ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

25 февраля 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг фондовые индексы США закрылись разнонаправлено. В плюсовой зоне завершил торги индекс Nasdaq (+0,55%), в то время как Dow Jones (-0,31%) и S&P-500 (-0,1%) понесли небольшие потери. Разнополярной была и макростатистика выходившая вчера: ослабление безработицы (заявки на пособия упали на 22 тыс. до 391 тыс.) и рост объема заказов на товары длительного пользования (+2,7%) соседствовали с падением продаж новых домов в январе (-12,6%) на фоне очередного снижения цен на жилье. На этом фоне акции домостроительных компаний оказались под давлением продаж. Из-за коррекции в ценах на нефть (котировки WTI опустились с 102,5 до 96 $/барр.)

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 901,14	0,63%	1,58%	2,03%	35,65%
Индекс ММВБ	1 715,20	0,15%	1,32%	-0,06%	28,52%
FTSE	5 919,98	-1,58%	-2,75%	0,04%	10,80%
S&P 500	1 306,10	-2,75%	-2,56%	1,16%	18,17%
Dow Jones Avg.	12 068,50	-2,60%	-2,03%	0,76%	16,33%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Татнефть	6,0400	6,90%	9,22%	21,29%
Газпром	7,2000	5,66%	12,50%	20,00%
Лукойл	69,2500	4,45%	7,36%	18,93%
Транснефть, п.	1340,0000	2,96%	3,25%	18,58%
ОАО РОСИНТЕР	24,6000	1,44%	8,37%	64,00%
Татнефть, п.	3,5100	0,57%	15,08%	12,86%
Фармстандарт	102,0000	0,20%	0,00%	26,16%

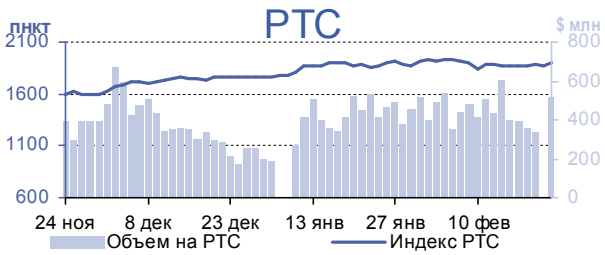
Лидеры снижения

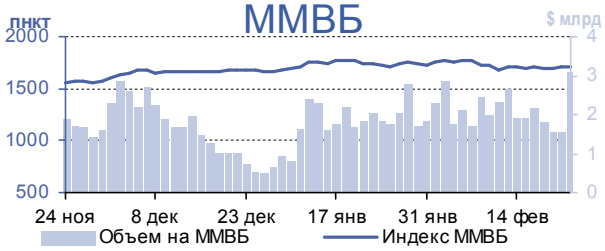
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь	17,0816	-6,15%	-8,54%	24,53%
ОАО Группа ЛСР	40,0000	-5,59%	10,80%	7,38%
Магнит	124,0000	-4,98%	-9,82%	41,71%
НорНикель	228,0000	-4,60%	-9,16%	18,75%

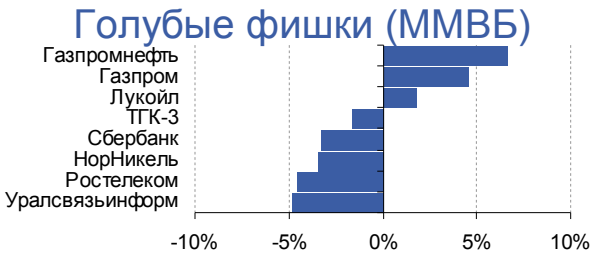
Индекс MSCI

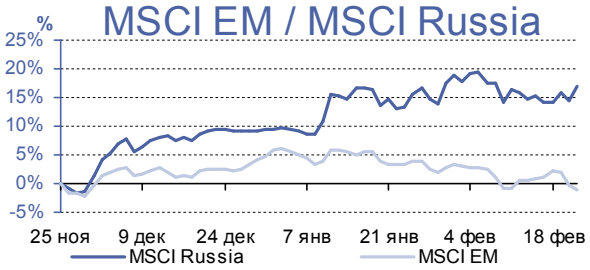
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1087,10	-2,98%	-4,30%	16,49%
Индекс MSCI BRAZIL	3653,92	-0,28%	-2,05%	10,18%
Индекс MSCI RUSSIA	996,00	1,02%	3,26%	28,14%
Индекс MSCI INDIA	469,49	-5,50%	-7,42%	6,33%
Индекс MSCI CHINA	62,70	-4,78%	-5,68%	4,19%

Основные индикаторы









Обзор рынка

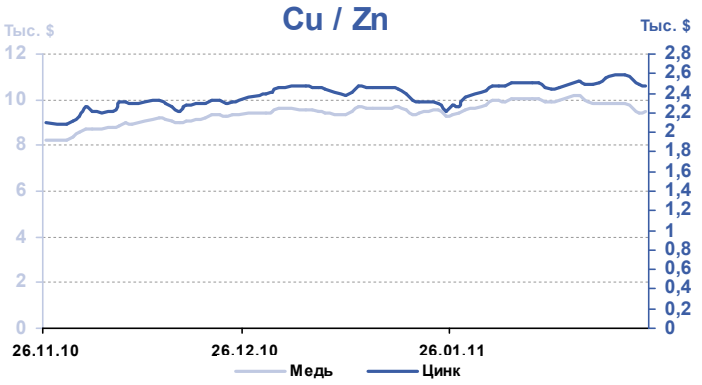
В четверг фондовые индексы США закрылись разнонаправлено. В плюсовой зоне завершил торги индекс Nasdaq (+0,55%), в то время как Dow Jones (-0,31%) и S&P-500 (-0,1%) понесли небольшие потери. Разнополярной была и макростатистика выходившая вчера: ослабление безработицы (заявки на пособия упали на 22 тыс. до 391 тыс.) и рост объема заказов на товары длительного пользования (+2,7%) соседствовали с падением продаж новых домов в январе (-12,6%) на фоне очередного снижения цен на жилье. На этом фоне акции домостроительных компаний оказались под давлением продаж. Из-за коррекции в ценах на нефть (котировки WTI опустились с 102,5 до 96 $/барр.) индекс нефтяного сектора акций вчера снизился на 1,36%. В ходе вчерашних торгов индекс S&P пробивал вниз уровень 1300 п., однако, по итогам сессии все же сумел закрепиться выше этой знаковой отметки (1306,1 п.).

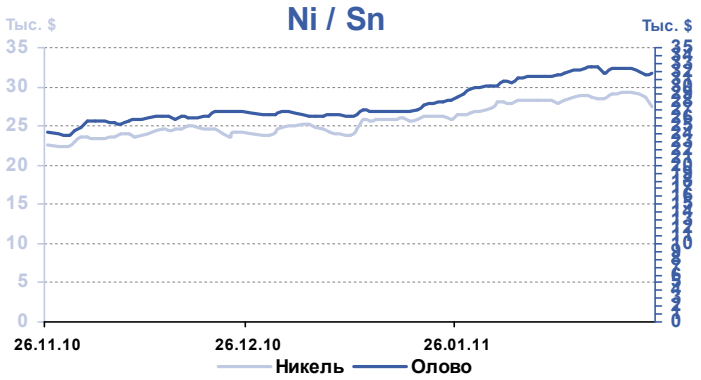
Курс евро поднялся до новых 3-недельных максимумов против доллара (1,3830) на ожиданиях разбалансировки базовых ставок в США и Еврозоне. Так, вчера Президент Бундесбанка Аксель Вебер заявил, что процентные ставки в еврозоне могут, лишь вырасти с текущего уровня. Напротив, его коллега из ФРБ - Сент-Луиса Джеймс Буллард сообщил, что не исключает третьего раунда количественного смягчения. Нефть марки Brent вечером в четверг упала до отметки $110/барр, однако пятницу утром ее котировки опять восстанавливаются ($112,8/барр). Вчерашнему обвалу цен на нефть способствовало повышение маржинальных требований для нефтяных контрактов биржами ICE и Nymex, плюс к этому Саудовская Аравия пообещала восполнить недостаток ливийской нефти на рынке. Кстати, стоимость топлива на заправках в США сейчас достигла самых высоких показателей за более чем за два года: в среднем по стране цена на бензин там составляет около $ 3,23 за галлон, против $3,08 в начале января этого года. Цены на природный газ подешевели на 6,4%, вероятно после того, как Россия пообещала компенсировать Европе возможный срыв поставок газа из Ливии.

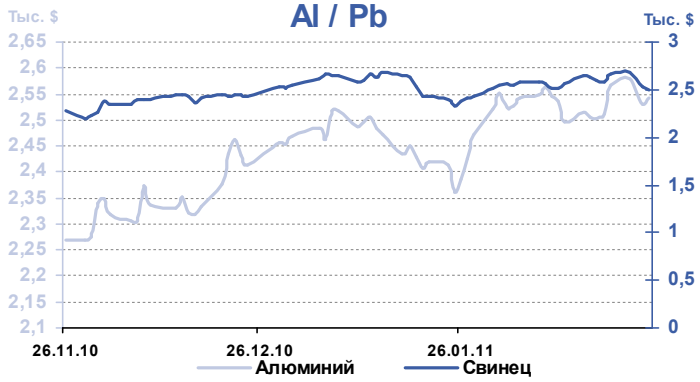
Внешний фон на открытие российского рынка акций выглядит довольно смешанным. Вчерашнее падение цен на нефть и слабое закрытие биржевых торгов в Штатах, сегодня утром компенсируются ростом фьючерсов (S&P +0,38%), восстановлением цен на рынке промышленных металлов (медь +0,7%; никель +0,6%), а также позитивной динамикой торгов в Азии (MSCI Asia +1,15%). В этой связи на наших биржах стоит ждать сегодня непродолжительной утренней просадки и попыток роста днем. Если вчера в лидерах роста были бумаги нефтяного сектора, то сегодня стоит ждать постепенного восстановления бумаг банков (здесь мы делаем ставку на ВТБ), а также коррекционное восстановление акций компаний энергетики и металлургов. Индекс ММВБ сумел закрепиться в четверг выше важной отметки 1710 п., однако на пути дальнейшего подъема находится ближайшее сопротивление на 1722 п., пробой которого поднимет индекс еще на 10 пунктов.

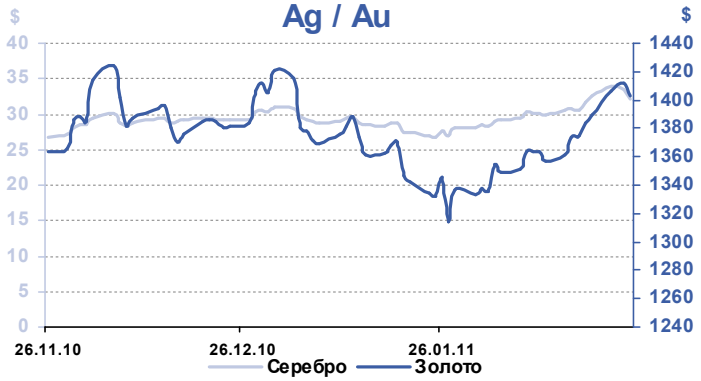
Сегодня в 12-30 выходят данные по росту ВВП Великобритании за 4 кв. В 15-00 ждем статистики из Германии по индексу потребительских цен. В 16-30 будет опубликован отчет по ВВП США за 4 кв. А в 17-55 Университет Мичигана представят отчёт с окончательными данными по индексу потребительского доверия США за февраль.

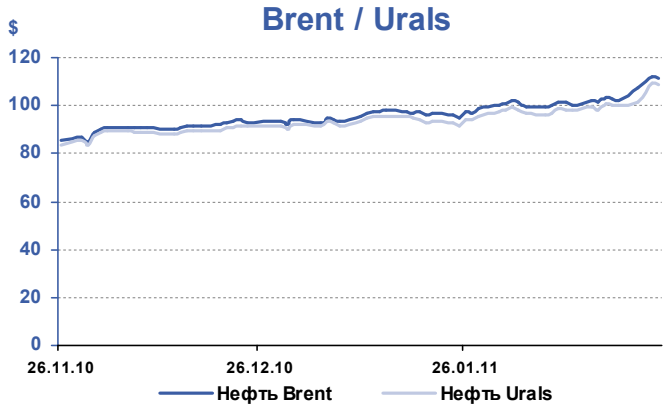
Commodities

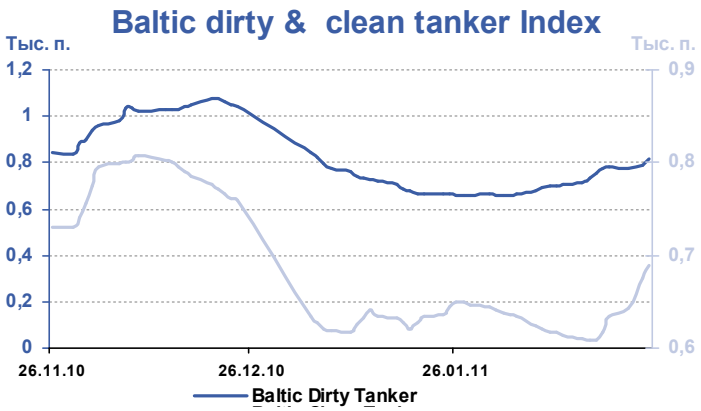












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 502,00	-3,14%	-3,09%	2,72%	32,85%
Цинк, $/t	2 473,00	-4,74%	-1,55%	11,35%	12,21%
Никель, $/t	27 505,00	-6,13%	-3,46%	6,20%	34,33%
Олово, $/t	31 650,00	-2,16%	0,00%	12,25%	86,45%
Алюминий, $/t	2 541,00	-1,51%	1,15%	7,62%	18,91%
Свинец, $/t	2 500,00	-6,54%	-3,29%	6,97%	12,87%
Серебро, $/oz	32,15	-5,13%	1,19%	19,78%	101,33%
Золото, $/oz	1 402,88	-0,25%	1,36%	5,30%	27,80%
Нефть Brent, $/	111,24	3,58%	8,57%	17,56%	43,37%
Нефть Urals, $/	108,58	7,19%	8,56%	18,95%	43,00%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,603	0,00%	-2,85%		188 628	299
БашИнСв	BISV	0,395	0,00%	-23,66%		38 100	379
БашЭнрг	BEGY	1,821	0,00%	-1,22%		38 640	1 896
ВМЗ	VSMZ	1724,394	0,00%	0,00%		29 318	2 962
ДВМП	FESH	0,539	0,00%	-2,01%		15 278	1 593
КазанскВЗ	KHEL	3,411	0,00%	-3,04%		33 294	524
КОМСТАР	CMST	6,942	0,00%	-1,57%		97 965	2 894
Мечел	MTLR	29,935	0,00%	-5,65%		4 257 732	12 393
Мотовил	MOTZ	0,097	0,00%	-1,40%		2 243	94
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,090	0,00%	0,00%	9 000		89
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,020	1,34%	0,00%	726 300		45 291
СилМашины	SILM	0,338	0,00%	-3,00%		129 428	2 886
Сильвинит	SILV	941,553	0,00%	-5,13%		775 015	7 396
СинТЗ-ао	SNTZ	62,009	0,00%	10,31%		26 067	381
Славн-ЯНОС	JNOS	0,509	0,00%	1,55%		3 308	475
СТЗ-ао	SVTZ	5,878	0,00%	-1,23%		326	285
ТАГМЕТ	TAMZ	0,775	0,00%	-3,15%		305	388
ТНК-ВР	TNBP	3,035	0,00%	0,28%		2 518 758	45 711
У-УАЗ	UUAZ	2,380	0,00%	-0,72%		3 074	632
ЧМК	CHMK	289,698	0,00%	-2,44%		798 271	928
ЧТПЗ	CHEP	2,791	0,00%	-2,86%		753 689	1 315
ЮжКузб.	UKUZ	53,058	0,00%	-5,03%		184 008	1 904
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	49,500	0,00%	0,00%	30 542		8 423
Газпром	GAZP	7,200	5,66%	4,59%	1 060 825	1 042 990 752	170 449
Газпромнефть	SIBN	4,950	0,00%	6,71%	99 000	18 466 864	23 469
Лукойл	LKOH	69,250	4,45%	1,85%	1 369 600	299 350 289	58 902
НОВАТЭК	NVTK	10,800	0,00%	0,00%	324 000		32 792
Роснефть	ROSN	8,895	0,00%	4,23%	117 350	206 544 669	94 269
Сургутнефтегаз	SNGS	1,138	0,00%	1,17%		45 125 653	40 332
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,570	0,00%	0,88%	226 404	16 514 374	4 390
Татнефть	TATN	6,040	6,90%	0,00%	302 000		13 159
Татнефть, п.	TATNP	3,510	0,57%	0,00%	70 200		518
Транснефть, п.	TRNFP	1340,000	2,96%	-2,02%	359 120	16 985 257	2 084
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,795	-3,11%	-2,86%	7 587	334 005	3 787
Ленэнерго	LSNG	0,920	0,00%	-2,87%	9 200	65 193	852
МОЭСК	MSRS	0,054	0,00%	0,80%	161 300	367 908	2 620
Новосибирскэнерго	NVNG	52,000	0,00%	0,00%	18 408		676
ОГК-2	OGKB	0,054	0,00%	0,00%	54 000		1 768
ОГК-3	OGKC	0,050	0,00%	-5,02%	311 950	760 474	2 374
ОГК-4	OGKD	0,091	0,00%	0,00%	9 349		5 737
ОГК-5	OGKE	0,091	0,00%	-2,22%	45 500	250 597	3 219
ТГК-3	MSNG	0,106	0,00%	-1,70%	19 026	2 338 557	4 202
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	1,16%	89 656	92 137	726
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,62%		355 733	1 022
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,450	0,00%	0,00%	45 000		427
ВолгаТелеком	NNSI	4,920	-3,53%	0,00%	36 408		1 210
Дальсвязь	ESPK	4,950	0,00%	0,00%	5 629 852		473
МТС	MTSS	8,750	0,00%	0,00%	87 500		17 442
Ростелеком	RTKM	5,070	0,00%	-4,55%		4 545 394	3 681
Ростелеком, п.	RTKMP	3,030	0,00%	-3,04%	15 150	5 810 430	736
СЗТ	SPTL	1,100	0,00%	-4,08%	11 000	228 922	969
СибирьТелеком	ENCO	0,098	0,00%	0,00%	49 000		1 177
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	-2,56%		24 901	164
Уралсвязьинформ	URSI	0,055	0,00%	-4,81%	981 900	7 212 178	1 762
ЮТК	KUBN	0,228	0,00%	0,00%	79 800		675
Машиностроение							

АвтоВАЗ	AVAZ	1,024	0,00%	-3,54%		545 627	1 429
ГАЗ	GAZA	50,500	0,00%	0,00%	25 250		935
ИРКУТ	IRKT	0,360	0,00%	-6,19%		187 260	355
Казанский ВЗ	KHEL	3,449	0,00%	0,00%	34 487		531
КАМАЗ	KMAZ	2,756	0,00%	-4,64%		706 543	1 959
Кировский завод	KIRZ	8,000	0,00%	0,00%	8 000		87
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,750		0,00%	11 750		94
ОМЗ	OMZZ	2,989	0,00%	-2,03%		44 116	105
РКК Энергия	RKKE	335,000	0,00%	0,00%	33 500	17 482	376
Северсталь-авто	SVAV	21,800	0,00%	-5,15%	21 800	1 156 321	747
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	0,00%	-3,42%	22 914	524 390	1 390
Мечел	MTLR	29,250	-2,50%	0,00%	220 500		12 176
ММК	MAGN	1,075	0,00%	-5,55%	591 750	4 301 569	12 012
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	-4,46%	18 011	3 881 491	24 872
НорНикель	GMKN	228,000	-4,60%	-3,45%	247 800	154 561 455	43 463
Полиметалл	PMTL	17,500	0,00%	2,76%	13 493	11 671 934	7 089
Полюс Золото	PLZL	56,800	0,00%	2,59%	29 025	22 738 852	10 828
Северсталь	CHMF	17,082	-6,15%	-4,73%	341 632	39 001 634	17 213
ТМК	TRMK	4,669	0,00%	-6,26%		1 621 063	4 366
ЧТПЗ	CHEP	2,730	0,00%	0,00%	99 208		1 290
Банки							
Банк Москвы	MMBM	41,385	0,00%	-3,62%		101 419	7 433
Возрождение	VZRZ	43,750	0,00%	-5,63%	21 875	60 671	1 039
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,73%	221 303	135 317 273	35 566
РОСБАНК	ROSB	4,000	0,00%	-1,85%	6 000	11 582	4 975
Сбербанк	SBER	3,355	-2,89%	0,00%	3 852 800		72 424
УРАЛСИБ	USBN	0,009	0,00%	0,00%	9 000		2 633
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,500	0,00%	-3,17%	62 500	5 861 443	2 777
Дальневосточное МП	FESH	0,541	0,00%	0,00%	216 400		1 597
НМТП	NMTP	0,140	0,00%	-4,00%	42 980	623 183	2 696
Приморское МП	PRIM	0,210	0,00%	-4,16%	21 000	67 384	167
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,716	0,00%	0,00%	371 570		390
Балтика	PKBA	44,000	0,00%	-1,62%	22 000	172 579	6 675
Верофарм	VRPH	46,000	0,00%	0,00%	46 000		460
Вимм-Билль-Данн	WBDF	127,500	0,00%	0,12%	254 500	1 352 608	5 610
Дикси	DIXY	14,200	0,00%	0,82%	56 300	733 529	1 221
Концерн Калина	KLNA	29,325	0,00%	-1,81%	35 190	53 009	286
Красный Октябрь	KROT	12,313	0,00%	-4,54%		22 636	114
Магнит	MGNT	124,000	-4,98%	-4,84%	331 684	2 045 572	11 033
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,202	0,00%	-7,46%		327 133	35
Разгуляй	GRAZ	2,700	0,00%	-2,37%	135 000	911 014	427
Седьмой континент	SCON	9,950	0,00%	0,00%	9 642		746
Фармстандарт	PHST	102,000	0,20%	-3,25%	61 200	105 108	3 855
Черкизово	GCHE	31,000	0,00%	-1,98%	31 000	59 597	1 335
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,260	0,00%	0,00%	13 000		464
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,758	0,00%	3,09%	37 919	93 923	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	4,667	-1,44%	-4,10%	10 005	13 521 127	2 302
РБК ИС	RBCI	1,481	0,00%	-7,89%		2 853 391	208
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	46,000	0,00%	-3,72%	23 000	567 249	2 194
Дорогобуж	DGBZ	0,581	0,00%	-2,04%		52 526	413
Сильвинит	SILV	975,000	0,00%	0,00%	97 250		7 630
Уралкалий	URKA	7,730	0,00%	-5,06%	38 650	26 894 992	16 422
Уголь							

Белон	BLNG	0,860	0,00%	0,00%	86 000		989
Распадская	rasp	7,550	-3,21%	-3,09%	407 700	9 144 474	5 895
УК Южный Кузбасс	UKUZ	52,000		0,00%	104 000		1 878

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	172,000	-5,68%	76,84
Башнефть	AK6		EUR	188,000	3,87%	14,19
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,730	-10,36%	138,93
ТГК-3	AOMD		USD	10,010	-3,10%	21,50
Татнефть	ATAD		USD	40,550	5,19%	26 746,30
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,620	-2,16%	16,33
Бурятзолото	BYT		EUR	23,000	-5,15%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,006	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,700	-3,60%	4 243,22
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	36,990	-4,44%	60 542,09
X5	FIVE		USD	39,180	-4,79%	21 991,17
Газпром	GAZ		EUR	20,895	4,37%	4 647,95
Иркутскэнерго	IRK		EUR	29,500	-1,67%	
ЮТК	KUE		EUR	8,300	-2,92%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,450	-3,26%	21,56
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,400	-1,54%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,100	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	69,150	3,06%	532 604,70
Лукойл	LUK		EUR	50,350	1,51%	3 006,04
Лукойл	LUKOY	1	USD	68,860	4,73%	20 225,04
МТС	MBT	5	USD	18,510	-4,44%	60 774,20
МТС	MKY	5	EUR	13,155	-5,77%	5,05
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,200	-1,38%	17,13
Мечел	MTL	3	USD	28,710	-8,51%	78 308,70
НорНикель	NILSY	1	USD	22,700	-0,92%	3 208,44
НорНикель	NNIA		EUR	16,380	-3,93%	374,04
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	125,000	4,08%	124 663,40
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,150	-2,59%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,515	-14,17%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,625	1,26%	4,32
Газпром	OGZD		USD	28,740	5,47%	979 271,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	-16,67%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,430	-4,55%	45,77
Ростелеком	RTL		EUR	22,000	-6,78%	6,04
Газпромнефть	SCF		EUR	19,450	6,40%	404,52
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	8,190	1,52%	12,88
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,026	-1,80%	17,58
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,750	4,93%	14,85
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	11,450	6,31%	742,21
АФКСистема	SSA	1	USD	24,020	-4,30%	28 872,56
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	24,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	37,000	-9,76%	8,14
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	38,000	-3,80%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	440,550	-1,00%	2,20
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,450	-4,61%	10,07
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,750	-2,54%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,920	-2,32%	28 935,43
ВТБ	VTBR		USD	6,525	0,08%	90 416,39
Возрождение	VZY		EUR	29,500	-9,23%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,410	-0,09%	2 275,34
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,240	-0,47%	

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.