

Фундаментальный анализ: Внешние рынки

Европа

Европейские фондовые индексы показали четвертый недельный рост после того, как компании BP Plc и Alcatel-Lucent SA опубликовали результаты, которые превысили оценки, в то время как замедление инфляции усилило спекуляции о том, что Европейский центральный банк может смягчить денежно-кредитную политику.

Евро понес свои крупнейшие еженедельные потери с июля 2012 года после выхода данных на этой неделе, которые показали, что в еврозоне инфляция неожиданно замедлилась, а уровень безработицы вырос до рекордных отметок. Инфляция в регионе снизилась до 0,7 процента в октябре, это самый низкий годовой показатель с ноября 2009 года, и находится значительно ниже целевого уровня ЕЦБ в 2 процента.

Америка

Основные фондовые индексы США в пятницу продемонстрировали смешанную динамику. Участники рынка надеялись, что положительная динамика, которую американские фондовые индексы демонстрировали в октябре, сохранится в ноябре, однако слабые квартальные отчеты компаний сдерживали рост. Определенную поддержку индексам также оказали лучшие, чем ожидалось, данные по китайским индексам PMI, которые были представлены утром. Китайские индексы PMI для производственной сферы превзошли прогнозы. Официальный индекс менеджеров по снабжению, рассчитываемый Китайской федерацией логистики и закупок в октябре вырос до 51,4 с 51,1 в сентябре и среднего прогноза 51,2. Индекс PMI от HSBC в октябре был на уровне 50,9 против 50,2 в сентябре и среднего прогноза 50,7. Среди квартальных отчетов стоило отметить данные от Chevron (CVX), которые оказались хуже средних ожиданий аналитиков.

Азия

Фондовые индексы Азиатско-тихоокеанского региона начали торговую неделю умеренным снижением. Фондовый рынок Японии сегодня не работает, в стране официальный выходной день. В Австралии данные по розничным продажам показали прирост самыми быстрыми темпами за последние семь месяцев. Сентябрьский показатель вырос на 0,8%, тогда как аналитики ожидали роста всего на 0,4%. Данная новость не поддержало рынок.

На выходных был опубликован индекс PMI в сервисном секторе Китая, который показал значение 56.3 за октябрь, что значительно выше уровня 50 пунктов, что в свою очередь свидетельствует про расширение сектора. Показатель достиг самого высокого значения за последние 14 месяцев.

Основные макроэкономические данные и события этого дня:

время	страна	показатель	период	предыдущее значение	прогноз
-------	--------	------------	--------	---------------------	---------

10:00	Еврозона	Речь представителя ЕЦБ В. Констанцио			
10:48	Франция	Индекс деловой активности в производственном секторе (окончательные данные)	Октябрь	49.449.4	
10:53	Германия	Индекс деловой активности в производственном секторе (окончательные данные)	Октябрь	51.551.5	
10:58	Еврозона	Индекс деловой активности в производственном секторе (окончательные данные)	Октябрь	51.351.3	
11:30	Еврозона	Индикатор уверенности инвесторов от Sentix	Ноябрь	6.1	6.6
11:30	Великобритания	Индекс деловой активности в строительном секторе, м/м	Октябрь	58.9	58.9
17:00	США	Производственные заказы, м/м	Август	-2.4%	+0.2%
18:40	США	Речь члена Комитета по открытым рынкам ФРС Джерома Пауэлла			

Фондовые индексы

UX	862.22	-0.59%
Uxagro	1083.76	-0.79%
FTSE	6734.74	+0.05%
CAC	4273.19	-0.62%
DAX	9007.83	-0.29%
RTS	1477.61	+0.16%
MICEX	1515.15	0.00%
S&P	1761.64	+0.29%
DJ	15615.55	+0.45%
Nikkei	14201.57	-
Hang Seng	23196.33	-0.23%
S&P/ASX	5390.53	-0.38%
Shanghai	2149.63	0.00%

Фьючерсы:



Фьючерсы сырье валюта

S&P_fut	1757.30	+0.15%
BRENT	106.34	+0.42%
GOLD	1313.04	-0.01%
EUR/USD	1.3491	+0.04%
USD/UAH	8.1905	+0.06%
EUR/UAH	11.0555	-0.82%
RUB/UAH	0.2539	-0.47%



Открытие фондового рынка Украины

Премаркет

Открытие сессии сегодня нейтрально 862-865UX, 865UX-12.13, с последующим движением вверх 870-873UX, 875UX-12.13, горизонтальное сопротивление, где можно ожидать незначительное время проторговки. Прорыв данного сопротивления позволит дальнейшее движение вверх, цель 880UX, 885UX-12.13., что на сегодня маловероятно. Азиатские рынки продемонстрировали смешанную динамику на отчетности японских компаний. Отчетность корпорации Sony, увеличившей чистый убыток во втором квартале 2013 финансового года. Также Nissan уменьшила прогноз по прибыли на текущий финансовый год на 15% - до 335 миллиардов иен (3,6 миллиарда долларов). На текущий момент индекс Китая Shanghai Composite вырос на 0,08%. Сегодня в России выходной – День Единства. Европа открыла сессию в зеленой зоне почти на 0,5%.

Диапазон торговли на сегодня 848-885UX и 855-895UX-12.13



Техника индекс UX

Сопротивление 3: 948 (минимум 21.03.13)
 Сопротивление 2: 910 (закрытие 29.03.13)
 Сопротивление 1: 900 (максимум 24.10.13)
 Цена: 862,22 (-0,59%)
 Поддержка 1: 854 (закрытие 03.10.13)
 Поддержка 2: 831 (максимум 04.09.13)
 Поддержка 3: 809 (минимум 03.09.13)

Индекс пока ничего нового не показывает и продолжает торговаться на диагональной поддержке в восходящем канале. Сегодня будем пробовать расти от поддержки и основная цель на сегодня 885-887, но к этой цели мы подойдем, если преодолеем сопротивление 875.

Компоненты индекса UX

ALMK	0.04	0.5%
AVDK	3.108	-1.96%
AZST	0.643	-1.12%
BAVL	0.1007	-2.14%
CEEN	5.013	0.2%
DOEN	24.75	1.29%
ENMZ	33.59	0.33%
MSICH	1559	-0.43%
UNAF	107.5	-1.06%
USCB	0.1834	0.6%

Лидеры роста объемов P3 грн.

BAGR01	4928.8	18.02%
MSICH	4625	16.91%
VTBB01	2146.6	7.85%
CEEN	1818.8	6.65%
BAVL	1544	5.65%

Лидеры роста P3

SHKD	0.71	8.4%
MZVM	0.1138	7.87%
LUAZ	0.03	5.26%
SVGZ	1.34	3.47%
SGOK	7.899	1.53%

Лидеры падения P3

NVTR	0.1857	-20.98%
CGOK	6.01	-6.09%
BAVL	0.1007	-2.14%
AVDK	3.108	-1.96%
ALIA	10	-1.96%

Зарезервированные ден. средства тыс. грн.

22.08.2013	34240	6.41%
29.08.2013	33581	-1.87%
05.09.2013	34063	1.43%
12.09.2013	35400	4.00%
19.09.2013	36373.9	2.75%
26.09.2013	34981	-3.83%
03.10.2013	33992.7	-2.82%
10.10.2013	61597	82%
17.10.2013	21701	0%
24.10.2013	18245	-15.89%



Торговые рекомендации

Технические уровни и ожидания

Инструмент	Направление	Комментарии
ALMK	Вниз	0,039идем дальше на 0,0382и 0.0374
	Вверх	0,0404ледующая цель 0,0415и 0,042
AVDK	Вниз	Прохождение 3.15 открывает дорогу вниз 3.08и 2.95
	Вверх	3,35 открывает дорогу на 3,55и 3,70
AZST	Вниз	Пробитие поддержки 0,647 идем на 0,635и 0.62
	Вверх	Сопротивление 0,66 далее 0,673и 0,689
BAVL	Вниз	0,10пробивая, идем к 0,0965и 0,0945
	Вверх	Прохождение 0,10 5далее идем 0,108и 0,1125
CEEN	Вниз	Пробитие 4.92идем на 5,74 и 4,54
	Вверх	При прохождении 5,15 следующая 5,15и 5,35
DOEN	Вниз	Поддержка 23.05 пробитие открывает направление вниз 22 и 21.3
	Вверх	24.65 пройдя это сопротивление идем на 25.8и 27
ENMZ	Вниз	33,00 спустимся на поддержку 32,3 и 30,85
	Вверх	Пройдя сопротивление 34,00 открывается дорога наверх 34,5 и 35,5
MSICH	Вниз	1545, следующий уровень 1495 и 1405.
	Вверх	Пробивая 1650 следующий уровень 1700 и 1745
UNAF	Вниз	Пробитие 104 далее 95 и 87 поддержка
	Вверх	111, далее 120 и следующее сопротивление 125
USCB	Вниз	0,1800 проходим, идем 0,1755 и 0,171
	Вверх	0.1975 пробивая, идем на 0,20 35и 0,21.

Техника по основным компонентам индекса


AZST

Сопротивление 3: 1645 (максимум 24.10.13)
 Сопротивление 2: 1625 (максимум 17.10.13)
 Сопротивление 1: 1585 (минимум 22.10.13)
 Текущее значение: 1559 (-0.43%)
 Поддержка 1: 1525 (минимум 30.10.13)
 Поддержка 2: 1495 (минимум 03.09.13)
 Поддержка 3: 1440 (максимум 06.10.09)


MSICH

Сопротивление 3: 1645 (максимум 24.10.13)
 Сопротивление 2: 1625 (максимум 17.10.13)
 Сопротивление 1: 1585 (минимум 22.10.13)
 Текущее значение: 1559 (-0.43%)
 Поддержка 1: 1525 (минимум 30.10.13)
 Поддержка 2: 1495 (минимум 03.09.13)
 Поддержка 3: 1440 (максимум 06.10.09)



Техника по основным компонентам индекса

DOEN

Сопротивление 3: 26.00 (максимум 03.10.13)
 Сопротивление 2: 25.60 (максимум 15.08.13)
 Сопротивление 1: 25.13 (максимум 17.10.13)
 Текущее значение: 24.75 (+1.29%)
 Поддержка 1: 24.70 (максимум 24.10.13)
 Поддержка 2: 24.00 (минимум 28.10.13)
 Поддержка 3: 22.90 (максимум 09.09.13)


BAVL

Сопротивление 3: 26.00 (максимум 03.10.13)
 Сопротивление 2: 25.60 (максимум 15.08.13)
 Сопротивление 1: 25.13 (максимум 17.10.13)
 Текущее значение: 24.75 (+1.29%)
 Поддержка 1: 24.70 (максимум 24.10.13)
 Поддержка 2: 24.00 (минимум 28.10.13)
 Поддержка 3: 22.90 (максимум 09.09.13)

Торговые идеи

DOEN восходящий тренд

Цена продолжает тестировать верхние границы, преодолев сопротивление на уровне 24,05-24,25грн. Для дальнейшего роста надо немного скорректироваться или хотя бы короткое время проторговать диагональную поддержку 24,05грн. Пробитие поддержки, может говорить об отработке «медвежьего» сценария, с целью на 22,9-23,0грн. Если же пробития поддержки не увидим, тогда ждем отскока после чего отработываем «бычий» сценарий, основная цель наверху 26,8грн., промежуточная 25,5-25,6грн.


AZST падает на поддержку

На текущий момент, технически цена сформировала нисходящую дивергенцию указанную на графике. Дальнейшее снижение к поддержке 0,65 - 0,6515грн., будет говорить о усилении коррекции и в случае пробития поддержки снизимся на 0,6310 - 0,632грн., отработка «медвежьего» сценария. «Бычий» сценарий можно рассматривать после достижения поддержки 0,65грн., и отскока, на уровне 0,6525 - 0,6535грн. покупаем, цель основная наверху 0,68грн.



Календарь собрания акционеров

Дата	Время	Тикер	Название, рус	Важные вопросы на голосовании
07.11.13	11:00	DOEN	Донбассэнерго, ПАО	-

Отчетность эмитентов за 2012 год

Тикер	Цена	Чист. прибыль, грн	Рент. акционерного капитала, %	Цена/чист. прибыль	Чист. прибыль / активы, %	Чист. прибыль на акцию, грн
ALMK	0,04	-3 166 361 000	-	-0,33	-17,30%	-0,1228
AVDK	3,108	-1 109 583 000	-	-0,54	-11,76%	-5,7094
AZST	0,643	-2 695 424 000	-	-1,00	-10,14%	-0,6418
BAVL	0,1007	33 846 000	1,10%	89,17	0,07%	0,0011
CEEN	5,013	233 766 000	11,20%	7,92	5,19%	0,6328
DOEN	24,75	30 975 000	4,71%	18,89	1,06%	1,3100
ENMZ	33,59	69 431 000	10,55%	5,10	2,37%	6,5807
MSICH	1559	1 998 720 000	24,48%	1,59	16,43%	978,5406
UNAF*	107,5	2 616 000 000	-	2,23	-	48,2403
USCB	0,1834	1873000	0,10%	1776,24	0,00%	0,0001

*данные за 9 месяцев 2012 года

Макростатистика Украины по годам

Показатель	2008	2009	2010	2011	2012
ВВП по факт. ценам, млн.грн	948 056	913 345	1 082 569	1 302 079	1 408 889
Реальный ВВП, в % к пред году	2,30%	-16,80%	4,10%	5,20%	0,20%
Рост промышленного производства	-5,20%	-21,90%	11,20%	7,60%	-1,80%
Индекс потребительских цен	22,30%	12,30%	9,10%	4,60%	-0,20%
Индекс промышленных цен	23%	14,30%	18,70%	14,20%	0,30%
Учетная ставка НБУ	12,00%	10,25%	7,75%	7,75%	7,50%
Государственный долг к ВВП	20,00%	34,80%	39,90%	36,30%	36,80%
Сальдо гос. бюджета к ВВП	-1,30%	-3,90%	-5,90%	1,80%	-3,81%
Сальдо платежного баланса, млн дол США	-12 763	-1 732	-3 018	-10 245	-4 175
в % к ВВП	-7,00%	-1,50%	-2,20%	-6,20%	-2,37%
Резервы НБУ млн.дол. США	31 543	26 505	34 576	31 795	24 546



