

В четверг, 23 июня, индекс ПФТС потерял 1,84% - до 902,34 пунктов, индекс «Украинской биржи» обвалился на 2,61% - до 2 306,06 пунктов.

Индекс ПФТС:
902,34

Индекс «УБ»:
2 306,06

Изменение, %
1,84 ↓

Изменение, %
2,61 ↓

ИТОГИ ДНЯ:

Ведущие фондовые индексы Украины, в четверг, продемонстрировали удручающую динамику, обвалившись до минимумов года. Медвежье настроение читалось еще до начала торгов, учитывая сложившийся негативный внешний фон. Открытие сессии гэпом вниз не стало сюрпризом для игроков, однако неспособность быков закрыть его в течение дня, или хотя бы дать должный отпор, все же, свидетельствовало о многом.

Объем торгов на протяжении дня остался невысоким, однако, активность медведей существенно увеличилась, на фоне непрекращающегося падения на внешних площадках. После выхода макростатистики в США, давление на рынки усилилось, что привело к очередной порции распродаж, которую прервало лишь окончание торгов. Наиболее активны игроки были в акциях «Моторсичи», составившей значительную часть общего объема торгов внутри дня. Хуже рынка смотрелись также акции предприятий чёрной металлургии. Светлым пятном на фоне остальных представителей индексной корзины были бумаги «Западэнерго», спрос на которые теплится с момента выхода сильных новостей, однако объем торгов оставался на крайне низком уровне, что не позволяло утверждать о наличии крупного покупателя. Весь покупательский спрос сошел на нет, ближе к концу дня, когда акции ZAEN потеряли свыше 5%.

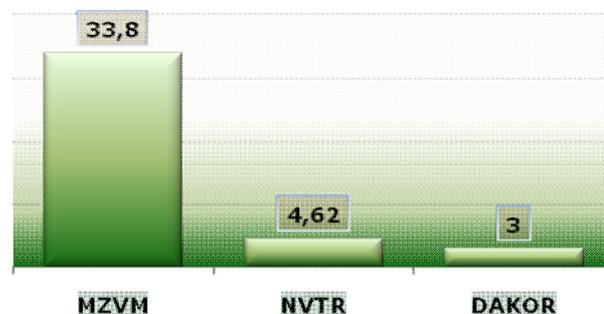
Динамика срочного рынка несколько отличалась от предыдущих дней: медведи не спешили опускать фьючерс, за счет чего, в определенные моменты, при падениях индекса, производный инструмент переходил в положение контанго и впервые за несколько месяцев сумел закрепиться выше спота по итогам дня.

По итогам дня, украинские акции потеряли значительную долю капитализации, опустившись до минимальных значений за год, в то время, как некоторые из них обновили двухгодичные экстремумы.

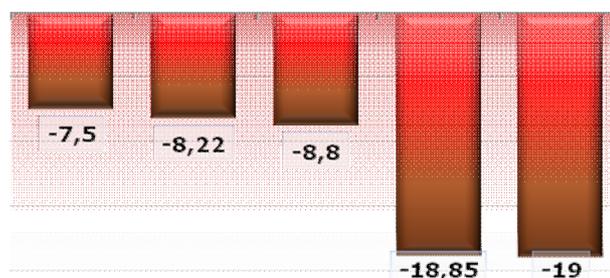
Динамика индекса "УБ" и объемы торгов акциями

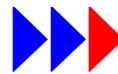


Лидеры роста/падения, %



MTBD ZHEN MMKI FORM DMKD





ИТОГИ ТОРГОВ НА ЗАРУБЕЖНЫХ ПЛОЩАДКАХ:

В четверг, медведи безоговорочно выиграли битву, воспользовавшись неблагоприятными статистическими данными с рынка труда и недвижимости в США.

Кроме этого, обеспокоенность инвесторов начала появляться уже после заявлений ФРС накануне, что оставило быков практически без шансов. Спасительным кругом, под конец дня, стала новость о предоставлении Греции пакета финансовой помощи в ближайшем времени.

ЕВРОПА

Четверг завершился глубоким обвалом для фондовых рынков Европы.

После того, как Федрезерв накануне понизил прогноз роста американской экономики в 2011 году с 3,1-3,3% до 2,7-2,9%, на рынке стали доминировать продавцы.

В течение дня, дополнительное давление на котировки оказывала макростатистика: деловая активность в промышленности и сфере услуг в еврозоне снизилась в июне сильнее ожиданий, и промышленность Германии также сбавила темпы роста.

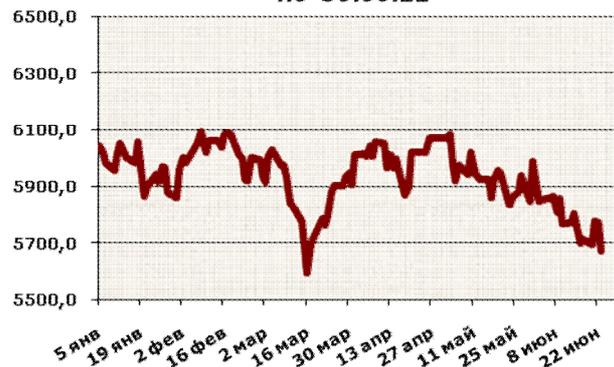
Среди аутсайдеров дня стоит выделить акции банковских учреждений, потерявших в среднем более 2,5%, после слов президента ЕЦБ о том, что банковской сфере угрожает долговой кризис.

Обвал котировок нефти, после оглашения намерений стран-членов IEA выпустить на рынок 60 млн. баррелей нефти в ближайшие месяцы, спровоцировал распродажи в нефтегазовом секторе, а также в акциях ГМК, на фоне снижения цен на промышленные металлы.

По итогам торгов, британский индекс FTSE 100 закрылся в минусе на 1,74%, немецкий DAX опустился на 1,77%, французский CAC 40 потерял -2,16%.

Индекс	Значение	Изменение, %
FTSE 100	5 674.38	<u>1,71</u>
DAX	7 149.44	<u>1,77</u>
CAC 40	3 787.79	<u>2,16</u>

Динамика индекса FTSE 100 с 05.01.11 по 30.06.11



Динамика индекса DAX с 05.01.11 по 30.06.11



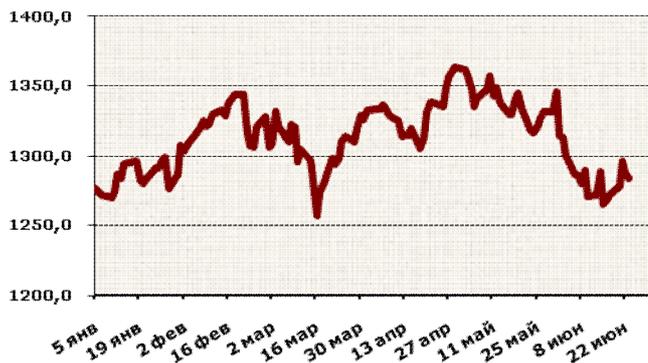
Динамика индекса CAC 40 с 05.01.11 по 30.06.11





Индекс	Значение	Изменение, %
S&P 500	1 283.5	<u>0.28</u>
DOW	12 050	<u>0.49</u>
NASDAQ	2 686.75	<u>0.66</u>

Динамика индекса S&P 500 с 05.01.11 по 30.06.11



Динамика индекса Dow с 05.01.11 по 30.06.11



Динамика индекса NASDAQ с 05.01.11 по 30.06.11



США

Закрытие торговых площадок США в смешанной зоне стало настоящим подарком держателям длинных позиций, учитывая динамику торгов в первой половине дня.

Итоги двухдневного заседания FOMC, а также выступление Бена Бернанке, было расценено инвесторами с негативной точки зрения. Пессимизм усилился после комментариев главы ЕЦБ, Жана-Клода Трише, о том, что долговой кризис в банковском секторе может всерьез пошатнуть экономики развитых стран.

Кроме этого, недельные данные по рынку труда и недвижимости вновь оставляли желать лучшего, лишней раз, подтверждая слабость восстановления наибольшей экономики мира.

Катастрофическое падение котировок нефти и промышленных металлов лишь отягощало положение добывающих компаний. Банковский сектор, также пребывал в первых рядах снижения.

Однако, после обеда, после появления информации о том, что решение по предоставлению Греции пакета помощи для избежания дефолта успешно принят, на Уолл-Стрит последовала незамедлительная реакция. Оставшуюся часть дня, быки отыгрывали упущенное, и сумели закрепиться на положительной территории в ряде высокотехнологичных акций. Основополагающие поддержки вновь выстояли, дав держателям лонгов надежду на дальнейшее продвижение вверх.

По итогам сессии: Dow -0,49%, Nasdaq +0,66%, S&P 500 -0,28%



Индекс	Значение	Изменение, %
Nikkei 225	9 596.74	0,34
Hang Seng	21 759.1	0,46
Shanghai	2 687.5911	1,44

Динамика индекса Nikkei с 06.01.11 по 30.06.11



Динамика индекса Hang Seng с 05.01.11 по 30.06.11



Динамика индекса ММВБ с 05.01.11 по 30.06.11



АЗИЯ

Азиатские инвесторы с самого утра принялись отыгрывать новости от ФРС США, поступившие накануне.

Понижение прогнозов темпов роста экономики Соединенных Штатов, спровоцировали распродажи в акциях компаний, ориентированных на американский рынок. Это, прежде всего представители высокотехнологического сектора. Кроме этого, отрицательная динамика на товарных рынках, увеличили в минус бумаги горнодобывающих предприятий.

Негативную роль сыграли также чистые вложения нерезидентов в японские акции, которые сократились за минувшую неделю на 190,5 млрд. йен, тогда как неделей ранее было зафиксировано снижение показателя на 76,8 млрд. йен.

По итогам сессии: гонконгский Hang Seng закрылся ниже на 0,46%, южнокорейский Kосpi и японский Nikkei 225 потеряли 0,39%, 0,34%.

РОССИЙСКАЯ ФЕДЕРАЦИЯ

Торги на российском рынке акций прошли под знаком медведей.

Помимо негатива с внешних фондовых площадок, настоящим драйвером такого падения стал обвал котировок нефтяных фьючерсов, который спровоцировал распродажи в акциях нефтегазового сектора.

Хуже рынка смотрелись также бумаги всего ГКМ, на фоне падения цен на промышленные металлы. Продажи только усилились после выхода макростатистики в США.

По итогам торговой сессии, индекс ММВБ убавил из своего актива 1,97%, в то время как индекс РТС обвалился на 2,58%.



СИТУАЦИЯ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

В четверг, евровалюта продолжила снижение, плавно перешедшее в обвал, на фоне неблагоприятных макроданных из США, сделавших американский доллар более привлекательным для покупок.

На этом фоне, резервная валюта существенно прибавила относительно конкурентов, чему способствовало также понижение прогнозов роста ВВП США от ФРС накануне, а также пессимистичное выступление главы ЕЦБ.

Отскок в паре EUR\USD в конце дня был обеспечен благоприятными новостями о выделении Греции пакета финансовой помощи для избежания дефолта.

Валюта	Значение на 09:00	Изменение, %
EUR/USD	1,425	0.09
USD/JPY	80,49	0.11
GBP/USD	1,6010	0.03
USD/CHF	0,838	0.03

ДИНАМИКА ЦЕН НА ТОВАРНЫХ РЫНКАХ:

Котировки «черного золота» продемонстрировали впечатляющее падение, теряя в моменте 7%, на фоне сообщений о том, что Международное энергетическое агентство выделит 60 млн. баррелей из собственных стратегических запасов, для компенсации нехваток поставок из Ливии и снижения цен.

На фоне укрепляющегося доллара, а также замедления мировой экономики, котировки промышленных металлов уверенно устремились вниз, теряя более 2% внутри дня. Золото и серебро также продемонстрировали понижающую динамику при высокой волатильности торгов: инвесторы предпочитали выходить в «cash» при сложившихся макроэкономических условиях.

Сырье	Значение на 09:00	Изменение, %
Brent	108	0.98
Light Crude	91	1.03
Gold	1 522	0.42

ЭКОНОМИЧЕСКИЙ КАЛЕНДАРЬ:

Главным блюдом макроэкономической статистики сегодня будет публикация данных по ВВП США за первый квартал в 15:30. В это же время будут оглашены данные по объёму заказов на товары длительного пользования в США.

Помимо этого, в первой половине дня, инвесторов ожидает важные данные из Европы:

11:00 - Индекс настроений в деловых кругах Германии Ifo

11:00 - Розничные продажи в Италии

12:30 - Выступление управляющего Банка Англии Мервина Кинга

12:30 - Отчёт Банка Англии о финансовой стабильности

Также, биржевая публика будет ожидать новостей из Саммита Евросоюза, а также со встречи лидеров стран G-8.



ПРЕМАРКЕТ:						
Внешний фон						
Внутреннее настроение						
Технический анализ						

Подготовлено: аналитическим отделом

ООО «Сити Брок»,

Михальчук Дмитрий

Внешний фон:

Настроение на мировых площадках перед открытием торгов в Украине заметно улучшилось. Американским индексам почти удалось отыграть более чем 1,5% снижение, частично выйдя в плюс по итогам дня. С утра фьючерсы на американские индексы прибавляют 0,43%. На рынках Азии быки сумели перехватить инициативу, организовав подобие ралли: большая часть фондовых индикаторов завершила сессию повышением свыше 1%. На товарных рынках наблюдается восстановление после катастрофического падения накануне. Торги в Российской Федерации начались ростом на 0,7% вслед за котировками нефти.

В ближайшие дни на мировых рынках основное внимание будут уделять нескольким главным темам: понижение темпов роста ВВП США от ФРС, решение МЭА открыть стратегические запасы нефти для возмещения недостатка объемов на рынке с целью сбить высокие цены на нефть, а также решение МВФ выделить Греции очередной транш финансовой помощи, после представления страной 5-летнего плана по сокращению бюджетного дефицита. Кроме этого, приятные новости пришли из Китая, где регулятор заявил о том, что необходимость в дальнейшем ужесточении отпала, поскольку инфляционные риски находятся под контролем.

Среднесрочная перспектива мировой экономики по-прежнему не очень радужна, однако, учитывая столь длительное падение, позитивным новостям будет придаваться больший вес. Поэтому, в краткосрочной перспективе, при условии, что новых негативных вестей не будет, рынки могут попытаться совершить отскок. Сегодня ожидается публикация ВВП США, поэтому до обеда, инвесторы будут предельно осторожны в решениях. Кроме этого, встреча лидеров G-8 также может преподнести сюрпризы игрокам.

Внутреннее настроение:

Учитывая ожидающие рынок длительные выходные, сегодняшний день будет иметь особое значение в проекции на следующую неделю. Четверг продемонстрировал, что при желании, отечественному рынку еще есть куда падать. Однако, близость основополагающих поддержек, может сыграть на руку быкам, надеющимся на отскок, поскольку дальнейшее продвижение вниз критично для рынка. Внутренние новости сейчас отошли на второй план, оказывая посредственное влияние на ход торгов. Поэтому, учитывая внешние тренды, откат на украинском рынке акций, достаточно вероятное событие: настроение игроков заметно улучшилось, учитывая первый за несколько месяцев переход фьючерса в положение контанго. Однако, не стоит забывать, что отскоки имеют обыкновение заканчиваться медвежьим поглощением, поэтому рекомендуется внимательно следить за новостями, в особенности, за публикацией ВВП США, который даст ориентир для движения котировок на ближайшее время.

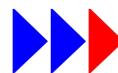
Технический анализ:

Индекс УБ дошел до критических отметок, ниже которых шансы быков выжить стремятся к нулю. Именно такая ситуация и может способствовать краткосрочному отскоку. Тем не менее, в среднесрочной перспективе, медвежий тренд по-прежнему в силе, и, принимая во внимание обстановку на мировых площадках, прорыв этих отметок, скорее, дело времени.

Рынок продолжает опускаться все ниже 200-периодной ЕМА, что делает долгосрочные покупки в данный момент рискованной сделкой. Сигналов к развороту тенденции не наблюдается, однако, учитывая близость нижних границ понижательного тренда, отскок может и случиться.

Ключевые уровни сопротивления: 2 350, 2 370, 2 390, 2 400, 2 440, 2 450, 2 500.

Важные поддержки: 2 300, 2 290, 2 253, 2 200, 2 210, 2 100.



Предоставляемый обзор не является коммерческим продуктом, а рекомендации выраженные аналитиками компании являются исключительно их мнениями, исходя из текущей ситуации на рынке. Компания «Сити Брок» не несет ответственности за Ваши инвестиционные решения.



