ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ ИК РУСС-ИНВЕСТ

Ежедневный обзор

10 Июля, 2013

Комментарий

Во вторник 9 июля российские фондовые индексы продемонстрировали разнонаправленное движение. Выходившая макроэкономическая статистика была разнонаправленной и оказывала противоречивое влияние на настроения инвесторов. Российскому рынку поддержку оказывает сильная нефть, котировки которой находятся в краткосрочном восходящем канале.

По итогам дня Индексы РТС вырос на 0,43%, а индекс ММВБ потерял около 0,4 п.п. Торговые обороты во вторник незначительно выросли, но продолжают находится на минимальных на минимальном за последний месяц уровне. Так, биржевые обороты по акциям, входящим в расчет индекса ММВБ, составили 16,0 млрд руб. против 14,2 млрд руб. накануне. Среди отраслевых фондовых индексов лучше рынка торговался нефтегазовый сектор. Хуже рынка выглядели потребительский сектор. Индекс акций «второго эшелона» показал динамику лучше базового индекса: индекс менее ликвидных акций РТС-2 прибавил всего 0,63%. Отраслевой индекс РТС – Нефти и газа вырос на 0,68% по итогам дня, индекс РТС – Потребительские товары и розничная торговля снизился на 1,14%, Индекс РТС – Электроэнергетика подрос на 0,56%, Индекс РТС – Металлы и добыча вырос на 0,49%, Индекс РТС – Финансы вырос на 0,16%, Индекс РТС-Промышленность прибавил 0,45%, а Индекс РТС-Телекоммуникации вырос на 0,51%. Индекс волатильности РТС по итогам дня упал на 3,5%, что отразило ослабление негативных ожиданий рыночных участников.

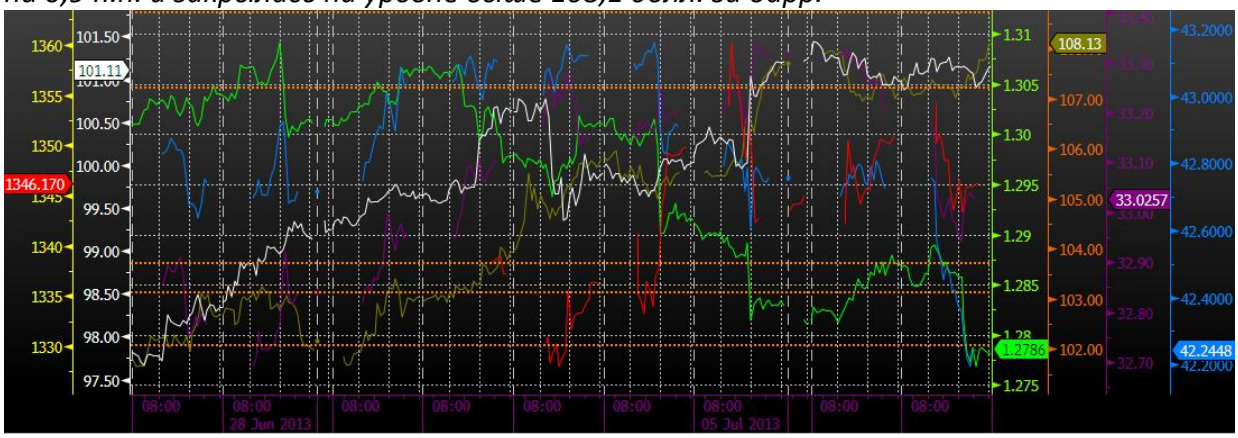
В лидерах роста по итогам дня оказались акции РОСИНТЕРА, выросшие на 3,9%. На 3,4% подросли привилегированные акции Ростелекома. Неплохо смотрелись ряд компаний электроэнергетики. Среди более ликвидных бумаг на 2,2% прибавили акции Э.ОН Россия. В аутсайдерах дня оказались бумаги Росбанка, потерявшие около 4,2%. На 3,7% просели бумаги ДИКСИ, реализовав техническую коррекцию после опережающего роста накануне. Среди корпоративных новостей стоит отметить публикацию производственных результатов НОВАТЭК за 2 кв. 2013г.: производство выросло более чем на 8,2% в годовом выражении. По итогам дня котировки бумаг компании снизились на 0,6%.

Индикатор страха на мировых рынках вновь снизился: индекс волатильности опционов VIX потерял 2,9% и составил 14,35. На рынке FOREX пара евро/доллар продолжила снижение с 1,2872 долл. до 1,2786 долл. за евро. Пара иена/долл. незначительно выросла со 101 иены до 101,11 иен за долл. Российский рубль в основных валютных парах

Рыночные индикаторы*		
US Tsys 10Y	2,62%	-0,43%
EUR/USD	1,2796	+0,12%
USD/JPY	100,47	+0,68%
EUR/GBP	0,85923	+0,06%
S&P 500	1652,32	+0,72%
VIX	14,35	-2,91%
DJIA	15228	+0,04%
Topix	1197	-0,25%
Shanghai Comp	2001,644	+1,84%
DJ EURO Stoxx 50	2664,14	+0,50%
РТС Индекс	1287,93	+0,40%
РТС Фьючерс	127950	+0,59%
ММВБ Индекс	1344,35	-0,10%
Лидеры роста/снижения за день		
РОСИНТЕР	103,9	+3,9%
Ростелеком_пр	75,75	+3,4%
МРСК СЗ	0,03996	+3,2%
РАО ЭС Востока	0,188	+2,7%
Э.ОН Россия	2,49	+2,2%
МРСК Волга	0,056	-3,3%
ТГК-14	0,00146	-3,3%
ТГК-2	0,00139	-3,5%
ДИКСИ	481,75	-3,7%
Росбанк	74	-4,2%

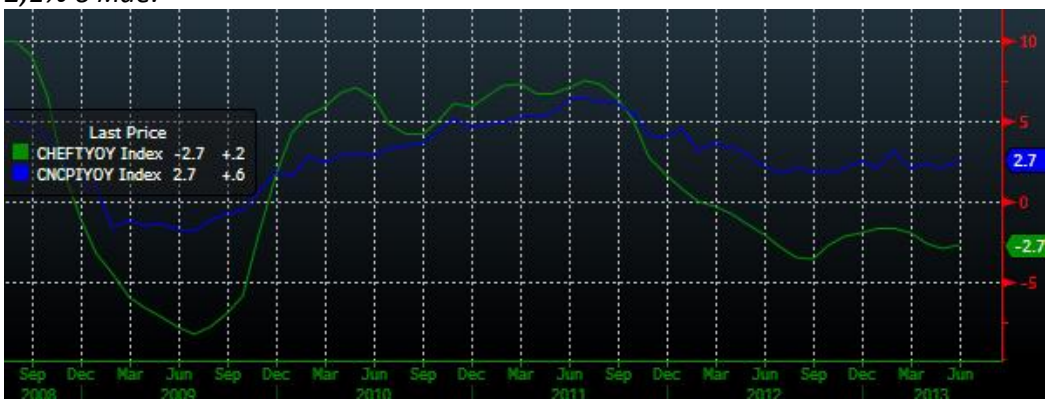
* на 10-00 10 Июля 2013 г.

продемонстрировал незначительное укрепление. Так, значение пары рубль/евро по итогам дня снизилось с 42,72 руб. до 42,24 руб. за евро, а курс рубля к доллару США укрепился с 33,21 руб. до 33,02 руб. за доллар. На рынке металлов наблюдалось умеренное снижение цен. Так, котировки фьючерсов на никель потеряли 0,8%, меди упали на 1,4%, платины и палладия выросли на 0,5%, золота прибавили 1,2%, а серебра подросли на 1 п.п. Цена нефти смеси марки Brent по итогам дня подросла на 0,9 п.п. и закрылась на уровне выше 108,1 долл. за барр.



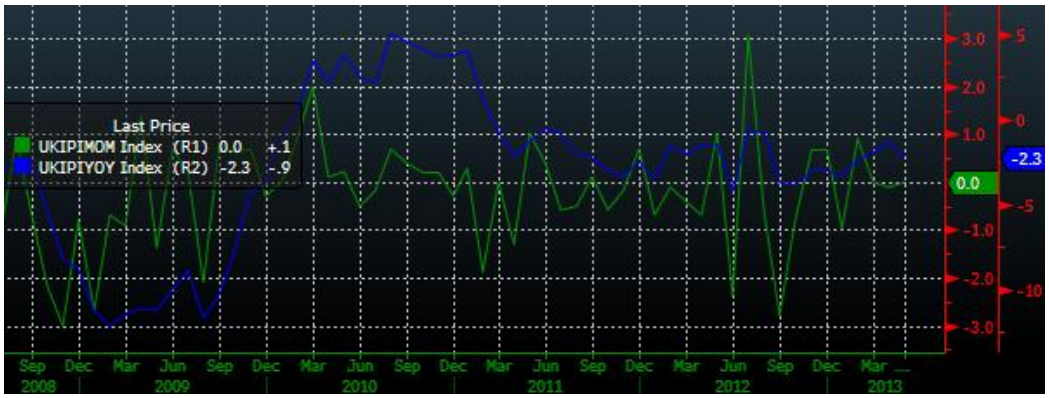
Источник: Bloomberg

Макроэкономическая статистика была смешанной. Темпы потребительской инфляции в Китае в июне выросли до 2,7% против 2,1% в мае.



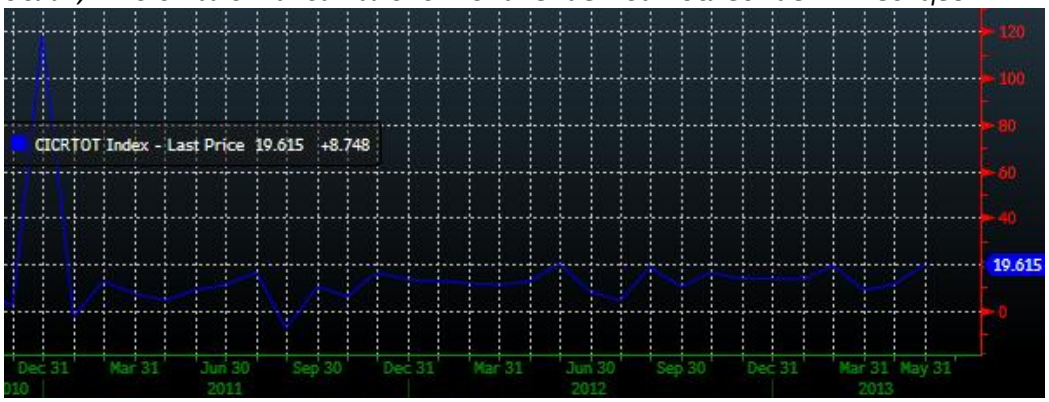
Источник: Bloomberg

Темпы снижения промышленного производства в Великобритании в мае снизились до 2,3% против 1,4% в апреле.



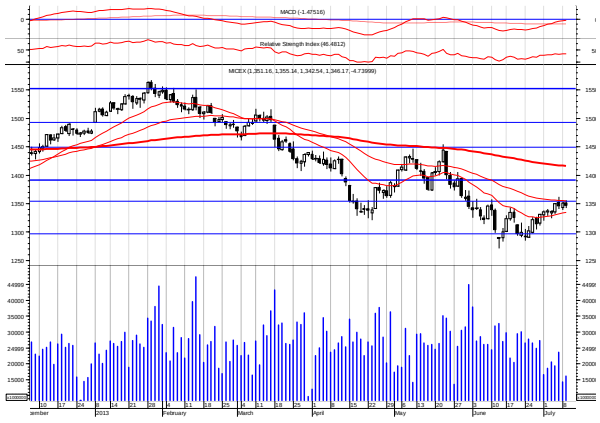
Источник: Bloomberg

Из американской статистики стоит отметить показатель потребительского кредитования в мае, который превысил 19,6 млрд долл., что стало максимальным значением за последние 12 месяцев.



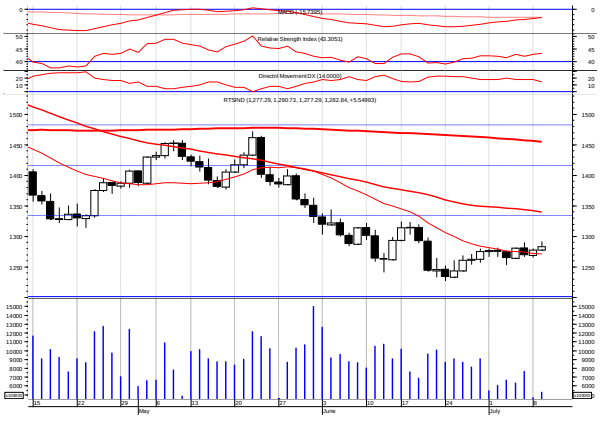
Источник: Bloomberg

Индекс ММВБ



Источник: ММВБ

Индекс РТС



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.***
- ✓ ***В случае возобновления движения рынка вверх ближайшим уровнем сопротивления может стать 1418 пунктов по индексу ММВБ, что соответствует 200-дневной скользящей средней. В случае усиления тенденции роста индекс ММВБ может достичь уровня 1450-1490 пунктов, что соответствует диапазону между двумя линиями Фибоначчи.***
- ✓ ***С учетом неопределенного внешнего и внутреннего новостного фона для среднесрочного движения вверх на российском фондовом рынке нужны дополнительные поддерживающие факторы.***

Динамика котировок российских акций

Эмитент	Цена на 10.07.13г. (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	0,10165	4 411	-2,76%	-0,98%	-23,32%	-49,49%	-57,09%	0,27	0,09
РусГидро	0,5313	5 779	+2,04%	+11,35%	-1,12%	-27,60%	-38,27%	1,24	0,45
Иркутскэнерго	9,553	1 559	-1,54%	-8,28%	-22,95%	-41,88%	-43,55%	18,50	9,32
Интер РАО ЕЭС	0,012867	4 600	-0,35%	+10,08%	-12,00%	-48,21%	-53,47%	0,029	0,011
МРСК Центра	0,36	520	+0,03%	-16,24%	-23,40%	-39,85%	-27,35%	0,70	0,32
Россети	1,07	2 098	-1,92%	-1,56%	-26,56%	-45,44%	-39,79%	2,50	0,98
МРСК ЦВ	0,1225	473	-2,00%	-12,52%	-25,30%	-28,79%	-18,33%	0,22	0,12
Мосэнерго	1,107	1 507	+2,23%	-0,51%	-11,16%	-16,95%	-20,36%	1,68	1,03
МОЭСК	1,2286	2 049	-0,79%	-4,70%	-17,72%	-18,64%	-0,12%	1,79	1,15
ОГК-2	0,2485	940	+2,31%	-1,00%	-21,08%	-27,48%	-47,00%	0,48	0,22
Ленэнерго	4,761	185	+2,83%	+9,62%	-9,30%	-27,26%	-26,64%	7,81	4,03
Э.ОнРоссия	2,4949	5 387	+3,08%	+3,04%	-3,18%	-4,59%	+2,09%	2,98	2,24
Энель ОГК-5	1,319	1 598	+0,69%	+0,27%	-5,72%	-18,58%	-25,05%	2,03	1,20
ТГК-1	0,006623	874	-1,59%	+11,55%	+19,07%	-3,67%	-4,53%	0,0085	0,0051
ТГК-2	0,0014	70	-0,07%	+0,72%	-16,17%	-37,47%	-27,74%	0,0030	0,0013
ТГК-5	0,003	126	+1,69%	+3,73%	-10,31%	-16,01%	-20,26%	0,0055	0,0024
ТГК-6	0,003998	255	-1,53%	-0,07%	-5,28%	+10,78%	+24,78%	0,0064	0,0031
ТГК-9	0,002949	792	-3,31%	+4,16%	+6,99%	-10,64%	+94,17%	0,0046	0,0014
Волжская ТГК	1,7022	1 750	-2,73%	+2,77%	+5,68%	+8,43%	+44,24%	2,35	1,12

БЕЛОН	4,358	172	-1,47%	+12,20%	-11,87%	-27,23%	-44,86%	8,47	3,62
Северсталь	231,9	6 653	+5,60%	+3,16%	-14,36%	-37,21%	-38,16%	437,70	203,20
ГМК Норникель	4614	25 005	-0,32%	-0,65%	-13,24%	-17,70%	-12,86%	6130,00	4282,00
ММК	7,674	2 937	-0,71%	+3,72%	-2,34%	-26,29%	-20,78%	11,78	6,70
МЕЧЕЛ	95,3	1 359	-2,16%	-2,56%	-35,70%	-53,38%	-52,59%	253,70	85,00
МЕЧЕЛ_пр	54	257	+1,29%	-1,41%	-31,70%	-54,63%	-64,72%	178,60	40,16
НЛМК	44,35	9 103	+1,03%	+3,55%	-11,16%	-27,47%	-18,50%	69,86	40,22
Полюс Золото	844	5 510	+0,54%	-7,36%	-16,20%	-6,49%	-19,22%	1310,00	787,60
АМЗ	4,127	70	+5,90%	+0,39%	-23,42%	-34,44%	-42,04%	8,70	3,70
Распадская	34,93	841	+10,54%	+0,00%	-25,92%	-39,64%	-59,40%	90,96	30,20
ТМК	79,01	2 537	-0,48%	+3,67%	-8,43%	-13,99%	-15,54%	113,00	69,00
РУСАЛ рдр	129	6 712	-3,15%	-4,85%	-24,16%	-32,76%	-26,91%	199,86	120,02
Polymetal	506	1 971	+2,39%	-21,43%	-43,34%	-56,94%	-40,65%	1231,00	439,50
Банк Санкт Петербург	43,05	539	+3,84%	-0,12%	+30,14%	-13,59%	-26,46%	70,99	28,98
Банк Москвы	831	7 734	+0,57%	-3,79%	-5,05%	-3,45%	-14,30%	997,50	700,20
Росбанк	74	3 932	-5,07%	-9,65%	-15,81%	-32,86%	-12,65%	115,00	68,19
Сбербанк	92,48	68 369	-0,60%	-5,47%	-10,46%	-0,47%	+1,68%	111,50	83,01
Сбербанк_пр	69,71	2 387	+0,03%	-4,86%	-5,63%	+3,52%	+5,57%	80,76	60,50
ВТБ	0,04684	20 790	-0,26%	-1,76%	-2,82%	-12,68%	-18,04%	0,06	0,04
Банк Возрождение	378,8	308	-1,56%	-15,86%	-23,49%	-29,72%	-30,15%	684,00	352,70
Банк Возрождение_пр	133,96	6	-0,02%	-1,80%	+1,30%	-3,87%	-26,51%	198,80	120,00
Номос-Банк	875	2 770	-3,35%	-3,84%	+10,76%	+6,32%	+20,69%	1039,00	577,60
Газпром	114,56	92 878	+5,04%	-1,58%	-11,45%	-20,39%	-26,33%	171,04	106,50
ЛУКОЙЛ	1915	55 782	-0,48%	+1,11%	-1,56%	-4,68%	+5,04%	2088,40	1763,70
Славнефть	395	447	+6,76%	+9,66%	+3,95%	+7,65%	+47,94%	471,00	259,00
НОВАТЕК	357,1	37 132	-0,27%	+15,42%	+12,74%	+3,22%	+8,70%	379,50	274,79
Роснефть	232,69	84 455	+1,36%	+7,54%	+3,03%	-13,85%	+12,00%	275,50	178,92
ГазпромНефть	117	18 998	-0,89%	-5,87%	-11,33%	-17,91%	-22,72%	177,25	110,22
Сургутнефтегаз	25,805	37 060	+0,74%	+3,46%	-13,71%	-3,87%	-7,18%	32,15	23,47
Сургутнефтегаз_пр	20,806	37 060	+1,89%	+3,82%	-6,69%	+4,46%	+8,16%	23,36	17,77

Татнефть	193,56	14 442	-2,01%	+7,97%	-0,59%	-11,19%	+0,30%	225,67	165,11
Татнефть_пр	96,81	489	+1,10%	+6,38%	-10,32%	-8,73%	+8,22%	113,00	87,26
Башнефть	1945	12 570	+2,37%	-0,36%	-0,77%	+10,37%	+25,74%	2400,00	1487,10
Башнефть_пр	994	1 317	+0,87%	-5,76%	-23,49%	-25,39%	-17,71%	1540,50	854,90
ТНК-ВР	48,3	24 807	+1,71%	+14,86%	+18,61%	-17,02%	-37,49%	89,96	30,64
ТНК-ВР_пр	37,9	584	+4,41%	+11,21%	+34,54%	-13,59%	-44,83%	80,47	26,27
МНПЗ	8561	1 733	-3,80%	+1,92%	+2,20%	+16,08%	+82,38%	11481	4090,00
ННГ	15	7	+0,00%	+7,14%	-23,08%	+11,03%	+41,43%	27,00	9,00
АК Транснефть	78921	19 194	+5,13%	+5,18%	+18,21%	+14,89%	+60,50%	79397	47100
АФК Система	20,64	341	+4,30%	+9,21%	+9,38%	+2,18%	+9,79%	24,07	15,21
МТС	263,51	18 648	+1,80%	+3,17%	-0,94%	+7,12%	+15,07%	289,80	221,00
Вымпелком ($)	9,89	595	-1,88%	-0,80%	-11,75%	+0,78%	+36,41%	11,99	7,25
Мегафон	1050	21 700	+4,12%	+4,00%	+14,70%	+45,23%	#N/A N/A	1100,00	609,70
Ростелеком	103,5	10 432	+4,33%	+4,55%	-10,79%	-13,86%	-13,58%	141,40	86,54
Ростелеком_пр	75,75	630	+1,12%	+4,40%	-7,55%	-16,17%	-7,38%	107,96	66,97
АвтоВАЗ	10,107	631	+1,08%	+7,20%	-6,77%	-36,43%	-39,96%	18,50	8,90
АвтоВАЗ_пр	4,231	67	+5,27%	+19,52%	-5,26%	-29,67%	-30,67%	7,59	3,23
ИРКУТ	5,359	214	-0,80%	+4,87%	-12,06%	-9,54%	-10,47%	6,62	4,81
Московская биржа	53,69	4 373	-0,07%	+0,36%	+14,53%	#N/A N/A	#N/A N/A	58,15	42,57
КАМАЗ	41,4	1 003	+2,81%	+41,44%	+8,98%	+11,32%	-5,46%	46,99	26,73
ОМЗ	37,75	46	+4,05%	+16,15%	+12,92%	+18,90%	+19,99%	38,71	26,11
СОЛЛЕРС	747,9	878	+3,88%	+5,71%	+1,48%	+9,25%	+76,93%	827,00	400,00
Аэрофлот	59,02	2 245	+1,85%	+12,74%	+10,84%	+31,51%	+33,95%	59,80	38,56
Аптеки 366	25,36	91	+14,23%	+24,01%	-10,42%	-20,82%	-21,10%	38,90	18,75
ДИКСИ	481,75	2 058	+1,55%	+2,06%	+19,79%	+20,36%	+51,49%	517,00	298,50
Группа Черкизово	510	768	+2,93%	+1,69%	-0,08%	-5,73%	-0,97%	746,00	479,30
Разгуляй	11,38	74	+0,80%	+3,36%	-21,19%	-14,44%	-37,75%	22,00	9,84
Магнит	7186	23 271	+2,75%	+2,66%	+11,24%	+48,89%	+93,00%	7600,00	3575,00
М ВИДЕО	254,5	1 567	+1,76%	+1,39%	+5,01%	+5,92%	-0,62%	298,97	210,01
Фармстандарт	2100	2 718	-3,41%	+0,72%	+3,74%	+28,66%	+46,35%	2645,00	1255,50
АКРОН	1226,8	1 703	-0,96%	-7,50%	-8,56%	-12,31%	-4,90%	1555,00	1125,50

ДОРОГОБУШ	16,696	412	-0,02%	-0,02%	-0,64%	-3,21%	+11,46%	19,50	13,51
ДОРОГОБУШ_пр	17,9	95	+1,13%	+1,98%	+3,74%	-1,36%	+12,40%	19,32	14,02
Нижнекамскнефтехим	25	1 379	-0,00%	+0,00%	-4,21%	-14,97%	-7,42%	33,00	23,00
Нижнекамскнефтехим_пр	21,1	158	-0,48%	-2,52%	-9,39%	-12,98%	-2,16%	28,50	20,10
Уралкалий	217,57	21 876	-0,65%	-4,41%	-6,79%	-7,38%	-17,91%	277,95	215,00

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

© 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