

18 Октября 2018

Комментарий

В среду 17 Октября основные российские фондовые индексы показали умеренное снижение. Так, по итогам дня Индекс РТС потерял 0,26%, а рублевый Индекс МосБиржи снизился на 0,24%. Торговая активность продолжает повышаться. Так, биржевые обороты по акциям, входящим в индекс МосБиржи, составили 35,9 млрд. руб. против 33,1 млрд. руб. во вторник. Среди отраслевых индексов РТС в лидерах по темпам роста вновь оказались индексы металлургического и потребительского секторов. Хуже рынка торговались индекс нефтегазового сектора. Среди отраслевых рублевых индексов, индекс Химического производства упал на 0,68%, индекс Транспорта просел на 0,27%, индекс Потребительских товаров и торговли прибавил 1,07%, индекс Электроэнергетики прибавил 0,49%, индекс Телекоммуникации потерял 0,27%, индекс Металлов и добычи подрос на 1,16%, индекс Банков и финансов снизился на 0,19%. В долларовой выражении отраслевой индекс Транспорта просел на 0,29 %, индекс Потребительских товаров и торговли подрос на 1,05%, индекс Нефти и газа упал на 0,63%, индекс Электроэнергетики прибавил 0,46%, индекс Банков и Финансов просел на 0,22%, индекс Металлов и добычи прибавил 1,13%, а индекс Телекоммуникации упал на 0,29%.

По итогам дня в лидерах по темпам роста оказались акции ОАК, цены которых взлетела на 25%. Котировки бумаг Х5 подросли на 5,0%. Акции Северсталь выросли в цене на 2,8%. Котировки бумаг Лента Лтд и Интер РАО прибавили 2,4% по итогам дня. В аутсайдерах дня оказались акции НОВАТЭК, котировки которых упали на 3,2%. Котировки акций Газпромнефть просели на 3,0%. Цена привилегированных акций Сбербанка упала на 1,7%. Котировки акций Распадской просели на 1,4%, а акции СОЛЛЕРС снизились в цене на 1,3% по итогам дня.

Индикатор уровня риска на американском фондовом рынке незначительно вырос. Так, индекс VIX по итогам дня подрос на 0,4% и закрылся на уровне 17,70. На рынке FOREX значение пары EUR/USD снизилось со 1,158 долл. до 1,154 долл. за евро, а значение пары британский фунт/ доллар США упало с 1,318 долл. до 1,314 долл. за фунт. На внутреннем валютном рынке рубль показал разнонаправленное движение в основных валютных парах. Так, значение пары USD/RUB снизилось с 65,36 руб. до 65,40 руб. за доллар, а значение пары EUR/RUB упало с 75,65 руб. до 75,43 руб. за евро. На товарном рынке наблюдалось незначительное снижение цен на металлы. Так, котировки серебра просели в пределах 0,2%, палладия упали на 0,7%, платины снизились на 0,8%. Котировки золота по итогам дня потеряли около

Рыночные индикаторы*

US Tsys 10Y	3,16%	-0,06%
EUR/USD	1,153	-0,38%
USD/JPY	112,21	+0,04%
EUR/GBP	0,87785	+0,01%
S&P 500	2808,18	+2,15%
VIX	17,70	+0,42%
DJIA	25794,99	+2,17%
Shanghai Comp	2561,614	+0,60%
DJ EURO Stoxx 50	3243,08	-0,17%
Лидеры роста/снижения за день		
ОАК	0,925	+25,0%
Х5	1 442	+5,0%
Северсталь	1 073	+2,8%
Лента Лтд	234,5	+2,4%
Интер РАО	4,0735	+2,4%
СОЛЛЕРС	460	-1,3%
Распадская	124,67	-1,4%
Сбербанк пр	165,91	-1,7%
Газпромнефть	383,7	-3,0%
НОВАТЭК	1 117,4	-3,2%

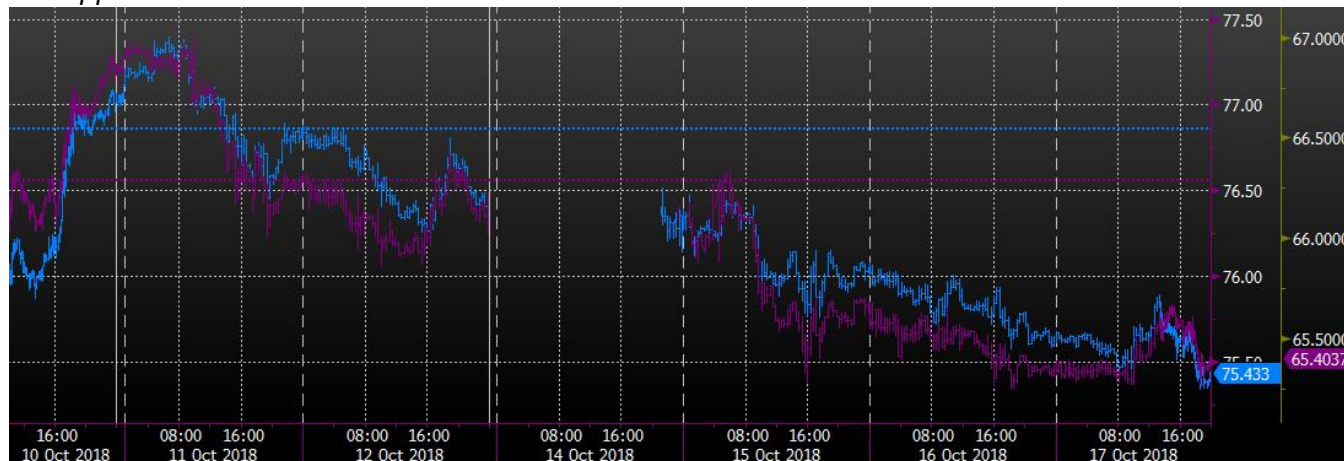
*- на 19-00 17 Октября 2018г.

Источник: ПАО Московская Биржа

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

0,2% и составили на закрытии 1229 долл. за тр. ун. Котировки нефти смеси марки Brent потеряли около 1,7% и закрылись на уровне 80,2 долл. за барр.



Источник: ПАО Московская Биржа

Большая порция статистики вышла по российской экономике. Темпы падения реальных располагаемых доходов в сентябре ускорились до 1,5% в годовом выражении против снижения на 0,9% месяцем ранее. В то же время темпы роста реальной заработной платы выросли до 7,2% против 6,8% в августе.



Источник: Bloomberg

Темпы роста розничных продаж в сентябре упали до 2,2% в годовом выражении, что стало минимальным значением с февраля.



Источник: Bloomberg

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

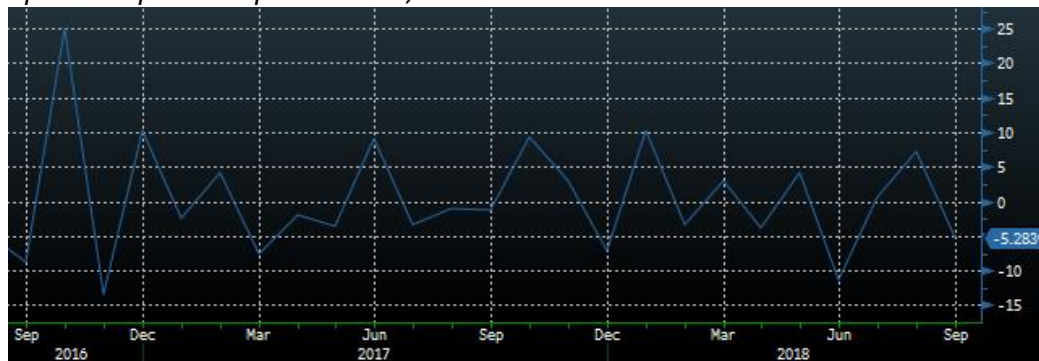
Ежедневный обзор

Темпы роста грузооборота упали в сентябре до 1,9% в годовом выражении против роста на 2,6% в августе. Динамика строительства впервые с мая текущего года вышла в положительную область.



Источник: Bloomberg

Из мировой статистики стоит отметить снижение количества новостроек в США в сентябре на 5,3% против роста на 7,1% в августе. Количество разрешений на строительство в сентябре упало на 0,6% против прогноза роста на 2,0%.



Источник: Bloomberg

Индекс МосБиржи



Источник: ПАО Московская Биржа

Индекс РТС



Источник: ПАО Московская Биржа

Взгляд на рынок

- ✓ На динамику российского фондового рынка в среднесрочной и долгосрочной перспективе по-прежнему будет оказывать сильное влияние внешнеполитические факторы и перспективы ужесточения или смягчения взаимных санкций между Россией, ЕС и США. Анонсированные властями США

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

новые санкции в отношении России, которые могут быть приняты в ближайшие месяцы, отражают сохранение существенного фактора риска для российских ценных бумаг, по крайней мере, в среднесрочной перспективе.

- ✓ Индекс широкого рынка S&P 500 находится в рамках коридора, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящими средними со значениями 2855 и 2761 пунктов соответственно. Внимание инвесторов в среднесрочной перспективе будет концентрироваться на оценке возможного количества повышений ставки ФРС в текущем году и реакции других ведущих мировых центральных банков на эти изменения. Из макроэкономической статистики до конца текущей недели важными окажутся данные по темпам роста ВВП и промышленного производства в Китае, платежному балансу еврозоны, рынку недвижимости в США.
- ✓ С технической точки зрения индекс РТС ушел выше верхней границы бокового канала, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящих средних, значение которых составляет 1134-1145 пункта. Индекс МосБиржи также находится чуть выше верхней границы диапазона, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящими средними, которые находятся на уровне 2382 и 2291 пунктов. Перспективы дальнейшего движения на российском рынке в ближайшее время будут зависеть от внешнеполитического фона, данных мировой макроэкономической статистики и динамики цен на нефть.

Динамика котировок наиболее крупных по рыночной капитализации российских акций

Эмитент	Цена на 17.10.18г. (руб.)	Рын. кап. (млн. долл.)	Изм. цены за 1 дн.	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.
Роснефть	467,85	75 864	-0,18%	-0,19%	+6,02%	+17,11%	+60,50%	+42,64%	522,80	281,65
Сбербанк	194,05	64 092	-1,02%	+2,19%	+3,16%	-12,79%	-13,83%	-1,60%	285,00	165,90
ЛУКОЙЛ	4773	62 115	-0,46%	-2,62%	+3,07%	+11,98%	+43,14%	+58,94%	5115,00	2975,50
Газпром	164,56	59 606	-0,86%	-0,99%	+5,85%	+13,25%	+26,10%	+31,49%	176,95	123,64
НОВАТЭК	1117,4	51 910	-3,22%	-4,50%	+4,03%	+26,12%	+64,88%	+69,90%	1215,00	641,70
ГазпромНефть	383,7	27 835	-3,01%	-1,82%	+15,64%	+13,22%	+57,19%	+64,57%	404,60	227,10
ГМК НорНикель	11430	27 674	+1,47%	+0,47%	-0,95%	+7,73%	+5,35%	+6,52%	12144	8824
Татнефть	790,5	27 592	+0,52%	-4,04%	+0,71%	+14,56%	+65,10%	+85,87%	847,10	407,55
НЛМК	171,3	15 708	+2,05%	-2,86%	-0,02%	+9,05%	+16,36%	+25,55%	184,88	128,01
Сургутнефтегаз	27,175	14 854	-0,02%	+0,76%	-1,70%	-4,97%	-2,56%	-8,19%	30,92	26,78
Северсталь	1073	13 753	+2,78%	-1,81%	-0,57%	+11,62%	+20,92%	+19,22%	1118,60	786,70
Yandex	2310	11 641	+0,13%	+7,64%	+7,54%	-4,55%	+21,96%	+26,02%	2519,00	1743,00
АЛРОСА	101,43	11 430	+1,43%	-2,56%	-4,54%	+1,33%	+35,13%	+27,79%	107,92	72,51
Полюс	4350	8 889	+0,79%	+5,84%	+5,97%	+5,15%	-5,33%	-6,57%	5242,00	3208,00
МТС	271,05	8 288	-0,50%	+2,87%	-2,02%	+0,24%	-1,79%	-3,99%	321,00	245,10

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

ММК	48,215	8 243	-0,22%	+0,52%	-2,00%	+8,06%	+15,18%	+4,25%	53,84	40,06
ВТБ	0,03846	7 627	+0,16%	+0,87%	-3,95%	-21,06%	-18,72%	-36,53%	0,062	0,037
RUSAL Plc	28,55	6 637	+0,14%	+1,96%	+6,53%	+16,86%	-29,59%	-29,33%	43,06	15,04
Интер РАО	4,0735	6 507	+2,36%	+2,04%	-0,10%	-6,62%	+19,81%	+8,37%	4,43	3,22
МегаФон	592	5 616	+0,37%	+2,16%	+1,81%	+1,20%	+15,42%	+0,24%	680,00	435,00

Источник: ПАО Московская Биржа

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, ПАО «ИК РУСС-ИНВЕСТ» не исключает возможность включения в обзор ошибочной информации, предоставленной соответствующими источниками, и не несет за это ответственности. ПАО «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

Факс: +7(495) 363-93-90

E-mail: mail@russ-invest.com

Адрес: Москва, 119019, Нащокинский
переулок, д.5, стр. 4

© 2011 | ПАО «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Лицензия № 045-11769-001000 Лицензия № 045-08757-000100 Лицензия № 045-06310-100000

Лицензия № 045-06312-010000