ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

14 ноября 2011г.

Комментарий по рынку акций

В пятницу американские фондовые индексы закрылись уверенным ростом. Позитивные новости из еврозоны и благоприятная макростатистика обусловили поддержку биржевым «быкам». В конце недели итальянский сенат одобрил программу экономии госбюджета страны на 2012 год, которая может предотвратить развал еврозоны.

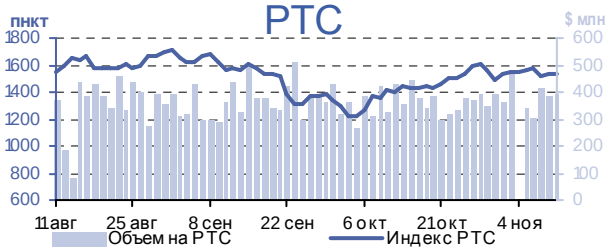
На этом фоне доходность 10-летним итальянских бондам в пятницу снизилась до 6,45% после рекордных 7,5% в середине прошлой недели. Таким образом, инвесторы отыгрывали устранение двух главных неопределенностей в отношении новых

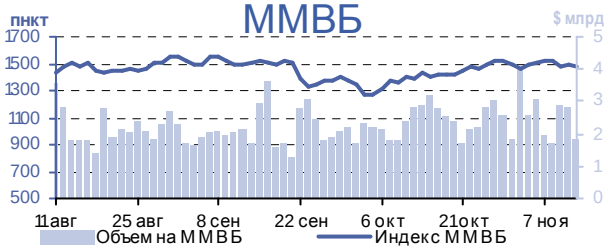
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 530,70	0,06%	-1,21%	5,62%	-6,07%
Индекс ММВБ	1 484,97	-0,31%	-1,08%	3,70%	-4,59%
FTSE	5 545,38	1,85%	0,33%	1,45%	-4,64%
S&P 500	1 263,85	1,95%	0,85%	3,21%	4,15%
Dow Jones Avg.	12 153,68	2,19%	1,42%	4,37%	7,72%

Основные индикаторы

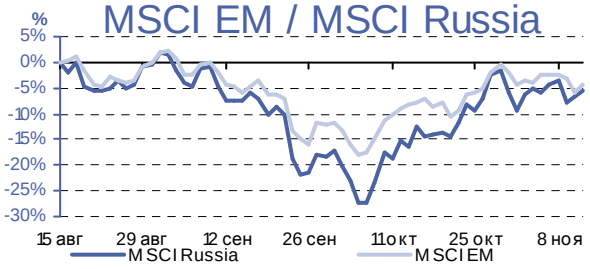




Голубые фишки (ММВБ)

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	971,15	1,80%	3,81%	-14,72%
Индекс MSCI BRAZIL	3052,26	3,11%	4,97%	-17,72%
Индекс MSCI RUSSIA	824,17	1,10%	8,17%	-4,38%
Индекс MSCI INDIA	414,41	-0,96%	-1,44%	-27,83%
Индекс MSCI CHINA	55,07	1,21%	6,06%	-23,98%



Обзор рынка

В пятницу американские фондовые индексы закрылись уверенным ростом. Позитивные новости из еврозоны и благоприятная макростатистика обусловили поддержку биржевым «быкам». В конце недели итальянский сенат одобрил программу экономии госбюджета страны на 2012 год, которая может предотвратить развал еврозоны.

На этом фоне доходность 10-летним итальянских бондам в пятницу снизилась до 6,45% после рекордных 7,5% в середине прошлой недели. Таким образом, инвесторы отыгрывали устранение двух главных неопределенностей в отношении новых правительств в Италии и Греции. Восстановление американских фондовых индексов на фоне стабилизации ситуации на рынке труда вылилось в рост индекса потребительского доверия в США в ноябре до максимального за 5 месяцев уровня 64,2 п., что также поддержало «бычий» настрой на рынке.

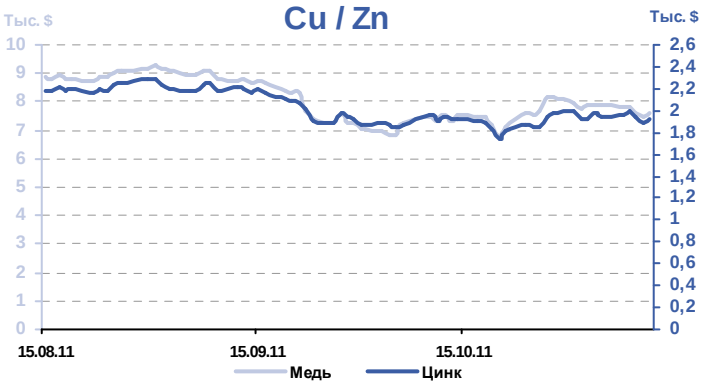
По еврозоне последние новости, которые повлияли на рынки (EUR/USD 1,3770) были такие: в пятницу Сенат Италии одобрил проект госбюджета страны с программой мер по сокращению дефицита на 2012 год, в субботу за него проголосовала нижняя палата парламента. Сразу после этого премьер-министр Италии Сильвио Берлускони ушел в отставку (как и обещал). Теперь новым премьер-министром Италии стал бывший еврокомиссар Марио Монти (член оргкомитета Бильдербергского клуба).

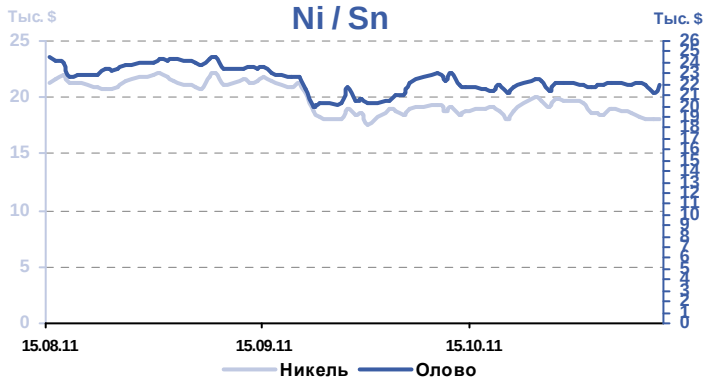
Трейдеры по нефти марки Brent в понедельник утром продолжают смотреть вверх, имея целью на этой неделе протестировать ценовой максимум предыдущей на $116/барр. Азиатские биржевые индикаторы сегодня растут вслед за Штатами: MSCI Asia +2,5%.

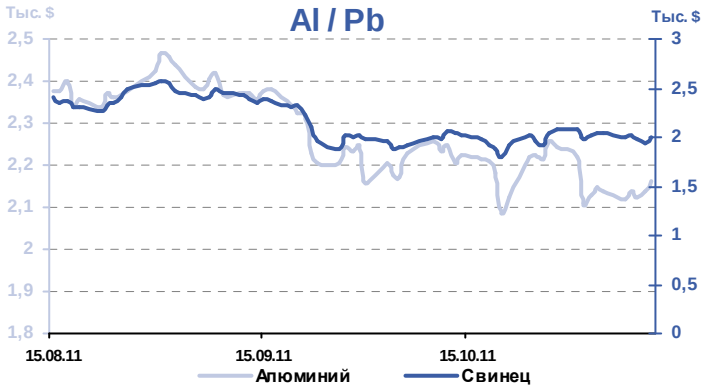
В понедельник нас ждем открытие торгов на наших биржах с гэпом вверх в пределах 0,8%. Внешний фон сегодня утром окрашен в зеленые тона на фоне остаточного позитива доставшегося нам с предыдущей недели. То есть все сигналы говорят в пользу покупателей. Однако не все так просто. Многие уже обратили внимание на то, что в ходе торгов пятницу наши индексы почти не реагировали на сильный рост на европейских биржах и в ценах на нефть. Вероятно, это может быть связано с сегодняшней экспирацией ближайших опционных контрактов. Поэтому пока мы не видим четких сигналов в пользу роста. График индекса ММВБ остается зажатым в границах сужающегося треугольника (1525 п. сверху и 1450 п. снизу), поэтому повышенная волатильность и неустойчивость котировок внутри этого диапазона по котировкам ликвидных бумаг сохранятся. Тем не менее, мы предпочтем аккуратные покупки на локальных просадках рынка.

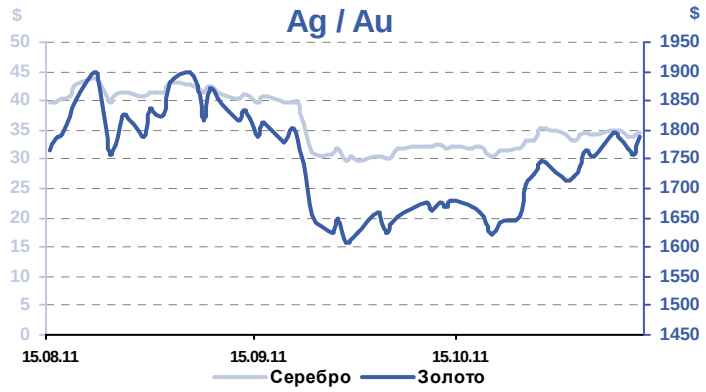
Сегодня в 14-00 в Еврозоне выходят данные по объемам промышленного производства за сентябрь. Если они окажутся хуже прогноза (-2,2% м/м), думаю, на вторую половину торгов настроения рынку может быть испорчено

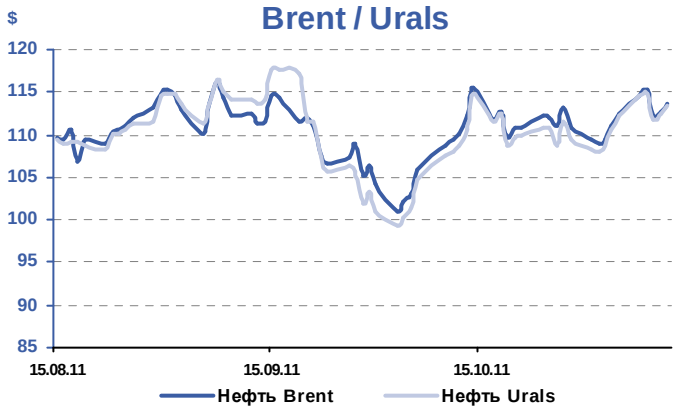
Commodities

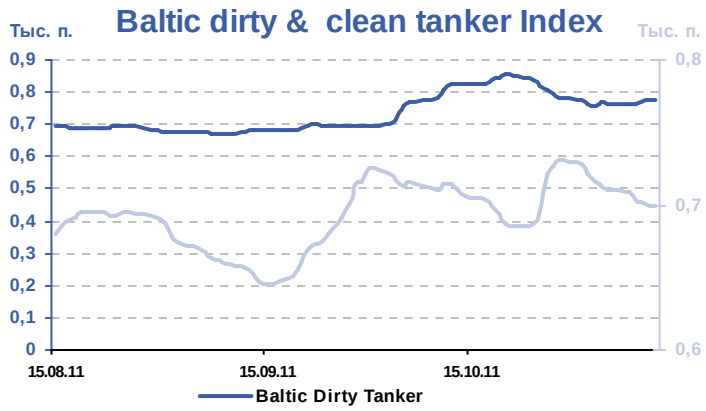












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 639,00	2,17%	-2,94%	1,25%	-13,49%
Цинк, $/t	1 920,00	1,59%	-1,54%	-0,57%	-24,47%
Никель, $/t	18 075,00	-0,41%	-4,37%	-4,24%	-24,69%
Олово, $/t	21 925,00	3,40%	-0,57%	0,57%	-18,78%
Алюминий, $/t	2 162,00	1,03%	1,03%	-2,83%	-12,01%
Свинец, $/t	1 995,00	2,68%	-2,59%	-1,53%	-23,56%
Серебро, $/oz	34,68	1,82%	1,55%	7,72%	25,19%
Золото, $/oz	1 788,68	1,72%	1,94%	6,42%	26,98%
Нефть Brent, $/	113,76	0,91%	1,08%	-1,51%	28,59%
Нефть Urals, $/	113,42	0,88%	1,13%	-1,30%	31,08%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1275,000	0,00%	0,00%	12 750		2 190
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,066	0,00%	0,00%	17 132		66
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,720	0,00%	0,00%	95 000		40 792
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,450	0,00%	0,00%	385 875		8 755
Газпром	GAZP	6,110	0,00%	0,00%	76 375		144 645
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	13,040	0,00%	0,00%	130 400		39 593
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,00%	211 500		74 717
Татнефть	TATN	4,450	0,00%	0,00%	89 000		9 695
Электроэнергетика							
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	32,500	0,00%	0,00%	6 500		602
Красный Котельщик	KRKO	0,300	0,00%	0,00%	6 000		64
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
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	0,00%	0,00%	130 928		37 363
Полиметалл	PMTL	16,395	0,00%	0,00%	57 448		6 548
Северсталь	CHMF	14,654	0,00%	0,00%	48 381		14 767
СТЗ	SVTZ	4,300	0,00%	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	2,595	0,00%	0,00%	625 180		56 018
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	39,000	0,00%	0,00%	19 500		5 917
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
Фармстандарт	PHST	67,000	0,00%	0,00%	173 835		2 532
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,169	0,00%	0,00%	12 663		301
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							
ПИК	pikk	2,800	0,00%	0,00%	10 003		1 381
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	40,600	0,00%	0,00%	5 603		1 936
Уралкалий	URKA	7,730	0,00%	0,00%	97 398		23 922
Уголь							
Распадская	rasp	3,150	0,00%	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	122,090	-1,21%	
Башнефть	AK6		EUR	185,000	-1,07%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,460	9,52%	2,51
ТГК-3	AOMD		USD	5,700	-10,24%	0,57
Татнефть	ATAD		USD	33,650	4,70%	14 411,44
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,561	-0,39%	
Бурятзолото	BYT		EUR	17,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	24,630	4,23%	19 644,90
Газпром	GAZ		EUR	8,771	0,24%	1 177,59
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,010	-33,33%	0,02
Иркутскэнерго	IRK		EUR	21,750	2,47%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,850	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,150	-1,21%	227 641,80
Лукойл	LUK		EUR	41,640	-2,55%	439,66
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,270	-1,77%	8 125,21
МТС	MBT	5	USD	14,110	4,36%	20 556,13
МТС	MKY	5	EUR	10,245	2,74%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,800	4,55%	4,70
Мечел	MTL	3	USD	12,550	4,67%	28 636,62
НорНикель	NILSY	1	USD	18,140	-0,17%	8 586,35
НорНикель	NNIA		EUR	13,100	-1,50%	219,42
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	148,000	2,99%	40 601,02
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	-0,17%	
Газпром	OGZD		USD	12,100	2,28%	330 581,20
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	31,000	0,00%	767,27
Ростелеком	RTL		EUR	22,600	2,03%	
Газпромнефть	SCF		EUR	16,245	0,90%	26,57
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,556	-0,44%	25,88
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,597	-0,91%	14,44
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,030	1,00%	543,47
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,970	0,90%	9,85
АФКСистема	SSA	1	USD	17,150	3,00%	11 900,14
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,405	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,480	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	25,000	10,57%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	14,29%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	214,290	2,93%	0,23
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,260	3,59%	18 512,29
ВТБ	VTBR		USD	4,720	1,11%	47 683,59
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.