ЦИФРА брокер

Ротация по секторам

Обзор российского рынка на 1 июля

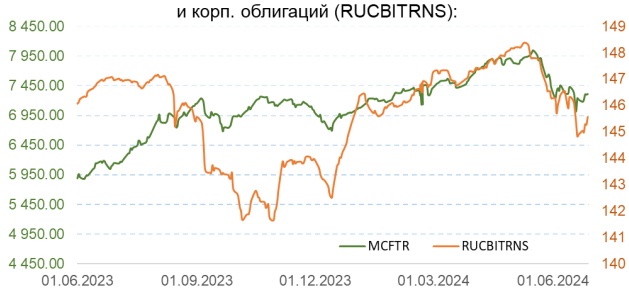
Рыночные индикаторы

Индексы		Значение	За день	Изм. YTD
МосБиржи	IMOEX	3 154.36	0.13%	1.78%
РТС	RTSI	1 158.85	-0.79%	6.96%
Гос. облигаций	RGBITR	571.34	0.37%	-7.31%
Корп. облигаций	RUCBITRNS	145.57	0.21%	0.18%
Валюты		**Курс**	**За день**	**Изм. YTD**
Доллар США*	USD/RUB	87.0520	1.52%	-3.66%
Евро*	EUR/RUB	92.9490	1.30%	-6.70%
Китайский юань	CNY/RUB	11.7345	0.18%	-6.95%
Нефть и металлы*		**Значение**	**За день**	**Изм. YTD**
Brent	USD/bbl	86.47	0.61%	10.56%
Золото	XAU/USD	2392	0.34%	13.42%
Серебро	XAG/USD	30.30	1.10%	23.12%
Лидеры роста и аутсайдеры, в % к предыдущей сессии:				
ELFV	ЭЛ5Энер ао	0.6064	4.84%	
NVTK	Новатэк ао	1091.8	4.14%	
TRNFP	Транснф ап	1621.50	1.76%	
FLOT	Совкомфлот	121.25	1.56%	
AFKS	Система ао	23.75	1.40%	
VKCO	МКПАО "ВК"	502.6	-1.61%	
MVID	М.видео	166.00	-2.47%	
CIAN	CIAN-адр	826.80	-2.73%	
GLTR	GLTR-гдр	638.10	-3.06%	
SELG	Селигдар	62.23	-4.38%	

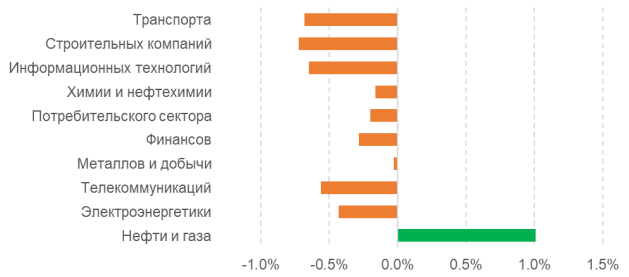
**- фьючерсы с ближайшей датой исполнения*

По данным «Московская Биржа» на 28.06.2024 23:59 мск

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



Динамика отраслевых индексов за день



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

Рынок накануне. Позитивная динамика в нефтегазовом секторе поддержала рынок. Индекс МосБиржи в пятницу повысился на 0,13% до 3154,36 п., индекс РТС, наоборот, снизился на 0,79% до 1158,85 п. на фоне небольшого ослабления рубля. По итогам недели индексы прибавили соответственно 1,28% и 3,90%. Кривая доходности ОФЗ сроком погашения от двух до пяти лет сместилась вниз за неделю на 17-37 б. п., а индекс RGBI отступил от многомесячных максимумов и повысился на 1,45%, несмотря на опубликованные на неделе разочаровывающие данные по инфляции.

Тем не менее рассчитывать на устойчивое восстановление в сегменте суверенного долга пока не приходится. Помимо высокой инфляции и, как следствие, ожиданий повышения ключевой ставки Банком России на заседании в июле, давление на рынок ОФЗ могут оказывать планы Минфина по размещению облигаций в III квартале 2024 года. В пятницу стало известно, что с июля по октябрь включительно Минфин планирует разместить ОФЗ на 1,5 трлн руб., из которых 300 млрд руб. – ОФЗ с дюрацией до 10 лет и 1,2 трлн руб. – ОФЗ с дюрацией 10 и более лет.

Во II квартале план по размещениям был выполнен только наполовину от установленного объема в 1 трлн руб. На фоне повышенной рыночной волатильности Минфин отменил аукционы по размещению облигаций 29 мая и 5 июня. В I квартале Минфин привлек почти 805 млрд руб. при запланированном объеме привлечения 800 млрд руб. В целом в 2024 году валовый объем привлечения на внутреннем рынке составит 3,921 трлн руб.: программа внутренних заимствований будет скорректирована в меньшую сторону, до 2,479 трлн руб. Еще 1,442 трлн руб. потребуется на погашение облигаций. Таким образом, до конца 2024 года Минфин может разместить облигаций на 2,611 трлн руб., по сравнению с первичной эмиссией на 1,310 трлн руб. в первом полугодии.

Рубль в пятницу немного ослаб на фоне завершения налогового периода, но укрепился по итогам недели. Поддержку рублю оказала в том числе позитивная динамика нефтяных котировок. Котировки Brent повысились до максимумов с начала июня, достигнув на пике $86,5 за баррель. Рост цен на нефть обусловлен привычными уже факторами – опасениями перед усилением геополитической напряженности на Ближнем Востоке и началом высокого автомобильного сезона в США.

Между тем поддержку нефтяным котировкам может оказать еще один 'привычный' сезонный фактор. В регионе Карибских островов набирает силу ураган «Берилл», который по прогнозам к пятнице может достигнуть берегов Мексики или Центральной Америки. Компьютерные модели указывают на невысокую вероятность того, что «Берилл» обрушится на американские нефтедобывающие поля в Мексиканском заливе, хотя и не исключают вероятности такого развития событий ближе к концу недели.

Новости, ожидания и торговые идеи. Позитивная динамика на нефтяном рынке может оказать поддержку нефтяному сектору, что мы наблюдали по ходу торгов в пятницу. Тем не менее высокие цены на нефть – дополнительный фактор укрепления рубля, который сдерживает потенциал повышения по индексу МосБиржи наряду с высокими процентными ставками. В конечном счете баланс рисков складывается в пользу дальнейшей консолидации на фондовом рынке, в рамках которой мы не исключаем восстановления индекса МосБиржи в направлении 3200 п. Основное внимание инвесторов на неделе привлекут данные Росстата по недельной инфляции, которые будут опубликованы в среду вечером.

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.