

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|-----------------|----------|---------|---------|-------|
| S&P 500 | 1875,39 | -0,22 | 1,76 | |
| S&P фьючерс | | 0,28 | | |
| Eurostoxx | 335,05 | -0,59 | 1,59 | |
| Bovespa | 51569,69 | -0,78 | -0,05 | |
| Nikkei 225 | 14482,72 | 0,65 | 0,45 | |
| Shangh Composit | 2066,77 | -0,29 | -1,53 | |

| | | | | |
|------|---------|-------|-------|--|
| MMVB | 1329,11 | -0,49 | -0,04 | |
| PTC | 1171,99 | -0,58 | -0,05 | |

Лидеры роста/падения

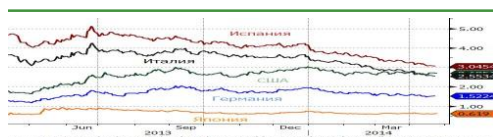
| ▲ | Close P | Δ 1D, % | ▼ | Close P | Δ 1D, % |
|--------------|----------|---------|---------|-----------|---------|
| Акрон | 1120,300 | 0,45 | ФСКЕЭС | 0,0606 | -3,98 |
| Лукойл | 1880,10 | 0,36 | Магнит | 7520,0000 | -2,08 |
| ММК | 6,0 | 0,32 | Ростел | 78,2500 | -1,95 |
| Татнефть Зао | 209,7500 | 0,19 | РосСети | 0,47 | -1,86 |
| Трансф ап | 80387,00 | 0,08 | Уркалий | 158,0000 | -1,85 |

Отраслевая динамика индекса ММВБ

| Δ 1D, % | Отрасль | Δ 1W, % | Отрасль |
|---------|----------|---------|----------|
| 0,29 | Финанс | 3,54 | Телеком |
| -0,07 | Метал | 1,55 | Химпром |
| -0,10 | Химпром | 1,19 | Машин |
| -0,34 | Телеком | 0,92 | Финанс |
| -0,37 | Нефтегаз | 0,89 | Потреб |
| -0,38 | Машин | 0,77 | Нефтегаз |
| -1,09 | Потреб | -0,09 | Метал |
| -1,16 | Электр | -1,07 | Электр |

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|---------------|---------|---------|---------|-------|
| Brent | 109,30 | 0,03 | -0,27 | |
| Индекс Метал. | 1340,34 | -0,33 | 1,91 | |
| Золото | 1286,20 | 0,44 | -1,30 | |
| Серебро | 19,45 | 0,43 | -0,96 | |
| Индекс Зерн | 460,01 | 0,59 | -1,04 | |

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|------------|---------|---------|---------|-------|
| EURUSD | 1,382 | 0,12 | 0,06 | |
| USDJPY | 102,42 | -0,20 | 0,03 | |
| Индекс \$ | 79,84 | -0,09 | 0,04 | |
| EURRUB | 49,30 | 0,10 | -0,97 | |
| USDRUB | 35,68 | -0,04 | -0,89 | |
| Корзина ЦБ | 41,81 | 0,02 | -0,92 | |



Фондовый рынок

- Американские биржевые индексы откорректировались после шести дней непрерывного роста. Формальным поводом для продаж могла стать не самая лучшая макростатистика, но скорее всего, инвесторы просто фиксировали прибыль после более чем 3,5%-ого роста. Тем не менее, опубликованные вчера данные действительно оказались не самыми лучшими: продажи нового жилья резко снизились на 14,5% в марте, достигнув минимума за 8 месяцев, тогда как аналитики ожидали показатель чуть выше февральских значений. Индекс производственной активности PMI также снизился до 55,4 при прогнозе 56. Не порадовали инвесторов и отчеты таких компаний как Procter&Gamble, AT&T и Amgen. Уже после закрытия торгов в Apple объявили о повышении объема «buyback» до \$90 млрд. и росте дивидендов, что поддерживает рост фьючерсов на американские индексы с утра.
- Биржи Европы снижались вместе с американскими индексами на вчерашних торгах, реагируя на слабые макро данные из США и Китая. Индекс деловой активности в промышленном секторе Китая, рассчитываемый банком HSBC, вновь оказался хуже прогнозов, хотя и немного вырос в сравнении с предыдущим показателем. При этом, европейские инвесторы решительно не хотят обращать внимание на внутреннюю статистику, а ведь индексы PMI Германии и Еврозоны продемонстрировали очень неплохой рост и оказались значительно лучше ожиданий.
- Движение на российском рынке постепенно затухает – закрыв гэп, биржевые индексы пока что не могут определиться с дальнейшим движением. Сохраняющаяся напряженность и неопределенность в ситуации на юго-востоке Украины заставляет инвесторов осторожничать и постепенно сокращать длинные позиции. С другой стороны, чего-то страшного тоже пока что не произошло, поэтому массовых распродаж мы не видим. Вчера на рынок также давила Европа, торговавшаяся в красной зоне, и слабые данные из Китая. В случае продолжения такого невнятного боковика с тягой вниз, мы видим потенциал для постепенного снижения биржевых индикаторов в район 1300 пунктов по индексу ММВБ или 1130-1150 пунктов по индексу РТС. Для дальнейшего падения необходим сильный драйвер.
- Внешний фон с утра вновь не дает однозначного направления движению российского рынка. Фьючерсы на российские индексы на вечерней сессии успели вместе с Америкой сходить вверх на 1000 пунктов и также успешно опуститься до уровней закрытия основных торгов. С утра фьючерсы на индекс S&P и основной индекс Гонконга в небольшой плюсе, но вот биржи Шанхая и Токио торгуются в красной зоне.
- Инвесторы ждут ясности в свете последних украинских событий, но появляющиеся новости, пока что не могут дать много поводов для оптимизма, да и заявления политиков и дипломатов с разных сторон пока что остаются довольно резкими, нагнетая и без того напряженную ситуацию. Создается впечатление, что и не было никаких «женевских соглашений», и что достигнутые договоренности так ни к чему и не приведут.

Товарный рынок

- Нефть марки Brent продолжает стабилизироваться в диапазоне 109-110 долларов за баррель, а вот WTI остается под сильным давлением: коммерческие запасы сырья в стране выросли за неделю сильнее прогнозов и оказались максималными с 1982 года, по данным министерства энергетики США.

Валютный рынок

- Может фондовый рынок Европы и не обращает особого внимания на внутреннюю макро статистику, но вот валютный вчера отреагировал на совокупность двух факторов: позитивные данные PMI еврозоны и слабые макро данные из США, помогли единой валюте, в результате чего, курс евродоллар в течение дня поднимался выше 1,385, хотя сейчас эта пара торгуется немного ниже – на уровне 1,3825, но сам факт закрепления выше отметки 1,38 краткосрочно говорит в пользу евро.
- Пара доллар-йена успешно развернулась вниз у линии четырехмесячного нисходящего тренда и имеет все шансы опуститься в район 101,3-101,7, но там она найдет поддержку более «сильного», годового ростового тренда, от которого вполне может начаться новый среднесрочный тренд на укрепление доллара к японской валюте.

Долговой рынок

- Запланированный на вчера аукцион по размещению ОФЗ был признан несостоявшимся «в связи с отсутствием заявок по уровню цен, адекватно отражающим кредитное качество размещаемых облигаций».

Взгляд на рынок

Каких-то сильных драйверов, способных вызвать интересное движение на финансовых рынках так пока и нет. Тем не менее, сегодня будет на что посмотреть в свете экономических событий: днем ждем публикацию блока индексов по Германии, а ближе к вечеру – выступление Марио Драги. Уже вечером, будет опубликована статистика по заказам на товары длительного пользования в США и еженедельный отчет по рынку труда. Не забываем также и про продолжающийся сезон корпоративных отчетов: результаты Facebook и Apple будут поддерживать западные рынки сегодня, но инвесторы уже готовятся оценивать отчетность таких гигантов как Visa, Coca-Cola, GM, Microsoft, Amazon и многих других, которые появятся сегодня.

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.