ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

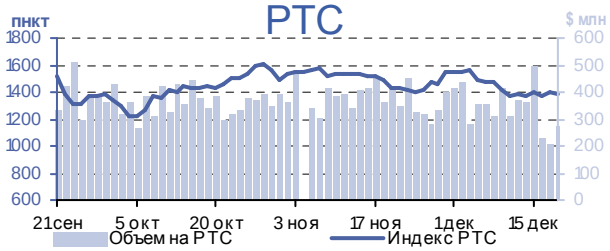
22 декабря 2011г.

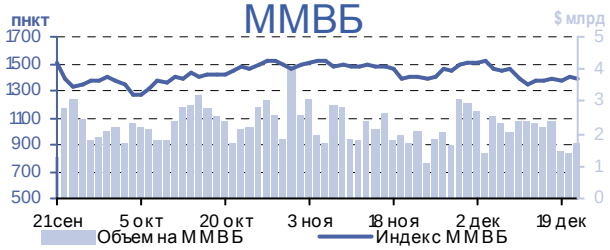
Комментарий по рынку акций

В среду ведущие американские фондовые индексы завершили торги в разнополярных зонах. Все первоначальные потери, связанные с очередной встряской на долговом рынке еврозоны, к концу сессии были отыграны в индексах S&P-500 и Dow Jones. А вот индекс Nasdaq так и не смог выйти в позитивную зону, попав под давление продаж в связи со слабой отчетностью компании Oracle. Таким образом, можно констатировать, что, несмотря на имевший место новостной негатив заокеанские инвесторы не стали раскручивать эту тему и если уже активно не росли, то хотя бы постарались отойти от ближайших уровней поддержки.

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



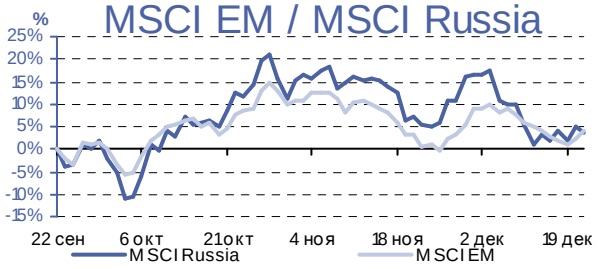


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 382,50	-0,95%	0,94%	-3,40%	-21,27%
Индекс ММВБ	1 385,17	-1,75%	0,93%	-1,19%	-17,25%
FTSE	5 389,74	-0,55%	0,43%	3,51%	-9,44%
S&P 500	1 243,72	0,19%	2,63%	4,69%	-0,87%
Dow Jones Avg.	12 107,74	0,03%	2,40%	5,34%	4,98%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Газпромнефть	4,4500	3,01%	4,71%	-6,32%
Возрождение	18,5000	2,78%	-20,26%	-57,71%
Сбербанк	2,5550	2,00%	4,29%	-26,47%
ОГК-2	0,0252	0,80%	-14,86%	-53,33%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	916,20	1,71%	0,75%	-18,51%
Индекс MSCI BRAZIL	2835,34	-1,23%	0,65%	-21,67%
Индекс MSCI RUSSIA	737,21	-1,11%	-3,25%	-20,26%
Индекс MSCI INDIA	356,86	3,81%	-3,24%	-34,06%
Индекс MSCI CHINA	52,81	2,10%	1,05%	-20,18%

Обзор рынка

В среду ведущие американские фондовые индексы завершили торги в разнополярных зонах. Все первоначальные потери, связанные с очередной встряской на долговом рынке еврозоны, к концу сессии были отыграны в индексах S&P-500 и Dow Jones. А вот индекс Nasdaq так и не смог выйти в позитивную зону, попав под давление продаж в связи со слабой отчетностью компании Oracle. Таким образом, можно констатировать, что, несмотря на имевший место новостной негатив заокеанские инвесторы не стали раскручивать эту тему и если уже активно не росли, то хотя бы постарались отойти от ближайших уровней поддержки.

Позиции евро во второй половину недели не выглядят сильно (EUR/USD 1,3045). Здесь есть как сильный наклонной уровень сопротивления на 1,32, так и сообщение о том, что Греции пока так и не удается полностью решить проблему списания 50% своей задолженности по облигациям перед частными кредиторами. Понижение кредитного рейтинга Венгрии со стороны агентства Standard & Poor's в среду «мусорного» уровня (BB+/B, с негативным прогнозом) не добавляет оптимизма участникам рынка.

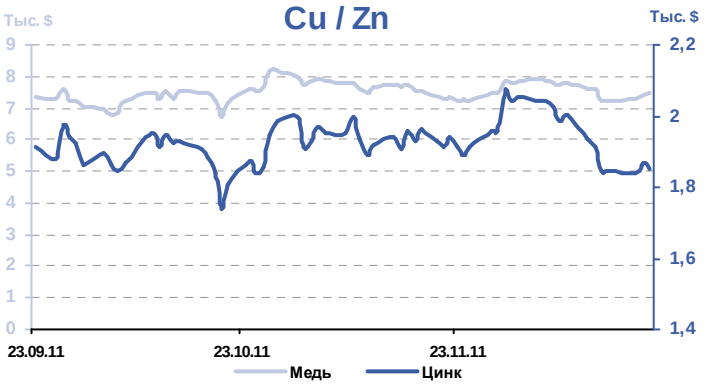
Цены на нефть марки Brent вчера вечером поднялись к отметке $108/барр. Котировки «черного золота» начали рост еще до выхода данных от Министерства энергетики США, сообщившего о том, что коммерческие запасы нефти на прошлой неделе рухнули на 10,57 млн. барр.; запасы дистиллятов также снизились на -2,4 млн. барр. Таким образом, в нефтяных котировках еще есть запас хода на рост до конца этого года.

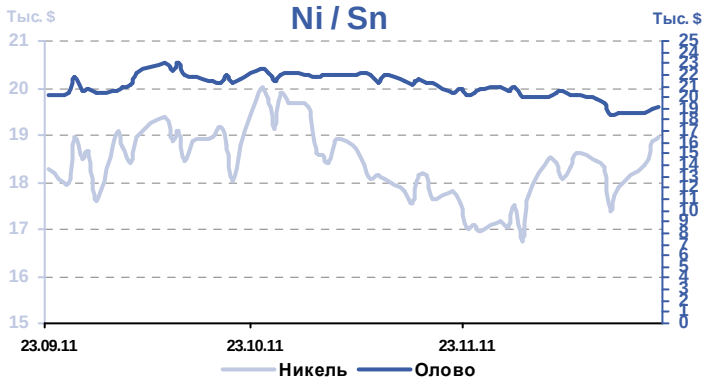
Сегодня утром мы видим снижение интереса к покупкам рисковых активов на фондовых рынках в Азии (MSCI Asia: -0,74%). Китайский индекс Shanghai Composite (-0,44%) сегодня плавно опустился на минимальные отметки с середины марта 2009 года. Если бы индекс ММВБ вернулся к этим датам, его значение было бы около 800 п.

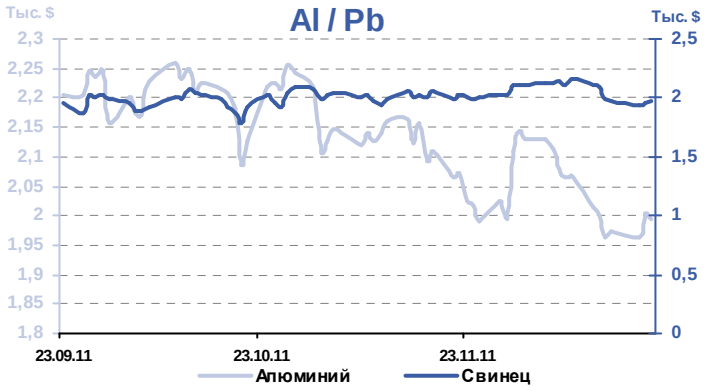
Открытие торгов в четверг на наших биржах мы ожидаем увидеть в позитивной зоне. Вчера вечером индекс ММВБ завершил день возле минимальных дневных уровней. А значит, давление продаж мы можем ощущать в первой половине сегодняшней сессии. Выходить ли из акций на локальных просадках индекса? Мы не видим в этом смысла, поскольку акции и так очень дешевы, а конец года совсем близок. Значит, возможна «рисовка» котировок под закрытие квартала и года.

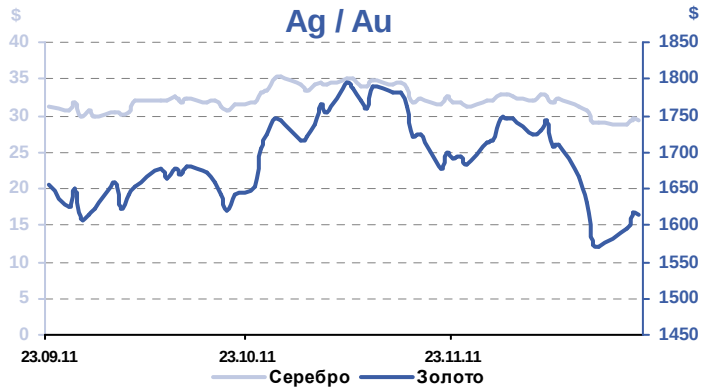
Важно также, что с середины декабря мы видим, что на графике индекса ММВБ каждые следующие дневные минимумы и максимумы оказываются выше предыдущих. Поэтому не столь важно, на каких уровнях сегодня остановится снижение индекса ММВБ, главное – это тот уровень, на котором мы закроем сессию. На наш взгляд позитив на нашем рынке сегодня будет преобладать и индекс ММВБ имеет все шансы завершить день возле уровня 1404-1412 п. В этом случае фьючерс РТС вернется к отметке 139500 п. Большой объем статистики из Штатов выходящий вечером внесет свою долю нестабильности в биржевые котировки, но в целом мы рассчитываем увидеть позитивные данные.

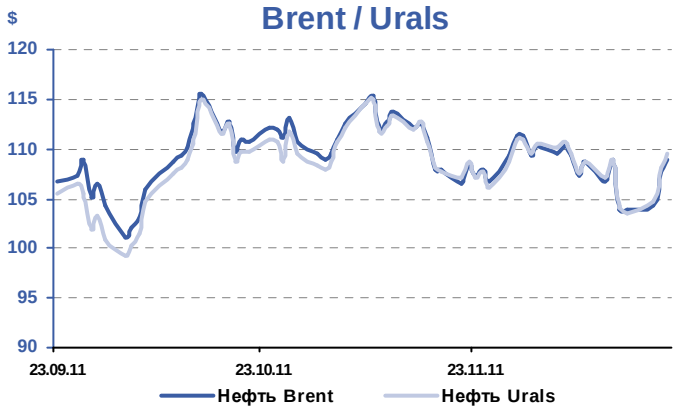
Commodities

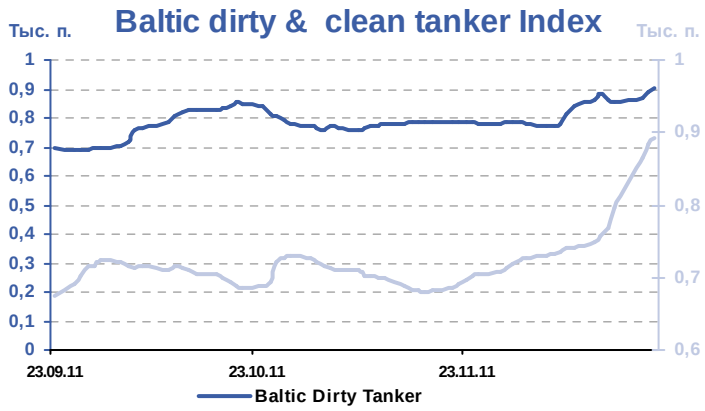












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 455,00	0,61%	3,40%	1,71%	-20,40%
Цинк, $/t	1 851,00	-0,86%	0,33%	-4,59%	-20,56%
Никель, $/t	18 975,00	0,58%	9,05%	8,12%	-22,94%
Олово, $/t	19 200,00	1,05%	3,64%	-7,69%	-28,60%
Алюминий, $/t	1 994,00	-0,45%	1,63%	-3,69%	-18,11%
Свинец, $/t	1 966,00	0,36%	-1,60%	-2,65%	-19,23%
Серебро, $/oz	29,39	-0,56%	1,67%	-10,18%	0,19%
Золото, $/oz	1 615,23	-0,04%	2,62%	-4,98%	16,57%
Нефть Brent, $/	108,93	1,21%	4,77%	0,37%	16,98%
Нефть Urals, $/	109,49	1,29%	5,25%	0,72%	20,45%

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	0,00%	0,00%	2 553 750		40 492
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,500	0,00%	0,00%	108 750		7 402
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	0,00%	130 000		123 102
Газпромнефть	SIBN	4,450	3,01%	0,00%	222 500		21 099
Лукойл	LKOH	51,200	0,00%	0,00%	256 000		43 549
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,540	0,00%	0,00%	54 000		4 159
Транснефть, п.	TRNFP	1500,000	0,00%	0,00%	105 000		2 332
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	0,80%	0,00%	75 500		825
ОГК-3	OGKC	0,029	0,00%	0,00%	6 867		1 363
ОГК-5	OGKE	0,060	0,00%	0,00%	5 313		2 122
ТГК-3	MSNG	0,060	0,00%	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, 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
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,250	0,00%	0,00%	12 500		125
ВСМПО	VSMO	172,000	0,00%	0,00%	1 269 200		2 018
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	18,500	2,78%	0,00%	27 750		439
Сбербанк	SBER	2,555	2,00%	0,00%	1 041 523		55 155
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,412	0,00%	0,00%	162 070		1 568
НМТП	NMTP	0,100	0,00%	0,00%	38 000		1 926
Потребительский рынок							
Дикси	DIXY	9,350	0,00%	0,00%	195 501		1 166
Магнит	MGNT	85,000	0,00%	0,00%	37 400		7 563
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	53,020	0,00%	0,00%	5 302		2 004
Черкизово	GCHE	18,000	0,00%	0,00%	18 000		775
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	0,00%	0,00%	8 500		121
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,200	0,00%	0,00%	20 227		1 869

Уголь

Распадская	rasp	3,240	0,00%	0,00%	64 800		2 530
УК Южный Кузбасс	UKUZ	51,250	0,00%	0,00%	51 250		1 851

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	104,000	3,34%	
Башнефть	AK6		EUR	162,650	-1,00%	
ТГК-3	AOMD		USD	5,960	0,00%	70,85
Татнефть	ATAD		USD	28,490	-0,56%	6 066,34
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,449	-1,29%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,001	0,00%	
X5	FIVE		USD	21,700	4,13%	15 312,59
Газпром	GAZ		EUR	8,188	-0,68%	947,55
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,013	18,18%	0,29
Иркутскэнерго	IRK		EUR	14,800	-13,70%	12,70
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,500	-3,85%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	3,08%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,400	-20,00%	
Лукойл	LKOD		USD	52,050	-0,19%	149 612,80
Лукойл	LUK		EUR	39,725	-0,35%	281,26
Лукойл	LUKOY	1	USD	52,450	0,44%	7 238,17
МТС	MBT	5	USD	14,740	-1,01%	31 115,47
МТС	MKY	5	EUR	11,230	0,27%	4,52
ТГК-3	MRO		EUR	4,618	0,50%	0,45
Мечел	MTL	3	USD	8,350	-2,34%	29 199,80
НорНикель	NILSY	1	USD	15,480	0,52%	176,65
НорНикель	NNIA		EUR	11,755	0,47%	58,37
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,400	-1,03%	37 314,55
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,451	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,600	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,720	0,00%	334 799,10
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	20,00%	0,85
ПриморскоеМП	PSK		EUR	3,600	-10,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,280	-1,62%	904,41
Ростелеком	RTL		EUR	20,695	-1,33%	
Газпромнефть	SCF		EUR	17,100	1,79%	66,26
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,049	-1,18%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,763	-0,32%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,000	1,42%	64,88
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,830	-1,14%	61,85
АФКСистема	SSA	1	USD	16,900	0,84%	3 929,68
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,100	0,50%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	9,760	-3,84%	
СТЗ	SVY		EUR	21,430	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	238,000	-0,08%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	9,490	-0,84%	20 744,05
ВТБ	VTBR		USD	3,800	-2,06%	46 819,24
Возрождение	VZY		EUR	20,000	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.