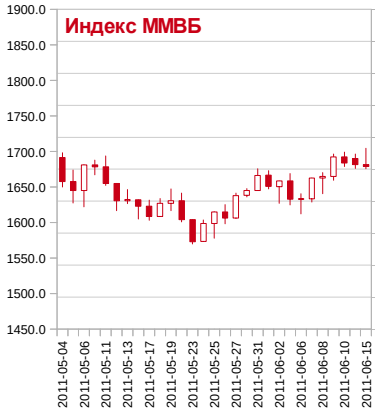
ЗАО "БФ "Ленстройматериалы"
Санкт-Петербург, ул. Миллионная, д.8
Телефон: +7 (812) 325 9696
http://www.brok.ru

УТРЕННИЙ МОНИТОР

Четверг, 16 июня 2011



Говорят на рынке . . .

. . . Судя по опросу, проведенному компанией Bank of America Merrill Lynch Аппетит к риску среди инвесторов за последний месяц снизился. По данным исследования, проведенного с 3 по 9 июля, число управляющих с повышенной долей акций в портфелях с 41%в мае сократилось до 27% в июне. Кроме того, с 12% в мае до 6% в июне снизилась доля инвесторов, открывших "длинные" позиции в сырьевых активах сверх стандартных лимитов. Изменения в структуре портфелей диктуются опасениями инвесторов по поводу кризиса государственного долга в Европе. Именно его участники опроса поставили на первое место среди рисков с плохо предсказуемыми последствиями.

. . . Премьер-министр Греции Йоргос Папандреу в среду во время переговоров с оппозицией заявил о готовности добровольно уйти в отставку, чтобы содействовать формированию правительства национального единства, поддерживающего взятые страной экономические обязательства, передает Reuters. Главным условием своей отставки Папандреу назвал поддержку новым правительством обязательств, взятых на себя Грецией под нажимом ЕС и МВФ.

. . . ОАО "РТС" включит российские депозитарные расписки (РДР) на акции "Русала" в состав индекса РТС и отраслевого индекса РТС металлов и добычи. Кроме того, в состав индекса РТС из листа ожидания войдут обыкновенные акции ОАО "Ростелеком". Между тем из состава индикатора будут исключены обыкновенные акции ОАО "Соллерс", характеризующиеся наименьшим уровнем капитализации среди акций, входящих в расчет РТС.

Российский рынок: внешний фон

Среда была одним из тех редких дней, когда удается противостоять внешним тенденциям и сосредоточиться на внутреннем новостном фоне. Повод был скорее технический: вчера происходило закрытие июньских фьючерсов, базовым инструментом по которым являются российские голубые фишки. К середине июня, после сильного падения в мае, рынок вплотную подходил к уровню поддержки 1700 пунктов по ММВБ и последние два дня держался вблизи его. Вчера в середине дня были попытки этот уровень преодолеть, и это даже удалось на несколько пунктов. Но внешний фон говорил о противоположной тенденции - рынки Европы с самого утра снижались, опасаясь проблем Греции и нашлось много желающих зафиксировать прибыль. Затем на рынок стала поступать статистическая информация из США, и российский фондовый рынок буквально за час ушел в отрицательную зону. Итоговое значение индекса ММВБ 1678 п. (-0,17%). Индекс РТС составил 1919 п. (-0,34%).

Из бумаг можно выделить акции золотодобывающих компаний – Полюс Золото (+3%) и Полиметалл (+1,58%). Они дорожали вместе с ценами на драгоценные металлы. Уже который день стабильно дорожает ФСК ЕЭС, акции которого вчера прибавили 1%. Хуже рынка практически весь нефтегазовый сектор: все-таки рынок нефти вчера был неопределенным.

Днем несколько статистических данных пришло из Европы: в Великобритании выросло число безработных, а в Еврозоне немного выросло промышленное производство, что компенсирует снижение предыдущего месяца. По большому счету – эти данные можно проигнорировать, т.к. они не являются самыми важными и компенсируют друг друга. Важнее была статистика из США. Потребительская инфляция ускоряется, промышленное производство выросло за месяц на 0,1%, что было ниже прогнозов. В целом это вызвало умеренное снижение мировых индексов: фьючерсы на американские индексы последовали за Европой и ушли в минус. Затем агентство Moody`s заявило о пересмотре прогноза кредитных рейтингов банков BNP Paribas, Societe Generale и Credit Agricole, которые ведут бизнес в Греции и держат греческие облигации. К вечеру выходили запасы нефти в США, которые слегка снизились (есть надежда на успешный автомобильный сезон в США). Нефть подорожала, на что российский рынок не успел отреагировать.

На этом в России торговый день завершился, а дальнейшие события развивались гораздо стремительнее. Министры финансов еврозоны не смогли договориться о том, как уговорить частных кредиторов поучаствовать во второй программе спасения Греции. Премьер министр Греции заявил о возможной отставке. Все это вызвало буквально обрушение фондовых рынков по всему миру. Dow Jones потерял 1,5%, индекс S&P снизился на 1,74%. Нефтяные котировки пробили вниз трехмесячный минимум и упали на 4%. Все это нам предстоит отыграть сегодня.

Прогноз на сегодня. На утро ситуация выглядит следующим образом: Азия

Накануне:

Индексы MSCI		
MSCI World	1,284.0	-1.68%
MSCI North America	1,359.9	-1.70%
MSCI Europe	92.43	-1.07%
MSCI Pacific	2,144.8	-0.23%
MSCI EM	1,127.8	-0.58%
MSCI BRIC	341.80	-0.82%
MSCI Russia	1,010.95	-0.79%
Основные индексы США		
Dow Jones	11,897.3	-1.48%
S&P 500	1,265.4	-1.74%
Основные российские фондовые индексы		
Индекс ММВБ	1,678.8	-0.17%
Индекс РТС	1,894.8	-1.26%
Отраслевые российские фондовые индексы		
ММВБ-Машиностроение	2,390.0	-0.07%
ММВБ-Металлургия	5,295.4	0.00%
ММВБ-Нефть и Газ	3,115.9	-0.32%
ММВБ-Потреб. сектор	5,357.9	-0.35%
ММВБ-Телекоммуникации	2,417.6	0.00%
ММВБ-Финансы	6,142.1	-0.04%
ММВБ-Химия и нефтехимия	7,066.3	0.48%
ММВБ-Энергетика	2,854.5	0.13%
ММВБ10	3,843.7	-0.61%

Перед открытием:

Фьючерсы на фондовые индексы в США		
DJIA INDEX	11,814.0	-0.14%
S&P 500	1,259.4	-0.04%
NASDAQ 100	2,202.3	-0.12%
Фьючерсы на фондовые индексы в Европе		
DJ EURO STOXX 50	2,733.0	-1.65%
FTSE 100	5,695.0	-0.95%
CAC 40 10 EURO	3,807.0	-1.48%
DAX	7,120.0	-1.14%
Азиатские фондовые рынки		
MSCI ASIA	856.7	-2.27%
NIKKEI 225 (Токио)	9,418.4	-1.63%
HANG SENG (Гонконг)	21,929.6	-1.85%
Shanghai Composite	2,674.6	-1.14%
AOI (Австралия)	4,548.7	-1.87%
Валюты на FOREX		
EUR-USD	1.4126	-0.38%
GBP-USD	1.6165	-0.18%
USD-JPY	80.7935	-0.20%
AUD-USD	1.0532	-0.43%
USD-CAD	0.9803	0.12%
USD-CHF	0.8531	0.02%
Dollar Index (USDX)	76.20	0.24%
Сырьевые товары		
Нефть Brent	114.0	0.88%
Нефть WTI	95.0	0.20%
Природный газ	4.6	0.20%
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

реагирует и на негативную статистику и на риски Греции: основные индексы теряют примерно 1%. Нефтяные котировки потеряли за ночь больше 4-х долларов и продолжают падение. Фьючерсы на американские индексы слегка восстанавливались, но за последние два часа вновь уходят в минус. Российский рынок с утра будет вынужден реагировать на весь негатив одновременно. Это однозначно выбивает нас из коридора 1680-1700 пунктов по индексу ММВБ. Если мировые рынки остановят падение, можно надеяться на уровень поддержки 1660 пунктов. Только не надо забывать, что риски дефолта Греции как никогда высоки, стоимость страховки ее долга вчера выросла на 10%.

Сегодняшняя статистика из США вновь с самых неудачных секторов: выйдут данные о начале нового строительства домов и заявках на пособия по безработице. В России состоится Петербургский международный экономический форум. Также Верофарм обнародует отчетность за 1 квартал и состоится собрание акционеров ТГК-2.

Акции в составе индекса ММВБ

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (руб)
Полиметалл	PMTL	562.50	603.00	558.30	578.90	3.01%	195,334,049
Полюс Золото	PLZL	1936.00	1974.00	1934.00	1964.50	1.58%	237,801,227
Уралкалий	URKA	252.82	258.18	251.70	256.69	1.57%	1,199,855,632
Татнефть	RU14TATN3006	169.05	172.98	167.34	170.84	1.37%	653,067,136
Интер РАО ЕЭС	IUES	0.04	0.04	0.04	0.04	1.32%	524,461,000
Холдинг МРСК	MRKH	3.95	4.07	3.88	3.99	1.24%	200,734,982
Магнит	MGNT	3880.10	4050.00	3880.00	3932.70	1.03%	234,233,866
ФСК ЕЭС	FEES	0.388	0.406	0.385	0.392	1.02%	1,182,315,915
Распадская	RASP	162.07	167.90	162.07	166.00	0.72%	56,206,952
Сургутнефтегаз	SNGS	27.30	27.64	27.30	27.44	0.64%	1,411,341,121
Сургутнефтегаз (ап)	SNGSP	14.700	14.955	14.559	14.698	0.26%	342,043,645
Лукойл	LKOH	1781.40	1797.30	1761.00	1774.00	0.12%	4,660,034,980
Банк ВТБ	VTBR	0.0882	0.0894	0.0874	0.0882	0.00%	2,208,328,549
Сбербанк	SBER03	97.60	98.78	97.06	97.70	0.00%	12,976,169,309
ММК	MAGN	26.65	26.72	26.42	26.60	-0.02%	46,246,043
ГМК Норильский никель	GMKN	7061.00	7169.00	7010.00	7030.00	-0.21%	5,261,281,337
Ростелеком	RTKM	166.51	171.00	164.00	166.16	-0.21%	151,905,906
Новатэк	NOTK	359.74	371.00	357.14	358.58	-0.32%	476,494,773
ОГК-3	OGKC	1.373	1.385	1.362	1.366	-0.50%	20,514,994
НЛМК	NLMK	103.33	105.20	102.33	102.60	-0.71%	301,212,695
Мосэнерго	MSNG	2.652	2.699	2.615	2.622	-0.74%	64,324,324
Роснефть	ROSN	248.00	251.85	244.76	246.07	-0.90%	3,648,354,786
Аэрофлот	AFLT	71.30	72.00	70.60	70.60	-0.98%	54,986,440
Газпром	GAZP	208.27	210.49	205.60	206.00	-1.08%	13,991,613,912
МТС	MTSI	242.16	244.90	237.99	239.00	-1.24%	445,571,854
РусГидро	HYDR	1.400	1.410	1.375	1.382	-1.31%	1,164,789,407
Сбербанк (ап)	SBERP03	72.99	73.15	71.75	71.87	-1.51%	1,386,920,041
Северсталь	CHMF	517.50	521.60	507.20	508.60	-1.66%	1,302,887,365
Транснефть (ап)	TRNFP	43952.00	44500.00	43014.00	43149.00	-2.09%	634,432,684
Газпром нефть	SIBN	127.94	128.31	124.75	124.77	-2.48%	201,192,708

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.