

Ежедневный обзор по рынку акций

Комментарий по рынку

В пятницу российский рынок акций продолжил корректироваться вниз после существенного роста в начале прошлой недели. Неопределенность, связанная с решениями ФРС по итогам предстоящего в ближайшие дни заседания американского регулятора, вероятно, заставила часть инвесторов зафиксировать прибыль. Кроме того, участников рынка не порадовала информация о продолжающемся высокими темпами оттоке средств из фондов, инвестирующих в российские акции. Вечером в Штатах вышли худшие, чем ожидалось, статданные по розничным продажам и индексу потребительского доверия от университета Мичигана, однако они не оказали заметного воздействия на ход сессии – игроки посчитали, что они увеличивают шансы на более сдержанное сокращение стимулирующих программ в США. По итогам дня индекс ММВБ потерял немного более полпроцента, оставшись выше отметки 1440 пунктов. Объемы торгов при этом оказались минимальными за неделю.

Сегодня мы ждем позитивного начала торговой сессии на рынке акций РФ. Американские фондовые индексы в пятницу умеренно повысились, между тем, фьючерс на индекс S&P 500 с утра растет более чем на процент, позитивная динамика преобладает на азиатских биржах. Поводом для улучшения настроений инвесторов стали сообщения о том, что Л. Саммерс отозвал свою кандидатуру на пост главы ФРС. Наиболее вероятным кандидатом на этот пост теперь становится зампреда ФРС Д. Йеллен, являющаяся сторонницей мягкой денежно-кредитной политики. В то же время котировки нефти Brent опустились ниже отметки \$111 за баррель.

В течение дня участники рынка будут ждать очередных новостей по Сирии – как ожидается, сегодня ООН обнародует отчет по итогам расследования предполагаемого применения химического оружия под Дамаском 21 августа. Из интересной макростатистики можно выделить лишь окончательную оценку потребительской инфляции в Еврозоне за август, а также данные по промпроизводству в США. Впрочем, учитывая близость знакового заседания ФРС, реакция участников рынка на поступающие экономические данные может оказаться довольно сдержанной.

Динамика индекса ММВБ



Мировые фондовые индексы

Dow Jones	15 376.1	+0.49%
S&P 500	1 688.0	+0.27%
Nasdaq	3 722.2	+0.17%
FTSE 100	6 583.8	-0.08%
DAX	8 509.4	+0.18%
CAC 40	4 114.5	+0.19%
Micex	1 440.8	-0.65%
RTSI	1 396.6	-0.35%
Nikkei 225	14 404.7	+0.12%
ASX 200	5 250.2	+0.56%
KOSPI	2 009.2	+0.74%
Bovespa	53 797.5	+0.92%
Shanghai Composite	2 230.9	-0.24%
Hang Seng	23 182.0	+1.16%
Sensex	19 949.5	+1.12%
MSCI World	1 533.7	+0.05%
MSCI EM	986.8	-0.36%
MSCI Russia	773.7	-0.33%
S&P 500 Fut	1 700.2	+1.09%

Сырьевые товары

Нефть Brent	110.8	-0.76%
Нефть WTI	107.4	-0.73%
Золото	1 328.5	+1.19%
Никель	13 809.5	+0.70%
Алюминий	1 744.5	-1.23%
Медь	7 010.5	-0.26%

Доходности облигаций

UST 10Y	2.89%	-3 б.п.
Germany 10Y	1.98%	-2 б.п.
Japan 10Y	0.73%	0 б.п.
Italy 10Y	4.58%	+5 б.п.
Spain 10Y	4.49%	+3 б.п.
Russia 2030	4.28%	-3 б.п.

Котировки валют

EUR/USD	1.336	+0.52%
GBP/USD	1.595	+0.50%
USD/JPY	98.943	+0.45%
USD/RUB	32.412	+0.13%

Макроэкономическая статистика

Время	Страна	Статистика/событие	Период	Прогноз	Предыдущее значение
13:00	Еврозона	Индекс потребительских цен, г/г	август	1.3%	1.3%
16:30	США	Производственный индекс ФРБ Нью-Йорка	сентябрь	9.00	8.24
17:15	США	Промышленное производство, м/м	август	0.4%	0.0%
17:15	США	Коэффициент загрузки производственных мощностей	август	77.9%	77.6%
19:30	США	Продажа 3- и 6-месячных векселей на \$55 млрд.			

Основные события дня

В Конгрессе США состоится голосование по законопроекту о временном финансировании работы правительства.

Президент ЕЦБ М. Драги выступит с речью (12:00 мск).

ООН обнародует отчет по итогам расследования предполагаемого применения химического оружия в Сирии 21 августа.

Биржи Японии закрыты в связи с национальным праздником – Днем почитания старших.

Данные отчетности американских компаний

Дата	Компания	EPS факт, \$	EPS прогноз, \$
13/09	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	0.700	0.666
13/09	United Natural Foods Inc	0.650	0.603
14/09	Globecomm Systems Inc	0.190	0.193
16/09	Chimera Investment Corp		0.108
16/09	Oclaro Inc		-0.367
17/09	Coty Inc		0.013
17/09	FactSet Research Systems Inc		1.190
17/09	Adobe Systems Inc		0.337
18/09	FedEx Corp		1.501
18/09	Oracle Corp		0.561
18/09	General Mills Inc		0.699
19/09	Pier 1 Imports Inc		0.209
19/09	Rite Aid Corp		-0.023
19/09	ConAgra Foods Inc		0.398
19/09	TIBCO Software Inc		0.220
19/09	Ascena Retail Group Inc		0.217
20/09	Darden Restaurants Inc		0.703

Новости компаний**Квадра**

Событие. По данным газеты «Коммерсантъ», в пятницу ФАС разрешила офшору Михаила Прохорова Ragato Management приобрести 30% акций Квадры. По неофициальным данным, группе ОНЭКСИМ косвенно принадлежит 81% акций Квадры, при этом с 2008г. структуры Прохорова избегали выставления оферты миноритариям.

Комментарий. Новость должна подогреть интерес к бумаге: миноритарии давно ждут оферту, и, хотя предложенная цена окажется значительно ниже цены 2008г., средневзвешенная цена за 6 месяцев превышает текущую приблизительно на 15%. В то же время, с учетом аффилированности между участниками сделки, не исключено, что компания снова сможет избежать оферты, тогда акции Квадры снова окажутся в районе исторического минимума. В ожидании дальнейших новостей бумаги компании получают заметную поддержку: уже в пятницу рост цены акции составил почти 8%.

Голубые фишки

Газпром ао

Газпром торгуется в диапазоне 135-145 руб., в ближайшее время вероятно движение к отметке 145руб., являющейся ближайшим сопротивлением. Ближайшая поддержка находится в районе 135 руб., далее 122руб.



Источник: Transaq 1-Hour Chart

Роснефть ао

Роснефть торгуется в диапазоне 250-265 руб. В ближайшее время вероятно продолжение консолидации в данном диапазоне. Ближайшая поддержка расположена в районе 250 руб., далее 240 руб., ближайшее сопротивление – 265 руб.



Источник: Transaq, 1-Hour Chart

Лукойл ао

Лукойл торгуется в диапазоне 1990 - 2030 руб. вблизи отметки 2030руб., являющейся ближайшим сопротивлением. В ближайшее время вероятна консолидация внутри данного канала. Ближайшая поддержка расположена на отметке 1990 руб., далее 1890 руб.



Источник: Transaq, 1-Hour Chart

Сбербанк ао

Сбербанк продолжает консолидацию в канале 93-98 руб. В ближайшее время вероятно движение к верхней границе диапазона 98руб., являющейся ближайшим сопротивлением. Ближайшая поддержка находится в районе 93 руб., далее 88 руб.



Источник: Transaq 1-Hour Chart

ВТБ ао

ВТБ торгуется в диапазоне 0,0438-0,0448 руб. Ближайшее сопротивление находится на отметке 0,0448 руб., далее 0,0462 руб., ближайшая поддержка находится в районе 0,0438 руб.



Источник: Transaq 1-Hour Chart

ГМК Норникель ао

ГМК Норникель торгуется в диапазоне 4500-4750 руб. В ближайшее время вероятно продолжение консолидации внутри канала. Ближайшая поддержка находится в районе 4500 руб., далее 4300 руб., ближайшее сопротивление – 4750 руб.



Источник: Transaq 1-Hour Chart

Группа клиентской аналитики
(Департамент клиентского обслуживания)

Зайцева Анна
Руководитель
+7 (495) 796-90-26, доб.2025
zaytseva@corp.finam.ru

Додонов Игорь
Консультант-аналитик
+7 (495) 796-90-26, доб.1627
idodonov@corp.finam.ru

Пальянов Андрей
Консультант-аналитик
+7 (495) 796-90-26, доб.2040
palyanov@corp.finam.ru

Бертяков Сергей
Консультант-аналитик
+7 (495) 796-90-26, доб.2045
sbertyakov@corp.finam.ru

Рублевская Екатерина
Консультант-аналитик
+7 (495) 796-90-26, доб.1636
erublevskaya@corp.finam.ru

Силакова Екатерина
Управляющий активами
УК «Финам Менеджмент»
+7 (495) 796-90-26, доб.1608
silakova@corp.finam.ru

Отдел Классического Рынка
(доверительное и консультационное
управление, операции в РТС и на внебиржевом
рынке)

Коновалов Василий
Руководитель отдела
+7(495) 796-93-88, доб.2744
konovalov@corp.finam.ru

Голубев Артем
Портфельный менеджер
+7(495) 796-93-88, доб.2745
golubev@corp.finam.ru

Дубинин Иван
Портфельный менеджер
+7(495) 796-93-88, доб.2747
dubinin_i@corp.finam.ru

Зюриков Александр
Портфельный менеджер
+7(495) 796-93-88, доб.2740
zyurikov@corp.finam.ru

Степаненко Александр
Портфельный менеджер
+7(495) 796-93-88, доб.2748
stepanenko@corp.finam.ru

Настоящий материал и содержащиеся в нем сведения предназначены для клиентов ЗАО «ФИНАМ», носят исключительно информативный характер и не могут рассматриваться ни как приглашение или побуждение сделать оферту, ни как просьба купить или продать ценные бумаги/другие финансовые инструменты, либо осуществить какую-либо иную инвестиционную деятельность. Представленная информация подготовлена на основе источников, которые, по мнению авторов данного аналитического обзора, являются надежными, но при этом отражает исключительно мнение авторов относительно анализируемых объектов. Несмотря на то, что настоящий обзор был составлен с максимально возможной тщательностью, ни его авторы, ни ЗАО «ФИНАМ» не заявляют и не гарантируют ни прямо, ни косвенно его точность и полноту. Любая информация и любые суждения, приведенные в данном материале, являются суждением на момент публикации настоящего аналитического обзора и могут быть изменены без предупреждения. Ни ЗАО «ФИНАМ», ни его сотрудники не несут ответственности за какие-либо потери, возникшие в результате использования настоящего материала либо в какой-либо другой связи с ним. Копирование, воспроизводство и/или распространение настоящего материала, частично или полностью, без письменного разрешения ЗАО «ФИНАМ» категорически запрещено.