ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

14 января 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг фондовые индексы США закрылись незначительным снижением на фоне коррекции в акциях банков и горнодобывающих компаниях. Видимо рынку просто нужна была передышка после нескольких дней непрерывного роста. Наступающий сезон корпоративных отчетов обещает быть сильным, но вместе с этим на биржах существенно возрастет волатильность. После окончания торгов корпорация по производству компьютерных чипов Intel сообщила о рекордной прибыли в прошедшем квартале (прибыль на акцию выросла на 48% г/г до 59 центов) и дала положительные прогнозы на следующий год. Вышедшая вчера макростатистика из Штатов

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 878,14	0,49%	5,96%	7,58%	22,08%
Индекс ММВБ	1 749,75	-0,55%	3,66%	5,01%	21,93%
FTSE	6 023,88	-0,44%	0,07%	2,25%	10,06%
S&P 500	1 283,76	-0,17%	0,78%	3,40%	12,05%
Dow Jones Avg.	11 731,90	-0,20%	0,30%	2,23%	9,84%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ВТБ	0,0037	11,11%	10,78%	41,76%
Возрождение	51,0000	11,11%	22,60%	8,51%
ЧТПЗ	2,9000	9,43%	46,46%	19,83%
ПИК	4,3500	6,23%	-0,46%	-8,42%
Лукойл	63,0500	5,08%	11,79%	17,85%
Аэрофлот	2,7200	4,62%	2,64%	48,39%
ОАО Банк Санкт-	5,8600	3,72%	19,59%	65,07%
Башнефть, п.	37,0000	2,78%	8,03%	102,74%

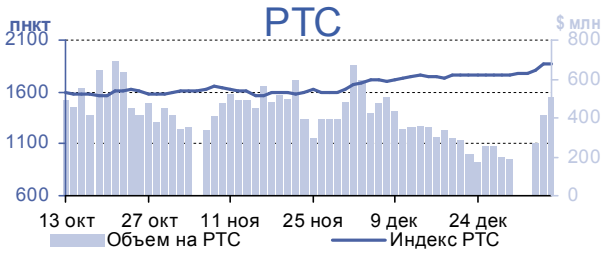
Лидеры снижения

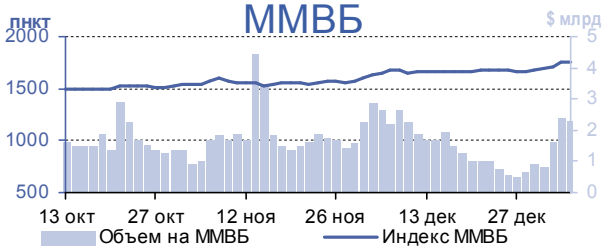
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Дикси	12,8500	-1,91%	-3,02%	35,76%
ОГК-2	0,0600	-1,64%	1,69%	41,18%
Магнит	144,0000	-0,69%	9,09%	95,52%
ОАО Компания М.видео	8,7300	-0,34%	-2,78%	66,60%

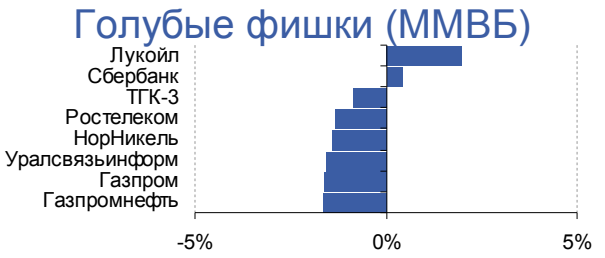
Индекс MSCI

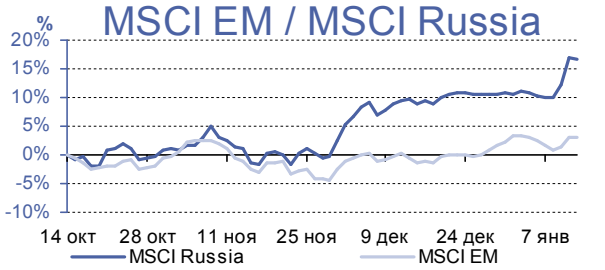
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1163,03	0,00%	3,02%	14,91%
Индекс MSCI BRAZIL	3805,71	-1,09%	4,62%	2,74%
Индекс MSCI RUSSIA	982,37	-0,06%	6,80%	15,18%
Индекс MSCI INDIA	518,06	-2,03%	-3,83%	7,16%
Индекс MSCI CHINA	69,02	0,39%	2,09%	6,60%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В четверг фондовые индексы США закрылись незначительным снижением на фоне коррекции в акциях банков и горнодобывающих компаниях. Видимо рынку просто нужна была передышка после нескольких дней непрерывного роста. Наступающий сезон корпоративных отчетов обещает быть сильным, но вместе с этим на биржах существенно возрастет волатильность. После окончания торгов корпорация по производству компьютерных чипов Intel сообщила о рекордной прибыли в прошедшем квартале (прибыль на акцию выросла на 48% г/г до 59 центов) и дала положительные прогнозы на следующий год. Вышедшая вчера макростатистика из Штатов показала рост базового индекса без учета продуктов питания и энергии на +0,2% м/м, или 1,3% г/г. Продукты питания за месяц подорожали на +0,8%, потребительские товары на +1,5%, энергия +3,7%. Несколько огорчил инвесторов рост числа первичных заявок на пособие по безработице на 35 тыс., при этом показатель за предыдущую неделю также был пересмотрен в сторону повышения, до 410 000.

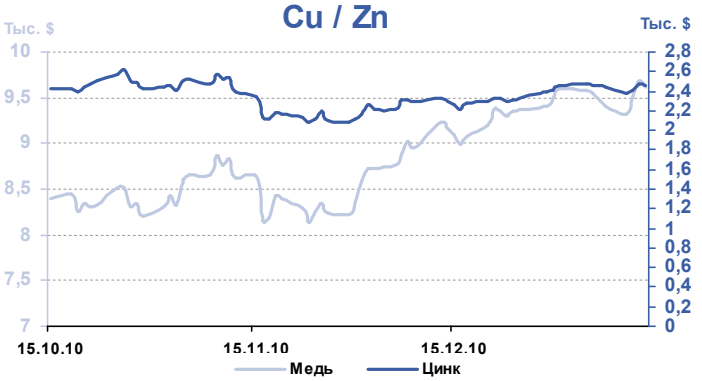
Пара EUR/USD растет уже 4-й день к ряду, достигнув отметки 1,3340, что трейдеры объясняют более-менее удачными аукционами по испанским и итальянским облигациям. Показательно, что ослабление позиций доллара вновь не дает никакой адекватной реакции в ценах на золото ($1376/унц) и на промышленные металлы (медь -0,17%; никель -0,36%). Мартовский фьючерс на смесь Brent котируется сейчас на уровне $97,5/барр. Утренние торги на азиатских биржах проходят без единой динамики фондовых индексов: Nikkei -0,86%; Shanghai Comp -0,9%; Kospi +0,9%.

В пятницу мы ожидаем увидеть открытие торгов нашем рынке акций с небольшим снижением. Сегодня в первой половине дня мы ждем продолжения просадки котировок в индексных бумагах (Газпром, Сбербанк, ГМК) с выходом в консолидацию. Если инвесторов не разочарует, выходящий днем квартальный отчет банка JPMorgan Chase (прогноз прибыли $0,99/акция), то к вечеру мы увидим волну роста. Фаза агрессивного движения нашего рынка вверх уже вчера начала изживать себя, поэтому в ближайшие дни наш рынок либо войдет в зоне высокой волатильности с проторговкой текущих уровней, либо начнет коррекцию, ища точки поддержки. В случае развития негативного сценария индекс ММВБ может легко опуститься на уровень 1715 п.

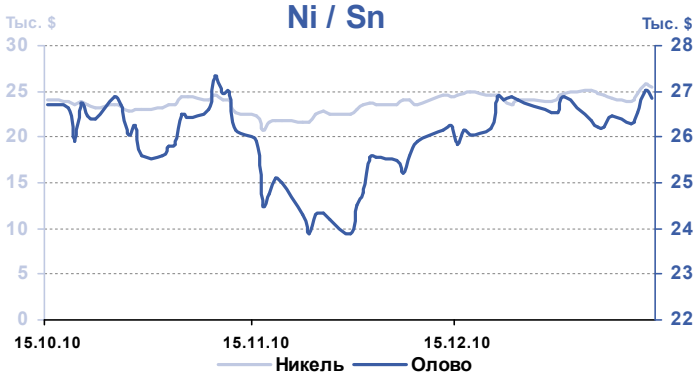
Сегодня в 16-30 в США выходит индекс потребительских цен за декабрь, а также ключевой отчет по уровню розничных продаж (прогноз: 0,7%). В 17-15 ждем публикации индекса инфляционных ожиданий за январь; отчета по промышленному производству (прогноз: 0,4%) и уровню загрузки производственных мощностей за декабрь (прогноз: 75,6%). В 17-55 выходит индекс настроений потребителей от Мичиганского университета (прогноз: 75,5). И, наконец, в 18-00 ждем данных по запасам на оптовых складах (прогноз: 0,8%). Таким образом, корпоративная отчетность сегодня накладывается на важную макростатистику, а значит, торговый день будет очень не простым.

Commodities

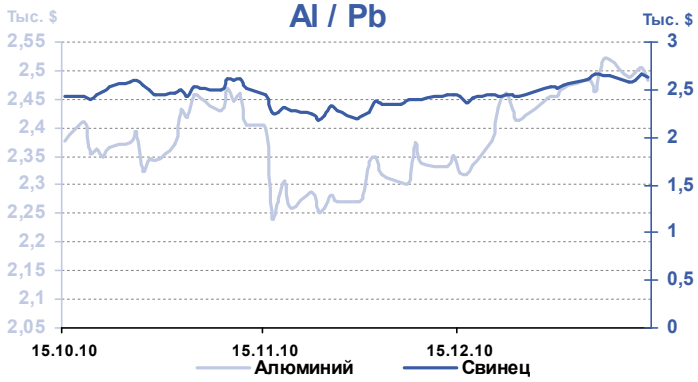
Cu / Zn



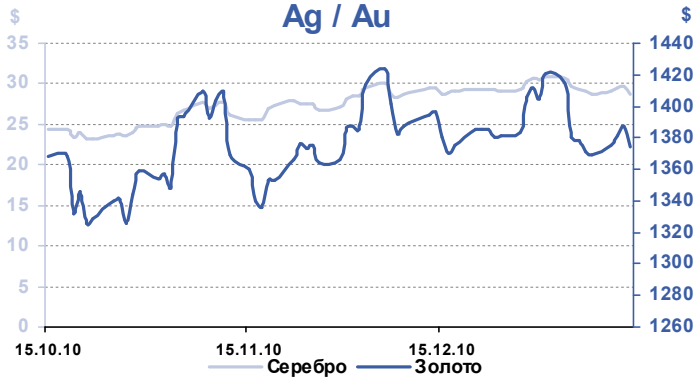
Ni / Sn



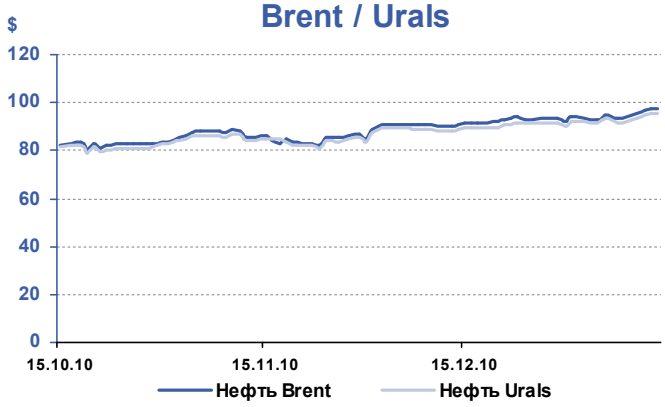
Al / Pb



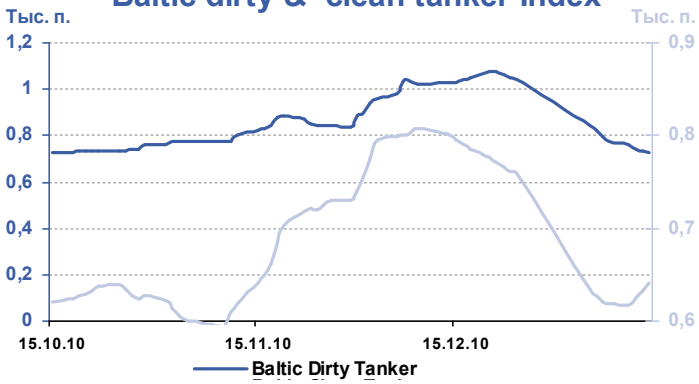
Ag / Au



Brent / Urals



Baltic dirty & clean tanker Index



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 615,00	-0,77%	1,48%	4,91%	28,46%
Цинк, $/t	2 462,00	-0,69%	0,29%	7,04%	-1,08%
Никель, $/t	25 550,00	-0,97%	4,01%	4,29%	39,62%
Олово, $/t	26 850,00	-0,68%	2,38%	2,29%	49,17%
Алюминий, $/t	2 484,00	-0,84%	-1,39%	5,66%	8,28%
Свинец, $/t	2 635,00	-0,98%	-0,79%	7,55%	6,25%
Серебро, $/oz	28,69	-3,32%	-1,35%	-2,64%	54,05%
Золото, $/oz	1 373,78	-1,01%	0,16%	-1,61%	20,70%
Нефть Brent, $/	97,26	-0,07%	3,56%	6,97%	24,95%
Нефть Urals, $/	95,25	-0,07%	2,91%	7,46%	23,08%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,607	0,00%	-0,62%		231 203	303
БашИнСв	BISV	0,226	0,00%	-5,08%		55 747	214
БашЭнрг	BEGY	2,182	0,00%	0,25%		89 084	2 270
ВМЗ	VSMZ	1634,445	0,00%	1,66%		14 710	2 807
ДВМП	FESH	0,560	0,00%	1,21%		200 361	1 643
КазанскВЗ	KHEL	3,532	0,00%	0,29%		53 524	543
КОМСТАР	CMST	6,838	0,00%	-0,49%		13 639	2 862
Мечел	MTLR	31,938	0,00%	-1,29%		5 324 434	13 475
Мотовил	MOTZ	0,102	0,00%	1,73%		31 940	100
Новсибэнрг	NVNG	47,702	0,00%	-4,60%		1 207	653
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1565,000	0,00%	0,00%	15 650		2 688
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,095	0,00%	0,00%	4 744		95
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,980	2,76%	0,00%	442 500		44 691
СилМашины	SILM	0,311	0,00%	-0,24%		276 675	2 729
Сильвинит	SILV	923,928	0,00%	0,74%		3 866 551	7 237
СинТЗ-ао	SNTZ	58,938	0,00%	0,00%		884	371
Славн-ЯНОС	JNOS	0,560	0,00%	1,90%		24 302	526
СТЗ-ао	SVTZ	6,337	0,00%	5,54%		542	303
ТАГМЕТ	TAMZ	0,801	0,00%	0,42%		1 763	408
ТНК-ВР	TNBP	2,981	0,00%	1,90%		4 177 809	44 906
У-УАЗ	UUAZ	2,302	0,00%	-2,12%		42 598	622
ЧМК	CHMK	316,883	0,00%	-2,06%		81 771	1 010
ЧТПЗ	CHEP	2,887	0,00%	1,93%		930 392	1 379
ЮжКузб.	UKUZ	57,039	0,00%	8,57%		2 958 406	2 082
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	44,800	0,34%	0,00%	44 800		7 658
Газпром	GAZP	6,685	1,21%	-1,61%	1 637 825	495 200 615	158 257
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-1,63%	10 625	7 214 921	20 151
Лукойл	LKOH	63,050	5,08%	1,98%	126 100	243 966 006	53 628
Роснефть	ROSN	7,700	0,00%	0,18%	382 000	127 808 863	81 606
Сургутнефтегаз	SNGS	1,175	0,00%	-2,50%		38 400 154	42 508
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	-1,39%	92 121	16 177 452	3 928
Татнефть	TATN	5,200	0,00%	0,00%	52 000		11 329
Татнефть, п.	TATNP	2,973		0,00%	178 180		439
Транснефть, п.	TRNFP	1390,000	0,00%	-1,64%	317 100	19 718 837	2 161
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,100	0,00%	0,00%	210 000		2 190
Иркутскэнерго	IRGZ	0,860	0,00%	0,90%	62 264	389 028	4 099
Ленэнерго	LSNG	0,950	0,00%	-0,56%	950	44 650	880
МОЭСК	MSRS	0,056	0,00%	-2,39%		594 443	2 739
Новосибирскэнерго	NVNG	50,000	0,00%	0,00%	29 150		676
ОГК-2	OGKB	0,060	-1,64%	0,00%	30 000		1 964
ОГК-3	OGKC	0,055	0,00%	-1,57%	27 300	1 838 176	2 593
ОГК-4	OGKD	0,098	0,00%	0,00%	97 568		6 147
ОГК-5	OGKE	0,092	0,00%	-0,67%	436 438	334 164	3 258
Самараэнерго	SAGO	0,017	0,00%	0,00%	21 125		60
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	-0,86%	29 251	2 396 679	4 305
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-1,09%	102 000	161 884	738
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-1,17%		37 338	1 050
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,220	0,00%	0,00%	31 000		209
ВолгаТелеком	NNSI	4,750	0,00%	0,00%	47 500		1 168
Комстар-ОТС	CMST	6,500	0,00%	0,00%	32 500		2 717
МГТС	MGTS	14,000	0,00%	0,00%	14 000		1 118
МГТС, п.	MGTSP	13,700		0,00%	13 700		219
МТС	MTSS	8,540	0,00%	0,00%	85 400		17 023
Ростелеком	RTKM	4,750	0,00%	-1,32%	24 482	16 240 945	3 461
Ростелеком, п.	RTKMP	3,200	0,00%	-2,13%	16 000	16 247 761	777
СЗТ	SPTL	1,100	0,00%	-2,52%	55 000	285 292	969
СибирьТелеком	ENCO	0,091	0,00%	0,00%	45 250		1 087

Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	-0,47%		314 721	149
Уралсвязьинформ	URSI	0,051	0,00%	-1,56%		7 519 245	1 642
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,155	0,00%	-0,66%	138 600	541 603	1 603
ГАЗ	GAZA	38,000	1,60%	0,00%	38 000		704
ИРКУТ	IRKT	0,340	0,00%	-0,73%		82 336	335
КАМАЗ	KMAZ	2,425	0,00%	-0,27%		293 979	1 714
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,250	0,00%	0,00%	10 250		82
ОМЗ	OMZZ	3,436	0,00%	-2,37%		122 434	123
РКК Энергия	RKKE	355,000	0,00%	-6,85%	3 550	2 926	399
Северсталь-авто	SVAV	21,150	0,00%	3,09%	27 601	1 835 585	725
Силовые машины	SILM	0,298	0,00%	0,00%	83 440		2 595
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,600	0,00%	0,00%	43 870		299
Бурятзолото	BRZL	33,000	0,00%	0,00%	75 405		232
ВСМПО	VSMO	122,000	0,00%	-3,16%	61 000	1 468 341	1 407
Мечел	MTLR	30,600	0,00%	0,00%	13 770		12 738
ММК	MAGN	1,185	0,00%	-1,60%		2 555 800	13 469
НЛМК	NLMK	4,770	0,00%	-1,47%		4 558 252	29 065
НорНикель	GMKN	250,000	0,81%	-1,39%	500 000	136 291 363	47 276
Полиметалл	PMTL	18,100	1,12%	-1,89%	8 688	3 026 716	7 189
Полюс Золото	PLZL	61,089	0,00%	-2,39%	21 870	10 051 720	11 645
Северсталь	CHMF	19,080	2,47%	-0,21%	48 351	49 699 223	19 227
СинТЗ	SNTZ	60,000	0,00%	0,00%	90 000		378
ТМК	TRMK	5,150	0,00%	-0,89%	10 300	1 491 651	4 829
ЧТПЗ	CHEP	2,900	9,43%	0,00%	14 500		1 370
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,257	0,00%	7,86%		2 071 070	6 442
Возрождение	VZRZ	51,000	11,11%	4,69%	51 000	641 899	1 211
ВТБ	VTBR	0,004	11,11%	-1,19%	5 550	113 805 850	38 704
РОСБАНК	ROSB	3,826	0,00%	-0,08%		270 808	2 862
Сбербанк	SBER	3,590	1,99%	0,00%	8 262 760		77 497
УРАЛСИБ	USBN	0,008	5,19%	0,00%	24 200		2 370
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,720	4,62%	-0,12%	495 915	1 809 243	3 021
Дальневосточное МП	FESH	0,553	0,82%	0,00%	104 700		1 631
НМТП	NMTP	0,135	0,00%	0,31%	6 750	381 732	2 600
Приморское МП	PRIM	0,195	0,00%	11,30%	48 750	417 628	155
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,700	0,00%	0,00%	16 650		389
Балтика	PKBA	50,000	0,00%	-3,56%	50 000	156 304	7 586
Верофарм	VRPH	51,000	0,00%	0,00%	51 000		510
Вимм-Билль-Данн	WBDF	124,100	0,08%	-0,65%	12 410	890 006	5 460
Дикси	DIXY	12,850	-1,91%	-2,91%	25 850	368 682	1 105
Концерн Калина	KLNA	30,019	0,00%	-0,23%		86 692	292
Красный Октябрь	KROT	11,975	0,00%	0,93%		8 587	111
Магнит	MGNT	144,000	-0,69%	-0,80%	216 000	2 276 745	12 812
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,328	0,00%	-2,24%		78 762	37
Разгуляй	GRAZ	1,688	0,00%	-1,80%		407 553	266
Фармстандарт	PHST	100,500	0,00%	-0,98%	62 009	72 793	3 798
Черкизово	GCHE	29,650	0,00%	-0,28%	177 900	41 844	1 277
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,752	0,00%	0,01%	112 827	59 692	1 212
Уфанефтехим	UFNC	4,537	0,00%	0,00%	272 220		1 249
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	280,000	0,00%	0,00%	7 000		390
ПИК	pikk	4,350	6,23%	0,73%	5 655	9 975 403	2 146
РБК ИС	RBCI	1,758	0,00%	-3,19%	152 146	2 888 728	246
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	37,500	0,00%	-1,94%	224 500	981 998	1 788
Дорогобуж	DGBZ	0,600	0,00%	-2,12%	60 000	143 360	433
Сильвинит	SILV	920,000	1,10%	0,00%	920 000		7 200
Уралкалий	URKA	7,150	0,00%	1,82%	5 005	31 710 491	15 189
Уголь							

Распадская	rasp	7,770	0,13%	-2,40%	77 700	14 737 068	6 067
УК Южный Кузбасс	UKUZ	51,500	0,00%	0,00%	101 000		1 860

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	202,010	-1,45%	3,29
Башнефть	AK6		EUR	168,000	-2,89%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,280	2,40%	16,00
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	-2,22%	55,00
Татнефть	ATAD		USD	35,800	-0,72%	17 736,50
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,386	2,00%	22,91
Бурятзолото	BYT		EUR	24,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,008	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,645	-0,82%	1 419,27
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	40,000	-2,87%	65 266,66
X5	FIVE		USD	46,350	0,32%	16 269,89
Газпром	GAZ		EUR	19,790	-2,49%	2 872,78
Иркутскэнерго	IRK		EUR	33,000	-1,20%	9,90
ЮТК	KUE		EUR	8,200	-0,61%	16,70
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,900	-1,01%	11,67
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,800	4,62%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,000	-1,96%	
Лукойл	LKOD		USD	63,300	2,34%	497 856,90
Лукойл	LUK		EUR	47,415	0,30%	1 902,53
Лукойл	LUKOY	1	USD	63,000	1,61%	6 723,72
МТС	MBT	5	USD	20,600	-0,53%	82 847,87
МТС	MKY	5	EUR	15,315	-2,14%	9,54
МГТС	MOW		EUR	10,250	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	8,100	-1,34%	16,67
Мечел	MTL	3	USD	33,260	-2,46%	110 750,10
НорНикель	NILSY	1	USD	24,550	-1,01%	784,27
НорНикель	NNIA		EUR	18,575	-2,75%	641,28
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	121,100	-0,74%	22 771,64
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,300	1,39%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,858	-4,98%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,275	9,13%	
Газпром	OGZD		USD	26,350	-1,09%	568 311,60
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	35,060	-2,18%	171,72
Ростелеком	RTL		EUR	26,350	-1,86%	16,07
Газпромнефть	SCF		EUR	16,450	-4,08%	230,56
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	8,600	-5,60%	136,83
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,113	-0,92%	10,72
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,580	-0,36%	287,66
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	11,730	-2,17%	527,19
АФКСистема	SSA	1	USD	25,090	-1,61%	14 250,22
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	44,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	44,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	345,150	4,59%	111,39
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,550	-2,27%	28,25
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,980	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,340	-1,98%	34 977,64
ВТБ	VTBR		USD	7,250	0,62%	39 769,98
Возрождение	VZY		EUR	36,250	2,84%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	33,440	-0,09%	4 548,49
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	24,685	-1,85%	

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

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@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.