ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

23 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

Во вторник фондовые индексы США немного сдали позиции после сильного роста за последние 3 дня. Лидерами снижения стали акции компаний автомобильной промышленности а также сектора туризма и развлечений. В плюсовой зоне продолжал торги лишь телекоммуникационный сектор. Из-за продолжающего военного противостояния в Ливии и столкновений между правительственными войсками и оппозицией в Йемене цен на нефть WTI в Нью-Йорке вчера вечером достигли $105/барр. Интересно, что иногда высокая стоимость цен на энергоносители помогает расти фондовым индексам, через подъем капитализации компаний нефтяного сегмента, а иногда, из-за

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 976,38	-0,28%	3,65%	6,04%	29,55%
Индекс ММВБ	1 741,34	-0,68%	2,40%	1,68%	22,84%
FTSE	5 762,71	-0,40%	1,18%	-2,71%	2,09%
S&P 500	1 293,77	-0,36%	0,93%	-1,04%	10,98%
Dow Jones Avg.	12 018,63	-0,15%	1,38%	-0,72%	11,43%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ЧЦЗ	5,4500	11,00%	-21,58%	47,70%
Магнит	138,0000	6,15%	5,75%	79,22%
Сургутнефтегаз, п.	0,5625	3,59%	-1,32%	42,95%
ВСМПО	116,7000	3,27%	-3,23%	17,40%
Дикси	13,8000	2,22%	-0,62%	81,58%
Башнефть, п.	41,0000	1,23%	15,01%	78,26%
Сбербанк	3,5600	0,42%	2,45%	60,94%

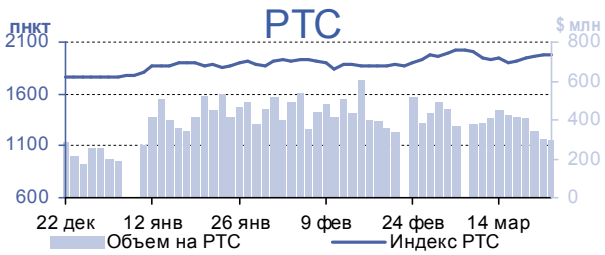
Лидеры снижения

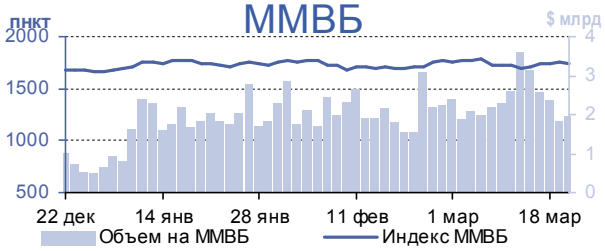
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ПИК	4,5200	-1,31%	-0,88%	17,95%
Аэрофлот	2,6400	-0,94%	6,45%	50,00%
Вимм-Билль-Данн	134,0000	-0,74%	5,10%	219,05%
Татнефть	6,0800	-0,33%	7,61%	49,75%

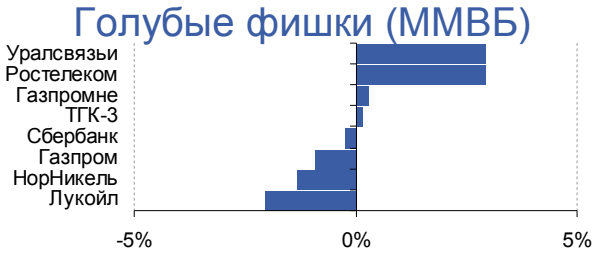
Индекс MSCI

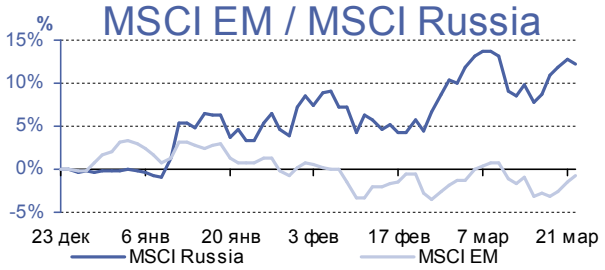
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1120,09	0,90%	2,20%	13,15%
Индекс MSCI BRAZIL	3682,28	1,29%	0,94%	4,82%
Индекс MSCI RUSSIA	1047,88	-0,36%	7,46%	26,83%
Индекс MSCI INDIA	488,50	0,96%	-0,06%	1,90%
Индекс MSCI CHINA	65,93	1,29%	3,57%	5,41%

Основные индикаторы









Обзор рынка

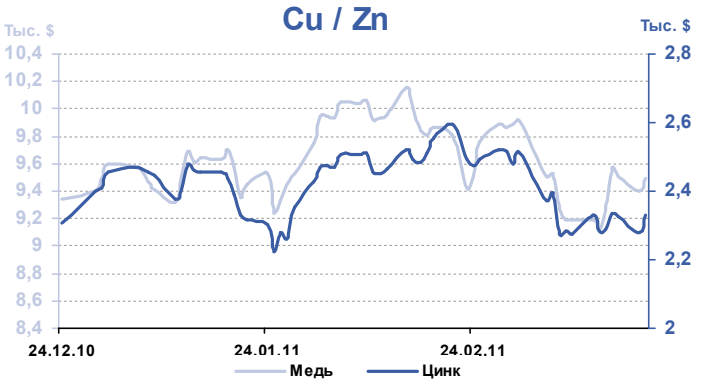
Во вторник фондовые индексы США немного сдали позиции после сильного роста за последние 3 дня. Лидерами снижения стали акции компаний автомобильной промышленности а также сектора туризма и развлечений. В плюсовой зоне продолжал торги лишь телекоммуникационный сектор. Из-за продолжающего военного противостояния в Ливии и столкновений между правительственными войсками и оппозицией в Йемене цен на нефть WTI в Нью-Йорке вчера вечером достигли $105/барр. Интересно, что иногда высокая стоимость цен на энергоносители помогает расти фондовым индексам, через подъем капитализации компаний нефтяного сегмента, а иногда из-за аналогичного роста цен на WTI растут опасения замедления темпов восстановления мировой экономики. Вчера был второй вариант. Вышедшая вчера в США статистика от FHFA показала, что цены на жилье за январь снизились на -0,3% м/м против прогноза -0,2% м/м.

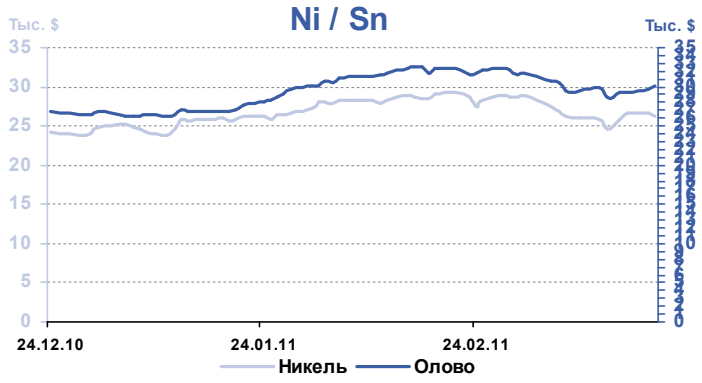
Цены на нефть марки Brent сегодня утром достигли отметки $116,3/барр. Сильное сопротивление на $117/барр не дает котировкам пробиться выше, да и текущее снижение экспорта нефти из Ливии уже учтено рынком в текущих ценах. Согласно последним данным от API запасы нефти в США на прошлой неделе выросли на 0,97 млн. барр., запасы бензина упали на 7,883 млн. барр., запасы дистиллятов снизились на 0,612 млн. барр. Цены на промышленные металлы уже три дня безыдейно торгуются вблизи текущих уровней: медь $9550/т; никель $26500/т. Сегодняшние торги на азиатских фондовых биржах проходят без единой динамики движения индексов: Nikkei -1,65%; Sensex +0,98%.

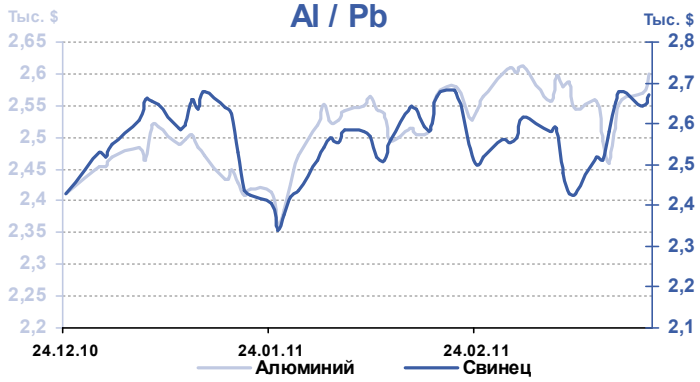
Открытие торгов на наших биржах в среду мы ожидаем увидеть в нейтрально-негативной зоне. Вчерашние торги показали, что из-за отсутствия ярких стимулов наши индексы не способны на рост. Однако агрессивного движения вниз не получается в силу стабильных цен на нефть, поэтому не исключено, что к концу квартала мы все же увидим индекс ММВБ вблизи уровней 1745-50 пунктов. Сегодня локомотивами роста из «голубых фишек» могут стать акции Роснефти, ГМК и ВТБ. Во втором эшелоне акций мы выделяет акции региональных телекомов. Думаю, настрой игроков в среду создаст базу для движения биржевых индексов до конца недели.

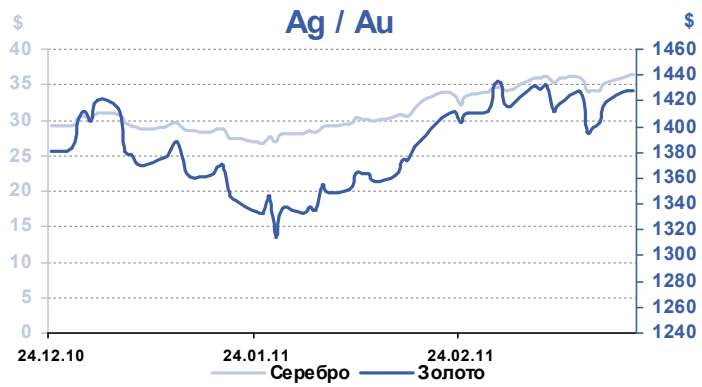
Сегодня на 12-00 мск в Португалии намечено голосование в парламенте по дополнительной программе, направленной на сокращение дефицита госбюджета. При этом ведущая оппозиционная партия страны дала понять, что не поддержит предложение правительства. Думаю, в это время стоит обратить внимание на котировки португальских гособлигаций и позиции евро. В 17-00 ждем данных из США по продажам новых домов за февраль (прогноз: рост продаж до 291 тыс.). В 17-30 Минэнерго США (EIA) опубликует отчет по запасам нефти и нефтепродуктов. В 19-00 следим за выступлением главы ФРС Бена Бернанке.

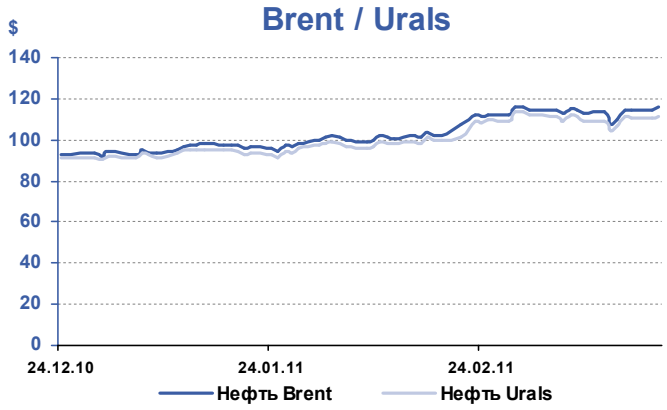
Commodities

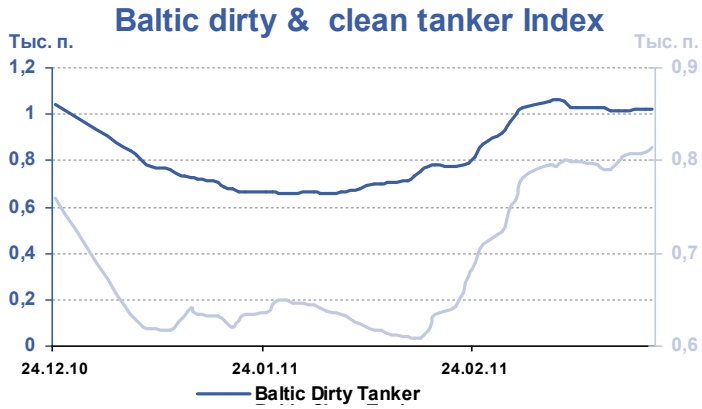












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 490,00	0,98%	4,08%	0,69%	27,38%
Цинк, $/t	2 331,00	2,24%	2,15%	-6,57%	2,37%
Никель, $/t	26 350,00	-1,50%	6,66%	-8,12%	18,29%
Олово, $/t	30 150,00	1,52%	5,42%	-4,36%	71,79%
Алюминий, $/t	2 600,00	1,17%	4,29%	2,77%	15,30%
Свинец, $/t	2 670,00	0,95%	6,40%	5,16%	23,33%
Серебро, $/oz	36,36	0,69%	6,17%	8,37%	114,21%
Золото, $/oz	1 427,65	0,00%	2,29%	1,13%	29,52%
Нефть Brent, $/	115,83	1,23%	7,45%	3,58%	45,06%
Нефть Urals, $/	111,66	0,67%	7,08%	2,05%	45,20%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,555	0,00%	-0,63%		17 709	276
БашИнСв	BISV	0,517	0,00%	-0,17%		62 828	489
БашЭнрг	BEGY	1,720	0,00%	-0,33%		13 978	1 799
ВМЗ	VSMZ	1724,224	0,00%	1,10%		17 201	2 954
ДВМП	FESH	0,530	0,00%	-0,33%		7 863	1 557
КазанскВЗ	KHEL	3,492	0,00%	-0,46%		8 745	535
КОМСТАР	CMST	7,038	0,00%	0,20%		438 629	2 935
Мечел	MTLR	30,524	0,00%	0,10%		2 584 702	12 610
Мотовил	MOTZ	0,092	0,00%	-0,05%		1 105	91
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 Мотовилихинские заво	MOTZ	0,088	0,00%	0,00%	52 500		87
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,870	0,00%	0,00%	28 700		43 041
СилМашины	SILM	0,337	0,00%	-0,23%		15 178	2 957
Сильвинит	SILV	1010,495	0,00%	-1,04%		449 531	7 923
СинТЗ-ао	SNTZ	53,083	0,00%	0,00%		106	334
Славн-ЯНОС	JNOS	0,453	0,00%	-1,73%		45	422
СТЗ-ао	SVTZ	6,010	0,00%	-0,29%		301	289
ТАГМЕТ	TAMZ	0,675	0,00%	0,00%		408	346
ТНК-ВР	TNBP	2,865	0,00%	-0,25%		755 304	42 953
У-УАЗ	UUAZ	2,354	0,00%	1,37%		12 232	629
ЧМК	CHMK	296,944	0,00%	-0,65%		122 100	937
ЧТПЗ	CHEP	2,978	0,00%	-0,59%		110 298	1 408
ЮжКузб.	UKUZ	56,730	0,00%	1,26%		19 873	2 033
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,500	0,00%	0,00%	187 250		9 104
Газпром	GAZP	7,885	0,00%	-0,92%	1 971 250	419 628 664	186 666
Газпромнефть	SIBN	5,310	0,00%	0,32%		2 807 426	24 927
Лукойл	LKOH	70,500	0,00%	-2,04%	35 250	170 393 984	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%	0,62%	514 000	97 703 726	92 204
Сургутнефтегаз	SNGS	1,080	0,00%	-0,53%	108 000	33 250 582	38 584
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,563	3,59%	-0,74%	422 625	5 969 978	4 340
Татнефть	TATN	6,080	-0,33%	0,00%	747 840		13 246
Татнефть, п.	TATNP	3,510	0,00%	0,00%	70 200		518
Транснефть, п.	TRNFP	1347,000	0,00%	-0,45%	202 050	14 004 082	2 094
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,810	0,00%	-0,98%	10 935	62 388	3 861
Ленэнерго	LSNG	0,790	0,00%	0,86%	24 710	14 423	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	2,79%	23 750	342 426	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	0,048	0,00%	2,63%	24 000	1 038 383	2 279
ОГК-4	OGKD	0,098	0,00%	0,00%	49 000		6 147
ОГК-5	OGKE	0,089	0,00%	0,00%		999 659	3 121
ТГК-3	MSNG	0,097	0,00%	0,18%	46 363	524 447	3 856
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	3,38%	324 500	65 071	701
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	2,65%	156 557	113 684	894
Телекоммуникации							
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	5,480	0,00%	2,93%	600 247	6 285 917	3 993
Ростелеком, п.	RTKMP	3,083	0,00%	0,93%		4 538 613	743
СЗТ	SPTL	1,150	0,00%	2,70%	23 000	2 391 681	1 013
СибирьТелеком	ENCO	0,100	0,00%	0,00%	10 000		1 201
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	0,05%		66 267	165
Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	2,96%	20 340	14 126 184	1 725
ЮТК	KUBN	0,230	0,00%	0,00%	11 500		681

Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,068	0,00%	0,38%		705 036	1 488
ГАЗ	GAZA	50,500	0,00%	0,00%	1 111		935
ИРКУТ	IRKT	0,315	0,00%	1,03%	31 500	72 282	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,500	0,00%	0,00%	175 000		539
КАМАЗ	KMAZ	2,730	0,00%	-0,19%		102 486	1 928
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,905	0,00%	1,01%		3 163	102
РКК Энергия	RKKE	342,150	0,00%	1,53%		17 443	384
Северсталь-авто	SVAV	22,000	0,00%	0,24%	22 000	192 032	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	116,700	3,27%	0,15%	116 850	226 214	1 345
Мечел	MTLR	28,850	0,00%	0,00%	8 655		12 072
ММК	MAGN	1,085	0,00%	0,52%	191 043	3 170 196	12 124
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	0,25%	18 011	5 439 024	24 872
НорНикель	GMKN	250,000	0,00%	-1,32%	250 000	123 281 669	47 657
Полиметалл	PMTL	18,083	0,00%	0,73%		4 750 958	7 192
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	-0,62%	196 681	2 813 033	11 495
Северсталь	CHMF	18,500	0,00%	-2,06%	925 000	32 732 796	18 642
ТМК	TRMK	4,646	0,00%	-0,73%		981 642	4 354
ЧТПЗ	CHEP	2,931	0,00%	0,00%	439 576		1 384
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,048	0,00%	-0,35%		29 208	6 267
Возрождение	VZRZ	45,000	0,00%	2,18%	31 500	70 970	1 069
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,58%	6 500	69 054 736	33 997
РОСБАНК	ROSB	3,793	0,00%	0,00%		6 698	2 825
Сбербанк	SBER	3,560	0,42%	0,00%	710 500		76 850
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,640	-0,94%	-1,28%	26 400	1 143 382	2 932
Дальневосточное МП	FESH	0,515	0,00%	0,00%	130 250		1 520
НМТП	NMTP	0,132	0,00%	-0,69%		80 793	2 551
Приморское МП	PRIM	0,189	0,00%	0,62%		3 572	150
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	0,00%	0,00%	240 000		315
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	-2,93%	16 625	245 356	7 206
Вимм-Билль-Данн	WBDF	134,000	-0,74%	-0,33%	134 000	81 846	5 896
Дикси	DIXY	13,800	2,22%	0,17%	27 600	113 310	1 187
Концерн Калина	KLNA	28,347	0,00%	-0,71%		20 700	280
Красный Октябрь	KROT	11,743	0,00%	1,06%		1 289	108
Магнит	MGNT	138,000	6,15%	0,67%	1 275 447	1 394 217	12 279
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,968	0,00%	-4,38%		199 979	32
Разгуляй	GRAZ	2,350	0,00%	-0,93%	58 846	243 420	372
Седьмой континент	SCON	9,500	0,00%	0,00%	11 875		713
Фармстандарт	PHST	92,000	0,00%	-0,38%	156 400	67 508	3 477
Черкизово	GCHE	28,650	0,00%	0,12%	231 950	39 483	1 234
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,235	0,00%	0,00%	10 575		420
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,770	0,00%	-1,89%	38 500	17 633	1 241
Уфанефтехим	UFNC	5,100	0,00%	0,00%	114 087		1 404
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	200,500	0,00%	0,00%	20 050		279
ПИК	pikk	4,520	-1,31%	1,13%	10 008	6 043 746	2 230
РБК ИС	RBCI	1,450	0,00%	-0,64%		167 872	203
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	44,000	0,00%	-1,20%	264 750	562 038	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	-1,36%	177 000	17 567	425
Сильвинит	SILV	1000,000	0,00%	0,00%	25 000		7 826
Уралкалий	URKA	7,438	0,00%	-2,21%	7 438	19 075 907	15 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,760	0,00%	0,00%	7 600		874
Распадская	rasp	7,190	-0,14%	-0,12%	201 060	4 034 300	5 622

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	181,150	-1,02%	
Башнефть	AK6		EUR	180,000	-3,74%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,880	0,00%	0,19
ТГК-3	AOMD		USD	9,600	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	42,030	0,31%	25 728,07
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,647	0,47%	0,39
Бурятзолото	BYT		EUR	21,000	-4,55%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,007	40,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,950	0,00%	6 717,43
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	37,480	-0,77%	31 291,44
X5	FIVE		USD	41,400	1,10%	11 056,23
Газпром	GAZ		EUR	22,100	-0,67%	4 513,79
Иркутскэнерго	IRK		EUR	26,750	0,94%	2,80
ЮТК	KUE		EUR	8,100	-2,41%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,050	1,25%	1,73
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,300	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,010	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	70,050	-1,48%	369 891,20
Лукойл	LUK		EUR	49,400	-1,22%	1 485,83
Лукойл	LUKOY	1	USD	69,900	-1,51%	7 836,61
МТС	MBT	5	USD	21,190	-0,70%	53 528,72
МТС	MKY	5	EUR	14,670	-0,64%	18,23
МГТС	MOW		EUR	9,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,970	-0,43%	
Мечел	MTL	3	USD	29,710	-0,20%	39 581,52
НорНикель	NILSY	1	USD	25,280	-0,16%	663,40
НорНикель	NNIA		EUR	17,700	0,14%	75,78
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	133,000	-0,75%	55 080,31
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,150	2,14%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,990	-3,41%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,525	2,31%	
Газпром	OGZD		USD	31,300	-0,89%	531 196,70
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	34,100	1,79%	718,60
Ростелеком	RTL		EUR	23,850	1,71%	0,24
Газпромнефть	SCF		EUR	18,700	0,00%	28,37
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,265	-0,55%	1,47
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,910	0,00%	8,42
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,660	0,89%	58,65
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,530	-0,47%	457,16
АФКСистема	SSA	1	USD	27,300	0,81%	26 507,91
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,010	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,050	-7,88%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	359,000	5,59%	1,70
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,400	0,34%	75,25
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,700	-5,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,940	0,07%	33 422,10
ВТБ	VTBR		USD	6,645	-0,45%	50 468,51
Возрождение	VZY		EUR	26,000	4,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	33,590	0,96%	7 232,24
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,500	1,53%	8,03

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.