12 мая 2011 г.

Ежедневный аналитический обзор «Ваш консультант»

Внешний фон

Внешний фон сегодня складывается **негативный**: торги в Штатах завершились снижением, которое не было накануне отыграно нашим рынком фьючерсы утром настроены негативно. В Азии торги проходят также с негативом. Цены на нефть утром снижаются. Открытие торгов ожидаем **с гэпом вниз в районе 1,5%**.

Наиболее важные индексы

РТС	1908,46	-1%
ММВБ	1654,78	-1,39%
DowJones	12630,03	-1,02%
S&P500	1342,08	-1,11%
НефтьBrent	113,8	+1,09%

Лидеры роста и падения прошлых торгов , %

Лензолото	+11,72
ВТГК	+8,82
Автоваз ао	+2,71
ГМК НорНикель	-2,67
Автоваз ап	-2,73
ММК	-3,2
Полиметалл	-3,26
МТС	-4,11
ВТГК	-5,58

Индекс ММВБ на прошедших торгах



Фьючерс на индекс РТС на прошедших торгах



Торговые идеи на сегодня:

Спекулятивно покупаем внутри дня на утреннем гэпе вниз, среднесрочно позиции пока не открываем

- **Газпром***: покупаем от уровня 205руб. с целью от отскока на 208-209руб., ставим стоп-лосс на 204руб.*
- **Сургутнефтегаз ап***: держим акции до закрытия реестра.*
- **РусГидро***: закрыли акции по стоп-лоссу с прибылью, новые позиции пока не открываем.*
- **Лукойл***: покупаем акции от уровня 1750руб. с целью отскока на 1-1,5%., ставим стоп-лосс на 1740руб.*
- **Сбербанк***: покупаем от уровня 95руб. с целью отскока на 96,5-97руб., ставим стоп-лосс на пробой 94,5руб.*

Обзор торгов накануне

Торги в среду проходили очень волатильно. В первой половине дня участники рынка никак не могли определиться с направлением, уводя котировки то вниз, то вверх. Поводом для оптимизма был отскок цен на нефть и нвоости из китая, где удалось замедлить инфляцию и китайский правительственный экономист Ван Цзян сообщил, что Китай может понизить базовую учетную ставку до конца 2011г. На этом фоне индекс ММВБ почти сумел дойти до уровня 1700п, но выше уже не получилось. Сначала торги по нефти в США начались снижением, а потом на плохом отчете компании Disney падать стали и американские акции. Это спровоцировало резкие распродажи и на нашем рынке, особенно резко в последний час распродавали Газпром. В итоге рынок после классического отскока вверх теперь с высокой степенью вероятности пойдет обновлять свои годовые минимумы.
Аутсайдерами накануне были акции металлургов, которые продолжают безостановочное падение. В угольном секторе не порадовали новости Распадской: компания Мечел, долгое время бывшая основным претендентом на ее покупку, не смогла договориться о сделке. Голубая фишка отрасли, Норильский Никель, также стал одним из лидеров падения.
Нефтяные компании накануне следовали за динамикой нефтяных цен с соответствующим результатом. Не смог избежать падения даже Газпром, который в начале дня был лучше рынка перед закрытием реестра. Устоял перед распродажами только Сургут, где дивиденды ожидаются намного выше, чем в Газпроме.
Более-менее стабильно вчера чувствовали себя банки. Сбербанк даже на всеобщих распродажах пытался бороться с негативом, но в итоге сдался и он.

Прогноз по ходу торгов на сегодня

Рост накануне предсказуемо оказался лишь завершением коррекции верх после падения. От уровня 1700п по индексу ММВБ рынок снова развернулся вниз и нацелен на обновление годовых минимумов. Сегодня с утра на негативном внешнем фоне можно ожидать панических распродаж, в результате которых имеем шансы сходить на уровень 1600-1610п. Там проходит поддержка, от которой покупатели могут организовать отскок вверх. Спекулятивно можно поиграть на этом и поймать 1-1,5% роста внутри дня, но стоит обязательно помнить, что общая динамика остается негативной и рынок в любой момент может пойти дальше вниз. Интересными бумагами для игры на отскок являются Газпром и Сбербанк (при достижении 205руб. и 95руб. соответственно).
Сегодня ожидается достаточно существенная порция значимой статистики, рекомендуем внимательно следить за ней внутри дня.

Ожидаемые сегодня события:

- 12:30 мск - Великобритания - Промышленное производство - март Прогноз: 0,8% Предыдущее значение: -1,2%
- 13:00 мск - Еврозона - Промышленное производство - март Прогноз: 0,3% Предыдущее значение: 0,5%
- 16:30 мск - США - Количество первичных заявок на пособие по безработице - за неделю до 7 мая Прогноз: 430 000 Предыдущее значение: 474 000
- 16:30 мск - США - Индекс цен производителей - апрель Прогноз: 0,6% Предыдущее значение: 0,7%
- 16:30 мск - США - Розничные продажи - апрель Прогноз: 0,6% Предыдущее значение: 0,4%
- 16:30 мск - США - Выступление члена FOMC Чарльза Плоссера
- 18:00 мск - США - Выступление главы ФРС США Бена Бернанке 18:00 мск - США - Производственные запасы - март Прогноз: 0,8% Предыдущее значение: 0,5%