ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

2 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

Во вторник ведущие американские фондовые индикаторы завершили торги со средним снижением около 1,5%. Западные участники рынка говорят о том, что рынок развернулся после речи главы ФРС Б. Бернанке, который заявил, что если стоимость нефти останется высокой, экономический рост в стране может замедлиться. Именно в это время цены на нефть на NYMEX шли в активный рост. В ходе вчерашних торгов котировки WTI прибавили более $3, опять преодолев планку $100/барр. Традиционные слова Бернанке о том, что ФРС США будет сохранять ставки без изменений в течение длительного периода времени не былого восторга на фондовых биржах, тем

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 962,66	-0,37%	3,88%	1,62%	37,27%
Индекс ММВБ	1 758,44	-1,09%	2,67%	-0,40%	29,65%
FTSE	5 935,76	-0,97%	-1,31%	-1,07%	9,80%
S&P 500	1 306,33	-1,57%	-2,73%	0,18%	17,09%
Dow Jones Avg.	12 058,02	-1,38%	-2,69%	0,13%	15,90%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Мосэнергосбыт	0,0190	8,57%	-2,56%	9,20%
ЧЦЗ	6,6000	8,20%	46,67%	43,48%
ОГК-2	0,0525	3,96%	-8,22%	-15,32%
Аэрофлот	2,5850	3,40%	0,58%	20,23%
ПИК	4,9900	3,31%	16,05%	-6,73%
Транснефть, п.	1418,0000	3,13%	9,09%	23,30%
Акрон	47,0000	2,17%	0,00%	30,19%
Иркутскэнерго	0,8100	1,95%	-5,81%	30,65%

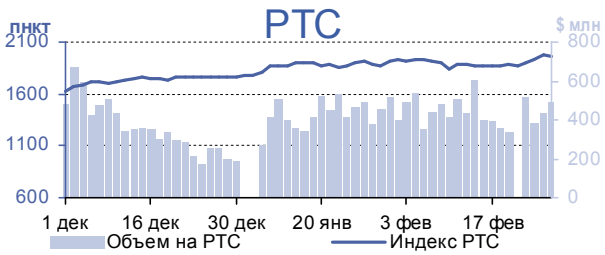
Лидеры снижения

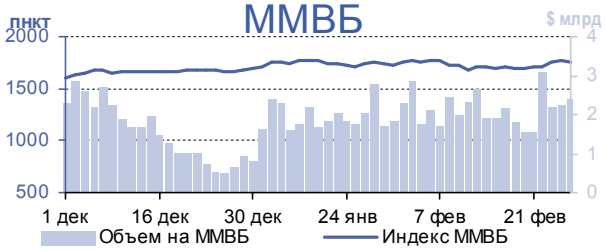
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аптечная сеть 36,6	3,6000	-3,11%	4,35%	-6,49%
Уфанефтехим, п.	1,8900	-3,08%	-5,50%	6,48%
ВСМПО	117,6357	-2,46%	-3,18%	-13,50%
ОАО Синергия	42,0000	-2,44%	-8,70%	23,17%

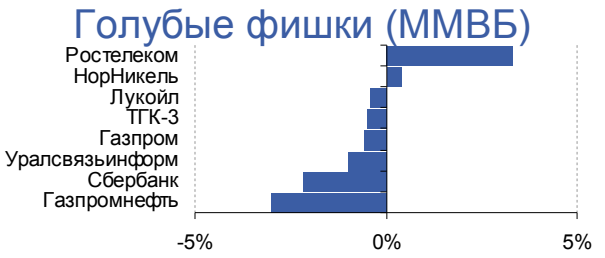
Индекс MSCI

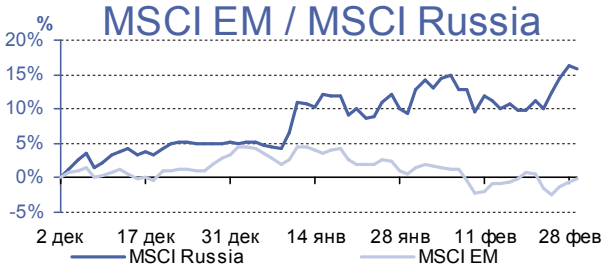
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1112,15	0,40%	-2,04%	17,33%
Индекс MSCI BRAZIL	3645,85	-1,56%	0,35%	6,64%
Индекс MSCI RUSSIA	1026,45	-0,40%	1,46%	30,48%
Индекс MSCI INDIA	497,57	4,23%	2,85%	10,70%
Индекс MSCI CHINA	65,71	1,45%	-1,89%	6,08%

Основные индикаторы









Обзор рынка

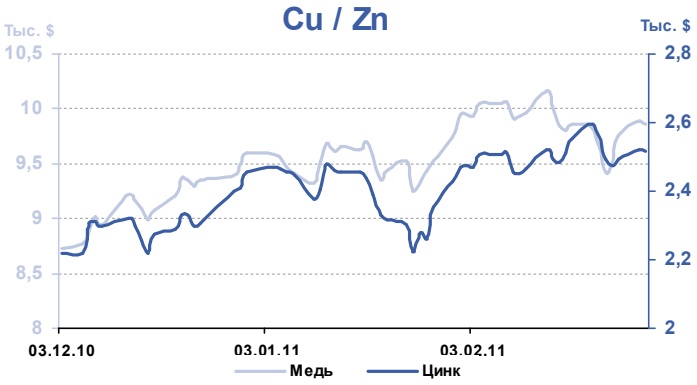
Во вторник ведущие американские фондовые индикаторы завершили торги со средним снижением около 1,5%. Западные участники рынка говорят о том, что рынок развернулся после речи главы ФРС Б. Бернанке, который заявил, что если стоимость нефти останется высокой, экономический рост в стране может замедлиться. Именно в это время цены на нефть на NYMEX шли в активный рост. В ходе вчерашних торгов котировки WTI прибавили более $3, опять преодолев планку $100/барр. Традиционные слова Бернанке о том, что ФРС США будет сохранять ставки без изменений в течение длительного периода времени не былого восторга на фондовых биржах, тем более, что рынок труда, по прогнозам американского ЦБ, остается вялым и рынок недвижимости «исключительно слабым». Выходившая вчера макростатистика была разнополярной: в феврале индекс деловой активности в производственном секторе США вырос до 61,4 пункта, а вот расходы на строительство в январе, снизились еще на 0,7% ($791.82 млрд - минимальный показатель за последние 5 месяцев).

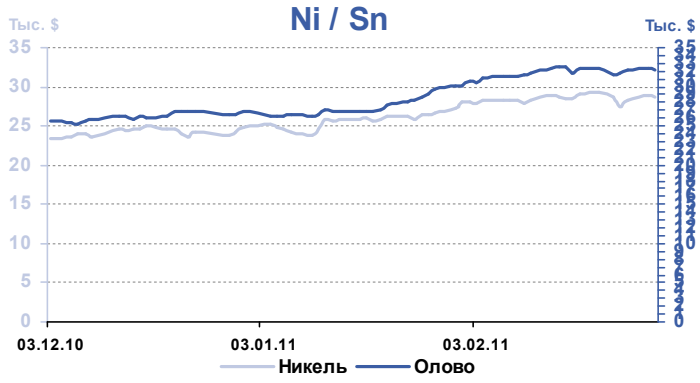
Пара EUR/USD так и не смогла преодолеть уровень 1,3850. Курс доллара укрепил свои позиции к евро на фоне геополитической напряженности на Ближнем Востоке. Из-за этого фактора фаворитами спекулятивного роста вчера стали нефть и золото. Нефтетрейдеры опасаются, что беспорядки в Ливии могут распространиться на богатый нефтью Иран. Уличные беспорядки начинаются в Омане, что не исключает появления очагов напряженности в Ираке и Алжире. Из-за этого котировки смеси Brent в среду утром мы видим на новой рекордной отметке $116,6/барр. Интересно, что такие высокие цены на нефть не остановили вчерашнее снижение котировок американских нефтяных компаний (AMEX Oil -1,46%), а также бразильского Petrobras (-1,38%). Азиатские фондовые рынки сегодня падают: MSCI Asia -1,32%.

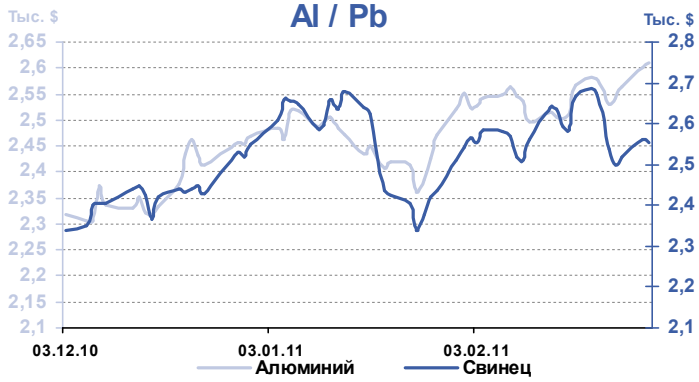
Начало торгов на российских биржах в среду мы ожидаем увидеть с полупроцентным гэпом вниз. Не исключено, что утром мы увидим попытки отыграть низкое открытие, однако думаю, что негативный фон может сохраниться на наших биржах до вечера. Бумаги нефтяного сектора будут торговаться сегодня немного лучше рынка. Но только после того, как эмоциональные продажи в остальных сегментах рынка начнут сходить на нет. Индекс ММВБ вчера дотронулся до максимальных годовых отметок (1788 п.), пробить которую, даже с учетом роста цен на нефть, будет теперь не просто. Ближайшим ориентиром продолжения коррекции по индексу ММВБ будет уровень 1740 п. Банковские, металлургические и энергетические бумаги сегодня будут испытывать давление продавцов.

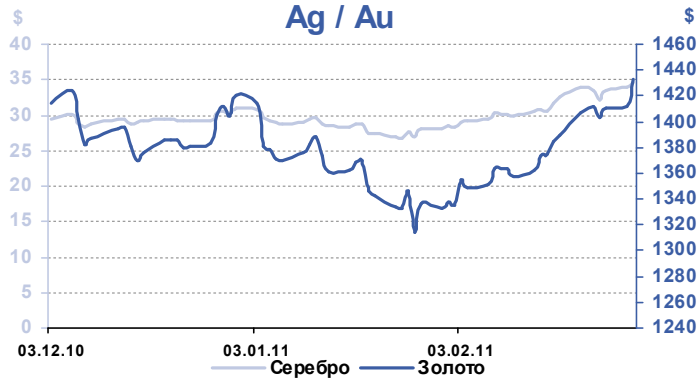
Сегодня в 13-00 выходят данные по еврозоне по индексу цен производителей за январь. В 16-15 ждем статистики из США по изменению числа рабочих мест в частном секторе от ADP за февраль (прогноз: 185 тыс.). В 18-00 опять следим за выступлением главы ФРС Бена Бернанке. В 18-30 выходят недельные данные по запасам нефти в США. И, наконец, в 22-00 будет опубликован экономический обзор ФРС США «Бежевая книга».

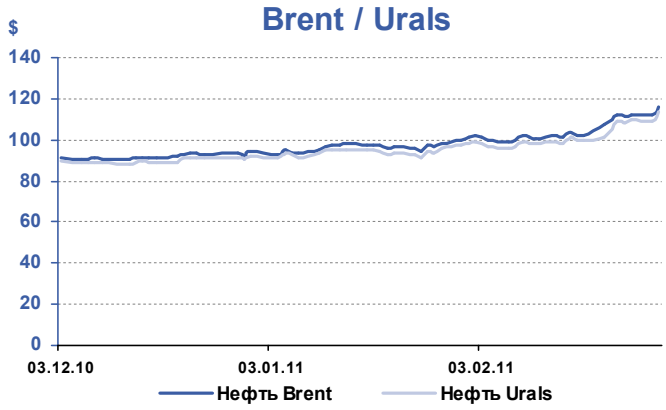
Commodities

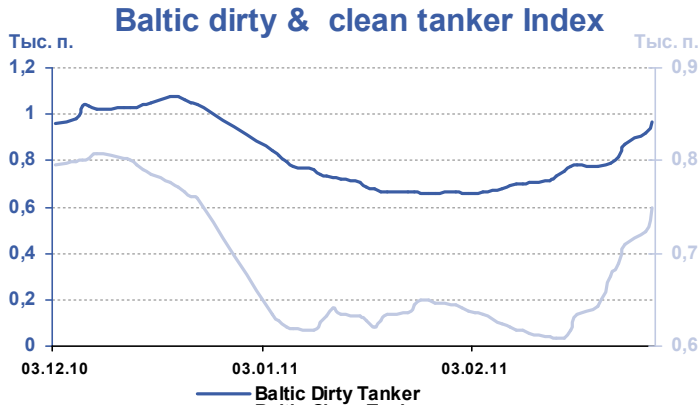












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 859,50	-0,26%	0,50%	-0,86%	33,24%
Цинк, $/t	2 515,00	-0,20%	-3,12%	1,62%	13,29%
Никель, $/t	28 775,00	-0,74%	-1,79%	2,77%	34,15%
Олово, $/t	32 200,00	-0,39%	-0,46%	5,06%	88,86%
Алюминий, $/t	2 610,00	0,38%	1,16%	3,37%	21,79%
Свинец, $/t	2 555,00	-0,27%	-4,49%	-0,39%	17,74%
Серебро, $/oz	34,68	2,33%	2,33%	22,33%	110,77%
Золото, $/oz	1 433,28	1,54%	1,91%	7,34%	28,09%
Нефть Brent, $/	116,02	3,64%	8,03%	13,67%	51,94%
Нефть Urals, $/	114,00	4,37%	12,54%	14,83%	53,02%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,602	0,00%	-1,04%		9 068	301
БашИнСв	BISV	0,377	0,00%	-0,97%		24 034	352
БашЭнрг	BEGY	1,817	0,00%	-1,40%		4 550	1 897
ВМЗ	VSMZ	1793,321	0,00%	-0,94%		8 967	3 080
ДВМП	FESH	0,573	0,00%	7,19%		23 376	1 662
КазанскВЗ	KHEL	3,479	0,00%	-0,52%		42 504	537
КОМСТАР	CMST	6,980	0,00%	-0,50%		48 441	2 921
Мечел	MTLR	30,797	0,00%	-2,58%		6 170 983	12 821
Мотовил	MOTZ	0,102	0,00%	2,66%		28 800	98
ОАО Банк Москвы	MMBM	40,000	0,00%	0,00%	40 000		7 200
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1760,000	0,00%	0,00%	10 560		3 023
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,090	0,00%	0,00%	9 000		89
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,030	0,00%	0,00%	955 580		45 441
СилМашины	SILM	0,344	0,00%	-2,61%		92 356	3 006
Сильвинит	SILV	1060,097	0,00%	2,77%		3 229 855	8 201
СинТЗ-ао	SNTZ	60,376	0,00%	0,00%		691	362
Славн-ЯНОС	JNOS	0,505	0,00%	-1,96%		1 267	473
СТЗ-ао	SVTZ	6,613	0,00%	2,37%		193	309
ТАГМЕТ	TAMZ	0,786	0,00%	0,00%		3 089	403
ТНК-ВР	TNBP	3,029	0,00%	-0,25%		396 203	45 497
У-УАЗ	UUAZ	2,437	0,00%	2,93%		61 285	650
ЧМК	CHMK	288,959	0,00%	-2,99%		1 559 157	928
ЧТПЗ	CHEP	2,973	0,00%	0,90%		92 722	1 404
ЮжКузб.	UKUZ	55,915	0,00%	-1,82%		50 407	2 025
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,250	0,00%	0,00%	106 500		9 062
Газпром	GAZP	7,300	1,39%	-0,58%	365 250	735 798 123	172 817
Газпромнефть	SIBN	4,950	0,00%	-2,98%	99 000	5 921 660	23 469
Лукойл	LKOH	71,000	0,55%	-0,39%	355 000	126 880 954	60 390
НОВАТЭК	NVTK	12,700	17,59%	0,00%	317 500		38 561
Роснефть	ROSN	9,485	0,00%	-1,21%	32 239	149 570 256	100 524
Сургутнефтегаз	SNGS	1,155	0,00%	-0,19%		26 171 293	41 231
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,580	0,00%	-2,33%	290 000	10 457 443	4 467
Татнефть	TATN	6,070	1,61%	0,00%	303 500		13 225
Татнефть, п.	TATNP	3,510	0,00%	0,00%	70 200		518
Транснефть, п.	TRNFP	1418,000	3,13%	-1,69%	41 122	19 186 353	2 205
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,810	1,95%	-0,91%	10 935	37 063	3 861
Ленэнерго	LSNG	0,920	0,00%	0,23%	9 200	48 529	852
МОЭСК	MSRS	0,054	0,00%	-0,89%	161 300	754 773	2 620
Новосибирскэнерго	NVNG	52,000	0,00%	0,00%	18 408		676
ОГК-2	OGKB	0,053	3,96%	0,00%	5 258		1 719
ОГК-3	OGKC	0,050	0,00%	-1,94%	311 950	1 156 050	2 374
ОГК-4	OGKD	0,091	0,00%	0,00%	18 698		5 737
ОГК-5	OGKE	0,091	0,00%	-1,43%	45 500	332 572	3 219
ТГК-3	MSNG	0,103	0,00%	-0,48%	282 315	979 456	4 082
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%	89 656	20 936	726
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,00%	176 015	194 209	1 025
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,450	0,00%	0,00%	45 000		427
ВолгаТелеком	NNSI	4,920	0,00%	0,00%	36 408		1 210
Дальсвязь	ESPK	4,850	1,04%	0,00%	145 500		464
МТС	MTSS	8,750	0,00%	0,00%	87 500		17 442
Ростелеком	RTKM	5,577	0,00%	3,32%		6 631 952	4 021
Ростелеком, п.	RTKMP	3,030	0,00%	-0,79%	15 150	2 690 142	736
СЗТ	SPTL	1,100	0,00%	0,14%	11 000	991 889	969
СибирьТелеком	ENCO	0,098	0,00%	0,00%	49 000		1 177
Таттелеком	TTLK	0,009	0,00%	1,96%		510 737	192
Уралсвязьинформ	URSI	0,055	0,00%	-0,97%	981 900	4 669 956	1 762
ЮТК	KUBN	0,228	0,00%	0,00%	79 800		675

Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,079	0,00%	2,96%		1 063 628	1 499
ГАЗ	GAZA	50,500	0,00%	0,00%	25 250		935
ИРКУТ	IRKT	0,382	0,00%	1,38%		57 909	372
Казанский ВЗ	KHEL	3,449	0,00%	0,00%	34 487		531
КАМАЗ	KMAZ	2,855	0,00%	0,54%		290 182	2 018
Кировский завод	KIRZ	8,000	0,00%	0,00%	8 000		87
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,750	0,00%	0,00%	11 750		94
ОМЗ	OMZZ	3,050	0,00%	-1,72%		51 600	108
РКК Энергия	RKKE	335,000	0,00%	-8,18%	33 500	5 956	376
Северсталь-авто	SVAV	21,267	0,00%	-1,30%	21 267	588 405	729
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	0,600	0,00%	0,00%	30 000		299
ВСМПО	VSMO	117,636	-2,46%	-1,46%	23 527	457 256	1 356
Мечел	MTLR	30,300	-2,26%	0,00%	150 375		12 488
ММК	MAGN	1,075	0,00%	-2,53%	591 750	2 315 308	12 012
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	0,30%	18 011	2 961 636	24 872
НорНикель	GMKN	234,000	0,00%	0,40%	1 787 844	194 977 355	44 607
Полиметалл	PMTL	18,950	0,00%	-0,73%	41 362	5 393 221	7 568
Полюс Золото	PLZL	56,800	0,00%	-0,43%	29 025	6 054 982	10 828
Северсталь	CHMF	19,000	0,00%	-2,37%	62 261	38 555 516	19 146
ТМК	TRMK	5,008	0,00%	0,29%		882 057	4 712
ЧТПЗ	CHEP	2,730	0,00%	0,00%	99 208		1 290
Банки							
Банк Москвы	MMBM	41,255	0,00%	0,08%		63 055	7 423
Возрождение	VZRZ	41,000	0,00%	1,11%	363 383	344 605	974
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-3,16%	42 510	170 014 542	35 984
РОСБАНК	ROSB	4,000	0,00%	-2,42%	6 000	118 713	4 975
Сбербанк	SBER	3,520	-0,56%	0,00%	2 836 018		75 986
УРАЛСИБ	USBN	0,009	0,00%	0,00%	9 000		2 633
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,585	3,40%	1,67%	129 250	3 662 984	2 871
Дальневосточное МП	FESH	0,545	0,74%	0,00%	81 750		1 608
НМТП	NMTP	0,140	0,00%	-0,88%	42 980	239 756	2 696
Приморское МП	PRIM	0,210	0,00%	0,59%	21 000	6 844	167
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	-3,11%	0,00%	25 200		378
Балтика	PKBA	48,000	0,00%	-3,57%	136 700	168 184	7 282
Верофарм	VRPH	46,000	0,00%	0,00%	36 800		460
Вимм-Билль-Данн	WBDF	127,464	0,00%	-0,41%	5 098 573	1 428 670	5 610
Дикси	DIXY	14,620	0,00%	0,00%	233 800	470 150	1 257
Концерн Калина	KLNA	29,325	0,00%	1,18%	35 190	42 232	286
Красный Октябрь	KROT	12,798	0,00%	-1,45%		33 057	120
Магнит	MGNT	133,000	1,92%	-0,26%	133 000	587 500	11 834
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,270	0,00%	-0,52%		51 109	36
Разгуляй	GRAZ	2,700	0,00%	-3,58%	135 000	504 179	427
Седьмой континент	SCON	9,500	0,00%	0,00%	11 875		713
Фармстандарт	PHST	102,000	0,00%	-2,36%	61 200	116 842	3 855
Черкизово	GCHE	31,000	0,00%	-0,12%	31 000	126 833	1 335
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,260	0,00%	0,00%	13 000		464
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,786	0,00%	-1,06%	94 331	64 399	1 267
Уфанефтехим	UFNC	4,640	0,00%	0,00%	66 768		1 278
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	4,990	3,31%	-0,69%	49 900	8 939 191	2 461
РБК ИС	RBCI	1,530	0,00%	-1,48%		519 727	216
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	47,000	2,17%	-1,32%	142 500	2 622 481	2 241
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	-0,80%	177 000	19 637	425
Сильвинит	SILV	975,000	0,00%	0,00%	97 250		7 630
Уралкалий	URKA	7,500	0,00%	2,56%	74 750	42 467 143	15 933

Уголь

Распадская	rasp	7,770	0,65%	-0,12%	1 311 309	3 611 778	6 067
УК Южный Кузбасс	UKUZ	52,000	0,00%	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	185,810	3,53%	3,70
Башнефть	AK6		EUR	184,000	-6,12%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,750	4,79%	3,48
ТГК-3	AOMD		USD	10,400	3,90%	58,76
Татнефть	ATAD		USD	41,650	-0,24%	12 117,87
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,823	-1,77%	3,84
Бурятзолото	BYT		EUR	23,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,004	-20,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,830	0,37%	2 927,34
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	38,720	-1,73%	27 942,58
X5	FIVE		USD	40,160	-0,10%	33 889,18
Газпром	GAZ		EUR	21,150	-0,68%	3 420,15
Иркутскэнерго	IRK		EUR	29,600	0,34%	0,89
ЮТК	KUE		EUR	8,400	2,44%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,550	1,11%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	-0,83%	64,00
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,100	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	70,750	0,00%	399 999,90
Лукойл	LUK		EUR	51,160	-0,21%	2 052,60
Лукойл	LUKOY	1	USD	70,800	-0,55%	20 314,60
МТС	MBT	5	USD	18,480	-1,86%	70 265,23
МТС	MKY	5	EUR	13,230	-1,16%	26,18
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,450	0,68%	0,77
Мечел	MTL	3	USD	29,460	-3,19%	78 612,14
НорНикель	NILSY	1	USD	24,280	0,12%	1 398,11
НорНикель	NNIA		EUR	17,640	0,23%	908,41
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	129,100	-0,62%	65 392,01
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,350	2,80%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,900	5,26%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,575	2,20%	
Газпром	OGZD		USD	29,180	-0,82%	608 219,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	33,240	4,36%	309,40
Ростелеком	RTL		EUR	24,150	6,39%	32,03
Газпромнефть	SCF		EUR	19,300	0,26%	199,53
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	8,305	-1,24%	59,74
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,165	-2,00%	4,17
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,820	-1,52%	217,77
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	11,720	-0,26%	94,71
АФКСистема	SSA	1	USD	25,500	0,04%	25 158,65
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,000	-6,12%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	39,000	2,63%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	470,000	-1,88%	27,57
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,760	1,77%	1,96
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,900	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,090	-0,21%	47 628,66
ВТБ	VTBR		USD	6,775	-2,24%	83 194,19
Возрождение	VZY		EUR	31,000	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,480	0,31%	5 900,73
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,250	-0,34%	

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.