ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

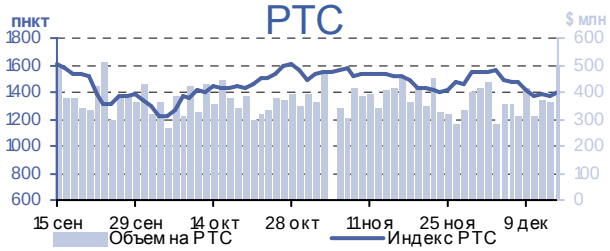
16 декабря 2011г.

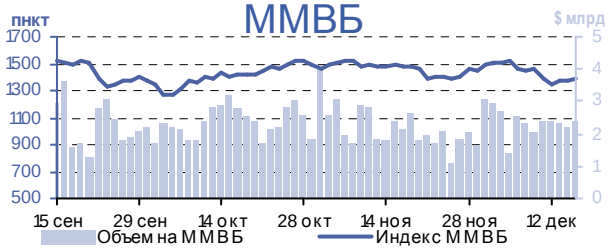
Комментарий по рынку акций

По итогам торгов в четверг фондовые индексы США показали небольшой подъем. Прервать череду снижения рынка помогла неплохая макростатистика, а также сильный квартальный отчет компании по доставке грузов и почты FedEx. В III квартале дефицит платежного баланса США снизился до $110,3 млрд. (2,9% от ВВП против 3,3% во II квартале). В декабре индекс деловой активности ФРБ Филадельфии поднялся до 10,3 п. против прогноза 5 п. На прошлой неделе количество обращений за пособием по безработице сократилось до самой низкой отметки с мая 2008 года (366 тыс.). Наконец, индекс производственной активности ФРБ Нью-Йорка поднялся до 9,5 п.

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





Значение основных индексов

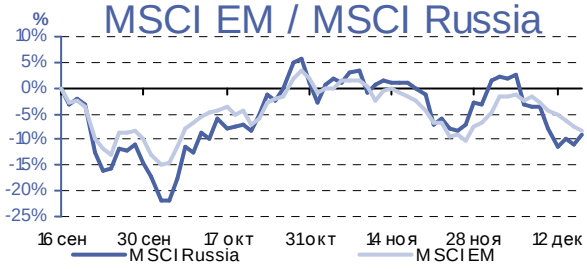
	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 395,28	1,87%	-5,31%	-8,25%	-20,62%
Индекс ММВБ	1 393,61	1,54%	-4,31%	-6,04%	-16,56%
FTSE	5 400,85	0,63%	-1,51%	-1,96%	-8,18%
S&P 500	1 215,75	0,32%	-1,51%	-1,71%	-1,58%
Dow Jones Avg.	11 868,81	0,38%	-1,07%	-0,31%	3,59%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ВСМПО	172,0000	14,67%	20,98%	45,15%
Магнит	87,0000	1,09%	-13,26%	-30,79%
ПИК	2,3000	0,88%	-14,81%	-49,45%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-2	0,0001	-27,27%	-33,33%	-71,43%
МСЗ, Электросталь	85,0000	-19,05%	-22,73%	-68,52%
Мечел	9,3500	-14,22%	-27,52%	-68,83%
ОАО АФК Система	0,7730	-14,11%	-14,11%	-19,14%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	896,68	-0,80%	-6,60%	-19,96%
Индекс MSCI BRAZIL	2789,73	0,39%	-7,64%	-22,55%
Индекс MSCI RUSSIA	738,94	2,27%	-9,82%	-20,00%
Индекс MSCI INDIA	353,85	-0,07%	-10,91%	-33,08%
Индекс MSCI CHINA	51,58	-2,03%	-6,00%	-22,35%

Обзор рынка

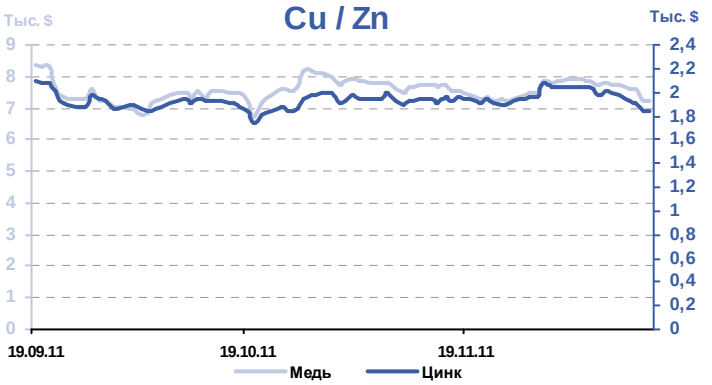
По итогам торгов в четверг фондовые индексы США показали небольшой подъем. Прервать череду снижения рынка помогла неплохая макростатистика, а также сильный квартальный отчет компании по доставке грузов и почты FedEx. В III квартале дефицит платежного баланса США снизился до $110,3 млрд. (2,9% от ВВП против 3,3% во II квартале). В декабре индекс деловой активности ФРБ Филадельфии поднялся до 10,3 п. против прогноза 5 п. На прошлой неделе количество обращений за пособием по безработице сократилось до самой низкой отметки с мая 2008 года (366 тыс.). Наконец, индекс производственной активности ФРБ Нью-Йорка поднялся до 9,5 п. (максимальный уровень за последние 7 месяцев) против 0,6 в ноябре. Таким образом, постепенное снижение безработицы приводит к росту потребительских расходов, что в итоге позитивно сказывается на динамике производства.

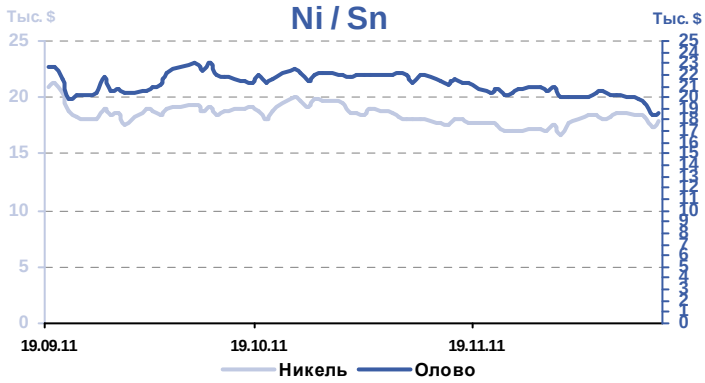
Прекращение падения фондовых индексов вчера шло параллельно с остановкой снижения пары EUR/USD. Найдя вчера поддержку на уровне 1,2950, курс евро пошел на укрепление, чему способствовал успешный аукцион по размещению испанских облигаций. Сегодня утром EUR/USD торгуется возле 1,3030, имея в качестве поддержки позитивный ход торгов азиатских фондовых рынках (MSCI Asia +1,1%). После закрытия торгов в Штатах агентство Fitch снизило долгосрочные рейтинги таких крупных банков, как Bank of America, Goldman Sachs, Barclays, BNP Paribas, Credit Suisse, Deutsche Bank. Однако настроения американских фьючерсов от этого не испортились: S&P +0,45%.

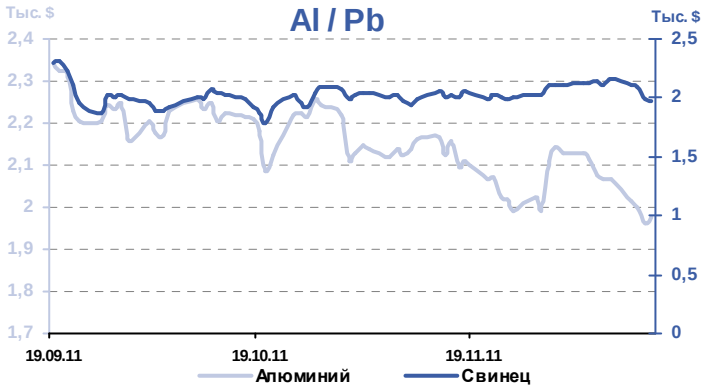
В пятницу мы ждем нейтрального открытия торгов на нашем рынке акций. Вчера наши индексы показали рост, сегодня стоит ждать небольшого продолжения. Но долгим ли оно будет? В эту пятницу истекает срок действия опционов и фьючерсов на индексы и акции (Quadruple Witching Day), поэтому позитивная динамика торгов во фьючерсах может быть обманчивой. Думаю, сегодня мы не увидим активных торгов, а индекс ММВБ в своем росте найдет сопротивление на отметке 1406 п. Фьючерс РТС в этом случае стоит ждать возле уровня 139500 п. Слом нисходящего движения последних дней произойдет, если индекс ММВБ по итогам сегодняшних торгов пробьет и закрепится выше отметки 1410 п. Поддержкой сегодня будет служить уровень 1360 п. Все позиции в бумагах, купленных на этой недели мы держим. С середины следующей недели западные инвесторы будут уходить с бирж на Рождественские праздники, формируя позиции на следующий год. Поэтому окончание этой и начало следующей недели будет для рынков решающими.

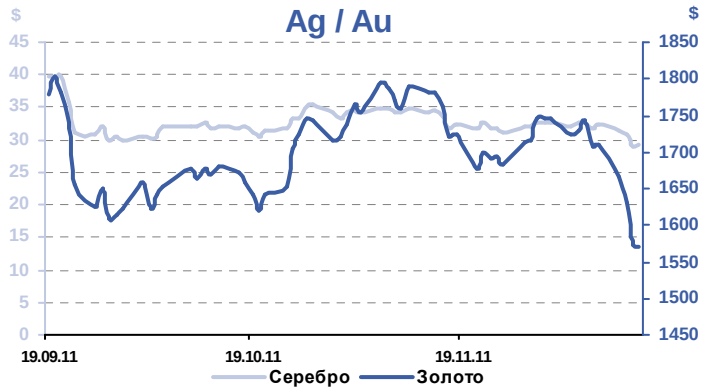
Сегодня в 14-00 ждем данных из Еврозоны по торговому балансу за октябрь. В 17-30 в США будут опубликованы данные индекса потребительских цен (CPI) за ноябрь (прогноз: рост на +0,1%).

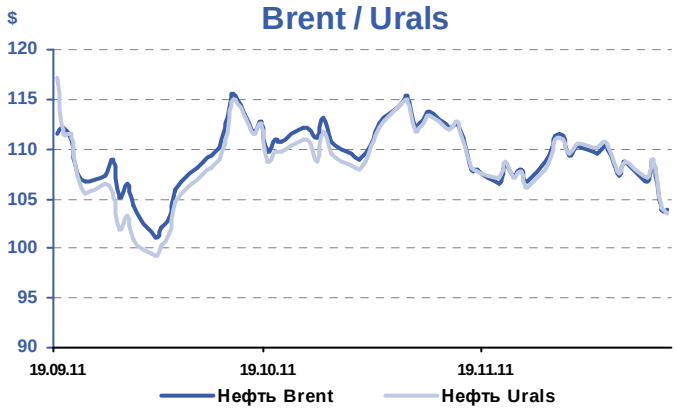
Commodities

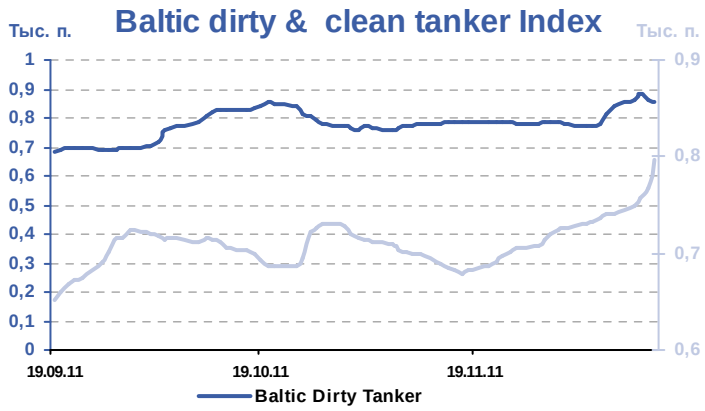












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 211,00	0,01%	-6,47%	-6,71%	-20,71%
Цинк, $/t	1 845,50	0,03%	-7,03%	-5,84%	-18,27%
Никель, $/t	17 895,00	2,84%	-2,21%	-1,35%	-27,11%
Олово, $/t	18 600,00	0,40%	-7,69%	-14,29%	-27,98%
Алюминий, $/t	1 975,00	0,66%	-4,36%	-8,44%	-14,91%
Свинец, $/t	1 975,00	-1,15%	-6,09%	-2,71%	-18,56%
Серебро, $/oz	29,16	0,85%	-8,02%	-13,61%	1,24%
Золото, $/oz	1 570,52	-0,22%	-8,07%	-10,94%	13,74%
Нефть Brent, $/	103,83	-0,13%	-3,30%	-6,53%	13,62%
Нефть Urals, $/	103,54	-0,47%	-3,75%	-6,55%	15,36%

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	0,00%	0,00%	2 690		2 310
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,000	15,38%	0,00%	2 553 750		40 492
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	44,750	-0,56%	0,00%	1 602 105		7 615
Газпром	GAZP	5,070	0,00%	0,00%	383 750		120 025
Газпромнефть	SIBN	4,250	-3,41%	0,00%	85 000		20 151
Лукойл	LKOH	51,200	0,00%	0,00%	256 000		43 549
НОВАТЭК	NVTK	12,330	0,00%	0,00%	101 724		37 438
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	0,00%	0,00%	6 491		2 523
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,100	0,00%	0,00%	5 500		1 147
Иркутскэнерго	IRGZ	0,530	0,00%	0,00%	5 300		2 526
МОЭСК	MSRS	0,049	0,00%	0,00%	12 318		2 394
ОГК-2	OGKB	0,025	0,00%	0,00%	5 000		818
ОГК-3	OGKC	0,029	0,00%	0,00%	6 867		1 363
ОГК-5	OGKE	0,060	-7,12%	0,00%	5 313		2 122
Самараэнерго	SAGO	0,028	0,00%	0,00%	268		97
ТГК-3	MSNG	0,060	-4,00%	0,00%	18 000		2 385
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%	2 027		258
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	3 595		391
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	6,565	0,00%	0,00%	65 650		13 566
Ростелеком	RTKM	4,410	-3,50%	0,00%	6 615		12 980
Ростелеком, п.	RTKMP	3,194	0,00%	0,00%	11 498		776
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	28,000	0,00%	0,00%	6 972		519
Нефтекамский автозавод	nfaz	6,000	0,00%	0,00%	25 100		48
Северсталь-авто	SVAV	9,700	0,00%	0,00%	8 943		332
Силовые машины	SILM	0,193	0,00%	0,00%	9 625		1 676
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	172,000	14,67%	0,00%	1 269 200		2 018
Мечел	MTLR	9,350	-14,22%	0,00%	343 549		3 892
НЛМК	NLMK	2,100	0,00%	0,00%	21 000		12 586
НорНикель	GMKN	158,500	0,00%	0,00%	158 500		30 214
Полиметалл	PMTL	16,440	0,00%	0,00%	150 632		6 566
Северсталь	CHMF	12,500	0,00%	0,00%	12 500		12 596
СТЗ	SVTZ	4,000	0,00%	0,00%	8 000		193
ЧТПЗ	CHEP	2,100	0,00%	0,00%	10 500		992
Банки							
Возрождение	VZRZ	18,000	-11,33%	0,00%	36 450		427
Сбербанк	SBER	2,550	-2,11%	0,00%	505 500		55 694
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,414	-2,01%	0,00%	121 190		1 570
Дальневосточное МП	FESH	0,250	0,00%	0,00%	12 500		738
НМТП	NMTP	0,100		0,00%	38 000		1 926
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	38,250	0,00%	0,00%	19 125		5 803
Дикси	DIXY	9,350	-8,78%	0,00%	195 501		1 166
Концерн Калина	KLNA	125,000	0,00%	0,00%	125 000		805
Магнит	MGNT	87,000	1,09%	0,00%	2 280 351		7 741
Разгуляй	GRAZ	0,830	0,00%	0,00%	27 390		130
Седьмой континент	SCON	5,000	0,00%	0,00%	5 000		375
Фармстандарт	PHST	54,750	-0,99%	0,00%	161 725		2 069
Черкизово	GCHE	21,656	0,00%	0,00%	149 729		933
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,130	0,00%	0,00%	13 000		232

Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,799	0,00%	0,00%	5 754		1 288
Уфанефтехим	UFNC	4,500	0,00%	0,00%	45 000		1 239
Уфаоргсинтез	UFOS	2,700	0,00%	0,00%	27 000		264
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	85,000	-19,05%	0,00%	8 500		121
ПИК	pikk	2,300	0,88%	0,00%	27 690		1 134
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,850	-1,85%	0,00%	33 422		1 900
Уголь							
Распадская	rasp	3,050	-7,58%	0,00%	975 600		2 381

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	100,600	-0,37%	
Башнефть	AK6		EUR	166,140	-0,05%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,200	11,11%	3,20
ТГК-3	AOMD		USD	5,960	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	28,360	0,14%	13 394,23
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,201	-7,29%	2,20
Бурятзолото	BYT		EUR	18,100	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	20,550	0,00%	19 598,86
Газпром	GAZ		EUR	8,277	5,51%	1 009,69
Иркутскэнерго	IRK		EUR	17,650	-2,49%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,600	41,18%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	51,250	2,40%	183 458,00
Лукойл	LUK		EUR	39,405	2,71%	441,19
Лукойл	LUKOY	1	USD	51,280	3,08%	3 682,65
МТС	MBT	5	USD	14,730	2,01%	52 558,97
МТС	MKY	5	EUR	11,245	1,58%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,608	0,46%	4,68
Мечел	MTL	3	USD	8,680	-3,56%	37 430,80
НорНикель	NILSY	1	USD	15,620	1,69%	469,07
НорНикель	NNIA		EUR	12,010	1,78%	442,49
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	127,000	3,67%	89 683,95
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,524	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,675	3,18%	
Газпром	OGZD		USD	10,710	4,79%	330 501,70
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,610	-1,41%	2 087,76
Ростелеком	RTL		EUR	20,400	0,00%	
Газпромнефть	SCF		EUR	16,370	1,11%	163,73
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,229	0,81%	13,92
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,870	0,00%	0,36
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,070	0,40%	1 787,15
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,090	1,76%	330,53
АФКСистема	SSA	1	USD	16,700	-0,12%	11 136,66
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,100	0,70%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	11,565	-2,98%	
СТЗ	SVY		EUR	24,005	-0,60%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	0,00%	120,00
Ukrnafta	UKAA		EUR	260,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	9,490	-1,25%	16 291,74
ВТБ	VTBR		USD	3,815	2,97%	34 688,72
Возрождение	VZY		EUR	20,000	-5,66%	

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.