

Фундаментальный анализ: Внешние рынки

Америка

Основные фондовые индексы США закрылись с заметным приростом. Рынок откатывается после падения на прошлой неделе. Сразу после открытия, основные фондовые индексы сделали импульсное движение вверх, отыграв новости, вышедшие за 15 минут до открытия рынка. Напомним, что сегодня были опубликованы данные по промышленному производству и загруженности промышленных мощностей в США за ноябрь, которые оказались лучше ожиданий.

Среди европейских новостей, стоит выделить опубликованное сегодня совместное заявление МВФ и Еврокомиссии, в котором было сообщено, что финансовые институты Испании отвечают всем требованиям, необходимым для сворачивания программы спасения 23 января, в соответствии с предполагаемыми сроками.

Большинство инвесторов зафиксировали часть прибыли на прошлой неделе, и не делают резких движений, ожидая предстоящее заседание Комитета по открытому рынку (FOMC) ФРС. Основным вопросом, который будет рассматриваться на заседании, безусловно, будет вопрос сокращения масштабных покупок активов, которые проводятся в рамках программы количественного смягчения (QE). Решение данного вопроса будет зависеть от того, считают ли члены Комитета текущий экономический рост самодостаточным, чтобы стимулировать улучшение ситуации на рынке труда и справиться с низкой инфляцией.

Европа

Европейские фондовые индексы резко выросли, показав при этом наибольшее увеличение за последние два месяца, чему помогли положительные данные по еврозоне и США. В еврозоне активность частного сектора увеличилась более быстрыми темпами в декабре, и в большей степени, чем ожидалось экономистами, показали данные опроса проведенного Markit Economics. С учетом сезонных колебаний композитный индекс производства, который измеряет производительность труда в обрабатывающей промышленности и секторе услуг, вырос до 52,1 в декабре с 51,7 в ноябре. Экономисты ожидали скромного роста до 51,9.

Азия

В ходе сегодняшних торгов, фондовые индексы Азиатско-Тихоокеанского региона закрылись разнонаправлено. Позитив из США способствовал росту японского рынка. Протоколы Резервного банка Австралии в которых шла речь о готовности дальнейшего стимулирования не добывающего сектора экономики.

Основные макроэкономические данные и события этого дня:

| время | страна | показатель | период | предыдущее значение | прогноз |
|-------|----------------|--|---------|---------------------|---------|
| 11:30 | Великобритания | Индекс розничных цен, м/м | Ноябрь | 0.0% | +0.1% |
| 11:30 | Великобритания | Индекс розничных цен, г/г | Ноябрь | +2.6% | +2.7% |
| 11:30 | Великобритания | Индекс закупочных цен производителей, м/м | Ноябрь | -0.6% | -0.5% |
| 11:30 | Великобритания | Индекс отпускных цен производителей (м/м) | Ноябрь | -0.3% | -1.2% |
| 11:30 | Великобритания | Индекс потребительских цен, м/м | Ноябрь | +0.1% | +0.2% |
| 11:30 | Великобритания | Индекс потребительских цен, базовое значение, г/г | Ноябрь | +1.7% | +1.8% |
| 12:00 | Еврозона | Индекс настроений в деловой среде от института ZEW | Декабрь | 60.2 | 60.9 |
| 12:00 | Еврозона | Индекс потребительских цен, м/м | Ноябрь | -0.1% | -0.1% |
| 12:00 | Еврозона | Индекс потребительских цен, базовое значение, г/г | Ноябрь | +1.0% | +1.0% |
| 12:00 | Германия | Индекс настроений в деловой среде от института ZEW | Декабрь | 54.6 | 55.3 |
| 15:30 | США | Сальдо платежного баланса, млрд III кв | -98.9 | -100.5 | |
| 15:30 | США | Индекс потребительских цен, м/м | Ноябрь | -0.1% | +0.1% |
| 15:30 | США | Индекс потребительских цен, базовое значение, м/м | Ноябрь | +0.1% | +0.1% |
| 17:00 | США | Индекс состояния рынка жилья от NAHB | Декабрь | 54 | 55 |
| 23:30 | США | Изменение объема запасов сырой нефти по данным API, млн баррелей | Декабрь | -7.5 | |

Фондовые индексы

| | | |
|-----------|---------|--------|
| UX | 892,72 | +0,26% |
| Uxagro | 1036,11 | -0,33% |
| FTSE | 6522 | +1,27% |
| CAC | 4120 | +1,49% |
| DAX | 9164 | +1,75% |
| RTS | 1414 | +0,51% |
| MICEX | 1475 | +0,38% |
| S&P | 1787 | +0,66% |
| DJ | 15885 | +0,82% |
| Nikkei | 15279 | +0,82% |
| Hang Seng | 23065 | -0,21% |
| S&P/ASX | 5103 | +0,27% |
| Shanghai | 2151 | -0,46% |

Фьючерсы:

S&P 500



DAX 30



Фьючерсы сырье валюта

| | | |
|---------|---------|--------|
| S&P_fut | 1786,90 | -0,12% |
| BRENT | 109,38 | +0,24% |
| GOLD | 1244,71 | +0,30% |
| EUR/USD | 1,3776 | +0,12% |
| USD/UAH | 8,3010 | -0,11% |
| EUR/UAH | 11,4279 | +0,01% |
| RUB/UAH | 0,2526 | -0,04% |



Открытие фондового рынка Украины

Премаркет

Сегодня открытие навверх 900UX, 905UX-12.13, с последующим ростом на 905UX, 910UX-12.13 сопротивление горизонтальное, где можем остаться проторговывать уровень. После чего можем откатиться вниз на 895UX, 900UX-12.13поддержка. В противном случае пробитие сопротивления позволит подрасти 920-925UX, 920UX-12.13 . Как сообщают , состоятся переговоры Украины с Россией на тему получения кредита в размере 15 млрд долларов. Подписание соответствующего договора может состояться уже завтра, 17 декабря, на встрече президентов двух стран. Европейская сессия открылась в красной зоне, так же и азиатский рынок. Русские торгуются в зеленой зоне. Сегодня выходит ряд новостей, которые могут привести к серьезной волатильности.

Диапазон торговли на сегодня 880-925UX и 870-930 UX-12.13



Техника индекс UX

Сопротивление 3: 972 (минимум 15.03.13)
Сопротивление 2: 948 (минимум 21.03.13)
Сопротивление 1: 900 (максимум 24.10.13)
Цена: 892.72 (0.26%)
Поддержка 1: 872 (закрытие 18.06.13)
Поддержка 2: 854 (закрытие 03.10.13)
Поддержка 3: 836 (минимум 14.10.13)

После вчерашней экспирации индекс фактически не изменил своего положения. Сегодня открытие навверх 900 с последующим ростом на 905, горизонтальное сопротивление. Пробитие данного уровня после недолгой проторговки двинет индекс на 924 следующее горизонтальное сопротивление. В противном случае откатываемся от сопротивления на 900.

Компоненты индекса UX

| | | |
|-------|--------|--------|
| ALMK | 0,04 | 0,25% |
| AVDK | 3,092 | 2,88% |
| AZST | 0,716 | 4,07% |
| BAVL | 0,1167 | 0,6% |
| CEEN | 4,719 | -3,04% |
| DOEN | 27,34 | -0,02% |
| ENMZ | 33,14 | 1,41% |
| MSICH | 1586 | -1,61% |
| UNAF | 104,8 | -2,36% |
| USCB | 0,1872 | 9,47% |

Лидеры роста объемов P3 грн.

| | | |
|--------|--------|--------|
| MSICH | 9830 | 37,65% |
| BAGRO1 | 3625 | 13,18% |
| UNAF | 1312 | 5,03% |
| CRIM01 | 1169,8 | 4,48% |
| SLAV | 1135 | 4,35% |

Лидеры роста P3

| | | |
|------|--------|-------|
| USCB | 0,1872 | 9,47% |
| AZST | 0,716 | 4,07% |
| YASK | 0,529 | 1,73% |
| AVDK | 3,055 | 1,65% |
| KUBI | 29,22 | 0,79% |

Лидеры падения P3

| | | |
|-------|--------|---------|
| KION | 0,79 | -16,84% |
| DNEN | 246,1 | -15,14% |
| ZHEN | 0,9 | -7,12% |
| LUAZ | 0,0265 | -5,02% |
| SHCHZ | 0,47 | -4,08% |

Зарезервированные ден. средства тыс. грн.

| | | |
|------------|--------|---------|
| 03.10.2013 | 33 993 | -2,82% |
| 17.10.2013 | 21 702 | -36,16% |
| 24.10.2013 | 18 245 | -15,93% |
| 31.10.2013 | 23 622 | 29,47% |
| 07.11.2013 | 31666 | 34,2% |
| 14.11.2013 | 34746 | 9,75% |
| 21.11.2013 | 22711 | -34,63% |
| 28.11.2013 | 27938 | 23,02% |
| 05.12.2013 | 29852 | 6,85% |
| 12.12.2013 | 16008 | 46,4% |



Торговые рекомендации

Технические уровни и ожидания

| Инструмент | Направление | Комментарии |
|------------|-------------|---|
| ALMK | Вниз | 0,0525 идем дальше на 0,0516и 0,051. |
| | Вверх | 0,0547, следующая цель 0,0554 и 0,0567 |
| AVDK | Вниз | Пробитие 952, следующим уровнем 923 и 900. |
| | Вверх | Проходя 990 дальше идем 1011 и 1022. |
| AZST | Вниз | 0,0525 идем дальше на 0,0516и 0,051. |
| | Вверх | 0,0547, следующая цель 0,0554 и 0,0567 |
| BAVL | Вниз | 0,0855пробивая, идем к 0,0835 и 0,0817. |
| | Вверх | Прохождение 0,0888 дальше идем 0,0895 и 0,0905. |
| CEEN | Вниз | Пробитие 6,22 идем на 6,1 и 5,98 |
| | Вверх | При прохождении 6,42 следующая 6,61 и 6,77. |
| DOEN | Вниз | 0,1284 проходим, идем 0,1267 и 0,1247. |
| | Вверх | 0,1360 пробивая, идем на 0,1390 и 0,1415. |
| ENMZ | Вниз | 0,1284 проходим, идем 0,1267 и 0,1247. |
| | Вверх | 0,1360 пробивая, идем на 0,1390 и 0,1415. |
| MSICH | Вниз | 2080, следующий уровень2042 и 1980. |
| | Вверх | Пробивая 2195, следующий уровень 2242 и 2241. |
| UNAF | Вниз | |
| | Вверх | |
| USCB | Вниз | |
| | Вверх | |

Торговые идеи



Корпоративные новости эмитентов**Информация об эмитенте**Тиккер: **MSICH**Влияние новости: **Позитивное**Рекомендация: **Покупать**

Кабинет министров Украины одобрил проект соглашения между правительством Украины и правительством Российской Федерации о реализации и мерах государственной поддержки восстановления серийного производства самолетов семейства Ан-124 с двигателями Д-18Т. Об этом говорится в распоряжении правительства № 973-р от 11 декабря 2013 г. (ugmk.info)

Информация об эмитентеТиккер: **HRTR**Влияние новости: **Позитивное**Рекомендация: **Покупать****Новость**

Харьковский трубный завод (ХТЗ) изготовил более 1 млн. тонн труб большого диаметра для строительства магистрального газопровода "Средняя Азия — Китай". Этот объем был отгружен для участков "Узбекистан — Китай", "Казахстан — Китай" и газопровода "Бейнеу — Бозой — Шымкент", сообщается в пресс-релизе, опубликованном на сайте группы "Метинвест" (контролирует ХТЗ) в понедельник, 16 декабря. Харьцызские трубы также будут использованы при строительстве ветки С магистрального газопровода "Средняя Азия — Китай". Данная ветка пролегает по территории Узбекистана, Казахстана и Туркмении и предназначена для увеличения транзита среднеазиатского газа в Китай. Общая ее протяженность составляет 1840 км. Проектная мощность ветки С составит 25 млрд куб.м газа в год. Ее запуск намечен на 2014 год. Как указывается в сообщении, для этого проекта ХТЗ поставил одношовные трубы диаметром 1219 мм из стали повышенной категории прочности Х80. (Дело)

Макроэкономические новости**Украина вступит в 2014 год без госбюджета**

В правительстве пообещали до конца недели передать в парламент проект госбюджета на 2014 год. Однако до конца года главный финансовый документ страны не будет принят — его утвердят лишь в январе-феврале. В условиях отсутствия госбюджета ежемесячные расходы казны будут ограничены. В Партии регионов ничего критического в этом не видят, ведь если удастся договориться о скидке на газ, государственные финансы от этого только выиграют. В оппозиции уверены, что затягивание процесса принятия бюджета чревато накоплением социальных долгов. (kommersant.ua)



Календарь собрания акционеров

| Дата | Время | Тикер | Название, рус | Важные вопросы на голосовании |
|------|-------|-------|---------------|-------------------------------|
| - | - | - | - | - |

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 | 0,0413 | -3 166 361 000 | - | -0,34 | -17,30% | -0,1228 |
| AVDK | 3,24 | -1 109 583 000 | - | -0,57 | -11,76% | -5,7094 |
| AZST | 0,696 | -2 695 424 000 | - | -1,08 | -10,14% | -0,6418 |
| BAVL | 0,1128 | 33 846 000 | 1,10% | 99,88 | 0,07% | 0,0011 |
| CEEN | 5,13 | 233 766 000 | 11,20% | 8,11 | 5,19% | 0,6328 |
| DOEN | 25,94 | 30 975 000 | 4,71% | 19,80 | 1,06% | 1,3100 |
| ENMZ | 34,31 | 69 431 000 | 10,55% | 5,21 | 2,37% | 6,5807 |
| MSICH | 1614 | 1 998 720 000 | 24,48% | 1,65 | 16,43% | 978,5406 |
| UNAF* | 110,5 | 2 616 000 000 | - | 2,29 | - | 48,2403 |
| USCB | 0,1929 | 1873000 | 0,10% | 1868,25 | 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 |



