

14 Августа 2019

Комментарий

Во вторник 13 Августа основные российские фондовые индексы показали разнонаправленное движение. Так, по итогам дня долларовой Индекс РТС подрос на 0,29%, а рублевый Индекс МосБиржи упал на 0,36%. Торговая активность выросла. Так, биржевые обороты по акциям, входящим в индекс МосБиржи, составили 45,4 млрд. руб. против 28,5 млрд. руб. в понедельник. Среди отраслевых индексов РТС в лидерах по темпам роста оказался индекс потребительского сектора. В лидерах по темпам снижения можно назвать индекс металлургического сектора. Среди отраслевых рублевых индексов индекс Химического производства упал на 0,58%, индекс Телекоммуникации потерял 0,31%, индекс Банков и финансов упал на 0,49%, индекс Транспорта прибавил в пределах 0,1%, индекс Нефти и газа просел на 0,26%, индекс Металлов и добычи упал на 1,7%, индекс Электроэнергетики снизился на 0,19%, индекс Потребительских товаров подрос на 0,19%. В долларовой выражении отраслевой индекс Транспорта прибавил 0,66%, индекс Телекоммуникации подрос на 0,34%, индекс Банков и Финансов прибавил 0,16%, индекс Потребительских товаров и торговли увеличился на 0,85%, индекс Нефти и газа подрос на 0,4%, индекс Металлов и добычи упал на 1,05%, индекс Электроэнергетики вырос на 0,47%.

По итогам дня в лидерах по темпам роста оказались акции ОГК-2, котировки которых выросли на 3,1%. Котировки акций Мосэнерго подросли на 1,7%. Цены акций ТМК прибавили 1,0%, а котировки бумаг Yandex выросли на 0,8%. Акции Магнита прибавили в цене 0,7% по итогам дня. В аутсайдерах дня оказались акции АЛРОСА, котировки которых упали на 3,2%. Цены акций ММК потеряли 2,7%. Котировки обыкновенных акций Россети просели на 2,6%. Акции Polymetal и АФК Система упали в цене на 2,5% по итогам дня.

Индикатор уровня риска на американском фондовом рынке резко упал. Так, индекс VIX упал на 17% и закрылся на уровне 17,52. На рынке FOREX значение пары EUR/USD снизилось с 1,12 долл. до 1,117 долл. за евро, а значение пары британский фунт/ доллар США упало с 1,21 долл. до 1,206 долл. за фунт. На внутреннем валютном рынке рубль показал резкое укрепление в основных валютных парах. Так, значение пары USD/RUB упало с 65,45 до 64,94 руб. за доллар, а значение пары EUR/RUB снизилось с 73,38 руб. до 72,56руб. за евро. На товарном рынке наблюдалось разнонаправленное движение цен на металлы. Так, котировки палладия выросли на 1,5%, платины и серебра потеряли 0,5%, никеля и меди прибавили 1,5%, алюминия выросли на 0,9%. Котировки золота по итогам дня потеряли 0,2% и составили на закрытии 1514

Рыночные индикаторы

| | | |
|--------------------------------|----------|--------|
| US Tsys 10Y | 1,65% | -3,31% |
| EUR/USD | 1,1184 | +0,12% |
| USD/JPY | 106,41 | +0,31% |
| EUR/GBP | 0,92658 | -0,02% |
| S&P 500 | 2926,32 | +1,50% |
| VIX | 17,52 | 16,9% |
| DJIA | 26279,91 | +1,44% |
| Shanghai Comp | 2808,915 | +0,42% |
| DJ EURO Stoxx 50 | 3351,33 | -0,17% |
| Лидеры роста/снижения за день* | | |
| ОГК-2 | 0,498 | +3,1% |
| Мосэнерго | 2,2875 | +1,7% |
| ТМК | 55,32 | +1,0% |
| Yandex | 2 428 | +0,8% |
| Магнит | 3 585,5 | +0,7% |
| АФК Система | 11,514 | -2,5% |
| Polymetal | 832 | -2,5% |
| Россети | 1,062 | -2,6% |
| ММК | 39 | -2,7% |
| АЛРОСА | 72,73 | -3,2% |

* - на 19-00 13 Августа 2019г.

Источник: ПАО Московская Биржа

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

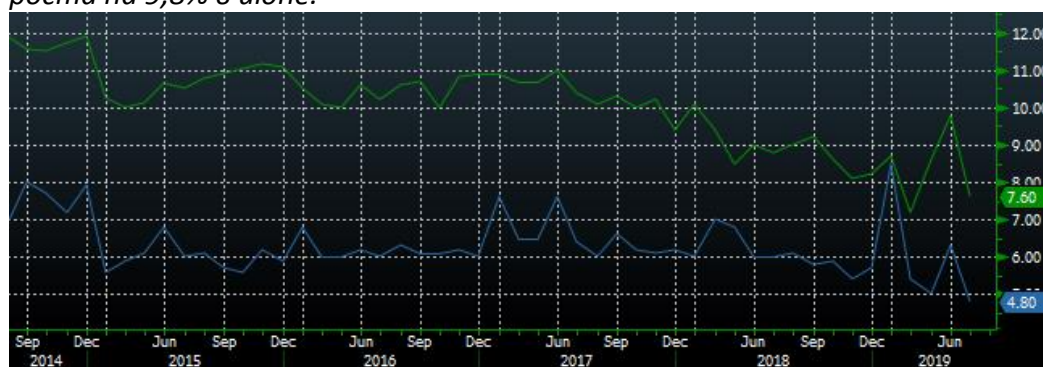
Ежедневный обзор

долл. за тр. ун. Котировки нефти смеси марки Brent выросли на 4,1% и закрылись на уровне 60,9 долл. за барр.



Источник: ПАО Московская Биржа

Последняя значимая макроэкономическая статистика оказалась преимущественно хуже ожиданий. Темпы роста промышленного производства в Китае в июле упали до 4,8% против роста на 6,3% в июне. Темпы роста розничных продаж в июле упали до 7,6% против роста на 9,8% в июне.



Источник: Bloomberg

Темпы потребительской инфляции в США в июле выросли до 1,8% против 1,6% в июне. Темпы инфляции без учета продуктов питания и электроэнергетики ускорились до 2,2% против 2,1% месяцем ранее.



Источник: Bloomberg

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

Индексы экономических ожиданий от института ZEW в Германии в августе обновил многолетние минимумы, упав до -44,1 против -24,5 в июле. Агрегированный индекс для еврозоны также упал до -43,6 против -20,3 месяцем ранее. Индекс оценки текущей экономической ситуации также упал до -13,5 против -1,1 в июле.



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.
- ✓ Индекс широкого рынка S&P 500 преодолел верхнюю границу диапазона, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящими средними, которые располагаются на отметках в 2935 и 2844 пунктов соответственно. Внимание инвесторов в среднесрочной перспективе будет концентрироваться на новостях в отношении перспектив возобновления переговоров по торговым вопросам между Китаем и США и перспектив дальнейшего смягчения кредитно-денежной политики ведущими центральными банками мира. Из макроэкономической статистики до конца текущей недели важными окажутся данные по динамике индекса цен производителей, розничным продажам и промышленному производству в США.
- ✓ Индекс РТС корректируется вниз и опустился в границы диапазона, ограниченного линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящими средними, которые находятся на уровнях 1330 и 1255 пунктов соответственно. Индекс МосБиржи также опустился в границы канала между линиями пятидесятидневной и двухсотдневной скользящими

ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ «ИК РУСС-ИНВЕСТ»

Ежедневный обзор

средними, которые располагаются на отметках 2706 и 2570 пунктов соответственно. 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 13.08.19г. (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. |
|----------------|---------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Газпром | 229,87 | 83 030 | -0,16% | +0,59% | -6,71% | +20,75% | +49,20% | +62,15% | 256,40 | 139,50 |
| Сбербанк | 223,18 | 73 441 | +0,40% | -0,04% | -6,27% | -2,51% | +19,24% | +15,25% | 250,65 | 165,90 |
| Роснефть | 405,3 | 65 936 | +0,72% | -0,07% | -3,10% | -3,49% | -6,07% | -5,81% | 522,80 | 390,75 |
| ЛУКОЙЛ | 5276 | 60 547 | -0,83% | +1,18% | +0,16% | +1,60% | +5,49% | +18,20% | 5996,00 | 4351,50 |
| НОВАТЭК | 1278,4 | 58 858 | +0,42% | -2,99% | -1,78% | +6,37% | +11,82% | +28,17% | 1382,20 | 957,10 |
| ГМК НорНикель | 14858 | 35 925 | -1,10% | +0,84% | +4,44% | +6,23% | +13,69% | +34,89% | 15218 | 10555 |
| ГазпромНефть | 422,6 | 30 888 | -0,65% | +0,81% | +3,50% | +21,54% | +22,70% | +28,79% | 438,10 | 312,15 |
| Татнефть | 729 | 25 654 | -1,30% | -0,38% | -0,26% | +2,63% | -1,75% | -3,67% | 847,10 | 649,40 |
| Сургутнефтегаз | 26,595 | 14 499 | -0,19% | +1,65% | -1,08% | +9,73% | -1,41% | -7,89% | 29,10 | 24,06 |
| Полюс | 7024 | 14 400 | -0,93% | +1,38% | +11,46% | +40,29% | +30,39% | +66,82% | 7199,50 | 3928,00 |
| НЛМК | 141,8 | 12 906 | -1,18% | -2,94% | -7,44% | -11,38% | -10,67% | -9,56% | 185,42 | 140,56 |
| Yandex | 2428 | 12 269 | +0,75% | -0,15% | -5,74% | +5,49% | +25,66% | +12,80% | 2679,00 | 1687,50 |
| Северсталь | 954 | 12 229 | -1,61% | -3,44% | -8,73% | -2,73% | +1,09% | -6,96% | 1121,60 | 904,70 |
| X5 | 2095,5 | 8 817 | +0,26% | +3,82% | -3,50% | +11,08% | +22,90% | +33,92% | 2277 | 1277,5 |
| АЛРОСА | 72,73 | 8 129 | -3,17% | -6,61% | -9,35% | -22,51% | -26,92% | -25,70% | 107,92 | 71,71 |
| ВТБ | 0,04022 | 7 947 | -0,94% | -1,98% | -9,00% | +14,63% | +18,29% | -8,25% | 0,045 | 0,033 |
| МТС | 258,25 | 7 910 | -0,40% | -0,35% | -3,76% | +1,17% | +8,59% | +2,97% | 289,70 | 222,40 |
| Интер РАО | 4,26 | 6 744 | +0,06% | +1,59% | -7,29% | +6,77% | +8,73% | +6,09% | 5,12 | 3,61 |
| ММК | 39 | 6 658 | -2,72% | -2,25% | -12,42% | -9,96% | -9,61% | -16,69% | 53,84 | 38,63 |
| RUSAL Plc | 26,61 | 6 131 | -1,08% | -7,92% | -1,83% | +5,08% | -14,43% | +8,26% | 39,00 | 19,32 |

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»

Ежедневный обзор

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