

Ежедневный обзор рынков

Индексы фондовых рынков

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
S&P 500	1958,12	-1,18	-0,33	
S&P фьючерс		-0,14		
Eurostoxx	339,74	-0,94	1,00	
Bovespa	55637,51	-0,14	1,91	
Nikkei 225	15182,25	-1,28	0,12	
Shangh Composit	2063,76	-0,17	0,82	

MMVB	1440,63	-2,31	-3,95	
PTC	1299,03	-3,81	-6,08	

Лидеры роста/падения

▲	Close P	Δ 1D, %	▼	Close P	Δ 1D, %
Алроса	44,80	-6,67	ЛСР	611,80	0,28
Башнфт ао	2271,00	-6,66	НЛМК	49,90	-0,18
НОВАТЭК	378,00	-5,52	Северсталь	303,90	-0,20
М.Видео	239,64	-5,02	ГМК	7135,00	-0,35
ИнтерРАО	0,01	-4,33	ММК	6,89	-0,48

Отраслевая динамика индекса MMVB

Δ 1D, %	Отрасль	Δ 1W, %	Отрасль
-1,40	Потреб	1,13	Метал
-1,48	Метал	-0,20	Потреб
-1,52	Химпром	-1,29	Телеком
-2,01	Машин	-1,86	Химпром
-2,22	Телеком	-2,65	Машин
-2,28	Финанс	-3,70	Электр
-2,50	Электр	-4,62	Нефтегаз
-2,82	Нефтегаз	-5,26	Финанс

Фондовый рынок

- Новостной фон четверга оказался крайне насыщенным на негативные события. Израиль начал массированную атаку на сектор Газа с участием пехоты, бронетанковых войск, авиации и артиллерии. Погибли по меньшей мере 8 жителей сектора Газа. Целью операции является уничтожение прорытых боевиками тоннелей под совместной границей. Также вчера над территорией самопровозглашенной Донецкой республики был сбит самолет малайзийских авиалиний, погибло 298 человек, в основном граждане Нидерландов. Ни Украина, ни ДНР не берут на себя ответственности за произошедшее, а отдельные представители Запада считают виновной в катастрофе Россию. Ну и под занавес дня поступило сообщение о блокировании доступа в Белый дом из-за найденного бесхозного пакета.
- В общем в четверг участникам торгов было из-за чего нервничать и продавать бумаги. В итоге американские и европейские фондовые площадки закрылись в приличном минусе: SP500 -1,2%, германский DAX -1,1%, французский CAC40 -1,2%, английский FTSE100 - 0,7%, Италия -2%. Конечно же, основным триггером стало крушение самолета, ведь данный инцидент свидетельствует о новом витке роста мировой геополитической напряженности, способной привести к расширению территориальной площади военного конфликта, который потенциально может затронуть экономики многих мировых держав. Ничего удивительного, что вчера мы опять наблюдали бегство инвесторов от рисков, американский индекс страха (индекс волатильности VIX) вчера подскочил сразу на 32%. Техническая картина на индексе SP500 тем не менее пока остается бычьей, но вот насколько долго перевес будет сохраняться на стороне быков зависит от дальнейшего развития событий. Сегодня в Европе соберется экстренное заседание ООН, которое безусловно потребует международного расследования.
- Азия сегодня торгуется на отрицательной территории, японский Nikkei теряет 1,2%, остальные страны реагируют более сдержанно. В плюсе только Китай, который как всегда живет своей собственной жизнью.
- Российский рынок вчера находился в явных аутсайдерах. Сначала участники отыгрывали введенные санкции, в результате чего к середине дня снижение по индексам достигало 3% по MMVB и 4,5% по PTC. Попытка отскока, предпринятая под закрытие торгов была полностью нивелирована на вечерней сессии после появления сообщений о крушении самолета. В ходе ночных торгов фьючерс на индекс PTC потерял еще порядка 2%, совокупные потери составили более 7%. Российская сторона не берет на себя ответственности за произошедшее, но очевидно, что ее попробуют нам навязать. В любом случае в произошедшем для нас нет ничего хорошего, ведь погибли европейские граждане и Запад, даже если не сможет установить причастность РФ, выжмет из ситуации максимум возможного для снижения российских переговорных возможностей по ситуации на Украине. Ну и конечно же, это пахнет новыми санкциями.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
Brent	108,33	2,34	1,57	
Индекс Метал.	1416,51	0,14	0,49	
Золото	1316,20	1,26	-1,59	
Серебро	21,09	1,17	-1,74	
Индекс Зерн	371,35	0,78	2,17	

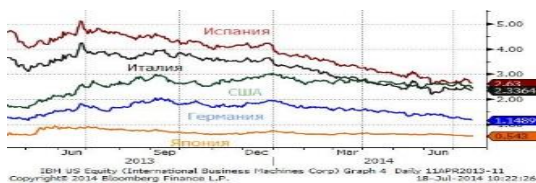
Товарный рынок

- Вчерашний новостной фон подогрел в том числе и котировки нефти, ведь Россия является крупнейшим нефтедобытчиком в мире. Хотя в целом реакцию энергоносителей нельзя назвать панической и она вполне укладывается в картину отскока после двухнедельного падения.
- Золото как защитный актив вчера стало вновь интересно спекулянтам, его котировки вчера выросли до 1320 долларов за унцию.

	Close P	Δ 1D, %	Δ 1W, %	Δ 30D
EURUSD	1,353	0,02	-0,59	
USDJPY	101,32	-0,35	0,02	
Индекс \$	80,52	-0,05	0,41	
EURRUB	47,56	2,11	2,83	
USD RUB	35,17	2,14	3,36	
Корзина ЦБ	40,74	2,13	3,12	

Валютный рынок

- На мировом валютном рынке в четверг наибольшее движение показали, конечно же, котировки рубля, который просел против доллара более чем на 2%, превысив отметку 35 рублей за доллар. В целом рубль, укреплявшийся уже достаточно длительное время, имеет все шансы на продолжение движения в район 36 рублей за доллар.



Долговой рынок

- Долговой рынок вчера опять всколыхнула волна паники: бегущие от риска инвесторы бросились скупать американские гособлигации, доходность которых упала до максимальных за год значений. В российском секторе вчера наблюдались распродажи, в первой половине дня особенно пострадали еврооблигации попавших под санкции компаний.

Взгляд на рынок

Сегодня российский рынок, отыгрывая новости о сбитом самолете, откроется гэпом вниз, который может превысить 2% по индексу ММВБ. Новостной фон вокруг РФ сейчас беспокойный и напряжение продолжает нарастать. Кроме того, впереди выходные, на которые многие участники торгов после вчерашнего происшествия побоятся уйти в длинные позиции. Как следствие в течение дня снижение может усилится.

С технической точки зрения цели ожидаемой коррекции практически достигнуты, в районе 1400 пунктов по индексу ММВБ находится неплохая поддержка, от которой рынок по аналогии с 3 марта, может оттолкнуться при нормализации внешнеполитической ситуации.

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