ЦИФРА брокер

Волатильность сохраняется

Обзор российского рынка на 11 июня

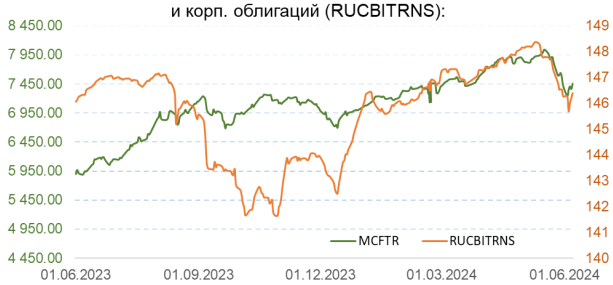
Рыночные индикаторы

Индексы		Значение	За день	Изм. YTD
МосБиржи	IMOEX	3 192.38	-0.62%	3.01%
РТС	RTSI	1 131.97	-0.74%	4.48%
Гос. облигаций	RGBITR	574.89	-0.78%	-6.73%
Корп. облигаций	RUCBITRNS	146.56	0.11%	0.86%
Валюты		**Курс**	**За день**	**Изм. YTD**
Доллар США	USD	88.5500	-0.89%	-2.00%
Евро	EUR	95.3400	-1.28%	-4.30%
Китайский юань	CNY	12.1725	-0.68%	-3.48%
Нефть и металлы*		**Значение**	**За день**	**Изм. YTD**
Brent	USD/bbl	81.27	1.68%	3.91%
Золото	XAU/USD	2315	-0.08%	9.79%
Серебро	XAG/USD	29.89	1.08%	21.45%
Лидеры роста и аутсайдеры, в % к предыдущей сессии:				
EUTR	ЕвроТранс	188.70	3.37%	
ENPG	ЭН+ГРУП ао	455.55	3.29%	
HHRU	iHHRU-адр	5100.00	1.37%	
UPRO	Юнипро ао	2.00	1.21%	
SELG	Селигдар	71.05	1.18%	
GAZP	ГАЗПРОМ ао	119.00	-3.08%	
POSI	iПозитив	3010.00	-3.27%	
MSNG	+МосЭнерго	2.95	-3.39%	
RENI	Ренессанс	102.00	-3.48%	
AGRO	AGRO-гдр	1414.00	-4.77%	

**- фьючерсы с ближайшей датой исполнения*

По данным «Московская Биржа» на 10.06.2024 23:59 мск

Динамика индексов полной доходности акций (MCFTR) и корп. облигаций (RUCBITRNS):



Динамика отраслевых индексов за день

Рынок накануне. Индексы не смогли развить восстановление. В понедельник индекс МосБиржи понизился на 1,62% до 3180,94 п., индекс РТС ослаб на 1,08% до 1130,91 п. на фоне умеренного укрепления рубля. Индекс RGBI не удержался на максимумах прошлой недели, снизившись в понедельник на 0,88%.

Предварительная оценка исполнения федерального бюджета в январе-мае текущего года могла способствовать укреплению рубля. По данным Минфина, объем доходов федерального бюджета в январе-мае 2024 года составил 14289 млрд руб. Нефтегазовые доходы составили 4951 млрд руб., ненефтегазовые доходы федерального бюджета достигли 9 338 млрд руб. Таким образом, бюджетный баланс вновь стал положительным (на уровне 501 млрд руб.), а накопленное в 2024 году отставание доходов от расходов снизилось в полтора раза — с 1,484 трлн руб. по итогам четырех месяцев до 983 млрд руб. по результатам первых пяти месяцев года.

Данные по внешней торговле тоже выступают на стороне рубля. По оценке Федеральной таможенной службы, внешнеторговое сальдо РФ в январе-апреле 2024 года выросло по сравнению с аналогичным периодом 2023 года на 18,8% и составило $50,5 млрд. Экспорт товаров из России в указанном периоде сократился до $135,1 млрд, на 0,3% в годовом выражении, импорт – на 9,1%, до $84,6 млрд.

Директор департамента денежно-кредитной политики Банка России Кирилл Тремасов сообщил в понедельник, что денежно-кредитные условия достигнут максимальной жесткости в III квартале 2024 года, если этого будет недостаточно для замедления спроса и инфляции, а Банк России будет готов повысить ключевую ставку в июле более чем на 100 базисных пунктов. Столь жесткая позиция Банка России тоже может оказывать поддержку рублю, но неблагоприятно отражается на динамике котировок на долговом рынке.

Новости, ожидания и торговые идеи. Слабая динамика в сегменте ОФЗ оказывает давление на рынок акций. Таким образом, устойчивое восстановление фондовых индексов будет возможным после того, как стабилизируется ситуация в сегменте суверенного долга. До этого времени волатильность на рынке акций может оставаться повышенной.

В понедельник индекс RVI, отражающий уровень волатильности на российском фондовом рынке, повысился до 24,05 п. по сравнению с достигнутым на прошлой неделе максимумом на уровне 28,44 п.

Пырьева Наталия 8 (800) 100 40 82
Аналитик research@cifra-broker.ru

ЦИФРА брокер

КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Юридический адрес
123112, г. Москва,
1-й Красногвардейский проезд,
д. 15, офис 18.02
м. Выставочная или Международная
Тел.: +7 (495) 783-91-73
Email: info@cifra-broker.ru

Фактический адрес
123112, г. Москва,
1-й Красногвардейский проезд,
д. 15, 18 этаж,
(Башня «Меркурий Тауэр»,
ММДЦ «Москва-Сити»)

Поддержка клиентов
Тел.: +7 (495) 783-91-73,
8-800-100-40-82
E-mail: shop@cifra-broker.ru

Для корпоративных клиентов
Тел.: +7 (495) 783-91-73 доб. 90999
E-mail: corp.clients@cifra-broker.ru

Ограничение ответственности: ООО «Цифра брокер» (ОГРН 1107746963785, 123112, Москва, 1-й Красногвардейский проезд, дом 15, офис 18.02). Лицензия №045-13561-100000 на осуществление брокерской деятельности, срок действия лицензии не ограничен. Сайт: https://cifra-broker.ru/ Телефон: +7 (495) 783 91 73. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Упомянутые финансовые инструменты или операции могут не соответствовать вашему инвестиционному профилю и инвестиционным целя (ожиданиям). В приведенной информации не принимаются во внимание ваши личные инвестиционные цели, финансовые условия или нужды. Определение соответствия финансового инструмента либо операции инвестиционным целям, инвестиционному горизонту и уровню допустимого риска является вашей задачей. ООО «Цифра брокер» не несет ответственности за возможные убытки инвестора в случае совершения операций либо инвестирования в финансовые инструменты и не рекомендует использовать данный материал в качестве единственного источника информации для принятия инвестиционного решения. Владение ценными бумагами и прочими финансовыми инструментами всегда сопряжено с рисками: стоимость ценных бумаг и прочих финансовых инструментов может как расти, так и падать.