ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

16 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

Несмотря на то, что во вторник фондовые индексы США завершили торги с потерями больше, чем на 1%, инвесторам все же удалось выкупить половину сильнейшего первоначального падения. Таким образом, волна биржевых продаж, которая вчера утром пришла из Японии, днем накрыла Европу, а вечером добралась до Америки. Несмотря на сохраняющиеся риски разрастания ядерного кризиса в Японии, инвесторы попытались восстановить потери, нанесенные биржевыми страхами. ФРС решила оставить без изменения уровень процентных ставок, а члены комитета по открытым рынкам (FOMC) единогласно проголосовали за сохранение без изменений программы покупки

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 906,83	-1,96%	-5,83%	1,57%	25,91%
Индекс ММВБ	1 700,54	-1,52%	-4,50%	-0,39%	21,45%
FTSE	5 695,28	-1,38%	-4,68%	-6,41%	1,81%
S&P 500	1 281,87	-1,12%	-3,02%	-4,07%	11,42%
Dow Jones Avg.	11 855,42	-1,15%	-2,94%	-3,52%	11,40%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Ленэнерго, п.	1,6000	5,26%	23,08%	72,04%
Вимм-Билль-Данн	135,0000	2,34%	6,30%	200,00%
НорНикель	240,0000	1,61%	2,13%	42,01%
СибирьТелеком	0,1000	1,52%	3,09%	85,19%

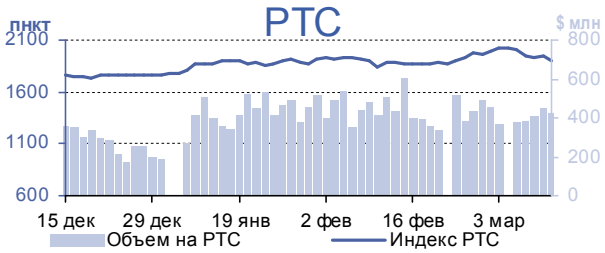
Лидеры снижения

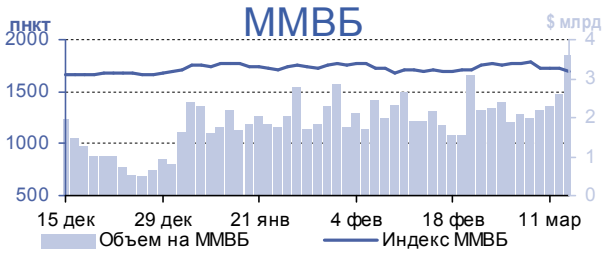
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ГАЗ	49,5000	-14,66%	3,13%	50,00%
ОАО ОПИН	42,0000	-14,29%	-6,67%	10,53%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,4500	-13,46%	-8,16%	95,65%
Аптечная сеть 36,6	3,0000	-13,04%	-18,92%	-9,64%

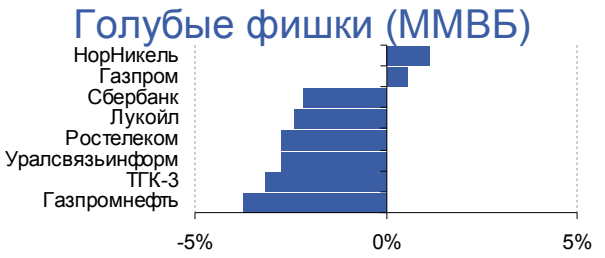
Индекс MSCI

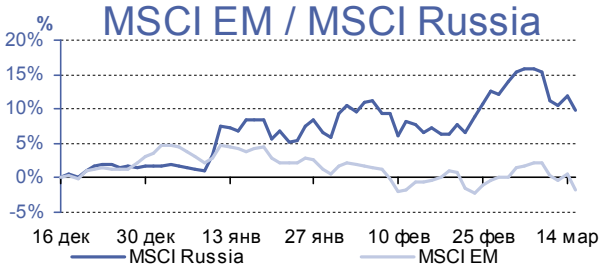
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1092,65	-2,17%	-1,44%	11,15%
Индекс MSCI BRAZIL	3630,55	-0,47%	-1,28%	1,40%
Индекс MSCI RUSSIA	1005,35	-1,86%	2,39%	21,82%
Индекс MSCI INDIA	489,55	-1,82%	0,44%	3,22%
Индекс MSCI CHINA	64,70	-2,71%	-0,40%	3,24%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Несмотря на то, что во вторник фондовые индексы США завершили торги с потерями больше, чем на 1%, инвесторам все же удалось выкупить половину сильнейшего первоначального падения. Таким образом, волна биржевых продаж, которая вчера утром пришла из Японии, днем накрыла Европу, а вечером добралась до Америки. Несмотря на сохраняющиеся риски разрастания ядерного кризиса в Японии, инвесторы попытались восстановить потери, нанесенные биржевыми страхами. ФРС решила оставить без изменения уровень процентных ставок, а члены комитета по открытым рынкам (FOMC) единогласно проголосовали за сохранение без изменений программы покупки облигаций, пообещав оставить краткосрочные процентные ставки вблизи нуля «в течение длительного периода времени». Инвесторы также услышали вчера традиционную мантру ФедРезерва о том, что экономическое восстановление в США обретает прочную основу, а условия на рынке труда постепенно улучшаются. Наиболее активно восстанавливали вчера свои потери акции компаний сырьевого, энергетического и промышленного секторов.

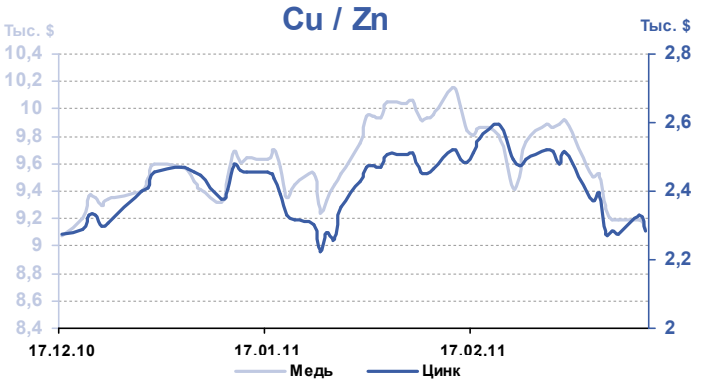
Валютная пара EUR/USD серьезно не изменила своих позиций (1,3975), даже, несмотря на то, что снизилась вероятность повышения процентной ставки со стороны ЕЦБ в апреле, да и агентство Moody's понизило долгосрочный кредитный рейтинг Португалии на две ступени с уровня A3 с негативным прогнозом.

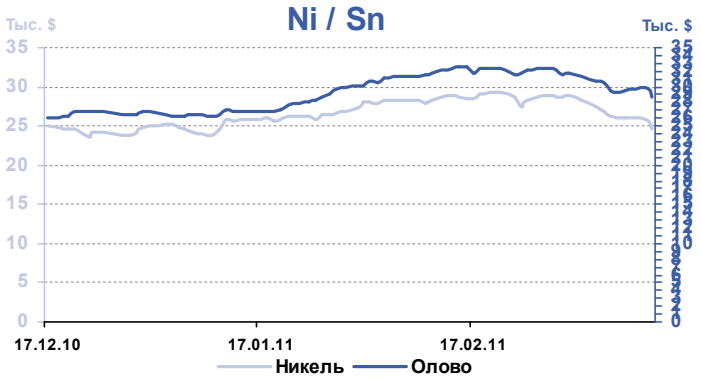
Цены на нефть марки Brent сегодня утром опустились до минимальных отметок с конца февраля ($107,5/барр) из-за того, что землетрясения в Японии снизят спрос на нефть, поскольку на нее приходилось 5,2% глобального потребления нефти в мире после США и Китая. Закрытие нефтеперерабатывающих заводов в Японии приведет к сокращению уровня переработки на 1,3 миллиона баррелей в сутки с 4,52 миллионов. Эти риски пока перевешивают новости из Бахрейна, где во вторник было введено чрезвычайное положение сроком на 3 месяца в связи с беспорядками. Сегодняшние торги на азиатских фондовых биржах проходят в зеленой зоне (MSCI Asia +0,88%), корректируя существенное падение индексов за последние 5 дней. Любопытно, что банк JPMorgan Chase понизил прогноз по экономическому росту Китая в этом году до 9,4% с 9,6%.

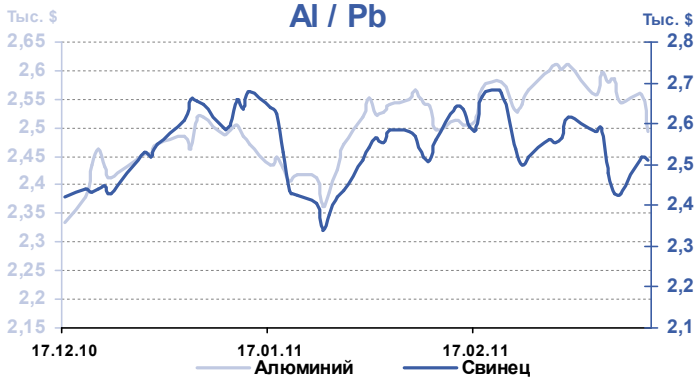
Открытие торгов на наших биржах в среду мы увидим в умеренно-позитивной зоне. Уже вчера днем было видно, что продажи по всему спектру российских акций сошли на нет. Сегодня нам остается только развить коррекционное движение вверх. Поэтому мы ждем возврата индекса ММВБ к уровню 1720 пунктов. Однако, в ситуации четко обозначенного flash-crash не стоит обольщаться длительным движением вверх. Уверен, что природные и техногенные катаклизмы в Японии напомнят о себе новыми неприятными последствиями в ближайшие недели, поэтому коррекционный рост многие участники рынка будут использовать для выхода из «бумажных» позиций. Тем не менее, сегодня стоит ждать спроса в акциях Газпрома, ГМК НорНикель и металлургических компаний.

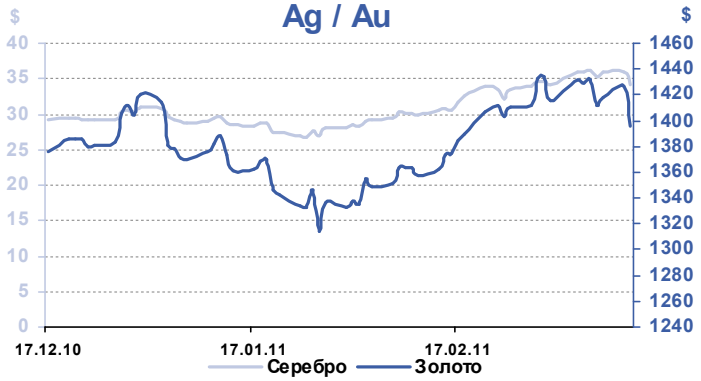
В среду днем в 15-30 ждем статистики из США по числу закладок новых домов и выданных разрешений на строительство жилья за февраль. В это же время выходит статистика по индексу цен производителей США за февраль, а также данные по платежному балансу США за IV квартал. В 17-30 Минэнерго (EIA) США опубликует отчет по запасам нефти и нефтепродуктов.

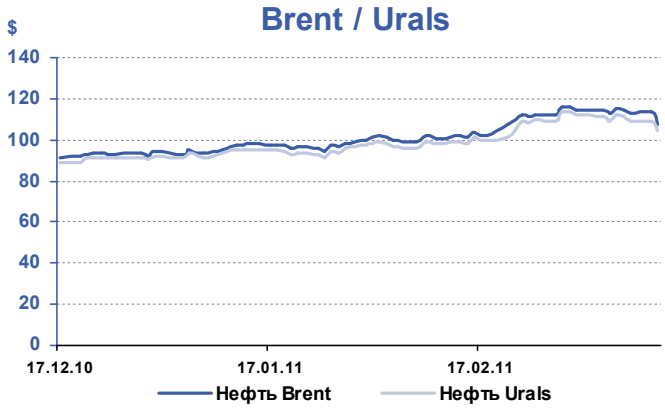
Commodities

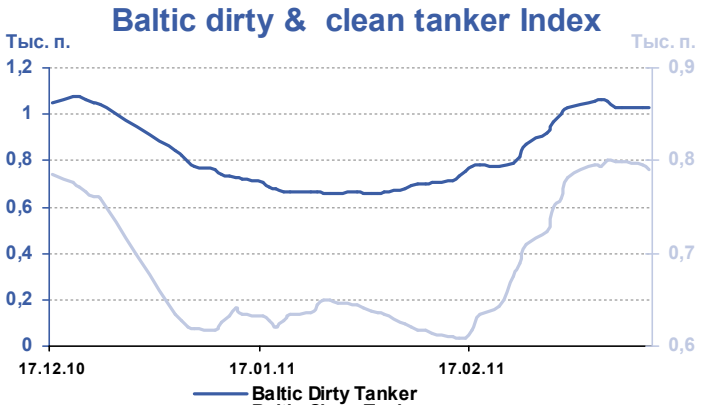












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 118,00	-0,78%	-4,32%	-7,36%	24,82%
Цинк, $/t	2 282,00	-2,06%	-4,72%	-8,21%	0,09%
Никель, $/t	24 705,00	-4,34%	-7,90%	-13,54%	14,91%
Олово, $/t	28 600,00	-4,35%	-6,54%	-12,00%	63,90%
Алюминий, $/t	2 493,00	-2,54%	-3,97%	-0,44%	11,94%
Свинец, $/t	2 509,50	-0,38%	-3,11%	-3,18%	13,86%
Серебро, $/oz	34,25	-4,67%	-4,95%	11,76%	100,12%
Золото, $/oz	1 395,70	-2,15%	-2,33%	1,55%	25,91%
Нефть Brent, $/	107,80	-5,01%	-4,32%	3,92%	38,45%
Нефть Urals, $/	104,28	-4,71%	-4,70%	3,20%	38,73%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,531	0,00%	-6,16%		174 904	265
БашИнСв	BISV	0,494	0,00%	1,42%		222 905	462
БашЭнрг	BEGY	1,704	0,00%	-3,41%		50 686	1 762
ВМЗ	VSMZ	1618,123	0,00%	-6,34%		49 134	2 813
ДВМП	FESH	0,524	0,00%	-2,94%		71 470	1 560
КазанскВЗ	KHEL	3,357	0,00%	-1,22%		187 191	513
КОМСТАР	CMST	6,890	0,00%	-1,37%		2 128 397	2 892
Мечел	MTLR	28,743	0,00%	-2,23%		2 314 201	11 982
Мотовил	MOTZ	0,093	0,00%	-0,09%		6 651	90
ОАО Банк Москвы	MMBM	40,000	0,00%	0,00%	40 000		7 200
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1730,000	0,00%	0,00%	145 320		2 971
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,950	0,00%	0,00%	29 500		44 241
СилМашины	SILM	0,332	0,00%	-6,38%		120 122	2 920
Сильвинит	SILV	946,515	0,00%	-4,73%		1 507 594	7 411
СинТЗ-ао	SNTZ	57,765	0,00%	-2,06%		2 311	364
Славн-ЯНОС	JNOS	0,425	0,00%	-5,31%		2 508	390
СТЗ-ао	SVTZ	6,158	0,00%	4,02%		62	296
ТАГМЕТ	TAMZ	0,695	0,00%	-9,23%		1 163	348
ТНК-ВР	TNBP	2,850	0,00%	-2,40%		487 858	42 934
У-УАЗ	UUAZ	2,227	0,00%	-5,85%		32 796	588
ЧМК	CHMK	295,055	0,00%	-2,52%		5 483 543	909
ЧТПЗ	CHEP	2,888	0,00%	-2,24%		247 796	1 372
ЮжКузб.	UKUZ	52,542	0,00%	-4,88%		430 834	1 904
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	52,100	-5,27%	0,00%	118 047		8 866
Газпром	GAZP	7,550	0,00%	0,58%	188 750	1 186 225 467	178 735
Газпромнефть	SIBN	4,854	0,00%	-3,75%		9 331 930	22 978
Лукойл	LKOH	67,081	0,00%	-2,41%		222 851 988	57 607
Мегионнефтегаз	MFGS	17,750		0,00%	17 750		1 766
НОВАТЭК	NVTK	12,320	0,00%	0,00%	12 320		37 407
Роснефть	ROSN	8,700	-8,28%	-2,23%	514 000	176 057 227	92 204
Сургутнефтегаз	SNGS	1,080	0,00%	-3,86%	108 000	58 954 637	38 584
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,554	-4,57%	-3,88%	299 010	28 914 644	4 263
Татнефть	TATN	6,260	0,00%	0,00%	1 254 500		13 639
Татнефть, п.	TATNP	3,510	0,00%	0,00%	70 200		518
Транснефть, п.	TRNFP	1347,000	-4,47%	-2,28%	202 050	21 124 989	2 094
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,810	0,00%	-4,38%	10 935	187 245	3 861
Ленэнерго	LSNG	0,825	-4,62%	-2,49%	16 750	33 649	764
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	-0,22%	23 750	328 593	2 314
Новосибирскэнерго	NVNG	45,000	0,00%	0,00%	14 985		608
ОГК-2	OGKB	0,051	0,00%	0,00%	25 500		1 669
ОГК-3	OGKC	0,046	-6,69%	-2,84%	161 000	1 422 894	2 184
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	89 500		5 580
ОГК-5	OGKE	0,082	0,00%	-2,49%		1 994 240	2 868
ТГК-3	MSNG	0,102	0,00%	-3,18%	51 000	3 479 134	4 054
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-6,14%	324 500	181 130	701
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-7,72%	156 557	399 599	894
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,450	0,00%	0,00%	45 000		427
ВолгаТелеком	NNSI	5,340	0,00%	0,00%	156 462		1 313
Дальсвязь	ESPK	5,000	0,00%	0,00%	50 000		478
МТС	MTSS	8,950	0,00%	0,00%	195 957		17 840
Ростелеком	RTKM	5,450	0,00%	-2,74%	136 250	3 676 549	3 971
Ростелеком, п.	RTKMP	3,030	0,00%	-1,95%	15 150	10 455 033	736
СЗТ	SPTL	1,150	0,00%	-4,45%	23 000	916 040	1 013
СибирьТелеком	ENCO	0,100	1,52%	0,00%	10 000		1 201
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	-9,92%		316 767	164
Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	-2,75%		11 193 692	1 714
ЮТК	KUBN	0,230	0,00%	0,00%	11 500		681

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,947	0,00%	-4,90%		682 825	1 309
ГАЗ	GAZA	49,500	-14,66%	0,00%	54 475		926
ИРКУТ	IRKT	0,322	0,00%	-4,50%		242 020	312
Казанский ВЗ	KHEL	3,250	0,00%	0,00%	32 500		493
КАМАЗ	KMAZ	2,582	0,00%	-7,12%		1 028 993	1 868
Кировский завод	KIRZ	8,000	0,00%	0,00%	8 000		87
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	-6,38%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,714	0,00%	-7,14%		90 644	100
РКК Энергия	RKKE	335,000	0,00%	0,52%	33 500	38 159	376
Северсталь-авто	SVAV	22,000	0,00%	-5,56%	22 000	1 717 602	754

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,600	0,00%	0,00%	30 000		299
Бурятзолото	BRZL	32,000		0,00%	32 000		225
ВСМПО	VSMO	113,000	-3,42%	-4,08%	39 450	1 694 207	1 303
Мечел	MTLR	29,000	0,00%	0,00%	5 800		12 072
ММК	MAGN	1,000	0,00%	-3,19%	10 000	2 859 147	11 174
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	-1,81%	18 011	6 833 041	24 872
НорНикель	GMKN	240,000	1,61%	1,15%	726 000	327 913 787	45 751
Полиметалл	PMTL	18,374	0,00%	1,58%		2 977 534	7 113
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	-3,39%	196 681	11 040 819	11 495
Северсталь	CHMF	18,071	-2,65%	-0,70%	45 816	52 869 249	18 211
ТМК	TRMK	4,541	0,00%	-4,74%		4 310 666	4 325
ЧТПЗ	CHEP	2,931		0,00%	439 576		1 384

Банки

Банк Москвы	MMBM	32,380	0,00%	-5,44%		57 255	5 923
Возрождение	VZRZ	45,000	0,00%	-4,79%	31 500	92 805	1 069
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-1,35%	32 400	158 842 541	34 520
РОСБАНК	ROSB	3,758	0,00%	-0,47%		26 369	2 768
Сбербанк	SBER	3,270	-3,82%	0,00%	2 377 200		70 589
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,620	-1,13%	2,12%	161 960	14 168 731	2 888
Дальневосточное МП	FESH	0,515	-4,63%	0,00%	130 250		1 520
НМТП	NMTP	0,140	0,00%	-2,48%	42 980	1 390 934	2 696
Приморское МП	PRIM	0,182	0,00%	-4,07%		40 332	144

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	-13,04%	0,00%	240 000		315
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	-1,02%	16 625	68 520	7 206
Вимм-Билль-Данн	WBDF	135,000	2,34%	0,92%	6 750	5 039 054	5 852
Дикси	DIXY	13,200	-5,38%	-4,41%	67 350	644 097	1 135
Концерн Калина	KLNA	29,325	0,00%	-8,15%	35 190	93 515	286
Красный Октябрь	KROT	11,000	0,00%	-7,84%		57 215	105
Магнит	MGNT	132,000	-0,90%	-2,11%	284 175	3 069 494	11 522
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,180	0,00%	-10,06%		185 217	36
Разгуляй	GRAZ	2,350	0,00%	-8,16%	58 846	1 664 945	372
Седьмой континент	SCON	9,500	0,00%	0,00%	11 875		713
Фармстандарт	PHST	90,000	-3,74%	-0,74%	85 265	247 098	3 401
Черкизово	GCHE	30,500	0,00%	-2,04%	61 000	115 979	1 314

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,240	-7,69%	0,00%	28 800		428
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,750	-4,59%	-1,21%	37 500	39 582	1 208
Уфанефтехим	UFNC	4,925	0,00%	0,00%	49 250		1 356
Уфаоргсинтез	UFOS	3,500	0,00%	0,00%	35 000		342

Другие сектора

МСЗ, Электросталь	MASZ	250,000	0,00%	0,00%	75 000		348
ПИК	pikk	4,470	-5,30%	-6,12%	54 703	11 239 284	2 205
РБК ИС	RBCI	1,397	0,00%	-4,90%		527 663	197

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	44,000	0,00%	-5,74%	44 000	3 460 939	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	-3,27%	177 000	57 996	425
Сильвинит	SILV	942,000	-3,38%	0,00%	403 866		7 372
Уралкалий	URKA	7,438	-11,87%	-1,67%	7 438	46 848 833	15 801

Уголь

Распадская	rasp	6,395	-3,40%	-3,12%	149 138	12 979 174	4 993
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	188,680	2,38%	21,11
Башнефть	AK6		EUR	187,000	-3,61%	15,98
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,840	-1,08%	13,00
ТГК-3	AOMD		USD	9,460	-9,04%	172,37
Татнефть	ATAD		USD	42,030	-2,82%	14 308,81
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,281	-13,41%	39,07
Бурятзолото	BYT		EUR	23,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,009	-10,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,745	-2,53%	9 490,36
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	35,510	-2,45%	68 250,69
X5	FIVE		USD	39,000	-2,86%	26 966,78
Газпром	GAZ		EUR	21,550	-0,90%	8 529,37
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,170	-41,38%	0,17
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,500	-3,51%	5,50
ЮТК	KUE		EUR	8,600	-1,15%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	-4,76%	10,08
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,700	0,00%	11,83
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,931	-9,61%	
Лукойл	LKOD		USD	67,150	-2,82%	583 021,30
Лукойл	LUK		EUR	47,860	-3,41%	3 994,85
Лукойл	LUKOY	1	USD	67,550	-2,81%	19 094,42
МТС	MBT	5	USD	20,760	0,10%	90 760,43
МТС	MKY	5	EUR	14,605	-0,71%	60,14
МГТС	MOW		EUR	9,500	-5,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,750	-3,71%	365,98
Мечел	MTL	3	USD	29,270	-1,15%	80 553,73
НорНикель	NILSY	1	USD	24,600	1,19%	2 130,88
НорНикель	NNIA		EUR	17,350	0,58%	1 646,04
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	118,800	-2,46%	102 801,20
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,200	-7,10%	19,40
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,855	-5,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,475	0,00%	9,18
Газпром	OGZD		USD	30,330	-0,07%	1 177 043,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,500	-1,96%	107,00
Ростелеком	RTL		EUR	23,200	-3,13%	38,53
Газпромнефть	SCF		EUR	17,280	-4,79%	803,29
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,558	-6,00%	157,28
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,814	-5,59%	200,55
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,570	-3,47%	403,74
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,700	-5,64%	351,47
АФКСистема	SSA	1	USD	26,830	-1,94%	14 478,37
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	-2,08%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	37,005	-2,62%	8,30
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	36,000	-2,70%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	355,000	-8,97%	44,01
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,375	-5,45%	22,79
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	6,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,960	-2,31%	53 585,32
ВТБ	VTBR		USD	6,310	-2,62%	107 735,40
Возрождение	VZY		EUR	30,000	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	33,050	-0,45%	2 826,32
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,400	-0,28%	9,43

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.