25 октября 2011 г.

Ежедневный аналитический обзор «Ваш консультант»

Внешний фон

Американские фондовые рынки вчера закрылись ростом, индекс S&P500 прибавил 1,3% и закрепился выше отметки 1250 пунктов, в лидерах роста бумаги финансового и сырьевого секторов. Азиатские рынки открылись разнонаправленно, здесь инвесторы фиксируют прибыль после ралли, нефть подорожала до 111 долл. по сравнению со вчерашним закрытием, сейчас снижается, как и основные промышленные металлы. Фьючерсы на американские индексы торгуются в красной зоне. Таким образом, на сегодня складывается нейтральный внешний фон, открытие ожидаем на прежних уровнях.

Торговые идеи на сегодня:

Роснефть: открываем короткие позиции от 209руб. с целью снижения до 205руб.
Сбербанк: держим короткие позиции от 84руб. с целью снижения до 82руб., стоп-лосс ставим на пробой 85руб.
Газпром: закрыли длинные позиции у 168руб., новые пока не открываем
Лукойл: открываем короткие позиции от 1790руб. с целью снижения до 1750руб.
Автоваз: держим купленные от 5,2руб. акции с целью 6руб.

Обзор торгов накануне

В понедельник на российских торговых площадках после небольшой коррекции в начале торговой сессии продолжился рост. Заявления европейских лидеров убедили инвесторов в том, что они серьезно подходят к решению европейских проблем и ведут активную работу в этом направлении, отсюда и оптимизм на рынках. Индекс ММВБ достиг отметки 1482 пункта, РТС показал более существенный рост на 3,6% до 1508 пунктов, причина тому — укрепление рубля по отношению к доллару. Росту российского рынка способствовал позитивный настрой на европейских площадках, а также хорошая отчетность Caterpillar, подтолкнувшая вверх американские рынки.
Оптимистичный настрой относительно перспектив мировой экономики и дорожающие промышленные металлы вывели металлургический сегмент в лидеры рынка. Акции НЛМК прибавляют 10,3%, Северсталь (+7,73%), ММК (+5,36%). Бумаги Норникеля в аутсайдерах (+0,91%), инвесторы ожидают, что после окончания приема заявок на выкуп акции потеряют в цене.
Агентство Moody's изменило прогноз по банковской системе России со «стабильного» на «негативный», но это не испугало покупателей, акции Сбербанка в плюсе на 2,92%, акции ВТБ, до этого отставшие в росте от рынка, продолжают расти и прибавляют 5,2%, Возрождение (+4,2%).
Нефть на вчерашних торгах подорожала несущественно, бумаги нефтегазового сектора показали умеренный рост. Газпром в плюсе на 2,4%, Роснефть (+4%), Лукойл (+1,83%).
Существенный рост котировок демонстрирует потребительский сектор, хорошая отчетность Седьмого континента выводит бумаги компании в плюс на 11,7%, Группа Разгуляй (+7,4%), МВидео (+2,1%). Неплохо торговались бумаги химической отрасли, Уралкалий (+3,26%), Акрон (+2,2%).
В секторе энергетики РАО ЕЭС Востока (+6,46%), РусГидро (+2,48%), ФСК ЕЭС (2,28%). В секторе телекоммуникаций Ростелеком (-0,06%), МТС (+1,82%).

Прогноз по ходу торгов на сегодня

С открытия сегодняшних торгов ожидаем рост, ближайшим сильным уровнем сопротивления станет 1500 пунктов по ММВБ. Позитивный настрой на рынках в ожидании итогов саммита сохраняется, однако уверенного роста ждать не стоит, инвесторы будут фиксировать прибыль. Стоит ожидать роста бумаг металлургического и банковского сектора, акции Роснефти могут показать негативную динамику, поскольку ожидается выход отчетности хуже ожиданий. Важными событиями сегодня станут данные о доверии потребителей, отчетность Deutsche Bank, индекс цен на жилье в США. В целом индекс ММВБ вышел к уровню 1500п, возле которого отскок пока может завершиться. Для дальнейшего роста необходима определенность с Грецией, которая должна решиться в среду. До этого времени вероятен боковик на текущих уровнях.

Наиболее важные индексы

РТС	1508,82	3,58%
ММВБ	1482,81	2,47%
DowJones	11913,62	0,89%
S&P500	1254,19	1,29%
Nikkei225	8815,79	-0,32%
НефтьBrent	111,12	-0,53%

Лидеры роста и падения прошлых торгов , %

Седьмой континент	11,7%
НЛМК	10,3%
Северсталь	7,73%
ТМК	6,75%
РАО ЕЭС Востока	6,46%
ЮТэйр	-1,82%

Индекс ММВБ на прошедших торгах



Фьючерс на индекс РТС на прошедших торгах



Ожидаемые сегодня события:

- «Роснефть» планирует опубликовать отчет по US GAAP за 3 квартал 2011г.
- Состоится заседание совета директоров Холдинга МРСК.
- 10:00 мск - Германия - Индекс потребительского доверия GfK - ноябрь Прогноз: 5,1 Предыдущее значение: 5,2
- 12:30 мск в Великобритании - платежный баланс за 2 квартал. Предыдущее значение - дефицит 9,35 млрд фунтов , прогноз — дефицит 9 млрд. фунтов .
- 12:30 мск в Великобритании — одобренные заявки на ипотечные кредиты за сентябрь. Предыдущее значение 35,2 тыс., прогноз — 36,3 тыс.
- 12:45 мск состоится выступление главы банка Англии Мервина Кинга.
- 17:00 мск в США - индекс цен на жилье S&P/Case-Shiller за август. Предыдущее значение — снижение на 4,11%, прогноз — минус 3,6%.
- **18:00 мск в США - индекс доверия потребителей за октябрь. Предыдущее значение показателя - 45,4 пункта, прогноз — 46,5 пунктов.**
- 18:00 мск в США - индекс цен на жилье за август. Предыдущее изменение показателя - рост на 0,8%, прогноз - рост на 0,3%.
- До открытия торгов в Америке отчитаются **Deutsche Bank, AK Steel Holding Corp, Xerox Corp**