ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

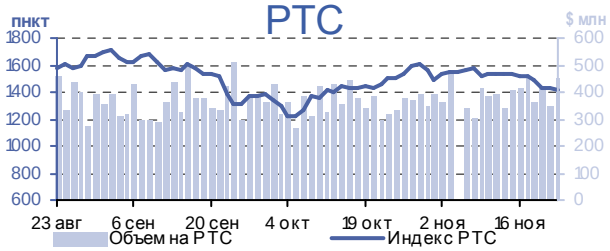
24 ноября 2011г.

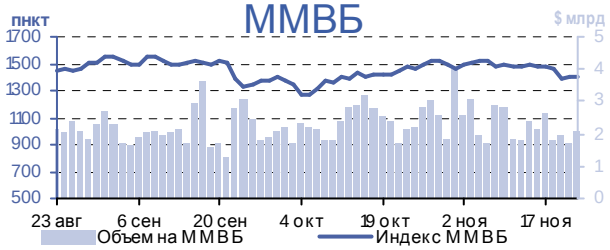
Комментарий по рынку акций

Американский рынок акций в среду опять обвалился. Формальными поводами для распродаж стала слабая статистика по производственной активности в Китае и сохранение негативных тенденций на долговом рынке еврозоны. Интересно, что еще 9 ноября количество пессимистов на американском рынке акций упало до 10-месячного минимума. Буквально через 2 недели все поменялось в обратную сторону: падение индексов вынуждает инвесторов выходить из «бумажных» позиций. Индекс рыночного страха VIX вчера вырос на 6,3%. Однако, пока индекс S&P-500 удерживается выше сильного уровня поддержки на 1150 п. говорить о полной капитуляции биржевых «быков» пока рано

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





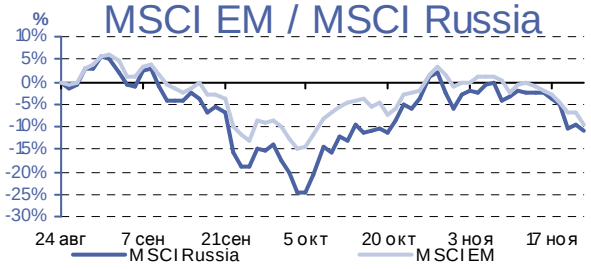
Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 422,00	-0,64%	-6,49%	-5,75%	-9,62%
Индекс ММВБ	1 404,26	0,17%	-5,32%	-5,30%	-8,63%
FTSE	5 139,78	-1,29%	-6,70%	-7,36%	-7,91%
S&P 500	1 161,79	-2,21%	-6,07%	-7,37%	-1,60%
Dow Jones Avg.	11 257,55	-2,05%	-5,44%	-5,51%	2,00%

Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Акрон	47,5000	7,95%	25,59%	5,56%
Сбербанк	2,4500	1,24%	-5,77%	-30,20%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь	13,2319	-12,74%	6,54%	-30,58%
ОАО Компания М.видео	6,6700	-5,39%	10,61%	-28,05%
Лукойл	52,7000	-4,70%	-1,50%	-18,29%
Башнефть	47,5000	-1,04%	0,00%	6,74%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	885,26	-2,65%	-6,75%	-18,78%
Индекс MSCI BRAZIL	2714,84	-3,63%	-7,04%	-22,99%
Индекс MSCI RUSSIA	748,35	-1,79%	-6,40%	-9,50%
Индекс MSCI INDIA	360,15	-2,35%	-12,24%	-32,33%
Индекс MSCI CHINA	50,97	-2,47%	-2,84%	-23,88%

Обзор рынка

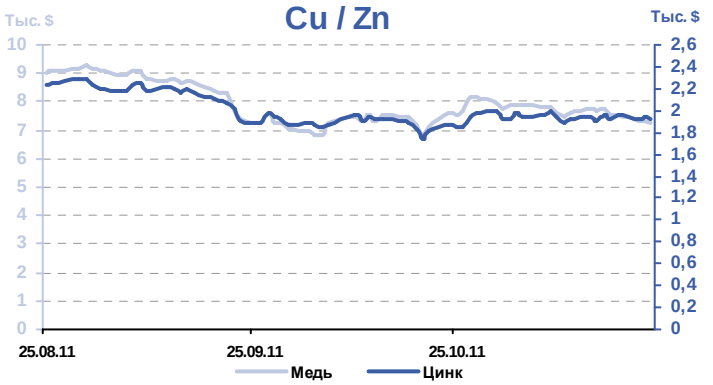
Американский рынок акций в среду опять обвалился. Формальными поводами для распродаж стала слабая статистика по производственной активности в Китае и сохранение негативных тенденций на долговом рынке еврозоны. Интересно, что еще 9 ноября количество пессимистов на американском рынке акций упало до 10-месячного минимума. Буквально через 2 недели все поменялось в обратную сторону: падение индексов вынуждает инвесторов выходить из «бумажных» позиций. Индекс рыночного страха VIX вчера вырос на 6,3%. Однако, пока индекс S&P-500 удерживается выше сильного уровня поддержки на 1150 п. говорить о полной капитуляции биржевых «быков» пока рано. Тем более, что последняя статистика из Штатов не выглядит удручающе слабой: индекс потребительского доверия от университета Мичигана за ноябрь составил 64,1 п. против октябрьского значения в 60,9 п.

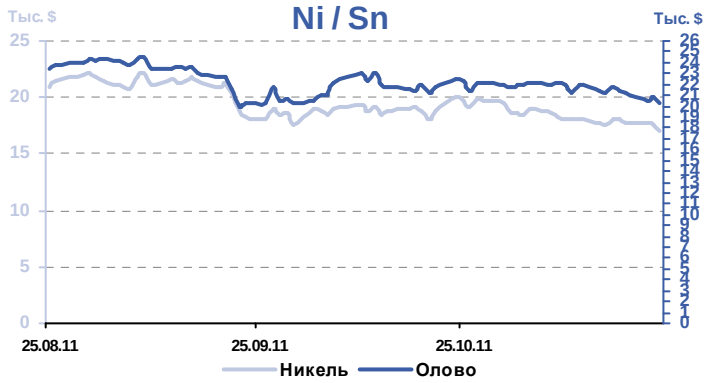
Вчера правительство Бельгии дало понять, что не может оплатить свою долю в рекапитализации франко-бельгийского банка Dexia. Соответственно, если это сделает Франция, у нее возрастут расходы госбюджета. На этом фоне в среду доходность 10-летних французских бондов выросла до 3,68%. Вчерашний аукцион по немецким гособлигациям также оказался неудачным: из предложенного объема в 6 млрд евро. удалось разместить лишь 3,644 млрд. евро, оставшуюся часть выпуска купил Бундесбанк. В итоге в среду доходность 10-летних бундосов выросла до 2%. Напротив, Минфин США в тот же день провел успешный аукцион по 7-летним бондам на сумму $29 млрд. с рекордно низким уровнем доходности для размещений – 1,415%. Воротилы рынка с Уолл-стрит сделали свою игру в середине ноября: разместили за неделю облигаций почти $100 млрд. по рекордно низким ставкам, да и акции опустили опять до уровней приятных к покупке.

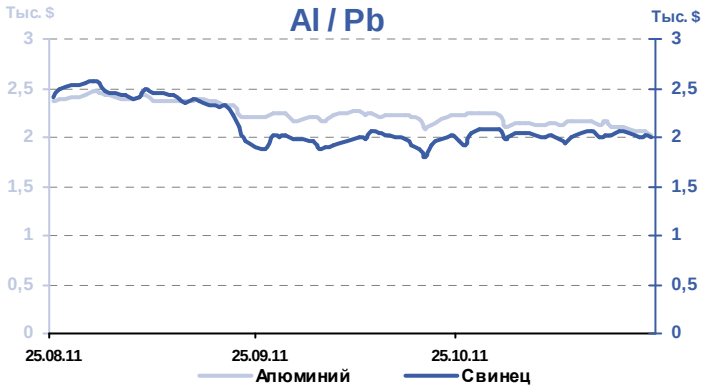
Цены на нефть марки Brent продолжают торговаться на средних уровнях с начала этой недели – $107,5/барр. На азиатских биржах сегодня не видно паническ их настроений. Здесь инвесторы не активно, но пробуют выкупить утреннюю просадку в индексах.

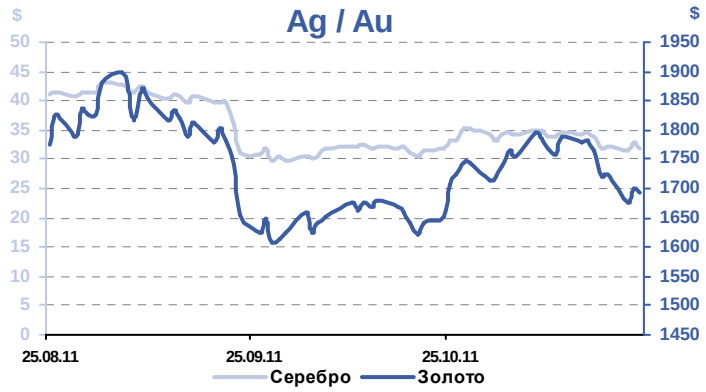
Открытие торгов на российских биржах в четверг мы ожидаем увидеть в красной зоне. Что в Европе, что в Штатах фондовые индексы продолжают падать, а инвесторы бегут от рисков. Вчера индекс ММВБ нащупал хорошую поддержку на отметке 1380 п. Думаю, сегодня этот уровень сохранит свою актуальность. Активно выкупать падающий рынок пока рискованно. Это комфортнее делать, когда график индекса ММВБ пробьет вверх свой падающий тренд. Но пока мы этого не увидим, наш рынок останется заложником внешнего фона. Сегодня днем торги будут проходить в боковом тренде с границами 1380 – 1410 п. по индексу ММВБ и торговая активность особенно ближе к вечеру будет не высокой, так как в четверг в США отмечается День Благодарения, и финансовые рынки там закрыты

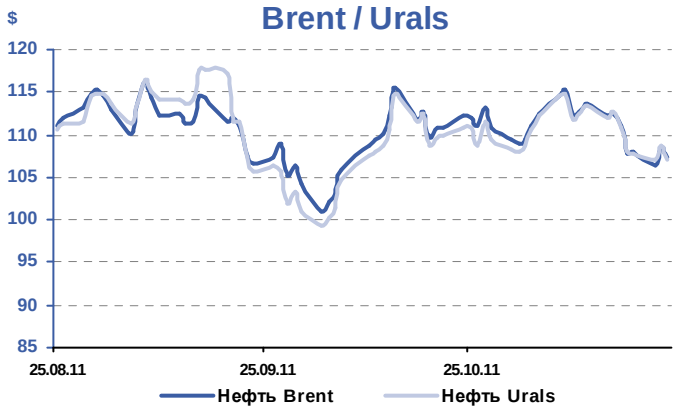
Commodities

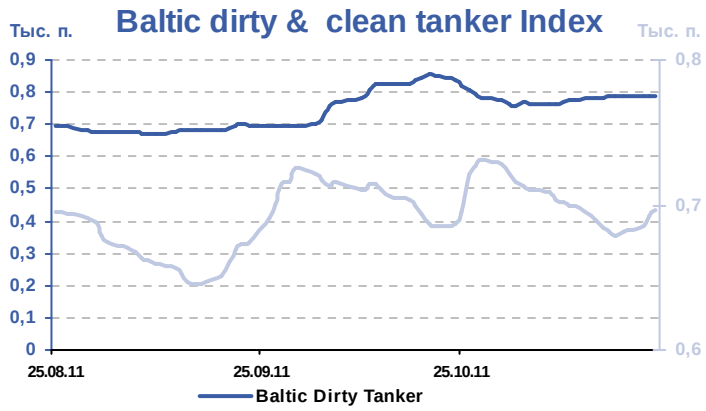












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 240,00	-1,23%	-6,34%	-5,17%	-11,06%
Цинк, $/t	1 914,00	-1,34%	-2,35%	2,03%	-8,25%
Никель, $/t	17 025,00	-2,99%	-6,15%	-14,85%	-21,18%
Олово, $/t	20 200,00	-2,88%	-6,91%	-10,40%	-15,48%
Алюминий, $/t	2 024,00	-2,25%	-6,17%	-8,75%	-10,24%
Свинец, $/t	2 005,00	-0,72%	-1,23%	-0,69%	-8,30%
Серебро, $/oz	31,72	-3,06%	-6,00%	-0,13%	15,30%
Золото, $/oz	1 692,27	-0,44%	-4,03%	2,35%	22,95%
Нефть Brent, $/	107,23	-1,20%	-3,47%	-4,39%	30,09%
Нефть Urals, $/	107,19	-1,40%	-3,26%	-3,39%	32,02%

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	2,640	0,00%	0,00%	72 072		39 592
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,500	-1,04%	0,00%	286 500		8 083
Газпром	GAZP	5,580	0,00%	0,00%	139 500		132 098
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,00%	42 500		20 151
Лукойл	LKOH	52,700	-4,70%	0,00%	263 500		44 825
НОВАТЭК	NVTK	13,040	0,00%	0,00%	130 400		39 593
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,00%	211 500		74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,878	0,00%	0,00%	43 900		31 367
Транснефть, п.	TRNFP	1540,000	0,00%	0,00%	154 000		2 395
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%	11 933		969
ОГК-3	OGKC	0,032	0,00%	0,00%	10 565		1 515
ОГК-5	OGKE	0,065	0,00%	0,00%	32 500		2 299
Самараэнерго	SAGO	0,028	0,00%	0,00%	268		97
ТГК-3	MSNG	0,062	0,00%	0,00%	5 925		2 476
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%	303 752		344
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	82 356		484
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	6,200	0,00%	0,00%	31 000		12 812
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	12,200	0,00%	0,00%	12 200		418
Силовые машины	SILM	0,193	0,00%	0,00%	9 625		1 676
Металлургия							
Мечел	MTLR	10,900	0,00%	0,00%	5 450		4 537
НЛМК	NLMK	2,391	0,00%	0,00%	488 460		14 331
НорНикель	GMKN	167,000	0,00%	0,00%	167 000		31 835
Полиметалл	PMTL	16,395	0,00%	0,00%	57 448		6 548
Северсталь	CHMF	13,232	-12,74%	0,00%	10 017		13 334
СТЗ	SVTZ	4,300	0,00%	0,00%	8 600		207
Банки							
Возрождение	VZRZ	23,200	0,00%	0,00%	38 280		551
Сбербанк	SBER	2,450	1,24%	0,00%	734 500		52 888
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,690	0,00%	0,00%	52 804		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	38,250	0,00%	0,00%	19 125		5 803
Верофарм	VRPH	29,800	0,00%	0,00%	77 480		298
Концерн Калина	KLNA	117,461	0,00%	0,00%	352 382		755
Магнит	MGNT	100,300	0,00%	0,00%	200 500		8 924
Разгуляй	GRAZ	0,952	0,00%	0,00%	6 854		151
Фармстандарт	PHST	65,550	-0,68%	0,00%	6 555		2 477
Черкизово	GCHE	21,900	0,00%	0,00%	219 000		943
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,145	0,00%	0,00%	10 875		259
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,764	0,00%	0,00%	84 070		1 231
Уфанефтехим	UFNC	4,750	0,00%	0,00%	23 750		1 308
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	2,670	0,00%	0,00%	10 002		1 317
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	47,500	7,95%	0,00%	35 625		2 265
Уголь							
Распадская	rasp	3,000	0,00%	0,00%	300 000		2 342
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	115,090	1,73%	
Башнефть	AK6		EUR	175,000	1,47%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,260	-13,33%	0,10
ТГК-3	AOMD		USD	6,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	27,430	-3,31%	6 377,56
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,190	-4,66%	
Бурятзолото	BYT		EUR	17,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	22,880	0,79%	7 527,12
Газпром	GAZ		EUR	7,965	-1,26%	710,34
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,030	0,00%	0,74
Иркутскэнерго	IRK		EUR	19,550	1,30%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,400	19,30%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	52,500	-0,76%	113 626,00
Лукойл	LUK		EUR	39,300	0,18%	158,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	52,000	-1,76%	6 642,75
МТС	MBT	5	USD	14,660	-3,43%	62 603,30
МТС	MKY	5	EUR	11,055	10,00%	12,92
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,500	-0,31%	4,44
Мечел	MTL	3	USD	9,100	-5,60%	21 923,04
НорНикель	NILSY	1	USD	16,200	-1,58%	753,62
НорНикель	NNIA		EUR	12,220	0,33%	113,03
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	133,900	-4,83%	81 990,25
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,680	-1,75%	356 938,80
ОМЗ	OMZD		USD	0,650	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,100	-2,38%	
Ростелеком	RKMD		USD	29,250	-1,02%	495,13
Ростелеком	RTL		EUR	22,250	1,14%	4,40
Газпромнефть	SCF		EUR	15,825	0,80%	49,69
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,406	-0,68%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,756	-0,13%	
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,410	-4,32%	25,39
АФКСистема	SSA	1	USD	17,500	5,49%	38 841,33
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,072	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,480	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	34,095	2,25%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	214,290	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,250	-1,06%	32 115,65
ВТБ	VTBR		USD	3,925	-4,01%	55 902,86
Возрождение	VZY		EUR	22,000	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.