



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

ММВБ:

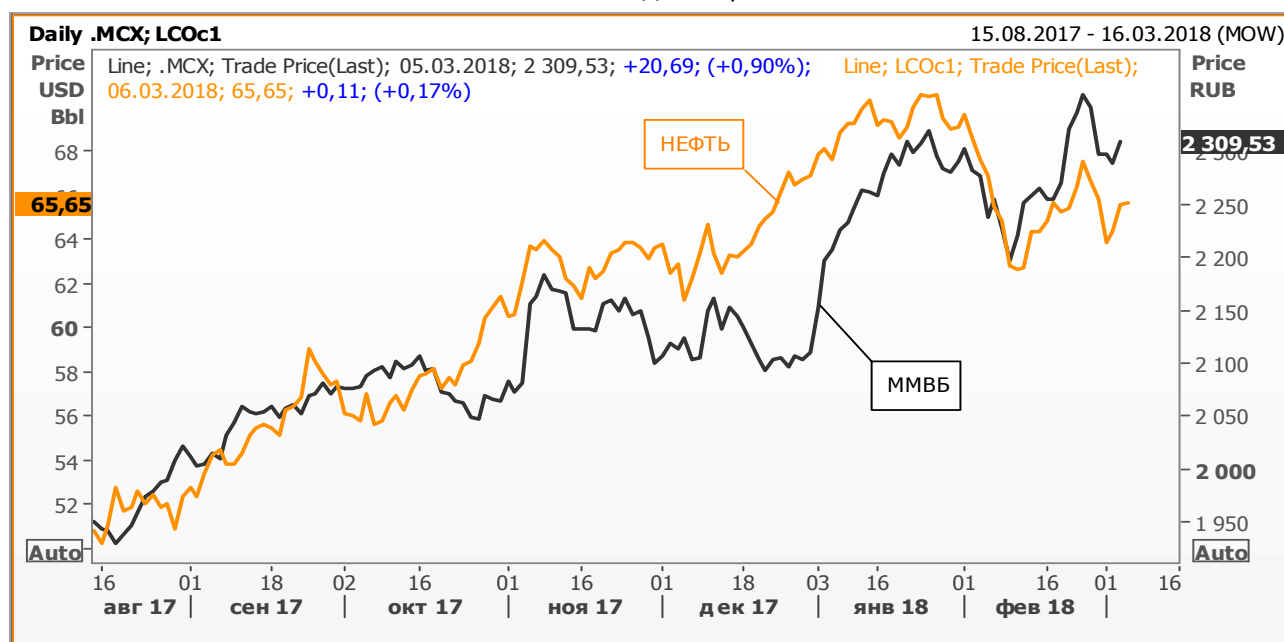
Текущая цена: 2 296,80
Поддержка: 2 265 и 2 327,15
Сопротивление: ---
Тренд: Растущий
Рекомендация: БЕЗ ПОЗИЦИИ
Цель: ---

Судя по операциям вчерашнего дня, активные спекулянты капитулировали и начали увеличивать длинную позицию, в то время как профучастники, напротив, перешли к её сокращению. И все эти изменения происходят на фоне кривой спреда (см. рис.1), которая не вызывает тревоги у покупателей.

Рис.1



Одновременно с кривой спреда усыпляет бдительность покупателей нефть, которая, обладая высокой корреляцией с индексом ММВБ, выступает в качестве опережающего индикатора...



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

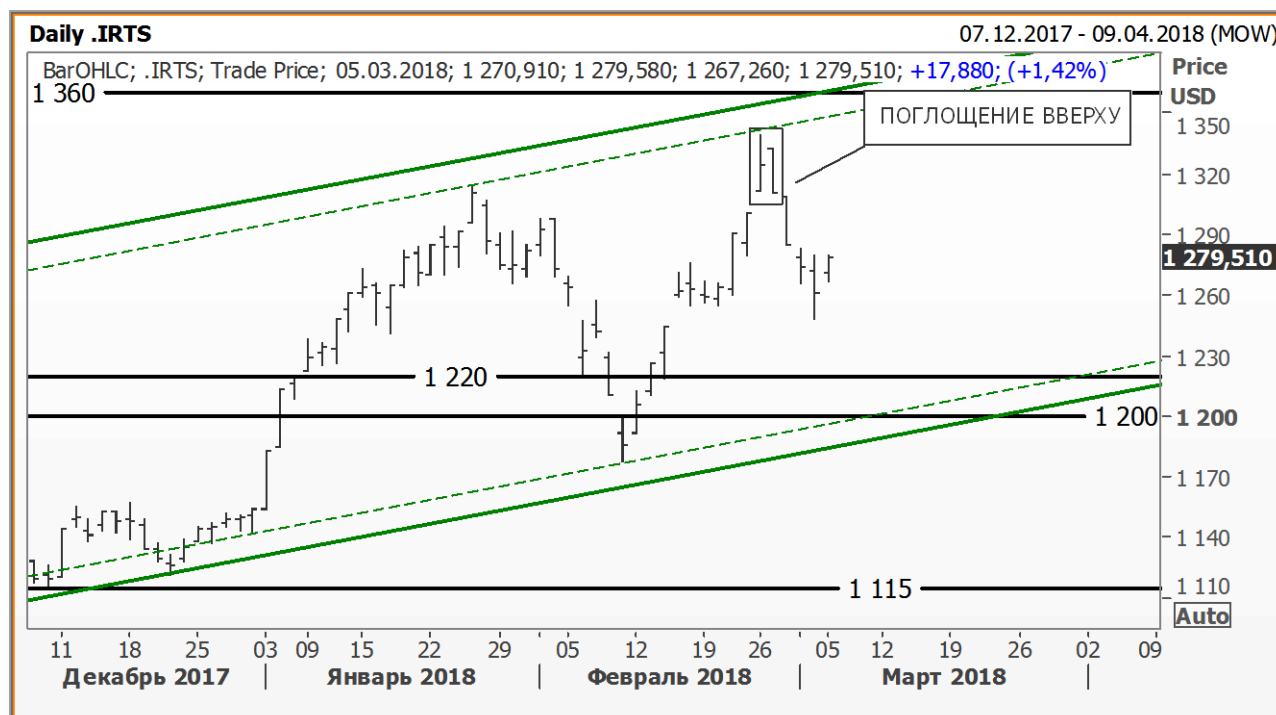
Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

РТС:

Текущая цена: 1 279,51
Поддержка: 1 200 и 1 220
Сопротивление: 1 360
Тренд: Растущий
Рекомендация: ШОРТ
Цель: 1 100

Опираясь на открытый интерес опционной доски, мы считаем, что в ближайшее время (до 15.03.2018) продавцы зоны «call» будут удерживать котировки индекса РТС ниже 1 300 пунктов. При этом оптимальная ситуация для них – это провести экспирацию ниже 1200 пунктов.



Источник: Московская биржа



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

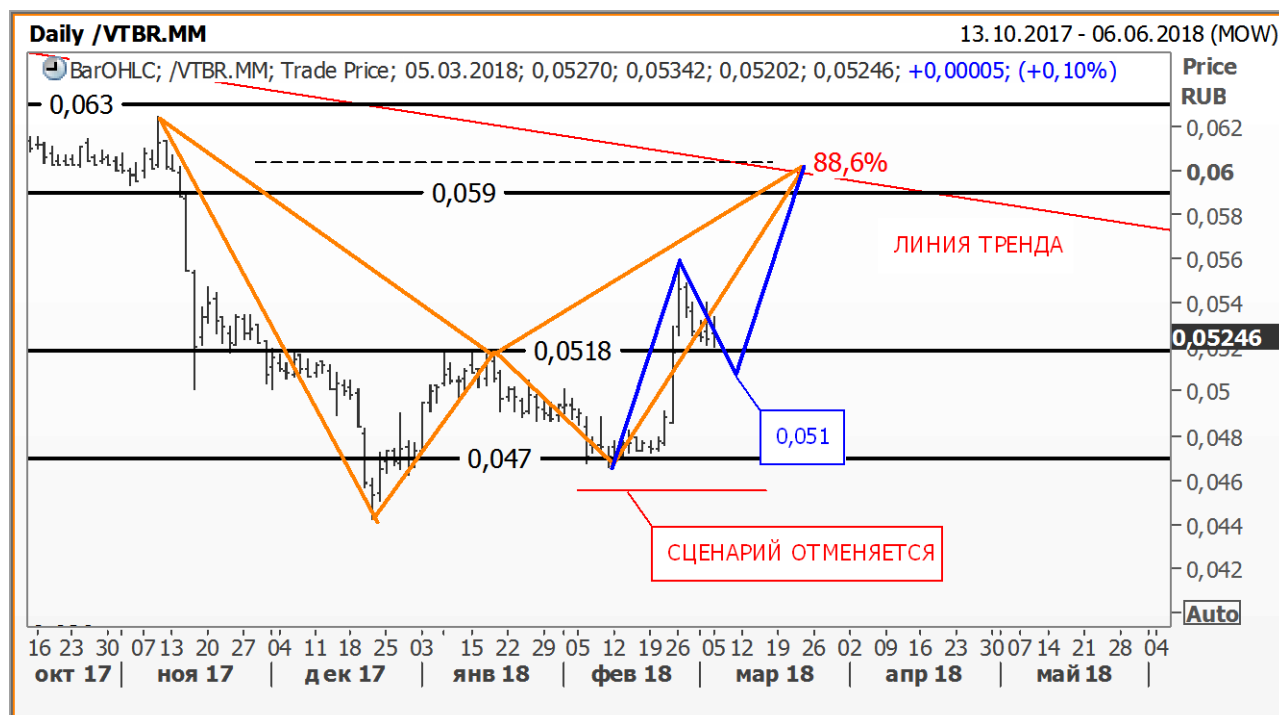
www.alfadirect.ru

ВТБ:

Текущая цена: 0,05246
Поддержка: 0,047 и 0,0518
Сопротивление: 0,059
Тренд: Формируется
Рекомендация: ДЕРЖАТЬ
Цель: 0,06

На рисунке ниже выделена одна из гармонических моделей, на фоне которой мы считаем, что спекулянтам, находящимся БЕЗ ПОЗИЦИИ, текущие уровни стоит рассматривать для спекулятивной игры на повышение, убытки от которой стоит ограничить движением ниже 0,051 руб.

Тем, кто открывал «лонг» вместе с нами в районе 0,047 руб, мы предлагаем удерживать свою позицию, несмотря на то что за эти дни прибыль упала до 11,45%.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

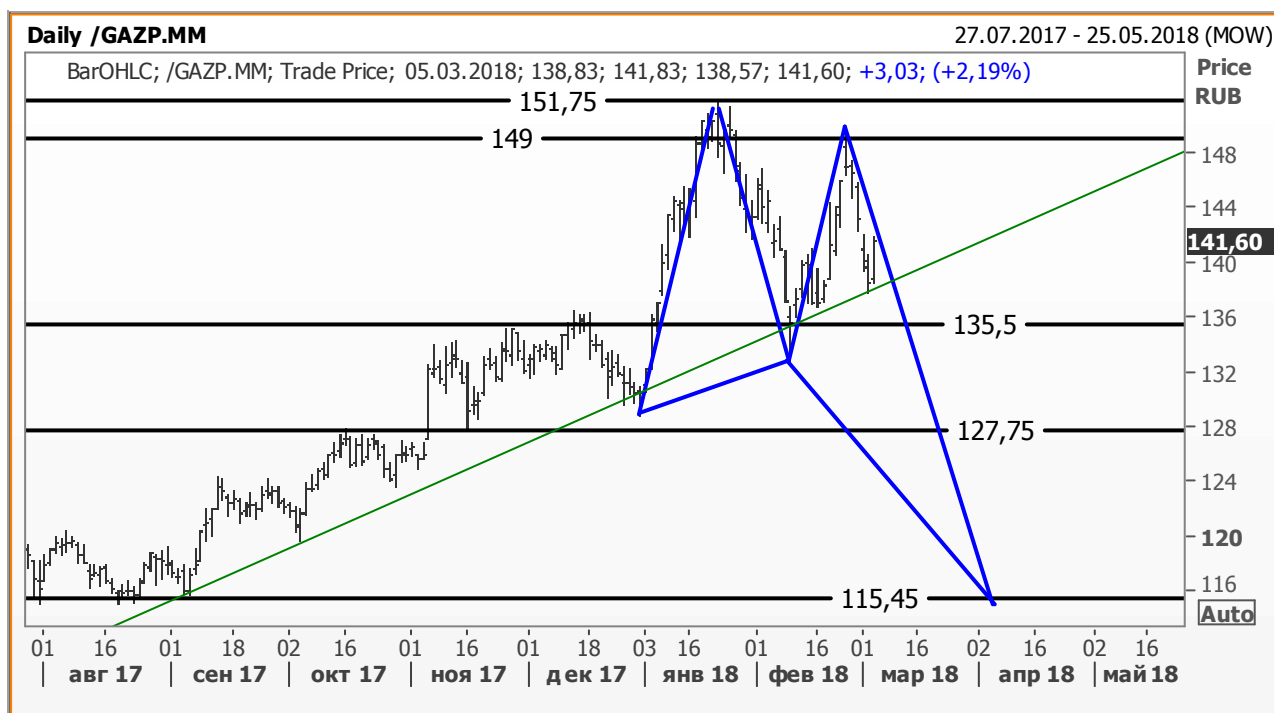
Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

ГАЗПРОМ:

Текущая цена: 141,60
Поддержка: 127,75 и 135,50
Сопротивление: 149 и 158(160)
Тренд: Формируется
Рекомендация: ШОРТ
Цель: 115

Со стопом выше 152 руб мы решили вернуться к идее «шорта», который может принести около 20%, если в ближайшее время реализуется одна из гармонических моделей, пропорции которой начали формироваться в январе текущего года.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

ГМК НорНикель:

Текущая цена: 11 199
Поддержка: 9 870 и 10 890
Сопротивление: 11 930 и 12 155
Тренд: Формируется
Рекомендация: БЕЗ ПОЗИЦИИ
Цель: ---

Судя по экстремальным значениям, акции ГМК НорНикель в данный момент торгуются внутри расходящегося «треугольника», границы которого помогут в дальнейшем определить спекулятивную позицию.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

МТС:

Текущая цена: 315
Поддержка: 224,25 и 292
Сопротивление: 329,45
Тренд: Растущий
Рекомендация: ШОРТ
Цель: 180

К игре на понижение мы предлагаем вернуться и в акциях МТС, которые выполнили правило «равноудаленное движение» и не нарушили волну Вульфа.

Предлагаем короткую позицию сформировать в два этапа: 1-ю продажу осуществить на текущих уровнях и 2-ю – после движения ниже 292 руб. Стоп – приказ 1-й продажи мы предлагаем разместить чуть выше 329,50 руб!

p.s. В данный момент по позиции образовался убыток 2,3% и/или 1,15%, если формирование «шорта» разбито в два этапа.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

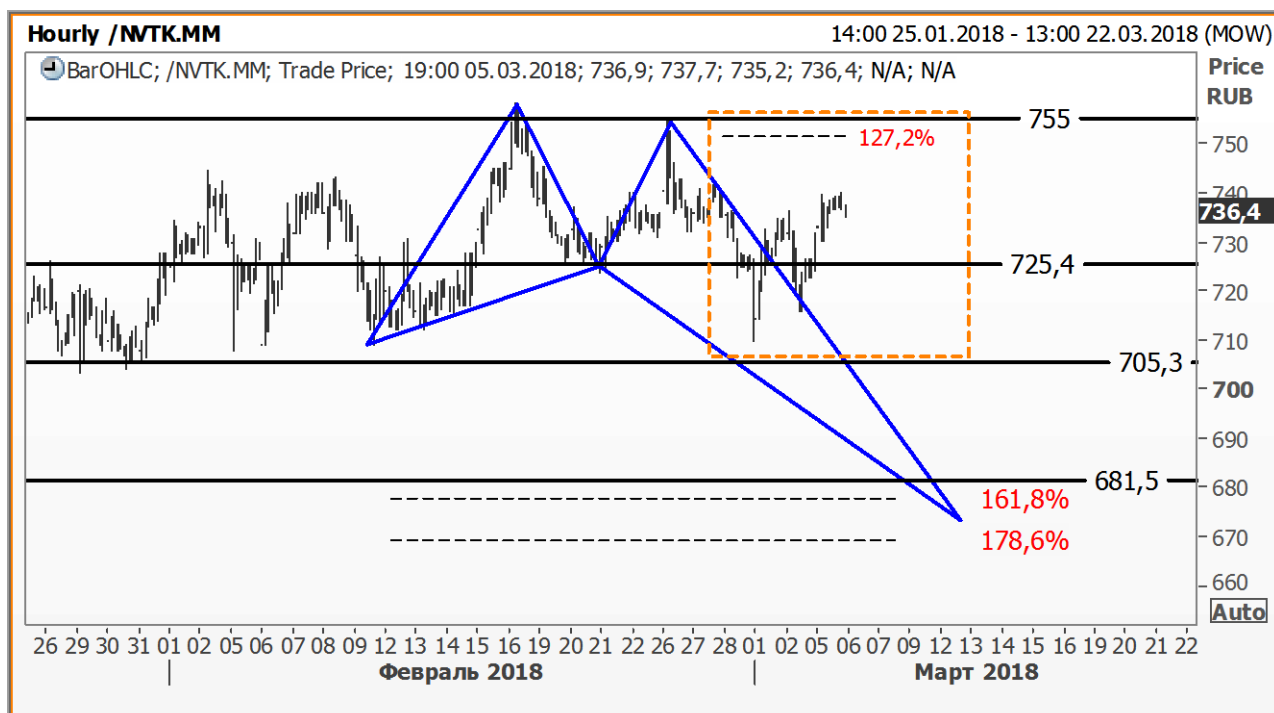
Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

НОВАТЭК:

Текущая цена: 736,40
Поддержка: 705,30 и 725,40
Сопротивление: 755
Тренд: Формируется
Рекомендация: ШОРТ
Цель: 675

Если три дня назад короткую позицию можно было закрыть с плюсом (2%), то сегодня – это минус 1,7%. А если учесть недавно образовавшиеся пропорции (речь идет об экстремальных значениях, попавших в квадрат), то акции НОВАТЭКа в ближайшее время, судя по всему, позволят спекулянтам без позиции открыть «шорт» в оптимальной зоне 127,2% по Фибоначчи.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

Общая таблица рекомендаций

Эмитент	Поддержка, руб	Соппротивление, руб	Тренд	Рекомендация	Стоп – приказы, руб
Лукойл	3 488 и 3 580,80	3 950	Растущий	Держать «лонг» Цель 4 150 руб	Ниже 3 580 руб
Магнит	4 695	6 180 и 6 645	Падающий	Держать «лонг» Цель 6 150 руб	Ниже 4 700 руб
Роснефть	300 и 310	337,25 и 345,50	Формируется	Держать «шорт» Цель 300 руб	Выше 359,50 руб
НЛМК	139,15	157,45	Растущий	Держать «шорт» Цель 105 руб	Выше 157,45 руб
РусГидро	0,71 и 0,7515	0,80 и 0,8425	Формируется	Держать «шорт» Цель 0,64 руб	Выше 0,825 руб
Сбербанк АО	243,95 и 270,35	---	Растущий	Держать «шорт» Цель 245 руб	Выше 277,55 руб
Сбербанк АП	206,20 и 221,50	---	Растущий	Держать «лонг» Цель 245 руб	Ниже 221 руб
СевСталь	860	925 и 995	Формируется	Ретест 925 руб использовать для открытия «шорта»	---
Сурнефтегаз АО	26 и 27	29 и 31	Формируется	Держать «шорт» Цель 26,25 руб	Выше 30 руб
Аэрофлот	125 и 137	152	Формируется	Держать «шорт» Цель 142 руб	Выше 155 руб
ВТБ	0,047 и 0,0518	0,059	Формируется	Держать «лонг» Цель 0,06 руб	Ниже 0,05 руб
Газпром	127,75 и 135,50	149 и 151,75	Растущий	Держать «шорт» Цель 115 руб	Выше 152 руб
МТС	224,25 и 292	329,45	Растущий	Держать «шорт» Цель 180 руб	Выше 329,50 руб
ГМК НорНикель	9 870 и 10 890	11 930	Формируется	Без позиции	---
Новатэк	705,30 и 725,40	755	Формируется	Держать «шорт» Цель 690 руб	Выше 760 руб



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

Контактная информация

Альфа-Банк (Москва)

Аналитический отдел

Телефон/Факс

Руководитель аналитического подразделения,

Металлы и горная добыча

Макроэкономика

Потребительский сектор, Интернет

Аналитическая поддержка российских клиентов

Перевод

Редактор

Торговые операции и продажи

Телефон

Продажи российским и иностранным клиентам

Группа продаж Альфа-Директ

Россия, Москва, 107078, пр-т Академика Сахарова, 12

(7 495) 795-3676

Борис Красноженов

Наталия Орлова, Ph.D, Валерия Волгарева

Александра Мельникова, Евгений Кипнис

Гельды Союнов, Алан Казиев

Анна Мартынова

Джон Волш

(7 495) 223-5500, (7 495) 223-5522

Александр Зоров

(7 495) 795-3680

Ирина Фадеева, Валерий Кремнев, Ольга Бабина

Данный материал предназначен АО «Альфа-Банк» (далее – «Альфа-Банк») для распространения в Российской Федерации. Он не предназначен для распространения среди частных инвесторов. Несмотря на то, что приведенная в данном материале информация получена из источников, которые, по мнению Альфа-Банка, являются надежными, Альфа-Банк, его руководящие и прочие сотрудники не делают заявлений и не дают заверений ни в прямой, ни в косвенной форме, относительно своей ответственности за точность, полноту такой информации и отсутствие в данном материале каких-либо важных сведений. Любая информация и любые суждения, приведенные в данном материале, могут быть изменены без предупреждения. Альфа-Банк не дает заверений и не заявляет, что упомянутые в данном материале ценные бумаги и/или суждения предназначены для всех его получателей. Данный материал и содержащиеся в нем сведения носят исключительно информативный характер и не могут рассматриваться ни как приглашение или побуждение сделать оферту, ни как просьба купить или продать ценные бумаги или другие финансовые инструменты, или осуществить какую-либо иную инвестиционную деятельность. Альфа-Банк и связанные с ним компании, руководящие сотрудники и прочие сотрудники всех этих структур, в т.ч. лица, участвующие в подготовке и издании данного материала, могут иметь отношения с маркет-мейкерами, а иногда и выступать в качестве таковых, а также в качестве консультантов, брокеров или представителей коммерческого или инвестиционного банка в отношении ценных бумаг, финансовых инструментов или компаний, упомянутых в данном материале, либо входить в органы управления таких компаний. Ценные бумаги с номиналом в иностранной валюте подвержены колебаниям валютного курса, которые могут привести к снижению их стоимости, цены или дохода от вложений в них. Кроме того, инвесторы, вкладывающие средства в ценные бумаги типа АДР, стоимость которых изменяется в зависимости от курса иностранных валют, принимают на себя валютный риск. Инвестиции в России и в российские ценные бумаги сопряжены со значительным риском, поэтому инвесторы, прежде чем вкладывать средства в такие бумаги, должны провести собственное исследование и изучить экономические и финансовые показатели самостоятельно. Инвесторы должны обсудить со своими финансовыми консультантами риски, связанные с таким приобретением. Альфа-Банк и их дочерние компании могут публиковать данный материал в других странах. Поскольку распространение данной публикации на территории других государств может быть ограничено законом, лица, в чьем распоряжении окажется данный материал, должны быть информированы о таких ограничениях и соблюдать их. Любые случаи несоблюдения указанных ограничений могут рассматриваться как нарушение закона о ценных бумагах и других соответствующих законов, действующих в той или иной стране. Примечание, касающееся законодательства США о ценных бумагах: Данная публикация распространяется в США компанией Alfa Capital Markets (USA) Inc. (далее «Alfa Capital»), являющейся дочерней компанией Альфа-групп, постольку, поскольку это разрешено законодательством США по ценным бумагам и другими соответствующими законами и положениями. В этой связи Alfa Capital несет ответственность за содержание данного исследования. Лица на территории США, получившие данную публикацию и желающие осуществить сделку с той или иной ценной бумагой или финансовым инструментом, анализируемым в ней, должны делать это только после уведомления об этом представителя Alfa Capital в США. Любые случаи несоблюдения данных ограничений могут рассматриваться как нарушение законодательства США о ценных бумагах.

Ценовые уровни и оценки, приведенные в настоящем обзоре, могут отличаться от взглядов Центра макроэкономического прогноза АО «Альфа-Банк» на фоне краткосрочных спекулятивных трендов в инвестиционных инструментах.

© Альфа-Банк, 2017 г. Все права защищены. Генеральная лицензия ЦБ РФ № 1326. Настоящий отчет и содержащаяся в нем информация являются исключительной собственностью Альфа-Банка. Несанкционированное копирование, воспроизводство и распространение настоящего материала, частично или полностью, в отсутствие разрешения Альфа-Банка в письменной форме строго запрещено.