ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

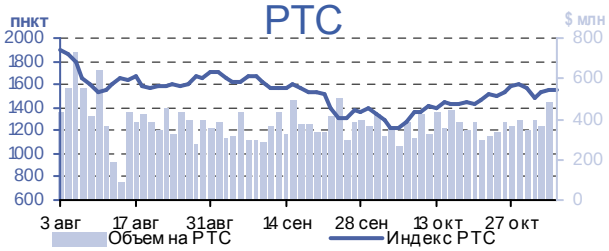
7 ноября 2011г.

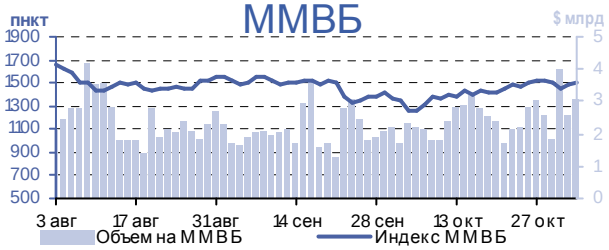
Комментарий по рынку акций

В пятницу торги на фондовых биржах США завершились небольшим снижением индексов. Нестабильность, связанная с европейским долговым кризисом продолжает давить на американский рынок акций. Вышедшая в пятницу статистика показала, что количество вновь созданных рабочих мест в октябре составило 80 тыс. (чуть ниже ожиданий), а ставка безработицы 9,0% . При этом уровень занятости в частном секторе показал снижение до 104 тыс. против 191 тыс. в сентябре. В целом, заокеанских биржах ситуация достаточно стабильная и инвесторы пока готовы выкупать снижения, используя в качестве поддержки уровень 1215 п. по S&P-500

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





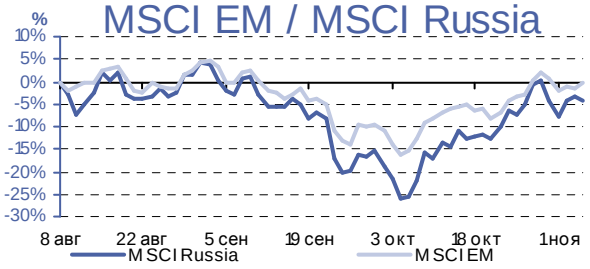
Голубые фишки (ММВБ)

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 542,39	1,06%	-3,17%	21,28%	-3,75%
Индекс ММВБ	1 501,18	0,83%	-1,60%	13,87%	-2,53%
FTSE	5 545,64	1,12%	-2,94%	4,81%	-3,54%
S&P 500	1 261,15	1,88%	-1,82%	8,26%	5,27%
Dow Jones Avg.	12 044,47	1,76%	-1,34%	8,28%	7,39%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Газпром	5,9000	5,36%	27,71%	-7,42%
Сбербанк	2,6250	5,00%	24,41%	-22,95%
Верофарм	32,6250	1,95%	20,83%	-36,03%
Северсталь	14,4380	1,50%	31,25%	-15,54%
ОАО Компания М.видео	7,0500	0,57%	10,85%	-19,34%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	100,3000	-8,82%	10,83%	-23,78%
НорНикель	177,0000	-7,33%	-9,02%	-24,20%
Аэрофлот	1,7130	-6,90%	11,96%	-34,12%
Башнефть, п.	41,0000	-4,65%	26,15%	17,14%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	973,99	-0,32%	12,72%	-13,99%
Индекс MSCI BRAZIL	3041,54	1,78%	13,56%	-19,39%
Индекс MSCI RUSSIA	826,32	1,09%	23,66%	-2,71%
Индекс MSCI INDIA	430,26	0,16%	11,57%	-24,46%
Индекс MSCI CHINA	55,14	-1,62%	16,47%	-22,73%

Обзор рынка

В пятницу торги на фондовых биржах США завершились небольшим снижением индексов. Нестабильность, связанная с европейским долговым кризисом продолжает давить на американский рынок акций. Вышедшая в пятницу статистика показала, что количество вновь созданных рабочих мест в октябре составило 80 тыс. (чуть ниже ожиданий), а ставка безработицы 9,0% . При этом уровень занятости в частном секторе показал снижение до 104 тыс. против 191 тыс. в сентябре. В целом, заокеанских биржах ситуация достаточно стабильная и инвесторы пока готовы выкупать снижения, используя в качестве поддержки уровень 1215 п. по S&P-500.

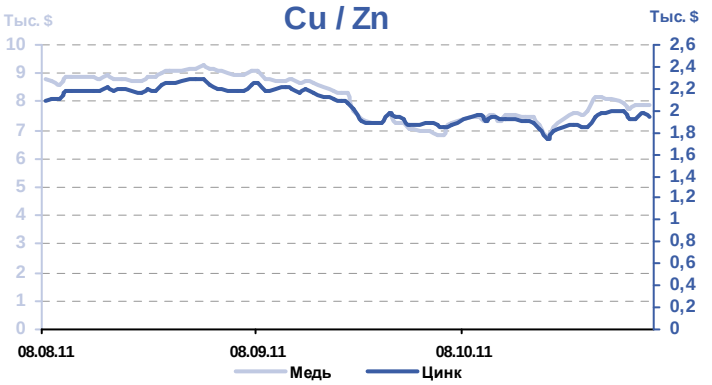
В пятницу спрэд по 10-летним облигациям Германии и Италии расширился до нового рекордного максимума по еврозоне +478 б.п. Причину стоит искать в том, что ЕЦБ рассматривает возможность прекращения выкупа итальянских облигаций, если его аналитики придут к выводу, что страна не в силах выполнить взятые обязательства и провести структурные реформы. На саммите G-20, прошедшем в эти выходные было решено, что Греция не станет проводить референдум по вопросу принятия антикризисных мер. В выходные премьер министр Греции Г. Папандреу ушел в отставку, поэтому дальнейшая экономическая политика в стране пока остается под вопросом.

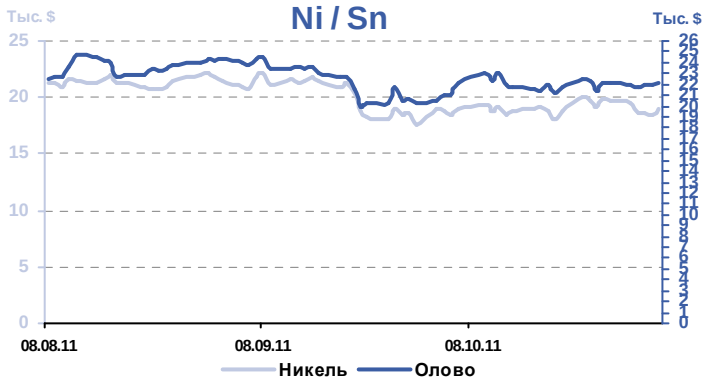
Тем не менее, все эти новости не оказывают серьезного влияния на положение основных торговых валют и цен на сырьевые товары. Несмотря на локальную волатильность, пара EUR/USD стабильно торгуется возле отметки 1,3780. В понедельник утром цены на нефть марки Brent тестируют на прочность уровень сопротивления $113,3 – максимум за последние 3 недели.

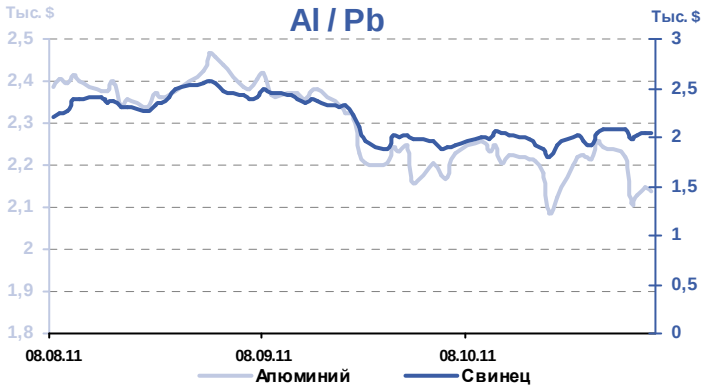
В понедельник мы ожидаем увидеть открытие торгов на российских биржах в зоне небольшого подъема. Безусловно, новостной фон говорит о том, что инвесторы остаются в напряжении в части разрешения долгового кризиса в Греции, но в целом, динамика наших фондовых индексов говорит о приходе к нам западных денег, вслед за ростом цен на нефть. По данным EPFR в первую неделя ноября приток капитала на российский рынок впервые с начала июля составил 56 млн. долл. В связи с этим, все большее число игроков будут искать точки для открытия длинных позиций по акциям и фьючерсам (торги в минувший четверг – лишнее тому доказательство). Индекс ММВБ на прошлой неделе обозначил уровень поддержки на 1440 п., а в начале на этой может дотянуться до отметки 1525 п. Наши фавориты на это время – акции Роснефти и Газпрома. Ближайшие поддержки по фьючерсу РТС расположены на 150 тыс. п., а ближайшей целью роста может стать диапазон сопротивления на 158-159 тыс. п.

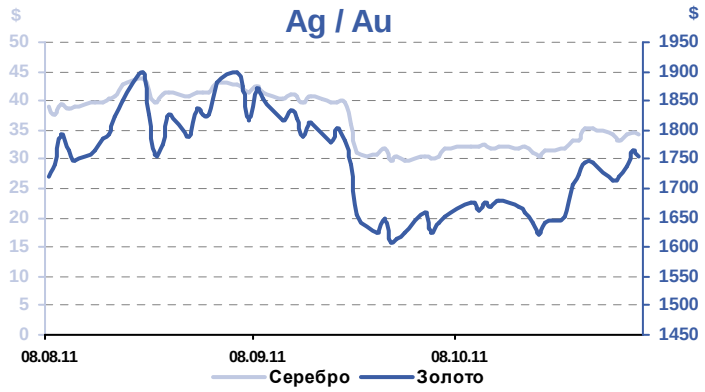
Сегодня дня в 13-30 выходит ноябрьский индекс доверия инвесторов Sentix по еврозоне. В 14-00 ждем выхода статистики по розничным продажам в еврозоне за ноябрь. В 15-00 выходят данные из Германии по объему промпроизводства за сентябрь. От этих данных будет зависеть не только настроения на европейских фондовых биржах, но на валютном рынке.

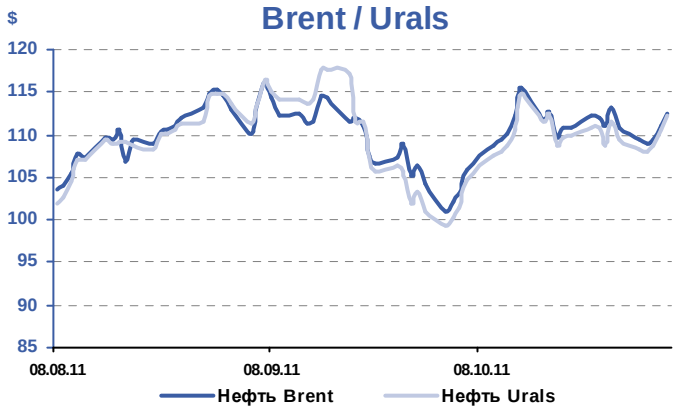
Commodities

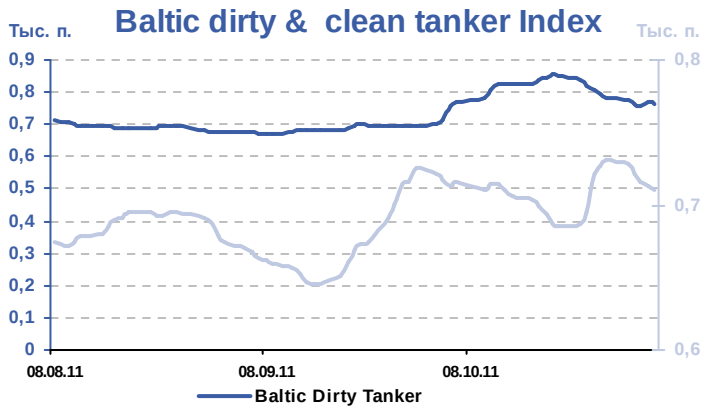












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 915,00	0,38%	-2,82%	9,55%	-4,87%
Цинк, $/t	1 969,50	2,21%	1,26%	5,49%	-18,11%
Никель, $/t	18 420,00	-0,86%	-7,44%	-2,80%	-21,78%
Олово, $/t	22 000,00	0,00%	-0,23%	-0,65%	-14,89%
Алюминий, $/t	2 146,00	0,89%	-4,83%	-3,68%	-11,25%
Свинец, $/t	2 035,00	0,54%	-0,25%	5,88%	-16,46%
Серебро, $/oz	34,55	0,80%	-1,60%	7,95%	38,96%
Золото, $/oz	1 763,82	1,45%	1,09%	6,81%	30,79%
Нефть Brent, $/	111,02	1,36%	-1,96%	4,83%	28,93%
Нефть Urals, $/	110,64	1,78%	-0,90%	5,68%	30,39%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1290,000	0,00%	0,00%	12 900		2 215
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,066	0,00%	0,00%	17 132		66
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,650	0,00%	0,00%	54 325		39 742
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,000	-0,97%	0,00%	25 500		8 679
Газпром	GAZP	5,900	5,36%	0,00%	147 500		139 674
Лукойл	LKOH	57,400	0,00%	0,00%	287 000		48 822
НОВАТЭК	NVTK	12,920	0,00%	0,00%	5 167 000		39 229
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,00%	211 500		74 717
Татнефть	TATN	4,450	0,00%	0,00%	89 000		9 695
Транснефть, п.	TRNFP	976,000	0,00%	0,00%	9 760		1 518
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,600	0,00%	0,00%	59 000		2 860
Ленэнерго	LSNG	0,426	0,00%	0,00%	131 317		395
МОЭСК	MSRS	0,049	0,00%	0,00%	12 388		2 401
ОГК-2	OGKB	0,030	-3,85%	0,00%	15 000		982
ОГК-4	OGKD	0,074	0,00%	0,00%	31 843		4 691
ОГК-5	OGKE	0,065	0,00%	0,00%	32 500		2 299
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	85 723		503
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	6,200	0,00%	0,00%	31 000		12 812
Ростелеком	RTKM	4,866	0,00%	0,00%	7 523		14 322
Ростелеком, п.	RTKMP	3,250	0,00%	0,00%	5 070		765
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	32,000	0,00%	0,00%	4 832		593
Красный Котельщик	KRKO	0,300	0,00%	0,00%	6 000		64
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,500	0,00%	0,00%	10 500		84
Северсталь-авто	SVAV	12,330		0,00%	6 165		423
Силовые машины	SILM	0,200	0,00%	0,00%	10 000		1 742
УМПО	UFMO	0,562	0,00%	0,00%	27 823		160
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	142,170	0,00%	0,00%	92 411		1 639
Мечел	MTLR	12,900	0,00%	0,00%	6 450		5 370
ММК	MAGN	0,480	0,00%	0,00%	334 750		5 364
НЛМК	NLMK	2,765	0,00%	0,00%	414 750		16 571
НорНикель	GMKN	177,000	-7,33%	0,00%	1 400 397		33 741
Полиметалл	PMTL	16,395	0,00%	0,00%	57 448		6 548
Полюс Золото	PLZL	59,000	0,00%	0,00%	17 700		11 247
Северсталь	CHMF	14,438	1,50%	0,00%	44 034		14 549
ТМК	TRMK	2,960	0,00%	0,00%	236 800		2 775
ЧМЗ	CHMZ	6,300	0,00%	0,00%	5 103		99
ЧТПЗ	CHEP	2,800	0,00%	0,00%	14 000		1 323
Банки							
Возрождение	VZRZ	26,500	0,00%	0,00%	26 500		629
Сбербанк	SBER	2,625	5,00%	0,00%	1 273 500		56 666
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,713	-6,90%	0,00%	1 107 013		1 902
Дальневосточное МП	FESH	0,290	0,00%	0,00%	14 500		856
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	1,615		0,00%	16 150		170
Балтика	PKBA	37,000	0,00%	0,00%	18 500		5 613
Верофарм	VRPH	32,625	1,95%	0,00%	5 220		310
Дикси	DIXY	8,820	0,00%	0,00%	8 820		1 100
Концерн Калина	KLNA	114,440	0,00%	0,00%	721 532		737
Магнит	MGNT	100,300	-8,82%	0,00%	200 500		8 924
Разгуляй	GRAZ	1,110	0,00%	0,00%	37 774		175
Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
Фармстандарт	PHST	66,150	-0,97%	0,00%	13 165		2 500

Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,160	0,00%	0,00%	16 000		286
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,764	0,00%	0,00%	84 070		1 231
Уфанефтехим	UFNC	4,950	0,00%	0,00%	124 250		1 363
Уфаоргсинтез	UFOS	2,700	0,00%	0,00%	27 000		264
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	110,000	0,00%	0,00%	5 500		156
ПИК	pikk	2,782	-2,01%	0,00%	15 003		1 381
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,500	0,00%	0,00%	29 625		1 884
Уралкалий	URKA	7,730	0,00%	0,00%	97 398		23 922
Химпром, НЧ	HIMC	0,020	0,00%	0,00%	582		14
Уголь							
Распадская	rasp	3,065	0,00%	0,00%	75 522		2 393
УК Южный Кузбасс	UKUZ	50,300	0,00%	0,00%	239 435		1 816

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	122,110	-1,67%	
Башнефть	AK6		EUR	179,000	-1,38%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,430	2,38%	14,99
ТГК-3	AOMD		USD	6,400	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	30,770	0,89%	10 907,38
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,690	1,51%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	14,700	-10,64%	36 138,01
X5	FIVE		USD	26,940	-2,81%	20 002,15
Газпром	GAZ		EUR	8,780	1,63%	1 567,87
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,013	0,00%	0,05
Иркутскэнерго	IRK		EUR	23,350	6,14%	5,39
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,800	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,650	0,26%	199 553,80
Лукойл	LUK		EUR	41,850	0,05%	187,81
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,850	0,35%	3 181,52
МТС	MBT	5	USD	14,580	3,92%	28 084,57
МТС	MKY	5	EUR	10,005	-1,38%	
МГТС	MOW		EUR	9,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,525	0,00%	
Мечел	MTL	3	USD	12,940	2,54%	40 475,37
НорНикель	NILSY	1	USD	19,480	7,56%	1 496,17
НорНикель	NNIA		EUR	14,150	7,24%	302,46
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	146,400	3,83%	129 779,00
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,900	1,90%	
Газпром	OGZD		USD	12,090	1,60%	703 770,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,750	-2,35%	484,88
Ростелеком	RTL		EUR	22,125	-2,75%	12,93
Газпромнефть	SCF		EUR	15,100	3,42%	99,03
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,247	-0,79%	5,81
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,608	0,36%	6,69
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,020	2,24%	340,69
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,760	0,11%	81,67
АФКСистема	SSA	1	USD	17,020	-0,76%	8 509,57
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,358	0,14%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,290	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	25,745	-3,14%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	208,190	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,260	3,40%	20 834,33
ВТБ	VTBR		USD	4,770	0,97%	31 068,61
Возрождение	VZY		EUR	23,700	0,00%	

Источник: Bloomberg

Аналитическая служба «Ай Ти Инвест - Проспект»

Александр Потавин
Начальник отдела, рыночный анализ

Ольга Самарец
Потребительский сектор

Солодин Дмитрий
Ситуационный анализ

Егишянц Сергей
Макроэкономика, мировые рынки

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Синельщикова Екатерина
skat@prsp.ru

Брокерская группа «Ай Ти Инвест -Проспект»

Россия, Москва, 119180, 1-ый Голутвинский переулок, д. 6
телефон: +7 (495) 937 33 63
факс: +7 (495) 937 33 60

www.prsp.ru
www.itinvest.ru

Представленная информация базируется на достоверных источниках.
Тем не менее, содержание данного аналитического обзора может использоваться только в информационных целях.
ОАО "ИК "Проспект" и ОАО "ИК "Ай Ти Инвест" не несут ответственности за точность предоставленных данных.
Данный документ не является предложением на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг.
Он также не является рекомендацией на покупку или продажу ценных бумаг, упомянутых в отчете.
Компании и ее сотрудники, включая тех, кто готовил этот отчет, могут иметь позиции, а также покупать и продавать ценные бумаги упомянутых в отчете компаний.
Инвестирование в странах СНГ является исключительно рискованным, поэтому инвесторы должны самостоятельно тщательно проработать свое решение.

Все права на данный аналитический отчет принадлежат Брокерской группе "Ай Ти Инвест - Проспект".
Перепечатка целиком или отдельными частями без ссылки на компании не допускается.