ЛЕНСТРОЙМАТЕРИАЛЫ
БРОКЕРСКАЯ ФИРМА

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

УТРЕННИЙ МОНИТОР

Понедельник, 27 июня 2011



Говорят на рынке . . .

. . . С сегодняшнего дня крупнейший банк России Сбербанк запускает программу депозитарных расписок, которые будут торговаться на Лондонской и Франкфуртской биржах. Сбербанк подготовил программу американских депозитарных расписок первого уровня объемом до 25 процентов капитала.

. . . Лидеры Евросоюза официально назначили новым главой Европейского центрального банка итальянца Марио Драги, который в ноябре сменит проработавшего восемь лет француза Жан-Клода Трише. Ранее Драги подвергался критике, учитывая его опыт работы в Goldman Sachs. Так же как и Трише, Драги считает большим риском для финансовой системы Европы неспособность справиться с долговым кризисом Греции.

. . . За минувшую неделю, по данным EPFR Global, отток из ориентированных на Россию инвестиционных фондов составил $297 млн. против притока $72 млн. по итогам предыдущей недели. Суммарные активы под их управлением сократились на 1,5%, и этот отток стал одним из наиболее значительных за последние пять лет. В прошлые недели объем выводимых средств из активно управляемых фондов, ориентированных на Россию, был небольшим, в основном деньги забирали из пассивных биржевых фондов (ETF). В эту неделю сильно вырос отток из фондов обеих категорий. Международное энергетическое агентство в конце прошлой недели заявило, что распечатает свои запасы нефти, что окажет давление на котировки нефти. Таким образом, на следующей неделе отток средств может продолжиться.

. . . Сегодня вступают в силу новые правила для участников ММВБ, в соответствии с которыми биржа имеет право временно отключить брокера. ММВБ будет блокировать идентификационные номера брокеров до конца торгового дня при превышении лимита трансакций, на уровне 150 трансакций в секунду в течение пяти минут. При достижении «сигнального» уровня брокер будет извещен о возникшей опасности отключения, чтобы самостоятельно снизить активность своих клиентов.

Российский рынок: внешний фон

В пятницу российский рынок компенсировал падение четверга и смог оставаться на достигнутых уровнях в течение всего дня. Инвесторы предпочли не замечать надвигающегося падающего тренда. Индекс ММВБ вырос по итогам дня на 1,62% до 1634 пунктов. Индекс РТС вырос на 1,48% до 1857 п.

Лучшими бумагами были в пятницу Татнефть (+3,96%) , НЛМК (3,96%) и Газпром Нефть (+3,3%). Собрание акционеров подогревало интерес к акциям Сургутнефтегаза (+2%) .Хуже рынка торговались акции ММК, Полюс Золото и Холдинга МРСК.

В США тем временем напоминали о себе и прежние проблемы Греции, и снижение рейтингов итальянских банков- держателей греческих облигаций. Американский индекс Dow Jones опустился ниже отметки 12 тысяч пунктов (-0,96%), однако минимум месяца до сих пор не преодолел. Следует наблюдать за этой ситуацией, но все-таки больше аргументов за преодоление уровней вниз.

Возможно, в пятницу мировым рынкам не хватило поводов для падения, т.к. новостной фон был довольно скудным. Сегодня фьючерсы на американские индексы вновь умеренно снижаются, примерно оставаясь на уровнях пятницы. Та же ситуация и на товарных рынках: падение остановилось и участники ждут развития событий.

Сегодня таковыми будут данные о личных доходах и расходах в США, а в России состоятся собрания акционеров МТС, Ростелекома, Северстали, Банка Москвы и Росбанка.

Прогноз на сегодня. Пока к торгам не присоединилась даже Европа, а весь новостной фон прошлой недели уже учтен в котировках. Остается обратить внимание на азиатскую сессию. Японский Nikkei теряет около 0,6%, как впрочем, и рынки Сингапура и Шанхая. Российскому рынку сперва нужно отреагировать на пятничное закрытие в США, а затем обратить внимание на Азию. Оба вектора направлены вниз, поэтому российский рынок откроется падением в пределах 1%. Поддержкой выступит уровень 1600 по ММВБ.

Накануне:

Индексы MSCI		
MSCI World	1,275.5	-0.48%
MSCI North America	1,360.5	-1.14%
MSCI Europe	91.12	-0.12%
MSCI Pacific	2,144.6	1.02%
MSCI EM	1,115.7	0.94%
MSCI BRIC	339.35	1.43%
MSCI Russia	974.89	1.79%
Основные индексы США		
Dow Jones	11,934.6	-0.96%
S&P 500	1,268.5	-1.17%
Основные российские фондовые индексы		
Индекс ММВБ	1,634.0	1.62%
Индекс РТС	1,847.9	-0.49%
Отраслевые российские фондовые индексы		
ММВБ-Машиностроение	2,439.6	1.06%
ММВБ-Металлургия	5,136.8	0.00%
ММВБ-Нефть и Газ	3,026.8	1.84%
ММВБ-Потреб. сектор	5,308.3	0.84%
ММВБ-Телекоммуникации	2,425.9	0.00%
ММВБ-Финансы	5,776.5	1.28%
ММВБ-Химия и нефтехимия	6,890.0	0.88%
ММВБ-Энергетика	2,720.7	0.24%
ММВБ10	3,765.2	1.72%

Перед открытием:

Фьючерсы на фондовые индексы в США		
DJIA INDEX	11,859.0	-0.19%
S&P 500	1,261.6	-0.11%
NASDAQ 100	2,203.8	-0.18%
Фьючерсы на фондовые индексы в Европе		
DJ EURO STOXX 50	2,720.0	-0.40%
FTSE 100	5,640.0	-0.35%
CAC 40 10 EURO	3,784.5	-0.01%
DAX	7,152.0	-0.27%
Азиатские фондовые рынки		
MSCI ASIA	859.6	-0.96%
NIKKEI 225 (Токио)	9,586.0	-0.96%
HANG SENG (Гонконг)	22,017.7	-0.70%
Shanghai Composite	2,753.1	0.25%
AOI (Австралия)	4,515.0	-1.10%
Валюты на FOREX		
EUR-USD	1.4136	-0.36%
GBP-USD	1.5937	-0.14%
USD-JPY	80.7250	0.37%
AUD-USD	1.0431	-0.57%
USD-CAD	0.9899	0.13%
USD-CHF	0.8367	0.44%
Dollar Index (USDX)	76.45	0.48%
Сырьевые товары		
Нефть Brent	103.6	-1.41%
Нефть WTI	90.5	-0.78%
Природный газ	4.2	-0.83%
Золото	1,501.6	0.05%
Серебро	33.9	-2.22%
Медь	406.9	-1.14%
Пшеница	651.0	-1.51%
Сахар	26.0	-0.31%

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

События, которые будут иметь значение на этой неделе:

- ФРС США не нашел что сказать, изменения вероятно появятся не раньше осени;
- Конгрессом США по-прежнему не расширен потолок заимствований – США грозит технический дефолт;
- фондовые индексы США остановили падение и находятся вблизи минимумов месяца – внимание на эти уровни;
- нефтяные котировки пробили растущий тренд, а МЭА еще сильнее уронил котировки;
- единственный позитив – Греция может принять план экономии, что поможет получать помощь без задержек.

Акции в составе индекса ММВБ

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (руб)
Татнефть	RU14TATN3006	165.35	173.01	164.90	171.79	3.96%	520,571,977
НЛМК	NLMK	101.21	105.64	100.81	105.00	3.96%	351,365,604
Газпром нефть	SIBN	122.10	126.80	122.10	125.53	3.30%	140,738,532
Сбербанк	SBER03	95.38	97.20	95.07	97.15	3.14%	17,365,036,873
Сбербанк (ап)	SBERP03	71.90	73.66	71.72	73.23	2.88%	1,794,604,693
Сургутнефтегаз	SNGS	27.02	27.69	26.95	27.44	2.00%	746,001,323
Новатэк	NOTK	333.05	339.90	332.77	337.27	1.85%	210,513,366
Сургутнефтегаз (ап)	SNGSP	13.700	13.800	13.505	13.693	1.81%	230,195,948
Уралкалий	URKA	235.75	238.96	234.60	237.75	1.75%	619,617,913
Газпром	GAZP	200.00	201.37	198.44	199.22	1.67%	15,151,472,158
ГМК Норильский никель	GMKN	7075.00	7140.00	7036.00	7135.00	1.55%	3,639,724,713
Лукойл	LKOH	1732.00	1767.60	1727.30	1745.90	1.51%	2,704,478,035
Аэрофлот	AFLT	68.05	69.48	68.05	68.88	1.28%	24,176,358
Полиметалл	PMTL	537.00	558.70	537.00	543.90	1.28%	52,610,249
Северсталь	CHMF	495.50	502.30	494.10	496.30	1.27%	778,648,171
РусГидро	HYDR	1.321	1.344	1.313	1.331	1.19%	711,747,717
Роснефть	ROSN	231.00	233.70	229.60	231.81	1.04%	2,277,745,432
Банк ВТБ	VTBR	0.0825	0.0834	0.0819	0.0822	0.80%	2,361,529,946
МТС	MTSI	230.23	231.75	228.70	230.80	0.74%	123,479,934
Ростелеком	RTKM	184.40	184.40	180.55	182.00	0.62%	180,226,458
Мосэнерго	MSNG	2.540	2.545	2.515	2.521	0.37%	45,564,249
ОГК-3	OGKC	1.347	1.351	1.340	1.340	0.00%	5,725,484
Транснефть (ап)	TRNFP	41201.00	41774.00	40851.00	40899.00	-0.01%	380,887,209
Магнит	MGNT	3809.00	3818.00	3751.70	3780.00	-0.05%	125,951,019
Распадская	RASP	164.83	165.99	161.69	162.48	-0.20%	65,031,650
Интер РАО ЕЭС	IUES	0.04	0.04	0.04	0.04	-0.27%	109,393,250
ФСК ЕЭС	FEES	0.374	0.379	0.371	0.371	-0.30%	215,490,668
ММК	MAGN	25.65	25.70	24.95	25.10	-0.59%	134,652,383
Полюс Золото	PLZL	1816.00	1832.80	1801.30	1802.80	-0.78%	130,848,606
Холдинг МРСК	MRKH	3.65	3.70	3.59	3.60	-0.96%	164,562,414

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.