18 октября 2011 г.

Ежедневный аналитический обзор «Ваш консультант»

Внешний фон

Американский фондовый рынок на прошедших торгах снижался в пределах двух процентов, хуже рынка торговались бумаги промышленного и сырьевого секторов. Азия во вторник открывается в минусе, фьючерсы на американские индексы в красной зоне. Нефть марки Brent снижается до 109 долл./барр., золото дешевеет. Таким образом, складывается **негативный внешний фон**, открытие ожидаем с гэпом вниз на 1-1,5%.

Торговые идеи на сегодня:

Открываем короткие позиции по Сбербанку и длинные по Газпрому

- **Сбербанк***: закрываем короткие позиции при достижении 78руб.*
- **Газпром:** *продали акции в районе 168руб., совершаем новые покупки в районе 158руб.*
- **Лукойл:** *закрыли длинные позиции у 1690руб., новые покупки совершаем около 1650руб.*

Новости на сегодня

- ВВП Китая за 3 квартал вырос на 9,4%, показатель хуже прогноза
- Moody's может пересмотреть кредитный рейтинг Франции, который сейчас на уровне Aaa
- Темп роста промпроизводства в сентябре в России сократился с 6,2% до 3,9% в годовом выражении, добыча нефти сократилась на 2,9%
- Чистая прибыль «Алроса» по МСФО за 1 полугодие 2011 г. выросла в 5,2 раза и составила26,27 млрд. руб.

Обзор торгов накануне

В понедельник российские фондовые площадки открылись существенным ростом котировок в условиях позитивного внешнего фона. Индекс ММВБ протестировал 1448 пунктов, где ему закрепиться не удалось — слишком сильный уровень сопротивления на уровне 1450 пунктов. Снижающиеся нефть и курс евро внесли свою долю негатива, бумаги нефтяного сектора снижаются быстрее рынка: Лукойл и Роснефть теряют по 2%, Сургутнефтегаз — минус 3,7%. Снижающиеся цены на промышленные металлы и негатив в зоне евро толкают вниз бумаги металлургического сектора, ММК теряет 3,6%, акции Мечел в минусе на 6,5%.
Позитивный настрой инвесторам испортили заявления канцлера Германии А. Меркель о том, что на саммите ЕС 23 октября еще не будет окончательного решения по греческому вопросу. Хорошие финансовые результаты в банковском секторе (чистая прибыль Citigroup выросла на 68%, чистая прибыль Wells Fargo – на 21%) не оказали поддержки падающему рынку.
Индексу S&P500 не удалось закрепиться выше ключевого уровня в 1220 пунктов, пробитие которого будет переломом бокового тренда и сигналом для дальнейшего роста.

Прогноз по ходу торгов на сегодня

Негативный внешний фон дополнили макростатистические данные из Китая, вышедшие сегодня утром. В связи с этим ожидаем снижения на открытии, ближайший уровень сопротивления в районе 1365 -1370 пунктов по ММВБ. Американский рынок продолжает коррекцию, что не добавляет оптимизма нашим игрокам. Сегодня с открытия ожидаем продолжения распродаж, но не очень сильных. После этого можно ожидать попыток восстановления рынка и боковой динамики до начала отчетности американских компаний. Это станет важнейшим событием дня, закрытие

Наиболее важные индексы

РТС	1427,31	-1,52%
ММВБ	1403,05	-2,02%
DowJones	11397	-2,13%
S&P500	1200,86	-1,94%
Nikkei225	8742,57	-1,54%
НефтьBrent	109,86	-0,27%

Лидеры роста и падения прошлых торгов , %

Возрождение	-8,03%
Мечел	-6,51%
НЛМК	-4,15%
Ростелеком	-3,22%
МРСКСиб	+2,04%
Полиметалл	+1,46%
ЮТэйр	+2,50%

Индекс ММВБ на прошедших торгах



Фьючерс на индекс РТС на прошедших торгах



Ожидаемые сегодня события:

- «М.Видео» опубликует предварительные операционные результаты за 3 квартал 2011 г.
- 12:30 мск - индекс потребительских цен в Великобритании за сентябрь. Предыдущее значение - рост на 0,6%, прогноз +0,4%.
- 12:30 мск - индекс розничных цен в Великобритании за сентябрь. Предыдущее изменение показателя - +0,6%, прогноз +0,5%.
- 13:00 мск - индекса потребительских настроений в Германии за октябрь. Предыдущее значение показателя - минус 43,3 пункта, прогноз — минус 45.
- 16:30 мск в США - индекс производственных цен за сентябрь. Предыдущее значение показателя не изменилось, прогноз - 0,2%.
- 17:00 мск - данные о притоке иностранного капитала в США за август. Предыдущее значение показателя - приток 9,5 млрд долл.
- **До открытия торгов в США свои отчеты опубликуют Bank of America Corp., Goldman Sachs Group Inc., Coca Cola Co., Johnson & Johnson**