

## Ежедневный обзор рынков

## Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1890,28	-2,50%	-9,05%	-7,52%
Dow Jones	16151,41	-2,21%	-8,86%	-7,31%
NASDAQ	4526,07	-3,41%	-11,39%	-9,61%
S&P фьючерс	1880,50	-0,05%		

## Индексы фондовых рынков Европы

FTSE 100	5960,97	0,54%	-5,60%	-4,51%
DAX	9960,96	-0,25%	-8,28%	-7,28%
CAC 40	4391,94	0,30%	-6,58%	-5,29%

## Остальной мир

Bovespa	38944,44	-1,44%	-10,79%	-10,16%
Nikkei 225	16968,46	-4,22%	-11,06%	-10,85%
Shangh Composite	2917,52	-1,09%	-18,07%	-18,34%
Hang Seng	19608,96	-1,63%	-10,46%	-10,52%

## Россия

ММВБ	1684,78	-0,33%	-4,46%	-4,35%
РТС	693,65	-0,24%	-9,87%	-8,37%
ММВБ-10	3746,85	-0,64%	-5,00%	-5,39%

## Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Аэрофлот	55,00	3,29%	Россети ао	0,45	-3,14%
ВСМПО-АВС	12620,00	3,00%	ТМК ао	56,20	-2,85%
Башнефт ао	2070,00	2,90%	ИнтерРАО ао	1,32	-2,47%
Сбербанк-п	70,60	1,85%	ММК	17,85	-2,38%
М.видео	254,90	1,80%	МосБиржа	91,60	-2,29%

## Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
2,18%	Транспорт	2,99%	Энергетика
1,04%	Телеком.	0,52%	Химпром
0,27%	Потреб.	-1,27%	Потреб.
0,11%	Химпром	-1,42%	Металлургия
0,00%	Машиностр.	-1,86%	Машиностр.
-0,20%	Нефть и газ	-2,12%	Транспорт
-0,42%	Металлургия	-2,61%	Нефть и газ
-1,12%	Финансы	-3,11%	Телеком.
-1,30%	Энергетика	-5,21%	Финансы

## Фондовый рынок

- Фондовые площадки США закрыли торги среды в «красной» зоне на фоне продолжающегося падения цен на нефть, которые в течение торгов моментами опускались ниже отметки в 30 долларов за баррель. Негативные настроения инвесторов не смогли развеять даже позитивные данные из Китая по экспорту и импорту. Вчера стало известно, что объем экспорта Китая в декабре упал на 1,4% в годовом выражении, тогда как прогнозировалось падение на 8%. Объем импорта упал на 7,6% в годовом выражении. Аналитики ожидали снижения импорта на 11,5%.
- Все компоненты индекса широкого рынка вчера потеряли в стоимости. Худшие показатели продемонстрировали компании сектора потребительских услуг, а также сектора здравоохранения. Акции «Netflix» потеряли почти 9%, продемонстрировав сильнейшее падение с октября 2014 года. Акции «AbbVie» и «Celgene» упали более чем на 5,5%. Ощутимо потеряли в стоимости также промышленные и энергетические компании. Так, «CSX» потеряла около 6%, снизившись до минимумов 2013 года. «Williams Cos.» вовсе упала на 18%, что составило самое резкое падение с 2002 года.
- Европейские фондовые рынки закрылись вчера в основном ростом. Позитивные на настроения инвесторов повлияли данные по торговле Китая, а также некоторая внутренняя статистика. Небольшие потери нес лишь немецкий индекс DAX, который потерял 0,25%. Так, «BMW» и «Continental» потеряли около 2% стоимости в ходе торгов.
- Так, индекс потребительских цен Франции в декабре составил 0,2% в месячном выражении, что оказалось выше ожиданий экспертов, прогнозовавших 0,1% инфляцию в месячном выражении. В то же время, разочаровали данные по объемам промышленного производства еврозоны, которые упали на 0,7% м/м в ноябре. Аналитики прогнозировали снижение на 0,3% м/м.
- Хорошо вчера чувствовали себя энергетические компании, которым в последние торговые сессии доставалось больше всех. Так, на 4,7% выросли акции «Tullow Oil», а ценные бумаги крупнейшей немецкой энергокомпании «E.ON» стали дороже на 4,1%. Индекс энергетических компаний Европы, который последние 9 дней снижался, наконец-то смог оттолкнуться от минимумов 2009 года.
- Отечественный рынок акций также закрылся в отрицательном ключе на фоне депрессии нефтяного рынка. Большую часть торгов российский рынок провел в «зеленой» зоне, однако к вечеру очередная ветвь падения нефтяных котировок оказала сильное давление на индексы, продавив их ниже уровней открытия. В итоге индекс ММВБ потерял 0,33%, опустившись до 1684,78 пунктов, а индекс РТС снизился на 0,24% - до 693,65 пунктов. Объем торгов был ниже предыдущих значений: 27 млрд рублей.
- В лидерах роста оказались такие компании, как «Аэрофлот», акции которого прибавили 3,3%, «ВСМПО-Ависма», ценные бумаги которой подорожали на 3%, а также «Башнефт», прибавившая 2,9%. Среди лидеров снижения акции «Россети», потерявшие 3,14%, а также «ТМК» и «ИнтерРАО», которые стали дешевле на 2,85% и 2,47% соответственно.
- «Аэрофлот», согласно новостям, собирается создать вторую крупнейшую в России авиакомпанию, которая будет иметь флот из 74 самолетов. Компания будет создана с участием «Донавиа» и «Оренбургских авиалиний».

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	30,00	-0,92%	-19,59%	-19,53%
Light	31,43	0,13%	-15,44%	-15,15%
Алюминий	1464,50	0,17%	-4,47%	-2,43%
Золото	1093,40	0,58%	2,19%	3,10%
Медь	4335,40	0,54%	-7,78%	-7,89%
Никель	8380,00	2,01%	-3,57%	-4,99%
Пшеница	476,60	-0,29%	-0,33%	1,40%
Серебро	14,11	-0,33%	1,04%	2,06%

## Товарный рынок

- Вчера на рынке «черного золота» наблюдалось очередное падение котировок, которое произошло после публикации данных от Минэнерго США. Согласно полученным данным, запасы нефти в стране за прошедшую неделю выросли на 0,234 млн баррелей, что оказалось лучше прогнозов аналитиков, ожидавших 2,5 млн роста в запасах. Однако, это не привнесло позитива на рынок, более того, данная новость отправила котировки прямо в район 30 долларов за баррель марки «Brent», моментами цены падали даже ниже психологической отметки.
- Негативные настроения на рынке США оказали поддержку котировкам золота, которые росли на фоне спроса на менее рискованные активы.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	76,68	-0,50%	6,19%	5,04%
EUR/RUB	83,40	-0,30%	5,56%	5,19%
Бивалютная корзина	79,57	-0,54%	4,66%	5,15%
EUR/USD	1,0889	0,13%	-0,38%	0,27%
GBP/USD	1,4401	-0,03%	-2,91%	-2,03%
USD/JPY	117,39	-0,23%	-2,53%	-2,44%

## Валютный рынок

- Несмотря на падение цен на нефть, рубль вчера немного укреплялся как к доллару, так и к евро. Национальной валюте также помогли словесные интервенции от чиновников. Глава департамента кредитно-денежной политики ЦБ РФ Игорь Дмитриев на Гайдаровском форуме заявил, что регулятор может ужесточить монетарную политику в случае реализации рискованного сценария с ценой нефти в 35 долларов за баррель в 2016 году. Алексей Улюкаев вовсе сообщил, что существует вероятность выйти на среднегодовой курс в 63 рубля за 2016 год, что заложено в базовый прогноз властей РФ.
- Индекс доллара снижался до 98,87 пунктов, теряя около 0,05% на фоне падения рынка США. К евро доллар потерял 0,13%. Пара евро/доллар находится на отметке 1,088 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	123,43	-0,09%	-2,02%	-2,14%
США 10-летние, %	2,07	-0,07	-0,22	-0,20
США 30-летние, %	2,86	-0,05	-0,16	-0,16
Россия 10-летние, %	10,45	0,04	0,65	0,71
Россия 15-летние, %	10,27	0,01	0,69	0,68

## Долговой рынок

- Минфин вчера на очередном аукционе ОФЗ разместил облигации двух серий – на 17,3 млрд рублей. Были размещены облигации с погашением в 2020 году на 7,8 млрд рублей. Цена отсечения составила 86,35% от номинала, а доходность по данной цене – 10,62% годовых. Также были размещены ОФЗ с погашением в 2017 году на 9,523 млрд рублей. Цена отсечения составила 101,55% номинала, а доходность – 11,38% годовых.

## Взгляд на рынок

Внешний фон с утра умеренно негативный: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются разнонаправленно, но превалирует отрицательная динамика. Площадки АТФ первую половину торгов проводят в минусе из-за низких цен на нефть. Нефть марки «Brent» немного укрепляется после падения ниже 30 долларов за баррель.

Открытие рынка ожидаем на отрицательной территории ввиду негативного закрытия американского рынка и низких цен на нефть. Индекс ММВБ вчера закрылся черной свечой на уровне 1684,78 пунктов, в ходе торгов вновь тестируя уровень сопротивления на 1700 пунктах. Снова попытка пробить «круглую» цифру не удалась. Снизу индекс поддерживается уровнем в районе 1680 пунктов. Если индекс опустится ниже данного уровня, то можно ожидать снижения до 1610 пунктов. Индекс РТС вновь нарисовал черную свечу, в ходе торгов пробиваясь выше 700 пунктов, что закончилось неудачно. Индекс закрылся на 693,65 пунктах. Если текущая ситуация на рынке нефти будет продолжаться, а рубль снова начнет терять позиции перед долларом, то индекс может опуститься еще ниже: в район 625 пунктов.

Сегодня ожидаются данные по импорту и экспорту из США, кроме того, инвесторы обратят внимание на регулярную еженедельную статистику по числу первичных обращений за пособиями по безработице в США.

Наконец, «JP Morgan Chase» также сегодня официально откроет сезон финансовых отчетностей американских компаний.

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.