

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков США

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|-------------|----------|---------|---------|-------|
| S&P 500 | 1936,92 | 0,28 | -0,11 | |
| Dow Jones | 16569,98 | 0,10 | 0,00 | |
| NASDAQ | 4401,33 | 0,70 | 0,40 | |
| S&P фьючерс | | 0,09 | | |

Индексы фондовых рынков Европы

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|---------------|---------|---------|---------|-------|
| Eurostoxx 600 | 329,36 | 1,37 | -0,54 | |
| FTSE 100 | 6632,82 | 1,00 | -0,67 | |
| DAX | 9180,74 | 1,90 | 0,29 | |
| CAC 40 | 4197,70 | 1,20 | -0,46 | |

Остальной мир

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|-----------------------|----------|---------|---------|-------|
| MSCI World | 420,06 | 0,75 | 0,16 | |
| MSCI Emerging Markets | 1061,41 | 1,52 | -0,16 | |
| Bovespa | 56613,32 | 1,87 | -0,01 | |
| Nikkei 225 | 15141,33 | 2,46 | -1,17 | |
| Shangh Composit | 2219,99 | 1,16 | 0,00 | |
| Hang Seng | 24615,06 | 1,17 | -0,13 | |

Россия

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|---------------------|---------|---------|---------|-------|
| ММВБ | 1372,45 | 1,80 | 1,07 | |
| РТС | 1203,67 | 2,83 | 1,03 | |
| Индекс АДР Нью-Йорк | 83,67 | 3,50 | -0,45 | |

Лидеры роста/падения

| ▲ | Close P | Δ 1D, % | ▼ | Close P | Δ 1D, % |
|---------|---------|---------|-----------|---------|---------|
| Сбер ап | 57,10 | 6,33 | Черкизово | 653,00 | -3,97 |
| Мечел | 31,00 | 5,80 | Мосэнерго | 0,84 | -1,47 |
| ПИКК | 89,80 | 5,61 | Алроса | 42,70 | -1,40 |
| Э.ОН | 2,52 | 5,52 | РусГидро | 0,63 | -1,17 |
| Сбер ао | 74,21 | 4,96 | Русал | 187,91 | -0,05 |

Отраслевая динамика индекса ММВБ

| Δ 1D, % | Отрасль | Δ 1W, % | Отрасль |
|---------|----------|---------|----------|
| 3,22 | Финанс | 1,18 | Электр |
| 1,98 | Машин | 1,08 | Финанс |
| 1,53 | Электр | 0,74 | Химпром |
| 1,32 | Нефтегаз | -0,39 | Потреб |
| 1,21 | Телеком | -0,44 | Метал |
| 0,82 | Потреб | -0,46 | Нефтегаз |
| 0,74 | Метал | -0,59 | Машин |
| 0,68 | Химпром | -1,34 | Телеком |



Фондовый рынок

- Геополитика наконец-то решила дать фондовым рынкам вздохнуть спокойно, впервые за несколько последних недель. В фокусе внимания инвесторов конечно же ситуация на Украине: Россия завершила военные учения, что ранее стало поводом для позитива на мировых площадках, а позднее появились сообщения о том, что Москве и Киеву удалось договориться о запуске гуманитарной миссии в Луганск, где ситуация с водой и продовольствием остается критической. Реализовывать миссию будет Красный Крест, а в ее состав войдут участники из США, ЕС и России.
- Однако не только на Украине появляются позитивные сигналы: Израилу и Палестине все-таки удалось достичь договоренности о временном перемирии, которое должно продлиться трое суток. Не забываем и про Ирак: по сообщениям западных СМИ, авиаудары армии США по позициям боевиков из группировки ИГИЛ оказались достаточно эффективными, что позволило отбросить экстремистов назад, что также является условно «позитивным» фактором, ведь это может позволить решить проблему ИГИЛ как можно быстрее.
- На этом фоне, торги в США прошли под знаком умеренного повышения биржевых индикаторов, хотя к концу дня рынок и растерял часть своего дневного роста. Вполне возможно, что коррекция уже подошла к концу и, учитывая очень неплохие финансовые результаты американских компаний во втором квартале, сейчас можно ждать возвращение спроса на рискованные активы и рост фондового рынка, хотя для подтверждения этого сценария индексу S&P 500 было бы неплохо закрепиться выше 1950 пунктов в ближайшие дни.
- Европейские биржи в пятницу не успели застать появления новостей о завершении учений РФ вблизи границ с Украиной, поэтому весь пул позитивных вестей с геополитического фронта европейские инвесторы отыгрывали на вчерашних торгах. Eurostoxx продемонстрировал сильнейший рост со второй половины июля и у котировок есть все шансы на продолжение развития коррекционного движения вверх. Ростом отметились практически все западноевропейские рынки, а в лидерах роста были главные аутсайдеры последних недель – индексы Германии, Франции и Италии.
- Открывшись солидным гэпом вверх, российские фондовые индексы в течение оставшегося дня продолжили двигаться в бок с незначительными колебаниями, но зато в очень неплохом плюсе. Индекс РТС значительно опережал индекс ММВБ в динамике за счет сильного укрепления курса рубля к доллару. Рост шел по всему спектру рынка – подавляющее большинство бумаг, входящих в расчет основных биржевых индикаторов, торговалась в зеленой зоне.
- В лидерах роста оказались обыкновенные и привилегированные акции Сбербанка и ВТБ, отыгрывавшие новости о решении агентства MSCI не исключать эти акции из расчета своих индексов. В рамках коррекции после солидной просадки росли котировки Мечела. В лидерах же падения оказались акции Группы Черкизово, которые также корректировались, но уже вниз, после роста котировок на 11% на прошлой неделе.
- При этом без особого внимания оказались публикации не особо позитивной макроэкономической статистики: ВВП РФ во втором квартале растет на 0,8% в годовом выражении при прогнозе экономистов в 0,7% и официальном прогнозе МЭР в 1,1%. Торговый баланс в июле резко упал до 14 миллиардов рублей при прогнозе в больше чем 16 миллиардов.

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|---------------|---------|---------|---------|-------|
| Brent | 104,41 | -0,58 | -0,19 | |
| Индекс Метал. | 1415,84 | 0,19 | -1,14 | |
| Золото | 1306,20 | -0,21 | 1,73 | |
| Серебро | 20,01 | 0,32 | 0,87 | |
| Индекс Зерн | 359,72 | -0,07 | -0,37 | |

Товарный рынок

- Успокоилась геополитика и вместе с ней успокоились цены на энергоресурсы и сырье: нефть Brent вновь незначительно меняется, торгуясь в узком боковом диапазоне 104-106 долларов за баррель.
- Золото пока что держится выше уровня 1300 долларов за унцию, но преодолеть сопротивление 200-дневной скользящей средней котировкам пока что не удается.
- Промышленные металлы консолидируются на достигнутых высотах.

| | Close P | Δ 1D, % | Δ 1W, % | Δ 30D |
|------------|---------|---------|---------|-------|
| EURUSD | 1,338 | -0,26 | -0,01 | |
| USDJPY | 102,29 | 0,24 | -0,30 | |
| Индекс \$ | 81,53 | 0,17 | 0,25 | |
| EURRUB | 48,11 | -0,90 | 0,06 | |
| USDRUB | 35,94 | -0,68 | 0,30 | |
| Корзина ЦБ | 41,42 | -0,78 | 0,19 | |

Валютный рынок

- Рубль резко укрепился к евро и доллару, получив поддержку от ослабления геополитической напряженности в мире. От пятничных минимумов нацвалюта прибавила больше 60 копеек к доллару и больше 80 к евро. При этом «деревянный» смог преодолеть сопротивление уровня 36 рублей за доллар и теперь ему открыт путь к росту в район 35,5 рублей за доллар, но об окончательном развороте нацвалюты в сторону роста пока что говорить рано.
- Попытки единой валюты закрепиться выше уровня 1,34 к доллару не увенчались успехом так что евродоллар продолжил свое снижение. «Гринбек» также продолжает укрепляться к йене.



Долговой рынок

- По итогам торгов понедельника, доходности ОФЗ резко снизились, теряя от 20 до 40 базисных пунктов по разным выпускам. Ослабление геополитической напряженности благосклонно сказывается на котировках государственных облигаций для которых последние недели оказались очень тяжелыми.

Взгляд на рынок

Российский рынок может ненадолго взять передышку после ралли, которое он устроил в несколько последних торговых сессий, но потенциал для коррекционного роста еще сохраняется. Внешний фон сегодня фактически нейтрален, так что открытие торгов по индексам пройдет вблизи уровней закрытия. На торги сегодня может оказать давление ожидания принятия Верховной Радой Украины закона о санкциях против России, которые могут в частности ограничить экспорт российского газа через территорию Украины, что безусловно негативно скажется на деятельности Газпрома. Нафтогаз предлагает Газпрому продавать газ на российско-украинской границе, а дальнейшим транзитом в Европу будет заниматься уже другой контрагент, который заключит прямой контракт с Нафтогазом. Однако пока что все эти инициативы – лишь домыслы и предположения, и нет точной информации по поводу того, какие именно и против кого Киев введёт санкции.

Главные экономические публикации сегодня: небольшой блок статистики по Китаю, а также ежемесячная публикация экономических индикаторов от института ZEW по странам Европы.

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.