

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1877,03	0,17	1,23	
S&P фьючерс		0,04		
Eurostoxx	337,28	0,07	0,02	
Bovespa	47093,13	1,08	0,81	
Nikkei 225	15227,99	2,22	2,61	
Shangh Composit	2059,91	0,33	0,18	
MMVB	1337,98	-0,97	-7,39	
PTC	1164,63	-1,47	-8,10	

Лидеры роста/падения

	Close P	Δ 1D, %	Close P	Δ 1D, %
Мечел	40,600	3,84	РосСети	0,5390 -5,11
ГМКНорНик	6194,00	3,23	ФСКЭС	0,0554 -4,38
Уркалий	162,5	2,46	Магнит	8100,0000 -4,14
МТС	259,9600	1,39	Сбер ап	71,30 -3,54
СевСт	283,60	0,46	Ростел	89,5000 -3,08

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
1,17	Метал	-1,51	Химпром
0,92	Машин	-5,66	Метал
0,38	Телеком	-6,09	Нефтегаз
-0,66	Химпром	-6,96	Телеком
-1,04	Нефтегаз	-8,46	Потреб
-1,39	Потреб	-11,72	Финанс
-1,79	Финанс	-12,84	Электр
-2,53	Электр	-13,43	Машин

Фондовый рынок

- Американский рынок достиг новых исторических максимумов, хотя динамика и размах движений были не самыми сильными. Инвесторов порадовала внутренняя статистика: заявки на пособие по безработице за неделю сократились на 20 тысяч и оказались выше ожиданий, число повторных заявок также снизилось до минимальных за полтора месяца значений. Судя по всему, инвесторы видят, что в стране все хорошо и рост продолжится, вот только рисковать активными и масштабными покупками они не хотят, поскольку ситуация вокруг Крыма и Украины может в любой момент ухудшиться. С другой стороны, они пока что не закладываются и на развитие наиболее негативного сценария, иначе мы уже какое-то время наблюдали бы за большими продажами на рынке.
- Европейские биржи закрылись преимущественно в минусе, отыгрывая решения ЕЦБ и крымского парламента. Европейский регулятор не стал изменять действующие параметры монетарной политики, хотя некоторые эксперты полагали, что для дальнейшего смягчения настало самое время. Позиция Марио Драги не изменилась, что, в условиях растущих рисков дефляции, несколько настораживает инвесторов и вызывает негативную реакцию на фондовом рынке. В тоже время, Европу испугала просьба парламента Крыма о вступлении автономии в состав Российской Федерации. Инвесторы боятся, что такие решения приведут к дальнейшему росту напряженности в регионе и в отношениях России и Украины.
- Российский рынок начал торги четверга на позитивной ноте и в первые часы торгов индексы ММВБ и РТС прибавляли до 1,5%. Однако затем, когда появились новости из Крыма о переносе даты референдума с 30 на 16 марта и о просьбе крымских властей о присоединении к России, рынок отреагировал обвалом котировок и распродажами, которые увели индексы на 5-5,5% вниз от дневных максимумов. Инвесторов пугает не только возможность нового обострения отношений РФ, Украины и Запада, но также и перспективы включения новой автономии в состав федерации, что не приведет ни к чему хорошему в экономическом плане. Кроме того, негатива добавили и сообщения о принятии, хоть пока и не серьезных, но все же вполне реальных санкций в отношении России со стороны США.
- В конце дня произошел небольшой отскок, на фоне позитивного открытия торгов в США, который позволил рынку восстановить часть потерь. Внешний фон с утра не дает определенных сигналов к движению: рынок скорее всего откроется около уровней закрытия вчерашнего дня, может чуть ниже. В течение дня возможно преобладание негативной динамики, все-таки впереди длинные выходные и многие инвесторы предпочтут зафиксироваться, чтобы не переживать потом новый обвал, если за праздничные дни появятся плохие новости.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	108,45	0,64	-0,57	
Индекс Метал.	1342,54	0,51	1,20	
Золото	1350,60	0,77	2,19	
Серебро	21,54	1,42	1,58	
Индекс Зерн	444,98	1,20	5,07	

Товарный рынок

- Новый виток опасений по поводу ситуации вокруг Крыма вызвал рост цен на commodities. Нефть Brent восстановилась после небольшого обвала и сейчас торгуется около 108,5 долларов за баррель, WTI вернулась к 102 долларам.
- Спрос на драгоценные металлы вчера возрос из-за ситуации на Украине, в результате чего цены на золото и серебро подскочили на 1-1,5% за день.

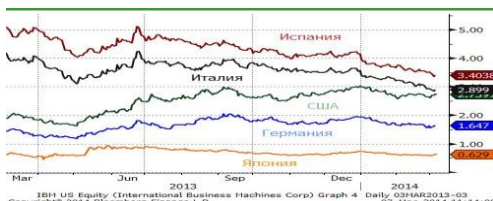
Валютный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,386	0,90	0,39	
USDJPY	102,94	0,62	1,11	
Индекс \$	79,66	-0,56	-0,04	
EURRUB	50,10	1,03	1,09	
USDRUB	36,18	0,21	0,20	
Корзина ЦБ	42,45	0,58	0,60	

- Курс евро к доллару «прыгнул» на вчерашних торгах выше сильного сопротивления 1,38 и закрепился на уровне 1,386, упершись при этом в верхнюю планку длинного и широкого нисходящего канала. Не все инвесторы были готовы к тому, что ЕЦБ оставит без изменений действующую монетарную политику, поэтому, когда были объявлены результаты заседания, валюта отреагировала бурным ростом.
- Рубль после коррекционного укрепления вновь начал слабеть. К евро национальная валюта упала до 50,2 рублей, что было во многом обусловлено резким удорожанием единой валюты к доллару. Йена к доллару упала до минимальных с января значений.

Долговой рынок

- Инвесторы в США продолжают выводить деньги из фондов государственных облигаций, и отток превысил 7 миллиардов долларов за последние 5 дней, по данным Bloomberg, в то время как фонды акций пополнились 9 миллиардами долларов. Падающий спрос на надежные активы, очевидно, говорит о том, что инвесторы с бóльшим оптимизмом смотрят на ближайшее будущее.



Взгляд на рынок

Сегодня инвесторы будут ждать официальную реакцию российских властей на вчерашние заявления и решения крымского парламента. Именно от характера речей отечественных политиков будет зависеть динамика торгов на фондовых биржах и то, как хорошо будет чувствовать себя рубль. Пока что, делать какие-то прогнозы и предсказания трудно, однако первые лица страны должны понимать, что движения в сторону «реального» присоединения Крыма будут восприняты во всем мире крайне негативно и могут привести не только к дальнейшему оттоку капитала из страны и падению инвестиционной привлекательности, но и к введению реальных и более серьезных санкций в отношении России.

Ну а главным экономическим событием сегодня станет публикация стат данных по рынку труда и безработице в США. Статистика от ADP в среду оказалась не самой сильной, поэтому инвесторы пересмотрят свои ожидания и прогнозы в сторону более слабых данных и скорее всего будут готовы к «плохим» цифрам, а вот неожиданно сильная статистика может поддержать настроение игроков.

Данный отчет подготовлен отделом управления активами 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 управления активами 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.

© 2014, 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, опубликовать, 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.