Ежедневный обзор рынка 25 марта 2016 г.

РУССОБАНК

Индекс	25.03.16	18.03.16	Изм.	
RTS	862,22	885,13	-2,59%	↓
MICEX	1866,23	1914,02	-2,50%	↓
S&P500	2035,94	2049,58	-0,67%	↓
DJIA	17515,73	17602,30	-0,49%	↓
Nasdaq	4773,505	4795,647	-0,46%	↓
DAX	9851,35	9950,80	-1,00%	↓
FTSE100	6106,48	6189,64	-1,34%	↓
CAC40	4329,68	4462,51	-2,98%	↓
Nikkei	17002,75	16724,81	1,66%	↑
SSE	2979,434	2955,150	0,82%	↑
HSI	20345,61	20671,63	-1,58%	↓
KOSPI	1983,81	1992,12	-0,42%	↓

Волатильность	25.03.16	18.03.16	Изм.	
VIX	146,04	150,65	-3,06%	↓
VDAX	2607,5	2810,0	-7,21%	↓
VSTOXX	109,10	112,40	-2,94%	↓
JGBV	0,0737	0,0776	-5,02%	↓
EMBI	21,47	21,10	1,75%	↑
VIX futures	713,0	667,6	6,80%	↑
TED spread	0,6954	0,7000	-0,66%	↓
Libor 3M	1,7700	1,6170	9,46%	↑
TED spread	95,3	95,8	-0,54%	↓
EM Corporates	10880	11400	-4,56%	↓
Euro Corporates	165,45	159,20	3,93%	↑
Euro Financials	17,58	17,73	-0,87%	↓

Валюта	25.03.16	18.03.16	Изм.	
USD/RUB	68,45	68,39	0,10%	↑
EUR/RUB	76,50	77,19	-0,90%	↓
Бивалютная корзина	72,07	72,35	-0,38%	↓
EUR/USD	1,1167	1,1270	-0,91%	↓
GBP/USD	1,4132	1,4476	-2,38%	↓
USD/CHF	0,9776	0,9695	0,84%	↑
USD/JPY	113,08	111,55	1,37%	↑
AUD/USD	0,7507	0,7608	-1,33%	↓
USD/CAD	1,3270	1,3004	2,05%	↑
USD/CNY	6,5160	6,4716	0,69%	↑
USD/HKD	7,7574	7,7550	0,03%	↑

Металлы	25.03.16	18.03.16	Изм.	
Золото	1217,05	1255,40	-3,05%	↓
Серебро	15,18	15,80	-3,93%	↓

Нефть	25.03.16	18.03.16	Изм.	
Brent	40,44	41,20	-1,84%	↓
WTI	39,46	39,44	0,05%	↑

Облигации	YTM,% 25.03.16	YTM,% 18.03.16	Изм.	
UST 10	1,9	1,8732	1,4%	↑
Russia 30	2,333	2,355	-0,9%	↓
Germ 10	0,179	0,211	-15,2%	↓

* Для фьючерсов указаны текущие котировки, для остальных инструментов – изменение за неделю. Для облигаций указана доходность к погашению.

Ключевые события прошедшей недели

Итоги: Индекс РТС в среду снизился на 1,4% (пятый день подряд) и по итогам недели потерял 1,0% (третья неделя подряд). Индекс ММВБ по итогам недели потерял 2,5%. Объем торгов акциями на ММВБ составил 265 млн (прогноз: 267) против 259 млн (прогноз: 265) днем ранее. Индекс ММВБ-10 потерял 2,8% (прогноз: потеря 3,0%), индекс РТС потерял 4,7% (прогноз: потеря 4,9%). Индекс ММВБ-10 по итогам недели потерял 1,0% (прогноз: потеря 0,2%), индекс РТС потерял 1,7% (прогноз: потеря 1,8%). Индекс ММВБ-10 закрылся на отметке 512 млн, против 502 млн (прогноз: 494). Индекс ММВБ-10 по итогам недели (прогноз: 51,4) составил 51,3 (прогноз: 51,6), индекс РТС – 51,4 (прогноз: 51).

Акции: Индекс GfK в феврале составил 9,4 (прогноз: 9,5), в марте – 9,5. Индекс потребительской уверенности Conference Board в феврале составил 54,0 (прогноз: 53,5), в марте – 53,3 (прогноз: 53). Индекс потребительской уверенности Conference Board в феврале составил 51,4, против 51,2 (прогноз: 51). Индекс деловой активности в производственном секторе Chicago PMI в марте составил 49,7 (прогноз: 49,0), против 49,0 (прогноз: 49). Индекс ISM в производственном секторе в феврале составил 49,5 (прогноз: 49,0), против 48,2 (прогноз: 48,5). Индекс деловой активности в производственном секторе Markit в марте составил 52,9 (прогноз: 52,5), против 52,5 (прогноз: 52,6). Индекс деловой активности в производственном секторе ISM в марте составил 51,8 (прогноз: 51,5), против 51,1 (прогноз: 51,2). Индекс деловой активности в производственном секторе Markit в марте составил 52,5 (прогноз: 52,6), против 52,6 (прогноз: 52,5). Индекс деловой активности в производственном секторе ISM в марте составил 51,3 (прогноз: 51,6), против 51,3 (прогноз: 51).

Облигации: Индекс потребительских цен в феврале составил 0,6% (прогноз: 0,3%), в марте – 1,5%. Индекс потребительских цен в феврале составил 0,4% (прогноз: 0,4%), в марте – 1,1