ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

25 ноября 2011г.

Комментарий по рынку акций

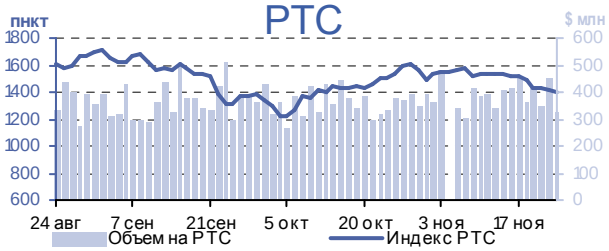
Вчера американские биржи были закрыты из-за праздника День Благодарения. За последние сутки все настроения на фондовых биржах диктовались новостным фоном идущим из Европы. Вчера агентство Fitch понизило рейтинг Португалии с «BBB- » до «BB+» с негативным прогнозом. По итогам состоявшейся встречи лидеры Франции и Германии заявили, что хотят скорректировать основополагающие соглашения ЕС, чтобы спасти евро. В свою очередь Ангела Меркель по-прежнему жестко выступает против выпуска еврооблигаций. На этом фоне валютная пара EUR/USD опустилась до 7-недельного минимума на 1,3305. Все эти факторы давят и на европейский рынок акций. Например

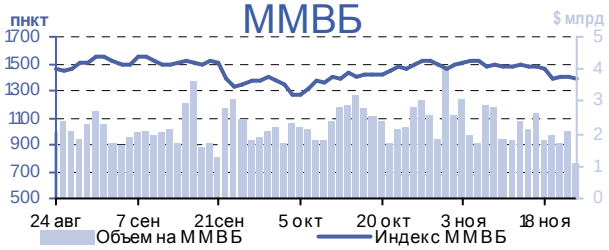
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 402,83	-1,35%	-7,26%	-6,48%	-12,39%
Индекс ММВБ	1 392,75	-0,82%	-5,60%	-4,75%	-10,83%
FTSE	5 127,57	-0,24%	-5,45%	-7,20%	-9,36%

Основные индикаторы





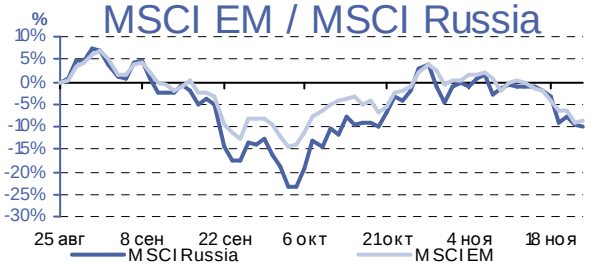
Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Синергия	20,2500	1,25%	-7,95%	-54,49%
НорНикель	167,6000	0,36%	-18,24%	-32,42%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Газпром	5,3700	-3,76%	-1,10%	-19,61%
Башнефть, п.	40,0000	-3,03%	11,11%	11,11%
Сбербанк	2,4150	-1,43%	-9,38%	-31,20%
Распадская	2,9600	-1,33%	4,59%	-61,31%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	888,24	0,34%	-7,02%	-19,01%
Индекс MSCI BRAZIL	2695,16	-0,72%	-7,30%	-25,57%
Индекс MSCI RUSSIA	744,22	-0,55%	-6,02%	-11,72%
Индекс MSCI INDIA	365,93	1,60%	-12,99%	-30,20%
Индекс MSCI CHINA	51,33	0,71%	-3,67%	-23,48%

Обзор рынка

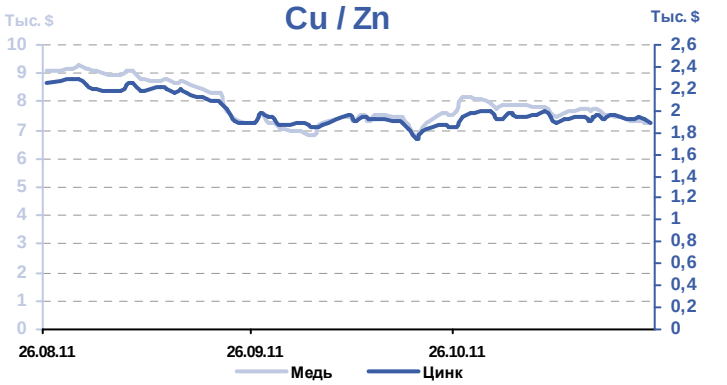
Вчера американские биржи были закрыты из-за праздника День Благодарения. За последние сутки все настроения на фондовых биржах диктовались новостным фоном идущим из Европы. Вчера агентство Fitch понизило рейтинг Португалии с «BBB- » до «BB+» с негативным прогнозом. По итогам состоявшейся встречи лидеры Франции и Германии заявили, что хотят скорректировать основополагающие соглашения ЕС, чтобы спасти евро. В свою очередь Ангела Меркель по-прежнему жестко выступает против выпуска еврооблигаций. На этом фоне валютная пара EUR/USD опустилась до 7-недельного минимума на 1,3305. Все эти факторы давят и на европейский рынок акций. Например, британский индекс FTSE-100 без остановки снижается уже почти 9 сессий подряд.

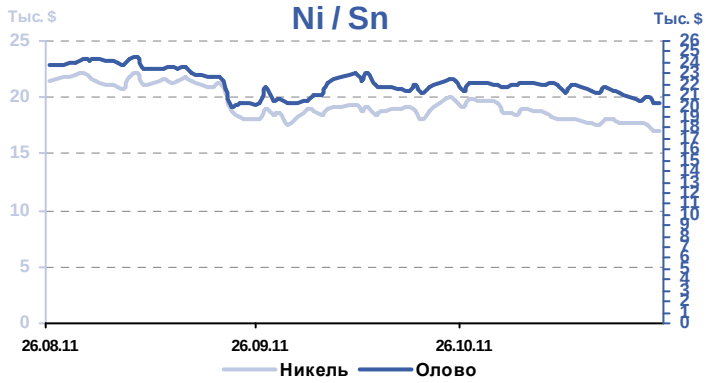
Цены на нефть марки Brent к закрытию недели торгуются без изменений возле отметки $107,6/барр. На рынке промышленных металлов также не отмечается серьезных изменений цен: медь $7200/т, никель $17100/т, алюминий $2030/т. Азиатские фондовые индексы сегодня торгуются преимущественно в красной зоне: MSCI Asia -1%. Отсутствие позитива в Азии сейчас давит на американские фьючерсы: S&P-0,56%.

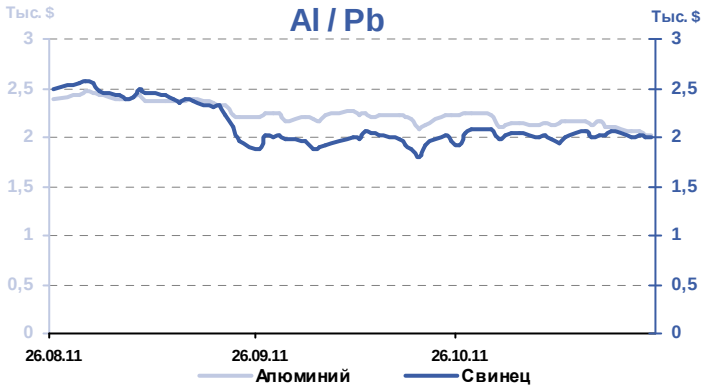
Открытие торгов на российских биржах в пятницу мы ожидаем увидеть в зоне незначительного снижения. Ближайшие торги будут проходить в условиях тонкого рынка. Индекс ММВБ сейчас балансирует возле важного уровня поддержки на 1380 п., прорыв которого будет означать выход вниз из консолидации последних дней. То же самое можно сказать и про фьючерс РТС, где благодаря усилиям «медведей» котировки приблизились к опасной точке срыва вниз на 138 тыс. п. Не исключаю, что в ближайшее время мы увидим попытки пробоя этого рубежа, что столкнет фьючерс к уровням 136-134 тыс. п.

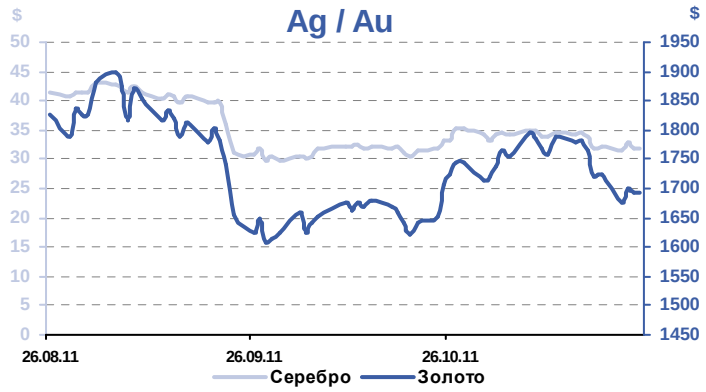
Сегодня не выходит важной статистики из Европы и США, поэтому все внимание инвесторов будет приковано к итогам аукциона (14-00 мск) по продаже итальянских облигаций с погашением в сентябре 2013 года на сумму 2 млрд. Сегодня в США «Черная пятница» открытие рождественских распродаж в магазинах, финансовые рынки открыты до 22-00 мск.

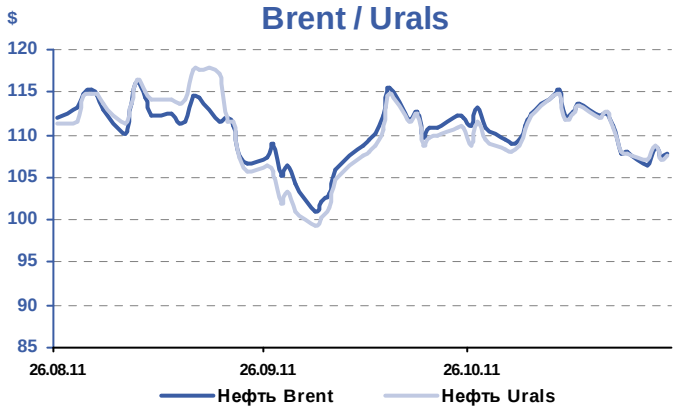
Commodities

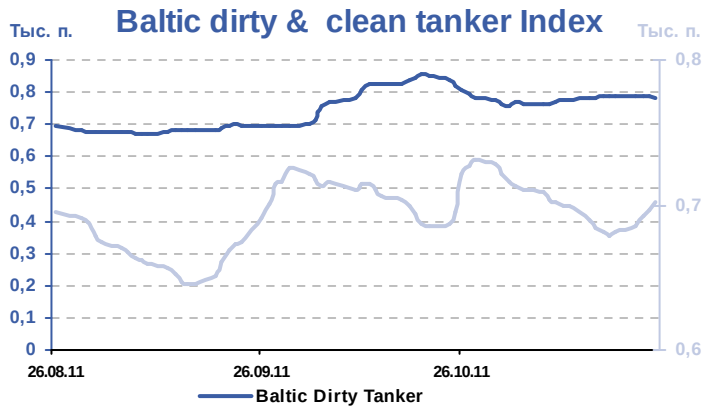












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 265,00	0,35%	-3,65%	-3,52%	-11,94%
Цинк, $/t	1 888,00	-1,36%	-2,02%	2,50%	-11,03%
Никель, $/t	17 075,00	0,29%	-5,92%	-13,54%	-24,11%
Олово, $/t	20 350,00	0,74%	-4,68%	-8,54%	-16,26%
Алюминий, $/t	2 019,00	-0,25%	-3,58%	-9,22%	-10,62%
Свинец, $/t	1 992,00	-0,65%	-1,09%	1,50%	-10,37%
Серебро, $/oz	31,86	0,43%	0,45%	-4,21%	15,48%
Золото, $/oz	1 694,32	0,12%	-1,59%	-0,66%	23,38%
Нефть Brent, $/	107,87	0,60%	0,01%	-3,69%	25,77%
Нефть Urals, $/	107,64	0,42%	-0,43%	-2,82%	27,66%

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	0,00%	0,00%	286 500		8 083
Газпром	GAZP	5,370	-3,76%	0,00%	537 000		127 127
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,00%	42 500		20 151
Лукойл	LKOH	52,700	0,00%	0,00%	263 500		44 825
НОВАТЭК	NVTK	13,040	0,00%	0,00%	130 400		39 593
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
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							
ВСМПО	VSMO	150,000		0,00%	1 950		1 729
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	167,600	0,36%	0,00%	167 600		31 949
Северсталь	CHMF	13,232	0,00%	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	2,415	-1,43%	0,00%	491 115		52 132
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
Дикси	DIXY	9,500		0,00%	570		1 185
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	0,00%	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	0,00%	0,00%	35 625		2 265
Уголь							
Распадская	rasp	2,960	-1,33%	0,00%	59 200		2 311
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	117,000	1,66%	
Башнефть	AK6		EUR	175,000	0,00%	
ТГК-3	AOMD		USD	6,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	27,490	0,22%	11 703,36
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,287	4,43%	
Бурятзолото	BYT		EUR	17,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	22,810	-0,31%	10 714,02
Газпром	GAZ		EUR	7,990	0,31%	794,99
Иркутскэнерго	IRK		EUR	19,050	-2,56%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,850	-16,18%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	52,050	-0,86%	112 641,80
Лукойл	LUK		EUR	39,050	-0,64%	127,96
МТС	MKY	5	EUR	10,960	-0,86%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,551	1,13%	
НорНикель	NNIA		EUR	12,250	0,25%	188,73
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	136,200	1,72%	38 010,76
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,540	-1,31%	215 097,30
ОМЗ	OMZD		USD	0,650	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,100	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,300	3,59%	163,62
Ростелеком	RTL		EUR	21,500	-3,37%	
Газпромнефть	SCF		EUR	15,850	0,16%	50,60
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,420	0,22%	0,64
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,726	-0,80%	27,89
АФКСистема	SSA	1	USD	17,500	0,00%	15 020,72
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,072	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,480	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	34,425	0,97%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	214,290	0,00%	
ВТБ	VTBR		USD	3,900	-0,64%	31 334,78
Возрождение	VZY		EUR	23,700	7,73%	

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.