ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

18 ноября 2010г.

Комментарий по рынку акций

В среду американский рынок акций сумел остановить снижение и завершил торги вблизи уровней закрытия предыдущего дня. Ключевая статистика дня показала сокращение числа закладок новых домов в США на 11,7% г/г (519 тыс.) – минимальный уровень за полтора года. Давление на акции банков в основном шло со стороны ФРС: банковский регулятор намерен потребовать от 19-ти крупнейших американских банков пройти ещё одну проверку достаточности капитала, плюс к этому Федрезерв опубликовал новыми требованиями к банкам, которые планируют увеличить дивиденды или расширить программу выкупа акций. Но даже на этом фоне индекс финансового сектора

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 569,97	0,12%	-4,10%	-0,83%	6,60%
Индекс ММВБ	1 533,92	0,48%	-2,59%	2,22%	13,32%
FTSE	5 692,56	0,19%	-2,14%	-0,87%	6,48%
S&P 500	1 178,59	0,02%	-3,29%	-0,52%	6,15%
Dow Jones Avg.	11 007,88	-0,14%	-3,07%	-1,22%	5,47%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскнефтехим, п.	0,3500	13,45%	16,67%	133,33%
Нижнекамскшина	0,8800	10,00%	-7,37%	-26,67%
Магаданэнерго	0,0950	9,20%	30,14%	90,00%
Казаньоргсинтез	0,2450	8,89%	36,11%	38,03%
Сбербанк	3,1100	1,80%	0,32%	10,72%
ОАО Синергия	36,0500	1,26%	0,00%	38,65%
Дикси	12,7500	0,79%	7,14%	66,67%
ОАО Компания М.видео	7,3200	0,27%	3,83%	84,38%

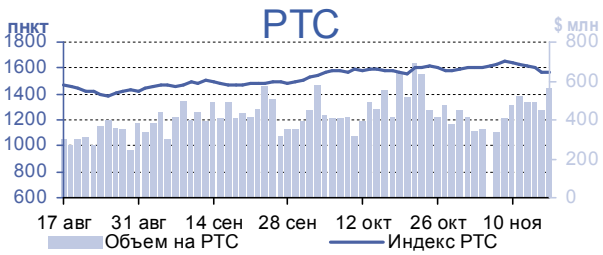
Лидеры снижения

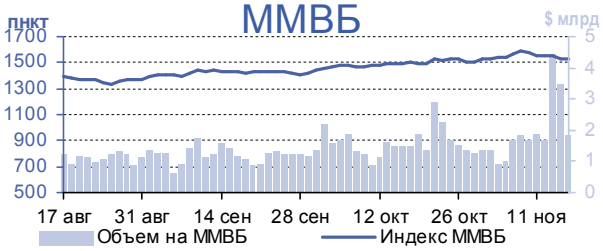
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Лукойл	54,5500	-5,13%	-5,30%	-2,94%
Аэрофлот	2,3900	-4,78%	3,91%	39,77%
Северсталь	13,9329	-3,91%	-10,17%	65,08%
Сургутнефтегаз, п.	0,4610	-3,46%	-9,61%	-4,06%

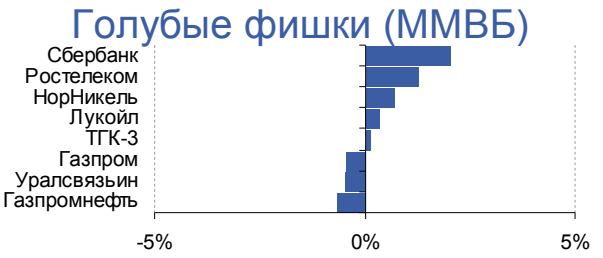
Индекс MSCI

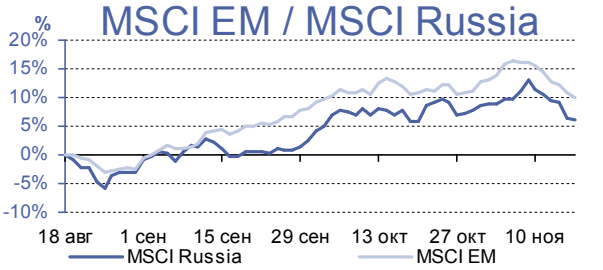
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1093,82	-0,61%	-1,67%	11,57%
Индекс MSCI BRAZIL	3608,28	0,67%	-6,30%	-1,28%
Индекс MSCI RUSSIA	826,58	-0,28%	-1,59%	-0,64%
Индекс MSCI INDIA	541,70	0,00%	-4,02%	18,22%
Индекс MSCI CHINA	66,85	-2,39%	-3,95%	-0,50%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В среду американский рынок акций сумел остановить снижение и завершил торги вблизи уровней закрытия предыдущего дня. Ключевая статистика дня показала сокращение числа закладок новых домов в США на 11,7% г/г (519 тыс.) – минимальный уровень за полтора года. Давление на акции банков в основном шло со стороны ФРС: банковский регулятор намерен потребовать от 19-ти крупнейших американских банков пройти ещё одну проверку достаточности капитала, плюс к этому Федрезерв опубликовал новыми требованиями к банкам, которые планируют увеличить дивиденды или расширить программу выкупа акций. Но даже на этом фоне индекс финансового сектора в индексе S&P-500 опустился лишь на 0,6%. Незакрытые гэпы сверху в купе с ажиотажем вокруг первичного размещения акций General Motors дают надежу на еще одну волну роста американского рынка акций в ближайшее время.

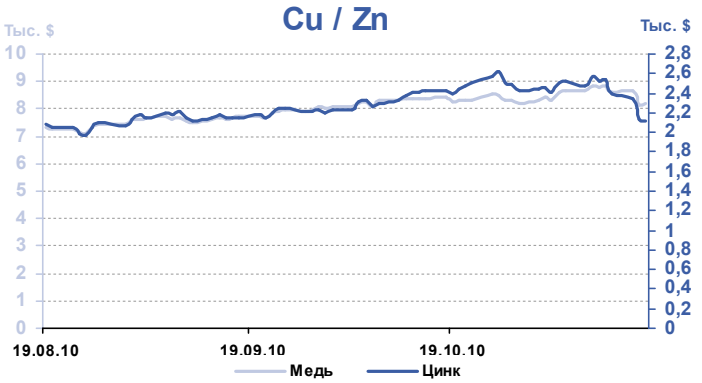
После закрытия NYSE GM сообщил, что в процессе IPO он увеличил предложение акций на 30%, реализовав их по цене $33 - верхняя граница ценового диапазона. Также после торгов производитель полупроводников Applied Materials сообщил о росте квартальной прибыли до $0,35/акция (прогноз: $0,31/акция.) при росте выручки на 89% ($2,89 млрд.). На этом фоне сегодня утром фьючерс S&P растет на 0,83%.

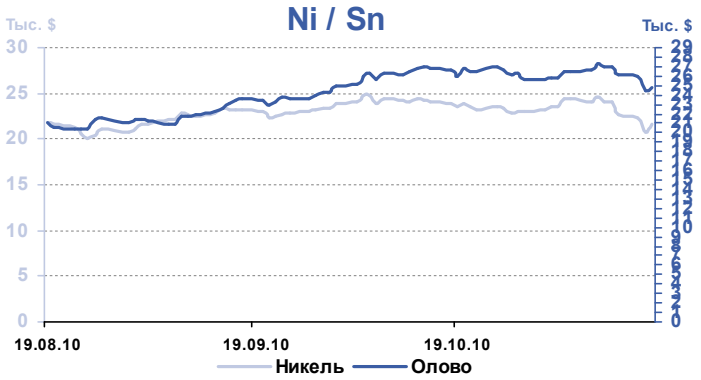
Курс евро сегодня укрепляется против американского доллара (EUR/USD 1,36). Участники валютного рынка ожидают заключения соглашения о рекапитализации ирландских банков в ходе сегодняшних переговоров правительства Ирландии с Евросоюзом, МВФ и ЕЦБ по стабилизации ситуации в банковском секторе. Все азиатские биржевые индикаторы сегодня торгуются в зеленой зоне: MSCI Asia +1,3%. Некий оптимизм сегодня отмечается в ценах на сырьевые товары, которые пытаются расти вслед за фондовыми рынками: Brent $84,3/барр, +1,2%; медь +1,18%; никель +1,15%, золото +1,2%, серебро +2,8%.

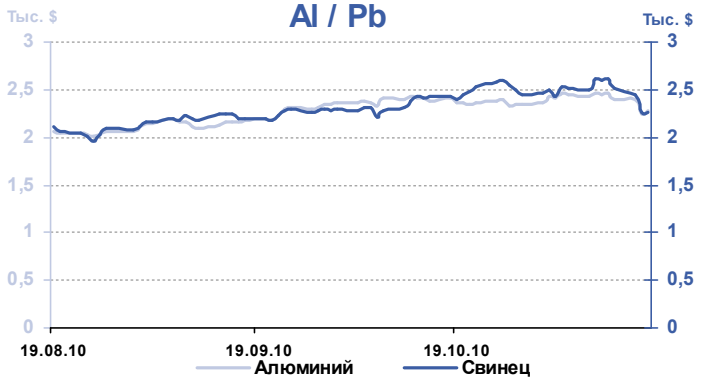
Открытие торгов на российском рынке акций мы ожидаем увидеть с небольшим гэпом вверх. Лучшие позиции на открытии могут быть в бумагах металлургических компаний и банков. С учетом того, что весь позитив уже в рынке, днем мы, вероятно, увидим плавное сползание наших индексов к уровням закрытия предыдущей сессии. Вчера индекс ММВБ два раза протестировал поддержку на уровне 1515 пунктов, сегодня вверху его движение будет ограничено верхней границей краткосрочного нисходящего тренда проходящей на 1542 пункта, пробой которой будет означать продолжения движение вверх с целью на 1560 п. Во втором эшелоне российских акций мы продолжаем сохранять позиции в бумагах электроэнергетики, химическом и потребительском секторе.

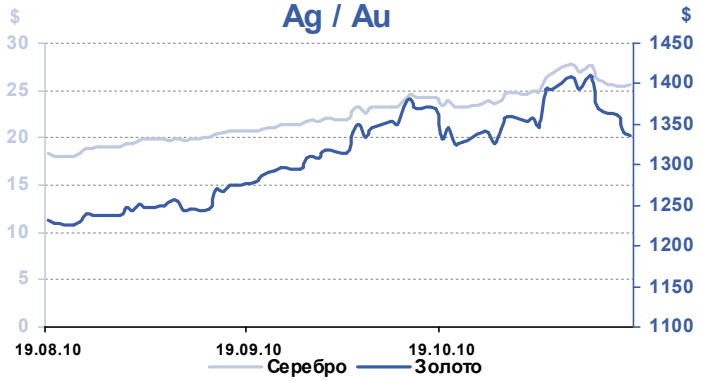
Сегодня в 12-30 ждем данных из Великобритании по объемам розничных продаж. В 16-30 следим за выступлением главы ЕЦБ Ж.К. Трише. В это же время в США будет опубликован еженедельный отчёт по числу обращений за пособиями по безработице (прогноз: +7 тыс.). В 18-00 ФРБ Филадельфии опубликует данные по индексу деловой активности в производственном секторе региона (прогноз: 5,1 пункт). В это же время компания Conference Board выдаст данные по индексу опережающих экономических индикаторов США за октябрь (прогноз: +0,5%).

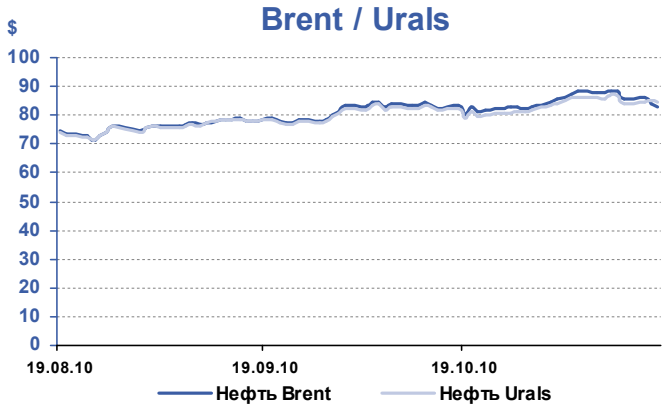
Commodities

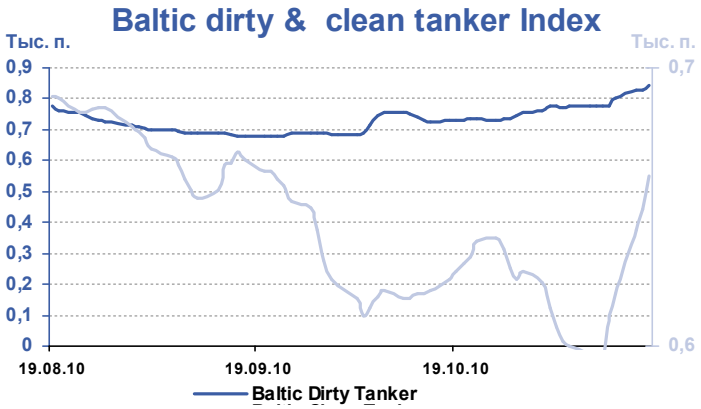












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 190,00	0,49%	-6,51%	-3,00%	19,98%
Цинк, $/t	2 113,00	-1,22%	-16,32%	-12,87%	-6,63%
Никель, $/t	21 550,00	3,51%	-10,78%	-9,49%	27,51%
Олово, $/t	24 750,00	0,92%	-8,16%	-7,13%	65,55%
Алюминий, $/t	2 275,50	1,49%	-7,05%	-5,58%	11,27%
Свинец, $/t	2 265,00	0,40%	-13,02%	-7,08%	-5,03%
Серебро, $/oz	25,63	0,62%	-5,97%	5,40%	39,13%
Золото, $/oz	1 336,00	-0,28%	-4,84%	-2,37%	17,06%
Нефть Brent, $/	82,60	-1,88%	-6,82%	-1,11%	5,51%
Нефть Urals, $/	84,71	-0,21%	-2,83%	2,82%	8,99%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,495	0,00%	-2,69%		56 671	247
БашИнСв	BISV	0,168	0,00%	0,04%		134	159
БашЭнрг	BEGY	2,204	0,00%	0,00%		1 628 773	2 343
ВМЗ	VSMZ	1394,567	0,00%	0,13%		4 110	2 353
ДВМП	FESH	0,433	0,00%	-0,37%		32 647	1 260
КазанскВЗ	KHEL	2,936	0,00%	9,67%		825 210	463
КОМСТАР	CMST	6,404	0,00%	-0,38%		3 628	2 679
Мечел	MTLR	23,831	0,00%	0,27%		535 845	9 831
Мотовил	MOTZ	0,086	0,00%	-0,95%		1 700	86
Новсибэнрг	NVNG	38,333	0,00%	0,00%		8 264	510
СилМашины	SILM	0,271	0,00%	-0,78%		249 110	2 378
Сильвинит	SILV	801,807	0,00%	0,40%		1 094 463	6 284
СинТЗ-ао	SNTZ	55,104	0,00%	1,47%		110	347
Славн-ЯНОС	JNOS	0,441	0,00%	-1,43%		2 291	411
СТЗ-ао	SVTZ	5,111	0,00%	-3,50%		2 014	254
ТАГМЕТ	TAMZ	0,670	0,00%	-0,53%		67	341
У-УАЗ	UUAZ	1,954	0,00%	3,68%		147 162	532
ЧМК	CHMK	278,556	0,00%	-1,25%		80 714	889
ЧТПЗ	CHEP	1,827	0,00%	0,21%		173 471	854
ЮжКузб.	UKUZ	40,730	0,00%	0,55%		35 923	1 474
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	41,800	0,00%	0,00%	10 826		7 105
Газпром	GAZP	5,440	0,00%	-0,45%	27 200	217 986 567	128 784
Газпромнефть	SIBN	4,057	0,00%	-0,68%		5 431 427	19 322
Лукойл	LKOH	54,550	-5,13%	0,34%	493 350	84 061 593	46 398
НОВАТЭК	NVTK	8,990	0,00%	0,00%	8 990		27 296
Роснефть	ROSN	6,790	0,00%	0,07%		69 101 766	71 902
Сургутнефтегаз	SNGS	1,000	0,00%	-0,63%	250 000	22 874 177	35 726
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,461	-3,46%	-0,21%	92 200	8 570 212	3 551
Транснефть, п.	TRNFP	1272,000	0,00%	2,62%	127 200	66 745 249	1 978
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,300	-1,60%	0,00%	45 195		2 398
Иркутскэнерго	IRGZ	0,890	0,00%	0,55%	53 400	203 531	4 242
Ленэнерго	LSNG	0,820	0,00%	0,82%	10 042	40 776	759
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	1,94%	53 000	302 688	2 581
ОГК-2	OGKB	0,057	0,00%	0,00%	5 650		1 850
ОГК-3	OGKC	0,054	0,00%	-0,42%	21 600	586 855	2 564
ОГК-4	OGKD	0,085	0,00%	0,00%	11 846		5 353
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	0,08%	42 000	291 814	2 971
Самараэнерго	SAGO	0,010	0,00%	0,00%	5 000		35
ТГК-3	MSNG	0,101	0,00%	0,13%		1 558 896	4 005
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-0,58%		161 673	672
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,62%	119 680	148 796	1 006
Телекоммуникации							
ВолгаТелеком	NNSI	3,888	0,00%	0,00%	388 800		956
Комстар-ОТС	CMST	6,600	0,00%	0,00%	6 600		2 758
МТС	MTSS	8,150	-0,61%	0,00%	81 500		16 246
Ростелеком	RTKM	4,482	0,00%	1,29%		4 511 859	3 252
Ростелеком, п.	RTKMP	2,500	0,00%	0,12%	125 000	5 821 800	607
СЗТ	SPTL	0,835	0,00%	0,00%		1 016 280	737
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	2,44%		38 976	111
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	-0,47%	389 500	4 003 867	1 258
ЮТК	KUBN	0,173	0,00%	0,00%	4 249		512
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	20,10%	120 000	9 024 880	1 666
ГАЗ	GAZA	31,850	0,00%	0,00%	31 850		590
ИРКУТ	IRKT	0,340	0,00%	0,29%	17 000	259 232	333
Казанский ВЗ	KHEL	2,600	0,00%	0,00%	65 000		401

КАМАЗ	KMAZ	2,319	0,00%	1,38%		138 091	1 626
Кировский завод	KIRZ	10,000	0,00%	0,00%	10 000		109
Красный Котельщик	KRKO	0,580	0,00%	0,00%	39 250		124
Нефтекамский автозавод	nfaz	9,000	0,00%	0,00%	9 000		72
ОМЗ	OMZZ	2,250	0,00%	-1,17%	19 125	58 700	80
Подольский МСЗ	PDMS	1,900	0,00%	0,00%	5 130		40
РКК Энергия	RKKE	304,112	0,00%	-0,83%		17 688	343
Северсталь-авто	SVAV	16,600	0,00%	1,07%	16 600	233 677	569
Силовые машины	SILM	0,275	0,00%	0,00%	27 500		2 395
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,510	0,00%	0,00%	5 100		254
Бурятзолото	BRZL	28,500	0,00%	0,00%	28 500		200
ВСМПО	VSMO	95,000	0,00%	0,00%	9 500	229 483	1 095
Мечел	MTLR	24,750	0,00%	0,00%	14 850		10 303
ММК	MAGN	0,992	0,00%	0,17%		769 826	10 949
НЛМК	NLMK	3,773	0,00%	0,72%		3 338 358	22 511
НорНикель	GMKN	184,000	-2,65%	0,70%	545 700	160 618 424	35 076
Полиметалл	PMTL	16,566	0,00%	-2,10%	36 643	701 895	6 616
Полюс Золото	PLZL	50,043	0,00%	2,33%	6 806	22 012 971	9 540
Северсталь	CHMF	13,933	-3,91%	1,31%	43 192	32 385 957	14 040
ТМК	TRMK	5,120	0,00%	0,20%	21 094	289 909	4 800
Банки							
Банк Москвы	MMBM	30,994	0,00%	-0,44%		171 927	4 918
Возрождение	VZRZ	40,800	-1,69%	0,15%	204 900	414 954	969
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,98%	34 500	105 863 892	36 089
РОСБАНК	ROSB	3,722	0,00%	0,53%		77 723	2 776
Сбербанк	SBER	3,110	1,80%	0,00%	5 055 850		67 135
УРАЛСИБ	USBN	0,005	0,00%	0,00%	12 500		1 463
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,390	-4,78%	0,03%	239 500	9 747 999	2 654
Дальневосточное МП	FESH	0,433	-2,81%	0,00%	10 813		1 276
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	2,61%	6 000	489 867	2 311
Приморское МП	PRIM	0,157	0,00%	-1,25%		4 210	123
Ютэйр	TMAT	0,510	0,00%	0,00%	7 650		294
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,640	0,00%	0,00%	35 900		382
Балтика	PKBA	33,091	0,00%	0,10%		73 731	3 909
Верофарм	VRPH	40,900	0,10%	0,00%	40 900		409
Вимм-Билль-Данн	WBDF	61,000	0,00%	2,25%	122 500	120 930	2 684
Дикси	DIXY	12,750	0,79%	0,14%	12 750	87 621	1 097
Концерн Калина	KLNA	25,000	0,00%	0,27%	12 500	61 337	244
Красный Октябрь	KROT	10,088	0,00%	2,20%		5 574	92
Магнит	MGNT	110,800	-1,69%	-0,94%	155 840	1 059 988	9 858
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,671	0,00%	7,39%		325 928	26
Разгуляй	GRAZ	1,485	0,00%	-1,07%	8 892	122 404	235
Седьмой континент	SCON	8,200	0,00%	0,00%	30 340		615
Фармстандарт	PHST	92,300	0,00%	-0,87%	97 007	131 968	3 488
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	0,33%	601 000	5 477	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,245	8,89%	0,00%	59 750		437
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,590	0,00%	8,40%	29 500	354 525	951
Уфанефтехим	UFNC	4,460	0,00%	0,00%	44 600		1 228
Уфаоргсинтез	UFOS	3,500	0,00%	0,00%	2 713		342
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	274,787	0,00%	0,00%	15 663		383
ПИК	pikk	3,680	0,00%	1,46%	10 003	4 481 530	1 815
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	-0,35%	171 100	646 128	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,100	0,00%	1,31%	345 500	532 655	1 435
Дорогобуж	DGBZ	0,495	0,00%	1,43%	39 600	12 209	357
Сильвинит	SILV	800,000	0,00%	0,00%	160 000		6 261
Уралкалий	URKA	5,500	0,00%	3,32%	10 950	27 372 702	11 684
Уголь							
Белон	BLNG	0,870	0,00%	0,00%	8 700		1 001
Распадская	rasp	5,710	0,00%	-0,46%	456 800	2 402 310	4 458

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	177,000	0,10%	
Башнефть	AK6		EUR	150,000	-3,23%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,580	-1,86%	140,92
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,180	-0,37%	9 972,89
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,033	18,79%	48,76
Бурятзолото	BYT		EUR	12,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,012	9,09%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,395	-4,55%	2 853,03
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,480	1,60%	36 351,10
X5	FIVE		USD	39,300	0,00%	7 116,08
Газпром	GAZ		EUR	15,895	0,22%	984,14
Иркутскэнерго	IRK		EUR	31,250	-0,98%	
ЮТК	KUE		EUR	6,000	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,300	-1,15%	8,60
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,040	23,81%	17,17
Лукойл	LKOD		USD	54,950	-0,36%	88 105,31
Лукойл	LUK		EUR	40,535	-0,52%	244,62
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,600	-0,27%	3 751,89
МТС	MBT	5	USD	20,910	-0,67%	72 826,31
МТС	MKY	5	EUR	15,370	-0,39%	
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,260	-0,55%	1,45
Мечел	MTL	3	USD	23,330	-1,77%	48 220,16
НорНикель	NILSY	1	USD	19,150	0,21%	691,38
НорНикель	NNIA		EUR	14,230	0,21%	353,25
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	98,000	-3,26%	69 881,25
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,600	-2,61%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,700	-1,82%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	4,450	12,66%	23,63
Газпром	OGZD		USD	21,560	-0,65%	245 550,80
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,250	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,930	0,15%	199,61
Ростелеком	RTL		EUR	19,300	-1,03%	1,39
Газпромнефть	SCF		EUR	15,000	0,67%	73,10
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,850	-0,87%	244,12
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,321	-1,75%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,550	-1,94%	1 509,15
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,320	-1,38%	20,72
АФКСистема	SSA	1	USD	25,940	0,46%	4 132,92
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	43,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	44,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	24,750	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,500	-0,70%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	194,500	4,43%	5,13
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,895	0,17%	0,30
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,500	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,530	0,65%	26 225,89
ВТБ	VTBR		USD	6,560	-0,46%	57 884,70
Возрождение	VZY		EUR	30,500	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	24,070	-1,67%	4 836,04
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,760	-0,62%	

Источник: Bloomberg

Аналитическая служба «Ай Ти Инвест - Проспект»

Александр Потавин
Начальник отдела, рыночный анализ

Ольга Самарец
Потребительский сектор

Солодин Дмитрий
Ситуационный анализ

Егишянц Сергей
Макроэкономика, мировые рынки

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Синельщикова Екатерина
skat@prsp.ru

Брокерская группа «Ай Ти Инвест -Проспект»

Россия, Москва, 119180, 1-ый Голутвинский переулок, д. 6
телефон: +7 (495) 937 33 63
факс: +7 (495) 937 33 60
www.prsp.ru
www.itinvest.ru

Представленная информация базируется на достоверных источниках.
Тем не менее, содержание данного аналитического обзора может использоваться только в информационных целях.
ОАО "ИК "Проспект" и ЗАО "ИК "Ай Ти Инвест" не несут ответственности за точность предоставленных данных.
Данный документ не является предложением на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг.
Он также не является рекомендацией на покупку или продажу ценных бумаг, упомянутых в отчете.
Компании и ее сотрудники, включая тех, кто готовил этот отчет, могут иметь позиции, а также покупать и продавать ценные бумаги упомянутых в отчете компаний.
Инвестирование в странах СНГ является исключительно рискованным, поэтому инвесторы должны самостоятельно тщательно проработать свое решение.

Все права на данный аналитический отчет принадлежат Брокерской группе "Ай Ти Инвест - Проспект".
Перепечатка целиком или отдельными частями без ссылки на компании не допускается.