ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

19 мая 2011г.

Комментарий по рынку акций

В среду торги на фондовых биржах США завершились уверенным ростом индексов. Взлет цен на сырье (металлы, нефть), впервые за последние три дня, вывел вчера в лидеры роста акции горнодобывающих и нефтяных компаний. Благоприятная корпоративная отчетность Dell также позитивно влияла на настроения биржевых игроков. Но даже несмотря на неплохую коррекцию в локальных минимумов, индекс S&P-500 остается зажатым в границах нисходящего канала, с верхней границей, проходящей на уровне 1350 пунктов. В среду вечером был опубликован протокол последнего заседания ФРС, из которого явствует, что среди голосующих членов FOMC велось активное

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 849,60	1,13%	-3,08%	-6,97%	28,54%
Индекс ММВБ	1 627,03	1,14%	-1,68%	-7,33%	19,43%
FTSE	5 923,49	1,07%	-0,88%	0,45%	11,61%
S&P 500	1 340,68	0,88%	-0,10%	2,14%	19,62%
Dow Jones Avg.	12 560,18	0,65%	-0,55%	2,39%	19,50%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ЧЦЗ	5,0000	8,70%	1,01%	35,50%
Башнефть, п.	43,0000	6,17%	-5,22%	82,98%
Возрождение	36,6000	2,52%	3,10%	17,68%
ВСМПО	125,0000	1,63%	4,17%	30,21%
Северсталь-авто	17,9000	1,53%	-12,68%	8,48%
Акрон	44,0000	0,69%	1,15%	69,23%
Башнефть	54,6800	0,33%	-6,93%	56,68%
Сбербанк	3,4280	0,23%	-4,65%	38,79%

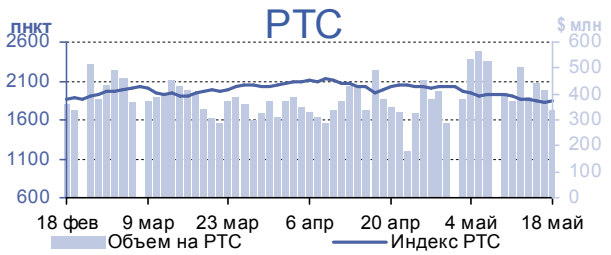
Лидеры снижения

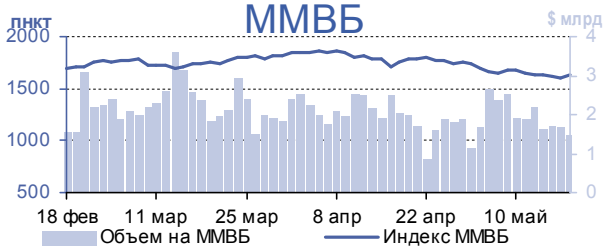
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аптечная сеть 36,6	3,0600	-18,40%	-13,07%	17,69%
Нижнекамскшина	1,2000	-14,29%	50,00%	20,00%
ОАО Волжская ТГК (ОАО	0,0640	-8,45%	-8,57%	29,16%
ГАЗ	43,0000	-4,44%	-8,51%	59,26%

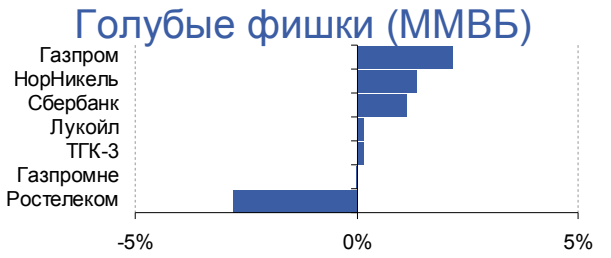
Индекс MSCI

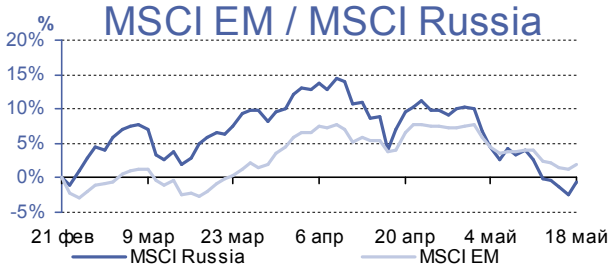
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1142,47	0,80%	-2,05%	21,57%
Индекс MSCI BRAZIL	3501,67	-0,07%	-7,03%	12,48%
Индекс MSCI RUSSIA	979,89	1,79%	-7,08%	27,06%
Индекс MSCI INDIA	488,08	-0,24%	-6,35%	5,01%
Индекс MSCI CHINA	67,42	0,83%	-2,20%	14,12%

Основные индикаторы









Обзор рынка

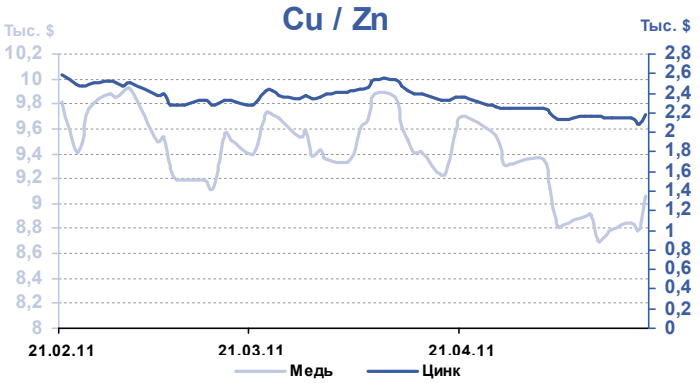
В среду торги на фондовых биржах США завершились уверенным ростом индексов. Взлет цен на сырье (металлы, нефть), впервые за последние три дня, вывел вчера в лидеры роста акции горнодобывающих и нефтяных компаний. Благоприятная корпоративная отчетность Dell также позитивно влияла на настроения биржевых игроков. Но даже несмотря на неплохую коррекцию в локальных минимумов, индекс S&P-500 остается зажатым в границах нисходящего канала, с верхней границей, проходящей на уровне 1350 пунктов. В среду вечером был опубликован протокол последнего заседания ФРС, из которого явствует, что среди голосующих членов FOMC велось активное обсуждение предложений о сворачивании стимулирующих мер, однако по факту зафиксировано, что отход от сверхмягкой монетарной политики не обязательно будет принят в скором времени.

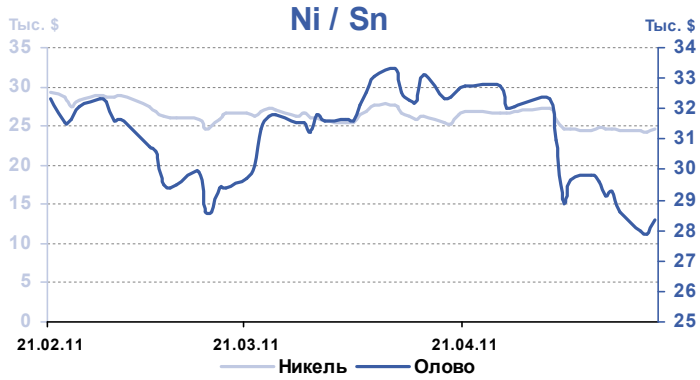
Валютная пара EUR/USD продолжает неактивное постепенное восстановление, а трейдеры надеются попробовать на прочность ближайший уровень сопротивления на отметке 1,4310. Торги нефтяными контрактами в среду завершились сильным ростом котировок, на фоне отчета департамента энергетики США, который вместо роста показал незначительное снижение запасов нефти. В результате в Нью-Йорке цена на нефть марки WTI выросла более, чем на $3, а в Лондоне котировки нефти Brent выросли на $2,5 до $112,6/барр. Сегодняшние торги на азиатских биржах не носят однозначной позитивной динамики: MSCI Asia +0,1%. Вышедшая статистика из Японии показала, что 1-м квартале 2011 г. ВВП страны снизился на -0,9% кв/кв, -3,7% г/г, что существенно хуже прогнозов.

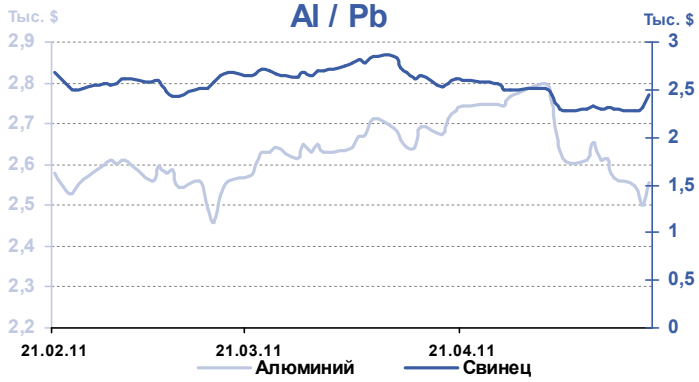
В четверг мы ожидаем увидеть очередной высокий старт торгов на ММВБ. Вечерние покупки ликвидных акций сегодня должны себя оправдать, правда, по нашим оценкам индекс ММВБ сегодня утром опять найдет сопротивление на отметке 1635 п. Показательно, что стремительный рост фьючерса РТС под закрытие торгов в среду сопровождался резким снижением объемов открытого интереса (ОИ), что пока не подтверждает силу движения вверх. Плюс к этому нас несколько напрягает неоднозначная динамика торгов на рынках развивающих стран (Bovespa -1,31%; Kospi -1,44%). Остается надеяться только на то, что вчерашний позитив в Штатах сегодня будет продолжен в Европе, что возможно окажет моральную поддержку нашим покупателям в их стремлении выйти вверх за границы консолидации.

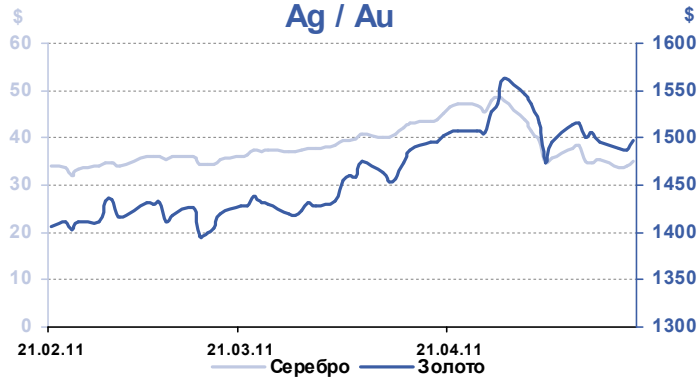
Сегодня в 12-30 ждем статистики из Великобритании по объемам розничных продаж за апрель. В 16-30 выходят данные из США по количеству заявок на пособие по безработице. В 18-00 ждем статистику по продажам на вторичном рынке жилья, а также индексу деловой активности ФРБ Филадельфии за май. В это же время выходит индекс опережающих индикаторов за апрель.

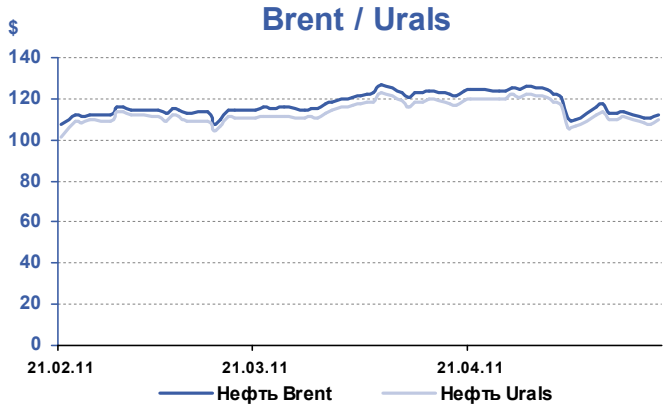
Commodities

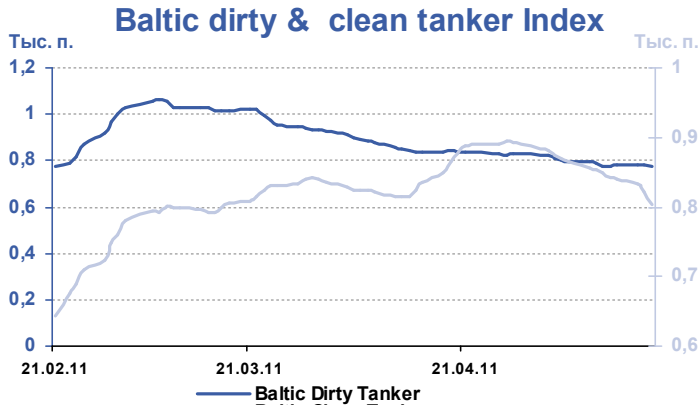












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 065,00	3,02%	4,20%	-2,94%	35,40%
Цинк, $/t	2 188,00	4,64%	1,30%	-6,05%	12,84%
Никель, $/t	24 675,00	2,17%	0,51%	-2,47%	11,40%
Олово, $/t	28 355,00	1,72%	-2,64%	-12,48%	62,03%
Алюминий, $/t	2 556,00	2,20%	-2,14%	-5,82%	24,56%
Свинец, $/t	2 445,00	5,89%	6,54%	-4,38%	33,24%
Серебро, $/oz	35,11	3,36%	-0,20%	-20,16%	84,28%
Золото, $/oz	1 497,15	0,70%	-0,27%	0,06%	22,20%
Нефть Brent, $/	112,52	1,51%	-0,06%	-7,44%	54,48%
Нефть Urals, $/	109,69	1,77%	-0,38%	-6,23%	56,12%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,479	0,00%	-0,87%		88 233	241
БашИнСв	BISV	0,497	0,00%	-0,71%		27 934	475
БашЭнрг	BEGY	1,521	0,00%	-3,39%		28 946	1 588
ВМЗ	VSMZ	1820,608	0,00%	2,00%		9 074	3 117
ДВМП	FESH	0,551	0,00%	0,33%		105 337	1 655
КазанскВЗ	KHEL	3,573	0,00%	0,09%		72 043	551
Мечел	MTLR	25,818	0,00%	0,43%		1 140 603	10 820
Мотовил	MOTZ	0,080	0,00%	3,21%		2 227	79
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,078	0,00%	0,00%	7 800		77
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,870	0,00%	0,00%	172 000		43 041
СилМашины	SILM	0,318	0,00%	0,66%		54 375	2 756
Сильвинит	SILV	1017,285	0,00%	0,00%		346 858	7 823
СинТЗ-ао	SNTZ	53,835	0,00%	-2,90%		323	339
Славн-ЯНОС	JNOS	0,385	0,00%	0,00%		311	363
СТЗ-ао	SVTZ	5,165	0,00%	0,00%		1 653	249
ТАГМЕТ	TAMZ	0,662	0,00%	2,78%		10 980	334
ТНК-ВР	TNBP	2,858	0,00%	-0,37%		609 948	43 085
У-УАЗ	UUAZ	1,893	0,00%	-0,81%		66 856	508
ЧМК	CHMK	258,033	0,00%	0,11%		31 150	821
ЧТПЗ	CHEP	2,821	0,00%	-0,16%		55 054	1 327
ЮжКузб.	UKUZ	54,189	0,00%	1,34%		31 907	1 940
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	54,680	0,33%	0,00%	1 487 196		9 359
Газпром	GAZP	7,040	0,00%	2,19%	49 280	429 292 454	166 662
Газпромнефть	SIBN	4,500	0,00%	-0,02%	90 000	5 392 374	21 336
Лукойл	LKOH	61,800	0,00%	0,17%	309 000	120 261 915	52 565
НОВАТЭК	NVTK	12,500	0,00%	0,00%	1 123 450		37 954
Роснефть	ROSN	8,143	0,00%	-0,32%		96 170 927	86 733
Сургутнефтегаз	SNGS	0,953	0,00%	1,91%		20 558 219	33 852
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	0,20%	51 000	7 218 554	3 928
Татнефть	TATN	5,500	0,00%	0,00%	691 000		11 983
Татнефть, п.	TATNP	3,070	0,00%	0,00%	21 490		453
Транснефть, п.	TRNFP	1450,000	0,00%	-0,26%	72 500	15 669 240	2 255
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,570	0,00%	0,00%	79 250		1 637
Иркутскэнерго	IRGZ	0,705	0,00%	-0,52%		50 541	3 369
Ленэнерго	LSNG	0,700	0,00%	0,05%	5 600	28 564	648
МОЭСК	MSRS	0,044	0,00%	-1,31%	2 200	67 331	2 256
ОГК-2	OGKB	0,057	0,00%	0,00%	28 669		1 850
ОГК-3	OGKC	0,048	0,00%	0,47%		180 462	2 263
ОГК-4	OGKD	0,082	0,00%	0,00%	100 900		5 138
ОГК-5	OGKE	0,087	0,00%	0,44%	43 500	1 015 442	3 077
Самараэнерго	SAGO	0,018	0,00%	0,00%	36 000		64
ТГК-3	MSNG	0,093	0,00%	0,16%	23 125	1 186 010	3 677
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	1,99%		19 630	550
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,21%	124 365	128 640	708
Телекоммуникации							
МГТС, п.	MGTSP	15,000		0,00%	15 000		239
МТС	MTSS	9,100	0,00%	0,00%	129 565		18 804
Ростелеком	RTKM	5,189	-3,19%	-2,78%	142 123	10 781 757	15 273
Ростелеком, п.	RTKMP	3,150	0,00%	-1,30%	63 000	1 551 650	765
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	0,92%		8 727	160
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,915	0,00%	0,29%		183 456	1 270
ГАЗ	GAZA	43,000	-4,44%	0,00%	16 125		796
ИРКУТ	IRKT	0,333	0,00%	-0,11%		36 397	330
Казанский ВЗ	KHEL	3,615	0,00%	0,00%	15 182		557
КАМАЗ	KMAZ	2,103	0,00%	0,27%		98 939	1 495
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,250	0,00%	0,00%	17 625		90

ОМЗ	OMZZ	3,440	22,86%	-2,49%	1 066 400	1 622 932	122
РКК Энергия	RKKE	304,031	0,00%	4,10%		44 057	339
Северсталь-авто	SVAV	17,900	1,53%	-1,52%	17 900	579 942	613
Силовые машины	SILM	0,318	-6,62%	0,00%	34 830		2 765
УМПО	UFMO	0,630	0,00%	0,00%	2 016		179
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,472	0,00%	0,00%	23 581		235
ВСМПО	VSMO	125,000	1,63%	0,60%	62 500	642 380	1 441
Мечел	MTLR	25,450	0,00%	0,00%	50 850		10 594
ММК	MAGN	0,856	0,00%	0,53%	21 400	3 228 334	9 565
НЛМК	NLMK	3,700	0,00%	1,00%	92 500	5 454 847	22 175
НорНикель	GMKN	258,000	0,00%	1,37%	322 500	103 930 406	49 182
Полиметалл	PMTL	16,300	0,00%	5,89%	77 865	4 583 794	6 510
Полюс Золото	PLZL	67,600	0,00%	-0,16%	268 750	13 701 981	12 886
Северсталь	CHMF	18,220	0,00%	2,55%	37 492	31 392 308	18 360
ТМК	TRMK	4,792	0,00%	1,48%		907 205	4 452
ЧТПЗ	CHEP	3,000	0,00%	0,00%	15 000		1 417
Банки							
Банк Москвы	MMBM	33,515	0,00%	0,51%		18 081	6 038
Возрождение	VZRZ	36,600	2,52%	2,18%	73 200	54 980	869
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,83%	6 100	57 479 848	31 905
РОСБАНК	ROSB	3,807	0,00%	1,27%		20 696	4 698
Сбербанк	SBER	3,428	0,23%	0,00%	1 833 332		74 000
УРАЛСИБ	USBN	0,008	0,00%	0,00%	8 000		2 341
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,410	0,00%	0,51%	139 415	3 899 326	2 677
Дальневосточное МП	FESH	0,550	0,00%	0,00%	27 500		1 623
НМТП	NMTP	0,122	0,00%	1,50%		100 554	2 303
Приморское МП	PRIM	0,180	0,00%	-2,49%	6 300	28 277	143
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,060	-18,40%	0,00%	13 709		321
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	0,15%	9 215	17 646	7 206
Верофарм	VRPH	42,000	0,00%	0,00%	42 000		420
Вимм-Билль-Данн	WBDF	138,300	0,00%	-3,14%	69 150	28 736	6 085
Дикси	DIXY	12,000	0,00%	-0,88%	60 000	172 773	1 032
Концерн Калина	KLNA	39,600	0,00%	1,22%	9 900	78 085	386
Красный Октябрь	KROT	11,539	0,00%	-1,94%		28 335	108
Магнит	MGNT	130,000	0,00%	0,97%	494 000	2 411 293	11 567
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,348	0,00%	-1,36%		41 242	22
Разгуляй	GRAZ	2,215	0,00%	-2,40%	997	306 118	350
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	40 000		600
Фармстандарт	PHST	82,000	0,00%	-0,80%	16 545	56 027	3 099
Черкизово	GCHE	29,000	0,00%	0,56%	67 425	5 456	1 249
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,225	0,00%	0,00%	11 250		402
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,823	0,00%	0,51%	82 250	201 736	1 325
Уфанефтехим	UFNC	5,750	0,00%	0,00%	57 500		1 583
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	220,000	0,00%	0,00%	5 500		306
ПИК	pikk	3,834	0,00%	1,00%	23 004	1 243 531	1 891
РБК ИС	RBCI	1,315	0,00%	0,60%	15 780	127 918	184
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	44,000	0,69%	0,59%	8 800	2 695 704	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,585	0,00%	12,15%		276 358	414
Сильвинит	SILV	980,000	0,00%	0,00%	30 380		7 669
Уралкалий	URKA	7,750	0,00%	0,05%	77 500	20 591 932	16 464
Уголь							
Распадская	rasp	5,610	-1,41%	0,83%	115 555	5 521 156	4 380
УК Южный Кузбасс	UKUZ	55,000	0,00%	0,00%	77 000		1 986

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	171,840	-0,51%	
Башнефть	AK6		EUR	202,000	5,21%	6,06
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,290	-1,53%	6,48
ТГК-3	AOMD		USD	8,870	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	36,830	2,14%	25 896,33
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,129	-1,07%	
Бурятзолото	BYT		EUR	20,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,004	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	31,910	2,41%	48 589,25
X5	FIVE		USD	35,000	-2,34%	13 137,29
Газпром	GAZ		EUR	10,230	3,42%	2 551,45
Иркутскэнерго	IRK		EUR	24,500	0,82%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,350	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,850	-4,88%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,931	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	62,150	0,73%	294 378,00
Лукойл	LUK		EUR	43,525	0,13%	294,36
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,550	1,30%	9 837,81
МТС	MBT	5	USD	19,930	0,40%	45 266,60
МТС	MKY	5	EUR	13,845	-0,36%	7,47
МГТС	MOW		EUR	8,450	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,270	-2,03%	
Мечел	MTL	3	USD	25,740	1,42%	55 209,22
НорНикель	NILSY	1	USD	25,410	2,05%	736,59
НорНикель	NNIA		EUR	17,715	0,94%	11,36
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	133,500	4,71%	93 869,98
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	4,000	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,850	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,700	3,64%	
Газпром	OGZD		USD	14,380	1,84%	501 841,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	0,67
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	34,330	-5,66%	1 624,22
Ростелеком	RTL		EUR	24,350	-2,79%	4,92
Газпромнефть	SCF		EUR	15,190	0,23%	61,15
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,505	-0,82%	54,52
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,550	-0,28%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,000	0,40%	480,65
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,550	2,69%	159,27
АФКСистема	SSA	1	USD	25,500	-0,70%	14 123,46
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,000	-2,13%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	0,23
СТЗ	SVY		EUR	38,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	19,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,400	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	400,000	-0,74%	8,87
Уралсвязьинформ	URL		EUR	6,200	1,22%	0,06
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,020	0,50%	19 368,90
ВТБ	VTBR		USD	5,960	1,45%	70 910,00
Возрождение	VZY		EUR	23,250	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,960	0,98%	4 173,10
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	22,925	-0,02%	10,20

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.