ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

18 февраля 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг торги на фондовых биржах США завершились очередным ростом фондовых индексов. Лидерами спроса стали акции компаний энергетического и сырьевого секторов, а вот финансовый сектор торговался несколько хуже рынка. Индекс S&P-500 вырос уже вдвое по сравнению с минимумами 2009 года, и достиг до уровней своих 32-месячных максимумов. В условиях сохранения «бычьего» тренда инвесторы, как всегда не рефлексировали на слабую макростатистику (рост числа обращений за пособиями по безработице на +25 тыс., до 410 тыс.; рост потребительской инфляции в январе (+0,4%) превысил прогноз (+0,3%)). Напротив, данные по деловой активности в

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 871,59	-0,31%	1,34%	-1,54%	31,62%
Индекс ММВБ	1 692,91	-0,83%	0,96%	-4,10%	25,02%
FTSE	6 087,38	0,03%	1,12%	0,51%	15,36%
S&P 500	1 340,43	0,31%	1,40%	3,51%	21,91%
Dow Jones Avg.	12 318,14	0,24%	0,73%	4,06%	19,49%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ВТБ	0,0034	6,25%	-5,82%	25,93%
ОАО Группа ЛСР	40,3700	5,27%	4,86%	-6,12%
ОГК-2	0,0540	2,66%	-8,94%	-12,90%
ТГК-3	0,1057	2,22%	-1,67%	-22,34%
ОАО Компания М.видео	9,8500	1,55%	13,22%	64,99%
Северсталь	18,2000	1,39%	-7,29%	28,17%
СибирьТелеком	0,0980	1,03%	8,29%	46,27%
Башнефть	49,5000	1,02%	9,27%	16,47%

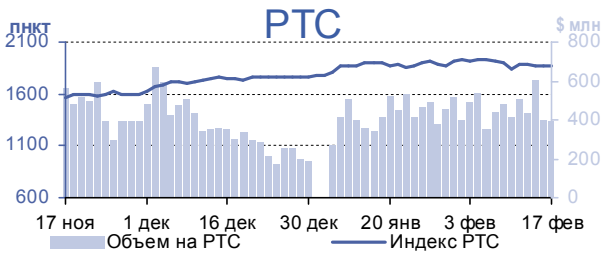
Лидеры снижения

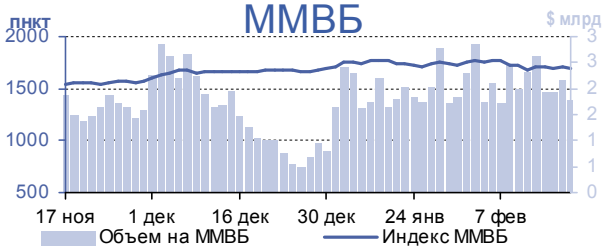
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Татнефть	5,6500	-4,40%	5,41%	11,88%
Сургутнефтегаз, п.	0,5700	-3,39%	11,76%	-5,63%
Возрождение	43,7500	-1,13%	-14,22%	9,92%
Распадская	7,4450	-0,60%	-3,31%	-3,31%

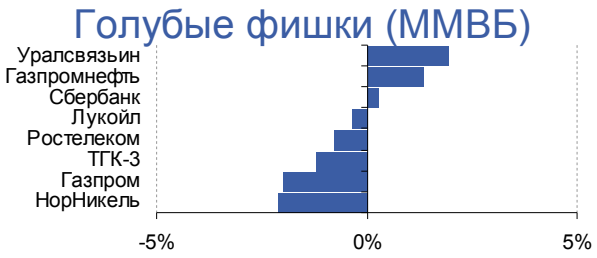
Индекс MSCI

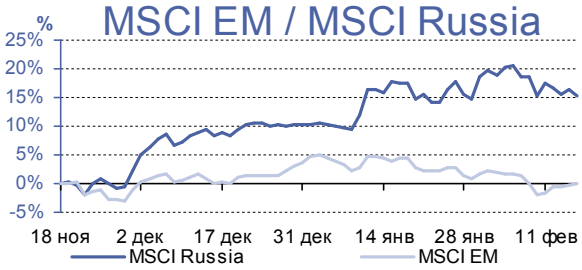
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1111,92	0,30%	-4,06%	17,65%
Индекс MSCI BRAZIL	3695,97	0,50%	-2,86%	9,79%
Индекс MSCI RUSSIA	972,64	-0,94%	-2,01%	23,87%
Индекс MSCI INDIA	494,46	1,45%	-3,70%	10,03%
Индекс MSCI CHINA	65,38	0,66%	-3,96%	7,70%

Основные индикаторы









Обзор рынка

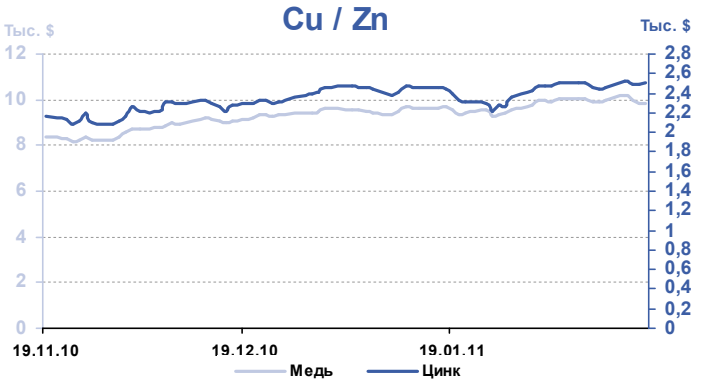
В четверг торги на фондовых биржах США завершились очередным ростом фондовых индексов. Лидерами спроса стали акции компаний энергетического и сырьевого секторов, а вот финансовый сектор торговался несколько хуже рынка. Индекс S&P-500 вырос уже вдвое по сравнению с минимумами 2009 года, и достиг до уровней своих 32-месячных максимумов. В условиях сохранения «бычьего» тренда инвесторы, как всегда не рефлексировали на слабую макростатистику (рост числа обращений за пособиями по безработице на +25 тыс., до 410 тыс.; рост потребительской инфляции в январе (+0,4%) превысил прогноз (+0,3%)). Напротив, данные по деловой активности в обрабатывающем секторе ФРБ-Филадельфии за февраль (35,9 пунктов – максимум с января 2004 года) и седьмой месяц подъема индекса опережающих индикаторов (+0,1%) вселили уверенность в том, что бизнес процессы в стране стабильны и будущие прибыли обещают быть хорошими. Это и позволило инвесторам продолжить ралли на заокеанских биржах.

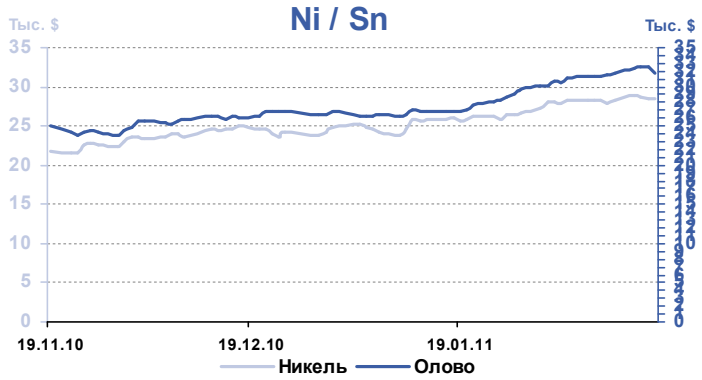
Валютная пара EUR/USD пытается торговаться в восходящем тренде, тестируя на прочность уровень 1,3620. Вчерашние торги нефтяными фьючерсами в США завершились ростом котировок до максимальных ценовых уровней этой недели ($86,1/барр) на фоне сохранения народных беспорядков в Бахрейне, Йемене и Ливии а также из-за напряженности вокруг Суэцкого канала. А вот цены на смесь Brent остались неизменными ($102,5/барр), поэтому рекордный спред между этими сортами нефти сузился до $16,5. Пятничные торги на азиатских фондовых биржах проходят в позитивном ключе, хотя оптимизм игрокам там несколько испортил индекс опережающих индикаторов КНР, который снизился впервые с 2008 года, показав значение 154,3 пункта (-0,5%).

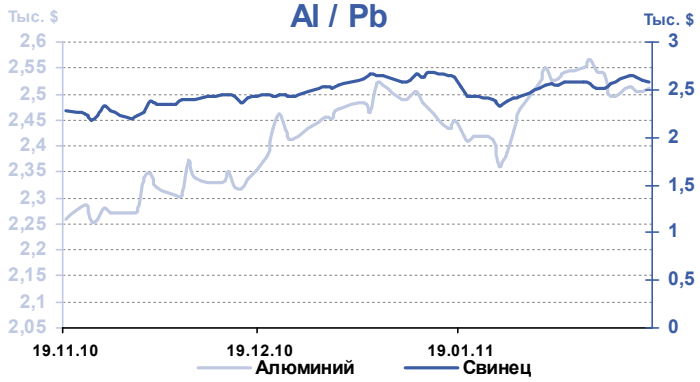
Открытие торгов на российских биржах в пятницу мы ожидаем увидеть опять в зоне роста и опять за счет перманентного позитива на Уолл-стрит. Неужели мы опять с утра пойдем вниз, копирую сценарий предыдущих дней? Все уже обратили внимание на отставание в темпах движения развитых рынков и EM. С учетом сохранения большой бэквордации по фьючерсу на индекс РТС, крупные игроки пока делают ставки на то, чтобы двинуть наши рынки ниже, для покупок по более привлекательным ценам. Ведь раскореляция между настроениями биржевых игроков там и здесь не будет длиться долго. Несмотря на то, что вчера вечером индекс ММВБ завершил день на дневных минимумах, серьезных продаж в ликвидных бумагах не было. Это дает шанс на то, что сегодня после непродолжительной утренней проторговки «быки» все же смогут развернуть рынок выше. Тем более, что индекс ММВБ вчера опустился на зыбкий уровень поддержки на линии краткосрочного восходящего тренда на уровне 1692 пункта.

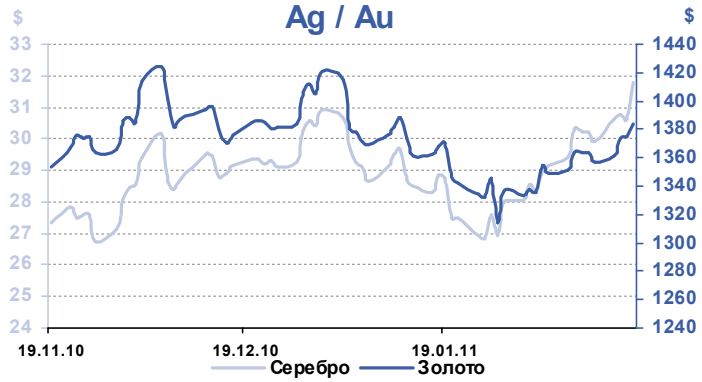
Сегодня в 12-30 ждем выхода данных по розничным продажам в Великобритании в январе. Статистики из США никакой не выходит, зато будет много важных выступлений: в 16-00 следит за речью главы ФРС США Бена Бернанке, в 16-20 выступает глава Банка Англии Мервин Кинг, а в 17-45 следим за выступлением министра финансов США Тимоти Гейтнера.

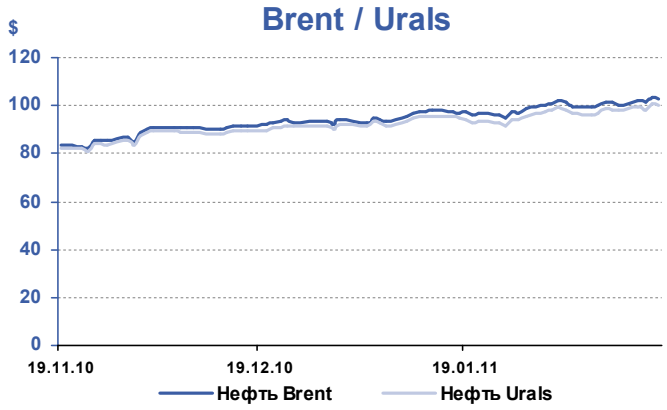
Commodities

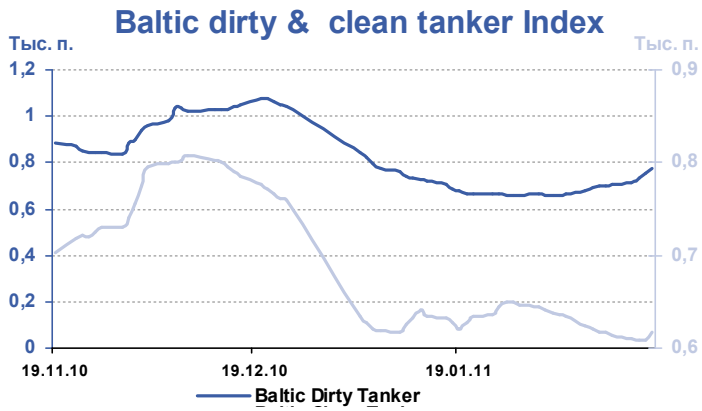












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 805,00	-0,38%	-1,36%	1,08%	37,52%
Цинк, $/t	2 512,00	1,05%	2,53%	3,12%	9,22%
Никель, $/t	28 490,00	-0,30%	2,30%	9,16%	41,46%
Олово, $/t	31 650,00	-2,62%	0,49%	17,55%	88,96%
Алюминий, $/t	2 512,00	0,32%	-1,00%	2,53%	18,38%
Свинец, $/t	2 585,00	-0,27%	2,99%	-1,47%	12,88%
Серебро, $/oz	31,78	3,69%	5,18%	10,06%	100,28%
Золото, $/oz	1 384,10	0,70%	1,49%	1,16%	25,05%
Нефть Brent, $/	102,46	-1,22%	0,93%	5,53%	35,69%
Нефть Urals, $/	100,02	-1,02%	1,75%	5,33%	40,14%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,622	0,00%	0,28%		16 302	309
БашИнСв	BISV	0,393	0,00%	10,99%		159 117	355
БашЭнрг	BEGY	1,892	0,00%	1,35%		48 068	1 952
ВМЗ	VSMZ	1708,409	0,00%	-1,19%		17 118	2 940
ДВМП	FESH	0,552	0,00%	-2,36%		28 567	1 637
КазанскВЗ	KHEL	3,465	0,00%	-1,38%		25 070	537
КОМСТАР	CMST	6,998	0,00%	2,09%		180 900	2 899
Мечел	MTLR	31,369	0,00%	0,23%		451 468	13 154
Мотовил	MOTZ	0,095	0,00%	3,57%		38 621	95
ОАО Банк Москвы	MMBM	34,000	0,00%	0,00%	17 000		6 120
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,090	0,00%	0,00%	9 000		89
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,990	-0,33%	0,00%	29 900		44 841
СилМашины	SILM	0,355	0,00%	0,83%		14 841	3 070
Сильвинит	SILV	970,376	0,00%	-0,44%		707 355	7 593
СинТЗ-ао	SNTZ	57,637	0,00%	0,00%		2 496	365
Славн-ЯНОС	JNOS	0,506	0,00%	-0,07%		2 023	472
СТЗ-ао	SVTZ	6,150	0,00%	0,09%		354	299
ТАГМЕТ	TAMZ	0,786	0,00%	-1,71%		6 290	400
ТНК-ВР	TNBP	2,990	0,00%	0,17%		327 281	44 785
У-УАЗ	UUAZ	2,376	0,00%	0,78%		33 685	638
ЧМК	CHMK	324,598	0,00%	-0,11%		286 584	1 036
ЧТПЗ	CHEP	2,768	0,00%	0,00%		428 105	1 300
ЮжКузб.	UKUZ	55,695	0,00%	-0,30%		24 243	2 031
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	49,500	1,02%	0,00%	265 518		8 423
Газпром	GAZP	6,850	0,00%	-1,98%	345 000	468 699 811	162 164
Газпромнефть	SIBN	4,750	0,00%	1,36%	7 467	4 042 216	22 521
Лукойл	LKOH	65,800	0,00%	-0,37%	65 800	108 664 143	55 874
НОВАТЭК	NVTK	10,800	0,00%	0,00%	324 000		32 792
Роснефть	ROSN	8,762	0,14%	-0,19%	39 723	99 447 761	92 863
Сургутнефтегаз	SNGS	1,076	0,00%	-0,95%		15 142 960	38 701
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,570	-3,39%	-1,31%	226 404	6 913 731	4 390
Татнефть	TATN	5,650	-4,40%	0,00%	393 319		12 310
Татнефть, п.	TATNP	3,215	0,00%	0,00%	96 450		474
Транснефть, п.	TRNFP	1301,500	0,00%	-0,30%	13 133 496	6 354 526	2 024
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,820	0,00%	1,00%	43 788	49 470	3 909
Ленэнерго	LSNG	0,920	0,00%	2,13%	9 200	13 542	852
МОЭСК	MSRS	0,054	0,00%	-0,32%	161 300	387 345	2 620
Новосибирскэнерго	NVNG	52,000	0,00%	0,00%	18 408		676
ОГК-2	OGKB	0,054	2,66%	0,00%	54 000		1 768
ОГК-3	OGKC	0,050	0,00%	-1,11%	311 950	1 168 045	2 374
ОГК-4	OGKD	0,094	0,00%	0,00%	22 545		5 895
ОГК-5	OGKE	0,091	0,00%	-0,11%	45 500	445 334	3 219
ТГК-3	MSNG	0,106	2,22%	-1,21%	19 026	1 842 540	4 202
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%	5 702	72 373	750
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,62%		93 257	1 031
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,330	0,00%	0,00%	99 000		313
ВолгаТелеком	NNSI	5,100	0,00%	0,00%	102 000		1 254
Дальсвязь	ESPK	4,950	0,00%	0,00%	5 629 852		473
МГТС, п.	MGTSP	13,800	0,00%	0,00%	69 000		220
МТС	MTSS	8,430	0,00%	0,00%	58 579		16 804
Ростелеком	RTKM	5,457	0,00%	-0,76%		2 302 431	3 991
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	1,49%	10 323	7 148 256	728
СЗТ	SPTL	1,100	0,00%	1,27%	11 000	312 502	969
СибирьТелеком	ENCO	0,098	1,03%	0,00%	49 000		1 177
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	5,38%		286 222	166
Уралсвязьинформ	URSI	0,055	0,00%	1,97%	981 900	7 221 168	1 762
ЮТК	KUBN	0,228	0,00%	0,00%	79 800		675

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	1,072	0,00%	-0,44%		424 765	1 508
ГАЗ	GAZA	51,500	0,00%	0,00%	626 250		954
ИРКУТ	IRKT	0,391	0,00%	1,41%		102 861	381
Казанский ВЗ	KHEL	3,449	0,00%	0,00%	34 487		531
КАМАЗ	KMAZ	2,833	0,00%	1,72%		1 049 563	1 996
Кировский завод	KIRZ	8,000		0,00%	8 000		87
Красный Котельщик	KRKO	0,650	0,00%	0,00%	13 000		139
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,500	0,00%	0,00%	23 500		96
ОМЗ	OMZZ	3,009	0,00%	0,62%		45 437	107
РКК Энергия	RKKE	335,000	0,00%	-0,99%	33 500	18 400	376
Северсталь-авто	SVAV	21,300	0,00%	0,94%	69 548	885 339	730
Силовые машины	SILM	0,365	0,00%	0,00%	36 500		3 179
УМПО	UFMO	0,630	0,00%	0,00%	31 500		179

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,620	0,00%	0,00%	77 500		309
ВСМПО	VSMO	120,600	0,50%	-0,57%	22 914	955 493	1 390
Мечел	MTLR	30,000	0,00%	0,00%	60 000		12 488
ММК	MAGN	1,075	0,00%	-0,06%	591 750	2 388 245	12 012
НЛМК	NLMK	4,285	0,00%	-1,04%		3 034 076	26 080
НорНикель	GMKN	239,000	0,00%	-2,12%	239 000	109 954 672	45 560
Полиметалл	PMTL	17,100	0,00%	0,68%	18 331	1 105 596	6 829
Полюс Золото	PLZL	55,933	0,00%	0,00%		3 426 764	10 704
Северсталь	CHMF	18,200	1,39%	-0,67%	144 790	33 084 941	18 340
ТМК	TRMK	4,940	0,00%	-0,28%		641 868	4 667
ЧМЗ	CHMZ	7,370	0,00%	0,00%	18 424		17
ЧТПЗ	CHEP	2,730	0,00%	0,00%	99 208		1 290

Банки

Банк Москвы	MMBM	41,856	0,00%	-0,24%		83 650	7 582
Возрождение	VZRZ	43,750	-1,13%	-1,03%	21 875	171 706	1 039
ВТБ	VTBR	0,003	6,25%	-1,42%	221 303	103 470 182	35 566
РОСБАНК	ROSB	4,000	0,00%	0,27%	6 000	16 657	4 975
Сбербанк	SBER	3,450	0,00%	0,00%	2 561 650		74 475
УРАЛСИБ	USBN	0,009	2,27%	0,00%	9 000		2 633

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,480	0,00%	1,28%	124 000	2 964 733	2 754
Дальневосточное МП	FESH	0,554	0,00%	0,00%	83 100		1 635
НМТП	NMTP	0,140	0,00%	0,80%	42 980	148 041	2 696
Приморское МП	PRIM	0,210	0,00%	-2,44%	21 000	308 118	167

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,700	0,00%	0,00%	7 400		389
Балтика	PKBA	44,000	0,00%	-0,63%	22 000	583 542	6 675
Верофарм	VRPH	47,950	0,00%	0,00%	23 975		480
Вимм-Билль-Данн	WBDF	127,500	0,39%	0,11%	254 500	2 446 865	5 610
Дикси	DIXY	13,840	0,29%	0,37%	914 050	485 742	1 190
Концерн Калина	KLNA	29,113	0,00%	0,87%		5 022	281
Красный Октябрь	KROT	12,714	0,00%	0,57%		15 492	117
Магнит	MGNT	128,500	0,00%	0,26%	109 225	1 237 303	11 433
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,000	0,00%	0,43%	400	341 566	32
Разгуляй	GRAZ	2,700	0,00%	-2,45%	135 000	907 305	427
Седьмой континент	SCON	9,950	0,00%	0,00%	9 642		746
Фармстандарт	PHST	101,800	0,00%	-0,25%	26 977	21 582	3 847
Черкизово	GCHE	31,000	0,00%	1,09%	31 000	480 723	1 335

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,260	0,00%	0,00%	13 000		464
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,758	0,00%	0,47%	37 919	20 883	1 222
Уфанефтехим	UFNC	4,300	0,00%	0,00%	174 500		1 184
Уфаоргсинтез	UFOS	3,500	0,00%	0,00%	35 000		342

Другие сектора

МСЗ, Электросталь	MASZ	270,000	0,00%	0,00%	27 000		376
ПИК	pikk	4,450	0,00%	0,38%	15 008	5 168 826	2 195
РБК ИС	RBCI	1,613	0,00%	0,08%		771 348	226

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	46,000	0,00%	-3,48%	23 000	2 916 900	2 194
Дорогобуж	DGBZ	0,650	0,00%	-2,68%	36 038	78 924	469

Сильвинит	SILV	965,000	-0,52%	0,00%	48 250		7 591
Уралкалий	URKA	7,730	0,00%	-0,24%	38 650	15 858 557	16 422

Уголь

Белон	BLNG	0,860	0,00%	0,00%	86 000		989
Распадская	rasp	7,445	-0,60%	0,27%	223 350	3 932 058	5 813
УК Южный Кузбасс	UKUZ	59,000	0,00%	0,00%	117 700		2 130

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	182,760	1,16%	5,45
Башнефть	AK6		EUR	181,000	4,02%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,590	3,25%	38,75
ТГК-3	AOMD		USD	10,330	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	38,270	-0,60%	11 977,26
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,839	-0,65%	11,07
Бурятзолото	BYT		EUR	24,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,008	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,850	1,93%	958,06
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	38,210	-0,42%	50 472,11
X5	FIVE		USD	39,500	0,23%	30 726,70
Газпром	GAZ		EUR	19,810	-1,12%	1 836,47
Иркутскэнерго	IRK		EUR	30,250	-3,97%	5,89
ЮТК	KUE		EUR	8,600	3,61%	8,60
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,650	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,500	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	-10,00%	
Лукойл	LKOD		USD	65,250	-0,08%	191 515,40
Лукойл	LUK		EUR	48,015	-0,82%	742,08
Лукойл	LUKOY	1	USD	65,420	-0,37%	2 432,63
МТС	MBT	5	USD	19,530	-0,96%	92 919,85
МТС	MKY	5	EUR	14,230	-0,91%	10,18
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,720	-0,39%	4,35
Мечел	MTL	3	USD	32,290	0,97%	48 215,71
НорНикель	NILSY	1	USD	23,290	-2,55%	1 480,54
НорНикель	NNIA		EUR	17,025	-3,62%	305,90
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	119,000	0,00%	46 901,56
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,350	0,68%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,664	-5,01%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,550	2,78%	
Газпром	OGZD		USD	26,700	-1,84%	521 808,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,870	-0,12%	277,88
Ростелеком	RTL		EUR	24,450	-1,21%	2,45
Газпромнефть	SCF		EUR	17,400	0,58%	300,34
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,861	-0,10%	57,54
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,140	-2,10%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,610	-1,92%	182,96
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,870	-0,46%	26,04
АФКСистема	SSA	1	USD	25,100	2,45%	36 870,77
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	24,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	39,000	2,63%	
ЦУМ	THT		EUR	20,000	-20,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	39,425	0,45%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	411,750	-0,24%	2,06
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,810	-0,32%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,800	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,420	0,35%	39 668,07
ВТБ	VTBR		USD	6,650	-0,75%	109 911,40
Возрождение	VZY		EUR	31,000	-4,62%	8,13
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,490	0,65%	3 688,69
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,645	0,15%	

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.