

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1845,16	0,00	0,90	
S&P фьючерс		0,22		
Eurostoxx	337,70	-0,20	0,82	
Bovespa	46599,21	-0,25	-1,17	
Nikkei 225	14992,66	-0,39	3,76	
Shangh Composit	2052,78	0,91	-4,02	

MMVB	1469,51	-0,62	-0,78	
PTC	1286,07	-1,55	-1,31	

Лидеры роста/падения

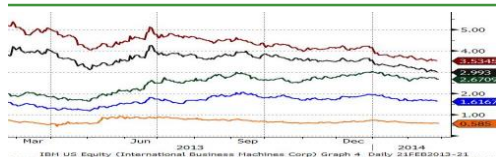
▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Сургут-п	27,410	4,54	Мечел	57,5000	-7,26
Акрон	1160,00	1,28	ФСК ЕЭС	0,0758	-2,65
Сургут	28,2	1,11	ММК	6,4490	-1,99
Магнит	8835,0000	0,97	Сбер	92,35	-1,89
Новатэк	421,00	0,95	МТС	276,5000	-1,88

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %		Δ 1W, %	
1,35	Электр	1,43	Химпром
0,22	Финанс	-0,60	Нефтегаз
0,18	Нефтегаз	-1,14	Электр
0,17	Метал	-1,26	Метал
0,11	Потреб	-1,76	Потреб
-0,17	Машин	-2,11	Машин
-0,37	Телеком	-2,37	Финанс
-2,15	Химпром	-3,65	Телеком

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	109,29	-0,20	-0,92	
Индекс Метал.	1326,44	-0,11	-1,21	
Золото	1327,50	-1,15	0,79	
Серебро	21,08	-4,02	-2,79	
Индекс Зерн	422,13	-0,52	0,51	

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,369	-0,41	-0,23	
USDJPY	102,43	0,19	0,15	
Индекс \$	80,41	0,34	0,15	
EURRUB	49,23	0,39	0,34	
USDRUB	36,02	0,97	1,01	
Корзина ЦБ	41,96	0,71	0,71	



Фондовый рынок

- Фондовый рынок США второй день подряд топчется на одном месте, торги при этом проходят при пониженных объемах торгов. Котировки успокоились после бурного роста и при условии отсутствия сильных сигналов, инвесторы редко переходят к активным действиям. Кроме того, сильное сопротивление оказывают исторические максимумы, которые совсем близко: без сильного драйвера рынок вряд ли начнет штурм новых высот. Вчерашняя сильная статистика по продажам нового жилья, хоть и является позитивным сигналом, но все же не настолько сильным. Сегодня пройдет выступление Джаннет Йеллен, а уже завтра будет опубликована новая оценка ВВП США – эти факторы способны вызвать сильное движение на американском рынке.
- Европейские биржевые индексы умеренно снизились после нескольких дней роста и достижения новых многолетних максимумов. Формальным поводом для снижения могли стать немного разочаровавшие данные по ВВП Великобритании, который по новой оценке вырос за год на 0,1% меньше, чем по предыдущим расчетам. Однако скорее всего котировки снизились из-за накапливающейся перегретости и перекупленности акций. Сегодня ждем важную статистику по рынку труда Германии, оценку ВВП Испании и Швейцарии, а также блок индикаторов по всей Еврозоне.
- Российский фондовый рынок отметился достаточно серьезным снижением второй день подряд. Олимпиада закончилась и теперь в новостных лентах говорят только об Украине и вести приходят не самые позитивные, что оказывает давление на отечественных инвесторов. При этом стоит отметить, что снижение проходило при достаточно низких объемах торгов, что говорит о высокой спекулятивной составляющей. Сильнее падал при этом индекс РТС – рубль после кратковременного укрепления вновь начал падать. Долларовый индекс сейчас уперся в сильную поддержку на уровне 1286-1287 пунктов, но если национальная валюта продолжит слабеть, мы можем увидеть индекс РТС около 1230 пунктов уже очень скоро.
- Против рынка уже второй день подряд растут привилегированные акции Сургутнефтегаза, котировки выросли на 7,3% при очень высоких объемах торгов. Складывается впечатление, что кто-то перекладывается в акции Сургута, в виду их большей надежности, которая обуславливается достаточно высокой дивидендной доходностью и относительной «невосприимчивостью» этого актива ослаблению рубля. Из-за «украинского» фактора второй день подряд падает Газпром. Сбербанк и ВТБ падают также из-за Украины и слабеющего рубля.
- Внешний фон с утра умеренно-позитивен: Штаты вяло торговались ночью, но фьючерсы на индекс S&P с утра слабо растут; Азия преимущественно в зеленой зоне, после сильного провала корректируются индекс Шанхая. Нефть стабильно высоко. Открытие торгов сегодня скорее всего пройдет около уровней закрытия, индекс ММВБ при этом в первые часы торгов попытается укрепиться, мы можем увидеть его где-нибудь около 1475 пунктов. Доллар дернули очень сильно и резко, поэтому возможен небольшой откат, а там и индекс РТС сможет немного укрепиться. Во второй половине дня динамика будет зависеть от характера торгов на западных площадках.

Товарный рынок

- Нефть, после падения во вторник, стабилизировалась выше 109 долларов за баррель, WTI закрепляется выше 102 долларов.
- Сильно перегретое золото, откатилось на вчерашних торгах после неплохого укрепления доллара к мировым валютам.

Валютный рынок

- На фоне неплохой статистики по продажам нового жилья в США, американский доллар укрепился к основным мировым валютам - индекс DXY показал сильнейшее с января дневное укрепление.
- Напряженная ситуация на Украине и решения Минфина надавили на рубль. Ведомство предложило ограничить объем свободных средств казначейства 200 миллиардами рублей, а оставшуюся часть размещать на счетах банков.

Долговой рынок

- Минфину удалось на вчерашнем аукционе разместить ОФЗ на 6 миллиардов из предложенных 20. Ведомство предложило те же бумаги, что и на несостоявшемся на прошлой неделе аукционе.

Взгляд на рынок

Сегодня движение фондовых рынков будет определяться характером выступления Джаннет Йеллен, которое пройдет уже вечером, после закрытия торгов в России. Инвесторы хотят услышать от главы ФРС комментарии о последних не самых сильных макро данных, и то как регулятор собирается действовать в таких условиях. Скорее всего новая глава американского ЦБ выскажется за продолжение сворачивания программы количественного смягчения, что должно оказать поддержку доллару. Фондовый рынок вряд лиотреагирует на это сильным негативом – инвесторы давно смирились с «tapering».

Сегодня, также будет опубликована традиционная статистика по рынку труда и данные по заказам на товары длительного пользования в США.

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, опубликовывать, 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.