

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
S&P 500	2041,89	-1,50%	-0,50%	-0,83%
Dow Jones	17495,84	-1,43%	-0,45%	-1,84%
NASDAQ	5002,55	-1,35%	-0,84%	5,63%
S&P фьючерс	2022,70	-0,10%		

Индексы фондовых рынков Европы

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
FTSE 100	6102,54	0,68%	0,24%	-7,06%
DAX	10738,12	2,57%	1,31%	9,51%
CAC 40	4677,54	1,14%	0,92%	9,71%

Остальной мир

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Bovespa	45261,48	0,55%	-0,81%	-9,49%
Nikkei 225	19585,53	1,20%	1,84%	12,17%
Shangh Composite	3580,17	0,00%	4,49%	10,68%
Hang Seng	21896,31	0,11%	1,58%	-7,24%

Россия

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
ММВБ	1780,97	1,50%	2,77%	27,52%
РТС	792,07	0,90%	-0,09%	0,17%
ММВБ-10	3988,51	1,47%	2,09%	31,20%

Лидеры роста/падения

Лидеры	Цена закр.	Δ день	Аутсайдеры	Цена закр.	Δ день
ТМКао	58,70	6,73%	Распадская	31,06	-2,72%
Акрон	3749,00	6,00%	Русал рдр	220,50	-2,30%
БСП ао	44,50	5,70%	НЛМКао	61,19	-2,16%
ГМКНорНик	9450,00	4,00%	+МосЭнерго	0,83	-1,78%
Роснефть	258,70	3,44%	ИнтерРАОао	1,10	-1,21%

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ день		Δ неделя	
3,22%	Химпром	6,66%	Химпром
1,93%	Нефть и газ	5,02%	Финансы
1,91%	Потреб.	3,90%	Энергетика
1,83%	Финансы	3,02%	Нефть и газ
0,87%	Транспорт	2,05%	Металлургия
0,59%	Металлургия	2,02%	Телеком.
0,58%	Машиностр.	1,92%	Потреб.
0,56%	Телеком.	0,47%	Машиностр.
0,06%	Энергетика	-1,52%	Транспорт

Фондовый рынок

- Американские рынки в четверг закрылись в «красной» зоне, потеряв по основным индексам от 1,35% до 1,5%. На динамику индексов повлияло продолжение снижения мировых цен на нефть и другое сырье. Кроме того, вышедшая в четверг макростатистика не оказалась однозначно позитивной. Теперь, когда неопределенность касательно изменения ключевой ставки спала, инвесторы сосредоточились на других факторах, среди которых как раз цены на топливо и макроэкономическая статистика.
- Снижение цен на нефть продолжает давить на энергетические компании. В частности, «Marathon Oil Corp» и «Williams Cos.» снизились более чем на 7% и стали в числе лидеров снижения в отрасли. Сырьевые компании также продемонстрировали снижение в среднем на 1,9%. «Newmont Mining» и «Freerport-McMogan» упали более чем на 7,7% на фоне падения цен на золото и медь. Также снизились на 1,6% компании финансового сектора.
- Дефицит баланса счета текущих операций США в 3 квартале вырос с 111,1 млрд долларов до 124,1 млрд долларов, тогда как ожидался рост дефицита лишь до 118 млрд долларов. Кроме того, индекс производственной активности от ФРБ Филадельфии в декабре составил -5,9 пунктов, тогда как ожидалось значение на уровне 1,5 пунктов после ноябрьских 1,9 пунктов, что также не обрадовало инвесторов. Однако не обошлось и без позитива: число первичных заявок на пособие по безработице за прошедшую неделю выросло на 271 тысячу, что оказалось меньше ожидаемых экспертами 275 тысяч.
- Рынки Старого Света вчера отыгрывали решение ФРС США по поводу ключевой ставки. Кроме того, вчера была опубликована некоторая макростатистика, которая оказалось смешанной. Однако, в итоге, основные индексы продемонстрировали рост на 0,68-2,57%. При этом рост европейских индексов наблюдается уже третью торговую сессию подряд.
- Внутренняя статистика по Великобритании вчера вся превзошла ожидания аналитиков. Базовый индекс розничных продаж в ноябре составил 1,7% в месячном выражении и 3,9% в годовом. Эксперты же ожидали 0,6% в месячном выражении и 2,3% в годовом. При этом объем розничных продаж в том же месяце вырос на 5% в годовом выражении и на 1,7% в месячном. Здесь аналитики прогнозировали годовой рост на уровне 3%, месячный – на уровне 0,5%. Наконец, индекс промышленных заказов СВИ в декабре вырос с ноябрьских -11 пунктов, до -7 пунктов, ожидалось, что индекс вырастет до -10 пунктов.
- В Германии, наоборот, вся статистика вышла разочаровывающей, что не помешало росту местного индекса DAX. Так, индекс делового климата IFO в декабре составил 108,7 пунктов, тогда как ожидалось значение 109 пунктов. Индекс деловых ожиданий в том же месяце отметился на 104,7 пунктах, при ожидаемых 105 пунктах. Наконец, оценка текущей ситуации в Германии, без учета будущих ожиданий, в декабре составила 112,8 пунктов, против ожидаемых 113,4 пунктов.
- Российский рынок акций также продемонстрировал рост вопреки падающим ценам на нефть и слабеющему рублю. Поддержку рынку оказали внешний позитив и заявления президента РФ Владимира Путина. В итоге индекс ММВБ вырос на 1,5% - до 1780,97 пунктов, а индекс РТС прибавил 0,9%, остановившись на отметке 792,07 пунктов. Объемы торгов выросли до 41,887 млрд рублей.
- На ежегодной пресс-конференции Владимир Путин заявил, что худшее уже позади, что со второго квартала наблюдаются

признаки стабилизации деловой активности. Президент по всем вопросам придерживался тональности – «Все будет хорошо!», однако конкретики по важным вопросам от него услышано не было.

- «Роснефть» закрывает сделки по реализации 50% долей в совместном предприятии с «ConocoPhillips» - компании «Полярное сияние». Это сообщение поддержало акции нефтяной компании, которые выросли на 3,44%.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Brent	37,09	-0,40%	-6,05%	-35,54%
Light	36,09	-1,80%	-5,45%	-32,81%
Алюминий	1480,00	-0,64%	-0,67%	-20,11%
Золото	1051,90	-1,47%	-1,36%	-11,10%
Медь	4530,51	-0,41%	-1,65%	-27,28%
Никель	8690,00	-0,57%	0,93%	-42,64%
Пшеница	482,60	0,25%	-2,03%	-18,15%
Серебро	13,72	-2,49%	-2,28%	-12,53%

Товарный рынок

- Мировые цены на нефть вчера продолжили нисходящий тренд, находясь под вышедшими на неделе данными от Минэнерго США и Американского института нефти, согласно которым, запасы сырой нефти в стране за прошедшую неделю выросли. Кроме того, вчера в США был утвержден фискальный план, подразумевающий снятие запрета с экспорта сырой нефти, что добавит новые баррели предложения на итак перенасыщенный мировой рынок.
- Решение повысить ставку ФРС США оказывает давление на стоимость большинства металлов. Котировки алюминия, золота, серебра, никеля и меди вчера демонстрировали снижение.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
USD/RUB	71,18	1,12%	2,94%	20,17%
EUR/RUB	76,92	0,12%	1,71%	6,82%
Бивалютная корзина	73,63	-0,11%	1,36%	19,34%
EUR/USD	1,0838	-0,06%	-0,87%	-10,44%
GBP/USD	1,4908	-0,28%	-1,53%	-4,35%
USD/JPY	122,56	0,07%	0,37%	2,34%

Валютный рынок

- Ослабление рубля вчера продолжилось на фоне негативной динамики цен на нефть, несмотря на поддержку от налогового периода в стране. «Деревянный» потерял к доллару 1,12%, а к евро ослаб на 0,12%.
- Доллар продолжает укрепляться к мировым валютам. Так, индекс доллара рос на 0,61% - до 99,18 пунктов, а к евро «зеленый» укрепился на 0,06% - до 1,0838 доллара за евро.

	Цена закр.	Δ день	Δ неделя	Δ с нач. года
Индекс ОФЗ	125,07	0,41%	-0,20%	18,71%
США 10-летние, %	2,22	-0,05	-0,01	0,05
США 30-летние, %	2,92	-0,05	-0,04	0,17
Россия 10-летние, %	9,99	-0,01	0,08	-4,10
Россия 15-летние, %	9,61	-0,06	0,05	-3,83

Долговой рынок

- На долговых рынках вчера серьезных событий не наблюдалось. Доходности 10- и 15-летних российских ОФЗ снизились, соответственно, на 0,01% и на 0,06%.

Взгляд на рынок

Внешний фон сегодня нейтрален: фьючерсы на зарубежные индексы торгуются с разнонаправленной динамикой. Площадки АТР в первую половину торгов в основном демонстрируют отрицательное движение. Цены на нефть марки «Brent» «отскочили» обратно к 37 долларам за баррель.

Открытие рынка сегодня ожидаем в отрицательном ключе. Индекс ММВБ вчера «нарисовал» третью подряд белую свечу, остановившись на отметке 1780,97 пунктов. Если индекс сможет пробить уровень 1800 пунктов и закрепиться выше него, то можно будет говорить о ростовом тренде по индексу, однако пока данный рост не выглядит зарождением тренда – сохраняется влияние негативных факторов на рынок, в частности, низких цен на нефть. Индекс РТС также закрылся белой свечой на 792,07 пунктах, пробить уровень сопротивления в районе 795-800 пунктов не удалось. По данному индексу взгляд аналогичный: пробитие уровня 800 пунктов и закрепление выше него станут сигналом к вероятному росту, в данный момент, говорить о зарождении ростового тренда рано. На индекс по-прежнему будет давить слабый рубль.

Сегодня важной макростатистики не ожидается, интересными могут быть данные от Baker Hughes об изменении числа буровых установок в США за последнюю неделю, что может повлиять на динамику мировых цен на нефть.

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.