ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

31 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

В среду американские фондовые индексы опять закрылись в плюсе. По сути, мы видим желание управляющих инвестиционных фондов нарисовать красивые цифры в своей отчетности по итогам 1-го квартала. Наибольший прирост вчера показали акции строительных, телекоммуникационных и финансовых компаний. Согласно статистике от компании ADP число рабочих мест в частном секторе США в марте выросло на 201 тыс. (прогноз 205 тыс.). Позитивным моментом стала хорошая динамика прироста числа сотрудников в компаниях малого бизнеса. В ходе торговой сессии индекс S&P-500 встретил сопротивление и не смог преодолеть важный рубеж

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	2 035,92	0,85%	1,95%	3,35%	30,32%
Индекс ММВБ	1 815,60	1,54%	2,54%	2,12%	25,75%
FTSE	5 948,30	0,27%	2,63%	-0,76%	4,87%
S&P 500	1 328,26	0,67%	2,37%	0,08%	13,21%
Dow Jones Avg.	12 350,61	0,58%	2,19%	1,02%	13,23%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ВСМПО	123,5000	5,11%	2,40%	23,50%
Башнефть, п.	44,5000	3,49%	17,11%	93,48%
ОАО Группа ЛСР	41,0000	2,50%	-3,30%	41,38%
Башнефть	57,0000	2,24%	7,04%	75,38%
ОАО Синергия	39,1000	0,99%	-9,18%	30,33%
Лукойл	71,1800	0,96%	0,81%	45,27%
Сбербанк	3,7620	0,86%	6,27%	62,16%
ЧТПЗ	2,9500	0,67%	8,06%	76,12%

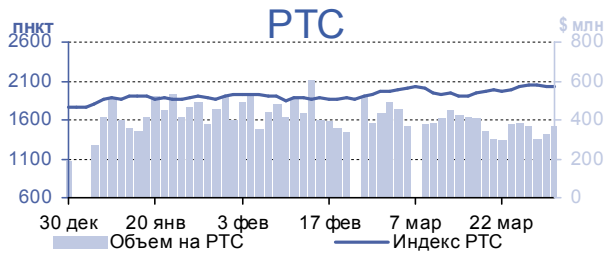
Лидеры снижения

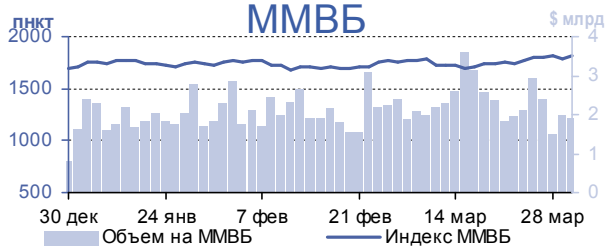
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-3	0,0455	-5,21%	-9,00%	-21,55%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,4425	-1,67%	-14,90%	121,25%
Северсталь	19,5811	-0,42%	3,06%	83,52%
Роснефть	9,2300	-0,05%	-2,69%	30,00%

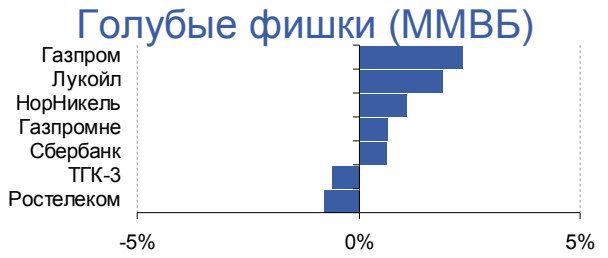
Индекс MSCI

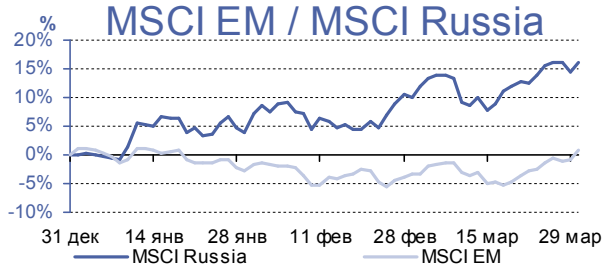
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1159,52	1,48%	4,67%	14,88%
Индекс MSCI BRAZIL	3768,72	2,03%	1,76%	5,71%
Индекс MSCI RUSSIA	1081,31	1,31%	4,93%	28,21%
Индекс MSCI INDIA	523,37	0,95%	9,63%	6,90%
Индекс MSCI CHINA	67,71	1,68%	4,53%	5,64%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В среду американские фондовые индексы опять закрылись в плюсе. По сути, мы видим желание управляющих инвестиционных фондов нарисовать красивые цифры в своей отчетности по итогам 1-го квартала. Наибольший прирост вчера показали акции строительных, телекоммуникационных и финансовых компаний. Согласно статистике от компании ADP число рабочих мест в частном секторе США в марте выросло на 201 тыс. (прогноз 205 тыс.). Позитивным моментом стала хорошая динамика прироста числа сотрудников в компаниях малого бизнеса. В ходе торговой сессии индекс S&P-500 встретил сопротивление и не смог преодолеть важный рубеж сопротивления на 1332 п.

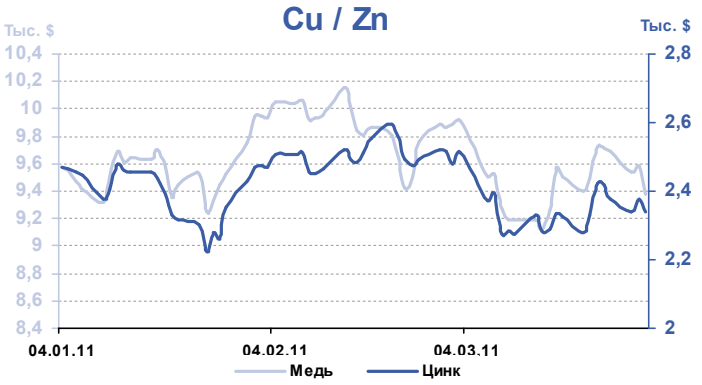
Но в целом в начала квартала рост индекса S&P составил 5,6%, в то время как индекс компаний малой капитализации Russell-2000 вырос на 7,15%.

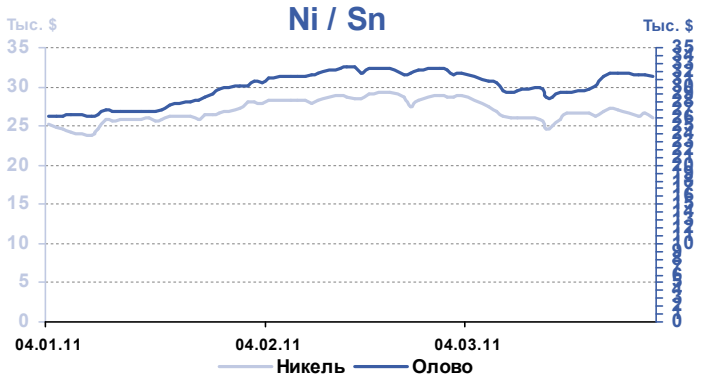
Сегодня утром курс евро по отношению к доллару сумел приблизиться к максимальным уровням за последнюю неделю (1,4160). Позиции европейской валюты укрепляются после комментария члена управляющего совета ЕЦБ Лоренцо Бини Смаги, который подтвердил, что ЕЦБ намерен постепенно повышать процентные ставки. Кстати, тему ухода от рекордных объемов денежного предложения со стороны ФРС даже, несмотря на сложности в Японии и конфликты на Ближнем Востоке озвучил вчера Президент ФРБ Сент-Луиса Джеймс Буллард.

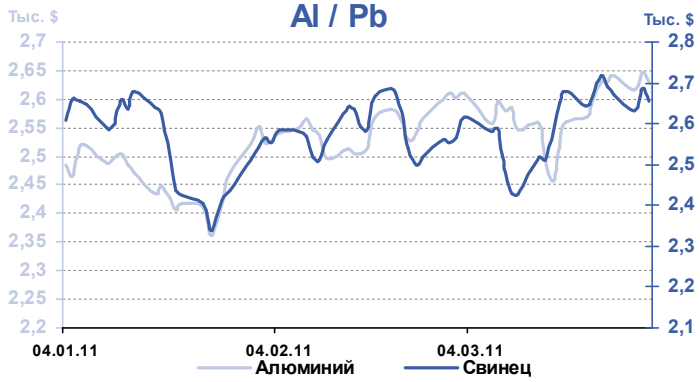
Цены на нефть марки Brent продолжают сохранять стабильность, торгуясь вблизи уровня $115,3/барр. Аналитики Deutsche Bank повысили прогноз по ценам нефть, заявив, что в текущем году средняя цена Brent составит $117,5/барр. Вчерашние данные по запасам нефти в США (рост запасов на 2,95 млн. барр., при прогнозе роста на 1,9 млн. барр.) не оказали на котировки нефти никакого негативного влияния. Сегодняшние торги в Азии в целом проходят в зеленой зоне: MSCI Asia +0,26%. Индекс деловой активности в Японии в марте на фоне разрушительного землетрясения и цунами упал до 46,6 п. по сравнению с 52,9 п. в феврале.

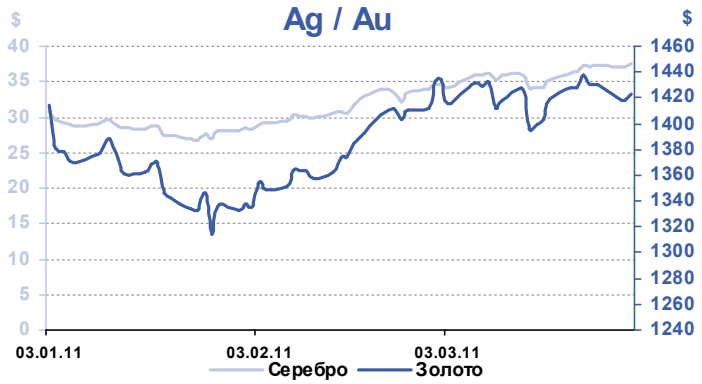
В четверг мы ожидаем увидеть очередной рост индексов на открытии наших бирж. Вчерашняя вялая консолидация рынка вблизи годового максимума наводит на мысль, что сегодня, в последний день марта наши биржевые индексы добавят к своим значениям еще 0,5-0,7%, то есть индекс ММВБ вполне может выйти на уровень 1825 пунктов. Локомотивом движения вверх станут акции нефтяных компаний. Правда, на пути роста акций Газпрома стоит рубеж 230 руб., где ряд инвесторов предпочтет зафиксировать прибыль, а некоторое могут даже начать игру на понижение. Акции Лукойла также могут встретить сопротивление при подходе к рубежу 2050 руб. Активных покупок во втором эшелоне акций под занавес квартала мы не видим, поэтому текущий рост вызывает у нас двоякие чувства. Тем не менее, активно играть на понижение даже с учетом перекупленности рынка пока не стоит. Сегодня компания Evraz Group опубликует финансовый отчет по МСФО за 2010 год.

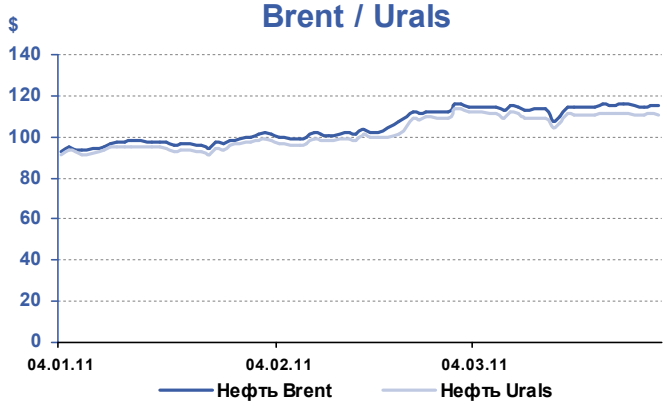
Commodities

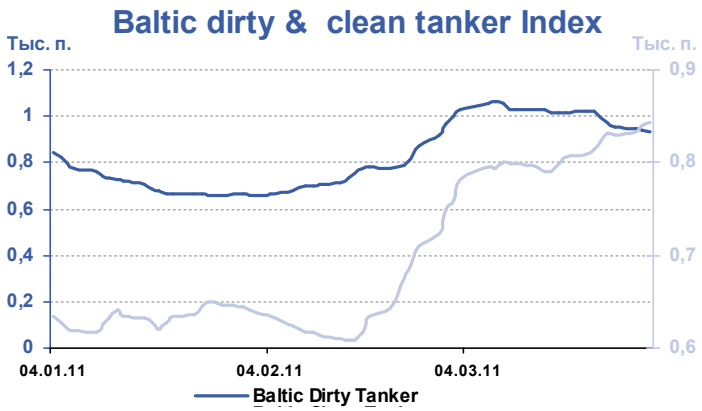












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 381,00	-2,13%	-3,56%	-5,10%	19,50%
Цинк, $/t	2 338,00	-1,56%	-3,55%	-7,22%	-1,76%
Никель, $/t	26 030,00	-2,14%	-2,96%	-10,21%	6,90%
Олово, $/t	31 250,00	-0,98%	-0,32%	-3,33%	70,11%
Алюминий, $/t	2 629,00	-0,72%	-0,08%	1,12%	14,60%
Свинец, $/t	2 655,00	-1,19%	-2,25%	3,63%	24,36%
Серебро, $/oz	37,47	1,14%	0,25%	10,55%	116,64%
Золото, $/oz	1 423,02	0,32%	-1,00%	0,82%	28,94%
Нефть Brent, $/	115,17	-0,27%	0,15%	2,89%	43,10%
Нефть Urals, $/	110,96	-0,11%	-0,05%	1,58%	41,78%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,579	0,00%	1,08%		28 820	289
БашИнСв	BISV	0,509	0,00%	1,75%		79 366	481
БашЭнрг	BEGY	1,843	0,00%	-1,41%		29 477	1 945
ВМЗ	VSMZ	1825,658	0,00%	0,97%		5 472	3 132
ДВМП	FESH	0,521	0,00%	0,61%		117 967	1 544
КазанскВЗ	KHEL	3,511	0,00%	2,48%		111 083	540
КОМСТАР	CMST	7,236	0,00%	0,00%		1 254 551	2 990
Мечел	MTLR	31,177	0,00%	1,16%		1 028 291	12 962
Мотовил	MOTZ	0,088	0,00%	0,46%		5 121	86
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1800,000	0,00%	0,00%	90 000		3 091
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,088	0,00%	0,00%	52 500		87
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,945	0,17%	0,00%	296 856		44 166
СилМашины	SILM	0,358	0,00%	0,95%		13 070	3 136
Сильвинит	SILV	1052,913	0,00%	0,71%		407 566	8 178
СинТЗ-ао	SNTZ	61,440	0,00%	0,00%		4 858	378
Славн-ЯНОС	JNOS	0,414	0,00%	-0,84%		79	368
СТЗ-ао	SVTZ	5,968	0,00%	3,02%		60	287
ТАГМЕТ	TAMZ	0,729	0,00%	0,00%		222	376
ТНК-ВР	TNBP	2,984	0,00%	2,08%		281 485	44 344
У-УАЗ	UUAZ	2,370	0,00%	0,00%		701 360	633
ЧМК	CHMK	296,002	0,00%	-0,22%		59 932	938
ЧТПЗ	CHEP	3,006	0,00%	2,18%		436 293	1 413
ЮжКузб.	UKUZ	60,208	0,00%	0,59%		346 618	2 141
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	57,000	2,24%	0,00%	170 400		9 785
Газпром	GAZP	7,941	0,00%	2,37%	2 178 550	640 227 245	187 991
Газпромнефть	SIBN	5,229	0,00%	0,68%		9 981 000	24 783
Лукойл	LKOH	71,180	0,96%	1,88%	92 534	167 253 888	60 543
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	9,230	-0,05%	0,13%	9 230	97 069 602	97 821
Сургутнефтегаз	SNGS	1,080	0,00%	1,28%	108 000	24 341 173	38 584
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,585	0,00%	2,08%	378 735	17 265 158	4 506
Татнефть	TATN	6,410	0,00%	0,00%	37 191		13 965
Транснефть, п.	TRNFP	1400,000	0,00%	3,44%	140 000	56 404 112	2 177
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,796	0,00%	-0,62%		88 796	3 813
Ленэнерго	LSNG	0,790	0,00%	0,00%	24 710	41 143	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	1,80%	23 750	768 151	2 314
Новосибирскэнерго	NVNG	45,000	0,00%	0,00%	14 985		608
ОГК-2	OGKB	0,054	0,00%	0,00%	27 000		1 768
ОГК-3	OGKC	0,046	-5,21%	-0,75%	22 750	1 279 286	2 161
ОГК-4	OGKD	0,094	0,00%	0,00%	28 050		5 895
ОГК-5	OGKE	0,089	0,00%	1,59%		477 645	3 154
Самараэнерго	SAGO	0,018	0,00%	0,00%	35 800		64
ТГК-3	MSNG	0,097	0,00%	-0,60%	46 363	1 368 391	3 856
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	1,72%	324 500	51 914	701
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,11%	156 557	53 573	894
Телекоммуникации							
ВолгаТелеком	NNSI	5,615	0,00%	0,00%	58 958		1 381
Дальсвязь	ESPK	5,000	0,00%	0,00%	50 000		478
МТС	MTSS	9,100	0,00%	0,00%	45 500		18 139
Ростелеком	RTKM	6,040	0,00%	-0,78%	120 800	4 643 842	4 401
Ростелеком, п.	RTKMP	3,117	0,00%	0,31%		3 680 932	755
СЗТ	SPTL	1,150	0,00%	0,00%	23 000	2 970 410	1 013
СибирьТелеком	ENCO	0,106	0,00%	0,00%	10 550		1 267
Таттелеком	TTLK	0,009	0,00%	2,35%		26 512	180
Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	0,00%	20 340	25 336 625	1 725
ЮТК	KUBN	0,230	0,00%	0,00%	11 500		681

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	1,057	0,00%	-0,06%		109 361	1 473
ГАЗ	GAZA	52,000	0,00%	0,00%	52 000		963
ИРКУТ	IRKT	0,315	0,00%	2,58%	31 500	72 371	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,500	0,00%	0,00%	175 000		539
КАМАЗ	KMAZ	2,669	0,00%	-0,63%		57 050	1 903
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,879	0,00%	-2,38%		31 958	103
РКК Энергия	RKKE	334,718	0,00%	0,00%		7 364	376
Северсталь-авто	SVAV	20,500	0,00%	0,24%	184 500	226 216	703

Металлургия

Бурятзолото	BRZL	32,000	0,00%	0,00%	32 000		225
ВСМПО	VSMO	123,500	5,11%	1,53%	61 750	1 564 974	1 424
Мечел	MTLR	31,020	0,06%	0,00%	7 755		12 913
ММК	MAGN	1,085	0,00%	2,88%	191 043	1 884 097	12 124
НЛМК	NLMK	4,365	0,00%	1,60%	74 205	7 487 381	26 160
НорНикель	GMKN	265,000	0,00%	1,10%	265 000	118 137 457	50 516
Полиметалл	PMTL	18,650	0,00%	0,65%	28 031	825 477	7 448
Полюс Золото	PLZL	58,719	0,00%	0,56%	6 048	3 918 711	11 194
Северсталь	CHMF	19,581	-0,42%	1,80%	58 743	31 094 127	19 732
СТЗ	SVTZ	8,000		0,00%	160 000		373
ТМК	TRMK	5,040	8,39%	3,77%	1 003 600	5 353 060	4 725
ЧТПЗ	CHEP	2,950	0,67%	0,00%	59 000		1 394

Банки

Банк Москвы	MMBM	35,772	0,00%	-0,10%		8 933	6 457
Возрождение	VZRZ	45,000	0,00%	-2,65%	31 500	220 527	1 069
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	1,40%	106 139	59 212 335	35 357
РОСБАНК	ROSB	3,749	0,00%	-0,48%		9 936	2 820
Сбербанк	SBER	3,762	0,86%	0,00%	1 127 500		81 210
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,590	0,00%	-0,14%	221 020	3 792 790	2 876
Дальневосточное МП	FESH	0,515	0,00%	0,00%	51 500		1 520
НМТП	NMTP	0,134	0,00%	0,00%		118 140	2 600
Приморское МП	PRIM	0,176	0,00%	-2,32%		28 321	138
Ютэйр	TMAT	0,570		0,00%	5 700		329

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	0,00%	0,00%	240 000		315
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	0,69%	16 625	64 994	7 206
Верофарм	VRPH	45,209	0,00%	0,00%	300 236		452
Вимм-Билль-Данн	WBDF	133,500	0,00%	-0,18%	102 929	32 202	5 874
Дикси	DIXY	14,400	0,00%	-0,25%	14 400	310 610	1 238
Концерн Калина	KLNA	30,720	0,00%	-0,88%		162 053	301
Красный Октябрь	KROT	11,384	0,00%	1,01%		8 814	104
Магнит	MGNT	139,000	0,00%	1,52%	139 000	1 398 114	12 368
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,046	0,00%	5,66%	1 023	117 818	33
Разгуляй	GRAZ	2,350	0,00%	1,10%	58 846	255 982	372
Фармстандарт	PHST	98,000	0,00%	1,61%	117 350	36 851	3 704
Черкизово	GCHE	28,650	0,00%	2,41%	231 950	194 051	1 234

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,235	0,00%	0,00%	10 575		420
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,770	0,00%	0,69%	38 500	26 038	1 241
Уфанефтехим	UFNC	5,400	0,00%	0,00%	107 500		1 487

Другие сектора

МСЗ, Электросталь	MASZ	200,500	0,00%	0,00%	20 050		279
ПИК	pikk	4,500	0,00%	0,17%	10 008	5 184 083	2 220
РБК ИС	RBCI	1,562	0,00%	1,13%		898 591	218

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	44,000	0,00%	0,05%	418 100	2 390 559	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,614	0,00%	2,23%		77 741	440
Сильвинит	SILV	1000,000	0,00%	0,00%	25 000		7 826
Уралкалий	URKA	7,438	0,00%	2,00%	7 438	15 215 218	15 801

Уголь

Белон	BLNG	0,750	0,00%	0,00%	74 500		863
Распадская	rasp	6,750	0,00%	-0,06%	135 800	10 090 882	5 270

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	177,340	-1,08%	
Башнефть	AK6		EUR	192,000	-4,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,710	-3,39%	18,41
ТГК-3	AOMD		USD	10,300	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	43,540	0,35%	21 666,56
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,631	-0,93%	
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,008	33,33%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	39,290	1,13%	27 271,62
X5	FIVE		USD	42,030	-0,92%	16 067,33
Газпром	GAZ		EUR	22,900	1,48%	3 919,92
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,750	-0,89%	
ЮТК	KUE		EUR	8,700	-1,14%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,250	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,600	1,54%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,010	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	71,000	1,43%	224 279,20
Лукойл	LUK		EUR	50,530	1,44%	713,44
Лукойл	LUKOY	1	USD	71,250	1,09%	14 487,67
МТС	MBT	5	USD	21,540	2,47%	65 373,40
МТС	MKY	5	EUR	15,070	2,34%	
МГТС	MOW		EUR	8,750	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,350	0,27%	0,07
Мечел	MTL	3	USD	31,300	1,69%	48 912,75
НорНикель	NILSY	1	USD	26,500	0,45%	1 870,35
НорНикель	NNIA		EUR	18,825	0,40%	66,62
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	137,000	3,01%	59 137,78
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,000	0,00%	
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,450	-0,67%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,813	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,200	-6,73%	5,20
Газпром	OGZD		USD	32,110	1,61%	491 317,80
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	35,790	-0,31%	1 724,18
Ростелеком	RTL		EUR	25,500	-1,70%	8,50
Газпромнефть	SCF		EUR	18,560	0,32%	122,90
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,412	0,12%	6,69
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,127	1,45%	4,25
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,980	1,36%	432,64
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,640	0,57%	129,71
АФКСистема	SSA	1	USD	28,650	1,60%	8 591,75
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,000	-0,03%	
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	-9,68%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	402,000	-6,51%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,835	-0,32%	4,56
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,800	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,070	-0,42%	33 053,73
ВТБ	VTBR		USD	6,985	1,16%	42 795,29
Возрождение	VZY		EUR	27,250	-6,84%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	33,350	-0,12%	5 953,24
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,350	-0,51%	

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.