ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

9 ноября 2011г.

Комментарий по рынку акций

Фондовые индексы на Уолл-стрит вчера опять закрылись ростом. В лентах новостей почему-то приписывают этот торговый оптимизм к сообщению о намерении премьер-министра Италии С. Берлускони уйти в отставку. Какая связь между американскими акциями и одобрением парламентом Италии экономических реформ, затребованных Евросоюзом? Якобы отставка Берлускони освободит место для нового лидера, который выведет страну на путь процветания и решит ее долговые проблемы. Если на то пошло, то до этой радужной перспективы предстоять прожить еще годы экономического застоя. Об этом, кстати, свидетельствует доходность по 10-

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 579,82	1,06%	6,39%	24,23%	-2,98%
Индекс ММВБ	1 520,88	-0,01%	4,44%	15,37%	-3,02%
FTSE	5 567,34	1,03%	2,69%	5,22%	-4,83%
S&P 500	1 275,92	1,17%	4,73%	9,52%	4,31%
Dow Jones Avg.	12 170,18	0,84%	4,39%	9,41%	6,69%

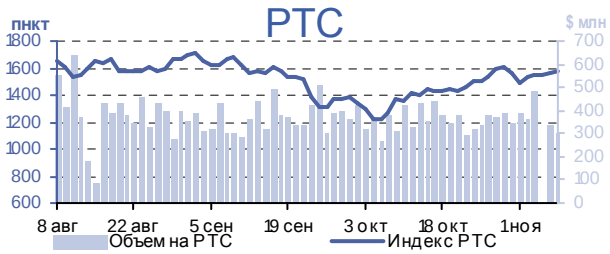
Лидеры роста

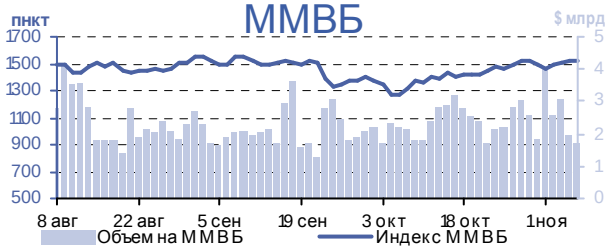
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскнефтехим, п.	0,5350	20,90%	29,19%	22,99%
НорНикель	196,0000	10,73%	0,75%	-16,06%
Сбербанк	2,7850	3,15%	31,99%	-18,26%
Фармстандарт	67,0000	3,08%	6,35%	-33,33%
Башнефть	51,4500	1,88%	15,62%	16,40%
Распадская	3,1500	0,32%	31,25%	-55,13%

Индекс *MSCI*

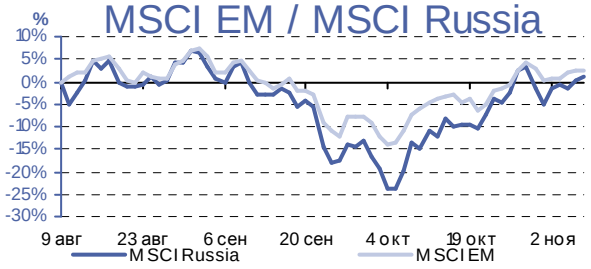
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	990,56	0,03%	14,64%	-14,18%
Индекс MSCI BRAZIL	3085,40	0,21%	15,20%	-19,73%
Индекс MSCI RUSSIA	840,43	0,71%	25,77%	-2,96%
Индекс MSCI INDIA	429,09	-0,76%	11,26%	-25,90%
Индекс MSCI CHINA	56,26	-0,25%	18,82%	-23,21%

Основные индикаторы





Голубые фишки (ММВБ)



Обзор рынка

Фондовые индексы на Уолл-стрит вчера опять закрылись ростом. В лентах новостей почему-то приписывают этот торговый оптимизм к сообщению о намерении премьер-министра Италии С. Берлускони уйти в отставку. Какая связь между американскими акциями и одобрением парламентом Италии экономических реформ, затребованных Евросоюзом? Якобы отставка Берлускони освободит место для нового лидера, который выведет страну на путь процветания и решит ее долговые проблемы. Если на то пошло, то до этой радужной перспективы предстоять прожить еще годы экономического застоя. Об этом, кстати, свидетельствует доходность по 10-летним итальянским гособлигациям, которая продолжает оставаться вблизи непозволительно высокой отметки 7%.

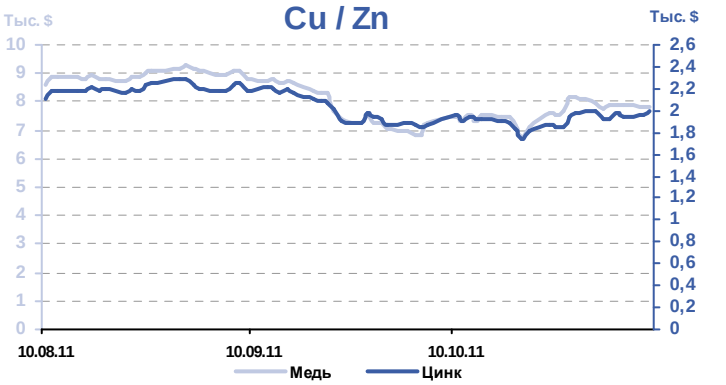
На наш взгляд на мировых биржах все достаточно банально: изгнав «медведей» с бирж в конце октября «быкам» уже не нужно прилагать больших усилий для того, чтобы двигать индексы выше. Что мы сейчас и видим. Управляющие различных фондов тоже не против к концу года увидеть восстановление стоимости своих портфелей. Не скажу, что данная конструкция устойчива, но пока торговля от покупок пока выглядит явно предпочтительнее.

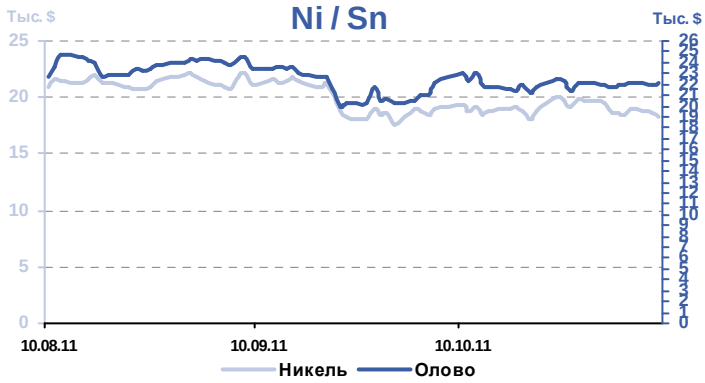
Цены на нефть марки Brent к середине недели находятся на отметке $115,4/барр. и остаются в узком торговом канале направленном вверх. Котировкам WTI осталось совсем немного до заветной отметки в $100/барр. Кстати, на стоимости бензина этот рост цен на сырье пока не оказал существенного влияния. Согласно последним данным API запасы нефти в США выросли на 0,148 млн. барр., запасы бензина сократились на 1,5 млн. барр., запасы дистиллятов опустились на 2,9 млн. барр.

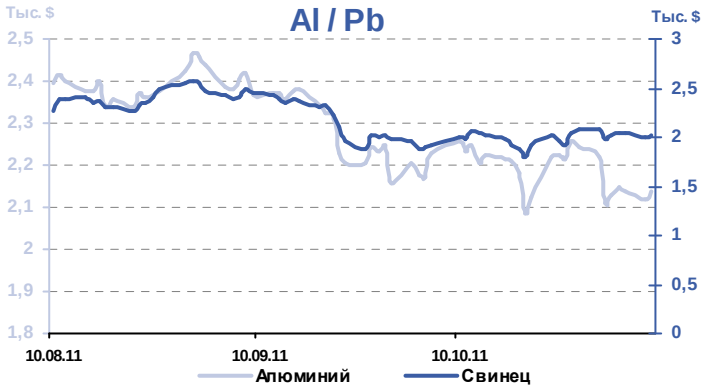
В среду мы ожидаем увидеть позитивное открытие торгов на наших биржах. Думаю, сегодня индекс ММВБ сумеет обновить ценовой максимум этого месяца, приблизившись к октябрьским пикам на уровне 1540-50 п. Последние дни рост наших индексов проходит на снижающихся торговых оборотах скорее по факту позитивного внешнего фона. По нашим наблюдениям уже вчера в отдельных ликвидных бумагах можно было наблюдать преобладание аккуратных продаж больших лотов. Продавать позиции на позитивном внешнем фоне всегда приятнее и легче. Как бы то ни было, но середина недели обычно либо подтверждает сформировавшейся краткосрочный тренд, либо его ломает. Закрытие среды, возможно, предопределит настрой рынка на закрытие этой недели.

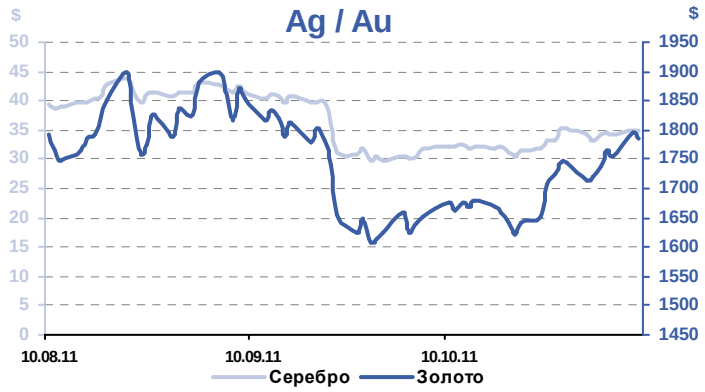
Сегодня в 18-30 ожидается выступление главы ФРС Бена Бернанке. В 19-00 выходят данные по объемам запасов на оптовых складах в США за сентябрь. В 19-30 Минэнерго США опубликует отчет по запасам нефти и нефтепродуктов.

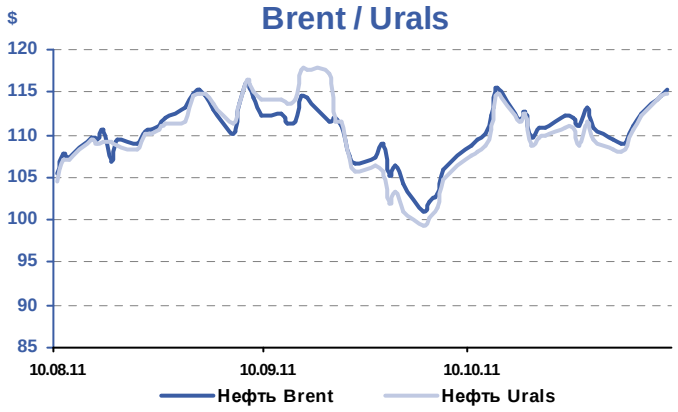
Commodities

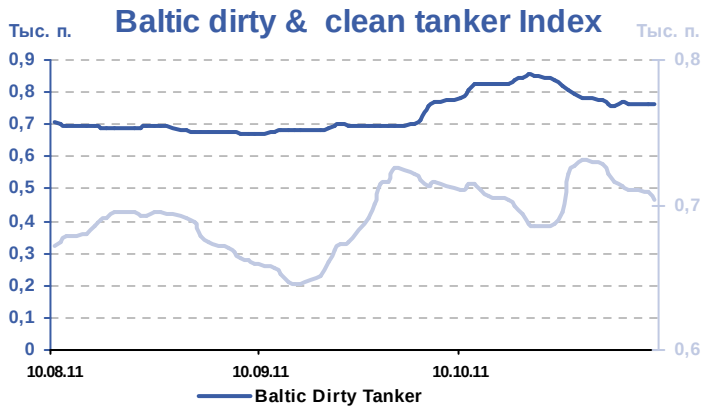












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 800,00	-0,32%	0,91%	7,96%	-9,93%
Цинк, $/t	2 000,00	2,46%	4,49%	7,12%	-19,34%
Никель, $/t	18 350,00	-1,87%	-1,34%	-3,17%	-23,94%
Олово, $/t	22 205,00	0,93%	1,97%	0,27%	-16,52%
Алюминий, $/t	2 140,00	0,90%	1,37%	-3,95%	-11,93%
Свинец, $/t	2 021,00	0,55%	1,97%	5,15%	-19,32%
Серебро, $/oz	34,98	0,06%	4,98%	9,30%	26,06%
Золото, $/oz	1 786,30	-0,49%	3,86%	8,17%	26,73%
Нефть Brent, $/	115,27	0,58%	5,84%	8,85%	30,90%
Нефть Urals, $/	114,88	0,19%	6,45%	9,73%	32,89%

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	2,850	7,55%	0,00%	84 900		42 741
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,450	1,88%	0,00%	205 800		8 755
Газпром	GAZP	6,000	0,00%	0,00%	150 000		142 041
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	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	0,00%	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	196,000	10,73%	0,00%	130 928		37 363
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	0,00%	0,00%	48 381		14 767
СТЗ	SVTZ	4,300	43,33%	0,00%	8 600		207
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	2,785	3,15%	0,00%	1 104 500		60 120
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,690	0,00%	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	0,00%	0,00%	20 200		160

Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
Фармстандарт	PHST	67,000	3,08%	0,00%	173 835		2 532
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%	13 500		264
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,320	0,00%	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
Уголь							
Распадская	rasp	3,150	0,32%	0,00%	94 779		2 460
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	124,630	1,03%	
Башнефть	AK6		EUR	181,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,490	28,95%	0,06
ТГК-3	AOMD		USD	6,400	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,820	2,32%	8 616,30
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,690	0,00%	11,64
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	25,500	-1,89%	26 685,65
Газпром	GAZ		EUR	8,909	1,72%	2 523,39
Иркутскэнерго	IRK		EUR	21,450	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,350	11,67%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	-6,25%	
Лукойл	LKOD		USD	59,450	1,19%	232 313,20
Лукойл	LUK		EUR	43,365	1,11%	234,98
Лукойл	LUKOY	1	USD	60,000	1,35%	6 397,10
МТС	MBT	5	USD	14,430	-2,24%	44 765,91
МТС	MKY	5	EUR	10,355	-2,86%	37,48
МГТС	MOW		EUR	10,000	11,11%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,847	7,88%	3,85
Мечел	MTL	3	USD	13,640	1,49%	31 500,72
НорНикель	NILSY	1	USD	19,720	-0,20%	2 024,55
НорНикель	NNIA		EUR	14,115	-1,50%	209,39
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	149,100	-0,07%	34 715,65
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	12,210	1,33%	365 478,30
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,350	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,500	0,00%	233,06
Ростелеком	RTL		EUR	21,025	-4,43%	15,52
Газпромнефть	SCF		EUR	16,300	3,16%	63,95
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,416	1,23%	17,59
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,650	0,69%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,120	1,79%	184,20
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,090	5,33%	73,89
АФКСистема	SSA	1	USD	17,200	0,88%	6 604,79
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,405	0,64%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,480	1,04%	
СТЗ	SVY		EUR	23,285	-3,76%	24,00
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	208,190	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,310	-0,79%	21 448,19
ВТБ	VTBR		USD	4,875	1,14%	33 931,95
Возрождение	VZY		EUR	23,600	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.