

Ежедневный обзор рынков

Фондовый рынок

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1981,57	0,42	0,44	
S&P фьючерс		-0,22		
Eurostoxx	342,97	1,34	0,89	
Bovespa	55717,36	-0,46	3,88	
Nikkei 225	15404,34	0,06	1,23	
Shangh Composit	2050,59	-0,96	0,60	

MMVB	1474,72	-0,07	-1,35	
PTC	1350,52	-0,12	-2,40	

Лидеры роста/падения

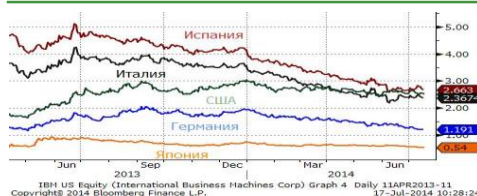
▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
АФК Сист	42,60	-6,99	Алроса	48,00	7,26
Башнфт ао	2433,00	-3,53	Ростел ао	92,62	2,71
Мечел	41,40	-3,04	Северсталь	304,50	2,11
Газпром	142,50	-2,74	Ростел ап	62,85	2,03
ИнтерРАО	0,01	-2,20	ММК	6,92	1,76

Отраслевая динамика индекса ММВБ

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
1,86	Метал	-0,06	Метал
1,48	Химпром	-0,23	Потреб
0,71	Потреб	-0,28	Машин
0,39	Телеком	-1,63	Телеком
0,04	Машин	-1,74	Химпром
-0,03	Нефтегаз	-2,89	Нефтегаз
-0,63	Электр	-3,26	Электр
-1,70	Финанс	-5,35	Финанс

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	107,15	1,07	-1,40	
Индекс Метал.	1414,58	-0,16	0,15	
Золото	1305,00	0,61	-2,55	
Серебро	20,73	-0,66	-1,40	
Индекс Зерн	368,47	0,78	-1,21	

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,353	-0,31	-0,61	
USDJPY	101,52	-0,16	0,18	
Индекс \$	80,51	0,14	0,47	
EURRUB	46,56	-0,23	0,53	
USDRUB	34,41	0,07	1,24	
Корзина ЦБ	39,88	-0,07	0,92	



IBM US Equity (International Business Machines Corp) Graph 4 Daily 11APR2013-11 17-Jul-2014 10:28:24
Copyright © 2014 Bloomberg Finance L.P.

- В среду американские фондовые индексы продолжили топтаться вблизи ранее достигнутых исторических максимумов, прибавив в пределах половины процента. Сил для дальнейшего роста пока не хватает, но и настроений падать явно не присутствует, так что после некоторого перила консолидации мы вполне можем увидеть еще одну попытку дойти до уровня 2000 по SP500. Выходившая вчера статистика была противоречива: с одной стороны объем промпроизводства вырос хуже ожиданий, с другой – данные по инфляции несколько обогнали ожидания. Так что из вышедших вчера данные участники торгов не смогли получить явного сигнала о перспективах политики Федрезерва. Из компаний, публиковавших вчера квартальную отчетность, инвесторов порадовал интернет-ритейлер eBaу и крупнейшая в мире компания по управлению активами BlackRock, тогда как данные Bank of America вышли хуже ожиданий. Сегодня квартальные отчеты представят Morgan Stanley, IBM, Google.
- Европейские площадки в среду закрылись уверенным ростом: Германия +1,4%, Франция +1,5%, Италия +2,9%. Напряженность вокруг Португалии спала, а дополнительного позитива вчера привнесли данные по ВВП Китая – вторая по величине экономика мира продолжает демонстрировать стабильно высокие темпы роста. На вчерашнем саммите лидеры стран ЕС ужесточили санкции против России и впервые ввели ограничения против российских предприятий. Санкции включают в себя запрет на въезд в государства ЕС и заморозку активов. Список лиц и компаний, на которые будут распространяться ограничения, будет составлен до конца июля. Кроме того, лидеры стран Евросоюза дали указание Европейскому инвестиционному банку (ЕИБ) и Европейскому банку реконструкции и развития (ЕБРР) не финансировать новые проекты в России. Также было решено, что ЕС проверит, какие программы сотрудничества с Россией могут быть заморожены.
- Позднее вышли новости о том, что аналогичные санкции вводят и США, которые, однако, уже определились с перечнем лиц и предприятий. Под ограничения попадают компании из оборонного, финансового и энергетического секторов, в том числе Роснефть, Новатэк, концерн Калашников, Уралвагонзавод, Газпромбанк, Внешэкономбанк, а также нефтяной терминал в Феодосии. Лицам и предприятиям, включенным в данный список, значительно ограничивается доступ к рынкам США. Заморозки активов в то же время пока не будет, так что критичными для бизнеса предприятий данные санкции не назовешь.
- Участники торгов в России вчера вели себя очень осторожно в ожидании сообщений по новым санкциям и индексы еще немного просели относительно уровней вторника. При этом индекс ММВБ вчера закрепился ниже уровня 1480 пунктов, что говорит о высокой вероятности движения в район 1400. Новости из США вчера вышли уже после закрытия вечерних торгов, так что на открытии нас ожидает гэп вниз.
- Утром на открытии мы увидим дивидендный гэп в акциях Лензолота и Алросы. Сегодня последний день для желающих купить под дивиденды акции Траснефти.
- Азиатские рынки сегодня торгуются разнонаправленно.

Товарный рынок

- Котировки черного золота на торгах в среду попытались реализовать ожидаемый нами отскок от важного уровня поддержки, находящегося в районе 105 долларов за баррель марки Brent. В результате активизации покупателей цены закрепились выше отметки 107 долларов. Ждем дальнейшего роста котировок.
- Золото по итогам торгов понедельника-вторника оказалось сильно перепроданным в моменте и вчера продолжило отскок, начавшийся в среду. Котировки вернулись выше отметки 1300 долларов за тройскую унцию.

Валютный рынок

- За неимением новых данных евро продолжил слабеть относительно доллара и отметка 1,35 стала еще ближе. Йена по-прежнему заката в очень узком треугольнике, сформированном еще в начале года. Рубль остался в пределах торговых диапазонов последних дней: к доллару незначительно ослаб, к евро немного укрепился.

Долговой рынок

- Введенные вчера санкции со стороны США в адрес российских компаний касаются прежде всего ограничений на доступ к долговому рынку. Пока не совсем понятно, как именно будут оформлены эти ограничения, однако рост доходностей по еврооблигациям попавших в список предприятий мы вполне можем увидеть. Пока же ситуация на рынках спокойная. Вчера Промсвязьбанк разместил семилетние евробонды под 10,5%.

Взгляд на рынок

Все же страны ЕС и США ввели дополнительные санкции против России и впервые ввели санкции против российских компаний. И хотя пока санкции не носят жесткого характера, сам факт движения по пути ужесточения политики является негативным сигналом для инвесторов в российский рынок.

Индекс ММВБ вчера не смог вернуться выше уровня 1480 пунктов, что открывает дорогу в район 1400-1420 пунктов. На открытии возможен гэп вниз, поскольку новости из США не были вчера отыграны даже на ночной сессии.

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