

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1921,84	1,67%	-7,53%	-5,97%
Dow Jones	16379,05	1,41%	-7,57%	-6,00%
NASDAQ	4615,00	1,97%	-9,65%	-7,84%
S&P фьючерс	1901,00	-0,71%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5918,23	-0,72%	-6,28%	-5,19%
DAX	9794,20	-1,67%	-9,82%	-8,83%
CAC 40	4312,89	-1,80%	-8,26%	-6,99%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	39500,11	1,43%	-9,52%	-8,88%
Nikkei 225	17162,25	-0,46%	-10,04%	-9,83%
Shangh Composite	2961,47	-1,54%	-16,84%	-17,11%
Hang Seng	19657,36	-0,81%	-10,24%	-10,30%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
MMVB	1680,77	-0,24%	-4,68%	-4,58%
PTC	692,99	-0,10%	-9,96%	-8,46%
MMVB-10	3730,11	-0,45%	-5,42%	-5,82%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
Система ао	18,38	4,70%	Распадская	26,21	-5,21%
Русал рдр	228,90	2,40%	Акрон	3715,00	-5,00%
Polymetal	611,00	1,80%	Мечел ао	60,35	-3,08%
Сбербанк	93,04	1,68%	ЧеркизГ-ао	998,00	-3,00%
НМТП ао	3,71	1,64%	Аэрофлот	53,60	-2,55%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
1,31%	Финансы	2,10%	Энергетика
0,32%	Телеком.	-1,82%	Металлургия
-0,24%	Нефть и газ	-1,84%	Химпром
-0,41%	Металлургия	-2,53%	Потреб.
-0,80%	Машиностр.	-2,65%	Машиностр.
-0,86%	Энергетика	-2,80%	Телеком.
-1,04%	Транспорт	-2,84%	Нефть и газ
-1,27%	Потреб.	-3,14%	Транспорт
-2,35%	Химпром	-3,97%	Финансы

Фондовый рынок

- Американские рынки продолжают находиться во власти шторма: отрицательная торговая сессия среды сменилась ростом индексов во время вчерашней сессии. Поводом тому стал коррекционный рост цен на нефть, который пришелся как раз на время торгов в США. Кроме того, позитивными оказались данные по результатам деятельности «JP Morgan Chase», который открыл сезон финансовых отчетностей в стране. Не помешали росту даже разочаровывающие данные по первичным заявкам на безработицу за прошедшую неделю.
- Инвестиционный банк «JP Morgan Chase» отчитался о результатах деятельности в четвертом квартале прошедшего года. Согласно полученным данным, чистая прибыль выросла на 10% до 1,32 доллара на акцию, тогда как аналитики прогнозировали рост показателя до 1,25 доллара на акцию. Следующими свои отчеты опубликуют банки «Citigroup», «Morgan Stanley», «Bank of America» и «Wells Fargo».
- Число первичных обращений за пособиями по безработице в США за прошедшую неделю выросло на 7 тысяч – до 284 тысяч. Эксперты же ожидали снижения показателя до 275 тысяч. Индекс цен на экспорт в декабре составил -1,1% м/м, хотя ожидалось, что показатель примет значение -0,5% м/м. В то же время, лучше ожиданий оказался индекс цен на импорт. В том же месяце показатель составил -1,2% м/м, тогда как аналитики прогнозировали -1,4% м/м.
- Не совсем спокойно и на европейских рынках, которые закрыли торги четверга на отрицательной территории на фоне новостей от автопроизводителя «Renault», не самой позитивной внутренней статистики, а также сохраняющихся опасений инвесторов за состояние мировой экономики. Мировые цены на нефть, которые никак не могут прекратить снижаться, а также слабая статистика из Китая вызывают беспокойство, касающееся перспектив глобального роста в экономике, что негативно сказывается на состоянии фондовых рынков.
- Известный автопроизводитель «Renault» сообщил о том, что французская полиция провела ряд рейдов в офисах компании и изъяла некоторые персональные компьютеры. Сообщается, что рейды были проведены в рамках расследования по делу о фальсификации выбросов немецкой компанией «Volkswagen».
- Напомним, что в сентябре немецкий автопроизводитель оказался в центре скандала, суть которого заключалась в том, что «Volkswagen» занижала показатели выбросов CO2 в атмосферу на своих дизельных автомобилях. В итоге, акции «Renault» упали на 10% к закрытию торгов. «Fiat» и «Chrysler Automobiles» также подешевели почти на 8% из-за сообщений о фальсификации данных по объемам продаж.
- Российский фондовый рынок в течение вчерашней сессии торговался преимущественно в минусе на фоне слабости нефтяного рынка, где котировки «черного золота» моментами падали ниже 30 долларов за баррель. Однако вечерний рост цен на нефть и позитив на американских площадках вернул оптимизм на российский рынок, однако этого не хватило, чтобы вернуть индексы в «зеленую» зону. В итоге, индекс ММВБ оказался в минусе на 0,24%, закрывшись на 1680,77 пунктах, а индекс РТС потерял 0,1%, снизившись до 692,99 пунктов. Объемы торгов составили 31,6 млрд рублей.
- Лидерами роста стали бумаги АФК «Система», которые подорожали на 4,7% на новостях о прекращении уголовного дела против главы компании Владимира Евтушенкова по факту покупки акций башкирского ТЭК. Башкирская электросетевая компания внесла 3% вклад в выручку «Системы», а также

принесла около 17% чистой прибыли в 2015 году. Дочерняя компания «Системы» «МТС» также росла в стоимости на 1,37%.

- В лидерах снижения оказались компания из ритейла. Так, «X5 retail» теряли 3,8% стоимости, акции «Lenta» падали на 3,3%, «O'Key» дешевела на 3%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	30,66	-0,71%	-17,82%	-17,76%
Light	31,66	-1,40%	-14,82%	-14,52%
Алюминий	1475,50	-0,47%	-3,75%	-1,70%
Золото	1081,30	0,72%	1,06%	1,96%
Медь	4344,22	-0,28%	-7,60%	-7,71%
Никель	8550,00	0,00%	-1,61%	-3,06%
Пшеница	467,20	-0,30%	-2,30%	-0,60%
Серебро	13,86	0,78%	-0,79%	0,22%

Товарный рынок

- Котировки «черного золота» продолжают колебаться в районе 30-31 долларов за баррель, моментами падая ниже психологической отметки в 30 долларов за баррель. Позитивных факторов, которые могли бы остановить падение пока не видно. Конечно, низкие цены на нефть вызывают снижение капиталовложений в отрасль, так как добывать больше нефти при таких ценах становится не выгодно. Кроме того, на выходных ожидается снятие санкций с Ирана, а уже на следующей неделе иранская нефть может хлынуть на итак переполненный рынок, что вероятно окажет дополнительное давление на цены.
- Котировки золота вчера снижались на фоне позитива на американских рынках и укреплении доллара. Однако ночью доллар стал немного терять позиции перед мировыми валютами, что вернуло котировки золота в «зеленую зону».

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	76,05	-0,82%	5,33%	4,18%
EUR/RUB	82,61	-0,94%	4,57%	4,20%
Бивалютная корзина	79,84	0,32%	5,01%	5,50%
EUR/USD	1,0884	0,18%	-0,43%	0,22%
GBP/USD	1,4404	-0,03%	-2,89%	-2,01%
USD/JPY	117,78	-0,22%	-2,20%	-2,11%

Валютный рынок

- Вчерашнее укрепление на рынке нефти, которые продолжались до позднего вечера позволили рублю снова отыграть часть потерь у доллара и евро. Несмотря на депрессию на рынке нефти, рубль смотрится достаточно уверенно. Удерживает национальную валюту от дальнейшего ослабления дефицит ликвидности. Так, банкам было предложено только 100 млрд при общем спросе в 320 млрд. ЦБ активнее применяет стратегию ограничения ликвидности с целью поддержать рубль.
- Индекс доллара вчера рос на 0,24% - до 99,13 пунктов на фоне позитива на американских биржах. Пара евро/доллар продолжала торговаться в районе 1,088 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	122,89	-0,44%	-2,45%	-2,57%
США 10-летние, %	2,08	0,01	-0,21	-0,19
США 30-летние, %	2,88	0,02	-0,14	-0,14
Россия 10-летние, %	10,47	0,02	0,67	0,73
Россия 15-летние, %	10,32	0,05	0,74	0,73

Долговой рынок

- Несмотря на слабость национальной валюты и низкие цены на нефть спрос на последнем аукционе ОФЗ оказался довольно-таки высоким, превысив предложение почти в 2 раза. За торговую сессию четверга доходности российских 10- и 15-летних ОФЗ остались почти без изменений.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня негативен: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются в красной зоне. Цены на нефть после вечернего роста снова демонстрируют снижение в район 30 долларов за баррель. Площадки АТР также позитива не приносят, снижаясь по основным индексам, отыгрывая динамику рынка «черного золота»

Открытие рынка сегодня ожидаем на нейтральной территории. Вчера индекс ММВБ закрылся черной свечой, в ходе торгов вновь тестируя уровень поддержки на 1680 пунктах. Пока индексу удастся удержаться выше данного уровня поддержки, однако пробой данной отметки скорее всего направит индекс в район 1610 пунктов. Индекс РТС вчера также продемонстрировал снижение, остановившись на отметке 692,99 пунктов. Здесь поддержкой выступает уровень на 690 пунктов. Если слабость национальной валюты перед долларом «продавит» индекс ниже, то мы можем увидеть падение РТС до 625 пунктов. Пока общая ситуация на российском рынке остается негативной, так как рынок нефти продолжает находиться в депрессии и не собирается из нее выходить. Рубль держится из последних сил, однако давление со стороны доллара велико.

В Америке начинает «разгоняться» сезон финансовых отчетностей местных компаний, поэтому стоит обратить внимание на публикуемые данные, так как они могут повлиять на ход торгов за океаном. Также сегодня будут опубликованы данные по инфляции за декабрь в Испании и Италии. Большой пул статданных выйдут в США, в частности: индексы розничных продаж, индекс цен производителей, индекс производственной активности, данные по промышленному производству. Наконец, еженедельные данные по количеству буровых установок опубликует «Baker Hughes».

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