

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	1880,33	-2,16%	-2,17%	-8,00%
Dow Jones	15988,08	-2,39%	-2,19%	-8,25%
NASDAQ	4488,42	-2,74%	-3,34%	-10,36%
S&P фьючерс	1879,00	0,21%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	5804,10	-1,93%	-1,83%	-7,02%
DAX	9794,20	-1,67%	-0,56%	-8,83%
CAC 40	4210,16	-2,38%	-2,85%	-9,21%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	38569,13	-2,36%	-5,03%	-11,03%
Nikkei 225	16918,75	-1,33%	-4,40%	-11,11%
Shangh Composite	2903,33	0,08%	-6,64%	-18,74%
Hang Seng	19304,76	-1,11%	-3,25%	-11,91%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1608,36	-4,31%	-8,02%	-8,69%
РТС	652,98	-5,77%	-11,38%	-13,75%
ММВБ-10	3576,50	-4,12%	-8,73%	-9,70%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
СОЛЛЕРС	383,00	1,00%	РусГидро	0,62	-7,28%
ПИКао	211,60	0,80%	Акрон	3440,00	-7,00%
Уркалий-ао	178,35	0,39%	ЛСР ао	623,00	-6,70%
Транснф ап	204500,00	0,00%	Сбербанк	87,27	-6,20%
Галс-Девел	1780,00	0,00%	Магнит ао	9640,00	-6,00%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день	Отрасль	Δ неделя	Отрасль
-0,62%	Машиностр.	-3,02%	Транспорт
-2,33%	Потреб.	-3,19%	Машиностр.
-2,47%	Транспорт	-5,34%	Химпром
-3,23%	Химпром	-5,48%	Телеком.
-3,55%	Нефть и газ	-5,90%	Нефть и газ
-3,60%	Энергетика	-6,81%	Металлургия
-3,70%	Металлургия	-6,95%	Потреб.
-3,71%	Телеком.	-7,09%	Финансы
-4,75%	Финансы	-7,45%	Энергетика

Фондовый рынок

- В последний день торгов предыдущей недели американские рынки полностью находились во власти медведей, которые нещадно «топтали» рынок на фоне обвала цен на нефть, а также очередного снижения на Китайской фондовой бирже. Кроме того, вышедший пул макростатистики также смог привнести свои капли в пятничное море негатива. В итоге основные индексы потеряли 2,16-2,74%. Отметим, что в понедельник, 18 января, фондовые биржи будут закрыты из-за празднования дня Мартина Лютера Кинга.
- По итогам пятницы фондовый рынок Китая закрылся в негативном ключе, потеряв более 3% на фоне слабых данных по банковскому кредитованию в стране. Так, объем выданных займов в декабре вырос на 14,3% в годовом выражении, тогда как аналитики ожидали роста на 14,8%. Негатив с востока оказал сильное влияние на настроения мировых инвесторов.
- Из пула пятничной макростатистики выделим разочаровывающие данные по базовому индексу розничных продаж, который в декабре составил -0,1% в месячном выражении, тогда как ожидалось 0,2% м/м. Объем розничных продаж также снизился в декабре на 0,1% м/м, хотя аналитики ожидали роста на 0,1% м/м. Из сектора производства также статистика пришла отнюдь не позитивная: объем промышленного производства в декабре упал на 0,4% м/м, тогда как прогноз предполагал снижения на 0,2% м/м.
- Лучом света в темную пятничную торговую сессию на биржах США стали данные от Мичиганского университета, согласно которым, по предварительным данным, индекс ожиданий потребителей, а также индекс настроений потребителей в январе оказались выше ожиданий аналитиков. Кроме того, хорошие данные в своих отчетностях предоставили банки «Citigroup» и «Wells Fargo».
- Волны распродаж на фондовых рынках также задели и европейские площадки, где основные индексы потеряли 1,67-2,38%. При этом, британский индекс FTSE 100 достиг минимума ноября 2012 года из-за обвала рынка нефти, которое ударило по компаниям металлургического и нефтяного секторов. Акции «BHP Billiton» потеряли более 6%. Компания сообщила, что собирается списать по сланцевым нефтегазовым активам в США более 7 млрд долларов и учтет эти списания в результатах за второе полугодие прошедшего года.
- Внутренняя статистика по Европе оказалась смешанной. Так, сальдо торгового баланса еврозоны в ноябре немного снизилось по сравнению с месяцем ранее и составило 23,6 млрд евро. ВВП Германии в 2015 году вырос на 1,7%. В Испании уровень инфляции в декабре отметился на нулевом уровне в месячном выражении, что совпало с ожиданиями аналитиков.
- На российском рынке акций минувшая пятница оказалась черной: волны распродаж еще больше «размыли» позиции основных индексов, которые итак не были крепкими. Индекс ММВБ потерял 4,31%, опустившись до 1608,36 пунктов, а индекс РТС вовсе упал на 5,77% - до 652,98 пунктов. При этом недельное падение индекса ММВБ составило 8%, а индекса РТС - 11,4%. Негативными факторами для отечественного рынка остается бесконечная депрессия на рынке нефти, а также внешний негатив.
- Под каток депрессии нефтяных котировок в первую очередь попали нефтегазовые компании. Так, «НОВАТЭК» подешевел на 5,62%, «Татнефть» потеряла 5,5%, акции «Сургутнефтегаза» упали на 4,5%, «Лукойл» снизился на 4,15%.

- Ослабление национальной валюты не оставило без внимание банковский сектор: «Сбербанк» упал на 6,2%, а «ВТБ» - на 3,3%. ЦБ РФ также отозвал лицензию у очередного банка, на сей раз под руку регулятору попался «Эргобанк».
- В пятницу также были опубликованы результаты деятельности «Газпрома» по МСФО за 3 квартал и 9 месяцев прошедшего года. Согласно полученным данным, чистая прибыль компании за 9 месяцев выросла на 21%, однако поддержки бумагам это не оказало. «Сбербанк» также опубликовал отчетность за 2015 год по РСБУ, согласно которой чистая прибыль банка сократилась на 24% и составила 236,3 млрд рублей.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	28,67	-0,93%	-13,62%	-23,10%
Light	30,22	-0,56%	-10,27%	-18,41%
Алюминий	1479,00	0,41%	-0,67%	-1,47%
Золото	1092,00	0,12%	-1,04%	2,97%
Медь	4338,71	1,26%	-1,60%	-7,82%
Никель	8565,00	2,00%	2,57%	-2,89%
Пшеница	473,00	0,94%	-1,13%	0,64%
Серебро	13,97	0,53%	-0,04%	1,05%

Товарный рынок

- Итак, санкции, которые действовали против Ирана почти 10 лет, сняты. Это означает, что теперь страна получит возможность «вылить» баррели нефти на уже итак переполненный рынок. Намечается борьба Ирана и Саудовской Аравии на место под солнцем, что не скажется позитивно на нефтяных котировках, которые в пятницу смогли наконец-то пробить 30 долларов за баррель. Не сильно оказали поддержку ценам даже данные от «Baker Hughes» о сокращении числа буровых установок в США.
- Паника на мировых рынках вызвала падение спроса на рисковые активы, такие как акции, и обратила внимание на менее рисковые активы, в частности, золото, котировки которого дорожали.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	77,60	2,04%	3,80%	6,31%
EUR/RUB	84,68	2,51%	5,04%	6,81%
Бивалютная корзина	79,93	0,11%	4,78%	5,62%
EUR/USD	1,0891	-0,20%	-0,18%	0,29%
GBP/USD	1,4277	0,17%	-1,72%	-2,88%
USD/JPY	117,23	0,27%	-0,14%	-2,57%

Валютный рынок

- Пробой нефтяных котировок психологического уровня в 30 долларов за баррель дал о себе знать укреплением доллара к рублю до 77 рублей. В итоге курс доллара оказался на отметке выше 77,5 рублей, обновив очередные экстремумы. К евро «деревянный» ослаб на 2.5% - до 84,68 рублей за единицу «единой валюты».
- В пятницу потери понес доллар, который ослаб к евро с 1,0867 до 1,0952 доллара за евро. Индекс доллара падали на 0,4% - до 98,7 пунктов.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	122,39	-0,41%	-3,43%	-2,97%
США 10-летние, %	2,04	-0,05	-0,08	-0,23
США 30-летние, %	2,82	-0,06	-0,09	-0,20
Россия 10-летние, %	10,67	0,20	0,75	0,93
Россия 15-летние, %	10,54	0,22	0,89	0,95

Долговой рынок

- Доходности российских 10- и 15-летних ОФЗ снова выросли на 0,2% и 0,22% соответственно на фоне распродаж на российском фондовом рынке и ухода инвесторов в менее рискованные активы, чем российские акции и ОФЗ.

Взгляд на рынок

Внешний фон утром понедельника нейтральный: фьючерсы на зарубежные индексы хоть и торгуются в большинстве в зеленой зоне, однако динамику показывают слабую. Кроме того, индексы АТР демонстрируют в основном негативную динамику на фоне продолжающегося снижения цен на нефть.

Открытие рынка ожидаем на уровнях закрытия пятницы. Индекс ММВБ в последнюю торговую сессию прошедшей недели нарисовал длинную черную свечу, которая чем-то напомнила то, что произошло в понедельник, когда индекс потерял около 4%. Индекс пробил уровень поддержки на 1680 пунктах и остановился у очередного более-менее крепкого уровня в районе 1600-1610 пунктов. Пробой данного уровня откроет возможности для снижения в район 1570-1580 пунктов. Индекс РТС также закрылся внушительной черной свечой на 652,98 пунктах, пробив поддержку на 690 пунктах. Целью снижения в ближайшее время может стать район 620-625 пунктов. Негативная ситуация на рынке сохраняется, давление на индексы по-прежнему велико.

Однако рынок на данный момент выглядит перепроданным, что повышает вероятность коррекции вверх, однако ни о каком развороте рынка говорить сейчас нельзя, пока не начнется разворот на рынке нефти, где продолжается затяжная депрессия.

Сегодня важной макростатистики не ожидается. Кроме того, фондовые рынки США закрыты на выходной день.

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.