

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1829,83	0,58	3,18	
S&P фьючерс		-0,20		
Eurostoxx	331,48	-0,16	2,70	
Bovespa	47812,83	-0,84	0,16	
Nikkei 225	14435,07	-2,47	1,98	
Shangh Composit	2108,91	-0,05	3,15	
MMVB	1478,77	-1,15	0,02	
PTC	1322,27	-2,28	-1,43	

Лидеры роста/падения

	Close P	Δ 1D, %		Close P	Δ 1D, %
Трансфлп	81493,000	1,55	Уркалий	171,5700	-2,61
Мечел	62,60	0,64	МТС	294,8000	-2,55
Акрон	1172,9	-0,13	Аэрофлот	80,3500	-2,01
Лукойл	2027,0000	-0,15	НЛМК	52,71	-1,92
Магнит	8395,00	-0,18	Роснефть	243,7800	-1,84

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
0,25	Химпром	1,97	Нефтегаз
-0,68	Потреб	1,21	Метал
-0,87	Машин	0,92	Химпром
-0,93	Электр	0,81	Машин
-1,08	Нефтегаз	0,10	Электр
-1,21	Метал	-0,20	Телеком
-1,25	Финанс	-0,48	Потреб
-2,16	Телеком	-0,81	Финанс

Фондовый рынок

- Фондовая Америка на открытии существенно провалилась, отыгрывая слабые данные по рынку труда и розничным продажам в США: число первичных заявок на пособие по безработице увеличилось, вопреки прогнозам, объем розничных продаж в январе упал хотя аналитики ожидали рост. Несмотря на слабую макро статистику, на рынок быстро вернулось «бычье» настроение и инвесторы вытянули котировки в зеленую зону. Поводом для оптимизма могли стать хорошие квартальные отчеты компаний и информация о том, что корпорация Comcast приобретает Time Warner Cable, объединив два крупнейших оператора кабельного телевидения в США. Активность на рынке M&A обычно характерна для фазы роста в экономике, поэтому новости о таких сделках воспринимаются инвесторами очень позитивно.
- Слегка перегретые европейские фондовые индексы в первой половине дня подверглись достаточно сильной коррекции в отсутствии позитивных внешних сигналов. Ближе к вечеру негатива добавили слабые данные из США, в результате чего индекс Eurostoxx падал почти на 1%. Однако, с открытием торгов в Новом Свете и постепенным восстановлением котировок компаний из США, европейские рынки также подтянулись и можно сказать вышли в «нулевую» зону: большая часть европейских бирж закрылась в плюсе, но сводный Eurostoxx оказался в символическом минусе.
- Российский фондовый рынок сильно просел после почти полутора недель бурного роста. В течение дня торги проходили под знаком умеренного снижения на фоне негативного характера торгов в Европе и резко ослабшего рубля, из-за чего долларový индекс PTC снижался в два раза сильнее. К концу торгов вышли слабые данные из США, а биржи Америки открылись существенным гэпом вниз, из-за чего российский рынок упал в последние часы торгов.
- Дальнейший пробой уровней 1473-1474 пунктов по ММВБ может привести к более существенной коррекции, но сегодня это вряд ли произойдет: штаты ночью завершили торги уверенным ростом, фьючерсы на российские индексы на вечерних торгах также существенно подросли, поэтому с утра рынок может продемонстрировать неплохой отскок вверх. Фактором риска сейчас выступают сильно просевшие к утру фьючерсы на индекс S&P, торгующаяся разнонаправленно Азия и «стоящая» на месте нефть.
- Большая часть бумаг российского рынка вчера торговалась в красной зоне, исключением стали акции Транснефти и Московской Биржи. Бумаги последней дорожали на новостях о том, что ее вес в расчете индекса MSCI Russia увеличится с 0,48% до 0,9% - это позитивный сигнал поскольку в условиях нестабильной рыночной конъюнктуры спрос на акции компаний из этого индекса растет. Транснефть уверенно и быстро растет уже второй день подряд в рамках коррекции после сильной перепроданности.

Товарный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	108,51	-0,26	-0,97	
Индекс Метал.	1323,57	-0,33	0,47	
Золото	1305,50	0,79	3,34	
Серебро	20,72	1,86	3,93	
Индекс Зерн	408,65	0,97	1,09	

- Цены на нефть слабо снижались на вчерашних торгах после того как Международное Энергетическое Агентство понизило прогноз спроса на сырье со стороны развивающихся стран, хотя общемировой прогноз спроса оказался выше предыдущих значений. Скорее всего на нефть продолжает давить фактор растущего предложения со стороны США.

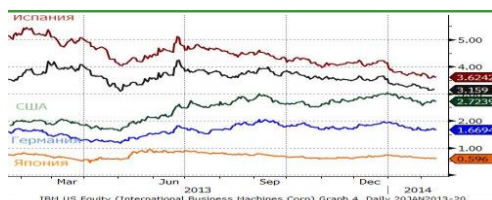
Валютный рынок

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,368	0,66	0,35	
USDJPY	101,76	-0,76	-0,53	
Индекс \$	80,23	-0,56	-0,57	
EURRUB	48,07	1,53	1,91	
USDRUB	35,17	0,97	1,44	
Корзина ЦБ	40,98	1,22	1,65	

- Слабые макроэкономические данные по США привели к достаточно существенному снижению доллара к мировым валютам: «гринбэк» упал к евро, приблизившись к отметке 1,37, йена укрепилась выше отметки 102.
- При этом одним из единственных пострадавших от американской валюты оказался российский рубль. «Деревянный» вышел из консолидации последних дней резким падением, с ходу пробив важный уровень - 35 рублей, и закрепился выше. Сегодня будет первое заседание ЦБ РФ в этом году и хотя никто не прогнозирует резких изменений в текущей политике ЦБ, поддержать рубль словесно чиновники могут.

Долговой рынок

- Американские казначейские облигации укрепляются в последние дня: на фоне не самой впечатляющей макро статистики, инвесторы предпочитают более надежные инструменты.



Взгляд на рынок

Внешний фон для отечественного рынка выглядит несколько неопределенно и несмотря на то что откроются торги скорее всего в плюсе, ожидать дальнейший рост перед выходными на фоне слабого рубля трудно.

С утра была опубликована позитивная статистика по инфляции в Китае, благодаря чему биржи Шанхая и Гонконга торгуются в зеленой зоне. Позднее ожидаем данные по ВВП Франции, Германии и Еврозоны, а также статистику по рынку труда Франции. Вечером – статистику по промышленному производству в США и индекс настроения потребителей Мичиганского Университета.

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, публицизировать, продавать, сдавать в аренду, включать в каталоги, создавать резервные копии, архивировать, включать в базы данных и давать право доступа.