ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

15 декабря 2010г.

Комментарий по рынку акций

Вчера американские фондовые индексы формально завершили торги в плюсовой зоне. Индекс S&P-500 торгуется сейчас вблизи от сопротивления на 1250 п., пробой которого будет означать заход вверх до 1300 п. Кстати, аналитики Deutsche Bank дали прогноз, что к середине следующего года этот рыночный индикатор взлетит до 1550 п. Во вторник оптимизм рынку принесли данные по розничным продажам в ноябре, объем которых вырос на +0,8%. По факту итогового релиза по монетарной политике и оценке ситуации в экономике США со стороны ФРС по рынку прокатилась волна продаж. FOMC сохранила ставки по федеральным фондам на уровне 0-0,25%

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 735,50	1,40%	1,41%	7,83%	25,59%
Индекс ММВБ	1 662,45	0,11%	-0,61%	6,83%	26,20%
FTSE	5 860,75	0,91%	1,57%	0,69%	10,26%
S&P 500	1 240,46	0,61%	1,42%	3,57%	11,34%
Dow Jones Avg.	11 428,56	0,51%	0,58%	2,02%	8,83%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	19,7500	12,86%	18,12%	27,42%
Верофарм	48,0000	10,88%	14,01%	67,25%
ОАО Группа ЛСР	33,0000	8,13%	18,24%	28,30%
ВТБ	0,0033	4,38%	-3,19%	44,59%
ОАО АРМАДА	11,5000	4,07%	36,90%	70,37%
ОАО Синергия	45,0000	4,05%	26,76%	73,08%
ПИК	4,1000	4,01%	10,81%	-11,83%
Акрон	32,5000	4,00%	7,97%	1,56%

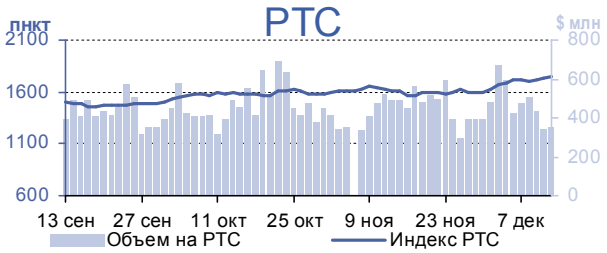
Лидеры снижения

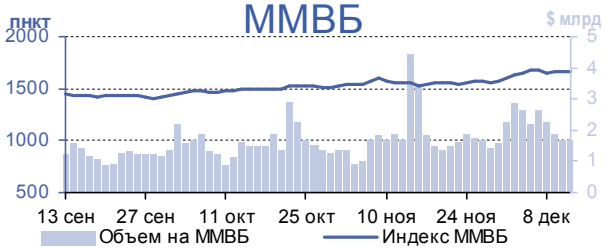
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-2	0,0590	-0,84%	4,42%	90,32%

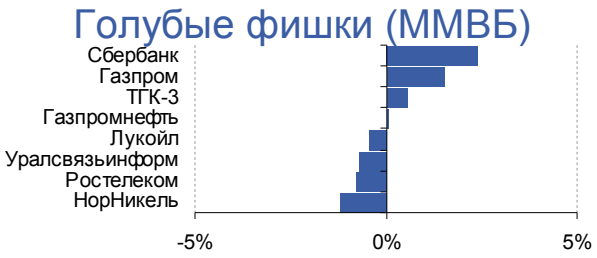
Индекс MSCI

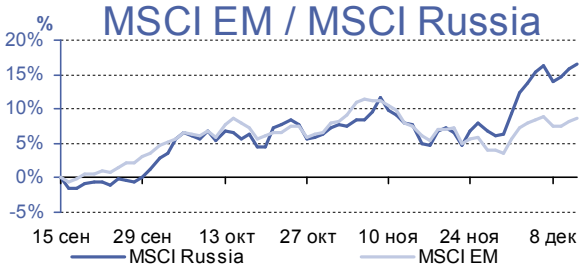
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1122,85	0,56%	0,70%	14,67%
Индекс MSCI BRAZIL	3636,42	1,72%	-0,63%	-0,66%
Индекс MSCI RUSSIA	915,53	1,02%	7,65%	19,67%
Индекс MSCI INDIA	533,25	2,83%	-3,97%	16,47%
Индекс MSCI CHINA	67,19	0,11%	-3,51%	2,28%

Основные индикаторы









Обзор рынка

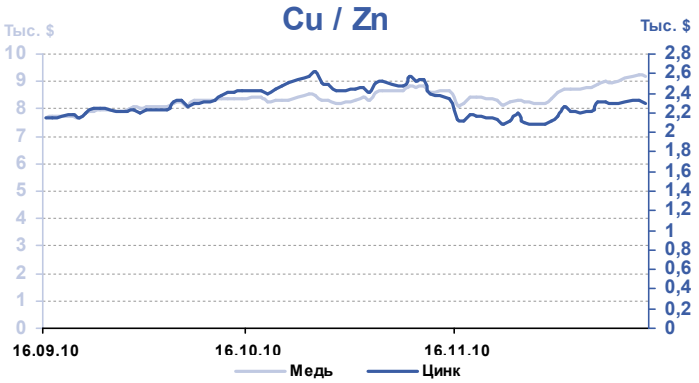
Вчера американские фондовые индексы формально завершили торги в плюсовой зоне. Индекс S&P-500 торгуется сейчас вблизи от сопротивления на 1250 п., пробой которого будет означать заход вверх до 1300 п. Кстати, аналитики Deutsche Bank дали прогноз, что к середине следующего года этот рыночный индикатор взлетит до 1550 п. Во вторник оптимизм рынку принесли данные по розничным продажам в ноябре, объем которых вырос на +0,8%. По факту итогового релиза по монетарной политике и оценке ситуации в экономике США со стороны ФРС по рынку прокатилась волна продаж. FOMC сохранила ставки по федеральным фондам на уровне 0-0,25%, было также подтвержден план покупки казначейских облигаций на сумму $600 млрд. до середины следующего года. В своих комментариях руководство ФРС никак не прокомментировало рост доходности по казначейским облигациям. В результате, вчера доходность 10-летних USTreasuries взлетела до 3,46% (максимум с мая), а доходность по 30-летним бондам до 4,55%.

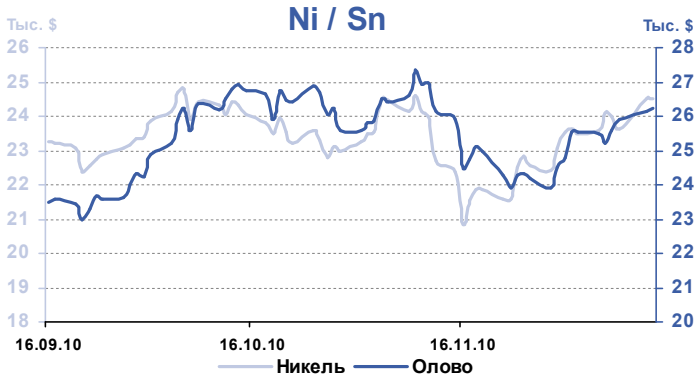
Вчера рейтинговое агентство S&P пересмотрело прогноз по суверенным долгам Бельгии на «Негативный». Сегодня агентство Moody's сообщило, что может понизить текущий рейтинг Испании AA1. Это вызвало волну продаж единой европейской валюты, которая опустилась сегодня ниже уровня 1,33 по отношению к доллару. Плюс к этому вчера впервые европейский политик (Председателя национального парламента Словакии) публично заявил о возможности отказа его страны от евро и перехода на крону. Последовавшее усиление позиций доллара вызвало просадку цен на золото ($1389/унц) и на промышленные металлы (медь -0,95%; никель -0,7%). Стабильность видна лишь в ценах на нефть: Brent $91/барр. Видимо здесь нефтетрейдеры не решаются двигать котировки не получив порции статистики от Минэнерго США по запасам сырья. Сегодня Американский институт нефти /API/ заявил, что запасы сырой нефти снизилась на -1,44 млн. барр., запасы дистиллятов выросли на +1,95 млн. барр.

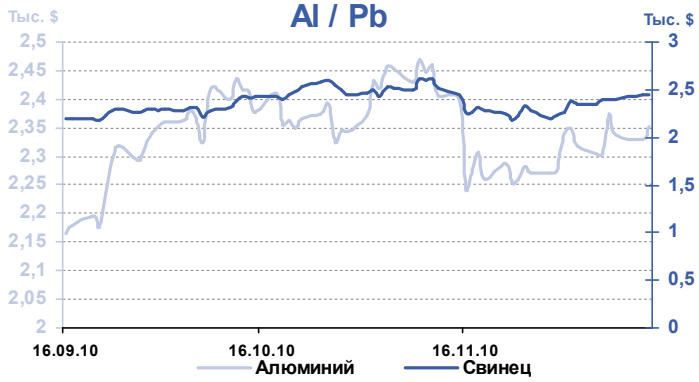
Таким образом, к открытию торгов на российских биржах в среду складывается неоднозначный внешний фон. С одной стороны, есть четкое принуждение к росту, идущее со стороны США, с другой мы видим усиление напряженности в зоне евро. Вчера акции Газпрома и ГМК завершили день на уровнях годовых максимумов, что традиционно является сильным сигналом к продолжению роста. Для того, чтобы поддержать это движение нам необходимо сначала посмотреть за реакций европейских инвесторов резкое ухудшение настроений вокруг курса евро и долгового рынка. Если эти факторы вновь будут проигнорированы, то покупки сильных ликвидных бумаг себя оправдают. В противном случае, индекс ММВБ опять вернется к отметке 1647 пунктов. В этой связи мы также делаем ставку на ослабления курса рубля.

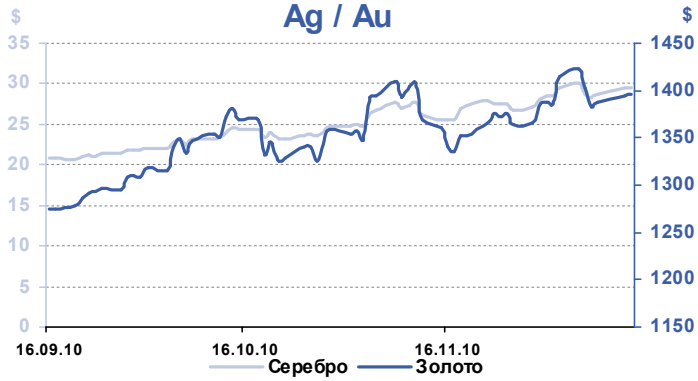
Сегодня в 16-30 ждем данных из США по индексу потребительских цен за ноябрь. В это же время ФРБ Нью-Йорка опубликует данные по индексу деловой активности в производственном секторе (Empire Manufacturing index) за декабрь. В 17-15 ФРС опубликует данные по объёму промышленного производства в США за ноябрь. В 18-30 Минэнерго США (EIA) выдаст отчёт по запасам нефти и нефтепродуктов.

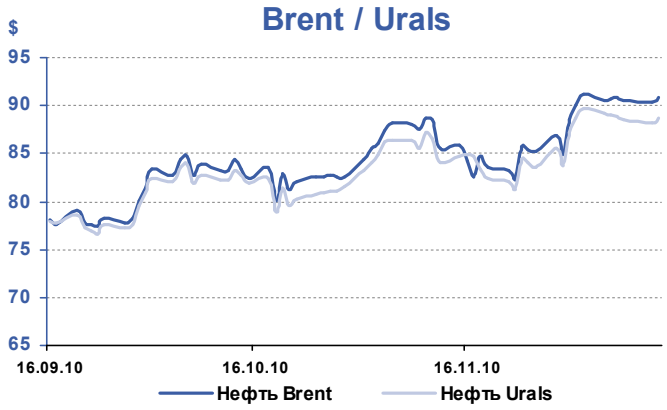
Commodities

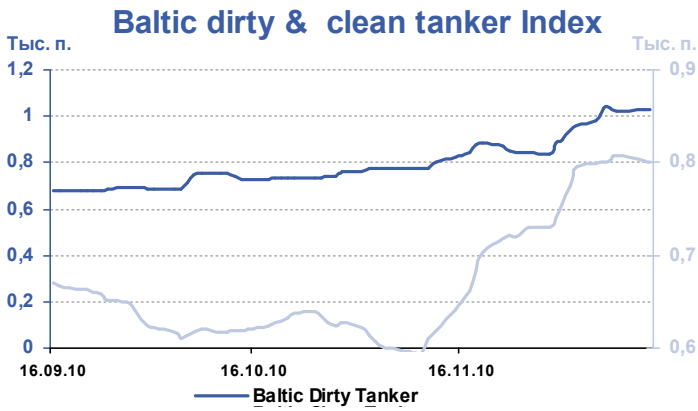












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 225,00	3,07%	5,19%	6,71%	33,44%
Цинк, $/t	2 322,00	0,96%	4,64%	-0,68%	-0,51%
Никель, $/t	24 530,00	3,92%	3,94%	9,75%	45,15%
Олово, $/t	26 150,00	0,98%	2,65%	0,97%	70,92%
Алюминий, $/t	2 331,00	-0,30%	1,13%	-2,88%	3,23%
Свинец, $/t	2 440,00	1,46%	3,79%	-0,61%	4,30%
Серебро, $/oz	29,53	2,82%	-2,06%	15,90%	69,83%
Золото, $/oz	1 394,18	0,51%	-2,08%	2,47%	23,74%
Нефть Brent, $/	90,37	-0,19%	-0,22%	5,17%	26,37%
Нефть Urals, $/	88,19	-0,47%	-1,11%	4,18%	24,63%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,558	0,00%	1,66%		317 209	279
БашИнСв	BISV	0,161	0,00%	-1,16%		111	151
БашЭнрг	BEGY	2,171	0,00%	1,03%		596 726	2 261
ВМЗ	VSMZ	1432,618	0,00%	0,00%		51 611	2 462
ДВМП	FESH	0,478	0,00%	-0,34%		43 613	1 396
КазанскВЗ	KHEL	3,289	0,00%	3,21%		126 412	494
КОМСТАР	CMST	6,501	0,00%	-0,16%		86 709	2 725
Мечел	MTLR	27,382	0,00%	1,94%		859 865	11 350
Мотовил	MOTZ	0,096	0,00%	4,61%		14 562	94
Новсибэнрг	NVNG	40,416	0,00%	-0,70%		1 448	559
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1410,000	0,00%	0,00%	14 100		2 422
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,090	0,00%	0,00%	9 000		89
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,780	2,96%	0,00%	55 600		41 692
СилМашины	SILM	0,301	0,00%	0,08%		85 427	2 626
Сильвинит	SILV	884,870	0,00%	0,28%		365 692	6 896
СинТЗ-ао	SNTZ	60,235	0,00%	2,78%		13 023	380
Славн-ЯНОС	JNOS	0,483	0,00%	1,25%		6 556	440
СТЗ-ао	SVTZ	6,175	0,00%	5,58%		398	295
ТАГМЕТ	TAMZ	0,711	0,00%	0,00%		641	362
ТНК-ВР	TNBP	2,811	0,00%	2,76%		1 308 748	42 403
У-УАЗ	UUAZ	2,240	0,00%	-0,58%		11 434	599
ЧМК	CHMK	310,129	0,00%	0,35%		38 618	985
ЧТПЗ	CHEP	2,062	0,00%	0,83%		109 705	968
ЮжКузб.	UKUZ	44,607	0,00%	0,00%		278 266	1 629
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,550	0,58%	0,00%	130 525		7 411
Газпром	GAZP	6,340	2,59%	1,52%	158 500	403 641 933	150 090
Газпромнефть	SIBN	4,304	0,00%	0,07%		2 869 828	20 459
Лукойл	LKOH	57,366	0,00%	-0,46%		106 209 822	49 128
Роснефть	ROSN	7,194	2,56%	0,84%	14 474	133 272 147	76 240
Сургутнефтегаз	SNGS	0,982	0,00%	0,15%		20 205 530	35 280
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,501	0,00%	-0,80%		7 422 888	3 891
Транснефть, п.	TRNFP	1324,000	0,00%	0,39%	886 530	11 052 176	2 059
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,150	0,00%	0,00%	39 818		2 242
Иркутскэнерго	IRGZ	0,906	0,00%	-0,35%	21 200	44 724	4 319
Ленэнерго	LSNG	0,842	0,24%	-1,34%	8 420	27 427	780
МОЭСК	MSRS	0,056	0,00%	1,46%	20 281	854 747	2 728
ОГК-2	OGKB	0,059	-0,84%	0,00%	29 500		1 931
ОГК-3	OGKC	0,054	0,00%	0,18%	24 300	777 045	2 564
ОГК-4	OGKD	0,101	0,00%	0,00%	348 381		6 343
ОГК-5	OGKE	0,091	0,00%	-0,70%	45 250	339 116	3 201
ТГК-3	MSNG	0,101	0,00%	0,56%	9 350	1 150 853	4 027
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%		51 290	689
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-0,56%		63 145	1 080
Телекоммуникации							
ВолгаТелеком	NNSI	4,260	0,00%	0,00%	42 600		1 048
МГТС	MGTS	13,800		0,00%	13 800		1 102
Ростелеком	RTKM	4,440	0,00%	-0,78%	66 600	2 591 739	3 235
Ростелеком, п.	RTKMP	2,700	0,00%	0,64%	13 500	6 098 511	656
СЗТ	SPTL	0,957	0,00%	-0,71%		499 750	844
Таттелеком	TTLK	0,006	0,00%	0,00%		28 050	120
Уралсвязьинформ	URSI	0,042	0,00%	-0,71%	42 000	5 440 108	1 357
ЦентрТелеком	ESMO	0,960	0,00%	0,00%	48 000		1 515
ЮТК	KUBN	0,190	0,00%	0,00%	12 350		562
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,250	0,00%	-0,42%		1 109 150	1 748
ГАЗ	GAZA	36,000	0,00%	0,00%	1 800		667
ИРКУТ	IRKT	0,336	0,00%	-1,09%		69 960	329

Казанский ВЗ	KHEL	3,150	0,00%	0,00%	63 000		485
КАМАЗ	KMAZ	2,381	0,00%	0,83%		1 507 797	1 698
Кировский завод	KIRZ	9,000	0,00%	0,00%	9 000		98
Красный Котельщик	KRKO	0,604	0,00%	0,00%	6 040		129
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,000		0,00%	10 000		80
ОМЗ	OMZZ	3,098	0,00%	1,78%	642 845	113 591	110
РКК Энергия	RKKE	335,363	0,00%	6,08%		96 494	387
Северсталь-авто	SVAV	19,750	12,86%	2,66%	39 500	885 420	677
Силовые машины	SILM	0,292	0,00%	0,00%	5 840		2 543
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,540	-1,82%	0,00%	5 400		273
ВСМПО	VSMO	120,000	2,56%	0,95%	24 000	1 985 178	1 384
Мечел	MTLR	25,250	0,00%	0,00%	75 750		10 511
ММК	MAGN	1,097	0,00%	-0,88%		670 721	12 366
НЛМК	NLMK	4,356	0,00%	-1,79%		4 459 808	26 382
НорНикель	GMKN	215,479	0,00%	-1,21%		190 769 596	41 538
Полиметалл	PMTL	18,266	0,00%	-0,33%		4 234 906	7 277
Полюс Золото	PLZL	61,750	0,00%	0,85%	39 715	9 010 981	11 771
Северсталь	CHMF	16,672	0,59%	-0,78%	94 196	22 999 557	16 800
ТМК	TRMK	5,120	0,00%	-0,38%	21 094	411 085	4 800
ЧМЗ	CHMZ	8,548	0,00%	0,00%	4 274		20
ЧТПЗ	CHEP	1,980	0,00%	0,00%	9 900		935
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,644	0,00%	-0,32%		5 730	5 698
Возрождение	VZRZ	41,600	2,34%	1,98%	41 600	226 402	988
ВТБ	VTBR	0,003	4,38%	0,99%	33 400	82 193 026	34 938
РОСБАНК	ROSB	3,777	0,00%	-0,36%		533 441	2 823
Сбербанк	SBER	3,490	2,65%	0,00%	970 000		75 338
УРАЛСИБ	USBN	0,008	0,00%	0,00%	88 000		2 341
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,680	3,08%	1,73%	406 600	2 260 754	2 971
Дальневосточное МП	FESH	0,465	0,00%	0,00%	1 375 453		1 372
НМТП	NMTP	0,136	0,00%	0,99%	6 750	393 312	2 632
Приморское МП	PRIM	0,161	0,00%	-1,73%		70 487	129
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	38,000	0,00%	3,88%	38 000	265 421	5 765
Верофарм	VRPH	48,000	10,88%	0,00%	96 000		480
Вимм-Билль-Данн	WBDF	117,300	0,69%	-0,33%	46 920	1 131 177	5 161
Дикси	DIXY	13,250	2,71%	0,53%	39 650	333 130	1 140
Концерн Калина	KLNA	26,049	0,00%	3,23%		152 066	254
Красный Октябрь	KROT	11,672	0,00%	-1,78%		99 125	107
Магнит	MGNT	132,000	2,33%	-2,18%	13 200	1 198 110	11 745
Нутринвестхолдинг	NTRI	3,500	0,00%	-0,03%	17 500	1 209 168	56
Разгуляй	GRAZ	1,480	0,00%	1,22%	74 000	400 354	234
Фармстандарт	PHST	96,000	0,00%	-0,33%	9 600	213 122	3 628
Черкизово	GCHE	30,114	0,00%	0,12%		38 449	1 291
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,236	0,00%	0,00%	155 700		421
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,780	0,00%	-0,04%	39 000	37 798	1 257
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	295,000	0,00%	0,00%	14 750		411
ПИК	pikk	4,100	4,01%	3,80%	20 500	11 168 325	2 022
РБК ИС	RBCI	1,432	0,00%	0,71%		1 914 150	202
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	32,500	4,00%	0,85%	32 500	1 053 854	1 550
Дорогобуж	DGBZ	0,553	0,00%	-0,05%		43 226	401
Сильвинит	SILV	865,000	0,00%	0,00%	86 500		6 769
Уралкалий	URKA	5,610	0,00%	-1,65%	28 050	20 922 085	11 918
Уголь							
Распадская	rasp	6,200	0,00%	0,94%	62 000	2 031 954	4 841
УК Южный Кузбасс	UKUZ	43,500	0,00%	0,00%	42 630		1 571

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	200,230	-1,67%	23,34
Башнефть	AK6		EUR	159,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,530	-4,97%	92,02
ТГК-3	AOMD		USD	10,300	0,98%	34,97
Татнефть	ATAD		USD	31,550	-1,28%	17 799,08
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,449	2,28%	34,84
Бурятзолото	BYT		EUR	21,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,008	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,320	-0,39%	1 386,60
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	34,380	-1,74%	17 882,72
X5	FIVE		USD	41,600	-3,82%	11 550,70
Газпром	GAZ		EUR	19,065	0,90%	3 108,76
Иркутскэнерго	IRK		EUR	31,750	1,60%	
ЮТК	KUE		EUR	7,350	5,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,680	-1,47%	9,40
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	2,56%	145,44
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,200	-4,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,150	-0,61%	212 410,00
Лукойл	LUK		EUR	42,700	-1,34%	988,63
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,150	-0,50%	8 679,19
МТС	MBT	5	USD	19,810	-2,37%	101 008,70
МТС	MKY	5	EUR	14,775	-2,31%	18,88
МГТС	MOW		EUR	9,650	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,650	1,19%	53,43
Мечел	MTL	3	USD	28,120	4,11%	99 275,95
НорНикель	NILSY	1	USD	22,900	3,53%	1 389,84
НорНикель	NNIA		EUR	17,325	3,25%	575,00
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	105,500	-4,52%	27 269,09
ВолгаТелеком	NZH		EUR	6,300	-0,94%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,700	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,520	0,91%	2,92
Газпром	OGZD		USD	25,500	2,25%	326 845,60
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	28,430	0,57%	28,63
Ростелеком	RTL		EUR	21,425	1,23%	19,47
Газпромнефть	SCF		EUR	16,300	0,62%	90,31
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,134	-0,63%	255,51
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,720	0,00%	21,33
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,010	0,20%	62,07
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,680	-0,21%	52,84
АФКСистема	SSA	1	USD	23,820	-2,78%	42 176,11
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	44,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	41,000	5,13%	5,00
ЦУМ	THT		EUR	17,000	6,25%	
Ютэйр	TYV		EUR	39,000	1,56%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	221,500	-1,34%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	6,775	3,04%	6,24
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,050	3,06%	15,20
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,300	-0,83%	47 776,29
ВТБ	VTBR		USD	6,600	2,48%	37 673,46
Возрождение	VZY		EUR	29,600	1,20%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	31,960	0,16%	45 030,13
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,550	-1,05%	23,74

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.