ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

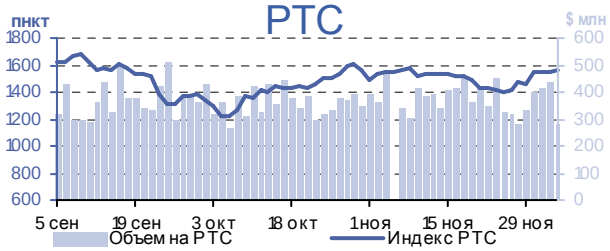
6 декабря 2011г.

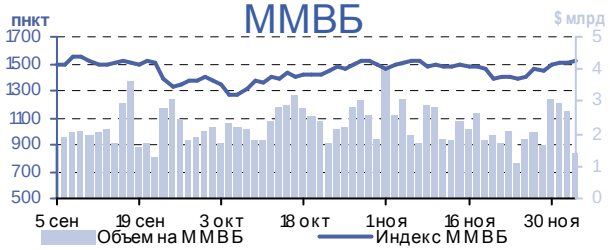
Комментарий по рынку акций

Вчера фондовые индексы США завершили торговую сессию умеренным ростом. Оптимизм в первой половине сессии был связан с договоренностью между Францией и Германией по вопросу внесения поправок в договор ЕС для обеспечения долгосрочной стабильности европейского валютного блока. На этом фоне доходность 10-летних облигаций Италии опустилась до 5,91%, Испании – 5,07%. Показательно, что при этом инвесторы проигнорировали негативную макростатистику: активность в непроизводственном секторе (ISM) в ноябре замедлилась до 52,0 п. против 52,9 п. в октябре. В свою очередь Министерство торговли США сообщило о снижении объема

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



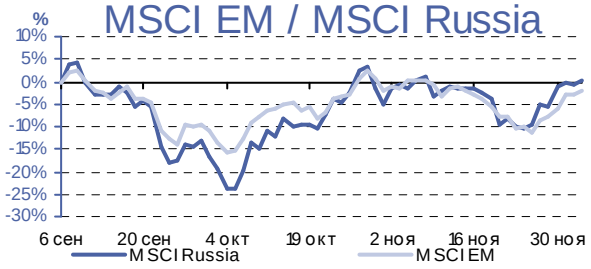


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 559,28	0,89%	5,70%	0,63%	-8,89%
Индекс ММВБ	1 517,89	0,80%	3,52%	1,11%	-9,25%
FTSE	5 567,96	0,28%	4,80%	0,74%	-3,51%
S&P 500	1 257,08	1,03%	5,41%	0,31%	2,78%
Dow Jones Avg.	12 097,83	0,65%	4,99%	0,96%	6,47%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Транснефть, п.	1622,8550	2,07%	66,28%	19,77%
Башнефть	47,9067	1,49%	-6,07%	1,93%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Акрон	46,3000	-9,22%	17,22%	-0,43%
ОАО СИТРОНИКС	0,0100	-4,76%	-15,90%	-50,00%
Сбербанк	2,9040	-1,56%	10,63%	-17,26%
ОАО Группа ЛСР	18,6000	-0,80%	-4,12%	-49,53%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	966,19	0,56%	-2,37%	-14,23%
Индекс MSCI BRAZIL	3029,15	2,02%	-0,55%	-17,88%
Индекс MSCI RUSSIA	832,88	0,68%	1,51%	-8,56%
Индекс MSCI INDIA	390,65	-0,57%	-9,65%	-28,03%
Индекс MSCI CHINA	55,29	0,40%	-2,83%	-18,22%

Обзор рынка

Вчера фондовые индексы США завершили торговую сессию умеренным ростом. Оптимизм в первой половине сессии был связан с договоренностью между Францией и Германией по вопросу внесения поправок в договор ЕС для обеспечения долгосрочной стабильности европейского валютного блока. На этом фоне доходность 10-летних облигаций Италии опустилась до 5,91%, Испании – 5,07%. Показательно, что при этом инвесторы проигнорировали негативную макростатистику: активность в непроизводственном секторе (ISM) в ноябре замедлилась до 52,0 п. против 52,9 п. в октябре. В свою очередь Министерство торговли США сообщило о снижении объема производственных заказов в стране в октябре на 0,4% после снижения на 0,1% месяцем ранее. Однако ключевым моментом для изменения настроений игроков под закрытие сессии стали слухи о том, что агентство S&P готовится сделать пересмотр рейтингов ряда ведущих европейских государств.

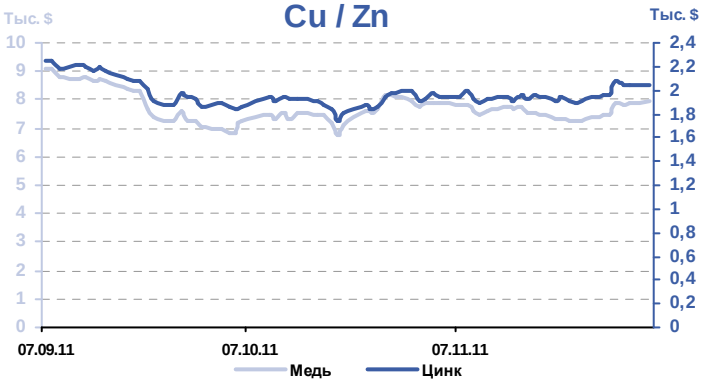
Действительно, после закрытия торгов в Америке агентство S&P поместило рейтинги 15 из 17 стран еврозоны в список на пересмотр в сторону понижения. Рейтинговое агентство заявило, что пересмотр может быть завершен по итогам саммита ЕС 9 декабря. То есть часы в мине замедленно действия, запущены. Это нервирует инвесторов, заставляя их избавляться от рискованных активов. Тем не менее, вчера лидеры Франции и Германии твердо заявили о согласовании совместной программы, предполагающей ужесточение фискальных правил в Европе, предусматривающей в частности, введение автоматических штрафных санкций для стран, превысивших 3%-ный порог по дефициту госбюджета. В среду глава Европейского совета Херман Ван Ромпей должен будет рассмотреть эту программу.

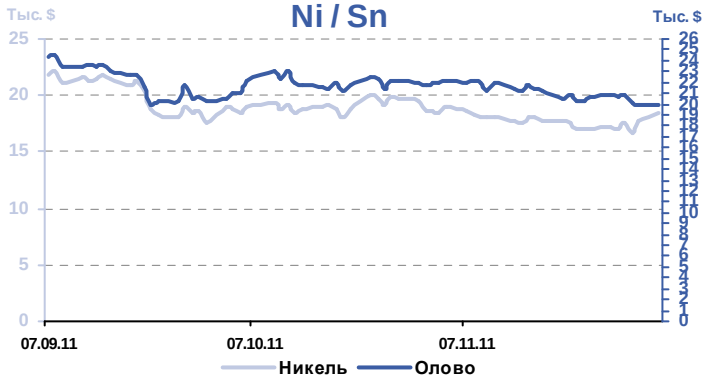
По факту решения агентства S&P валютная пара EUR/USD обвалилась к отметке 1,3370. Котировки нефти марки Brent также съехали к уровню $109,2/барр. Промышленные металлы теряют в цене 1,5-2,5%. Азиатские биржи показывают снижение: MSCI Asia -1,77%.

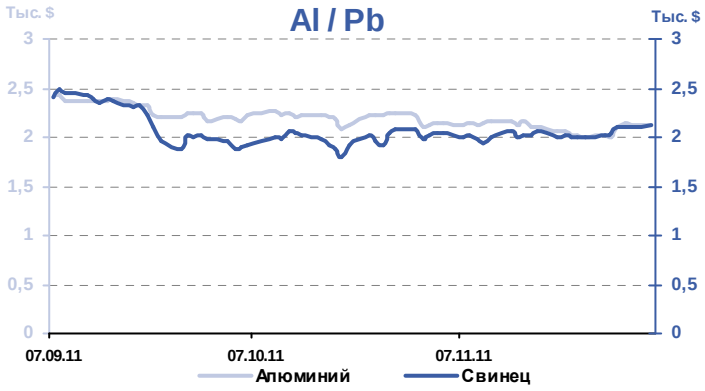
На таком негативном внешнем фоне открытие торгов на наших биржах во вторник мы увидим в красной зоне. То есть индекс ММВБ опять вернется к своему диапазону поддержки на 1500-1495 п., чуть ниже сильный уровень находится на 1485 п. Торги последних дней показали, что у игроков не было большого желания толкать рынок выше текущих уровней. Тем более что по индексу ММВБ прослеживается сильное сопротивление на 1521 п., равно как и по фьючерсу РТС на 157 тыс. п. Что дальше? Стоит ли ждать падения? Безусловно, под давлением негативных новостей сегодня в первой половине дня мы будем снижаться, но очевидно, что сдавать позиции без боя «быки» не намерены, поэтому в случае сохранения ближайших уровней поддержки мы увидим новые покупки. В любом случае, для инвесторов гораздо важнее конструктивные итоги предстоящего саммита ЕС, чем массовое снижение кредитных рейтингов европейских государств, которое кардинально все равно ничего не изменит на долговом рынке еврозоны.

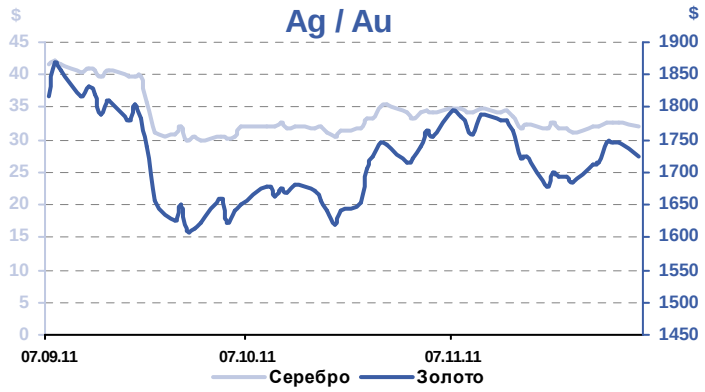
Сегодня в 14-00 выходят пересмотренные данные по объему ВВП Еврозоны за 3 квартал. В это же время ждем статистики из Великобритании по объемам розничных продаж за ноябрь. В 15-00 Германия опубликует данные по объему промышленных заказов за октябрь

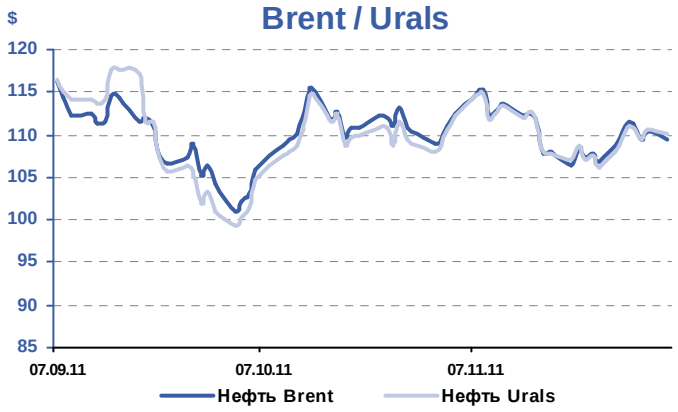
Commodities

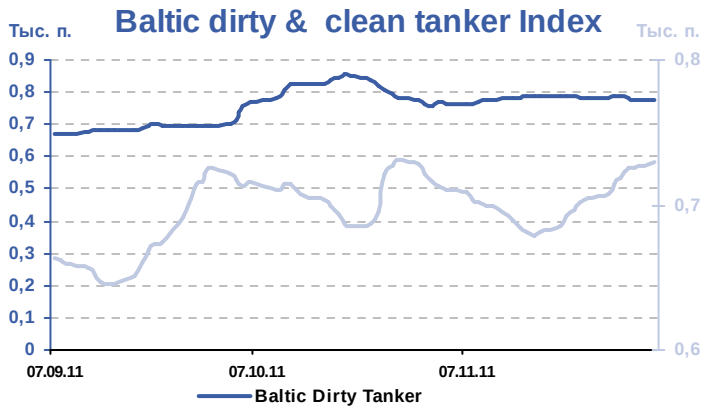












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 940,00	0,63%	5,94%	0,89%	-9,46%
Цинк, $/t	2 040,00	-0,58%	4,24%	4,62%	-8,07%
Никель, $/t	18 505,00	4,31%	7,71%	-2,09%	-21,59%
Олово, $/t	20 000,00	0,03%	-4,08%	-9,30%	-21,49%
Алюминий, $/t	2 130,00	0,00%	5,13%	-0,47%	-7,59%
Свинец, $/t	2 120,00	0,47%	4,69%	3,52%	-9,83%
Серебро, $/oz	32,13	-1,40%	0,11%	-5,92%	6,58%
Золото, $/oz	1 723,00	-1,36%	0,62%	-1,80%	21,02%
Нефть Brent, $/	109,50	-0,77%	0,13%	-2,71%	20,90%
Нефть Urals, $/	110,19	-0,36%	1,30%	-1,75%	23,56%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1345,000	5,49%	0,00%	2 690		2 310
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,626	-0,53%	0,00%	32 825		39 382
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,907	1,49%	0,00%	7 186		8 152
Газпром	GAZP	5,870	0,00%	0,00%	291 000		138 964
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,00%	42 500		20 151
Лукойл	LKOH	56,300	0,00%	0,00%	674 200		47 887
НОВАТЭК	NVTK	13,040	0,00%	0,00%	130 400		39 593
Сургутнефтегаз	SNGS	0,878	0,00%	0,00%	43 900		31 367
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,540	0,00%	0,00%	54 000		4 159
Транснефть, п.	TRNFP	1622,855	2,07%	0,00%	6 491		2 523
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,530	0,00%	0,00%	18 550		2 526
МОЭСК	MSRS	0,050	0,00%	0,00%	10 394		2 422
ОГК-2	OGKB	0,027	0,00%	0,00%	7 573		894
ОГК-3	OGKC	0,029	0,00%	0,00%	15 080		1 377
ОГК-5	OGKE	0,064	0,00%	0,00%	32 000		2 264
Самараэнерго	SAGO	0,028	0,00%	0,00%	268		97
ТГК-3	MSNG	0,066	0,00%	0,00%	66 000		2 623
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%	303 752		344
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	7 959		466
Телекоммуникации							
Ростелеком, п.	RTKMP	3,250	0,00%	0,00%	65 000		789
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	28,000	0,00%	0,00%	6 972		519
Нефтекамский автозавод	nfaz	7,000	0,00%	0,00%	7 000		56
Северсталь-авто	SVAV	11,500	0,00%	0,00%	23 000		394
Силовые машины	SILM	0,193	0,00%	0,00%	9 625		1 676
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	150,000	0,00%	0,00%	1 950		1 729
Мечел	MTLR	10,900	0,00%	0,00%	5 450		4 537
НЛМК	NLMK	2,100	0,00%	0,00%	21 000		12 586
НорНикель	GMKN	179,000	0,00%	0,00%	39 022		34 122
Северсталь	CHMF	13,126	0,00%	0,00%	26 252		13 227
СТЗ	SVTZ	4,200	0,00%	0,00%	24 800		202
ЧТПЗ	CHEP	2,100	0,00%	0,00%	10 500		992
Банки							
Возрождение	VZRZ	21,000	0,00%	0,00%	21 000		499
Сбербанк	SBER	2,904	-1,56%	0,00%	552 360		62 688
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,630	-0,61%	0,00%	200 066		1 810
Потребительский рынок							
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	10,160	0,00%	0,00%	10 160		1 267
Концерн Калина	KLNA	122,000	0,00%	0,00%	61 000		785
Разгуляй	GRAZ	0,915	0,00%	0,00%	19 082		145
Фармстандарт	PHST	70,000	0,00%	0,00%	5 040		2 479
Черкизово	GCHE	21,656	0,00%	0,00%	149 729		933
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,145	0,00%	0,00%	10 875		259
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,731	0,00%	0,00%	80 424		1 208
Уфанефтехим	UFNC	4,600	0,00%	0,00%	23 000		1 267
Уфаоргсинтез	UFOS	2,800	0,00%	0,00%	28 000		274
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,320	0,00%	0,00%	28 800		298
Другие сектора							
ПИК	pikk	2,640	0,00%	0,00%	5 000		1 302

Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	46,300	-9,22%	0,00%	185 663		2 208
Уголь							
Распадская	rasp	3,250	0,00%	0,00%	254 600		2 538

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	120,590	0,37%	
Башнефть	AK6		EUR	177,000	8,33%	3,68
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,200	0,00%	8,47
ТГК-3	AOMD		USD	6,700	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	33,490	2,98%	10 918,19
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,702	5,26%	1,30
Бурятзолото	BYT		EUR	17,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	23,600	-2,07%	49 959,94
Газпром	GAZ		EUR	8,889	1,02%	1 247,90
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,020	0,00%	0,31
Иркутскэнерго	IRK		EUR	21,100	-7,25%	8,37
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,900	1,75%	3,10
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	53,60
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,250	0,54%	110 780,90
Лукойл	LUK		EUR	41,620	0,22%	456,70
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,950	0,88%	4 128,25
МТС	MBT	5	USD	16,360	2,25%	52 119,76
МТС	MKY	5	EUR	12,230	2,04%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,151	-1,75%	20,91
Мечел	MTL	3	USD	11,740	5,58%	39 037,21
НорНикель	NILSY	1	USD	17,950	3,16%	1 791,83
НорНикель	NNIA		EUR	13,425	2,72%	49,25
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	149,300	-3,24%	128 523,50
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,524	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,900	0,85%	51,42
Газпром	OGZD		USD	12,110	1,59%	450 622,50
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	31,810	1,47%	583,74
Ростелеком	RTL		EUR	22,800	-0,87%	5,98
Газпромнефть	SCF		EUR	16,605	-1,60%	10,04
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,081	-1,38%	0,71
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,068	0,92%	11,36
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,530	1,10%	493,26
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,350	-1,58%	65,54
АФКСистема	SSA	1	USD	19,360	-0,72%	8 719,75
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,824	0,44%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	16,570	-0,03%	
СТЗ	SVY		EUR	28,260	-0,28%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	222,270	-5,42%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,810	2,34%	31 426,22
ВТБ	VTBR		USD	4,600	1,03%	44 367,78
Возрождение	VZY		EUR	23,700	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.