ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

6 апреля 2011г.

Комментарий по рынку акций

По итогам торгов во вторник американские фондовые индексы почти не изменили своих значений. Небольшой подъем котировок в секторе добычи природных ресурсов и розничной торговли компенсировался небольшим снижением в акциях страховых компаний и телекоммуникаций. Снижение индекса деловой активности в сфере услуг США в марте до 57,3 п. против 59,7 п. в феврале не принесло на биржи негативной динамики. В опубликованном вчера протоколе последнего заседания ФРС США были обозначены постулаты с заседаний о том, что экономика США набирает силу. Новым моментом здесь стало то, что среди его членов ФОМС не стало единого мнения на счет

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	2 088,64	-0,18%	3,46%	3,51%	28,39%
Индекс ММВБ	1 848,21	-0,21%	3,36%	3,80%	24,25%
FTSE	6 007,06	-0,16%	1,26%	0,03%	3,92%
S&P 500	1 332,63	-0,02%	1,00%	0,12%	12,23%
Dow Jones Avg.	12 393,90	-0,05%	0,94%	1,11%	12,94%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Транснефть, п.	1600,0000	3,23%	13,48%	88,24%
Башнефть, п.	47,2000	2,61%	19,49%	109,78%
НорНикель	278,0000	1,65%	11,20%	68,48%
Акрон	44,0000	0,80%	-6,38%	69,23%
Уфанефтехим	5,4060	0,11%	12,63%	63,82%

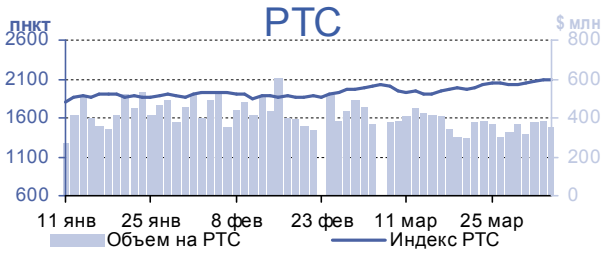
Лидеры снижения

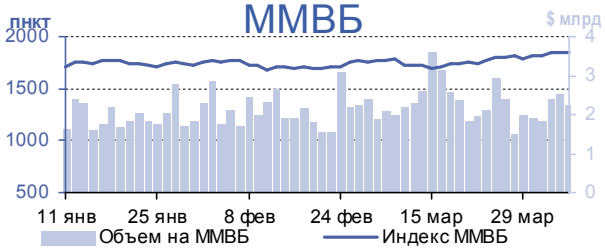
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аптечная сеть 36,6	3,5200	-6,13%	-2,22%	26,62%
ОГК-1	0,0350	-2,78%	-7,16%	-11,17%
Сбербанк	3,7700	-2,58%	6,05%	65,79%
Распадская	6,5500	-2,53%	-14,38%	47,19%

Индекс MSCI

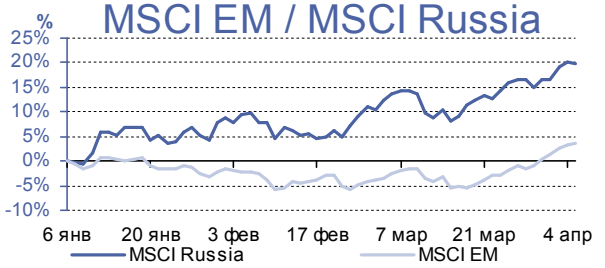
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1194,83	0,14%	5,98%	15,26%
Индекс MSCI BRAZIL	3914,93	0,43%	4,51%	5,69%
Индекс MSCI RUSSIA	1111,84	-0,30%	5,38%	26,42%
Индекс MSCI INDIA	540,73	0,56%	8,70%	6,49%
Индекс MSCI CHINA	70,13	0,02%	6,68%	7,87%

Основные индикаторы









Обзор рынка

По итогам торгов во вторник американские фондовые индексы почти не изменили своих значений. Небольшой подъем котировок в секторе добычи природных ресурсов и розничной торговли компенсировался небольшим снижением в акциях страховых компаний и телекоммуникаций. Снижение индекса деловой активности в сфере услуг США в марте до 57,3 п. против 59,7 п. в феврале не принесло на биржи негативной динамики. В опубликованном вчера протоколе последнего заседания ФРС США были обозначены постулаты с заседаний о том, что экономика США набирает силу. Новым моментом здесь стало то, что среди его членов FOMC не стало единого мнения на счет эффективности QE-2, а также изменилось отношение регулятора к перспективам инфляции. Отмечена важность отслеживания не только общей и базовой инфляции, но и инфляционных ожиданий. В ходе вчерашнего выступления президент ФРБ Сент-Луиса Дж. Буллард прямо указал, что предложит сократить объем QE-2 на $100 млрд. на следующем заседании ФРС.

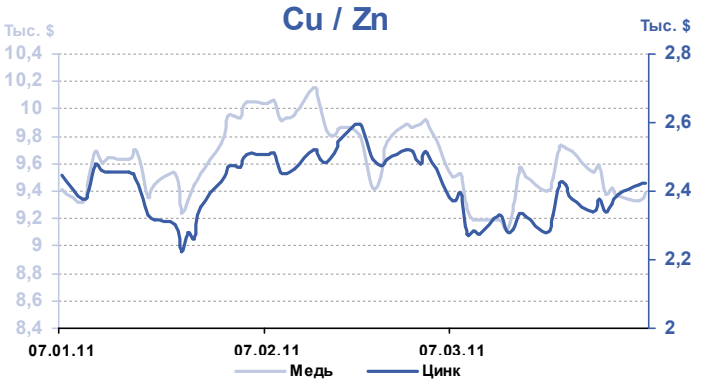
Подобная расстановка сил не повлияла на позиции американского доллара по отношению к евро. Напротив, пара EUR/USD поднялась в среду утром к отметке 1,4260. Золото обновило исторические высоты, поднявшись до отметки $1456/унц. Цены на нефть марки Brent вчера вечером также обновили ценовой рекорд, подскочив до уровня $122,8/барр. Таким образом, незначительная коррекция в котировках после объявления о повышении учетных ставок Народным Банком Китая участниками нефтяного рынка была полностью проигнорирована. Согласно последним данным API запасы нефти в США снизились на 2,8 млн. барр., запасы дистиллятов уменьшились на 1,0 млн. барр., лишь запасы бензина поднялись на 0,57 млн. барр.

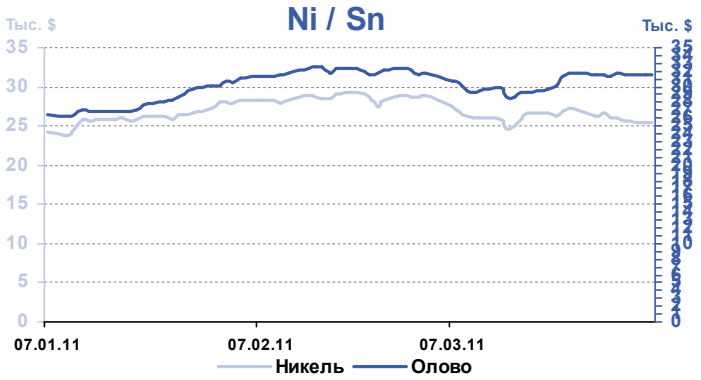
Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят с разнополярной динамикой фондовых индексов. Китайский рынок акций сегодня растет, несмотря на меры ужесточения монетарной политики со стороны Банка Китая. Там наблюдается подъем акций нефтяников и металлургов вслед за ростом цен на сырьевых биржах.

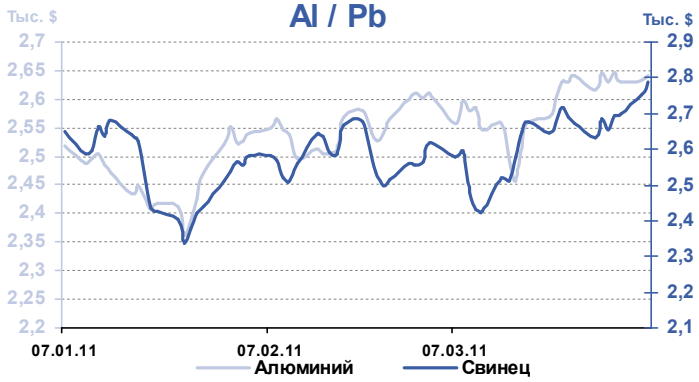
Начало торгов на российском рынке акций в среду мы ожидаем увидеть в позитивном ключе. Внешний фон не дает никаких факторов для коррекции индексов вниз. Индекс ММВБ вчера обозначит поддержку на уровне 1836 пунктов, при этом быстрые утренние продажи сменились новыми робкими покупками акций даже на негативном внешнем фоне. Таким образом, наши фондовые индексы продолжают проторговывать уровни и консолидироваться вблизи годовых максимумов. Слабость банковских акций сегодня опять может быть компенсирована сохранением спроса в бумагах нефтяного сектора и металлургов (цены на медь +1,1%; никель +1,7%). Не стоит забывать, что среда один из самых волатильных и непредсказуемых дней недели, поэтому подъем биржевых индексов в начале сессии вполне может смениться новым снижением под закрытие.

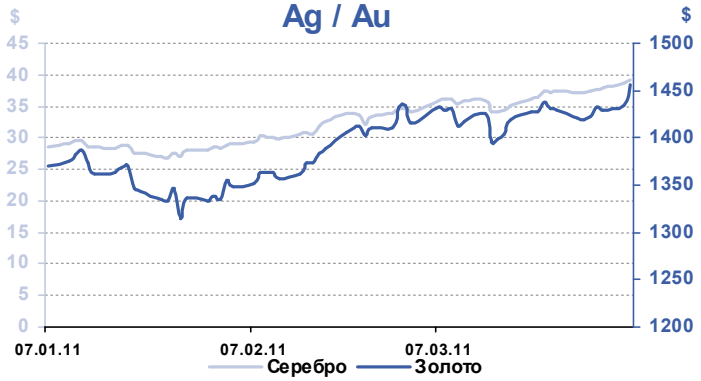
Сегодня в 12-30 ждем данных из Великобритании по промышленному производству. В 13-00 ждем пересмотра оценки роста ВВП еврозоны за 4 кв. В 18-30 Минэнерго США представит отчет по запасам нефти и нефтепродуктов.

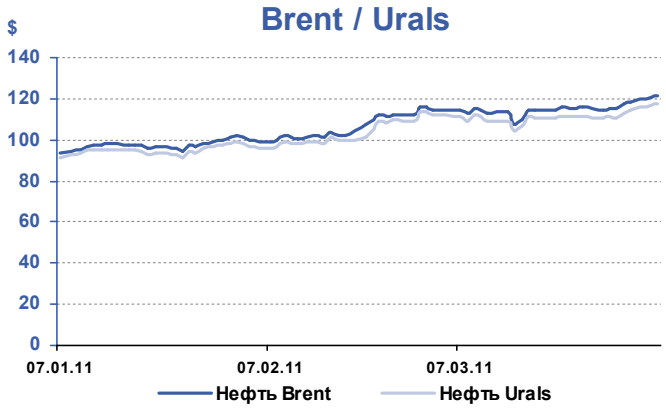
Commodities

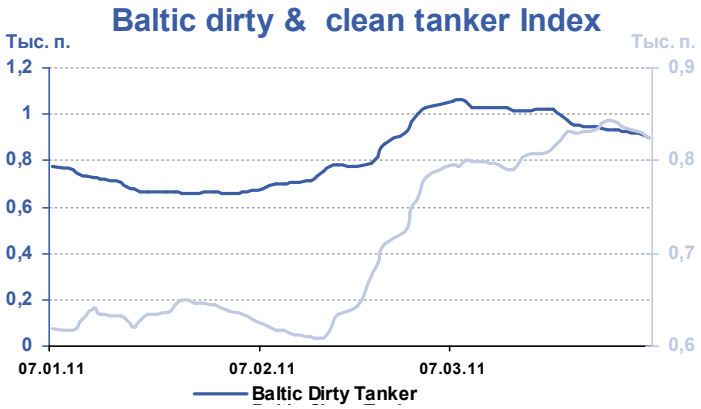












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 390,00	0,64%	-2,03%	-5,30%	17,52%
Цинк, $/t	2 425,00	0,33%	2,11%	-3,46%	-0,94%
Никель, $/t	25 405,00	-0,37%	-4,49%	-11,97%	2,23%
Олово, $/t	31 605,00	-0,06%	0,14%	-0,14%	71,63%
Алюминий, $/t	2 641,00	0,30%	-0,26%	1,11%	11,67%
Свинец, $/t	2 790,00	1,38%	3,83%	6,57%	21,30%
Серебро, $/oz	39,30	1,89%	6,09%	14,88%	117,32%
Золото, $/oz	1 455,73	1,52%	2,62%	2,81%	28,61%
Нефть Brent, $/	121,36	0,57%	5,09%	6,03%	41,83%
Нефть Urals, $/	117,64	0,61%	5,91%	4,84%	41,82%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,581	0,00%	-0,49%		16 941	287
БашИнСв	BISV	0,522	0,00%	2,20%		344 499	493
БашЭнрг	BEGY	1,845	0,00%	-2,47%		6 328	1 940
ВМЗ	VSMZ	1810,392	0,00%	1,59%		37 544	3 070
ДВМП	FESH	0,562	0,00%	3,45%		150 181	1 613
КазанскВЗ	KHEL	3,501	0,00%	-0,50%		552 912	539
КОМСТАР	CMST	7,236	0,00%	0,00%		1 254 551	2 990
Мечел	MTLR	31,491	0,00%	0,07%		995 893	13 051
Мотовил	MOTZ	0,087	0,00%	-0,38%		1 917	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	3,050	0,00%	0,00%	152 500		45 741
СилМашины	SILM	0,345	0,00%	-2,51%		72 884	3 075
Сильвинит	SILV	1085,174	0,00%	-0,68%		969 206	8 381
СинТЗ-ао	SNTZ	58,839	0,00%	0,00%		59	370
Славн-ЯНОС	JNOS	0,456	0,00%	0,00%		681	424
СТЗ-ао	SVTZ	5,974	0,00%	-0,26%		60	288
ТАГМЕТ	TAMZ	0,763	0,00%	0,00%		645	410
ТНК-ВР	TNBP	3,076	0,00%	-0,56%		217 014	46 034
У-УАЗ	UUAZ	2,381	0,00%	0,00%		326 754	636
ЧМК	CHMK	289,238	0,00%	-1,45%		1 228 519	914
ЧТПЗ	CHEP	3,394	0,00%	4,01%		1 095 929	1 592
ЮжКузб.	UKUZ	61,348	0,00%	0,87%		191 439	2 181
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	61,000	0,00%	0,00%	454 965		10 380
Газпром	GAZP	8,480	0,00%	0,43%	1 892 000	596 311 491	200 751
Газпромнефть	SIBN	5,277	0,00%	-1,09%		2 868 975	24 985
Лукойл	LKOH	72,400	0,00%	-0,48%	289 400	148 808 851	61 581
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	9,150	0,00%	0,26%	9 150	109 370 201	96 973
Сургутнефтегаз	SNGS	1,099	0,00%	2,30%	1 099 000	35 542 258	39 263
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,620	0,00%	0,39%	62 000	11 116 744	4 775
Татнефть	TATN	6,700	0,00%	0,00%	666 000		14 597
Транснефть, п.	TRNFP	1600,000	3,23%	0,00%	160 000	68 967 689	2 488
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,811	0,00%	-0,67%		58 815	3 883
Ленэнерго	LSNG	0,790	0,00%	-0,37%	24 710	18 859	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	-1,50%	23 750	208 307	2 314
Новосибирскэнерго	NVNG	45,000	0,00%	0,00%	14 985		608
ОГК-2	OGKB	0,054	0,00%	0,00%	27 442		1 768
ОГК-3	OGKC	0,046	0,00%	0,91%	22 750	568 171	2 161
ОГК-4	OGKD	0,099	0,00%	0,00%	49 250		6 116
ОГК-5	OGKE	0,095	0,00%	-0,63%		1 078 380	3 371
Самараэнерго	SAGO	0,018	0,00%	0,00%	35 800		64
ТГК-3	MSNG	0,097	0,00%	0,47%	46 363	1 032 321	3 856
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-2,06%	58 110	7 975	689
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,14%	156 557	26 209	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	9,150	0,00%	0,00%	26 361		18 239
Ростелеком	RTKM	6,040	0,00%	0,43%	120 800	8 635 785	4 401
Ростелеком, п.	RTKMP	3,400	0,00%	-1,44%	34 000	7 636 322	826
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	0,008	0,00%	1,54%		68 188	165
Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	0,00%	20 340	25 336 625	1 725
Машиностроение							

АвтоВАЗ	AVAZ	1,070	0,00%	0,50%		150 864	1 471
ГАЗ	GAZA	53,000	0,00%	0,00%	39 750		982
ИРКУТ	IRKT	0,315	0,00%	-1,38%	31 500	71 604	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,500	0,00%	0,00%	175 000		539
КАМАЗ	KMAZ	2,647	0,00%	-0,33%		171 665	1 874
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,896	0,00%	-0,70%		171 191	100
РКК Энергия	RKKE	321,840	0,00%	1,13%		71 313	376
Северсталь-авто	SVAV	20,500	0,00%	-1,13%	184 500	1 414 601	703
Металлургия							
Бурятзолото	BRZL	32,000	0,00%	0,00%	32 000		225
ВСМПО	VSMO	122,000	0,00%	-0,87%	24 400	352 576	1 407
Мечел	MTLR	31,200	0,00%	0,00%	7 800		12 988
ММК	MAGN	1,085	0,00%	-2,13%	191 043	3 261 936	12 124
НЛМК	NLMK	4,365	0,00%	-0,85%	74 205	3 743 417	26 160
НорНикель	GMKN	278,000	1,65%	-1,11%	278 000	248 487 666	52 613
Полиметалл	PMTL	18,650	0,00%	3,59%	28 031	6 136 890	7 448
Полюс Золото	PLZL	58,739	0,00%	1,41%	4 347	10 792 132	11 197
Северсталь	CHMF	19,679	-0,66%	-0,36%	72 813	21 900 020	19 831
СТЗ	SVTZ	8,000	0,00%	0,00%	160 000		373
ТМК	TRMK	5,150	0,00%	-0,30%	51 500	1 780 907	4 829
ЧТПЗ	CHEP	3,150	0,00%	0,00%	31 250		1 488
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,246	0,00%	-1,06%		49 918	6 292
Возрождение	VZRZ	43,000	0,00%	-0,64%	21 500	106 072	997
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-1,60%	106 139	92 255 096	35 357
РОСБАНК	ROSB	3,776	0,00%	-0,19%		3 378	4 668
Сбербанк	SBER	3,770	-2,58%	0,00%	1 117 805		81 383
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,560	0,00%	-0,15%	370 750	1 460 597	2 843
Дальневосточное МП	FESH	0,540	0,00%	0,00%	108 000		1 594
НМТП	NMTP	0,133	0,00%	-1,77%		158 560	2 560
Приморское МП	PRIM	0,185	0,00%	2,27%		7 473	145
Ютэйр	TMAT	0,560	0,00%	0,00%	56 000		323
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,520	-6,13%	0,00%	299 200		370
Балтика	PKBA	46,400	0,00%	-0,28%	65 702	99 100	7 040
Верофарм	VRPH	47,000	0,00%	0,00%	23 500		470
Вимм-Билль-Данн	WBDF	133,500	0,00%	0,29%	102 929	12 896 663	5 874
ГУМ	GUMM	1,430	0,00%	0,00%	14 300		86
Дикси	DIXY	14,200	0,00%	-0,69%	285 000	61 177	1 221
Концерн Калина	KLNA	30,920	0,00%	1,10%	22 132 720	22 444	302
Красный Октябрь	KROT	11,491	0,00%	-2,38%		17 560	106
Магнит	MGNT	138,500	-1,07%	-1,55%	69 250	1 742 935	12 323
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,046	0,00%	-1,35%	1 023	25 010	33
Разгуляй	GRAZ	2,570	0,00%	-0,93%	153 500	479 476	406
Фармстандарт	PHST	96,000	-2,04%	-0,91%	69 216	56 906	3 628
Черкизово	GCHE	28,650	0,00%	0,72%	231 950	191 886	1 234
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,235	0,00%	0,00%	10 575		420
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,770	0,00%	1,39%	38 500	111 372	1 241
Уфанефтехим	UFNC	5,406	0,11%	0,00%	54 060		1 488
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	230,000	0,00%	0,00%	23 000		320
ПИК	pikk	4,500	0,00%	-1,38%	10 008	5 594 336	2 220
РБК ИС	RBCI	1,500	-3,23%	-1,59%	3 450	440 136	210
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	44,000	0,80%	0,01%	880 000	1 036 736	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,610	0,00%	0,48%	30 500	17 064	440
Сильвинит	SILV	1000,000	0,00%	0,00%	25 000		7 826
Уралкалий	URKA	8,200	0,00%	-0,20%	82 000	16 993 443	17 420
Уголь							
Белон	BLNG	0,750	0,00%	0,00%	74 500		863
Распадская	rasp	6,550	-2,53%	-1,58%	1 180 450	13 443 320	5 114

УК Южный Кузбасс	UKUZ	61,500	0,00%	0,00%	61 500		2 221

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	178,230	-0,51%	
Башнефть	AK6		EUR	209,000	-1,42%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,512	-4,91%	251,46
ТГК-3	AOMD		USD	10,550	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	47,160	0,51%	9 312,13
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,623	-0,22%	5,44
Бурятзолото	BYT		EUR	19,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,006	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	39,950	-1,19%	44 565,32
X5	FIVE		USD	41,780	-1,69%	10 662,54
Газпром	GAZ		EUR	23,885	0,15%	4 808,26
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,000	0,00%	
ЮТК	KUE		EUR	8,700	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,250	1,19%	10,16
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,200	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,010	1,00%	
Лукойл	LKOD		USD	72,450	-0,28%	280 027,10
Лукойл	LUK		EUR	51,090	0,10%	448,43
Лукойл	LUKOY	1	USD	72,650	-0,59%	13 978,57
МТС	MBT	5	USD	21,080	-1,86%	83 646,79
МТС	MKY	5	EUR	14,595	-1,85%	31,41
МГТС	MOW		EUR	8,750	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,350	3,52%	
Мечел	MTL	3	USD	31,760	-0,56%	41 574,00
НорНикель	NILSY	1	USD	27,500	-1,26%	2 430,02
НорНикель	NNIA		EUR	19,325	-1,15%	141,69
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	140,600	-0,28%	38 030,70
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,000	-33,33%	
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,500	1,52%	0,75
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,000	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,200	-3,26%	2,08
Газпром	OGZD		USD	33,800	0,30%	633 211,60
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	25,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	36,450	-1,19%	370,62
Ростелеком	RTL		EUR	25,450	1,46%	3,30
Газпромнефть	SCF		EUR	18,535	-1,83%	121,71
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,780	1,04%	15,67
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,250	0,78%	4,06
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,190	0,65%	113,53
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	11,350	2,62%	1 003,43
АФКСистема	SSA	1	USD	29,860	-1,78%	8 440,72
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	24,750	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	38,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	419,000	-4,34%	0,43
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,625	-1,61%	7,60
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,800	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,440	-0,69%	22 529,19
ВТБ	VTBR		USD	6,995	-1,89%	93 436,00
Возрождение	VZY		EUR	26,750	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	33,690	0,24%	3 540,52
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,390	0,09%	28,02

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.