ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ ИК РУСС-ИНВЕСТ

Ежедневный обзор

2 Сентября, 2015

Комментарий

Во вторник 1 Сентября российские фондовые индексы продолжили рост. По итогам дня Индекс ММВБ вырос на 2,06%, а Индекс РТС взлетел на 6,7%. Торговая активность стабилизировалась. Так, биржевые обороты по акциям, входящим в расчет индекса ММВБ, составили 36,5 млрд. руб. против 32,0 млрд. руб. в понедельник. Среди отраслевых индексов в лидерах роста оказался сектор электроэнергетики и нефтегазовый сектор. Хуже рынка оказался металлургический сектор. Индекс акций «второго эшелона» показал динамику хуже базового индекса: индекс менее ликвидных акций РТС-2 вырос на 6,33%. Отраслевой индекс РТС – Нефти и газа по итогам дня вырос на 7,22%, индекс РТС – Потребительские товары и розничная торговля прибавил на 5,51%, Индекс РТС – Электроэнергетика вырос на 7,53%, Индекс РТС – Металлы и добыча подрос на 3,55%, Индекс РТС – Финансы прибавил 6,56%, Индекс РТС-Промышленность вырос на 6,15%, а Индекс РТС-Телекоммуникации вырос на 6,69%. Индекс волатильности РТС по итогам дня упал на 8,3%, что отразило ослабление негативных рыночных ожиданий участников торгов. Среди отраслевых индексов ММВБ, Индекс ММВБ-Химия и нефтехимия упал на 1,58%, Индекс ММВБ-Машиностроение вырос на 1,54%, Индекс ММВБ-Потребительский сектор подрос на 0,93%, Индекс ММВБ-Нефть и газ вырос на 2,57%, Индекс ММВБ-Телекоммуникации прибавил 2,06%, Индекс ММВБ-Финансы вырос на 2,08%, Индекс ММВБ-Металлургия просел на 0,94%, а Индекс ММВБ-Энергетика вырос на 2,77%.

В лидерах роста среди эмитентов по итогам дня оказались акции Трансаэро на сообщении о возможной покупке компании со стороны Аэрофлота. Котировки акций Трансаэро взлетели на 39,8%. Привилегированные акции РАО ЭС Востока прибавили в цене 6,3%. Котировки акций Полюс Золото и ЮТэйр выросли на 4,0%. Акции Московской Биржи выросли в цене на 3,1%. В аутсайдерах дня оказались привилегированные акции Банка Возрождение, цена которых упала на 6,3%. Цена акций Аэрофлота упала на 5,8%. Котировки бумаг QIWI упали на 5,5%. Котировки обыкновенных акций Татнефти упали на 4,0%. Котировки акций Южного Кузбасса потеряли около 3,9%. Среди бумаг, входящих в Индекс ММВБ, в лидерах роста помимо акций Московская Биржа оказались акции Мостотрест (+2,5%) и акции АЛРОСА (+2,3%), а в лидерах снижения помимо акций Аэрофлота и обыкновенных акций Татнефти оказались бумаги НОВАТЭК (-3,6%) и акций Группы Черкизово (-3,5%).

Рыночные индикаторы*		
US Tsys 10Y	2,16%	+0,17%
EUR/USD	1,1258	-0,49%
USD/JPY	120,06	-0,57%
EUR/GBP	0,73555	+0,51%
S&P 500	1913,85	-2,96%
VIX	31,4	+10,45%
DJIA	16058,35	-2,84%
Shanghai Comp	3160,167	-0,20%
DJ EURO Stoxx 50	3206,11	+0,55%
РТС Индекс	802,35	-0,34%
РТС Фьючерс	80470	+0,61%
ММВБ Индекс	1695,72	-0,13%
Лидеры роста/снижения за день		
Трансаэро	116	+39,8%
РАО ЭС Востока пр	0,1935	+6,3%
Полюс Золото	2 465	+4,0%
ЮТэйр	10,4	+4,0%
Московская Биржа	76,6	+3,1%
Южный Кузбасс	587	-3,9%
Татнефть	310	-4,0%
QIWI	1 640	-5,5%
Аэрофлот	37,7	-5,8%
Банк Возрождение пр	215,5	-6,3%

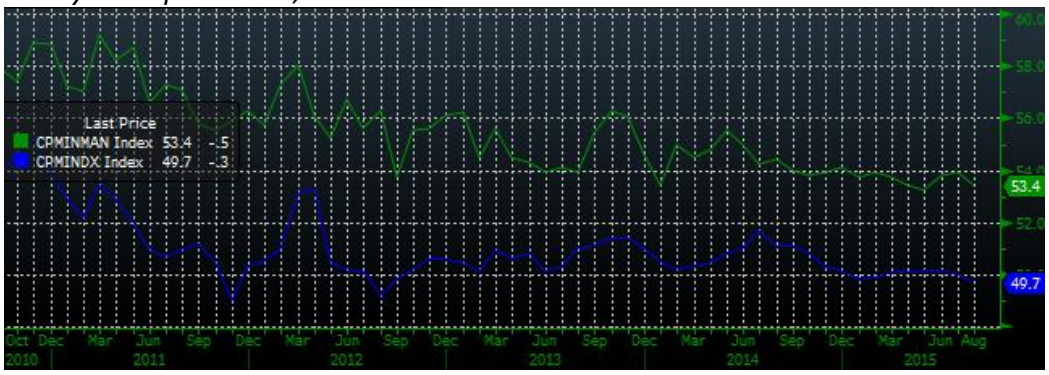
* на 19-00 1 Сентября 2015 г.

Индикатор уровня риска на американском фондовом рынке вновь резко вырос. Так, индекс VIX по итогам дня вырос на 10,5% к предыдущему закрытию и составил 31,4. На рынке FOREX значение пары EUR/USD выросло с 1,121 долл. до 1,1318 долл. за евро. Значение пары доллар/ японская иена упало со 121,3 иен до 119,3 иен за долл. На внутреннем валютном рынке рубль в основных валютных парах резко ослаб. Так, значение пары EUR/RUB выросло с 72,07 руб. до 75,63 руб. за евро, а значение пары USD/RUB выросло с 64,27 руб. до 66,83 руб. за доллар. На товарном рынке наблюдалось резкий рост цен на металлы. Так, котировки серебра выросли на 2,55%, котировки меди выросли на 4,15%, цены никеля выросли на 5,17, палладия взлетели на 7,35%, платины выросли на 2,63%. Котировки золота по итогам дня просел на 0,2% и закрылись на уровне 1122 долл. за тр. ун. Котировки нефти смеси марки Brent упал более чем на 8,5% и закрылись на уровне 48,6 долл. за барр.



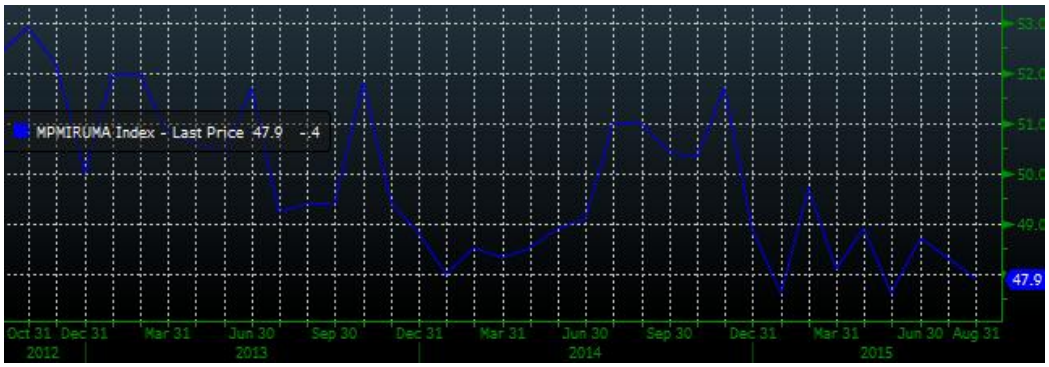
Источник: Bloomberg

Данные макроэкономической статистики оказались разнонаправленными. Индекс PMI в промышленности Китая упал до 49,7 в августе против 50,0 в июле.



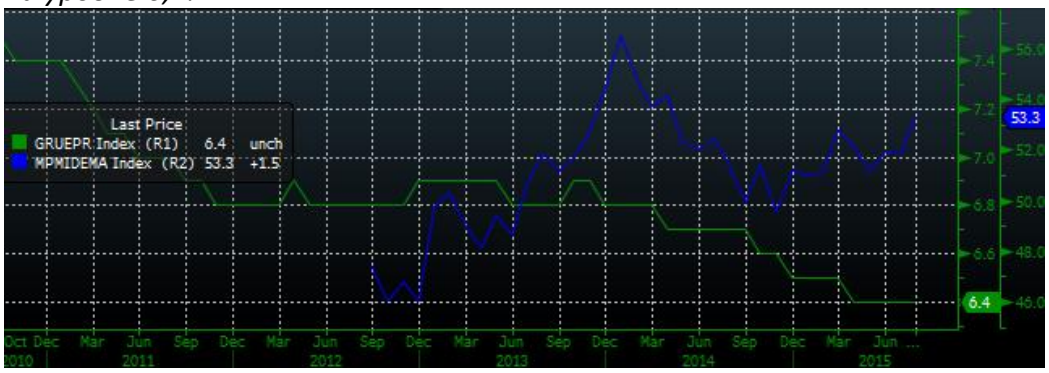
Источник: Bloomberg

Индекс PMI в промышленности России составила в августе 47,9 против 48,3 в июле.



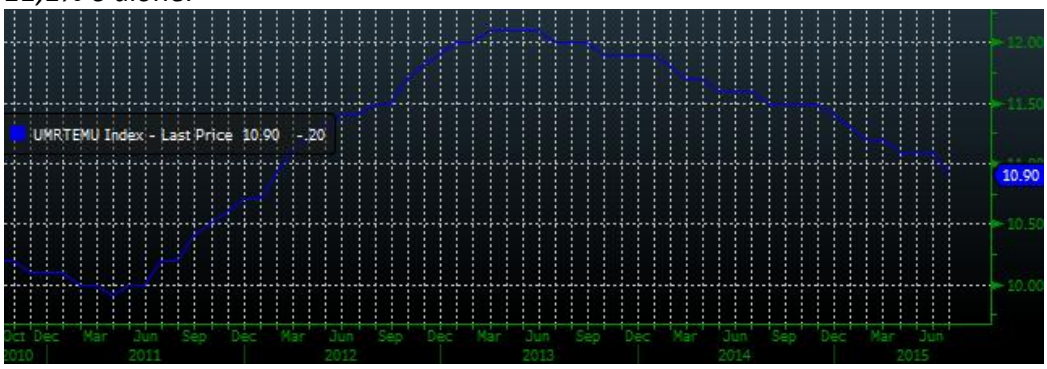
Источник: Bloomberg

Индекс PMI в промышленности Германии составила в августе 53,3 против 53,2 в июле. Уровень безработицы в Германии в августе остался на уровне 6,4%.



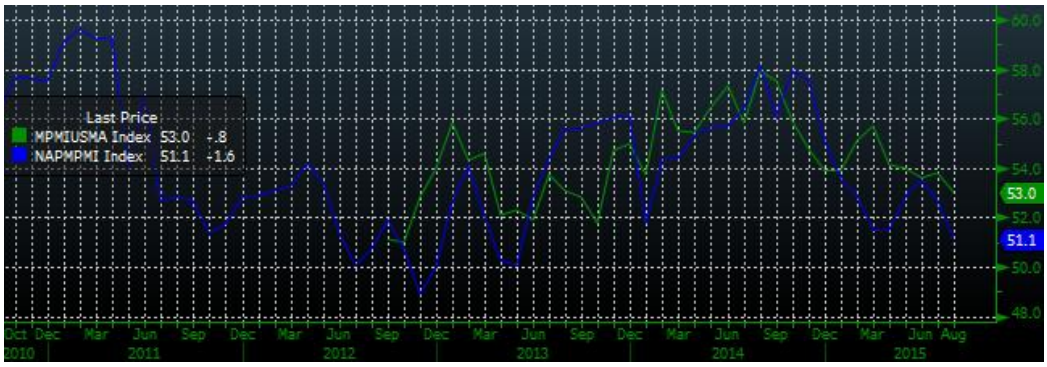
Источник: Bloomberg

Уровень безработицы в еврозоне в июле упал до 10,9% против 11,1% в июне.



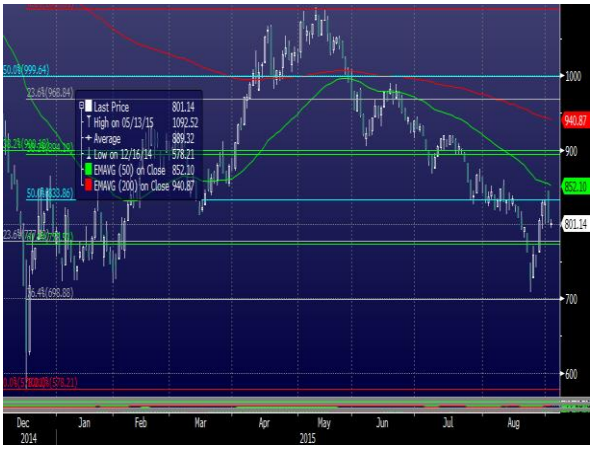
Источник: Bloomberg

Индекс PMI в промышленности США составила в августе 53,0 против 52,9 в июле. Индекс деловой активности в промышленности ISM опустился в августе до 51,1 против 52,7 в июле.



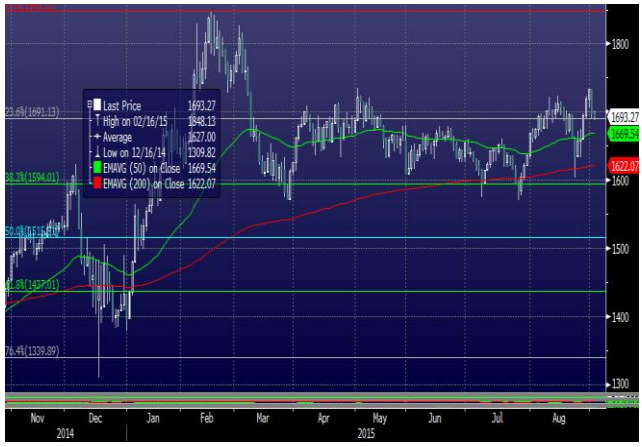
Источник: Bloomberg

Индекс РТС



Источник: Московская Биржа

Индекс ММВБ



Источник: Московская Биржа

Взгляд на рынок

- ✓ ***На динамику российского фондового рынка в среднесрочной и долгосрочной перспективе по прежнему будет оказывать сильное влияние ситуация в Украине и перспективы ужесточения взаимных санкций между Россией, ЕС и США. Пока сложно прогнозировать сценарии дальнейшего развития конфликта и перспективы дальнейших санкций. В части прекращения боевых действий минские соглашения в целом соблюдаются. Однако, многое будет зависеть от степени продвижения реализации других пунктов минских договоренностей и соблюдения мира в будущем.***
- ✓ ***На графике индекса широкого рынка S&P 500 наблюдается господство бокового тренда. Для формирования направленного тренда должны усилиться дестабилизирующие факторы, чего пока не наблюдается, хотя признаки перекупленности рынка достаточно красноречивы. В условиях сохраняющейся неуверенности участников рынка относительно наступления периода ужесточения кредитно-денежной политики ФРС, «аппетит к риску» на глобальных рынках снижается и усиливается спрос на защитные активы. Инвесторы все больше реагируют на противоречивую макроэкономическую статистику и комментарии официальных лиц, пытаясь краткосрочно спекулировать на ожиданиях очередных шагов в рамках проведения кредитно-денежной политики ведущих центробанков мира. Из макроэкономической статистики на текущей неделе значимыми станут данные по количеству новых рабочих мест в США и результатам заседания управляющего совета ЕЦБ.***

- ✓ ***На российском фондовом рынке техническая картина складывается в пользу сохранения бокового движения с некоторым наклоном вниз. В конце июля Индекс ММВБ вышел за пределы среднесрочного узкого бокового коридора, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящих средних. В то же время совокупность фундаментальных факторов свидетельствует скорее в пользу снижения индексов. В ближайшее время инвесторы будут внимательно следить за рынком нефти и курсом рубля.***

Динамика котировок российских акций

Эмитент	Цена на 01.09.15г. (руб.)	Рын кап. (млн. долл.)	Изм цены за 1 дн.	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.
РусГидро	0,5325	3 154	-0,06%	+4,95%	-0,56%	-6,54%	-1,77%	-22,58%	0,76	0,40
Иркутскэнерго	7,01	514	-0,14%	+1,74%	+5,71%	-11,79%	+18,35%	+5,44%	11,20	5,07
Интер РАО ЕЭС	1,138	1 786	+2,80%	+5,74%	-1,63%	-8,64%	+56,60%	+23,80%	1,30	0,52
Э.ОнРоссия	2,862	2 790	+1,81%	+5,06%	+11,18%	-4,41%	+26,49%	+19,58%	3,25	2,03
Энель Россия	0,816	440	+0,74%	+1,38%	-3,23%	-9,80%	+9,61%	-19,99%	1,086	0,635
ТГК-1	0,0045	264	+0,00%	+3,12%	-2,25%	-11,90%	-2,25%	-30,04%	0,0066	0,0034
ТГК-2	0,00118	26	-0,84%	+2,17%	-2,08%	-13,92%	+29,83%	+34,29%	0,0018	0,0005
Квадра	0,00267	77	-0,74%	-1,50%	+5,82%	+0,57%	-30,84%	+14,57%	0,0045	0,0023
ОГК-2	0,2499	421	+0,56%	+7,12%	-0,53%	-7,70%	+54,34%	+26,56%	0,32	0,12
Мосэнерго	0,824	500	+0,00%	+0,55%	-6,60%	-12,85%	+28,20%	-2,78%	1,08	0,54
Т Плюс	0,665	457	+0,00%	+6,35%	+2,29%	-2,19%	-38,81%	-55,18%	1,57	0,60
МРСК Центра	0,2195	143	-2,44%	+2,80%	+0,00%	-17,11%	-12,67%	-27,30%	0,37	0,19
Россети	0,452	1 121	-1,74%	+3,78%	-3,82%	-13,78%	+9,24%	-12,62%	0,67	0,29
МРСК ЦиП	0,0705	120	+3,68%	+1,61%	+0,72%	+0,00%	-28,05%	-30,47%	0,11	0,07
ФСК	0,06499	1 264	-0,55%	+2,85%	-4,97%	-0,08%	+41,43%	+20,04%	0,08	0,03
МОЭСК	0,875	658	-2,23%	+7,98%	+9,32%	+1,15%	-29,60%	-12,90%	1,4200	0,7750
МРСК СЗ	0,028	41	+2,56%	+4,51%	-0,71%	-4,47%	+9,88%	-10,61%	0,0395	0,0200
МРСК СК	14,25	34	+0,71%	+8,75%	-4,67%	-11,46%	+18,18%	-11,89%	20,10	10,00
Ленэнерго	2,54	65	-0,39%	+4,74%	+5,83%	+11,40%	+45,14%	-6,58%	4,25	1,40
МРСК Урала	0,06619	90	+0,85%	+3,85%	-2,05%	-11,32%	+10,27%	+12,22%	0,0918	0,0470
МРСК Волги	0,0218	60	-1,13%	+2,80%	+6,80%	-6,18%	-21,15%	-9,84%	0,03	0,02
АЛРОСА	65	7 433	+1,40%	+4,02%	-7,61%	+2,14%	+4,41%	+64,24%	84,10	34,13
БЕЛОН	4	70	+0,50%	+1,53%	+1,53%	+5,70%	+18,57%	+41,49%	6,11	2,55

Северсталь	725,2	9 280	+4,60%	+2,12%	+5,02%	+18,15%	+43,85%	+125,02%	749,50	317,82
ГМК Норникель	10569	25 178	+1,33%	+2,97%	+10,00%	+11,47%	+28,34%	+43,23%	12247	6766
ММК	22,25	3 729	+5,95%	+4,77%	+15,15%	+47,88%	+101,01%	+203,02%	22,34	7,10
МЕЧЕЛ	68,39	450	+6,21%	+23,90%	+15,52%	+5,70%	+185,31%	+105,54%	99,65	11,10
МЕЧЕЛ_пр	45,7	99	+6,28%	+19,23%	+8,06%	+2,18%	+184,23%	+283,98%	69,69	8,20
НЛМК	80,64	7 344	+2,57%	+0,15%	+0,82%	+8,40%	+19,58%	+52,54%	93,60	48,00
Полюс Золото	2370	6 771	+0,00%	+3,81%	+28,61%	+47,73%	+132,08%	+361,16%	2755,00	456,00
АМЗ	5,28	40	-0,75%	-2,77%	+4,36%	+0,96%	+0,19%	-13,61%	6,85	3,20
Распадская	39,42	425	+2,39%	+5,74%	+8,57%	+5,04%	+71,35%	+117,14%	52,88	15,43
ТМК	54,3	837	+1,50%	+3,19%	-0,72%	+3,97%	+57,14%	-38,91%	93,98	28,70
РУСАЛ рдр	300,5	6 947	-0,66%	-2,30%	+4,20%	+4,20%	-15,82%	+55,93%	545,80	190,35
Polymetal	491,5	3 110	+0,51%	-3,72%	+10,13%	+7,05%	-6,18%	+49,90%	716,98	269,11
Банк Санкт Петербург	36,95	255	-1,07%	+2,03%	-3,21%	-1,69%	+54,40%	+14,43%	42,95	23,20
Банк Москвы	748	3 256	-2,86%	-1,51%	-2,50%	-3,94%	-8,65%	-22,59%	1033,00	720,00
Росбанк	45	1 071	-1,10%	+0,00%	-4,05%	+0,45%	+3,69%	-13,61%	56,99	26,80
Сбербанк	74,5	24 291	-0,43%	+3,60%	+1,44%	+0,95%	+33,59%	-0,46%	81,30	47,21
Сбербанк_пр	54,34	823	+0,67%	+4,46%	+4,40%	+11,70%	+42,31%	-1,83%	62,17	36,54
ВТБ	0,069	13 417	-0,93%	-3,61%	-6,29%	-16,03%	+0,70%	+76,07%	0,083	0,037
Банк Возрождение	533	195	+5,34%	+4,29%	-4,63%	+10,08%	+30,17%	+36,83%	596,00	355,00
Банк Возрождение_пр	230	5	+13,30%	+27,60%	-9,59%	-2,58%	+247,52%	+152,58%	299,00	55,50
Славнефть-Мегионнефтегаз	521	801	+1,17%	+0,96%	+0,00%	-12,50%	-30,00%	-19,48%	894,00	470,00
Славнефть-Мегионнефтегаз пр	533	270	+4,51%	+2,70%	+5,34%	+0,57%	-27,97%	-16,72%	845,00	400,00
Газпром	148,19	52 777	+1,08%	+3,49%	+1,96%	+4,23%	+11,50%	+9,81%	166,94	113,73
ЛУКОЙЛ	2531	32 283	+0,44%	+3,89%	-2,52%	+1,07%	+11,18%	+21,56%	3297,70	1913,00
Славнефть	533	270	+4,51%	+2,70%	+5,34%	+0,57%	-27,97%	-16,72%	845,00	400,00
НОВАТЕК	633	28 590	+3,11%	+9,53%	+3,84%	+16,87%	+41,21%	+67,05%	633,00	364,50
Роснефть	245,1	39 766	-0,51%	+3,89%	+3,32%	+3,62%	+24,90%	+6,79%	294,20	183,95
ГазпромНефть	146,9	10 606	-0,47%	+1,96%	+6,11%	+5,65%	+1,96%	+2,77%	237,00	124,00
Сургутнефтегаз	34,295	18 503	-1,52%	+1,79%	-0,71%	+5,86%	+43,52%	+31,85%	39,80	21,82

Сургутнефтегаз_пр	40,4	4 767	+0,57%	+3,16%	+6,85%	+3,21%	+36,75%	+51,35%	47,87	24,12
Татнефть	323	10 463	+3,19%	+8,51%	+3,69%	+7,78%	+36,98%	+37,70%	354,40	208,85
Татнефть_пр	174	393	-0,40%	+7,63%	+6,83%	+10,44%	+29,38%	+26,61%	192,00	116,50
Башнефть	1783	4 004	+0,73%	+0,23%	-7,11%	-13,69%	+41,20%	-5,87%	2400,00	930,00
Башнефть_пр	1359	616	+0,15%	+3,45%	+0,45%	-12,01%	+46,20%	-1,96%	1764,00	681,00
АК Транснефть	157900	3 724	+2,53%	-2,80%	+13,03%	+26,68%	+23,89%	+91,03%	168200	80892
Qiwi	1700	1 679	+0,00%	+3,90%	+2,98%	+7,12%	+52,42%	+24,27%	2000,00	1060,00
Yandex ($)	12,2	3 943	-1,21%	+19,84%	-12,29%	-32,48%	-32,07%	-57,09%	32,05	9,94
АФК Система	20,14	2 949	+0,95%	-0,40%	-5,55%	+18,08%	+74,74%	-45,72%	38,00	5,02
МТС	228,85	7 265	-0,02%	+1,98%	+1,89%	-5,07%	+35,55%	-17,72%	306,50	154,10
Вымпелком ($)	4,67	8 204	+0,65%	+10,14%	-19,20%	-23,82%	+11,86%	-45,19%	9,14	3,09
Мегафон	814	7 648	-0,49%	-0,50%	+5,10%	-1,59%	-1,95%	-17,79%	1111,00	712,00
Ростелеком	81,49	3 301	+0,05%	+4,00%	-5,17%	-1,59%	-7,37%	-17,75%	112,40	75,62
Ростелеком_пр	56,7	212	-0,35%	+1,97%	+2,52%	-1,90%	-0,35%	-12,07%	73,48	54,22
АвтоВАЗ	9,68	269	+0,21%	+0,42%	-4,57%	-11,83%	+14,27%	+1,40%	14,60	6,30
АвтоВАЗ_пр	3,03	21	+1,00%	+2,23%	-4,17%	-9,27%	+12,01%	-7,33%	4,10	2,20
ИРКУТ	6,53	117	-1,51%	+0,15%	+3,48%	+2,18%	+16,76%	+11,76%	8,92	4,16
Московская биржа	74,31	2 631	+0,42%	+5,41%	+6,75%	+4,19%	+27,43%	+24,29%	79,77	55,90
КАМАЗ	35,3	390	+0,28%	+4,51%	+0,00%	-4,64%	+38,27%	+4,75%	53,00	20,55
СОЛЛЕРС	401	216	+0,00%	+2,76%	+11,72%	-13,68%	+17,14%	-23,55%	559,90	298,00
Аэрофлот	40	676	+2,46%	+2,45%	+0,86%	-2,07%	+23,15%	-15,73%	48,40	26,35
Трансаэро	83	198	+6,41%	+9,80%	-5,62%	-14,29%	-59,90%	-59,02%	239,00	73,00
ОАК	0,277	990	+1,65%	+1,30%	-0,55%	+11,86%	+198,91%	+164,57%	0,32	0,07
Аптеки 366	14,15	23	+1,07%	+1,81%	+0,79%	-0,92%	+10,02%	+13,31%	25,10	10,00
ДИКСИ	314	594	-0,32%	+1,64%	-6,48%	-17,53%	-13,68%	-26,01%	504,60	292,90
Группа Черкизово	909	589	-1,20%	-3,11%	+3,93%	+14,72%	+24,71%	+41,30%	947,00	565,29
Разгуляй	11,78	34	-0,25%	+4,09%	-10,76%	-11,30%	+160,58%	+79,72%	18,99	4,10
Магнит	12275	17 563	+0,85%	+2,33%	-0,78%	+15,77%	+24,78%	+36,01%	12944	8716,5
М ВИДЕО	210	567	+5,16%	+6,86%	+5,44%	+1,38%	+66,61%	+8,79%	220,80	105,00
Фармстандарт	1035	603	+0,49%	-0,48%	+1,96%	-1,89%	+13,66%	-11,86%	1489,90	770,00
АКРОН	2817	1 741	+4,33%	+1,52%	+9,55%	+30,60%	+55,64%	+143,90%	2980,00	1140,00

ДОРОГОБУШ	24	266	-4,57%	+1,48%	+12,15%	+28,34%	+45,45%	+80,17%	30,55	13,10
ФосАгро	2837	5 546	+0,57%	-3,86%	+14,86%	+34,12%	+68,64%	+129,33%	3060,00	1200,00
Нижнекамскнефтехим	39,1	979	-1,26%	+7,03%	+20,00%	+28,99%	+89,47%	+92,96%	40,00	19,05
Нижнекамскнефтехим_пр	28,7	96	+0,53%	+1,95%	+8,30%	+24,24%	+71,24%	+104,42%	29,45	13,73
Уралкалий	204	9 070	+1,14%	-0,96%	+24,06%	+41,40%	+56,81%	+50,49%	215,25	110,00

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 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
Факс: +7(495) 363-93-90
E-mail: mail@russ-invest.com
Адрес: Москва, 119019, 5-3/12
Нащокинский переулок

© 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