

Ежедневный обзор финансовых рынков за 09.01.2014 года



ИНДИКАТОРЫ РЫНКА АКЦИЙ

Изменения индексов на мировых фондовых рынках (значение на закрытии дня):

Индекс	Страна	Закрытие	Изменение в % за день
ММВБ	РФ	1465,14	+0,17%
PTC	РФ	1388,86	-0,11%
Bovespa	Бразилия	49321,68	-2,48%
Shanghai Comp*	Китай	2021,41	-0,31%
BSE*	Индия	20821,86	+0,52%
S&P BRIC 40	BRIC	2275,02	-1,37%
DJI	США	16444,76	-0,11%
S&P 500	США	1838,13	+0,03%
NASD	США	4156,19	-0,23%
FTSE 100	Великобритания	6691,34	-0,45%
DAX	Германия	9421,61	-0,80%
CAC 40	Франция	4225,14	-0,84%
S&P Europe 350	Европа	1337,68	-0,47%
Nikkei*	Япония	15858,49	-0,14%
Topix Index*	Япония	1294,83	-0,15%
S&P Japan 500	Япония	1188,05	-0,76%
Hang Seng*	Гонконг	22902,20	+0,50%

*-данные на 9 - 30 мск
текущего дня

TOP-10 лидеров торгов по объему на фондовых рынках США:

Компания	Изменение за 1 день	Объем, шт.
Bank of America	+1,51%	101,275,343
Sirius XM Holdings Inc.	+0,53%	100,536,251
Facebook, Inc.	-1,73%	92,349,222
Ford Motor Co.	+1,93%	68,016,443
Plug Power Inc.	-27,03%	64,407,214
Alcoa Inc.	-1,29%	49,855,075
Micron Technology Inc.	-2,64%	42,829,964
Microsoft Corporation	-0,64%	36,520,448
AT&T, Inc.	-2,04%	36,121,929
Sprint Corporation	-5,61%	34,367,974

Обзор российского фондового рынка

Торговая сессия 9 января закрылась ростом. Индекс ММВБ вырос на 0,17%. Лучшую динамику из отраслевых индексов показал сектор машиностроения – рост на 1,65%. Среди акций лидерами роста были Русал рдр - рост на 5,5%, Э.ОН Россия – выросла на 2,67%. Лидерами падения были акции Полиметал – снижение на 3,2%, Ростел ап - падение на 2,09%. Объем торгов на фондовом рынке повысился и составил – 151 696,62 млн. руб. Объем торгов акциями составил – 137 961,66 млн. руб., объем торгов облигациями – 13 734,96 млн. руб.

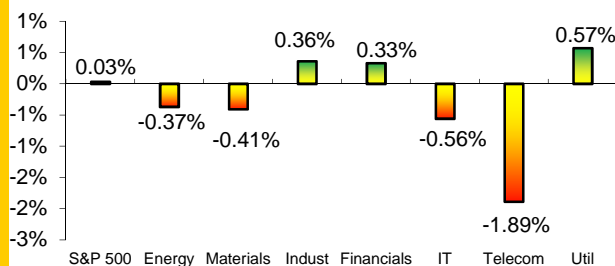
Ожидания на текущий день

Внешний фон нейтральный. Америка закрылась разнонаправленно. Европа закрылась падением. Япония торгуется в минусе на 0,14%, Китай торгуется в минусе, на 0,3%. Котировки на нефть в моменте: Brent – 106,78\$, WTI light - 92,49. Фьючерс на американский индекс SP500 сегодня торгуется плюсе.

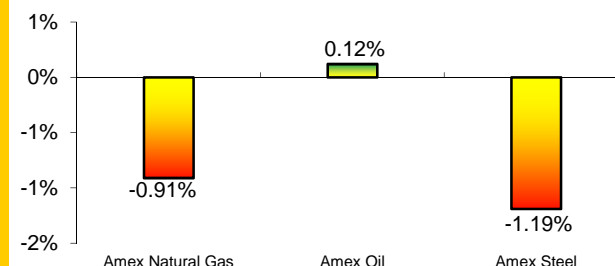
Отчетность компаний

Чистый убыток, приходящийся на акционеров ОАО "Мечел", за 9 месяцев 2013 года по US GAAP составил \$2,247 миллиарда, увеличившись в 4 раза. Выручка за 9 месяцев 2013 года составила \$6,7 миллиарда (-19% г/г). Консолидированный скорректированный показатель EBITDA за 9 месяцев 2013 года составил \$608 миллионов (-55% г/г).

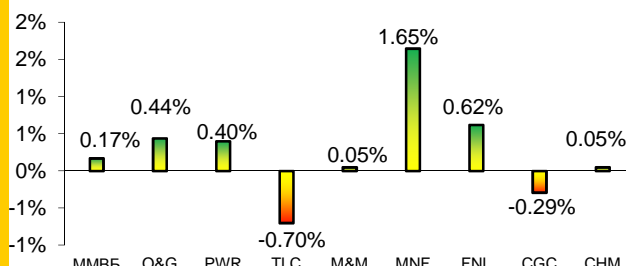
Изменение отраслевых индексов S&P USA



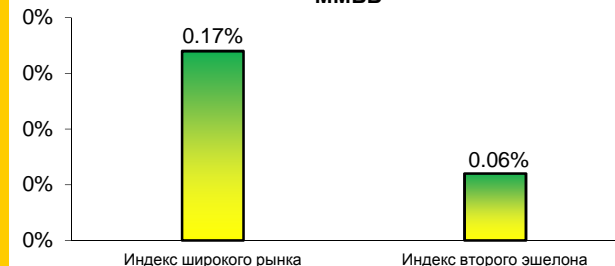
Изменение отраслевых индексов AMEX USA



Изменение отраслевых индексов ММВБ



Изменение капитализационных индексов ММВБ



События за 09.01.2014 года

Россия

- Банк России 31 декабря 2013 года сдвинул границы бивалютной корзины на 5 копеек вверх. Границы плавающего коридора были повышены с 33,05-40,05 руб. до 33,10-40,10 руб.
- Банк России продал в декабре 2013 года на внутреннем валютном рынке 3 569,93 млн. долларов США и 326,44 млн. евро.
- Денежная масса М2 в национальном определении на 1 декабря 2013 года составила 29 167,3 млрд. рублей, говорится в материалах Банка России. За ноябрь денежная масса выросла на 2,2%, с начала года - на 6,4%.
- Объем международных резервов РФ по состоянию на конец дня 27 декабря 2013 года составлял \$511,6 млрд против \$508,5 млрд на 20 декабря 2013 года.
- В декабре 2013 года инфляция в РФ составила 0,5%, по итогам 2013 года - 6,5%, говорится в материалах Росстата. Данные совпали с предварительной оценкой службы. В 2012 году в декабре инфляция составила 0,5%, за 2012 год - 6,6%.

В Европе

- Еврозона: индекс делового климата в декабре составил 0,27 пункта, ожидалось 0,22 пункта, предыдущее значение было пересмотрено с 0,18 пункта до 0,3 пункта.
- Германия: промышленное производство в ноябре увеличилось на 1,9% м/м, ожидалось +1,5% м/м, предыдущее изменение -1,2% м/м.
- Великобритания: ключевая ставка Банка Англии в январе составила 0,50%, как и ожидалось, предыдущее значение 0,50%.
- Еврозона: ключевая ставка ЕЦБ в январе составила 0,25%, ожидалось 0,25%, предыдущее значение 0,25%.
- Окончательный индикатор потребительского доверия в Еврозоне в декабре повысился до -13,6 пунктов (совпало с предварительным значением) с -15,4 пунктов в ноябре.
- В Великобритании в ноябре дефицит торгового баланса, как и ожидалось, составил 9,4 млрд фунтов стерлингов, в октябре дефицит составлял 9,7 млрд фунтов стерлингов.
- Во Франции в ноябре дефицит торгового баланса составил 5,7 млрд евро при ожидавшихся 4,6 млрд евро, в октябре дефицит торгового баланса составлял 4,8 млрд евро.

США

- Количество первичных обращений за пособиями по безработице на минувшей неделе составило 330 тыс, ожидалось 335 тыс, предыдущее значение было пересмотрено с 339 тыс до 345 тыс.

Азия

- Китай: профицит торгового баланса в декабре составил \$25,6 млрд, ожидался профицит в \$31,15 млрд, предыдущее значение профицита \$33,8 млрд.
- Япония: чистые вложения нерезидентов в японские акции выросли за минувшую неделю на 68,2 млрд йен, предыдущее изменение 491,6 млрд йен.

Товарные индексы

- Цены мирового рынка нефти по итогам торгов 9 января 2014 г. на ведущих нефтяных биржах понизились. Официальные цены нефтяных фьючерсов ближайшего месяца поставки составили:
 - ICE Brent Crude – 106,3 (-0,76) долл./барр.;
 - Light, Sweet Crude Oil – 91,66 (-0,67) долл./барр.

Индикаторы рынка облигаций:

Индексы корпоративных облигаций

Индекс	Изменение, %	Значение
MICEX CBI TR	-0,12%	244,27
MICEX CBI CP	-0,15%	93,34

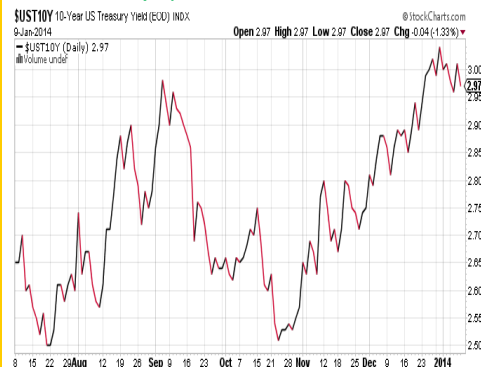
Индексы государственных облигаций

Индекс	Изменение, %	Значение
гос. обл. ММВБ	-0,20%	133,02
Эффективная доходность	7,21%	

Гос. облигации США

Наименование	YTM
UST 10	2,97↓
UST 30	3,88↓

График доходности UST10



Межбанковские ставки РФ

Наименование	Значение
MOSPRIME 1W	6,38↑
MOSPRIME 1M	6,78↓
MOSPRIME 3M	7,11↓

Межбанковские ставки Лондона

Наименование	Значение
LIBOR 1M	0,1675
LIBOR 3M	0,2381

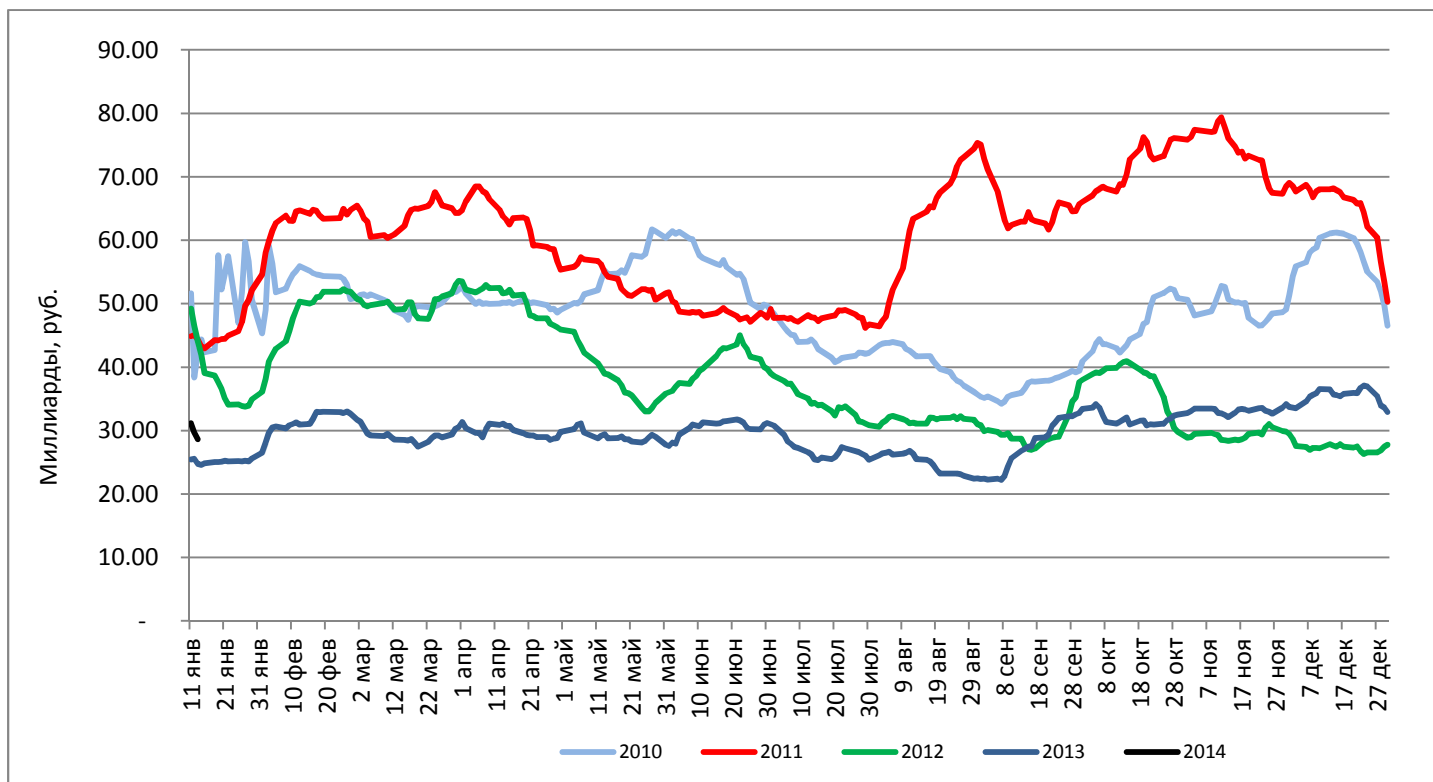
График открытого интереса на фьючерс индекс PTC (RH4)



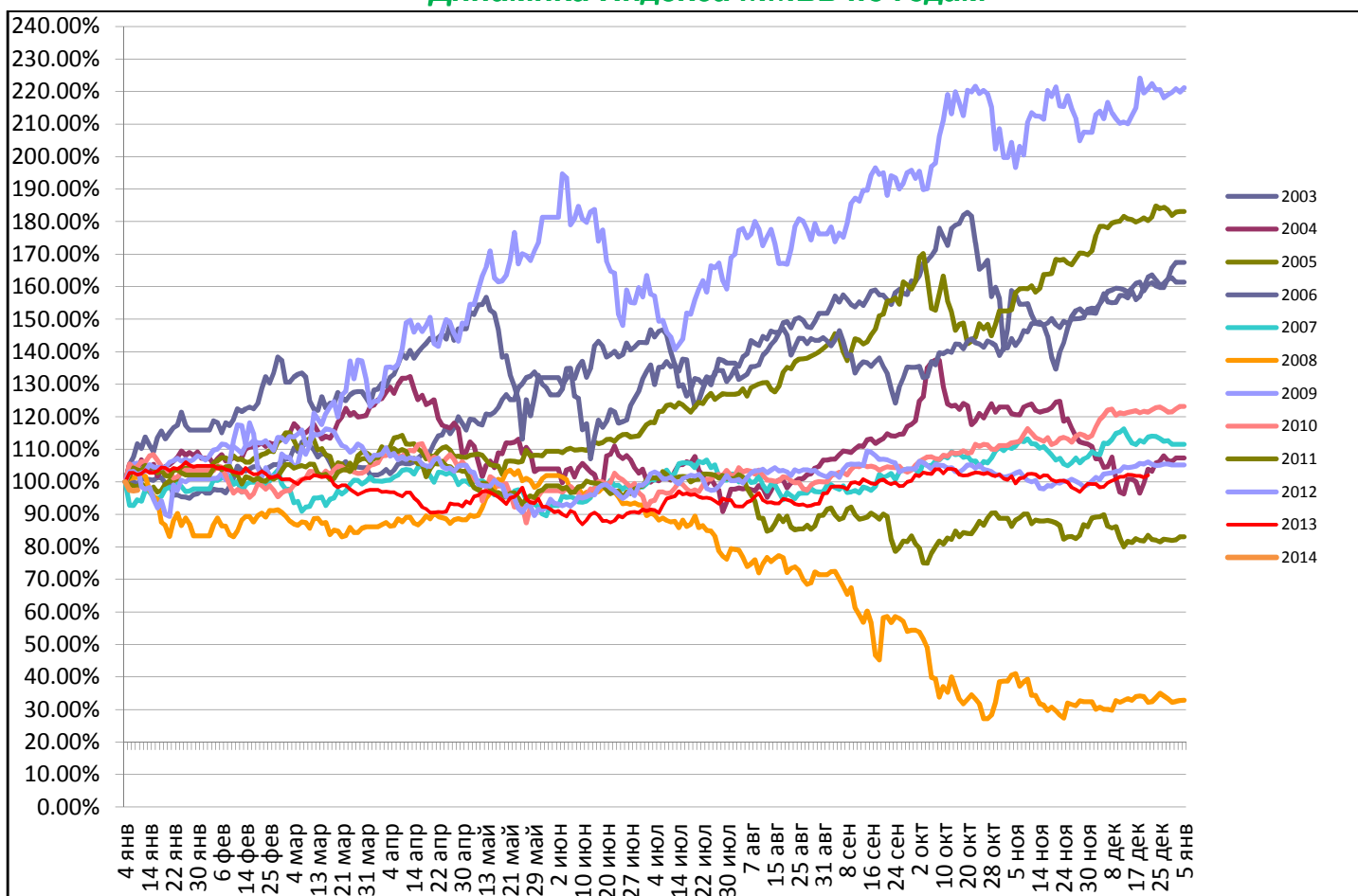
Количество открытых позиций 9 января повысилось на 8 тыс.



Объем торгов акциями (20-дн скользящее среднее)



Динамика Индекса ММВБ по годам





Обзор паевых инвестиционных фондов за 1 день.

Дата 30.12.2013г.

Фонд	Изм., %	Значение
АК БАРС - Акции	+0,22%	1167,52
АК БАРС - Сбалансированный	+0,17%	1546,90
АК БАРС - Консервативный	+0,18%	493,49
АК БАРС - Индекс ММВБ	+0,02%	2489,21
АК БАРС - Нефть и газ	+0,20%	1720,11
Фонд Динамического хеджирования	+0,11%	852,26

Предстоящие события 10.01.2014 г.

Россия

- Купонная выплата по облигациям ВТБ, БО-43, купонная ставка 7,6%, размер купона 18,95 руб. на облигацию.
- Купонная выплата по облигациям Россельхозбанк, 13, купонная ставка 7,7%, размер купона 38,39 руб. на облигацию.
- Купонная выплата по облигациям Новопластуновское, 01, купонная ставка 5,1%, размер купона 12,72 руб. на облигацию.
- Купонная выплата по облигациям Новая перевозочная компания, 01, купонная ставка 9,25%, размер купона 9,22 руб. на облигацию.
- Купонная выплата по облигациям Банк Держава, БО-01, купонная ставка 9,75%, размер купона 24,58 руб. на облигацию.
- Амортизация облигаций Новая перевозочная компания, 01, погашение номинала 50.

В США

- В 17:30 мск выйдут показатели занятости без учета сельскохозяйственного сектора за декабрь 2013г. Предыдущее изменение - рост на 196 тыс.
- В 17:30 мск - данные об уровне безработицы за декабрь. Предыдущее значение - 7,0%.
- В 17:45 мск состоится выступление президента ФРБ Ричмонда Джеффри Лэкера.
- В 22:05 мск - выступление президента ФРБ Сент-Луиса Джеймса Бумарда.

В Европе

- В 11:30 мск будут опубликованы данные индекса деловых настроений во Франции за декабрь. Предыдущее значение - 101 пункт.
- В 11:45 мск - данные о промышленном производстве во Франции за ноябрь. Предыдущее изменение - снижение на 0,3% в месячном выражении.
- В 13:30 мск будут опубликованы данные о промпроизводстве в Великобритании за ноябрь. Предыдущее изменение - рост на 0,4% в месячном выражении.
- В 14:00 мск - пересмотренные показатели ВВП зоны евро за III квартал 2013г. Предыдущая оценка - рост на 0,1% в квартальном выражении.

Отчеты компаний

-

Инвестиционное управление

Расим Саяхов - начальник инвестиционного управления
Максим Бугульминский - портфельный менеджер - управляющий портфелем облигаций
Олег Кокорев - портфельный менеджер - управляющий индексными портфелями
Данила Березин - портфельный менеджер - управляющий на срочном рынке
Марс Булатов - аналитик
Иосиф Найшулер - аналитик
Евгений Абрамов - программист
Телефон/Факс +7 (843) 518-66-77 Email: info@akbars-capital.ru

Общая информация

Лицензия ФКЦБ РФ на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными инвестиционными фондами № 21-000-100088 от 12 ноября 2002 года. Лицензия бессрочна. Лицензия ФСФР России на осуществление деятельности по доверительному управлению ценными бумагами № 116-10532-001000 от 11 сентября 2007 года. Лицензия бессрочная. Рейтинг надежности Национального Рейтингового Агентства «А+» (высокая надежность, первый уровень). Рейтинг качества управления пенсионными накоплениями Национального рейтингового Агентства: высокий уровень качества управления пенсионными накоплениями. Любые инвестиции в ценные бумаги являются в определенной степени рискованными. Существует вероятность возникновения реального ущерба или упущенной выгоды при осуществлении Управляющей компанией доверительного управления. Результаты деятельности Управляющей компании в прошлом не определяют доходы в будущем. Декларация о рисках инвестирования является неотъемлемой частью договора доверительного управления и подлежит обязательному подписанию инвестором. Информация о деятельности Управляющей компании раскрывается в сети Интернет по адресу: www.akbars-capital.ru