ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

# Ежедневный обзор рынка акций

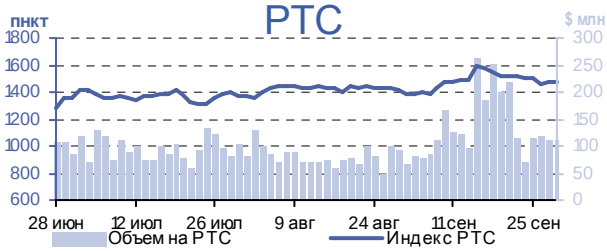
1 октября 2012г.

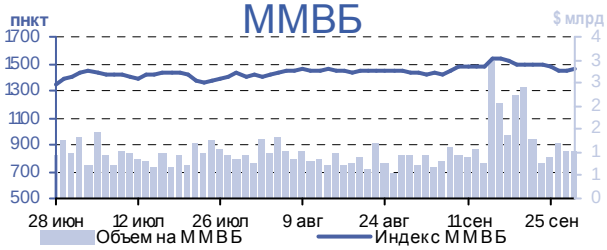
## Комментарий по рынку акций

Индекс ММВБ (1458,26 пункт) в пятницу поднялся на +0,36%. За неделю его снижение составило -2,57%, за сентябрь прирост оказался равным +2,48%, за 3-й квартал ММВБ вырос на +5,15%. Это в целом сопоставимо с тем, что индекс S&P-500 по итогам прошедшего квартала успел прибавить +5,75%. Пятничные новости из Испании (по итогам стресс-тестов крупнейших испанских банковских групп выявлено, что 7 банковским группам нужен дополнительный капитал в размере 59,3 млрд евро) не оказали серьезного влияния на расстановку сил на американских биржах. Позитивно то, что агентство S&P, вероятно с учетом недавно принятого бюджета Испании на 2013 год, не стало в

*Полный текст на 2 стр.*

## Основные индикаторы




## Значение основных индексов

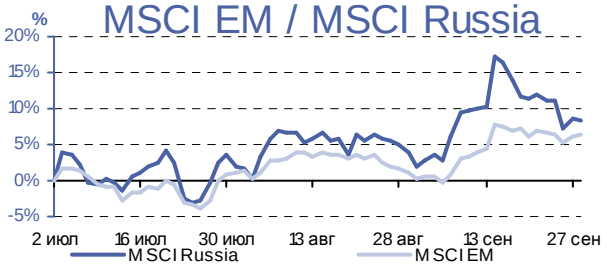
| | Значение | Δ, день | Δ, нед | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|---|
| Индекс РТС | 1 475,70 | 0,06% | -3,08% | 6,19% | 6,23% |
| Индекс ММВБ | 1 458,26 | 0,36% | -2,57% | 2,48% | 3,59% |
| FTSE | 5 742,07 | -0,65% | -1,89% | 0,54% | 10,49% |
| S&P 500 | 1 440,67 | -0,45% | -1,33% | 2,42% | 24,15% |
| Dow Jones Avg. | 13 437,13 | -0,36% | -1,05% | 2,65% | 20,47% |

## Лидеры роста

| | Цена | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Северсталь-авто | 20,0000 | 11,28% | 48,15% | 86,92% |
| Фармстандарт | 44,6200 | 1,87% | -4,04% | -31,46% |
| Магнит | 135,0000 | 0,52% | 5,06% | 34,60% |

## Лидеры снижения

| | Цена | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Сбербанк | 2,9250 | -0,54% | 0,65% | 10,38% |




## Индекс *MSCI*

| | Значение | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Индекс MSCI EM | 1002,66 | 0,43% | 5,84% | 12,09% |
| Индекс MSCI BRAZIL | 2668,41 | -1,15% | 2,71% | -1,01% |
| Индекс MSCI RUSSIA | 791,13 | -0,27% | 5,31% | 9,42% |
| Индекс MSCI INDIA | 428,83 | 1,88% | 14,55% | 4,31% |
| Индекс MSCI CHINA | 55,70 | 0,65% | 6,02% | 10,52% |

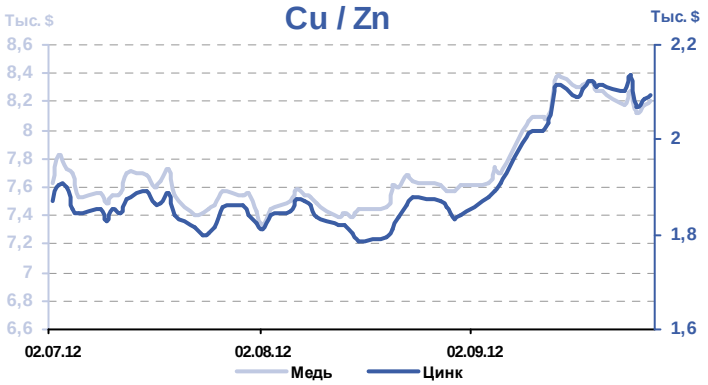
# Обзор рынка

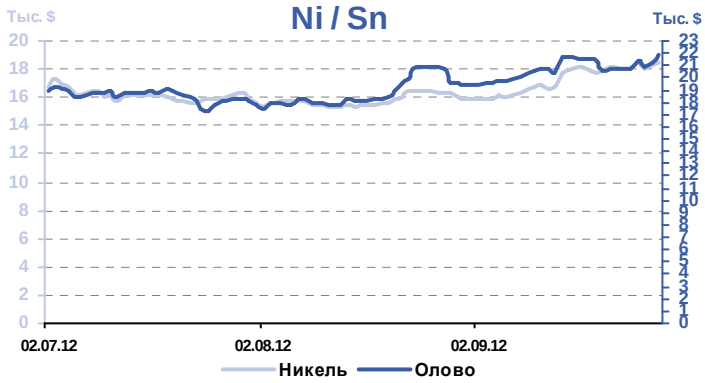
Индекс ММВБ (1458,26 пункт) в пятницу поднялся на +0,36%. За неделю его снижение составило -2,57%, за сентябрь прирост оказался равным +2,48%, за 3-й квартал ММВБ вырос на +5,15%. Это в целом сопоставимо с тем, что индекс S&P-500 по итогам прошедшего квартала успел прибавить +5,75%. Пятничные новости из Испании (по итогам стресс-тестов крупнейших испанских банковских групп выявлено, что 7 банковским группам нужен дополнительный капитал в размере 59,3 млрд евро) не оказали серьезного влияния на расстановку сил на американских биржах. Позитивно то, что агентство S&P, вероятно с учетом недавно принятого бюджета Испании на 2013 год, не стало в конце недели объявлять о пересмотре рейтинга Испании. Думаю, что сегодня европейские инвесторы воспримут отголоски пятничных новостей положительно.

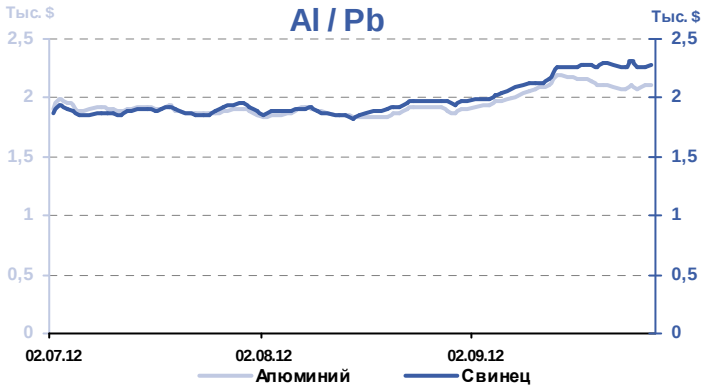
Открытие торгов в понедельник на наших биржах мы увидим в зоне незначительного снижения в основном из-за минусующих американских фьючерсов (S&P -0,42%), а также из-за просадки в азиатских индексах (MSCI Asia -0,26%) и в ценах на нефть (Brent $111,6/барр). В целом стоит заметить, что с момента запуска программы QE-3 прошло уже 2 недели. За это время и фондовые индексы и котировки ликвидных акций ушли от своих максимальных месячных отметок на 3-6%. Тем не менее, основная масса негативных сигналов, которые бы могли давить на рынки в октябре (Испания, Китай, Ближний Восток) начали постепенно обрастать нейтрализующими их факторами. С учетом того, что ликвидности на мировых рынках в ближайший месяц станет больше (программу QE-3 никто не отменял) поводы для роста рынка сохраняются. Но для начала, нужно, чтобы помимо отсутствия негатива в новостных лентах фондовые индексы «по технике» вышли из своих нисходящих трендов. Если на этой неделе индекс ММВБ сумеет закрепиться сначала выше 1480 п., затем выше 1510 п. – это будет означать дальнейший поход вверх на 1540 п. и еще выше.

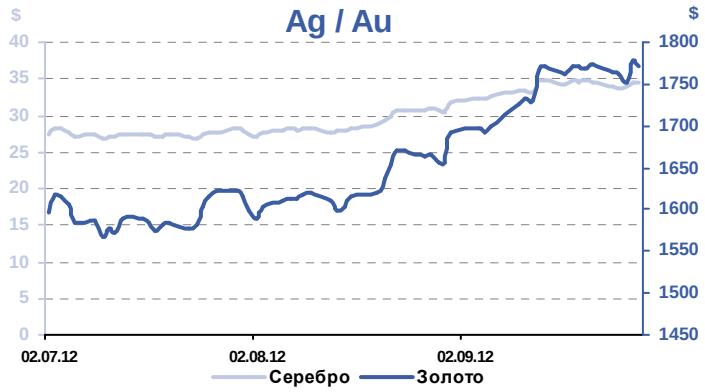
Сегодня днем выходит блок статистики по индексам деловой активности в промышленном секторе ведущих стран еврозоны за сентябрь. Вышедший сегодня Китайский индекс PMI для производственной сферы составил 49,8 п., что совпало с прогнозами аналитиков. В 13-00 ждем данных по уровню безработицы в еврозоне за август. В 18-00 в США выходит производственный индекс ISM за сентябрь. В 20-30 Председатель ФРС Бен Бернанке выступит с речью на тему «Пять вопросов о ФРС и денежно-кредитной политике»

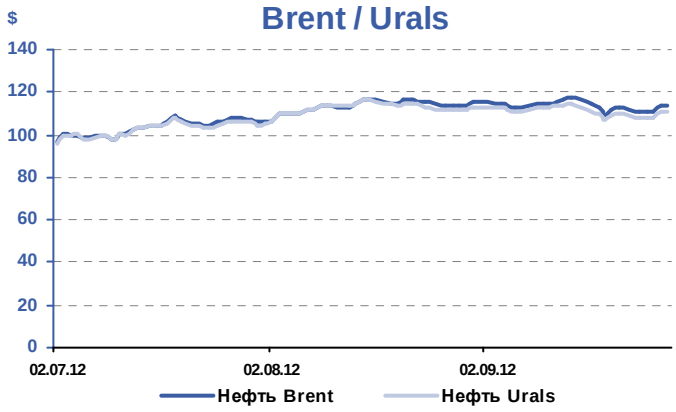
# Commodities

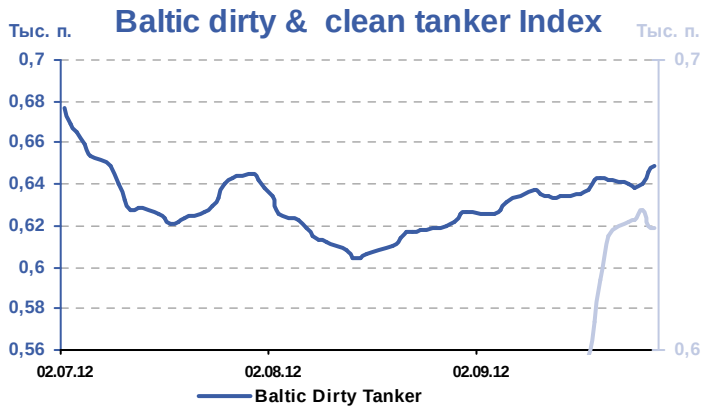



## Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

| | Значение | Δ за день, % | Δ за нед,% | Δ за мес,% | Δ ytd,% |
|---|---|---|---|---|---|
| Медь, $/t | 8 205,00 | 0,37% | -0,92% | 7,75% | 13,49% |
| Цинк, $/t | 2 096,00 | 0,58% | -0,92% | 13,85% | 8,88% |
| Никель, $/t | 18 475,00 | 0,71% | 1,65% | 15,83% | -1,04% |
| Олово, $/t | 21 800,00 | 2,85% | 5,06% | 12,37% | 5,44% |
| Алюминий, $/t | 2 112,00 | 0,19% | -0,19% | 11,04% | -6,01% |
| Свинец, $/t | 2 280,00 | 0,44% | -0,35% | 16,03% | 12,87% |
| Серебро, $/oz | 34,54 | -0,27% | 0,03% | 8,85% | 12,75% |
| Золото, $/oz | 1 772,10 | -0,29% | -0,06% | 4,73% | 9,77% |
| Нефть Brent, $/ | 113,25 | -0,10% | 0,85% | -1,91% | 6,40% |
| Нефть Urals, $/ | 110,68 | 0,05% | 0,48% | -2,23% | 7,19% |

# Российский рынок акций

| Эмитент | Тикер | Цена закрытия, $ | Δ РТС | Δ ММВБ | Объем на РТС, $ | Объем на ММВБ, $ | Капитализация, m$ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ОАО ТНК-ВР Холдинг | TNBP | 2,734 | -6,58% | 0,00% | 99 696 | | 41 008 |
| **Нефть и газ** | | | | | | | |
| Башнефть | BANE | 64,000 | 0,00% | 0,00% | 32 000 | | 10 891 |
| Газпром | GAZP | 5,160 | 0,00% | 0,00% | 258 000 | | 122 155 |
| Лукойл | LKOH | 63,500 | 0,00% | 0,00% | 317 500 | | 54 011 |
| Татнефть | TATN | 6,930 | 0,00% | 0,00% | 345 750 | | 15 098 |
| Татнефть, п. | TATNP | 3,460 | 0,00% | 0,00% | 17 300 | | 510 |
| Транснефть, п. | TRNFP | 1833,621 | | 0,00% | 33 005 | | 2 851 |
| **Электроэнергетика** | | | | | | | |
| ТГК-3 | MSNG | 0,042 | 0,00% | 0,00% | 7 953 | | 1 655 |
| ТГК-5 | TGKE | 0,000 | 0,00% | 0,00% | 2 428 | | 160 |
| **Телекоммуникации** | | | | | | | |
| Ростелеком, п. | RTKMP | 3,043 | 0,00% | 0,00% | 21 908 | | 739 |
| **Машиностроение** | | | | | | | |
| ГАЗ | GAZA | 30,500 | 0,00% | 0,00% | 4 575 | | 565 |
| РКК Энергия | RKKE | 125,000 | 0,00% | 0,00% | 20 500 | | 140 |
| Северсталь-авто | SVAV | 20,000 | 11,28% | 0,00% | 80 000 | | 685 |
| **Металлургия** | | | | | | | |
| ВСМПО | VSMO | 180,000 | 0,00% | 0,00% | 9 000 | | 2 075 |
| ММК | MAGN | 0,323 | 0,00% | 0,00% | 4 845 | | 3 609 |
| НЛМК | NLMK | 2,000 | 0,00% | 0,00% | 20 000 | | 11 986 |
| НорНикель | GMKN | 167,921 | 0,00% | 0,00% | 33 584 | | 32 010 |
| Полюс Золото | PLZL | 32,700 | 0,00% | 0,00% | 32 700 | | 6 234 |
| Северсталь | CHMF | 14,016 | 0,00% | 0,00% | 182 195 | | 11 742 |
| СинТЗ | SNTZ | 33,000 | 0,00% | 0,00% | 6 600 | | 208 |
| **Банки** | | | | | | | |
| Возрождение | VZRZ | 19,350 | 0,00% | 0,00% | 19 375 | | 460 |
| Сбербанк | SBER | 2,925 | -0,54% | 0,00% | 292 500 | | 63 142 |
| **Транспорт** | | | | | | | |
| Аэрофлот | AFLT | 1,400 | 0,00% | 0,00% | 21 000 | | 1 555 |
| Дальневосточное МП | FESH | 0,310 | 0,00% | 0,00% | 62 000 | | 915 |
| **Потребительский рынок** | | | | | | | |
| Верофарм | VRPH | 26,500 | 0,00% | 0,00% | 78 700 | | 265 |
| Магнит | MGNT | 135,000 | 0,52% | 0,00% | 189 225 | | 12 766 |
| Разгуляй | GRAZ | 0,500 | 0,00% | 0,00% | 25 000 | | 79 |
| Фармстандарт | PHST | 44,620 | 1,87% | 0,00% | 10 040 | | 1 686 |
| Черкизово | GCHE | 16,450 | 0,00% | 0,00% | 299 275 | | 723 |
| **Химическая промышленность** | | | | | | | |
| Акрон | AKRN | 46,410 | 0,00% | 0,00% | 155 984 | | 1 881 |

*Источник: РТС, Bloomberg*

# Российские *ADR/GDR*

| Эмитент | Тикер | Акций в АДР | Валюта торгов | Цена закрытия | Изменение, % | Объем, k$ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Аэрофлот | AETG | | EUR | 106,350 | 1,40% | |
| Башнефть | AK6 | | EUR | 225,240 | 0,00% | |
| ALPHABANKSPONSADR | ALBKY | | USD | 0,587 | 1,17% | 1,12 |
| ТГК-3 | AOMD | | USD | 4,700 | -4,30% | 4,73 |
| Татнефть | ATAD | | USD | 41,470 | 1,52% | 16 641,08 |
| АвтоВАЗ | AVVG | | EUR | 1,929 | 1,58% | |
| X5 | FIVE | | USD | 21,010 | -1,36% | 13 510,97 |
| Газпром | GAZ | | EUR | 7,889 | -0,11% | 845,30 |
| ГолденТелеком | GLDN | 1 | USD | 0,015 | 0,00% | 0,13 |
| Кузбассэнерго | KUW | | EUR | 1,650 | -15,38% | |
| Лукойл | LKOD | | USD | 61,600 | 0,08% | 175 695,70 |
| Лукойл | LUK | | EUR | 47,715 | -0,11% | 22,73 |
| Лукойл | LUKOY | 1 | USD | 61,540 | -1,14% | 15 028,89 |
| МТС | MBT | 5 | USD | 17,520 | -0,79% | 54 561,97 |
| МТС | MKY | 5 | EUR | 13,625 | -0,22% | 4,10 |
| ТГК-3 | MRO | | EUR | 3,524 | 0,26% | 1,71 |
| Мечел | MTL | 3 | USD | 7,040 | 0,43% | 19 459,47 |
| НорНикель | NILSY | 1 | USD | 15,810 | -2,89% | 1 320,00 |
| НорНикель | NNIA | | EUR | 12,355 | -1,28% | 5,92 |
| НОВАТЭК | NVTK | 1 | USD | 118,300 | -2,63% | 53 780,45 |
| Nizhnednepr.tubeRoll.Plant | NYZ | | EUR | 1,290 | 0,00% | |
| Нижнекамскнефтехим | OAO | | EUR | 7,050 | 0,00% | |
| Газпром | OGZD | | USD | 10,030 | -0,59% | 170 803,40 |
| ОМЗ | OMZD | | USD | 1,200 | 0,00% | |
| Ростелеком | RKMD | | USD | 25,300 | -1,71% | 18 517,08 |
| Ростелеком | RTL | | EUR | 19,675 | -0,88% | |
| Газпромнефть | SCF | | EUR | 19,015 | 0,72% | 16,18 |
| Сургутнефтегаз | SGN | | EUR | 7,003 | 1,10% | 2,18 |
| Сургутнефтегаз | SGNY | | EUR | 5,075 | -0,63% | |
| Сургутнефтегаз | SGTPY | | USD | 6,558 | -0,64% | 737,91 |
| Сургутнефтегаз | SGTZY | 50 | USD | 9,104 | -0,39% | 472,66 |
| АФКСистема | SSA | 1 | USD | 20,360 | -3,51% | 20 178,71 |
| SunInterbrewLtd | SUG | | EUR | 6,881 | 0,00% | |
| SunInterbrewLtdpr. | SUGA | | EUR | 2,037 | -0,05% | |
| СТЗ | SVY | | EUR | 26,000 | 8,33% | 24,70 |
| Ukrnafta | UKAA | | EUR | 84,546 | 0,00% | |
| Вымпелком | VIP | 1 | EUR | 11,900 | 1,02% | 36 094,20 |
| ВТБ | VTBR | | USD | 3,330 | -2,49% | 69 678,78 |
| Возрождение | VZY | | EUR | 15,000 | 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

Наумов Александр
электроэнергетика

# Трейдинг

**+ 7 (495) 937 33 63**

Лобанов Александр
Начальник отдела
*lobjr@prospect.com.ru*

Билялов Энвер
*bilyalov@prospect.com.ru*

Кузнецова Ирина
*kuznetsova@prospect.com.ru*

Хмельник Михаил
*hop@prospect.com.ru*

Бохин Александр
*abokhin@prsp.ru*

Зуев Дмитрий
*zouev@prospect.com.ru*

Сильвестров Кирилл
*ksilvestrov@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.