

21 октября 2011 г.

Ежедневный аналитический обзор

«Ваш консультант»

Наиболее важные индексы

PTC	1423,03	-1,08%
MMB5	1418,85	-0,12%
DowJones	11541,78	+0,32%
S&P500	1215,39	+0,46%
Nikkei225	8675,60	-0,08%
НефтьBrent	109,78	+0,02%

Лидеры роста и падения прошлых торгов, %

ФСК ЕЭС	-4,35%
Распадская	-2,78%
ОГК-3	-2,94%
НЛМК	-2,32%
ОГК-4	+6,35%
Соллерс	+4,62%
Дикси	+4,75%

Внешний фон

Внешний фон на сегодня складывается **умеренно позитивный**. Американские биржи закрылись в основном в плюсе, S&P500 прибавил 0,46%, лучше рынка торговались бумаги финансового и сырьевого секторов. Биржи Азии открылись разнонаправлено, нефть марки Brent останавливается чуть выше вчерашнего уровня, фьючерсы на американские индексы торгуются в зеленой зоне. Открытие ожидаем **с гэпом вверх в пределах 1%**.

Торговые идеи на сегодня:

Сбербанк: открываем короткие позиции от 84руб. со стоп-лоссом на пробой 85руб.

Газпром: купленные по 158руб. бумаги держим с целью 168руб., стоп ставим на уровень безубыточности

Лукойл: покупаем акции при снижении в район 1680руб.

Автоваз: держим купленные от 5,2руб. акции с целью 6руб.

Новости на сегодня:

- Лидерам Германии и Франции не удалось согласовать план выхода из европейского долгового кризиса.
- Япония направит на поддержку экспортеров, страдающих от укрепившейся иены, \$52 млрд.
- Парламент Греции одобрил пакет мер бюджетной экономии.
- ЦБ РФ не планирует изменять учетную ставку
- Fitch Ratings подтвердило долгосрочные рейтинги дефолта ОАО "Синергия" в иностранной и национальной валюте на уровне «В».

Обзор торгов накануне

Торги на российских фондовых биржах в четверг открылись существенным снижением котировок, причиной тому послужил негативный внешний фон, сложившийся накануне: снижение на американском рынке, падение цен на нефть и поступающая информация о том, что европейским лидерам не удастся выработать итоговый план по спасению Европы в ближайшее воскресенье. С другой стороны, проблемы Европы уже учтены в текущих ценах, а надежда на то, что действенные меры по разрешению этих проблем будут приняты, по-прежнему сохраняется. В связи со сложившейся неопределенностью на рынке сформировался устойчивый боковой тренд.

На фоне снижающейся нефти и растущего доллара российский рынок чувствовал себя неуверенно. Металлургический сектор продолжает снижаться из-за снижения цен на промышленные металлы, Северсталь в минусе на 1,65%, НЛМК теряет 2,32%, ММК (-1,35%). Нефтегазовый сектор в незначительном плюсе, Роснефть (+0,05%), Новатэк (+0,24%), Газпром (-0,36%). Сообщение о том, что Лукойл (-0,36%) получил долю в проекте на шельфе Вьетнама, не поддержало котировки компании, акции Газпром Нефти прибавили 2,52% на новостях о выплате хороших дивидендов. Бумаги энергетических компаний снижаются, акции ФСК ЕЭС, отчитавшейся о росте чистой прибыли за первое полугодие, теряют 4,35%, Инрер РАО (-1,11%), ОГК-3 (-2,94%), Русгидро в плюсе на 0,09%.

Банковский сектор снижается, ВТБ (-1,33%), Возрождение (-1,51%), исключение — Сбербанк (+0,12%). В секторе машиностроения акции Соллерс прибавляют 4,62%, Автоваз (-0,63%). В потребительском секторе неплохо смотрятся акции Дикси (+4,75%), Мвидео (+3,51%), бумаги Аптеки 36и6 в минусе на 0,3%. Акции МТС подросли на 0,51%, очевидно, инвесторы позитивно восприняли планы руководства сделать МТС глобальным игроком рынка.

Прогноз по ходу торгов на сегодня

Мы видим, что «бычий» настрой на рынке ослабевает, при этом позитивные новости, которые могли бы поддержать покупателей, отсутствуют, а также сохраняется неопределенность вокруг решения по долговым проблемам Европы. Все это указывает на то, что инвесторы предпочтут зафиксировать прибыль перед выходными, после которых, возможно, станет ясно дальнейшее движение рынка. Пока продолжаем двигаться в боковом диапазоне. Сегодня откроемся ростом, ближайшее сопротивление 1435 пунктов по MMB5, во второй половине дня ожидаем коррекцию вниз. Важными событиями на сегодня являются данные о деловом климате в Германии и уровень госдолга в Еврозоне.

Индекс MMB5 на прошедших торгах



Фьючерс на индекс РТС на прошедших торгах



Ожидаемые сегодня события:

- **Газпром может отчитаться за 2 квартал 2011 года по МСФО**
- Состоится заседание совета директоров ОАО «ОГК-6».
- 12:00 мск — деловой климат в Германии за октябрь. Предыдущее значение - 107,5 пункта, прогноз 106,2.
- 12:00 мск — индекс оценки текущих условий в Германии за октябрь. Предыдущее значение - 117,9 пункта, прогноз 116,5.
- 12:00 мск в Германии — индекс экономических ожиданий за октябрь. Предыдущее значение - 98 пунктов, прогноз 97 пунктов.
- 12:30 мск в Великобритании - данные об объеме чистых заимствований государственного сектора за сентябрь. Предыдущее значение - 13,16 млрд фунтов стерлингов, прогноз 11,8 млрд.
- **13:00 мск в еврозоне — отношение госдолга к ВВП, предыдущее значение 85,1%.**
- Перед открытием торгов в США отчитаются Suntrust Banks Inc, Verizon Communications Inc, McDonalds Corp