23 сентября 2015

ежедневный обзор

энергокапитал
инвестиционная группа

Прогноз дня

Мы ожидаем достаточно волатильного открытия сессии на российском рынке, а в перспективе дня на уровне 1660 пунктов быки, вероятно, найдут поддержку и попытаются оформить отскок. При прохождении данной отметки падение может углубиться до 1620 пунктов.

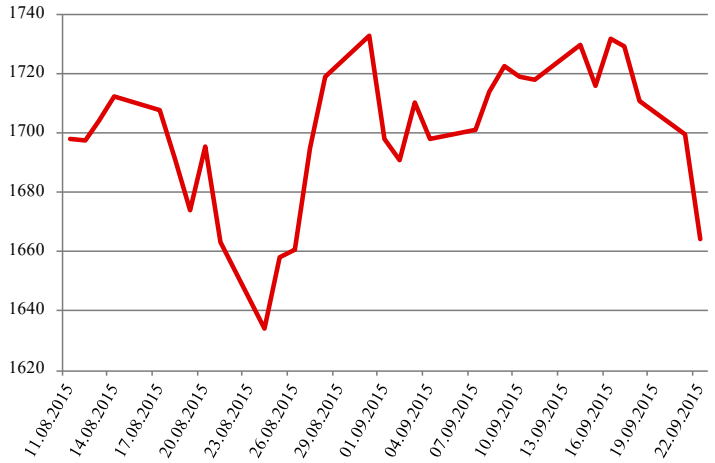
Нефть

Сорт, $/барр.	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Brent	49,08	-0,22	-0,51	-54,71
WTI	46,36	1,24	7,16	-55,28

Курсы валют

Инструмент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
USD/RUB	66,17	0,04	1,78	86,16
EUR/RUB	73,96	-1,17	2,42	51,36
EUR/USD	1,11	0,04	-0,22	-19,80

Индекс ММВБ за месяц



Голубые фишки

Эмитент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Газпром	136,4	-2,19	-2,77	1,00
ЛУКОЙЛ	2225,9	-4,51	-7,72	8,58
Сбербанк	74,39	-2,04	6,48	-2,12
Магнит	11360	-0,89	-4,22	19,20
Сургутнефтегаз	33,87	-0,81	2,45	26,38
Сургутнефтегаз, ап	40,975	-2,35	4,13	46,97
НОВАТЭК	604	-2,15	7,09	53,46
ГМК Норильский никель	10693	-3,49	6,29	49,34
Банк ВТБ	0,067	-1,36	-2,08	70,17
Роснефть	244,8	-1,73	4,06	6,43
МТС	221,95	-0,13	-2,95	-19,00

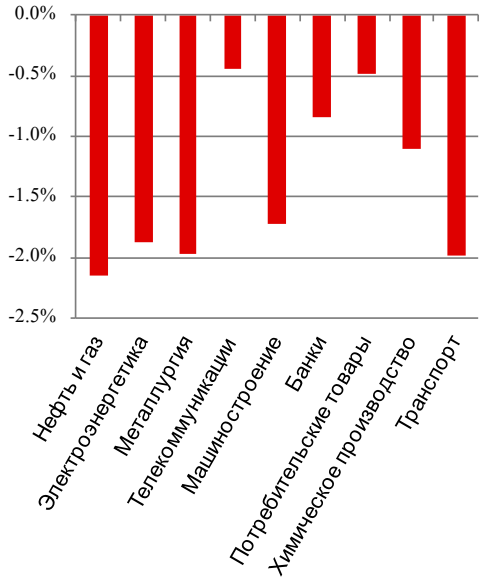
Мировые индексы

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
ММВБ	1664,25	-2,09	0,06	17,80
РТС	789,56	-2,38	3,57	-31,41

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
S&P 500	1942,74	-1,23	-1,43	-2,58
Dow Jones	16330,47	-1,09	-0,79	-4,90
Nasdaq	4756,723	-1,50	1,08	5,06

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
DAX	11727,01	-3,80	-5,47	-1,83
FTSE 100	5221,2	-2,83	-4,07	-12,37
CAC 40	1213,1	-3,42	-4,37	-0,32

Отраслевые индексы ММВБ за день



Слабые данные по Китаю способствуют снижению азиатских рынков

Торговая сессия накануне принесла долгожданную волатильность на российский рынок, причем обоснование ситуации выходит довольно спорным. С одной стороны в течение всего дня наблюдался слабый внешний фон, и выходили негативные для рынка новости, а с другой – коррекция основана и на технических факторах, обусловленными долгой консолидацией в период активности на мировых рынках. По индексу ММВБ снижение за день составило 2,1%, до 1664,3 пунктов. Валютный бенчмарк РТС также просел на 2,4%, закрывшись на отметке 789,6 пунктов.

Среди негативных новостей накануне стоит отметить заявления первых лиц государства по поводу бюджетного процесса и точек экономии. Так, Владимир Путин поставил задачу проработать вопрос о направлении допдоходов от девальвации рубля в доходную часть бюджета, а глава финансового блока правительства – Антон Силуанов, заявил о проработке вопроса очередной заморозки пенсионных накоплений и изменении формулы НДПИ (де-факто, увеличение налоговой нагрузки на сектор). В свете данных новостей неудивительно, что наиболее серьезным распродажам подвергся нефтегазовый и металлургический сектора и в частности акции бенефициаров девальвации. Позднее пришла другая новость, которая пока сдержано воспринята рынком, однако в перспективе может привнести дополнительный негатив. Правительство Украины поместило «российские» еврооблигации в список реструктуризации, собрание держателей которых пройдет 14 октября. Таким образом, может усилиться напряжение между государствами, что приведет к всплеску геополитических рисков и создаст дополнительное давление на рубль. Однако мы все же считаем, что решение по данному вопросу будет вынесено относительно спокойно.

На европейских площадках центральной темой дня оставался громкий скандал вокруг концерна Volkswagen AG, который обвиняется в неоднократных манипуляциях с тестами на экологичность автомобилей. Накануне стоимость акций компании снизилась на 20%, а в итоге за два дня бумаги потеряли 35% стоимости. Компания уже зарезервировала 6,5 млрд евро, которые могут пойти на исправление ситуации, тем не менее общий масштаб нарушений пока трудно оценить в связи с чем инвесторы не спешат покупать подешевевшие акции. К тому же подобные обвинения могут быть предъявлены компании и на европейском автомобильном рынке. На данных новостях акции других автопроизводителей снизились на 5-9%, а отраслевой подындекс стал лидером падения среди остальных бенчмарков. Кроме того падение показывали акции сырьевых компаний на фоне возобновления снижения цен на большинство металлов.

Сегодня в течение дня будут опубликованы предварительные данные по деловой активности Markit economics в сентябре. Наиболее значимыми показателями станут индексы PMI в промышленности и секторе услуг еврозоны и Германии. Тем временем утром уже стали известны данные по КНР. Так, деловая активность в перерабатывающей промышленности в сентябре снизилась до 47 пунктов с 47,3 пункта, что ниже консенсус-прогноза (47,5 пункта). Финальное значение будет опубликовано через неделю, однако уже сейчас понятно, что ухудшение экономических условий в КНР продолжается. Нефтяной рынок сегодня ожидает публикации еженедельных данных от EIA по запасам нефти в США.

Сегодня утром на азиатских площадках наблюдается негативная динамика в рамках реакции на слабые данные по Китаю. Рынки commodities чувствуют себя более спокойно, а фьючерсы на американские индексы снижаются слабыми темпами. Мы ожидаем достаточно волатильного открытия сессии на российском рынке, а в перспективе дня на уровне 1660 пунктов быки, вероятно, найдут поддержку и попытаются оформить отскок. При прохождении данной отметки падение может углубиться до 1620 пунктов.

Источник: ИК «Энергокапитал»

энергокапитал
инвестиционная группа

Календарь событий на неделю

		Показатель	Зона	Прогнозное значение	Предыдущее значение
23-Sep	**4:45**	**Индекс деловой активности в промышленности в сентябре**	**Китай**	**47,5**	**47,1**
23-Sep	10:30	Индекс деловой активности в промышленности в сентябре	Германия	52,7	53,3
23-Sep	11:00	Индекс деловой активности в промышленности в сентябре	Еврозона	52,0	52,3
23-Sep	**17:30**	**EIA недельное изменение запасов нефти**	**США**		**-2,104 млн барр**
23-Sep		Норильский никель: дата закрытия реестра для получения дивидендов (T+2)			
24-Sep	11:00	IFO Индекс делового оптимизма в сентябре	Германия	108,0	108,3
24-Sep	15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	США		264 тыс.
24-Sep	15:30	Заказы на товары длительного пользования в августе	США	-2,0%	2,2%
24-Sep	**17:00**	**Продажи новостроек в августе**	**США**	**0,515 млн**	**0,507 млн**
24-Sep		**Выступление Дж. Йеллен**			
24-Sep		Магнит: внеочередное собрание акционеров			
25-Sep	**2:30**	**ИПЦ в августе**	**Япония**	**-0,1%**	**0,0%**
25-Sep	**15:30**	**ВВП, окончательный, за II кв.**	**США**	**3,7%**	**3,7%**
25-Sep		Налоговый календарь: акцизы; НДС (1/3 суммы налога за II квартал), налог на добычу полезных ископаемых (август).			
25-Sep		Новатэк: внеочередное собрание акционеров			

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