

13 Августа, 2013

Комментарий

В понедельник 12 Августа на российском рынке ценных бумаг отмечен умеренный рост котировок на нейтральном новостном фоне. По итогам дня Индекс РТС подрос на 0,1%, а индекс ММВБ прибавил около 0,4%. Торговая активность в понедельник оставалась низкой. Так, биржевые обороты по акциям, входящим в расчет индекса ММВБ, составили 17,6 млрд руб. против 22,6 млрд руб. в пятницу. Среди отраслевых фондовых индексов РТС лучше рынка оказался металлургический сектор. В аутсайдерах дня оказался сектор машиностроения. Индекс акций «второго эшелона» показал динамику незначительно хуже базового индекса: индекс менее ликвидных акций РТС-2 потерял около 0,14%. Отраслевой индекс РТС – Нефти и газа прибавил 0,1% по итогам дня, индекс РТС – Потребительские товары и розничная торговля снизился на 0,45%, Индекс РТС – Электроэнергетика вырос на 1,53%, Индекс РТС – Металлы и добыча вырос на 0,74%, Индекс РТС – Финансы подрос на 0,41%, Индекс РТС-Промышленность прибавил 0,22%, а Индекс РТС-Телекоммуникации подрос на 0,28%. Индекс волатильности РТС по итогам дня вырос на 7,4%, что отразило усиление негативных ожиданий рыночных участников. Среди отраслевых индексов ММВБ, Индекс ММВБ-Химия и нефтехимия снизился на 0,32%, ММВБ-Нефть и газ вырос на 0,43%, ММВБ-Финансы прибавил 0,78%, ММВБ-Телекоммуникации подрос на 0,63%, ММВБ-Металлургия вырос на 1,1%, ММВБ-Потребительский сектор показал снижение на 0,13%, ММВБ-машиностроение прибавил 0,52%, а ММВБ-энергетика вырос на 1,6%.

В лидерах роста оказались привилегированные акции Дорогобуж и ВЕРОФАРМ, выросшие на 4,5%. Среди более ликвидных бумаг опережающим ростом отметились акции Россетей, прибавившие около 4 п.п. Акции РусГидро прибавили около 3,9%, а бумаги КАМАЗа выросли на 3,7%. Среди аутсайдеров дня оказались бумаги Русского Моря, упавшие на 9,2%. Падением отметились также привилегированные акции РАО ЭС Востока, упавшие на 8,3%. Бумаги Росбанка потеряли 5,9%. Акции МРСК Сибири и МРСК Центра просели на 4,9% и 3,2% соответственно.

Индикатор страха на мировых рынках упал: индекс волатильности опционов VIX снизился на 4,5% и составил 12,81. На рынке FOREX значение пары евро/доллар снизилось с 1,3321 долл. до 1,3299 долл. за евро. Пара иена/долл. скорректировалась с 96,21 иен до 96,92 иен за долл. Российский рубль в основных валютных парах показал разнонаправленное движение. Так, значение пары рубль/евро по итогам дня снизилась с 43,85 руб. до 43,91 руб. за евро, а пара рубль/долл.

Рыночные индикаторы*

US Tsys 10Y	2,64%	+0,82%
EUR/USD	1,3307	+0,05%
USD/JPY	97,46	-0,57%
EUR/GBP	0,85997	+0,02%
S&P 500	1689,47	-0,12%
VIX	12,81	-4,47%
DJIA	15412	+0,16%
Topix	1158,5	+2,07%
Shanghai Comp	2104,854	+0,17%
DJ EURO Stoxx 50	2827,15	+0,05%
РТС Индекс	1331,03	+0,34%
РТС Фьючерс	132780	+0,48%
ММВБ Индекс	1397,2	+0,64%

Лидеры роста/снижения за день

Дорогобуж_пр	16,89	+4,5%
ВЕРОФАРМ	700,1	+4,5%
Россети	1,17	+4,0%
РусГидро	0,5916	+3,9%
КАМАЗ	44,5	+3,7%
МРСК Центра	0,3627	-3,2%
МРСК Сибири	0,0831	-4,9%
Росбанк	63,4	-5,9%
РАО ЭС Востока_пр	0,11	-8,3%
Русское Море	32,23	-9,2%

* на 10-00 13 Августа 2013 г.

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

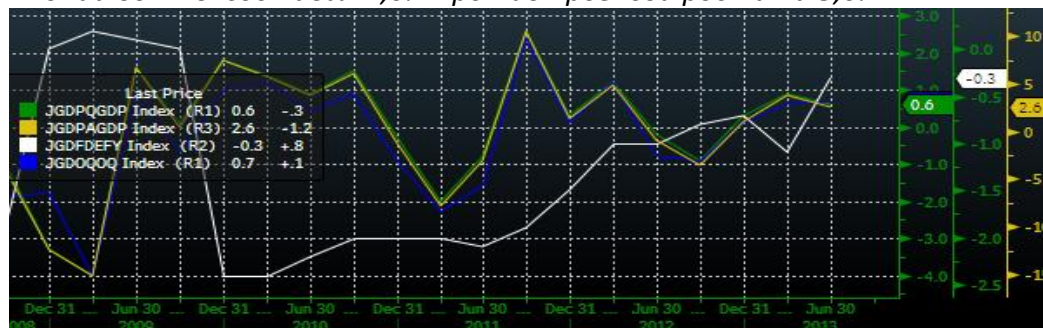
Ежедневный обзор

усилилась с 32,86 руб. до 33,00 руб. за доллар. На рынке металлов наблюдалось разнонаправленное движение котировок в узком диапазоне. Так, котировки никеля выросли на 0,3%, меди снизились на 0,4%, платины просели на 0,2%, палладия упали на 0,6%, золота выросли на 1,8%, серебра упали на 4,1%. Цена нефти смеси марки Brent стабилизировалась и составила на закрытии 109 долл. за барр.



Источник: Bloomberg

Макроэкономическая статистика была скудной. Стоит отметить смешанную статистику по экономике Японии. Рост ВВП Японии во 2 кв. составил 2,6% против прогноза роста на 3,6%.



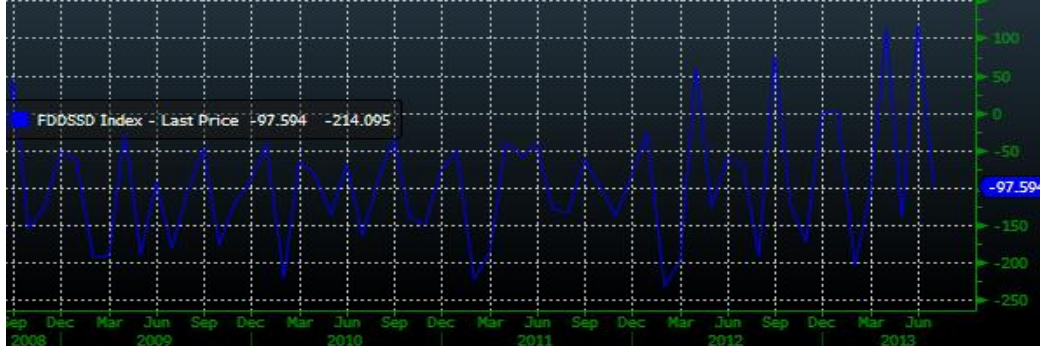
Источник: Bloomberg

Темпы снижения промышленного производства в Японии в июне замедлились до 4,6% против снижения на 4,8% в мае.

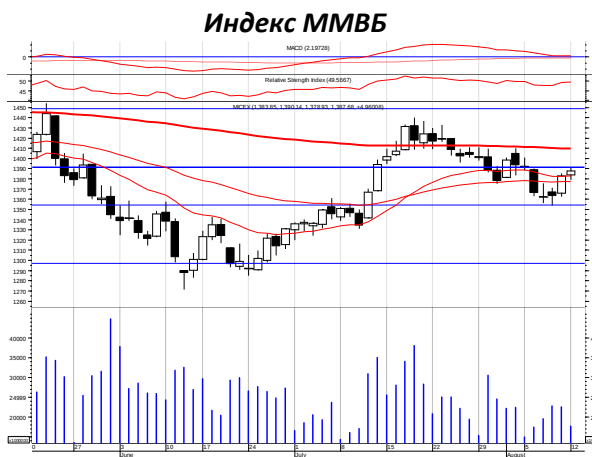


Источник: Bloomberg

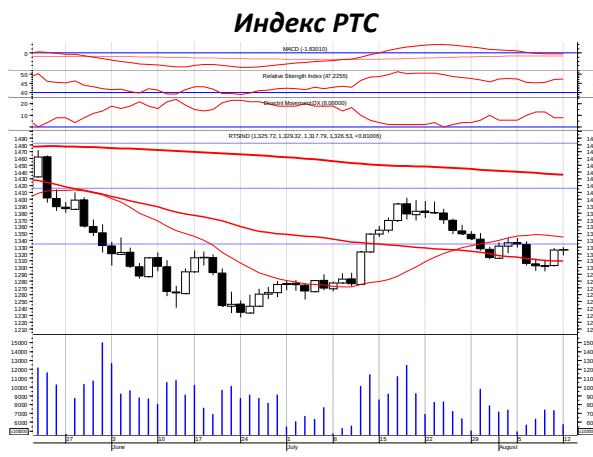
Бюджетный дефицит в США составил в июле 97,6 млрд. долл., что незначительно хуже прогноза в 96 млрд. долл.



Источник: Bloomberg



Источник: ММВБ



Источник: РТС

Взгляд на рынок и инвестиционные идеи

- ✓ На динамику российского фондового рынка в среднесрочной перспективе продолжает оказывать влияние усиление внешних факторов риска, разнонаправленные корпоративные новости и отсутствие внутренних инвестиционных идей.
- ✓ Декларирование приверженности мягкой кредитно-денежной политики со стороны ЕЦБ с возможностью применения дополнительных мер стимулирования может усилить «аппетит к риску» на мировых рынках, что должно оказать положительное влияние как на развивающиеся фондовые рынки в целом, так и на российский рынок в частности. Однако, пока преждевременно говорить о кардинальной переоценке инвестиционных приоритетов глобальных инвесторов в сторону emerging markets.
- ✓ Российский рынок не смог преодолеть 200-дневную скользящую среднюю по индексу ММВБ, что находится на уровне 1416 пунктов. В случае усиления тенденции роста индекс ММВБ может уйти в диапазон 1450-1490 пунктов между двумя веерными линиями Фибоначчи.
- ✓ С учетом неопределенного внешнего и внутреннего новостного фона для среднесрочного движения вверх на российском фондовом рынке нужны дополнительные поддерживающие факторы.

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

Динамика котировок российских акций

Эмитент	Цена на 13.08.13г. (руб.)	Рын. кап. (млн. долл.)	Изм. цены за 5 дн.	Изм. цены за 1 мес.	Изм. цены за 3 мес.	Изм. цены с нач. года	Изм. цены за 52 нед.	Макс. цена за 52 нед.	Мин. цена за 52 нед.
ФСК	0,117	5 077	+6,04%	+11,73%	-2,61%	-41,86%	-48,21%	0,27	0,09
РусГидро	0,5977	6 502	+5,45%	+8,81%	+12,80%	-18,55%	-30,73%	1,24	0,45
Иркутскэнерго	8,7	1 420	-3,27%	-8,94%	-21,80%	-47,07%	-41,12%	18,10	8,50
Интер РАО ЕЭС	0,01279	4 573	+3,28%	-3,86%	-1,38%	-48,52%	-51,40%	0,029	0,011
МРСК Центра	0,3648	527	-5,71%	+2,80%	-9,51%	-39,05%	-35,17%	0,70	0,32
Россети	1,182	2 317	+7,55%	+7,65%	-9,15%	-39,72%	-37,92%	2,50	0,98
МРСК ЦВ	0,12597	486	+0,35%	+6,15%	-11,98%	-26,77%	-13,05%	0,22	0,12
Мосэнерго	1,1773	1 603	+6,11%	+1,68%	-4,70%	-11,68%	-8,84%	1,68	1,03
МОЭСК	1,2486	2 083	+1,86%	+0,41%	-6,14%	-17,31%	-3,52%	1,79	1,15
ОГК-2	0,3218	1 217	+8,10%	+25,64%	+16,38%	-6,10%	-28,38%	0,48	0,22
Ленэнерго	4,968	193	+0,75%	+1,78%	-3,38%	-24,09%	-17,13%	7,81	4,03
Э.ОнРоссия	2,6577	5 739	+0,85%	+3,70%	-1,76%	+1,63%	-2,26%	2,98	2,24
Энель ОГК-5	1,2942	1 568	+0,88%	-1,59%	-1,36%	-20,11%	-27,09%	2,03	1,20
ТГК-1	0,006491	857	+1,42%	-4,72%	+1,82%	-5,59%	+3,86%	0,0085	0,0051
ТГК-2	0,001403	70	+2,11%	-2,43%	-11,65%	-37,34%	-35,86%	0,0030	0,0013
ТГК-5	0,002999	126	-0,37%	-1,77%	+2,95%	-16,04%	-35,70%	0,0055	0,0024
ТГК-6	0,003534	225	+4,84%	-7,97%	-7,90%	-2,08%	-27,97%	0,0064	0,0032
ТГК-9	0,003028	813	-0,72%	+4,19%	+0,93%	-8,24%	+10,61%	0,0046	0,0023
Волжская ТГК	1,693	1 740	-3,53%	+0,17%	+3,17%	+7,84%	-13,19%	2,35	1,21
БЕЛОН	4,407	174	+5,08%	+1,73%	-1,14%	-26,42%	-44,84%	8,47	3,62
Северсталь	272	7 803	+5,88%	+15,65%	-1,45%	-26,35%	-30,84%	437,70	203,20
ГМК Норникель	4275	25 204	-2,29%	-9,87%	-11,23%	-23,74%	-15,45%	6130,00	4063,00
ММК	8,355	3 197	+5,67%	+5,60%	+8,72%	-19,75%	-19,34%	11,78	6,70
МЕЧЕЛ	102,8	1 466	+7,76%	+5,65%	-18,80%	-49,71%	-53,59%	253,70	85,00
МЕЧЕЛ_пр	55,8	265	+5,20%	-0,66%	-15,16%	-53,12%	-64,75%	173,00	40,16
НЛМК	53,97	11 077	+11,88%	+18,02%	+4,80%	-11,74%	-9,79%	69,86	40,22
Полюс Золото	877,1	5 726	+4,23%	+2,11%	-6,87%	-2,83%	-9,77%	1310,00	787,60

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

АМЗ	4,272	73	+1,71%	+1,40%	-11,42%	-32,14%	-41,08%	8,70	3,70
Распадская	32,59	785	+4,35%	-4,90%	-25,44%	-43,68%	-57,75%	90,96	30,20
ТМК	90,95	2 920	+4,70%	+14,06%	+9,58%	-0,99%	-11,18%	113,00	69,00
РУСАЛ рдр	112,98	5 878	+0,76%	-10,10%	-27,65%	-41,11%	-34,31%	199,86	108,00
Polymetal	727	2 831	+14,13%	+43,68%	+3,71%	-38,13%	-18,32%	1231,00	439,50
Банк Санкт Петербург	43,13	540	-3,30%	-3,49%	+5,81%	-13,43%	-24,35%	70,99	28,98
Банк Москвы	834,5	7 766	+0,26%	-0,71%	+1,62%	-3,04%	-9,88%	957,90	700,20
Росбанк	63	3 347	-5,31%	-15,53%	-26,91%	-42,84%	-25,88%	115,00	47,16
Сбербанк	96,66	71 459	+2,05%	-1,91%	-6,46%	+4,02%	+3,80%	111,50	83,75
Сбербанк_пр	73,5	2 517	-0,07%	-1,54%	-2,94%	+9,15%	+9,41%	84,78	60,89
ВТБ	0,04654	20 657	+0,71%	-1,06%	-2,98%	-13,24%	-18,29%	0,06	0,04
Банк Возрождение	406,5	331	+1,09%	+9,78%	-17,04%	-24,58%	-38,29%	684,00	352,70
Банк Возрождение_пр	132,91	6	+0,26%	-0,05%	+1,92%	-4,62%	-26,92%	198,80	107,15
Номос-Банк	840,9	2 857	-2,84%	-3,34%	+3,60%	+2,17%	+11,54%	1039,00	577,60
Газпром	129,8	105 234	+3,11%	+6,80%	+0,15%	-9,80%	-16,31%	171,04	106,50
ЛУКОЙЛ	1931,9	56 274	+1,55%	-2,85%	-5,77%	-3,84%	+2,74%	2088,40	1781,30
Славнефть	399,99	453	-0,79%	-6,44%	+14,28%	+9,01%	+31,14%	471,00	291,10
НОВАТЕК	359,34	37 365	+4,56%	-1,53%	+15,51%	+3,87%	-0,47%	379,50	274,79
Роснефть	236,97	86 009	+1,35%	-3,89%	+6,24%	-12,27%	+16,81%	275,50	178,92
ГазпромНефть	121,82	19 780	+4,07%	+2,61%	-6,02%	-14,52%	-21,61%	177,25	110,22
Сургутнефтегаз	25,75	37 213	+1,71%	-3,62%	-1,15%	-4,07%	-10,28%	32,15	23,47
Сургутнефтегаз_пр	21,64	37 213	-0,05%	-0,06%	-0,59%	+8,65%	+8,57%	23,95	18,57
Татнефть	208,39	15 549	+3,81%	+2,32%	+0,28%	-4,39%	+4,02%	225,67	165,11
Татнефть_пр	102,88	520	-0,12%	+4,98%	-1,50%	-3,01%	+5,40%	113,00	89,00
Башнефть	1944,9	12 569	-0,28%	-3,28%	+2,99%	+10,36%	+16,91%	2400,00	1487,10
Башнефть_пр	1075	1 424	+0,94%	+2,39%	+5,68%	-19,31%	-6,85%	1540,50	854,90
ТНК-ВР	47	24 139	-0,32%	-3,89%	+4,37%	-19,26%	-37,95%	89,96	30,64
ТНК-ВР_пр	39,25	605	+3,34%	+3,29%	+10,07%	-10,51%	-41,07%	80,47	26,27
МНПЗ	8405	1 702	-1,25%	-0,94%	+5,06%	+13,97%	+91,11%	11481	4256,00
ННГ	13,6666	6	+0,00%	-8,89%	+16,81%	+1,16%	+18,27%	27,00	9,00

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

АК Транснефть	79263	19 278	+0,26%	+0,71%	+19,69%	+15,39%	+42,48%	86306	47280
АФК Система	23,1	382	+3,82%	+9,48%	+12,35%	+14,36%	+12,68%	24,07	15,21
МТС	296	20 947	+4,69%	+8,71%	+13,88%	+20,33%	+21,13%	296,92	222,78
Вымпелком (\$)	10,61	638	+6,31%	+2,22%	-5,69%	+8,12%	+22,21%	11,99	8,63
Мегафон	1080	22 320	+5,88%	+1,03%	+8,89%	+49,38%	-	1200,00	609,70
Ростелеком	114,23	11 514	+2,46%	+5,45%	-0,38%	-4,93%	-8,15%	141,40	86,54
Ростелеком_пр	77,41	644	-1,85%	+0,22%	-4,54%	-14,33%	-5,68%	107,96	66,97
АвтоВАЗ	9,499	593	+1,67%	-6,76%	-11,50%	-40,25%	-39,90%	18,50	8,90
АвтоВАЗ_пр	4,001	63	+1,27%	-3,82%	-1,70%	-33,49%	-34,45%	7,59	3,23
ИРКУТ	5,65	226	+7,17%	+3,76%	+7,23%	-4,63%	-3,50%	6,62	4,81
Московская биржа	56,15	4 574	-0,02%	+4,23%	+14,15%	-	-	67,72	42,57
КАМАЗ	45,1	1 092	+12,19%	+6,32%	+32,53%	+21,27%	+9,10%	46,62	26,73
ОМЗ	41,12	50	+2,75%	+14,19%	+24,38%	+29,51%	+20,76%	41,59	26,11
СОЛЛЕРС	710,3	834	+1,05%	-2,50%	+5,95%	+3,75%	+65,61%	827,00	420,40
Аэрофлот	56,7	2 157	+1,18%	-1,99%	+11,37%	+26,34%	+35,10%	59,89	38,56
Аптеки 366	25,6	92	-0,43%	-4,55%	+3,14%	-20,07%	-24,19%	38,90	18,75
ДИКСИ	491,3	2 099	+2,78%	+0,42%	+13,19%	+22,75%	+29,29%	517,00	298,50
Группа Черкизово	515,2	776	-2,44%	+1,84%	+0,82%	-4,77%	+4,08%	746,00	479,30
Разгуляй	11,62	76	+5,64%	-1,69%	-8,72%	-12,63%	-36,88%	18,72	9,84
Магнит	8100,7	26 233	+1,31%	+9,34%	+15,03%	+67,84%	+90,80%	8310,00	3800,00
М ВИДЕО	275,5	1 696	+0,15%	+8,53%	+7,96%	+14,66%	+6,86%	301,00	210,01
Фармстандарт	1651,5	2 137	+1,94%	+5,08%	-24,01%	+1,18%	+26,05%	2645,00	1280,60
АКРОН	1030,9	1 431	-3,08%	-15,93%	-18,57%	-26,31%	-25,24%	1555,00	996,00
ДОРОГОВУШ	15,105	373	-3,79%	-9,50%	-8,45%	-12,43%	-5,79%	19,50	13,51
ДОРОГОВУШ_пр	16,51	87	-4,00%	-7,23%	-5,60%	-9,02%	+5,79%	19,32	14,25
Нижнекамскнефтех им	25	1 379	+2,93%	-0,39%	+0,00%	-14,97%	-6,44%	33,00	22,25
Нижнекамскнефтех им_пр	20,1	151	+1,98%	-5,17%	-9,62%	-17,11%	-11,89%	28,50	17,00
Уралкалий	162,26	16 315	+7,73%	-25,34%	-29,00%	-30,92%	-37,23%	277,95	140,00

Источник: Bloomberg

Заявление об ограничении ответственности. Настоящие обзоры подготовлены в информационных целях. Они ни в коем случае не являются и не должны рассматриваться как предложение купить или продать соответствующие ценные бумаги. Информация, содержащаяся в данных обзорах, получена из вызывающих доверия открытых источников. Несмотря на то, что при подготовке

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

обзоров были предприняты необходимые меры для получения достоверной информации, ИК РУСС-ИНВЕСТ не исключает возможность включения в обзор ошибочной информации, предоставленной соответствующими источниками, и не несет за это ответственности. ИК РУСС-ИНВЕСТ, его работники и клиенты могут быть заинтересованы в покупке или продаже ценных бумаг, упомянутых в обзорах.

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ ИК РУСС-ИНВЕСТ

www.russ-invest.com

Москва

Тел: +7(495) 363-93-80

© 2011 | ОАО «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Лицензия ФСФР №077-08757-000100 и №077-08755-001000

Лицензия ФСФР №177-06310-100000 и №177-06312-010000

Лицензия ФСФР №906