

5 октября 2015

ежедневный обзор



энергокапитал
инвестиционная группа

Прогноз дня

Сегодня на открытии сессии мы ожидаем оформления отскока по индексу ММВБ в рамках реакции на положительный внешний фон. Кроме того достигнут уровень локальной поддержки на 1610 пунктов, что является дополнительным фактором для начала роста с целями как минимум 1640 пунктов.

Голубые фишки

Эмитент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Газпром	131,5	-1,05	-7,76	-2,05
ЛУКОЙЛ	2140	-2,01	-12,30	8,96
Сбербанк	73,8	-0,95	1,23	0,89
Магнит	11581	-1,60	-2,23	18,54
Сургутнефтегаз	33,3	-0,60	-0,89	30,69
Сургутнефтегаз, ап	39,085	0,54	-1,97	48,05
НОВАТЭК	588,1	0,05	-2,95	47,58
ГМК Норильский никель	9470	0,81	-8,50	35,36
Банк ВТБ	0,067	-0,99	0,07	76,04
Роснефть	234,6	-1,39	-5,78	3,64
МТС	209,7	-0,78	-8,03	-23,47

Нефть

Сорт, \$/барр.	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
Brent	48,13	0,75	12,22	-55,12
WTI	45,54	0,55	19,74	-54,59

Курсы валют

Инструмент	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
USD/RUB	65,94	1,40	-6,79	85,55
EUR/RUB	73,63	1,58	-9,27	49,95
EUR/USD	1,12	0,21	-2,46	-18,03

Мировые индексы

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
ММВБ	1612,56	-0,89	-4,63	17,16
PTC	764,93	-2,14	-3,10	-30,15

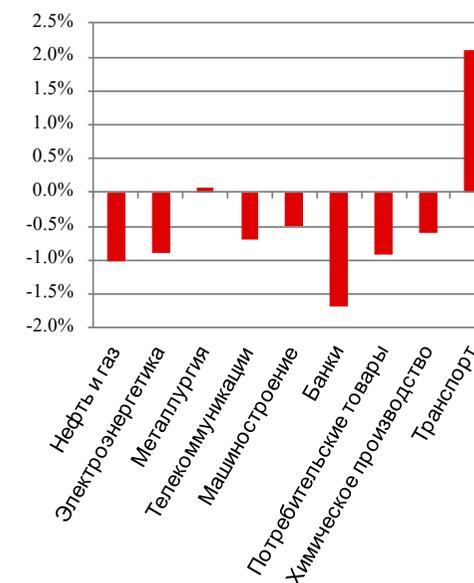
Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
S&P 500	1951,36	1,43	0,13	0,27
Dow Jones	16472,37	1,23	0,74	-1,96
Nasdaq	4707,775	1,74	-0,89	6,27

Индекс	Закрытие	Изменение %		
		за день	за месяц	за год
DAX	11727,01	0,46	-4,93	3,89
FTSE 100	5221,2	0,95	0,77	-4,91
CAC 40	1213,1	0,73	-2,11	5,10

Индекс ММВБ за месяц



Отраслевые индексы ММВБ за день



Рынки проигнорировали слабые статданные по экономике США

Завершил неделю российский фондовый рынок в красной зоне на фоне продолжения оттока капитала с площадок Emerging Markets. При этом основной негатив привнесла слабая макростатистика по рынку труда в США, что привело к падению американских индексов в начале сессии. В то же время рубль на фоне усиленного давления быков в ценах на нефть продемонстрировал умеренное ослабление. По итогам пятницы рублевый индекс ММВБ потерял 0,9% и составил 1612,6 пунктов. Валютный бенчмарк РТС снизился на 2,1%, до отметки 764,9 пункта. Сегодня на открытии сессии мы ожидаем оформления отскока по индексу ММВБ в рамках реакции на положительный внешний фон. Кроме того достигнут уровень локальной поддержки на 1610 пунктов, что является дополнительным фактором для начала роста с целями как минимум 1640 пунктов.

На европейских площадках пятница прошла в режиме повышенной волатильности: сводный индекс крупнейших предприятий Европы Stoxx 600 вырос по итогам сессии на 0,5%, при этом в течение дня падение индикатора достигало 0,9%, а рост - 1,7%. Поддержало котировки, помимо вопроса сохранения ставок в США, и выступле-

ние главы ЕЦБ Марио Драги, в котором прозвучало мнение о возврате экономики еврозоны к устойчивому росту в рамках реакции на меры денежно-кредитной политики. Остается непонятным смысл данного высказывания, так как еще недавно представители регулятора указывали на возможность расширения QE за счет отсутствия экономического прогресса. К тому же спорность заявлений господина Драги подтверждает и официальная статистика по экономике региона.

На Уолл-Стрит пятница завершилась в положительном ключе при том, что в первой половине дня индексы показывали падение, реагируя на слабые статданные. Занятость в несельскохозяйственном секторе США в сентябре составила 142 тыс против пересмотренных 136 тыс в прошлом месяце, тогда как прогноз предполагал рост на 203 тыс. Показатель считается опережающим индикатором роста ВВП, поэтому автоматически негативные данные могут привести к снижению прогнозов по ВВП в III кв. Уровень безработицы остался на уровне прошлого месяца – 5,1%. Между тем средняя продолжительность рабочей недели, а также средняя почасовая заработная плата оказались ниже ожиданий. Развороту рынка в течение дня способствовало осознание участниками того факта, что слабая статистика может стимулировать ФРС на сохранение ставок на текущем уровне до конца года.

Сегодня утром на азиатских рынках индексы отыгрывают положительное закрытие США, при этом на биржах материкового Китая торги не проводятся в связи с праздником. Открытие китайского

рынка произойдет только 7 октября и за счет продолжительных выходных может оказаться крайне волатильным, что создаст дополнительные риски для остальных мировых площадок. На сырьевых рынках утро проходит также в режиме покупок. Инвесторы отыгрывают новости о снижении количества буровых в США до пятилетнего минимума и снижении добычи в США.

Среди основных событий на сегодня стоит отметить публикацию сентябрьских индексов деловой активности по Еврозоне. Также станут известны данные по индексу доверия инвесторов Sentix в сентябре и розничные продажи в августе. Во второй половине дня ожидается публикация индекса экономических условий ISM в непродовольственной сфере в США за сентябрь. Что касается корпоративных событий российских эмитентов, единственным значимым поводом станет проведение ВОСА ВымпелКома, на которое вынесены вопросы по реструктуризации компании и утверждения устава компании в новой редакции.

Источник: ИК «Энергокапитал»



Календарь событий на неделю

		Показатель	Зона	Прогнозное значение	Предыдущее значение
5-Oct	12:00	Розничные продажи в августе	Еврозона	1,8%	2,7%
5-Oct	17:00	ISM индекс экономических условий в непроизводственной сфере	США	57,70	59,00
6-Oct	9:00	Промышленные заказы в августе	Германия	0,5%	-1,4%
6-Oct	15:30	Торговый баланс товаров и услуг	США	-45,5 млрд. долл.	-41,9 млрд. долл.
7-Oct	9:00	Промышленное производство в августе	Германия	0,20%	0,70%
7-Oct	15:00	ИПЦ в сентябре	Бразилия		
7-Oct	17:30	EIA недельное изменение запасов нефти	США		3,955 млн барр
8-Oct		Публикация протокола заседания FOMC	США		
8-Oct	4:45	Caixin индекс деловой активности в сфере услуг	Китай		51,5
8-Oct	9:00	Торговый баланс в августе	Германия	22,4 млрд евро	22,8 млрд евро
8-Oct	14:00	Ключевая ставка Банка Англии	Великобритания	0,50%	0,50%



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
Начальник брокерского отдела
voronova@energ.ru
+7 (812) 329-44-46

Иван Шарафутдинов
«Личный брокер»
sharafutdinov@energ.ru
+7 (812) 329-17-94

Управление по продажам

Елизавета Дубовик
Руководитель московского офиса
elizaveta@energ.ru
+7 (495) 223-52-09

Маковеева Наталья
Директор управления Санкт-Петербург
makoveeva@energ.ru
+7 (812) 458-57-05

Корпоративные финансы

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

Управление по работе с клиентами

Павел Философов
Директор управления по работе с клиентами
paulf@energ.ru
+7 (812) 329-17-45

Ирина Мальцева
Начальник отдела мониторинга
iramal@energ.ru
+7 (812) 329-55-02

Александра Бобкова
Финансовый консультант
bobkova@energ.ru
+7 (812) 329-17-72

Информационно-аналитическое управление

Василий Копосов
Директор управления
koposov@energ.ru
+7(812) 329-17-94

Марсело Муньос
Заместитель начальника отдела инвестиционного моделирования
marcelo@energ.ru
+7 (812) 329-55-92

Илья Березин
Специалист отдела
berezin@energ.ru
+7 (812) 329-55-92

Управляющая компания

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

Обращаем Ваше внимание, что информация и выводы, содержащиеся в настоящей публикации, были подготовлены специалистами компании "Энергокапитал" и предназначены 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.



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

