ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

16 декабря 2010г.

Комментарий по рынку акций

Посчитав, что дальнейший рост рынка до Рождества уже маловероятен и новых стимулов к росту не так много, в среду американские инвесторы приступили к неактивной фиксации прибыли. Заокеанский рынок акций приседал еще и по причине нового роста доходности казначейских облигаций, поскольку рост ставки по безрисковым активам напрямую снижает премию по рискованным активам. Тем не менее, вышедшая вчера американская статистика опять оказалась неплохой: рост промышленного производства в ноябре составил +0,4%, повысился также декабрьский индекс деловой активности в производственном секторе Нью-Йорка на 22 пункта до 10.6

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 757,71	0,68%	3,67%	12,09%	25,88%
Индекс ММВБ	1 670,26	0,24%	1,22%	9,41%	25,37%
FTSE	5 882,18	-0,15%	1,51%	3,52%	11,28%
S&P 500	1 235,23	-0,51%	0,57%	4,83%	11,49%
Dow Jones Avg.	11 457,47	-0,17%	0,75%	3,94%	9,62%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-3	0,1200	18,46%	11,11%	15,38%
Фармстандарт	103,0000	7,29%	11,59%	72,10%
ВолгаТелеком	4,5500	6,81%	17,03%	44,44%
СибирьТелеком	0,0870	6,10%	19,18%	55,36%
ЧТПЗ	2,1000	6,06%	7,69%	0,96%
УК Южный Кузбасс	46,5000	4,49%	16,25%	29,17%
Акрон	35,2500	4,29%	17,11%	10,16%
Дальневосточное МП	0,4950	3,13%	11,24%	54,69%

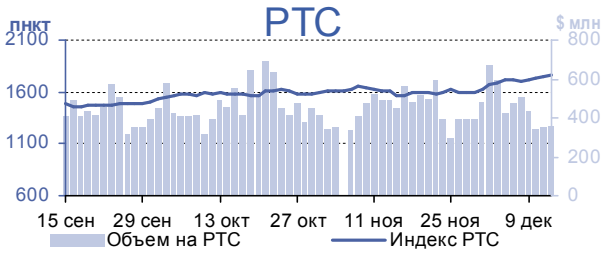
Лидеры снижения

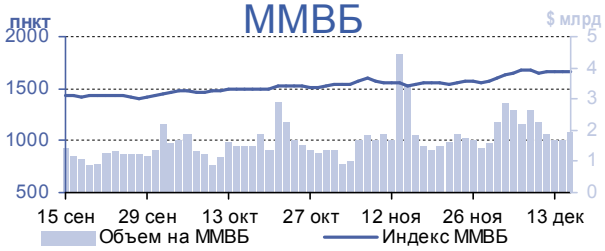
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Иркутскэнерго	0,8525	-5,91%	5,51%	83,33%
Верофарм	47,2500	-1,56%	12,23%	64,63%
ОАО Компания М.видео	8,9000	-0,89%	22,76%	76,24%

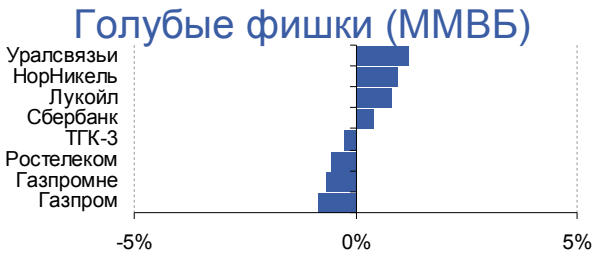
Индекс MSCI

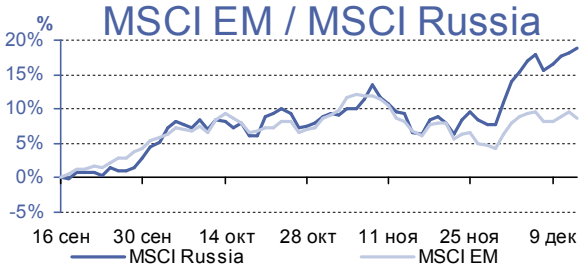
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1120,29	-0,76%	1,79%	14,90%
Индекс MSCI BRAZIL	3601,81	-0,98%	0,49%	-1,40%
Индекс MSCI RUSSIA	923,65	0,41%	11,43%	19,37%
Индекс MSCI INDIA	528,78	-1,84%	-2,39%	17,14%
Индекс MSCI CHINA	66,42	-1,76%	-3,02%	2,18%

Основные индикаторы









Обзор рынка

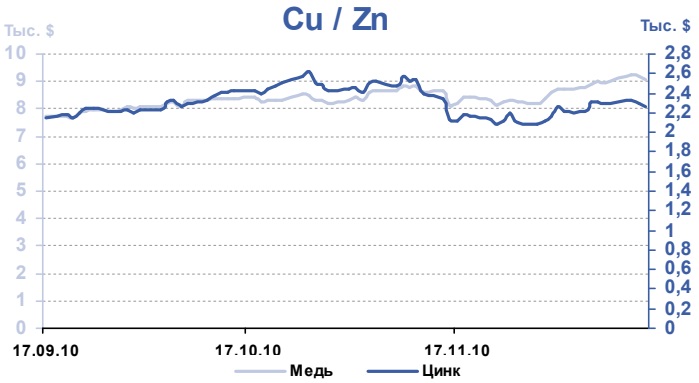
Посчитав, что дальнейший рост рынка до Рождества уже маловероятен и новых стимулов к росту не так много, в среду американские инвесторы приступили к неактивной фиксации прибыли. Заокеанский рынок акций приседал еще и по причине нового роста доходности казначейских облигаций, поскольку рост ставки по безрисковым активам напрямую снижает премию по рискованным активам. Тем не менее, вышедшая вчера американская статистика опять оказалась неплохой: рост промышленного производства в ноябре составил +0,4%, повысился также декабрьский индекс деловой активности в производственном секторе Нью-Йорка на 22 пункта до 10,6 пунктов. Думаю, вблизи текущих уровней американские фондовые индексы начнут консолидацию, накануне Рождественских праздников.

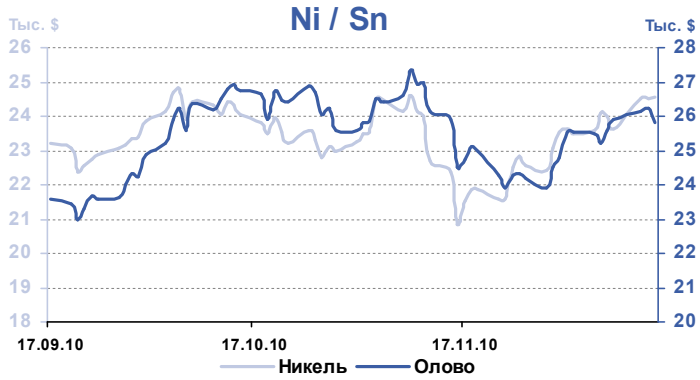
На фоне позитивной макростатистики курс доллара показывает большую силу по отношению к евро. Сегодня утром пара EUR/USD снова опустилась к отметке 1,3220, что в свою очередь снижает аппетиты к риску на сырьевых биржах. Цены на золото вернулись на уровень $1380/унц, а котировки меди и никеля продолжают снижаться уже второй день подряд. Февральские фьючерсы на смесь Brent торгуются возле уровня $92/барр, имея в качестве поддержки резкое падение запасов сырой нефти в США (-9,8 млн. барр.). На азиатских биржах сегодня наблюдается разнонаправленная динамика движения индексов вблизи нейтральных уровней: MSCI Asia -0,2%.

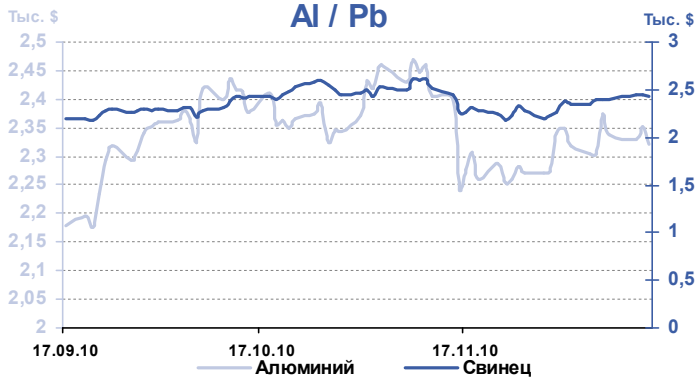
Открытие торгов на российском рынке акций в четверг мы опять увидим в негативной зоне. После вчерашнего принудительного подъема наших индексов вверх, специально под экспирацию фьючерсных и опционных контрактов, сегодня торги будут проходить в спокойном режиме. Утренняя просадка вполне может вылиться в консолидацию, а индекс ММВБ вполне может найти равновесие в диапазоне 1660-65 пунктов. Из наиболее интересных бумаг мы выделяем сейчас акции МРК, которые без лишнего шума скупают брокеры в интересах крупного игрока. Думаю, что покупатели акции химических компаний (Уралкалий, Акрон, Дорогобуж) также не остановятся на текущих уровнях.

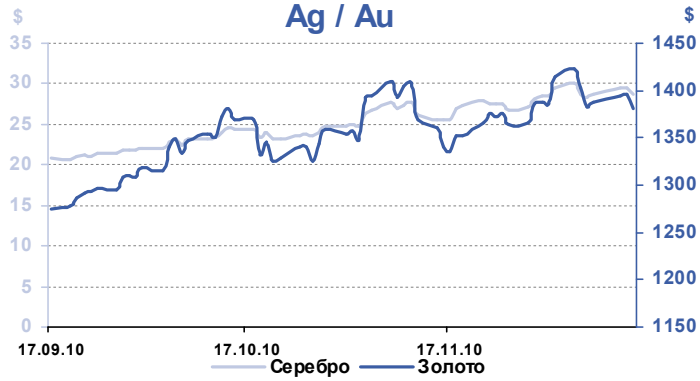
Сегодня в 12-30 ждем статистики из Великобритании по розничным продажам за ноябрь. В 13-00 выходит статистика по индексу потребительских цен в еврозоне. Днем ждем финансовых релизов от Home Depot и Wal-Mart. В 16-30 ждем выхода данных из США по числу обращений за пособием по безработице (прогноз: 421 тыс.). В это же время выходит важный отчёт по числу закладок новых домов и выданных разрешений на строительство жилья за ноябрь. Министерство торговли представит отчёт с данными платёжного баланса США за III квартал. А, в 18-00 ФРБ Филадельфии выдаст индекс деловой активности в производственном секторе региона за декабрь.

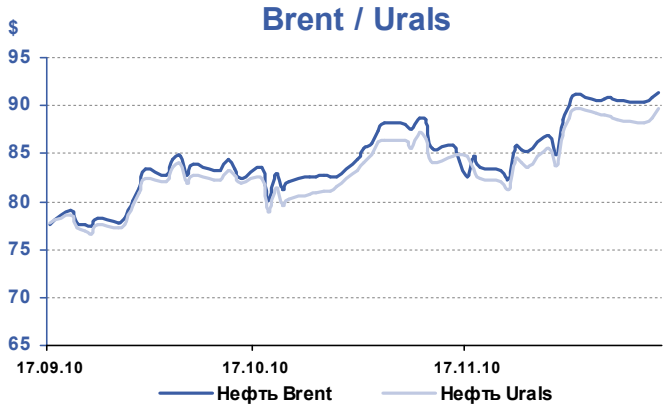
Commodities

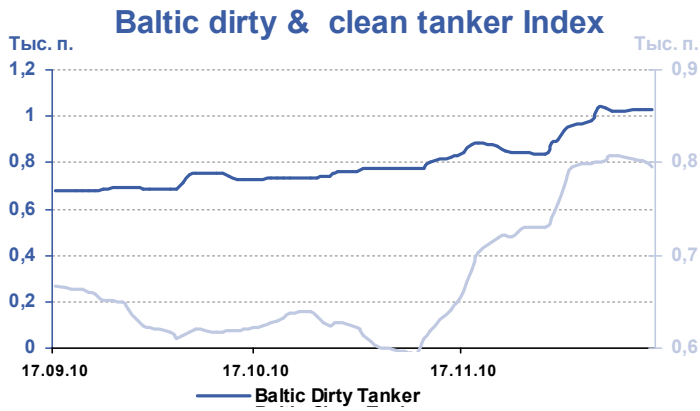












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 095,00	-0,76%	0,89%	11,60%	31,91%
Цинк, $/t	2 258,00	-1,83%	-2,29%	5,56%	-3,30%
Никель, $/t	24 550,00	0,20%	2,29%	17,92%	44,41%
Олово, $/t	25 825,00	-1,62%	0,88%	5,30%	68,52%
Алюминий, $/t	2 321,00	-1,28%	-2,19%	3,52%	3,89%
Свинец, $/t	2 425,00	-1,02%	0,83%	7,49%	2,75%
Серебро, $/oz	28,80	-2,28%	1,46%	13,04%	65,36%
Золото, $/oz	1 380,82	-1,11%	-0,09%	3,07%	22,72%
Нефть Brent, $/	91,38	0,51%	0,52%	8,55%	27,08%
Нефть Urals, $/	89,75	1,25%	1,04%	5,73%	26,34%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,564	0,00%	1,16%		299 585	281
БашИнСв	BISV	0,171	0,00%	2,94%		45 511	161
БашЭнрг	BEGY	2,134	0,00%	-0,61%		645 841	2 226
ВМЗ	VSMZ	1466,333	0,00%	4,00%		110 475	2 530
ДВМП	FESH	0,499	0,00%	2,68%		394 124	1 446
КазанскВЗ	KHEL	3,258	0,00%	0,50%		83 847	497
КОМСТАР	CMST	6,484	0,00%	-0,03%		4 027	2 710
Мечел	MTLR	27,974	0,00%	0,57%		1 632 840	11 562
Мотовил	MOTZ	0,099	0,00%	-1,55%		40 382	98
Новсибэнрг	NVNG	39,428	0,00%	-0,82%		17 747	530
ОАО Банк Москвы	MMBM	33,250		0,00%	33 250		5 985
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	0,00%	0,00%	55 600		41 692
СилМашины	SILM	0,299	0,00%	-0,05%		45 197	2 605
Сильвинит	SILV	882,732	0,00%	0,33%		1 485 381	6 895
СинТЗ-ао	SNTZ	60,235	0,00%	0,00%		13 023	380
Славн-ЯНОС	JNOS	0,497	0,00%	4,88%		124 019	485
СТЗ-ао	SVTZ	5,970	0,00%	1,78%		723	290
ТАГМЕТ	TAMZ	0,706	0,00%	-1,53%		28 714	348
ТНК-ВР	TNBP	2,721	0,00%	0,60%		266 782	40 868
У-УАЗ	UUAZ	2,232	0,00%	0,44%		111 503	592
ЧМК	CHMK	307,930	0,00%	-1,03%		48 178	977
ЧТПЗ	CHEP	2,116	0,00%	2,56%		574 444	994
ЮжКузб.	UKUZ	46,890	0,00%	2,06%		238 206	1 670
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	44,000	1,03%	0,00%	74 693		7 487
Газпром	GAZP	6,430	1,42%	-0,83%	1 287 430	477 812 991	152 221
Газпромнефть	SIBN	4,224	0,00%	-0,66%		5 048 878	19 981
Лукойл	LKOH	56,400	0,00%	0,83%	282 000	144 281 703	47 972
Роснефть	ROSN	7,194	0,00%	-0,99%	14 474	105 060 660	76 240
Сургутнефтегаз	SNGS	0,980	0,00%	0,45%	401 221	30 666 932	35 011
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,505	0,00%	1,22%		13 378 138	3 836
Татнефть	TATN	4,780	0,00%	0,00%	47 800		10 414
Транснефть, п.	TRNFP	1360,000	2,72%	-0,19%	17 644	15 437 659	2 115
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,150	0,00%	0,00%	39 818		2 242
Иркутскэнерго	IRGZ	0,853	-5,91%	-0,76%	5 907	174 855	4 064
Ленэнерго	LSNG	0,842	0,00%	0,38%	8 420	31 693	780
МОЭСК	MSRS	0,056	0,00%	-0,52%	20 281	241 216	2 728
ОГК-2	OGKB	0,059	0,00%	0,00%	29 500		1 931
ОГК-3	OGKC	0,054	0,00%	1,26%	24 300	1 597 552	2 564
ОГК-4	OGKD	0,101	0,00%	0,00%	348 381		6 343
ОГК-5	OGKE	0,091	0,00%	0,04%	45 250	189 560	3 201
ТГК-3	MSNG	0,120	18,46%	-0,28%	6 000	798 266	4 770
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	1,18%		49 557	681
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,56%		71 368	1 081
Телекоммуникации							
ВолгаТелеком	NNSI	4,550	6,81%	0,00%	90 850		1 119
МГТС	MGTS	13,900	0,00%	0,00%	41 700		1 110
Ростелеком	RTKM	4,440	0,00%	-0,57%	66 600	2 054 568	3 235
Ростелеком, п.	RTKMP	2,700	0,00%	0,12%	13 500	5 105 419	656
СЗТ	SPTL	0,991	0,00%	1,33%		515 970	871
СибирьТелеком	ENCO	0,087	6,10%	0,00%	43 500		1 045
Таттелеком	TTLK	0,006	0,00%	3,33%		62 024	124
Уралсвязьинформ	URSI	0,042	0,00%	1,20%	42 000	7 804 977	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	1,259	0,00%	-0,17%		633 372	1 749
ГАЗ	GAZA	36,000	0,00%	0,00%	1 800		667
ИРКУТ	IRKT	0,336	0,00%	1,41%		60 800	327
Казанский ВЗ	KHEL	3,150	0,00%	0,00%	63 000		485
КАМАЗ	KMAZ	2,373	0,00%	-0,10%		120 637	1 673
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%	0,00%	10 000		80
ОМЗ	OMZZ	3,098	0,00%	0,38%	642 845	74 404	110
РКК Энергия	RKKE	338,071	0,00%	0,73%		41 216	380
Северсталь-авто	SVAV	19,750	0,00%	2,33%	39 500	1 281 973	677
Силовые машины	SILM	0,292	0,00%	0,00%	5 840		2 543
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,540	0,00%	0,00%	5 400		273
ВСМПО	VSMO	123,000	2,50%	1,88%	244 300	3 639 105	1 418
Мечел	MTLR	25,250	0,00%	0,00%	75 750		10 511
ММК	MAGN	1,105	0,00%	-0,32%	11 050	1 566 849	12 348
НЛМК	NLMK	4,530	0,00%	2,25%	6 795	4 465 647	27 149
НорНикель	GMKN	217,148	0,00%	0,97%	2 400 615	274 491 094	41 394
Полиметалл	PMTL	19,212	0,00%	2,54%		3 285 537	7 635
Полюс Золото	PLZL	61,750	0,00%	-0,86%	39 715	13 438 534	11 771
Северсталь	CHMF	16,751	0,47%	1,00%	84 696	33 287 244	16 880
ТМК	TRMK	5,018	0,00%	-0,32%		370 186	4 718
ЧМЗ	CHMZ	8,717	0,51%	0,00%	5 230		20
ЧТПЗ	CHEP	2,100	6,06%	0,00%	27 300		992
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,191	0,00%	10,99%		1 228 700	6 052
Возрождение	VZRZ	41,600	0,00%	0,35%	41 600	292 994	988
ВТБ	VTBR	0,003	0,30%	-0,29%	8 375	63 633 241	35 043
РОСБАНК	ROSB	3,790	0,00%	-0,04%		106 816	2 822
Сбербанк	SBER	3,520	0,72%	0,00%	2 094 000		75 986
УРАЛСИБ	USBN	0,008	0,00%	0,00%	8 000		2 341
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,650	0,00%	-0,89%	198 750	1 111 077	2 943
Дальневосточное МП	FESH	0,495	3,13%	0,00%	121 750		1 461
НМТП	NMTP	0,135	0,00%	-0,50%	6 750	134 068	2 600
Приморское МП	PRIM	0,161	0,00%	1,31%		51 716	128
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	38,000	0,00%	-0,47%	38 000	100 407	5 765
Верофарм	VRPH	47,250	-1,56%	0,00%	94 500		473
Вимм-Билль-Данн	WBDF	119,000	0,85%	1,60%	119 000	2 201 249	5 236
Дикси	DIXY	13,300	0,38%	0,75%	163 523	115 451	1 144
Концерн Калина	KLNA	26,883	0,00%	3,38%		67 275	258
Красный Октябрь	KROT	12,056	0,00%	-1,34%		169 971	110
Магнит	MGNT	135,000	2,27%	2,22%	20 050	1 334 844	12 012
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,500	0,00%	-1,50%	12 500	168 097	40
Разгуляй	GRAZ	1,480	0,00%	-1,05%	74 000	497 439	234
Фармстандарт	PHST	103,000	7,29%	0,95%	51 148	267 679	3 893
Черкизово	GCHE	29,815	0,00%	-1,06%		88 046	1 278
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,236	0,00%	0,00%	155 700		421
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,780	0,00%	-2,09%	39 000	40 672	1 257
Уфанефтехим	UFNC	4,514	0,00%	0,00%	23 836		1 246
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	277,000	-6,10%	0,00%	27 700		386
ПИК	pikk	4,370	0,00%	-1,30%	477 985	6 435 020	2 156
РБК ИС	RBCI	1,412	0,00%	0,46%		1 293 416	197
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	35,250	4,29%	3,69%	24 689	5 298 082	1 681
Дорогобуж	DGBZ	0,564	0,00%	2,36%		279 523	407
Сильвинит	SILV	888,300	1,15%	0,00%	6 218		6 952
Уралкалий	URKA	5,610	0,00%	3,17%	28 050	33 020 594	11 918
Уголь							
Распадская	rasp	6,520	0,46%	0,40%	205 754	2 937 893	5 091
УК Южный Кузбасс	UKUZ	46,500	4,49%	0,00%	46 500		1 679

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	198,400	0,71%	1,00
Башнефть	AK6		EUR	163,000	5,16%	16,30
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,490	-2,61%	118,52
ТГК-3	AOMD		USD	10,250	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,980	0,00%	10 768,55
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,463	0,59%	11,68
Бурятзолото	BYT		EUR	23,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,010	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,330	-0,08%	1 408,66
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	34,590	-0,09%	18 676,79
X5	FIVE		USD	42,500	2,98%	13 134,17
Газпром	GAZ		EUR	19,135	-0,60%	2 411,19
Иркутскэнерго	IRK		EUR	31,600	0,00%	
ЮТК	KUE		EUR	7,550	2,72%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,750	1,06%	4,30
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,020	-13,56%	
Лукойл	LKOD		USD	57,000	0,53%	294 213,20
Лукойл	LUK		EUR	42,825	1,10%	760,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,450	-0,25%	5 548,06
МТС	MBT	5	USD	20,340	1,70%	77 478,26
МТС	MKY	5	EUR	15,135	2,37%	3,42
МГТС	MOW		EUR	9,650	-1,03%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,650	0,53%	0,85
Мечел	MTL	3	USD	28,090	-1,13%	84 214,37
НорНикель	NILSY	1	USD	23,330	-2,34%	1 937,92
НорНикель	NNIA		EUR	17,710	-0,51%	355,34
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	110,200	0,64%	47 739,51
ВолгаТелеком	NZH		EUR	6,850	5,38%	3,65
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,713	-4,93%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,545	0,45%	
Газпром	OGZD		USD	25,540	-1,01%	439 340,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	28,700	-0,31%	7,52
Ростелеком	RTL		EUR	21,165	0,43%	5,52
Газпромнефть	SCF		EUR	15,820	-0,63%	84,85
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,314	-0,22%	1,83
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,720	0,00%	6,70
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,960	-0,60%	242,55
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,780	0,10%	466,58
АФКСистема	SSA	1	USD	24,990	2,17%	16 750,14
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	44,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	41,000	-6,82%	
ЦУМ	THT		EUR	20,000	17,65%	
Ютэйр	TYV		EUR	39,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	264,400	9,03%	66,92
Уралсвязьинформ	URL		EUR	6,870	0,73%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,100	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,440	1,48%	38 213,34
ВТБ	VTBR		USD	6,640	-0,60%	32 417,75
Возрождение	VZY		EUR	30,500	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,070	0,22%	25 283,72
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,895	1,21%	0,66

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.