2 ноября 2011 г.

Ежедневный аналитический обзор «Ваш консультант»

Внешний фон

Рынки США и Европы в среду продемонстрировали существенное снижение, S&P500 теряет 2,8%, хуже рынка финансовый и сырьевой секторы. Азиатские биржи сегодня продолжают снижаться, нефть немного восстанавливается после вчерашнего падения до 107 долл./барр., промышленные металлы также подрастают. Фьючерсы на американские индексы торгуются в красной зоне. Таким образом, внешний фон перед открытием торгов **умеренно негативный**, откроемся на уровнях вчерашнего закрытия.

Новости на сегодня:

- Минфин РФ размещает ОФЗ-ПД серии 26206 на 10 млрд руб.
- Сегодня Минфин размещает на депозитах банков 55 млрд. долл.

Торговые идеи на сегодня:

Ожидаем технического отскока вверх после вчерашнего падения.

– Ростелеком: до объявления условий buy back стоит подержать бумаги, поскольку они чувствуют себя значительно лучше рынка.
– Сбербанк: покупаем акции с открытия с целью роста до 79руб., стоп ставим на пробой вчерашних минимумов.
– Газпром: покупаем акции на коррекции в район 174руб. с целью роста до 179руб., стоп ставим на пробой 172,5руб.
– РусГидро: покупаем акции с целью роста до 1,15руб., стоп ставим на пробой 1,10руб.

Обзор торгов накануне

Падение российского рынка во вторник происходило в русле мировых тенденций и было спровоцировано заявлением премьер-министра Греции о проведении референдума по принятию помощи от европейских стран, не добавило позитива и банкротство крупнейшего брокера MF Global. Индекс ММВБ в моменте снижался более чем на 3%, РТС в условиях дешевеющего рубля теряет 5%.

Динамику хуже рынка демонстрировали вчера бумаги металлургических компаний, падение цен на промышленные металлы, негативные статданные по экономике Китая указывают на сохраняющуюся угрозу спада в мировой экономике. Распадская (-8,08%), НЛМК (-6,09%), ММК (-5,32%), акции Северстали чуть лучше, (-2,82%). Сопоставимое падение наблюдалось и в банковском секторе, Сбербанк (-5,72%), Возрождение (-6,98%), ВТБ теряет 3,72%.

В потребительском сегменте акции Седьмого Континента стали лидерами роста на вчерашних торгах, +9,89%. Бумаги растут третью торговую сессию подряд, очевидно, происходит их скупка крупным игроком или акционером. Акции Разгуляй (-7,69%), Магнита (-2,99%), Дикси Групп (-1,29%). В секторе телекоммуникаций Ростелеком (+1,19%), акции поддержало решение совета директоров одобрить обратный выкуп. МТС (-1,54%), АФК Система (-2,55%).

В нефтегазовом секторе снижение было умеренным, Газпром (-2,46%), Роснефть (-3,14%), Лукойл (-1,03%).

Прогноз по ходу торгов на сегодня

Негативный внешний фон и неопределенность в греческом вопросе, с одной стороны, и возможный позитив от решения монетарных властей США, с другой, - будут способствовать волатильности на рынке. Впереди выходные, на которых могут приняты важные решения и сделаны заявления, способные существенно повлиять на динамику рынков в дальнейшем, выйдут данные по рынку труда. Таким образом, открытия стратегических лонгов ждать не приходится, но технические отскоки от значимых уровней 1445, 1435, 1410 по ММВБ вполне возможны. Ближайшее сопротивление — 1465 по ММВБ. Наибольшая коррекция наверх ожидается по бумагам вчерашних аутсайдеров — банков и металлургический компаний.

Наиболее важные индексы

РТС	1484,98	-5,01%
ММВБ	1456,29	-2,82%
Dow Jones	11657,96	-2,48%
S&P500	1218,28	-2,79%
FTSE 100	5421,57	-2,21%
Nikkei225	8662,62	-1,96%
Нефть Brent	109,24	-0,27%

Лидеры роста и падения прошлых торгов , %

Седьмой континент	9,88%
ТГК-13	2,61%
Ростелеком	1,19%
Распадская	-8,08%
Разгуляй	-7,69%
Возрождение	-6,97%
Сбербанк	-5,72%

Индекс ММВБ на прошедших торгах



Фьючерс на индекс РТС на прошедших торгах



Ожидаемые сегодня события:

- Состоится заседание совета директоров «Газпром нефти», «РусГидро».
- ОГК-5 отчитается по МСФО и представит операционные результаты за 3 квартал.
- **12:55 мск в Германии - данные об уровне безработицы за октябрь. Предыдущее значение — 6,9%, прогноз — 6,9%.**
- **12:55 мск в Германии — индекс производственной активности за октябрь. Предыдущее значение — 48,9, прогноз — 48,9.**
- 13:30 мск в Великобритании - индекс деловой активности в строительстве за октябрь. Предыдущее значение - 50,1 пункта, прогноз — 50,2.
- **16:15 мск в США - данные об изменении числа занятых за октябрь. Предыдущее значение — 91 тыс., прогноз 103 тыс.**
- 18:30 мск - данные по запасам нефти за неделю.
- **20:30 мск решение ФРС США о ключевой процентной ставке. Ожидается, что ставка останется в текущем целевом диапазоне 0-0,25%.**
- **22:15 мск - пресс-конференция главы ФРС Бена Бернанке.**