17 сентября 2015

ежедневный обзор

энергокапитал
инвестиционная группа

Прогноз дня

На российском рынке сегодня мы ожидаем положительное открытие в рамках реакции на положительный внешний фон, однако в ближайшие дни все же маловероятно продолжения роста индекса ММВБ выше сопротивления в 1730 пунктов. В условиях локальной перекупленности акций отсутствие позитива на рынках и сюрпризов от ФРС будет способствовать усилению давления медведей.

Голубые фишки

Эмитент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Газпром	142,91	0,68	-1,31	3,14
ЛУКОЙЛ	2475	-0,13	-3,36	13,27
Сбербанк	77,71	3,82	4,41	0,14
Магнит	11583	2,28	-4,64	15,83
Сургутнефтегаз	35,6	1,92	0,85	30,02
Сургутнефтегаз, ап	41,1	-0,36	6,48	41,45
НОВАТЭК	628,6	0,08	6,42	52,20
ГМК Норильский никель	11119	1,00	10,52	45,82
Банк ВТБ	0,069	-1,56	-2,58	70,73
Роснефть	251,5	2,24	1,99	4,57
МТС	227,3	2,16	0,26	-23,05

Нефть

Сорт, $/барр.	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Brent	49,75	0,54	2,90	-54,22
WTI	47,15	0,08	5,67	-54,45

Курсы валют

Инструмент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
USD/RUB	65,93	-1,83	3,23	87,02
EUR/RUB	74,24	-2,19	6,62	52,50
EUR/USD	1,13	-0,01	2,91	-18,40

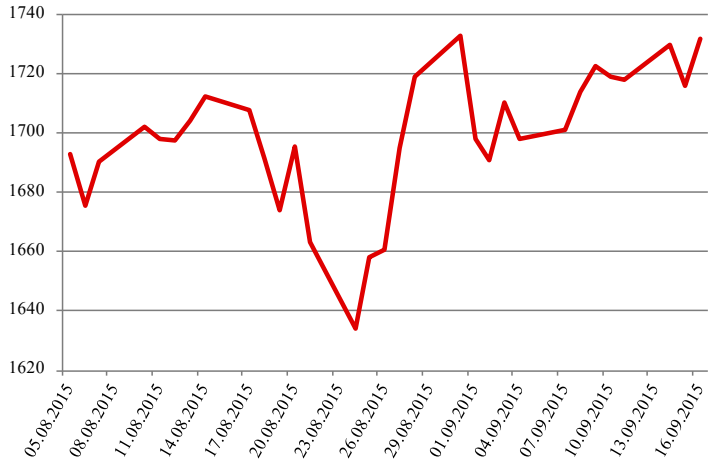
Мировые индексы

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
ММВБ	1731,81	0,91	1,13	17,23
РТС	837,39	3,70	0,27	-30,33

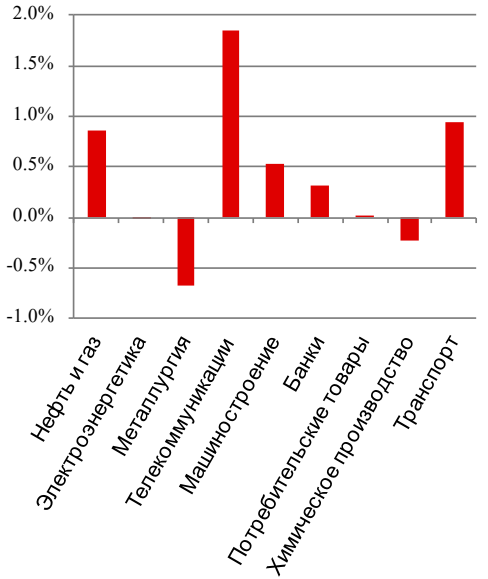
Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
S&P 500	1995,31	0,87	-4,60	-0,18
Dow Jones	16739,95	0,84	-4,22	-2,29
Nasdaq	4889,239	0,59	-3,15	7,39

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
DAX	11727,01	0,38	-6,90	6,17
FTSE 100	5221,2	1,49	-4,91	-8,29
CAC 40	1213,1	1,67	-6,27	5,37

Индекс ММВБ за месяц



Отраслевые индексы ММВБ за день



Рост мировых рынков продиктован ожиданиями итогов заседания ФРС

Российский фондовый рынок в среду показывал положительную динамику в течение всего дня. В последние часы торгов покупатели ослабили давление, реагируя на нейтральное открытие американских площадок, что способствовало боковой динамике. По итогам торговой сессии рублевый индекс ММВБ показал рост на 0,9% и составил 1731,8 пунктов. Фактически текущее значение индекса лежит в области среднесрочного сопротивления, которое покупатели не могут преодолеть со времени девальвационного бума в начале года. В то же время последние две недели индекс консолидируется в узком диапазоне, что косвенно свидетельствует о наличии потенциала для преодоления уровня. На наш взгляд такой вариант возможен при условии стабилизации курса рубля, так как укрепление валюты будет способствовать переоценке рублевой стоимости акций в сторону снижения. Также важным фактором будут настроения на западных площадках, так как август обнажил зависимость рынков развивающихся стран от наиболее развитых площадок.

Настроения на мировых рынках сегодня будут определяться ожиданиями итогов сентябрьского заседания ФРС, на котором будут в очередной раз пересмотрены ставки. В связи с этим окончание недели и на отечественном рынке может оказаться излишне нервным. Большинство экспертов все же не сомневается в сохранении процентных ставок на текущих уровнях, и спекуляции в основном ведутся на тему ужесточения или ослабления риторики регулятора. Поэтому интерес будет представлять выступление председателя ФРС Джанет Йеллен сразу после публикации итогов. Мы ожидаем, что глава регулятора продолжит занимать нейтральную позицию: в частности будет указана необходимость повышения ставок в текущем году, однако акцент останется на состоянии финансовых рынков и экономики. В этом случае рынок также будет реагировать нейтрально, а инвесторы постепенно увеличат аппетит к риску, нивелируя последствия шторма в августе.

Азиатские фондовые рынки в четверг утром продолжают рост в рамках реакции на положительную динамику рынков США на ожиданиях заседания ФРС. Повышение наблюдается помимо прочего, как на японском, так и на китайском рынках акций. При этом накануне международное рейтинговое агентство S&P снизило долгосрочные рейтинги по обязательствам в иностранной и национальной валютах Японии с “AA-“ до “A+”. Прогноз по рейтингам изменен с “негативного“ до “стабильного“.

Сегодня помимо процентных ставок в США интерес будет представлять макростатистика по стране. Так, во второй половине дня станут известны данные по числу начатых строительств домов в августе, количеству первичных обращений за пособиями по безработице и индексу деловой активности ФРБ Филадельфии в сентябре. На российском рынке сегодня мы ожидаем положительное открытие в рамках реакции на положительный внешний фон, однако в ближайшие дни все же маловероятно продолжения роста индекса ММВБ выше сопротивления в 1730 пунктов. В условиях локальной перекупленности акций отсутствие позитива на рынках и сюрпризов от ФРС будет способствовать усилению давления медведей.

Источник: ИК «Энергокапитал»

энергокапитал
инвестиционная группа

Календарь событий на неделю

		Показатель	Зона	Прогнозное значение	Предыдущее значение
17-Sep		**Заседание ЕЦБ**			
17-Sep	2:50	Торговый баланс в августе	Япония	-541,3 млрд иен	-268,1 млрд иен
17-Sep	10:30	Ключевая ставка ЦБ Швейцарии	Швейцария		
17-Sep	15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	США		275 тыс.
17-Sep	15:30	Число начатых строительств домов в августе	США	1.175 млн ед	1.206 млн ед
17-Sep	17:00	Индекс деловой активности ФРБ Филадельфии за сентябрь	США	6,0	8,3
17-Sep	**21:00**	**Заседание ФРС**	**США**		
17-Sep	**22:30**	**Пресс-конференция Дж. Йеллен**	**США**		
18-Sep		Вступление в силу результатов пересмотра индексов FTSE			
18-Sep		Налоговый календарь: акцизы (подтверждение авансового платежа за сентябрь)			
18-Sep		Публикация протокола заседания Банка Японии	Япония		

энергокапитал
инвестиционная группа

Контактная информация

Центральный офис компании

119121, Москва, 1-ый Тружеников пер., д. 27/2

Тел. (495) 223-52-09, (495) 223-52-08

E-mail: info@energ.ru

www.energ.ru

Брокерский отдел

Дарья Воронова	voronova@energ.ru
Начальник брокерского отдела	+7 (812) 329-44-46
Иван Шарафутдинов	sharafutdinov@energ.ru
«Личный брокер»	+7 (812) 329-17-94

Управление по продажам

Елизавета Дубовик	elizaveta@energ.ru
Руководитель московского офиса	+7 (495) 223-52-09
Маковеева Наталья	makoveeva@energ.ru
Директор управления Санкт-Петербург	+7 (812) 458-57-05

Корпоративные финансы

Константин Ермоленко	ermolenko@energ.ru
Директор управления корпоративного консалтинга	+7 (812) 329-55-92 (доб. 130)

Управление по работе с клиентами

Павел Философов	paulf@energ.ru
Директор управления по работе с клиентами	+7 (812) 329-17-45
Ирина Мальцева	iramal@energ.ru
Начальник отдела мониторинга	+7 (812) 329-55-02
Александра Бобкова	bobkova@energ.ru
Финансовый консультант	+7 (812) 329-17-72

Информационно-аналитическое управление

Василий Копосов	koposov@energ.ru
Директор управления	+7(812) 329-17-94
Марсело Муньос	marcelo@energ.ru
Заместитель начальника отдела инвестиционного моделирования	+7 (812) 329-55-92
Илья Березин	berezin@energ.ru
Специалист отдела	+7 (812) 329-55-92

Управляющая компания

Артем Конин	konin@energ.ru
Генеральный директор	+7 (812) 458-58-68 (доб. 120)

Обращаем Ваше внимание, что информация и выводы, содержащиесяв настоящейпубликации, были подготовлены специалистами компании “Энергокапитал” и предназначаются исключительно для сведения клиентов компании. Несмотря на то, что были приложены значительные усилия, чтобы сделать информацию, содержащуюся в настоящей публикации, как можно более достоверной и полезной, “Энергокапитал” не претендует на ее полноту и точность. Компания и любые из ее представителей и сотрудников могут, в рамках закона, иметь позицию или какой-либо иной интерес (включая покупку или продажу своим клиентам на принципиальной основе) в любой сделке, в любых инвестициях прямо или косвенно упомянутых в предмете настоящей публикации. Ни компания “Энергокапитал”, ни кто-либо из ее представителей или сотрудников не несет ответственности за любой прямой или косвенный ущерб, наступивший в результате использования настоящей публикации или ее содержания.

Необходимо помнить, что любые инвестиции, упомянутые в настоящей публикации, могут быть связаны со значительным риском, могут оказаться неликвидными или неприемлемыми для всех инвесторов. Стоимость или доход от любых инвестиций, упомянутых в настоящей публикации, могут изменяться под воздействием рыночных и иных факторов. Прошлые результаты не являются показателем будущих результатов. Возможность инвестирования в какие-либо ценные бумаги или инструменты, упомянутые в настоящей публикации следует рассматривать только инвесторам, обладающим значительными знаниями и опытом в финансовых вопросах и бизнесе, и способным оценить преимущества и риски, связанные с инвестированием в российские ценные бумаги.

энергокапитал
инвестиционная группа

Офисы компании Энергокапитал

Офис в г. Москва

119121, Москва, 1-ый Тружеников пер., д. 27/2

+ 7 (495) 223-52-09 + 7 (495) 223-52-08

dkostin@col.ru

Филиал компании в г. Архангельск

163000, Архангельск, пл. Ленина, д.4, офис 407

+7 (8182) 63-63-30, +7 (8182) 21-54-14

arhangelsk.doc@energ.ru

Филиал компании в г. Мурманск

183038, Мурманск, ул. Воровского, д. 5/23, офис 310

+ 7 (8152) 28-2425, + 7 (8152) 28-2424

murmansk.doc@energ.ru

Офис в г. Санкт-Петербург

190031, Санкт-Петербург, ул. Ефимова 4а, б/ц «Мир»

+ 7 (812) 329-55-92 + 7 (812) 329-55-64

info@energ.ru

Филиал компании в г. Ярославль

150003, Ярославль, ул. Республиканская, д. 3,

центральный корпус (Красный Маяк), 2 этаж

+ 7 (4852) 72-02-28, + 7 (4852) 73-90-93

yaroslavl@energ.ru

Филиал компании в г. Тольятти

445000, Тольятти, Новый проезд, д. 3,

ДЦ «ГРАНД СИТИ», офис 304

+ 7 (8482) 77-44-11, + 7 (8482) 77-47-11

энергокапитал
инвестиционная группа