российский рынок акций также закрылся в «красной» зоне на фоне снижения цен на «черное золото» и глобальных негативных настроений на мировых рынках. В итоге индекс ММВБ потерял 1,11%, снизившись до 1711,58 пунктов, а индекс РТС упал на 3,63% - до 671,34 пунктов. Объемы торгов вчера немного выросли - до 39,46 млрд рублей.
- Премьер-министр РФ Дмитрий Медведев вчера отметил, что Российская экономика демонстрирует неплохую устойчивость, большую, чем в 2009 году. Он отметил, что в 2009 году падение цен на нефть было не таким сильным, а ВВП потерял за год 7,9%. Сейчас же понижение цен на энергоносители более критичное, а ВВП снизился в 2 раза меньше, чем в 2009. Так же премьер заявил, что вероятность обращения в МВФ за помощью ничтожно мала.

- Кроме того, Дмитрий Медведев отметил важность строительства «Северного потока-2», также он сообщил, что не считает третий энергопакет Евросоюза справедливым, напротив он мешает некоторым странам.
- Также, на начавшейся международной конференции по безопасности в Мюнхене Россия и страны Запада начали обсуждать вероятное перемирие в Сирии на фоне взаимных обвинений в бомбардировках. Однако, глава МИД РФ Сергей Лавров сообщил, что российские ВКС будут продолжать операцию против ИГИЛ.
- На фоне снижения аппетита к риску растут цены на относительно безопасные активы, к которым относится золото, что повышает стоимость драгметалла. Этот факт оказывает поддержку горнодобывающим компаниям. Так, акции «Полюс Золото» прибавили 1,6%, а «Polymetal» подорожал на 4,6%. Также, на 2,73% выросли бумаги «АЛРОСА» после сообщения о добыче алмаза весом 121,95 карата.
- В целом, ослабление рубля поддержало российских металлургов-экспортеров. Так, подросли акции «Северсталь», «НЛМК» и «ММК».
- Кабинет Министров Украины вчера одобрил реструктуризацию долга двух местных компаний «Укравтодор» и КБ «Южное» перед «Сбербанком». Согласно реструктуризации будет списано около четверти общей суммы задолженности, которая составляет около 367 млн долларов. Акции «Сбербанка» снизились на 2,23%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	31,65	5,29%	-8,31%	-15,10%
Light	27,63	5,42%	-13,14%	-25,40%
Алюминий	1492,00	0,51%	-2,67%	-0,60%
Золото	1234,20	-1,09%	6,68%	16,38%
Медь	4450,05	0,60%	-4,45%	-5,46%
Никель	7705,00	1,00%	-9,67%	-12,64%
Пшеница	459,00	0,17%	-2,67%	-2,34%
Серебро	15,68	-0,72%	5,38%	13,42%

Товарный рынок

- Цены на «черное золото» вчера снова тестировали уровень в 30 долларов за баррель марки «Brent», однако ближе к полуночи намечился очередной рост в район 31,5 долларов за баррель. Давление на нефть оказывают беспокойства по поводу глобального экономического роста, так как замедление роста приведет к снижению спроса на нефть, что еще больше усилит разрыв между предложением и спросом, подвергнув давлению цены на энергоносители.
- Поддержку котировкам ближе к ночи оказали заявления министра энергетики ОАЭ о том, что ОПЕК готова сократить добычу нефти и собирается обсудить это с другими странами экспортерами, не входящими в картель.
- Котировки золота продолжали расти на фоне того, что спрос на относительно безопасные активы увеличивается из-за опасений инвесторов по поводу мировой экономики.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	79,59	1,25%	3,41%	9,03%
EUR/RUB	90,27	1,65%	4,74%	13,86%
Бивалютная корзина	84,23	0,10%	4,46%	11,30%
EUR/USD	1,1298	-0,21%	0,87%	4,03%
GBP/USD	1,4469	-0,04%	-0,65%	-1,57%
USD/JPY	112,70	0,27%	-3,42%	-6,33%

Валютный рынок

- Национальная валюта осталась без выбора из-за снижения цен на нефть и неуклонно теряла позиции перед долларом и евро. Курс евро пробил отметку 90 рублей, а курс доллара вплотную приблизился к отметке 80 рублей. Не помогли рублю и словесные интервенции главы ЦБ РФ о том, что регулятор никак не заинтересован в искусственном ослаблении рубля при падении цен на нефть.
- Индекс доллара вчера продолжил снижаться демонстрируя ослабление американской валюты к мировым валютам. DXY падал до 95,25 пунктов с 95,85 пунктов. Поддержку доллару вечером однако оказали сильные данные по рынку труда. К евро доллар слабел на 0,2% - до 1,1298 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	123,74	0,00%	-0,35%	-1,89%
США 10-летние, %	1,70	0,03	-0,14	-0,57
США 30-летние, %	2,55	0,06	-0,13	-0,47
Россия 10-летние, %	10,44	0,06	0,20	0,70
Россия 15-летние, %	10,23	-0,18	0,10	0,64

Долговой рынок

- Доходности российских 15-летних ОФЗ упали на 0,18% из-за роста спроса на относительно менее рискованные активы среди российских инвесторов на фоне распродаж на фондовом рынке.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются без единой динамики. Фондовый рынок Гонконга, однако, снова открылся в минусе на 1,44%. Площадки АТР, которые не закрыты на праздники, в первую половину сессии торгуются снижением, причем японский Nikkei 225 в минусе почти на 4%. Цены на нефть, однако, демонстрируют рост на заявлениях из ОАЭ.

Открытие рынка ожидаем в положительном ключе. Индекс ММВБ вчера нарисовал черную свечу с длинным хвостом, так как индекс в ходе торгов опускался до 1688 пунктов, однако к закрытию поднялся до 1711,58 пунктов. Пока уровень поддержки в районе 1700-1710 пунктов остается не пробитым, хотя сохранение негативных настроений может снова отправить индекс ММВБ тестировать отметку 1700 пунктов с целью ухода ниже в районе 1680 пунктов. Сегодня же с утра отмечается рост цен на нефть, что дает шанс на небольшой рост в течение сегодняшней сессии, а к закрытию индекс ММВБ, вероятно, достигнет отметки 1720-1730 пунктов. Индекс РТС вчера также черной свечой был отброшен к 671,34 пунктам из-за ослабления рубля ввиду падения цен на нефть. Как уже было написано выше, рост нефтяных котировок с утра дает шанс на небольшое повышение по индексу в течение сегодняшней сессии. Вероятно, индекс РТС попытается вернуться к отметке 700 пунктов.

Сегодня ожидается большой объем макростатистики из США. Так, будут опубликованы данные по розничным продажам за январь, предварительные оценки индексов потребительских настроений и ожиданий от Мичиганского университета за февраль. Кроме того, станут известны предварительные оценки ВВП Еврозоны за 4 квартал, ВВП Германии за 4 квартал и ИПЦ Германии за январь. Наконец, компания «Baker Hughes» опубликует данные по изменению числа буровых установок в США за прошедшую неделю.

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, публиковать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.