ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

8 ноября 2011г.

Комментарий по рынку акций

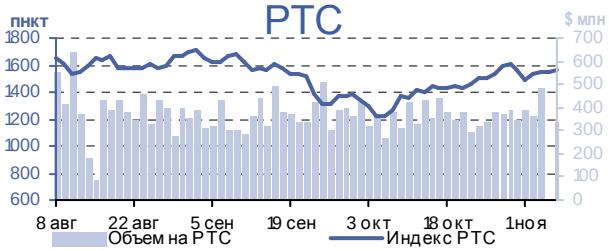
Вчера американские фондовые индексы завершили торги в плюсовой зоне. В отсутствии новой макростатистики инвесторы обращали внимание на новостной фон идущий из Европы. Усилению позиций акций нефтяных компаний способствовал рост цен на «черное золото» до трехмесячных максимумов. При этом инвесторы сохраняли некоторую осторожность в покупках, предпочитая прочим защитные акции компаний телекоммуникаций и здравоохранения. В целом индекс S&P-500 сейчас лишь восстановил позиции после пятничного обвала, когда инвесторы были разочарованы итогами саммита лидеров стран G-20

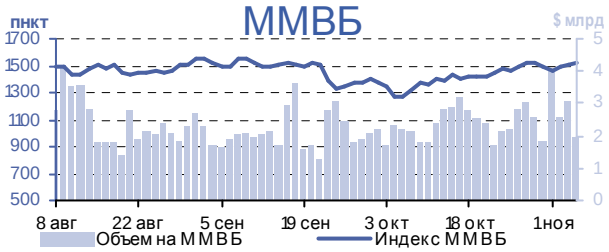
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 563,24	1,35%	0,00%	22,92%	-4,00%
Индекс ММВБ	1 521,01	1,32%	1,50%	15,38%	-3,01%
FTSE	5 510,82	-0,63%	-0,60%	4,15%	-5,80%
S&P 500	1 261,12	0,00%	0,62%	8,25%	3,10%
Dow Jones Avg.	12 068,39	0,20%	0,95%	8,50%	5,80%

Основные индикаторы





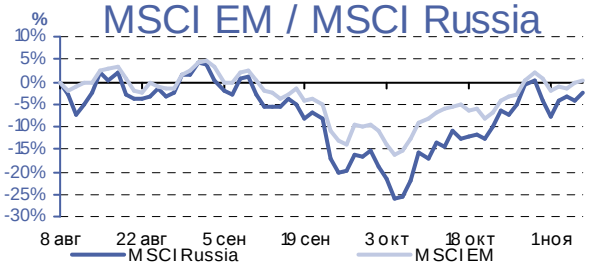
Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Группа ЛСР	20,1600	3,92%	34,31%	-38,72%
Северсталь-авто	12,7200	3,16%	-1,06%	-39,86%
Сбербанк	2,7000	2,86%	27,96%	-20,75%
Распадская	3,1400	2,45%	30,83%	-55,27%
Газпром	6,0000	1,69%	29,87%	-5,85%
Северсталь	14,6545	1,50%	33,22%	-14,28%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Разгуляй	1,0100	-9,01%	12,22%	-31,76%
Уфанефтехим, п.	2,2500	-2,17%	21,62%	6,13%
Фармстандарт	65,0000	-1,74%	3,17%	-35,32%
Аэрофлот	1,6900	-1,34%	10,46%	-35,00%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	990,29	1,67%	14,61%	-14,20%
Индекс MSCI BRAZIL	3078,91	1,23%	14,96%	-19,90%
Индекс MSCI RUSSIA	834,53	0,99%	24,88%	-3,65%
Индекс MSCI INDIA	432,36	0,49%	12,11%	-25,34%
Индекс MSCI CHINA	56,40	2,28%	19,12%	-23,02%

Обзор рынка

Вчера американские фондовые индексы завершили торги в плюсовой зоне. В отсутствии новой макростатистики инвесторы обращали внимание на новостной фон идущий из Европы. Усилению позиций акций нефтяных компаний способствовал рост цен на «черное золото» до трехмесячных максимумов. При этом инвесторы сохраняли некоторую осторожность в покупках, предпочитая прочим защитные акции компаний телекоммуникаций и здравоохранения. В целом индекс S&P-500 сейчас лишь восстановил позиции после пятничного обвала, когда инвесторы были разочарованы итогами саммита лидеров стран G-20.

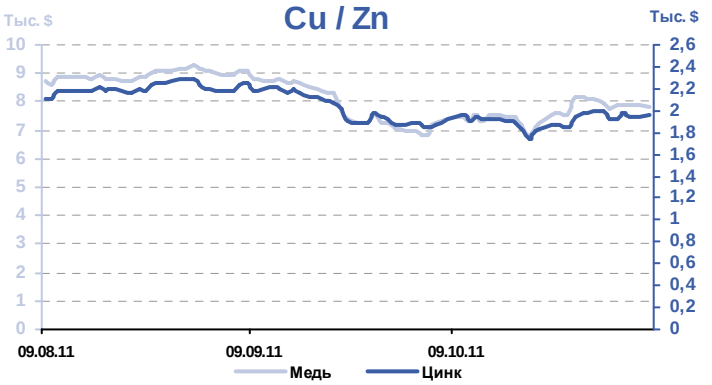
Вчера европейский стабфонд разместил 10 летние облигации на сумму 3 млрд. евро. Но несмотря на то, что спрос уверенно превысил предложение, текущая доходность облигаций на 10 б.п. превысила аналогичный показатель предыдущего размещения бумаг EFSF. То есть деньги у инвесторов есть, но они закладывают в котировки туманные перспективы долгового рынка Италии. Вчера доходности итальянских 10-летних облигаций достигли максимального с 1997 года уровня. То есть сейчас Италия сейчас занимает в три раза дороже Германии, что уже в ближайшей перспективе может затруднить дальнейшее рефинансирование ее громадных долгов.

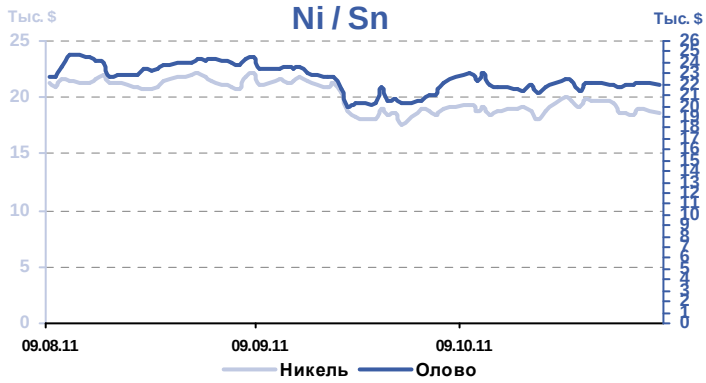
Валютная пара EUR/USD на утро вторника по-прежнему торгуется возле средней отметки вчерашней сессии - 1,3740. Цены на нефть марки Brent сегодня утром дотронулись до уровня $115/барр. На азиатских биржах сегодня не видно большого позитива: MSCI Asia -0,15%.

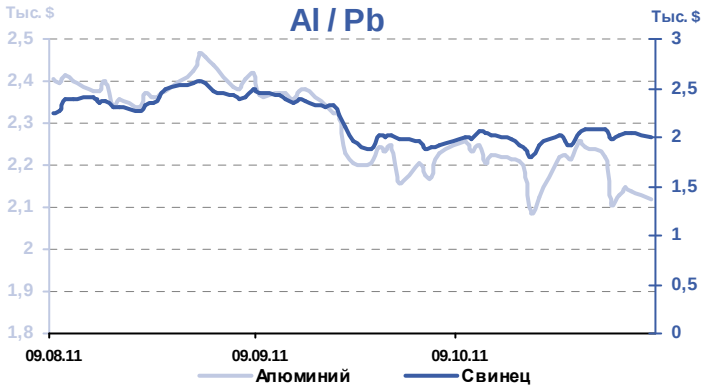
Открытие торговой сессии на нашем рынке акций во вторник мы увидим в нейтральной зоне. Цены на нефть не изменили своих значений со вчерашнего вечера, а подъем американских индексов утром компенсируют снижающиеся фьючерсы (S&P-0,46%). Тем не менее, индекс ММВБ днем может дотянуться до отметки 1530 п. Новости, которые сейчас инвесторы рассматривают в качестве позитива, сейчас переставляют наши индексы вверх в основном за счет спроса в ликвидных бумагах. Но это движение хрупкое, и мы в ближайшие пару дней можем отойти ниже в отсутствии прежних драйверов роста. Это значит, что рынок войдет в фазу консолидации.

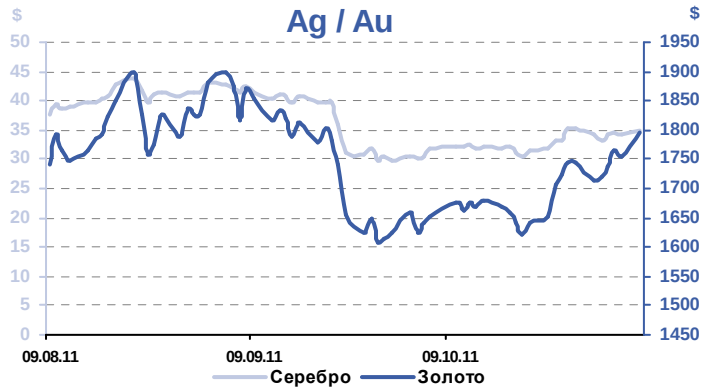
Сегодня 11-00 ждем данных из Германии по торговому балансу за сентябрь. В 13-30 ждем статистики из Великобритании по объему промышленного производства. Значимых данных макростатистики из США сегодня не выходит, поэтому торги обещают быть довольно спокойными.

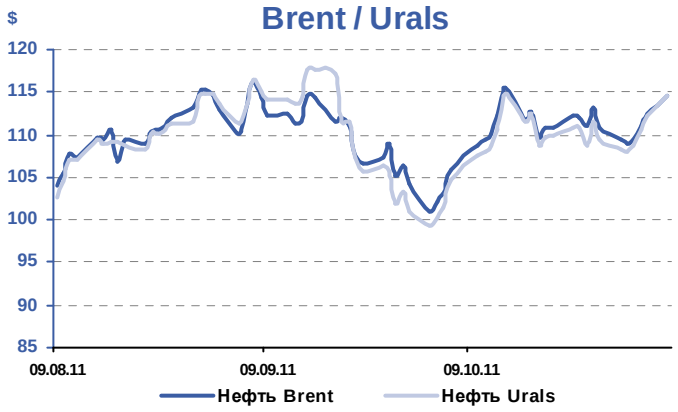
Commodities

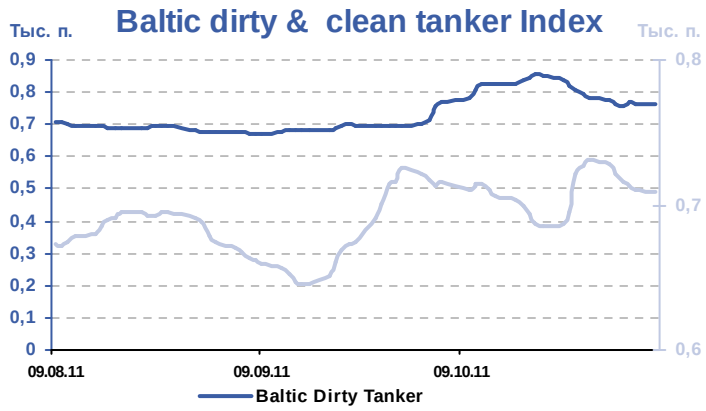












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 825,00	-1,14%	-2,07%	8,30%	-9,64%
Цинк, $/t	1 952,00	-0,89%	-2,40%	4,55%	-21,27%
Никель, $/t	18 700,00	1,52%	-4,47%	-1,32%	-22,49%
Олово, $/t	22 000,00	0,00%	0,00%	-0,65%	-17,29%
Алюминий, $/t	2 121,00	-1,16%	-4,37%	-4,80%	-12,72%
Свинец, $/t	2 010,00	-1,23%	-3,46%	4,58%	-19,76%
Серебро, $/oz	34,96	1,19%	1,92%	9,23%	25,98%
Золото, $/oz	1 795,10	1,77%	4,68%	8,70%	27,35%
Нефть Brent, $/	114,61	3,23%	4,65%	8,22%	30,15%
Нефть Urals, $/	114,66	3,63%	5,85%	9,52%	32,63%

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	50,500	-0,98%	0,00%	25 250		8 594
Газпром	GAZP	6,000	1,69%	0,00%	150 000		142 041
Газпромнефть	SIBN	4,250		0,00%	42 500		20 151
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	0,00%	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%	65 000		789
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	12,720	3,16%	0,00%	25 440		436
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	0,00%	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	14,654	1,50%	0,00%	48 381		14 767
СТЗ	SVTZ	3,000		0,00%	6 000		144
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	2,700	2,86%	0,00%	799 500		58 285
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,690	-1,34%	0,00%	84 500		1 877
Дальневосточное МП	FESH	0,290	0,00%	0,00%	14 500		856
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	1,615	0,00%	0,00%	16 150		170
Балтика	PKBA	37,000	0,00%	0,00%	18 500		5 613
Верофарм	VRPH	32,625	0,00%	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	0,00%	0,00%	200 500		8 924
Разгуляй	GRAZ	1,010	-9,01%	0,00%	20 200		160

Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
Фармстандарт	PHST	65,000	-1,74%	0,00%	6 500		2 457
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
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,320		0,00%	28 800		298
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	110,000	0,00%	0,00%	5 500		156
ПИК	pikk	2,782	0,00%	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	3,140	2,45%	0,00%	92 944		2 452
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	123,360	1,02%	
Башнефть	AK6		EUR	181,000	1,12%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,380	-11,63%	1,64
ТГК-3	AOMD		USD	6,400	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,100	1,07%	8 949,17
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,690	0,00%	29,30
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	25,990	-3,53%	14 664,86
Газпром	GAZ		EUR	8,758	-0,25%	899,73
Иркутскэнерго	IRK		EUR	21,450	-8,14%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	0,00%	1,05
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,800	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	58,750	1,91%	221 752,20
Лукойл	LUK		EUR	42,890	2,49%	357,17
Лукойл	LUKOY	1	USD	59,200	2,33%	1 490,18
МТС	MBT	5	USD	14,760	1,23%	29 552,70
МТС	MKY	5	EUR	10,660	6,55%	
МГТС	MOW		EUR	9,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,493	-0,71%	
Мечел	MTL	3	USD	13,440	3,86%	32 591,92
НорНикель	NILSY	1	USD	19,760	1,44%	3 524,48
НорНикель	NNIA		EUR	14,330	1,27%	187,47
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	149,200	1,91%	50 653,57
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	-1,86%	
Газпром	OGZD		USD	12,050	-0,33%	492 671,10
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,350	8,75%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,500	-0,81%	357,85
Ростелеком	RTL		EUR	22,000	-0,56%	19,81
Газпромнефть	SCF		EUR	15,800	4,64%	31,49
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,338	1,46%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,625	0,47%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,030	0,20%	66,61
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,630	-1,48%	77,20
АФКСистема	SSA	1	USD	17,050	0,18%	6 127,25
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,358	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,290	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	24,195	-6,02%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	14,29%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	208,190	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,400	1,24%	34 276,22
ВТБ	VTBR		USD	4,820	1,05%	26 137,11
Возрождение	VZY		EUR	23,600	-0,42%	

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.