ISDA спасла Грецию от дефолта, рынки в раздумье
Валерий Дмитриев, эксперт БКС Экспресс

Российский рынок оказался дезориентированным на торгах в четверг. Накануне американский рынок умеренно снизился (-0,4-0,7%), разочарованный выступлением главы ФРС Б. Бернанке, Департамент энергетики США порадовало серьезным ростом запасов нефти, который, в принципе был компенсирован снижением запасов бензина и дистиллятов (завершение «отопительного сезона»). Негатив от выступления Бенджамена был частично компенсирован блестящими данными по ВВП в 4 квартале (рост на 0,3%). Также росту пессимистичных настроений на торгах ММВБ-РТС способствовало закрытие в странах АТР, обошедших вниманием неплохие данные по деловой активности в Китае.

В результате на открытии «дорогие россияне» потеряли более 1% своих капитализации своих индексов. Валютная сессия первой сессии марта также отметилась ростом курса доллара в пределах 1%. Однако с открытием европейских площадок разгул медведей стал заметно затухать К этому моменту европейские площадки торгуются в плюсовой зоне, несмотря на рост (но умеренный инфляции и безработице), также плюсуют нефтяные фьючерсы (то ли по иранскому, то ли сирийскому поводу).

Основной интригой сегодня выступало решение ISDA (Международная Ассоциация по диреативам и свопам) по определению/неопределению страхового случая по греческим облигациям. После 16:30 мск вердикт по вопросу, так сильно интересовавшему спекулянтов, засевших в проблемных облигациях Еврозоны, «вынесли» - НЕТ!

Однако российские игроки, уставшие от утренней почти панической просадки и последующего восстановления, пока решают вопросы реакции на «недефолт» в Греции лишь теоретически, дожидаясь реакции американских игроков.

Из внутренних событий можно отметить отчетность ЛУКОЙЛа (-0,33%) за 2011 по US GAAP. Результат разнонаправленный – чистая прибыль выросла на 15% до $10,357 млрд, однако много (как всегда для ЛУКОЙЛа) пришлось списать на материальные затраты и убытки из-за переоценки.

С технической точки зрения российские индексы засели в боковиках (результат, как обычно, равновероятен). А вот рубль в ближайшие дни ждут нелегкие времена.