



УБЕЖДЕННЫЙ ТЕХНАРЬ

Обзор рынка акций Сбербанка, Газпрома, ГМК НорНикель и Магнита за 16 февраля 2018 года

Рекомендации

Сбербанк. Разрыв вверх, и мы открыли короткую позицию по второму варианту (продали 10 000 акций по 267.22 рубля). День закрылся черной свечей, и позиция перенесена на сегодня. При этом котировки уверенно превышают скользящую среднюю ЕМА-55, которая направлена вверх, а недельная свеча почти наверняка выйдет белой. Таким образом, угрозы долгосрочному тренду пока по-прежнему нет, и коррекция в район уровня прохождения скользящей средней ЕМА-55 может произойти несколько позже. С другой стороны, российские акции относительно Нефти Брент уже заметно переоценены (примерно на 6.3%) Так, «расчетное» значение ($PTC=18.5 \cdot \text{Брент}$) составляет $65,00 \cdot 18,5=1194.2$ пункта, а биржевое значение находится около 1269.1 пункта. В такой ситуации постараемся закрыть «шорт» на уровне разрыва, то есть, в районе 263.4 рубля.

Газпром. Черная свеча опустила котировки ниже скользящей средней ЕМА-55, но борьба за этот уровень продолжается. При этом линия пятимесячного восходящего тренда устояла. В такой ситуации шансы на сохранение восходящего тренда остаются вполне приличными.

ГМК НорНикель. Рост, но крестообразной свечей. Как результат, котировки пытаются закрепиться чуть выше верхней границе восходящего треугольника. Пробой данного уровня сулит дальнейшее движение на ширину треугольника, то есть, в район 13 000 рублей. Однако стоит помнить, что треугольники почти всегда предвещают смену тренда. В такой ситуации окончания волны «5» вряд ли придется ждать долго.

Магнит. Умеренный рост, и цены на акции остались несколько выше уровня поддержки в районе 4 600 рублей. В такой ситуации, учитывая силу предыдущего падения, не стоит рассчитывать на быстрое окончание тренда.

1. Рынок торгуется **повышением** цен ко вчерашнему закрытию (выше $264.6/137.1/(11785)<4850>$), в начале торгов $264.6-271.0/137.1-142.1/(11785-12045)<4850-4950>$ (вероятно):

- удерживать длинные позиции;
- не открывать новые позиции;
- короткие позиции можно закрыть в любое время, а можно расположить **Стоп-лосс** около $266.8/139.8/<4980>$.

2. Рынок открывается с **разрыва вверх** (выше $268.8/141.1/(11976)<4911>$) и торгуется выше $271.0/142.1/(12045)<4950>$ (маловероятно):

3. Рынок торгуется **понижением** цен ко вчерашнему закрытию (ниже $264.5/137.0/(11785)<4850>$), в начале торгов $264.5-261.7/137.0-136.1/(11785-11690)<4850-4790>$ (возможно):

- длинные позиции можно закрыть в любое время, а можно расположить **Стоп-лосс** около $256.2/137.2/(11370)$;
- не открывать новые позиции;
- удерживать короткие позиции (**Сбербанк** можно закрыть в диапазоне $263.2-263.6$).

4. Рынок открывается с **разрыва вниз** (ниже $263.9/137.0/(11756)<4826>$) и торгуется ниже $261.7/136.1/(11690)<4790>$ (маловероятно):

5. **Газпром/Сбербанк:** соотношение составляет **0.518**, что является новым историческим минимумом. В такой ситуации падающий тренд может продолжаться и далее.

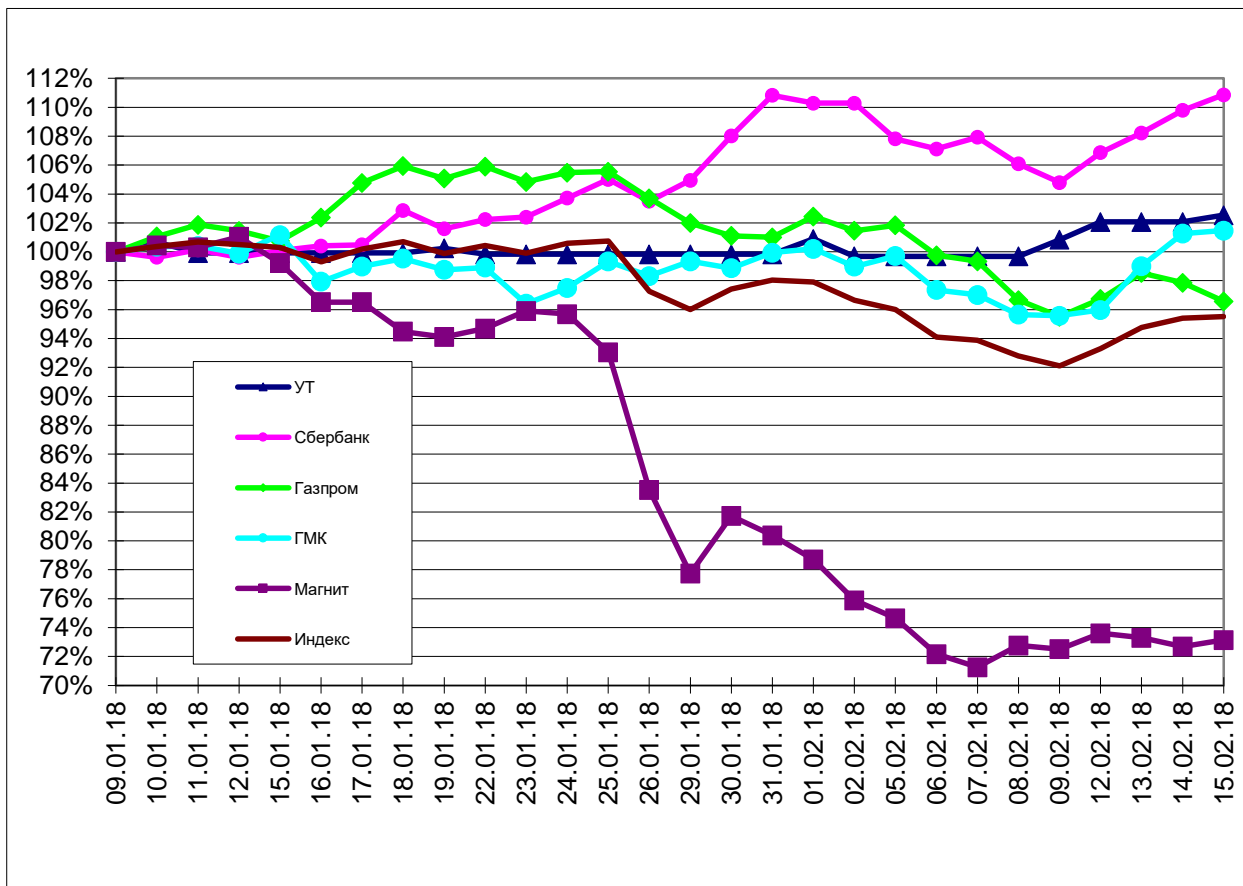


УНИВЕР
капитал

16 февраля 2018 г.

ТЕХНИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ

График изменения стоимости акций Газпрома, Сбербанка, ГМК Норникель, Магнита и «Портфеля УТ»*



* Акции для сравнения с Портфелем УТ в прошлом цикле считаются купленными по средневзвешенным ценам 10.01.2018 г.

График акций Сбербанка



TECH ANALYSIS



График акций Газпрома



График акций ГМК НорНикель

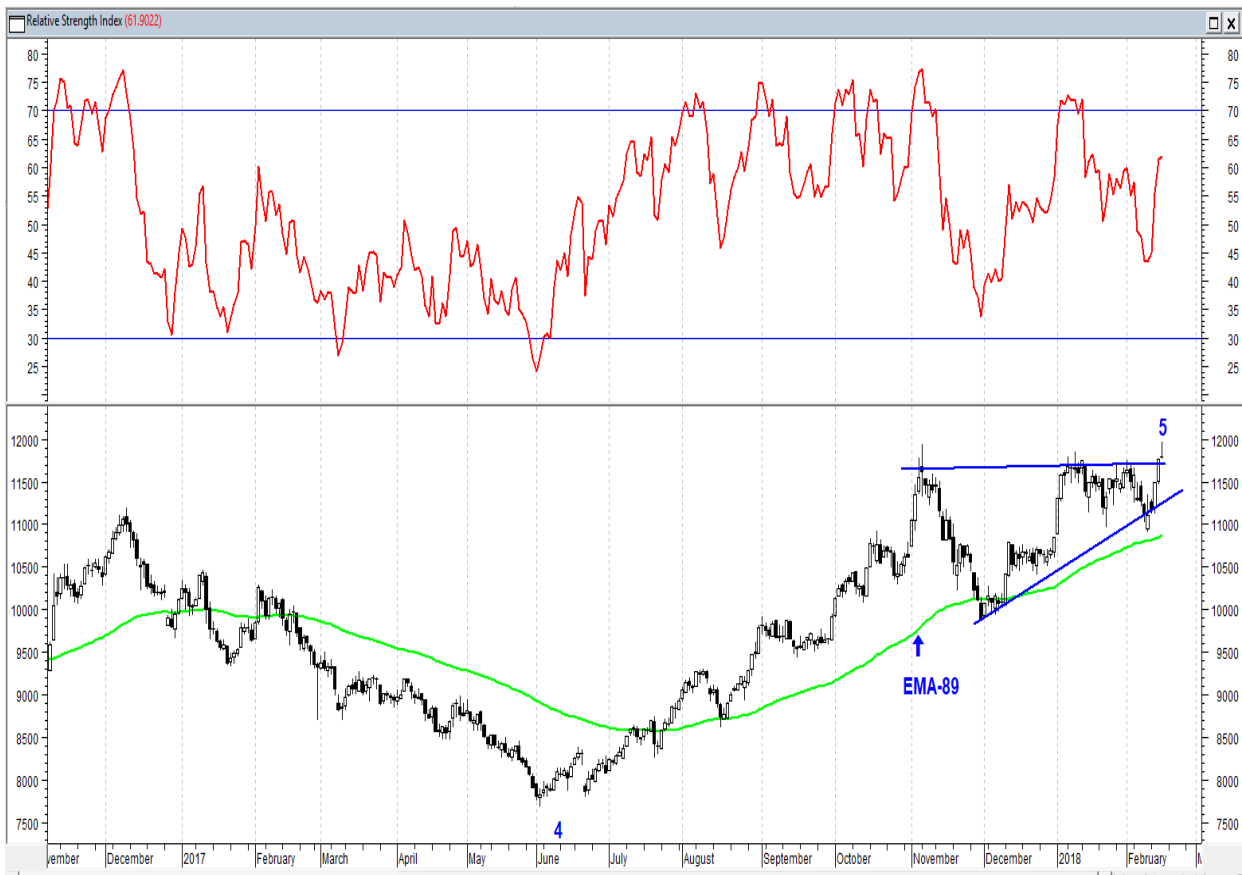
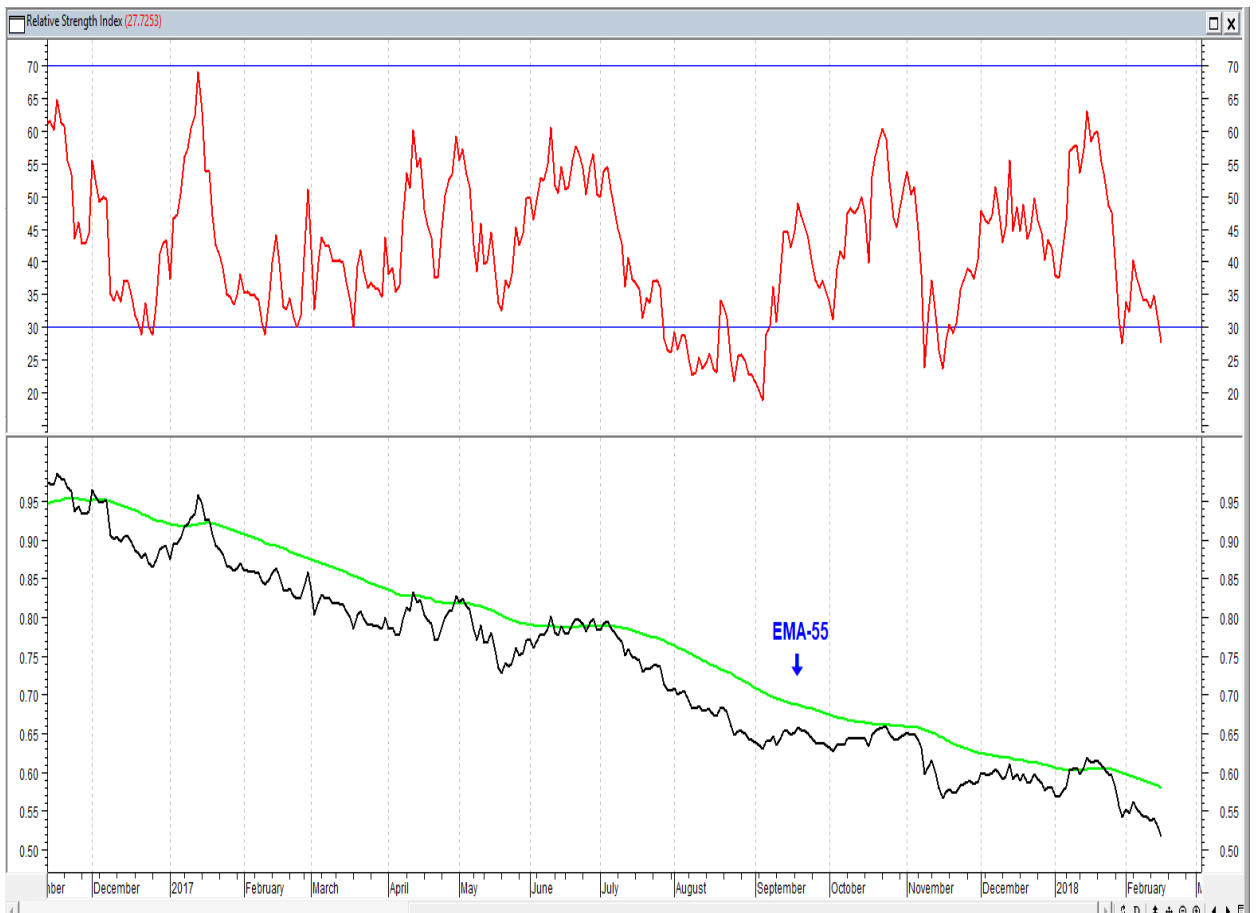




График соотношения Газпром/Сбербанк



TECH ANALYSIS



ОПИСАНИЕ РУБРИКИ

Рубрика "Убежденный технарь" представляет собой ежедневные рекомендации по работе с акциями Сбербанка, Газпрома, ГМК НорНикель и Магнита являющимися на текущий момент одними из самых ликвидных в фондовой секции ММВБ. Данные рекомендации представляют одну из возможных стратегий поведения на фондовом рынке, которую предлагает и использует ведущий рубрики Тарасов Роман. Рекомендации составляются ежедневно до 10.30 по московскому времени. Данная методика является информативной и не может служить указанием к непосредственному совершению сделок с акциями. ООО «УНИВЕР Капитал» не несет ответственности за убытки, которые могут быть получены в результате следования методике «Убежденный технарь».

Для наглядности результатов инвестирования по рекомендациям "Убежденного технаря" предоставляется график изменения стоимости «Портфеля УТ», управление которым осуществляется на основании данной методики.

Начало управления – 10 января 2018 года.

Первоначальный объем – 5 000 000 рублей.

Комиссия по операциям составляет 0.118%

Теперь Вы ежедневно можете видеть, как работает методика "Убежденный технарь", а также текущее состояние «Портфеля УТ».

В случае Вашей заинтересованности в сотрудничестве на фондовом рынке ООО «УНИВЕР Капитал» и получении персональных рекомендаций от профессиональных портфельных управляющих просим Вас обращаться в Департамент брокерского обслуживания или в региональное представительство ООО «УНИВЕР Капитал» в Вашем городе.

Если Вы не хотите получать рассылку аналитических материалов, то просьба сообщить об этом по e-mail: msapatova@univer.ru.



УНИВЕР
капитал

16 февраля 2018 г.

ТЕХНИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ

ООО «УНИВЕР Капитал»

- ✓ Собственный капитал превышает 700 млн RUB;
- ✓ Входит в ТОП-10 операторов Московской Биржи;
- ✓ Торговый оборот на Московской Бирже по итогам 2016г. – более 2,0 трлн. RUB;
- ✓ Участник торгов Московской Биржи, Санкт-Петербургской биржи, Национальной Товарной Биржи, Казахстанской биржи KASE.

Рейтинги

Аудитор



Crowe Horwath



Центральный Офис

123317, г. Москва. Пресненская набережная, дом 8, строение 1, ("Башня Москва" Город Столиц комплекса "Москва-Сити"), 4 этаж

Телефон: (495) 644-11-22 (многоканальный)

Эл. почта: info@univer.ru

Сайт www.univer.ru

Контакты

Президент

Иванов Алексей Алексеевич
тел.: (495) 644-11-22 доб. 2277
e-mail: aivanov@univer.ru

Заместитель Генерального

директора по инвестициям
Александров Дмитрий, к.х.н.
тел.: (495) 644-11-22 доб. 3336
e-mail: daleksandrov@univer.ru

Со-Директор Департамента

брокерского обслуживания
Тарасов Роман
тел.: (495) 644-11-22 доб. 4401
e-mail: rtarasov@univer.ru

Заместитель начальника

Управления продаж
Артем Ключкин
тел.: (495) 644-11-22 доб. 2272
e-mail: aklukin@univer.ru

Лицензии

Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности № 045-12601-100000 от 09 октября 2009 года, выдана Федеральной службой по финансовым рынкам, срок действия – без ограничения срока действия.

Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности № 045-12604-010000 от 09 октября 2009 года, выдана Федеральной службой по финансовым рынкам, срок действия – без ограничения срока действия.

Лицензия на осуществление депозитарной деятельности № 045-12895-000100 от 02.02.2010 г., выдана Федеральной службой по финансовым рынкам, срок действия - бессрочная.

Заявление об ограничении ответственности

Настоящее аналитическое исследование подготовлено ООО «УНИВЕР Капитал» на основе информации, полученной из официальных общедоступных источников, в надежности и достоверности которых нет оснований сомневаться. Специальных исследований, направленных на выявление фактов неполноты и недостоверности указанной информации, не проводилось. Аналитические выводы и заключения, представленные в настоящем документе, являются мнением специалистов ООО «УНИВЕР Капитал». Никакая информация и никакое мнение, выраженное в данном документе, не являются рекомендацией по покупке или продаже ценных бумаг, иных финансовых инструментов, опционов, фьючерсов или ценных бумаг, производных от этих активов (деривативов), не является офертой или предложением делать оферту или осуществлять иные вложения капитала. Данное аналитическое исследование не предоставляет гарантий или обещаний будущей эффективности (доходности) деятельности на рынке ценных бумаг. За достоверность информации, лежащей в основе настоящего документа, и за последствия решений, принятых Вами на основе настоящего документа, ООО «УНИВЕР Капитал» ответственности не несет. Необходимо принимать во внимание, что доход от инвестирования в определенные ценные бумаги или иные финансовые инструменты, если таковой имеет место, может варьироваться, а стоимость этих ценных бумаг и иных финансовых инструментов может повышаться или понижаться. Колебание курсов иностранных валют может оказать неблагоприятное влияние на курс, стоимость и доходность определенной ценной бумаги и иного финансового инструмента, упомянутых в настоящем документе. Никакая информация, касающаяся налогообложения, изложенная в настоящем документе, не является консультированием по вопросам налогообложения. Наша Компания настоятельно рекомендует инвесторам обращаться за консультациями к независимым специалистам в области налогообложения, которыми будут учитываться особые обстоятельства каждой конкретной ситуации. ООО «УНИВЕР Капитал» проводит строгую внутреннюю политику, направленную на предотвращение каких-либо действительных или потенциальных конфликтов интересов компании и инвесторов, а также предотвращение ущемления интересов инвесторов. Для получения дополнительной информации о ценных бумагах, упомянутых в настоящем исследовании, необходимо обратиться в ООО «УНИВЕР Капитал». Воспроизводить, копировать, цитировать, а также делать выдержки из настоящего документа без предварительного письменного согласия ООО «УНИВЕР Капитал» запрещено.