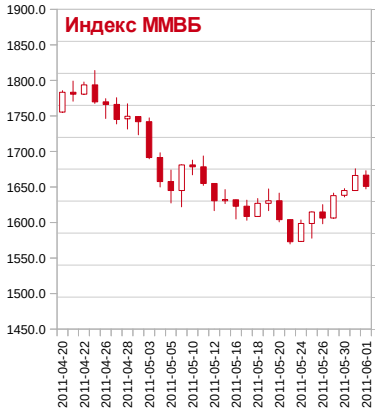
ЗАО "БФ "Ленстройматериалы"
Санкт-Петербург, ул. Миллионная, д.8
Телефон: +7 (812) 325 9696
http://www.brok.ru

УТРЕННИЙ МОНИТОР

Четверг, 2 июня 2011



Говорят на рынке . . .

. . . Международное рейтинговое агентство Moody's накануне понизило рейтинг Греции на несколько ступеней — до Caa1 с B1 с «негативным» прогнозом, говорится в пресс-релизе агентства. Понижение вызвано риском, что Греции не удастся стабилизировать ситуацию с госдолгом без реструктуризации. Рейтинг Caa1 предполагает ожидание того, что текущие переговоры Греции с ЕС, МВФ и Еврокомиссией приведут к предоставлению дальнейшей официальной поддержки греческого правительства и объявлению о дополнительных мерах по сокращению бюджета и структурных реформ.

. . . Во вторник прошло совещание о налогообложении газовой отрасли до 2014 г. Принято решение о повышении налога на 150 млрд., 170 млрд. и 185 млрд. в ближайшие три года соответственно. Попытки Газпрома убедить правительство не повышать НДПИ потерпели неудачу. Окончательные цифры будут примерно через неделю, говорит чиновник Минфина, но если исходить из оценок Кудрина, то ставка НДПИ должна вырасти до 468-497 руб. Ранее Минфин предлагал двукратный рост ставки НДПИ для "Газпрома": с нынешних 237 руб. до 536 руб. за 1000 кубометров в 2012 году и до 558 руб.— в 2013-м.

. . . За лето имущество "ИжАвто" продадут в несколько этапов на специальном аукционе. Часть ижевского автозавода, в отношении которого в марте была введена процедура конкурсного производства, 20 мая была продана "Объединенной автомобильной группе" за 220 млн. руб. Затем саму ОАК намерен приобрести АвтоВАЗ. Меморандум о намерениях между Сбербанком, ГК "Ростехнологии" и АвтоВАЗом был подписан еще в конце 2010 года.

Российский рынок: внешний фон

Первая половина торговой сессии среды проходила на позитивной волне, акции продолжали расти, а негатив игнорировался. Но примерно после 16 часов настрой рынка полностью поменялся. Поводом для продаж выступил прогноз занятости в США, который существенно снизился. Затем были и другие негативные новости, так что российские индексы довольно быстро ушли в отрицательную зону. Индекс ММВБ упал на 0,94% (1650 п.), индекс РТС упал на 0,6% до 1876 п.

На фоне общего падения были и акции, которые сильно выросли. Так, например 4,5% прибавили акции Транснефти: они демонстрировали устойчивость и ранее, а вчера, на котировки могло повлиять, то что на баланс компании поступили деньги китайских компаний за поставленную нефть. После коррекции вчера выросли и акции ФСК ЕЭС (+4%). Еще две бумаги, которые во вторник сильно дорожали, вчера отыграли большую часть падения, это Лукойл (-4,4%) и ОГК-3 (-5%).

Вечер вторника действительно внушал оптимизм, которым и воспользовался с утра российский рынок. Но все когда-нибудь заканчивается. Когда в США открывались торги, уже было известно о существенном снижении прогноза занятости ADP. Вскоре к этому добавилось снижение производственной активности, с 60,4 до 53,5 пункта, и это при прогнозе аналитиков 57,1. Напомним, падение ниже 50 означает снижение деловой активности. Фондовые индексы просели довольно существенно, Dow Jones потерял более 2,2%. Получается, что пробития индексом S&P своего майского падающего тренда хватило лишь на небольшой подъем, который длился буквально сутки. Затем технические факторы иссякли, а негатива накопилось много.

Нефтяные котировки тоже снижались, им не помогал даже дешевеющий доллар. А сегодня ко всему этому добавляется снижение рейтинга Греции агентством Moody`s. Азиатские рынки реагируют на все происходящее падением на 1,5-1,6%.

Прогноз на сегодня

Накопившийся еще два дня назад негатив вылился вчера в существенное падение большинства рынков. А вместе с этим растаяли надежды на преодоление российским рынком границы 1650 пунктов, которая могла стать сигналом для среднесрочного входа. Все-таки мы находимся внутри большого падающего движения, на котором можно совершать лишь краткосрочные спекулятивные атаки. Вчера российский индекс ММВБ закрылся немного выше границы 1650 пунктов, но сегодня он обязательно закрепится ниже. Сегодня самым важным является отчет о занятости а точнее о заявках на пособия и стоимости рабочей силы. Традиционно последнее время рынок труда является поводом для огорчений. Кроме того, из-за праздничного дня в понедельник, отчет о запасах нефти перенесен со среды на сегодня.

Накануне:

Индексы MSCI		
MSCI World	1,335.6	-1.40%
MSCI North America	1,413.4	-2.29%
MSCI Europe	96.05	-1.02%
MSCI Pacific	2,200.4	0.40%
MSCI EM	1,166.7	-0.11%
MSCI BRIC	353.69	-0.47%
MSCI Russia	996.88	-0.56%
Основные индексы США		
Dow Jones	12,290.1	-2.23%
S&P 500	1,314.6	-2.28%
Основные российские фондовые индексы		
Индекс ММВБ	1,650.7	-0.94%
Индекс РТС	1,858.0	-1.00%
Отраслевые российские фондовые индексы		
ММВБ-Машиностроение	2,400.3	-1.73%
ММВБ-Металлургия	5,256.0	-0.54%
ММВБ-Нефть и Газ	3,058.8	-0.94%
ММВБ-Потреб. сектор	5,369.5	-0.21%
ММВБ-Телекоммуникации	2,425.1	0.08%
ММВБ-Финансы	6,118.7	-0.52%
ММВБ-Химия и нефтехимия	6,741.4	-0.46%
ММВБ-Энергетика	2,697.6	0.71%
ММВБ10	3,757.4	-0.86%

Перед открытием:

Фьючерсы на фондовые индексы в США		
DJIA INDEX	12,285.0	0.09%
S&P 500	1,313.6	0.11%
NASDAQ 100	2,321.5	0.09%
Фьючерсы на фондовые индексы в Европе		
DJ EURO STOXX 50	2,797.0	-1.11%
FTSE 100	5,876.0	-1.13%
CAC 40 10 EURO	3,909.0	-1.02%
DAX	7,148.5	-1.09%
Азиатские фондовые рынки		
MSCI ASIA	906.2	-1.72%
NIKKEI 225 (Токио)	9,555.0	-1.69%
HANG SENG (Гонконг)	23,235.6	-1.65%
Shanghai Composite	2,686.4	-2.09%
AOI (Австралия)	4,683.2	-2.20%
Валюты на FOREX		
EUR-USD	1.4372	0.31%
GBP-USD	1.6349	0.09%
USD-JPY	80.9248	-0.03%
AUD-USD	1.0632	0.17%
USD-CAD	0.9790	0.17%
USD-CHF	0.8431	0.13%
Dollar Index (USDX)	74.81	-0.11%
Сырьевые товары		
Нефть Brent	115.6	-0.11%
Нефть WTI	105.4	-0.20%
Природный газ	4.2	0.00%
Золото	1,432.8	-0.15%
Серебро	37.4	0.17%
Медь	440.5	-0.44%
Пшеница	743.0	0.47%
Сахар	27.5	3.27%

ЗАО "БФ "Ленстройматериалы"
Санкт-Петербург, ул. Миллионная, д.8
Телефон: +7 (812) 325 9696
http://www.brok.ru

Акции в составе индекса ММВБ

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (руб)
Транснефть (ап)	TRNFP	39196.00	41032.00	38607.00	40987.00	4.58%	1,354,287,396
ФСК ЕЭС	FEES	0.335	0.348	0.333	0.347	4.06%	861,285,911
Распадская	RASP	171.89	176.90	169.20	176.84	2.81%	132,727,768
Полюс Золото	PLZL	1906.90	1959.40	1890.10	1959.00	2.57%	380,750,538
Холдинг МРСК	MRKH	3.66	3.73	3.63	3.70	1.84%	236,845,470
Сургутнефтегаз (ап)	SNGSP	13.923	14.300	13.923	14.267	1.26%	262,097,990
Сургутнефтегаз	SNGS	26.80	27.94	26.68	26.92	0.98%	1,826,059,934
Ростелеком	RTKM	160.99	163.40	160.03	161.75	0.72%	136,980,023
ГМК Норильский никель	GMKN	7049.00	7125.00	6980.00	7036.00	0.50%	3,642,073,337
Уралкалий	URKA	243.54	245.40	238.11	240.70	0.48%	925,587,115
Газпром нефть	SIBN	124.00	125.93	123.02	124.10	0.08%	67,628,649
Мосэнерго	MSNG	2.560	2.605	2.540	2.562	0.07%	24,943,267
РусГидро	HYDR	1.360	1.379	1.350	1.359	-0.09%	602,260,341
МТС	MTSI	234.32	236.70	234.32	235.20	-0.12%	159,473,376
Газпром	GAZP	205.46	206.60	203.13	203.48	-0.26%	12,839,268,826
ММК	MAGN	25.60	25.75	25.04	25.43	-0.27%	46,824,854
Интер РАО ЕЭС	IUES	0.03	0.03	0.03	0.03	-0.40%	320,163,767
Магнит	MGNT	3928.80	3979.00	3882.60	3900.00	-0.76%	117,140,526
Сбербанк	SBER03	98.00	98.11	96.15	96.73	-0.88%	10,845,329,714
Банк ВТБ	VTBR	0.0868	0.0874	0.0852	0.0860	-0.92%	1,875,366,574
Сбербанк (ап)	SBERP03	66.21	66.32	65.12	65.40	-0.97%	956,129,250
Татнефть	RU14TATN3006	160.46	164.44	158.04	160.13	-1.12%	379,014,540
Роснефть	ROSN	242.20	244.82	239.12	239.31	-1.17%	2,759,990,789
НЛМК	NLMK	103.91	104.05	101.81	102.20	-1.21%	203,758,266
Полиметалл	PMTL	540.00	547.00	536.00	543.20	-1.22%	188,026,143
Новатэк	NOTK	366.01	370.73	358.23	361.40	-1.26%	155,161,710
Северсталь	CHMF	509.80	513.40	498.70	500.00	-1.30%	940,202,172
Аэрофлот	AFLT	78.45	78.45	71.25	71.25	-2.09%	37,008,968
Лукойл	LKOH	1813.20	1827.80	1766.10	1768.50	-4.41%	5,846,516,817
ОГК-3	OGKC	1.493	1.493	1.396	1.406	-5.08%	41,331,733

данные биржи ММВБ

Аналитические исследования

Копытов Александр ..... Kopytov@brok.ru

Сведения, содержащиеся в настоящем обзоре, имеют только информационное значение и не могут рассматриваться как предложение о совершении сделок на финансовом рынке. Представленная аналитическая информация отражает исключительно собственное мнение аналитиков, участвовавших в его составлении, которое может не совпадать с мнением БФ "Ленстройматериалы".

Информация, на которой основан обзор, получена из открытых источников, которые мы считаем надежными. Тем не менее, БФ "Ленстройматериалы" и авторы обзора не несут ответственности за её достоверность и полноту, а также за убытки, возникшие в связи с использованием содержащейся в документе информации. При принятии инвестиционного решения необходимо помнить, что инвестирование в ценные бумаги сопряжено с риском, в связи с чем инвесторам необходимо провести самостоятельный анализ ситуации и объектов инвестирования.