ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

22 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

Вчера торги на фондовых рынках США завершились сильным ростом биржевых индексов. Спад беспокойства вокруг ядерного кризиса в Японии и череда сделок по слиянию и поглощению компаний позволили заокеанским индексам, вырасти в среднем более чем на 1,5%. Акции высокотехнологичных компаний выросли после того, как компания AT&T согласилась купить T-Mobile USA у Deutsche Telekom за $39 млрд. Имевший место возврат цен на нефть WTI к отметке $103/барр, поднял капитализацию акций энергетического сектора в подгруппе индекса S&P-500 на 2,9%. По доброй традиции, в оживления покупателей на биржах, негативная статистика была

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 962,92	0,88%	1,71%	3,90%	-14,53%
Индекс ММВБ	1 747,32	0,56%	1,59%	2,03%	-8,37%
FTSE	5 718,13	0,39%	-1,90%	-4,93%	-10,89%
S&P 500	1 279,20	0,43%	-1,92%	-4,75%	-11,61%
Dow Jones Avg.	11 858,52	0,71%	-1,54%	-4,30%	-9,09%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскнефтехим	0,7926	13,22%	4,51%	-11,94%
ОГК-4	0,0970	9,60%	6,59%	-27,07%
Уфанефтехим	5,2500	5,00%	22,09%	52,17%
Сильвинит	1000,0000	4,49%	2,56%	31,58%
Распадская	7,0500	3,98%	-5,50%	11,90%
Сбербанк	3,5200	3,23%	1,29%	-17,37%
Фармстандарт	92,0000	2,22%	-9,63%	33,33%
Лукойл	70,5000	2,17%	6,82%	-18,21%

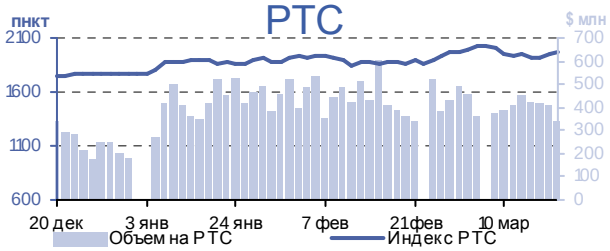
Лидеры снижения

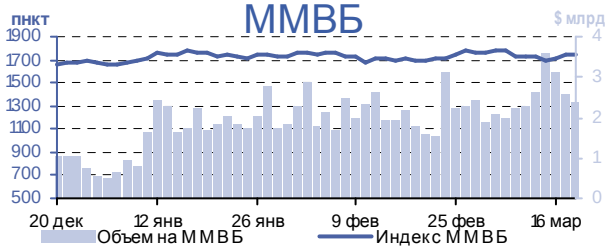
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Компания М.видео	8,5000	-1,62%	-13,71%	25,00%
ОГК-1	0,0330	-1,49%	-12,00%	-72,27%
Ленэнерго	0,7900	-1,25%	-14,13%	-57,30%

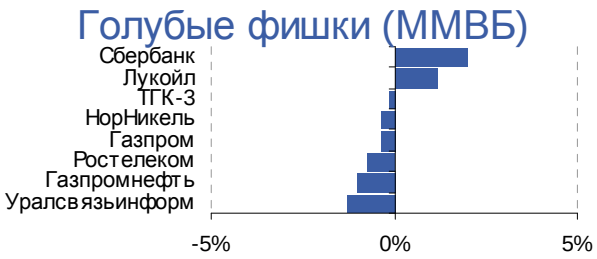
Индекс *MSCI*

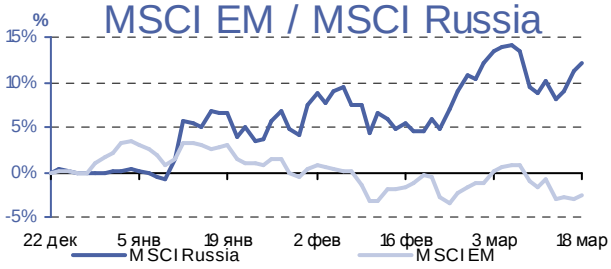
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1098,60	0,66%	-1,95%	-11,06%
Индекс MSCI BRAZIL	3611,54	0,87%	-1,44%	-5,12%
Индекс MSCI RUSSIA	1043,22	0,73%	5,81%	-32,36%
Индекс MSCI INDIA	483,47	-1,26%	-2,68%	-28,74%
Индекс MSCI CHINA	63,81	0,29%	-3,10%	-24,20%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Индекс ММВБ постарается сохранить стабильность

Вчера торги на фондовых рынках США завершились сильным ростом биржевых индексов. Спад беспокойства вокруг ядерного кризиса в Японии и череда сделок по слиянию и поглощению компаний позволили заокеанским индексам, вырасти в среднем более чем на 1,5%. Акции высокотехнологичных компаний выросли после того, как компания AT&T согласилась купить T-Mobile USA у Deutsche Telekom за $39 млрд. Имевший место возврат цен на нефть WTI к отметке $103/барр, поднял капитализацию акций энергетического сектора в подгруппе индекса S&P-500 на 2,9%. По доброй традиции, в оживления покупателей на биржах, негативная статистика была проигнорирована.

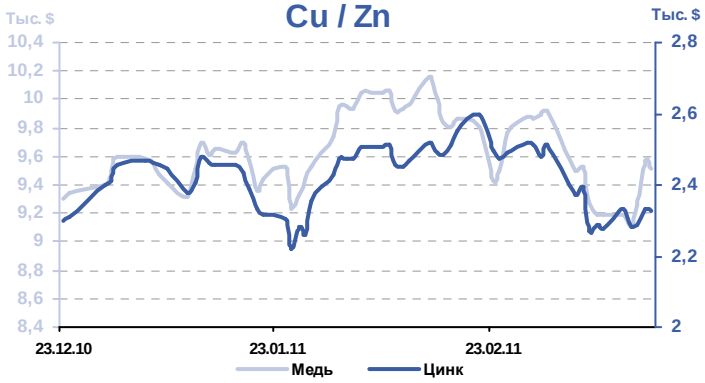
Продажи на вторичном рынке жилья в США в феврале упали на 9,6% г/г, при этом средняя цена жилья снизилась до минимального для февраля уровня с 2002 года (средняя цена дома уменьшилась на 5,2% г/г). Напомним, что именно падение цен на жилье стало одной из ключевых причин кризиса 2008 года. Показательно, что Министерство финансов США объявило вчера о начале продаж своего портфеля квазигосударственных ценных бумаг, обеспеченных ипотекой, которые были приобретены во время кризиса. Совокупный портфель MBS, находящихся на балансе Казначейства, оценивается в 142 млрд долл. Либо это попытка продать активы, которые еще чего-то стоят, либо желание сделать вид, что на рынке американского жилья, возможно, скоро наступит стабилизация.

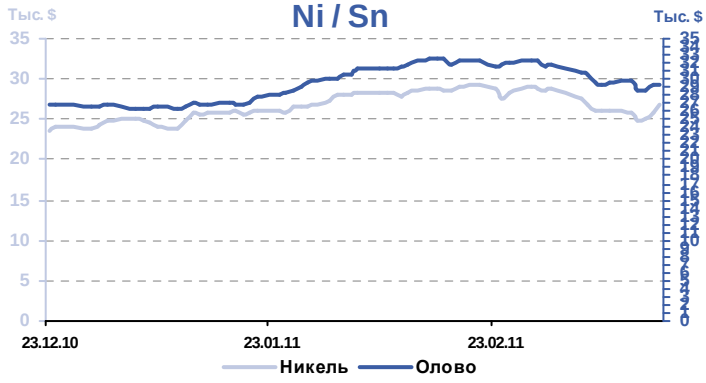
Возвращаясь на фондовые биржи можно констатировать факт резкой смены настроений инвесторов. Из-за этого в индексах сейчас теряется хороший долгосрочный тренд, а участники рынка вынуждены привыкать к рваным биржевым графикам, на которых гэп вниз закрывается гэпом вверх. Такие движения котировок качественными назвать нельзя.

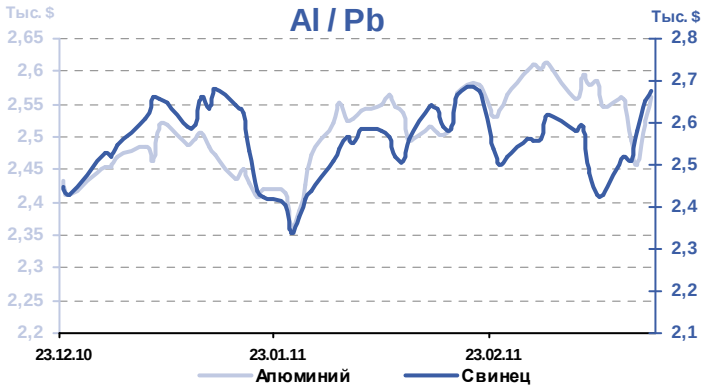
После роста в самом начале недели стоимость нефтяных контрактов к утру вторника немного снизилась. Котировки смеси Brent сегодня утром мы видим возле отметки $114/барр. Валютная пара EUR/USD сохраняет движение вверх, консолидируясь вблизи сильного уровня сопротивления на 1,4250-70 – максимум с начала ноября 2010 года. Сегодняшние торги в Азии в целом проходят в позитивном ключе: MSCI Asia +0,56%.

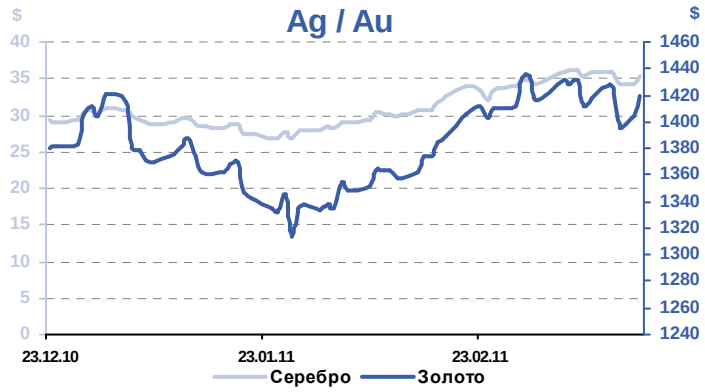
Открытие торгов на российских биржах во вторник мы ожидаем увидеть в зоне небольшого снижения. Не совсем уверенный вчерашний рост создает предпосылки к тому, чтобы индекс ММВБ продолжил неуверенную консолидацию в диапазоне 1760-1735 пунктов. Не за горами конец 1-го квартала, а значит, портфельные управляющие постараются либо сохранить стабильность на рынке вблизи текущих уровней, либо подтянуть индексы и котировки бумаг повыше. Новость о том, что Роснефть и Chevron могут разорвать партнерство по совместной разработке месторождения на шельфе Черного моря из-за разногласий в работе, может несколько усилить продажи в акциях нашей нефтяной компании. Сегодня в 15-30 следим за выступлением министра финансов США Тимоти Гайтнера. В 17-00 ждем данных по индексу цен на дома в США за январь от FHFA. В 17-00 ФРБ Ричмонда опубликует данные индекса деловой активности в производственном секторе региона за март.

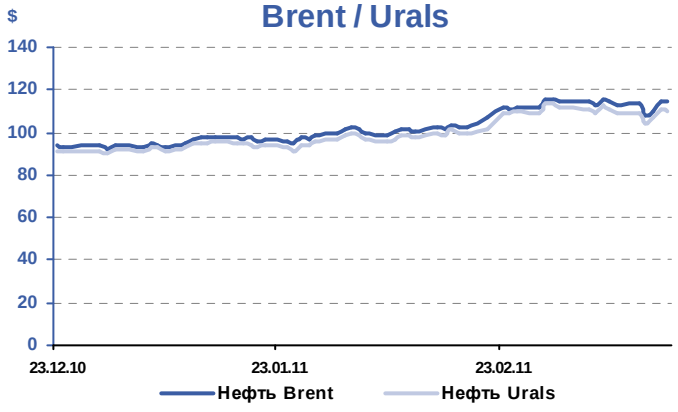
Commodities

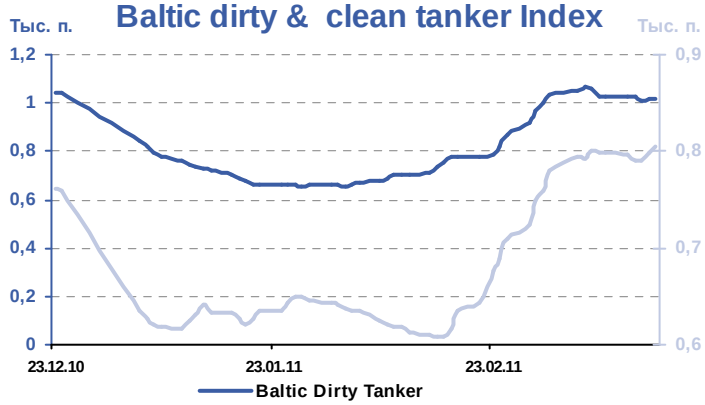












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 510,00	-0,58%	3,48%	-3,06%	40,78%
Цинк, $/t	2 325,00	-0,39%	2,20%	-10,44%	-5,14%
Никель, $/t	26 750,00	3,18%	3,08%	-8,70%	-1,65%
Олово, $/t	29 400,00	0,09%	-0,34%	-9,12%	79,54%
Алюминий, $/t	2 560,00	1,47%	0,59%	-0,78%	5,00%
Свинец, $/t	2 677,00	0,98%	10,30%	0,07%	2,37%
Серебро, $/oz	35,26	2,92%	-1,82%	4,03%	131,21%
Золото, $/oz	1 418,90	1,08%	0,10%	0,89%	65,46%
Нефть Brent, $/	114,30	-0,44%	1,24%	6,42%	16,91%
Нефть Urals, $/	110,33	-0,71%	0,96%	8,91%	16,68%

$
$
0
0
0
0
0
0
0
0
0
0
0
0
0

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,553	0,00%	1,65%		32 843	273
БашИнСв	BISV	0,509	0,00%	-2,09%		65 637	483
БашЭнрг	BEGY	1,716	0,00%	-1,39%		1 724	1 797
ВМЗ	VSMZ	1675,539	0,00%	0,00%		77 209	2 883
ДВМП	FESH	0,521	0,00%	-1,13%		18 293	1 516
КазанскВЗ	KHEL	3,479	0,00%	0,01%		7 963	533
КОМСТАР	CMST	6,926	0,00%	0,01%		556 482	2 890
Мечел	MTLR	29,883	0,00%	0,00%		1 583 915	12 555
Мотовил	MOTZ	0,091	0,00%	-1,23%		10 212	90
ОАО Банк Москвы	MMBM	40,000	0,00%	0,00%	40 000		7 200
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1730,000	0,00%	0,00%	145 320		2 971
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,088	0,00%	0,00%	52 500		87
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,870	0,70%	0,00%	28 700		43 041
СилМашины	SILM	0,329	0,00%	1,33%		114 628	2 826
Сильвинит	SILV	1003,579	0,00%	1,07%		872 362	7 838
СинТЗ-ао	SNTZ	52,735	0,00%	-6,25%		1 494	336
Славн-ЯНОС	JNOS	0,454	0,00%	0,00%		673	419
СТЗ-ао	SVTZ	5,818	0,00%	-4,87%		1 000	283
ТАГМЕТ	TAMZ	0,675	0,00%	-2,78%		408	346
ТНК-ВР	TNBP	2,864	0,00%	-0,65%		529 109	43 313
У-УАЗ	UUAZ	2,285	0,00%	3,75%		80 007	601
ЧМК	CHMK	295,280	0,00%	-0,20%		89 978	942
ЧТПЗ	CHEP	2,953	0,00%	1,08%		112 516	1 399
ЮжКузб.	UKUZ	55,551	0,00%	-0,49%		15 499	1 999
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,100	0,66%	0,00%	325 515		9 036
Газпром	GAZP	7,950	1,27%	-0,36%	238 500	603 435 556	187 021
Газпромнефть	SIBN	5,109	0,00%	-1,00%		8 482 124	24 613
Лукойл	LKOH	70,500	2,17%	1,16%	35 250	182 013 686	59 965
Мегионнефтегаз	MFGS	17,750	0,00%	0,00%	17 750		1 766
НОВАТЭК	NVTK	12,270	0,00%	0,00%	269 940		37 255
Роснефть	ROSN	8,700	0,00%	-0,46%	514 000	90 040 506	92 204
Сургутнефтегаз	SNGS	1,080	0,00%	-2,89%	108 000	91 030 169	38 584
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,543	0,00%	0,32%	325 500	15 080 071	4 182
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	0,00%	-0,88%	202 050	17 383 998	2 094
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,810	0,00%	1,10%	10 935	37 571	3 861
Ленэнерго	LSNG	0,790	-1,25%	-0,82%	24 710	42 816	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	4,57%	23 750	498 378	2 314
Новосибирскэнерго	NVNG	45,000	0,00%	0,00%	14 985		608
ОГК-2	OGKB	0,049	0,00%	0,00%	24 500		1 604
ОГК-3	OGKC	0,046	0,00%	1,91%	22 750	663 586	2 161
ОГК-4	OGKD	0,097	9,60%	0,00%	283 500		6 116
ОГК-5	OGKE	0,085	0,00%	2,76%		306 101	2 963
ТГК-3	MSNG	0,097	0,00%	-0,14%	46 363	773 589	3 856
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-4,42%	324 500	190 462	701
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-1,41%	156 557	26 479	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	5,440	-0,18%	-0,73%	219 100	2 382 447	3 964
Ростелеком, п.	RTKMP	3,030	0,00%	-0,28%	15 150	2 808 907	736
СЗТ	SPTL	1,150	0,00%	-0,63%	23 000	301 742	1 013
СибирьТелеком	ENCO	0,100	0,00%	0,00%	10 000		1 201
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	1,98%		68 210	162

Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	-1,28%		2 274 312	1 713
ЮТК	KUBN	0,230	0,00%	0,00%	11 500		681
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,067	0,00%	7,60%		2 210 762	1 465
ГАЗ	GAZA	50,500	0,00%	0,00%	1 111		935
ИРКУТ	IRKT	0,315	0,00%	-1,21%	31 500	68 227	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,250	0,00%	0,00%	32 500		493
КАМАЗ	KMAZ	2,705	0,00%	0,10%		309 687	1 921
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,815	0,00%	-1,61%		47 490	100
РКК Энергия	RKKE	334,163	0,00%	2,16%		334	376
Северсталь-авто	SVAV	22,000	0,00%	0,86%	22 000	295 171	754
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,600	0,00%	0,00%	30 000		299
Бурятзолото	BRZL	32,000	0,00%	0,00%	32 000		225
ВСМПО	VSMO	113,000	0,00%	0,09%	39 450	545 549	1 303
Мечел	MTLR	28,850	0,00%	0,00%	8 655		12 072
ММК	MAGN	1,000	0,00%	2,87%	10 000	3 453 251	11 174
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	-0,43%	18 011	5 195 867	24 872
НорНикель	GMKN	250,000	1,21%	-0,35%	250 000	110 073 905	47 657
Полиметалл	PMTL	17,803	0,00%	-2,22%		1 358 133	7 239
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	1,08%	196 681	5 632 697	11 495
Северсталь	CHMF	18,500	0,00%	1,22%	925 000	25 374 352	18 642
ТМК	TRMK	4,570	0,00%	-0,38%		5 825 096	4 303
ЧТПЗ	CHEP	2,931	0,00%	0,00%	439 576		1 384
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,332	0,00%	-0,88%		80 529	6 419
Возрождение	VZRZ	45,000	0,00%	-0,46%	31 500	324 296	1 069
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,90%	6 500	91 000 867	33 997
РОСБАНК	ROSB	3,779	0,00%	0,07%		227	2 821
Сбербанк	SBER	3,520	3,23%	0,00%	3 136 300		75 986
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,665	0,00%	-2,20%	266 500	1 320 095	2 960
Дальневосточное МП	FESH	0,515	0,00%	0,00%	130 250		1 520
НМТП	NMTP	0,130	0,00%	-2,11%		340 695	2 523
Приморское МП	PRIM	0,182	0,00%	-1,71%		3 635	145
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	0,00%	0,00%	240 000		315
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	-0,66%	16 625	2 491	7 206
Вимм-Билль-Данн	WBDF	135,000	0,00%	-0,13%	6 750	133 006	5 852
Дикси	DIXY	13,350	1,14%	0,27%	21 360	225 739	1 148
Концерн Калина	KLNA	29,325	0,00%	2,48%	35 190	16 374	286
Красный Октябрь	KROT	11,343	0,00%	0,20%		10 299	103
Магнит	MGNT	130,000	1,64%	2,73%	260 000	2 877 563	11 567
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,070	0,00%	-7,70%		276 341	34
Разгуляй	GRAZ	2,350	0,00%	-2,62%	58 846	1 327 641	372
Седьмой континент	SCON	9,500	0,00%	0,00%	11 875		713
Фармстандарт	PHST	92,000	2,22%	0,00%	156 400	33 285	3 477
Черкизово	GCHE	28,650	0,00%	0,49%	231 950	25 124	1 234
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,235	0,00%	0,00%	10 575		420
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,793	13,22%	4,23%	95 108	20 646	1 273
Уфанефтехим	UFNC	5,250	5,00%	0,00%	107 700		1 445
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	200,500	0,00%	0,00%	20 050		279
ПИК	pikk	4,580	0,66%	-0,20%	10 002	9 037 352	2 259
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	-1,25%		692 379	203
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	44,000	0,00%	4,55%	44 000	6 524 767	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	2,41%	177 000	32 492	425
Сильвинит	SILV	1000,000	4,49%	0,00%	25 000		7 826
Уралкалий	URKA	7,438	0,00%	0,93%	7 438	20 896 558	15 801
Уголь							

Распадская	rasp	7,050	3,98%	3,22%	1 963 400	14 636 015	5 505
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	184,730	-2,11%	35,57
Башнефть	AK6		EUR	183,000	-2,14%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,890	1,07%	4,44
ТГК-3	AOMD		USD	9,600	-0,52%	111,94
Татнефть	ATAD		USD	41,100	-2,88%	46 081,44
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,662	7,39%	12,53
Бурятзолото	BYT		EUR	22,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,006	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,790	-0,15%	7 919,24
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	37,450	1,22%	55 805,37
X5	FIVE		USD	40,500	3,32%	26 593,77
Газпром	GAZ		EUR	22,165	-1,45%	5 347,98
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	-3,91%	2,28
ЮТК	KUE		EUR	8,300	-2,35%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	2,56%	0,87
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,200	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,030	0,98%	17,87
Лукойл	LKOD		USD	70,550	1,95%	628 736,40
Лукойл	LUK		EUR	49,770	0,49%	2 388,07
Лукойл	LUKOY	1	USD	70,800	1,58%	15 010,36
МТС	MBT	5	USD	20,970	-0,33%	82 885,26
МТС	MKY	5	EUR	14,630	-1,08%	
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,840	-0,58%	104,74
Мечел	MTL	3	USD	29,550	0,20%	55 084,92
НорНикель	NILSY	1	USD	25,180	0,60%	1 807,24
НорНикель	NNIA		EUR	17,700	-0,59%	311,58
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	133,500	1,44%	132 725,20
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,250	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,062	-3,45%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,275	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	31,460	-0,06%	1 611 736,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	33,000	1,54%	247,40
Ростелеком	RTL		EUR	23,075	0,79%	36,80
Газпромнефть	SCF		EUR	18,300	0,49%	967,54
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,216	-3,01%	295,20
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,809	-0,13%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,610	1,08%	750,74
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,400	-2,71%	264,59
АФКСистема	SSA	1	USD	26,850	2,01%	39 385,89
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,000	-2,56%	3,80
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	38,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	328,350	-3,43%	18,07
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,275	-3,96%	66,70
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,800	0,00%	8,70
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,710	-1,65%	59 256,50
ВТБ	VTBR		USD	6,535	2,03%	113 223,70
Возрождение	VZY		EUR	27,750	2,78%	50,87
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,940	-0,03%	10 282,02
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,135	-1,01%	

Источник: Bloomberg

Аналитическая служба Ай Ти Инвест - Проспек

Александр Потавин
Начальник отдела, рыночный анализ

Ольга Самарец
Потребительский сектор

Габбасов Роман
Электроэнергетика

Тычкова Ольга
Транспорт

Солодин Дмитрий
Ситуационный анализ

Егишянц Сергей
Макроэкономика, мировые рынк

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 «Проспект - Ай Ти Инвест»

Россия, Москва, 123001, 1-ый Голутвинский переулок, д. 6
телефон: +7 (495) 937-33-63
факс: +7 (495) 937-33-6

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 "Проспект - Ай Ти Инвест".
Перепечатка целиком или отдельными частями без ссылки на компании не допускается.