

ММВБ:

Текущая цена: 2 319,38
 Поддержка: 2 100 и 2 190
 Сопротивление: 2 327,15
 Тренд: Растущий
 Рекомендация: ШОРТ
 Цель: 2 100

В нашем фокусе кривая спреда, которая в данный момент пытается выйти из-под влияния линии тренда (см. рис. 1).

Рис.1



Учитывая, что котировки индекса ММВБ в данный момент находятся достаточно близко к своему максимуму, а спред вместе с ценами на нефть находится в шаге от новой тенденции, текущие уровни можно задействовать для спекулятивной игры на понижение... Стоп – выше 2327,15/2380(?)



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

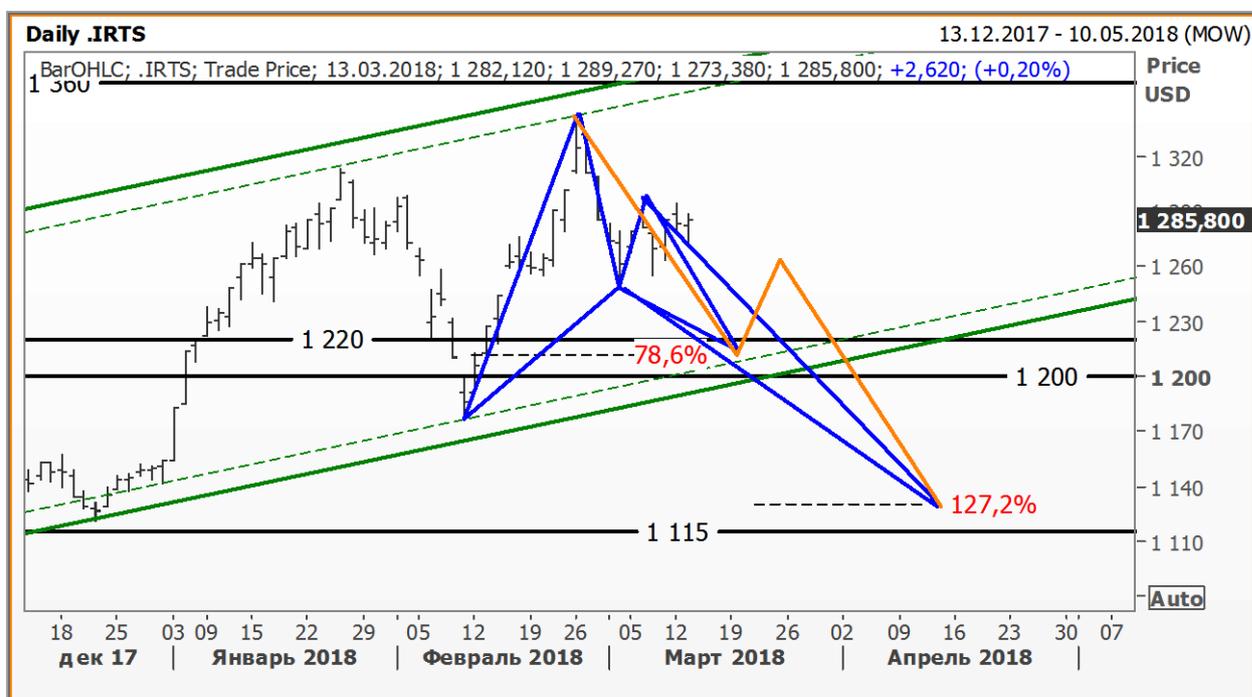
Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

РТС:

Текущая цена: 1 285,80
Поддержка: 1 200 и 1 220
Сопротивление: 1 360
Тренд: Растущий
Рекомендация: ШОРТ
Цель: 1 125

Консолидация на уровне 1300 пунктов, на наш взгляд, формирует у спекулянтов иллюзию готовности индекса РТС к дальнейшему движению вверх. Данное мнение основывается на опционных уровнях, которые, судя по открытому интересу, сосредоточены на ближайшие два месяца в районе 1 300 пунктов.



Источник: Московская биржа



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

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

www.alfadirect.ru

Лукойл:

Текущая цена: 3 773
Поддержка: 3 488 и 3 580,80
Сопротивление: 3 950
Тренд: Формируется
Рекомендация: БЕЗ ПОЗИЦИИ
Цель: ---

Находящиеся внутри «треугольника» акции Лукойла по-прежнему сохраняют предпосылки для дальнейшего движения вверх, которое может оказаться неустойчивым из-за того, что выход из данной модели приходится на последнюю четверть фигуры.

Тем, кто решится на открытие длинной позиции, мы предлагаем защитный стоп-приказ разместить на уровне 3 635 руб. Цель - 4 150 руб.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

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

www.alfadirect.ru

Магнит:

| | |
|----------------|-------------|
| Текущая цена: | 5 050 |
| Поддержка: | 4 695 |
| Сопротивление: | 6 180 |
| Тренд: | Формируется |
| Рекомендация: | БЕЗ ПОЗИЦИИ |
| Цель: | --- |

Несмотря на то, что мы ожидаем увидеть коррекцию на российском рынке акций, спекулянтам, на наш взгляд, не стоит игнорировать акции, на графиках которых формируются комфортные и понятные конструкции роста. К их числу мы относим акции Магнита, по которым мы на днях закрыли «лонг» из-за кривого спреда (см. обзор вчерашнего дня).

На рисунке ниже представлен дневной график, где, на наш взгляд, образовался «треугольник», выход из которого вверх, скорее всего, привлечет внимание спекулятивного капитала.

Тем, кто решит воспользоваться текущей ситуацией, мы предлагаем длинную позицию открывать выше 5 200 руб; стоп – ниже 4 945 руб.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

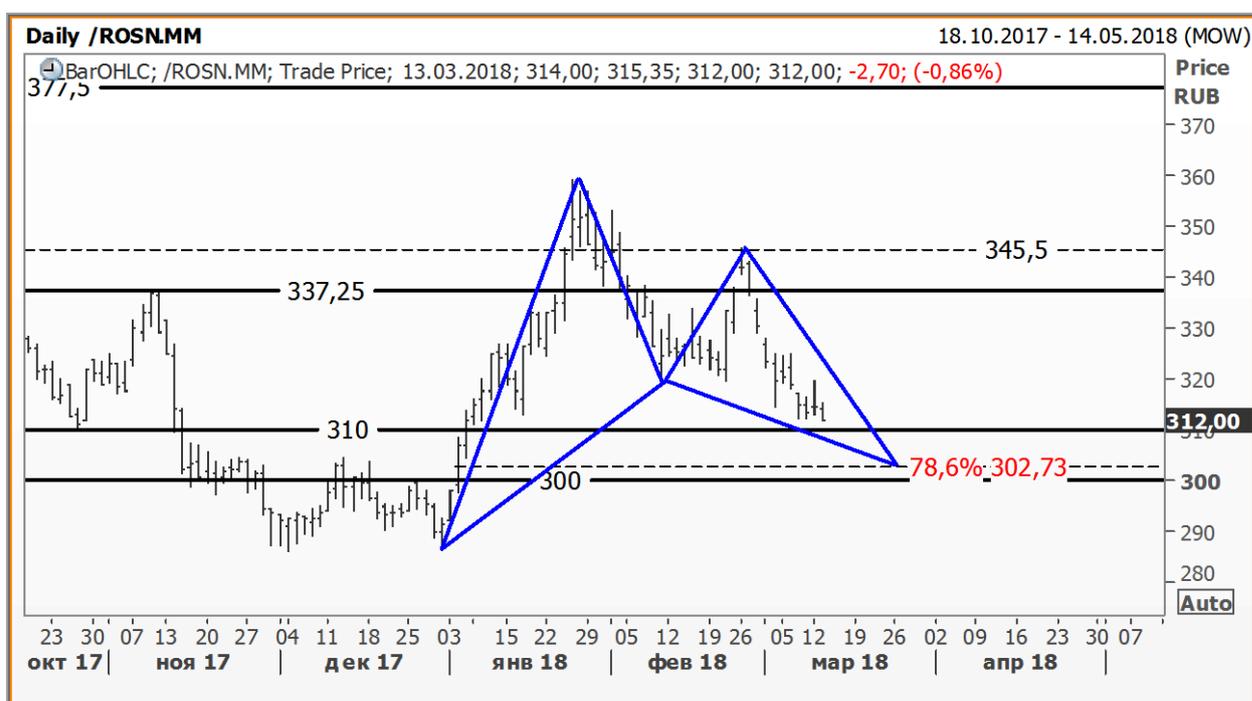
Казиев Алан. Ведущий аналитик. Москва +7 (495) 974-2515 доб 8568

www.alfadirect.ru

Роснефть:

| | |
|----------------|-----------|
| Текущая цена: | 312 |
| Поддержка: | 300 и 310 |
| Сопrotивление: | 337,25 |
| Тренд: | Падающий |
| Рекомендация: | ШОРТ |
| Цель: | 303 |

Сегодня, вместо паттерна «1-2-3», мы нанесли модель «Гартли», согласно которой потенциальная зона разворота находится в районе 303 руб. А это значит, что до фиксации 11%-ов прибыли осталось 9 руб и/или около 2,9%-ов.



Источник: Reuters



Альфа-Банк

РОССИЙСКИЙ РЫНОК АКЦИЙ

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

www.alfadirect.ru

НЛМК:

| | |
|----------------|-----------------|
| Текущая цена: | 150,99 |
| Поддержка: | 124,75 и 139,15 |
| Сопrotивление: | 157,45 |
| Тренд: | Растущий |
| Рекомендация: | ШОРТ |
| Цель: | 105 |

Если 7 марта можно было зафиксировать чуть больше 2%-х прибыли, то сегодня короткую позицию можно закрыть лишь с убытком (1,8%).

На рисунке ниже выделена одна из гармонических моделей, которая и вдохновила нас на открытие короткой позиции. Если анализировать текущие пропорции данной модели, то на истории, как правило, правая часть данной модели достигала 178,6% уровня Фибоначчи.

Что касается рисков, то защитный стоп-приказ мы предлагаем разместить выше 157,45 руб за акцию.



Источник: Reuters

РусГидро:

| | |
|----------------|---------------|
| Текущая цена: | 0,7664 |
| Поддержка: | 0,71 и 0,7515 |
| Сопротивление: | 0,80 и 0,8425 |
| Тренд: | Формируется |
| Рекомендация: | ШОРТ |
| Цель: | 0,64 |

Риски короткой позиции мы предлагаем сократить до 3%-х, разместив защитный стоп-приказ на уровне 0,81 руб.

Еще раз напомним, что с конца прошлого года мы сделали ставку на реализацию паттерна «ABCD», в конструкцию которого вошла фигура «голова – плечи».

С момента открытия (01.03.2018 года) короткая позиция принесла 2% прибыли. Цель – 0,64 руб.



Источник: Reuters

A

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 | Формируется | Без позиции | --- |
| Магнит | 4 695 | 6 180 и 6 645 | Формируется | Без позиции | --- |
| Роснефть | 300 и 310 | 337,25 и 345,50 | Падающий | Держать «шорт» Цель 303 руб | Выше 345,50 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 0,81 руб |
| Сбербанк АО | 243,95 и 270,35 | --- | Растущий | Держать «шорт» Цель 245 руб | Выше 277,55 руб |
| Сбербанк АП | 208,10 и 221,30 | 231,70 | Растущий | Без позиции | --- |
| СевСталь | 860 | 925 и 995 | Формируется | Без позиции | --- |
| Сурнефтегаз АО | 26 и 27 | 31 | Формируется | Держать «шорт» Цель 26,25 руб | Выше 29,60 руб |
| Аэрофлот | 137 и 152 | 168,60 | Формируется | Без позиции | --- |
| ВТБ | 0,047 и 0,0518 | 0,059 | Формируется | Без позиции | --- |
| 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 |

Контактная информация

Альфа-Банк (Москва)

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

Аналитический отдел

Телефон/Факс

(7 495) 795-3676

Руководитель аналитического подразделения,

Борис Красноженов

Металлы и горная добыча

Борис Красноженов, Юлия Толстых

Макроэкономика

Наталья Орлова, Ph.D, Валерия Волгарева

Потребительский сектор, Интернет

Александра Мельникова, Евгений Кипнис

Аналитическая поддержка российских клиентов

Гельды Союнов, Алан Казиев

Перевод

Анна Мартынова

Редактор

Джон Волш

Техническая поддержка

Денис Дорофеев

Торговые операции и продажи

Телефон

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

Продажи российским и иностранным клиентам

Константин Шапшаров, Александр Зоров

Группа продаж Альфа-Директ

(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 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.