

ЕЖЕДНЕВНЫЙ ОБЗОР ФОНДОВОГО РЫНКА ЗА 08.08.2011 г.

Понедельник, 8 августа 2011 г., стал худшим торговым днем с середины 2010 г.: индекс UХ рухнул на 8,28%, индекс ПФТС – на 6,20%.

Вчерашнюю сессию американцы назвали «адским днем»: Dow -5,55%, S&P -6,66%, Nasdaq -6,90%. На рынки продолжает давить новость о понижении рейтинга США с AAA до AA+ рейтинговым агентством S&P. Этот факт в дополнении с вялостью рынка жилья и труда, а также снижением потребительской активности формируют панические настроения относительно начала новой волны рецессии. Вслед за переоценкой рейтинга США, S&P понизило рейтинги с AAA до AA+ ключевым фининститутам страны: Depository Trust Co, National Securities Clearing Corp, Fixed Income Clearing Corp и Options Clearing Corp, а также крупнейшим ипотечным агентствам Fannie Mae и Freddie Mac. Свое решение агентство обосновало снижением кредитного рейтинга США, что повлекло необходимость пересмотра оценок по всей финсистеме страны. Действия S&P вынудили два остальных рейтинговых агентства пересмотреть и свои оценки по суверенному рейтингу США. Moody's вчера подтвердило triple-A рейтинг США, основываясь на статусе американского доллара как ключевой резервной валюты, позволяющий поддерживать высокие уровни долга страны. Fitch Ratings заявило о планах пересмотреть оценку суверенного рейтинга США до конца августа, после чего вынесет свой вердикт. Эти события вызвали ажиотажную панику: индекс волатильности американских рынков VIX достиг максимума с начала марта 2009 года – 48% (+50% к предыдущему закрытию). Массовые распродажи вынудили руководство NYSE и AMEX реализовать «правило 48», позволяющее приостанавливать биржевые торги в случае значительных колебаний акций в начале торговой сессии. Данное решение уже было расценено как индикатор опасности, нависшей над американской экономикой.

Внимание европейских инвесторов было приковано не только к американским событиям, но и к экстренному заседанию ЕЦБ, по итогам которого было утверждено решение о запуске масштабной скупки итальянских и испанских бондов. Данную программу уже начали реализовывать в понедельник, что немного снизило их доходность до 5,3% и 5,39% соответственно. Нервозность инвесторов просадила ключевые индексы более чем на 3%: FTSE -3,39%, DAX -5,01%, CAC -4,68%.

Украинские площадки двигались вслед за зарубежными коллегами. Которую сессию подряд хуже всех выглядят металлурги, провалившиеся более чем на 10%: ALMK -10,64%, AZST -12,89%, ENMZ -17,32%. Позитивные новости по вагоностроителям не смогли побороть общие настроения игроков (SVGZ -15,42%; KVBZ -9,95%): Стахановка заявила о планах расширения модельного ряда четырьмя новыми вагонами к 2012 году. Свое решение завод аргументировал повышенным спросом на специализированный подвижной состав.

Ключевое внимание рынков сегодня будет приковано к пресс-конференции главы ФРС Б. Бернанке. От финрегулятора ожидают каких-то комментариев и действий, особенные надежды возлагают на QE3.

КАЛЕНДАРЬ СОБЫТИЙ НА ТЕКУЩИЙ ДЕНЬ

| Дата | Время | Рынок | Событие |
|------------|----------------|-------|---|
| 08/08/2011 | 21:15 21:15 | США | Заявление Комитета по открытым рынкам ФРС США Решение ФРС США по процентной ставке |