ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

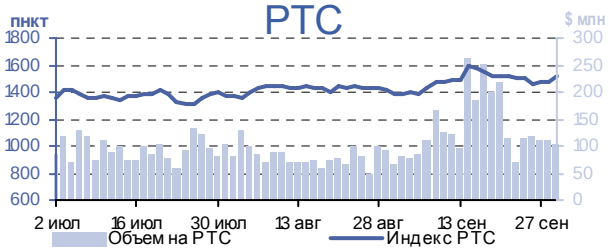
2 октября 2012г.

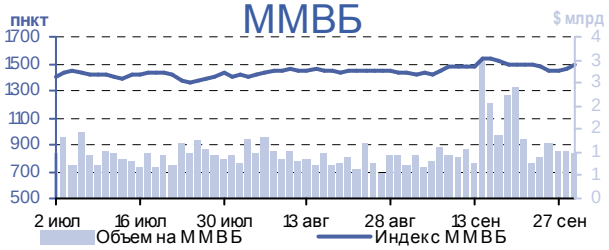
Комментарий по рынку акций

Вчера благодаря позитиву, пришедшему из Европы, наши фондовые индексы показали ударный день роста. Публикация американского индекса деловой активности в производственном секторе ISM за сентябрь усилила движение вверх под закрытие нашей торговой сессии. В итоге, начав день на отрицательной территории (1455 п.) индекс ММВБ сумел по итогам дня показать подъем на +2,2%, завершив его на уровне 1490 п. Однако, американские инвесторы не захотели удерживать рынок на высоких уровнях и «слили» весь первоначальный оптимизм. Неожиданным поводом для этого стали как заявления главы ФРС, так и очевидная слабость акций компании Apple

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



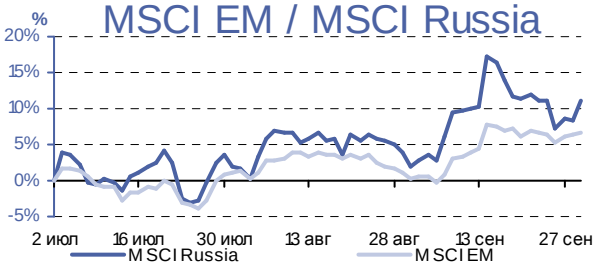


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 513,81	2,58%	0,28%	8,93%	17,20%
Индекс ММВБ	1 490,21	2,19%	0,02%	4,73%	10,82%
FTSE	5 820,45	1,37%	-0,31%	1,91%	14,68%
S&P 500	1 444,49	0,27%	-0,85%	2,70%	31,41%
Dow Jones Avg.	13 515,11	0,58%	-0,32%	3,24%	26,84%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-3	0,0456	9,53%	14,03%	-30,89%
Сбербанк	2,9400	0,51%	1,17%	4,26%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1005,08	0,24%	6,10%	17,93%
Индекс MSCI BRAZIL	2687,46	0,71%	3,45%	6,83%
Индекс MSCI RUSSIA	812,01	2,64%	8,09%	20,81%
Индекс MSCI INDIA	431,15	0,54%	15,17%	9,00%
Индекс MSCI CHINA	55,69	-0,01%	6,01%	20,90%

Обзор рынка

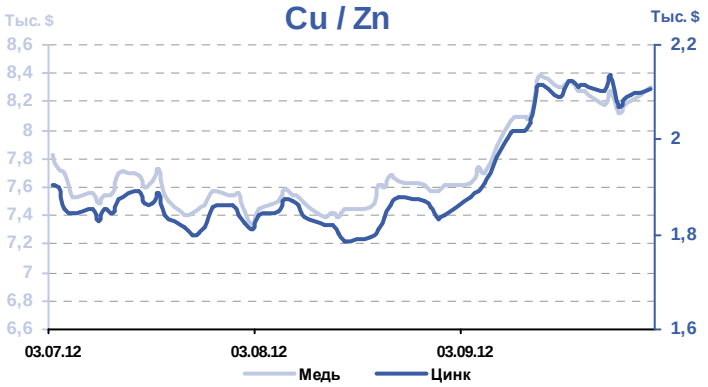
Вчера благодаря позитиву, пришедшему из Европы, наши фондовые индексы показали ударный день роста. Публикация американского индекса деловой активности в производственном секторе ISM за сентябрь усилила движение вверх под закрытие нашей торговой сессии. В итоге, начав день на отрицательной территории (1455 п.) индекс ММВБ сумел по итогам дня показать подъем на +2,2%, завершив его на уровне 1490 п. Однако, американские инвесторы не захотели удерживать рынок на высоких уровнях и «слили» весь первоначальный оптимизм. Неожиданным поводом для этого стали как заявления главы ФРС, так и очевидная слабость акций компании Apple.

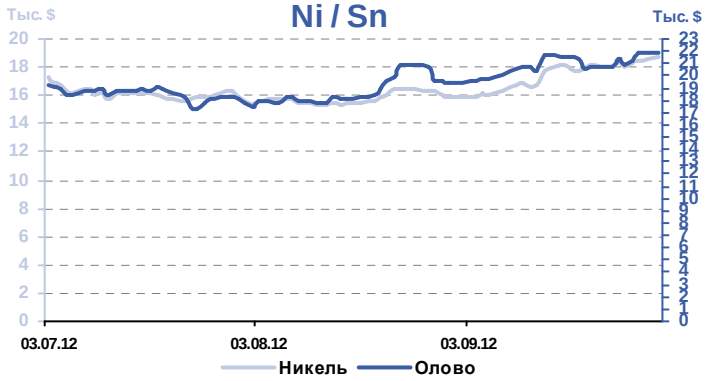
Вчера глава ФРС Бен Бернанке в своем выступлении в экономическом клубе Индианаполиса в очередной раз подчеркнул, что ФРС будет удерживать ставки низкими до тех пор, пока американская экономика не окрепнет. ФедРезерв признался, что «мягкая» монетарная политика так и не принесла реальных успехов на рынке труда. Наиболее негативно заокеанская биржевая публика отреагировала на предупреждение о надвигающейся проблеме «фискального обрыва» из уст главы ФРС. Эту же тему подкрепили и европейские чиновники, заявившие о том, что fiscal cliff является угрозой для глобальной мировой экономики. В результате в ходе вечерней торговой сессии фьючерс РТС упал на -1,22%, вернувшись на очевидный уровень поддержки 149 тыс. п.

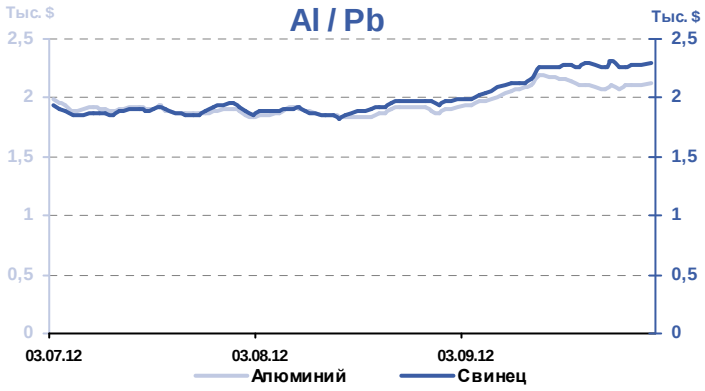
Из-за слабости на американских биржах, сегодня торги на нашем рынке акций начнутся с гэпом вниз чуть более полупроцента. В понедельник индекс ММВБ вышел за границу нисходящего коридора последних двух недель. Чтобы закрепить это движение «быкам» нужно и сегодня закрыть сессию на положительной территории. Думаю, им это удастся сделать. Фаза утренней просадки на нашем рынке, вероятно, не будет длительной и после обеда, ближе к вечеру в отсутствии новых негативных новостей индексу ММВБ вполне под силу придти к уровню 1500 п. Некоторый позитив сегодня в Азии (MSCI Asia +0,32%) идет со стороны Австралии, где Резервный Банк понизил ставку на 25 б.п. до 3.25%.

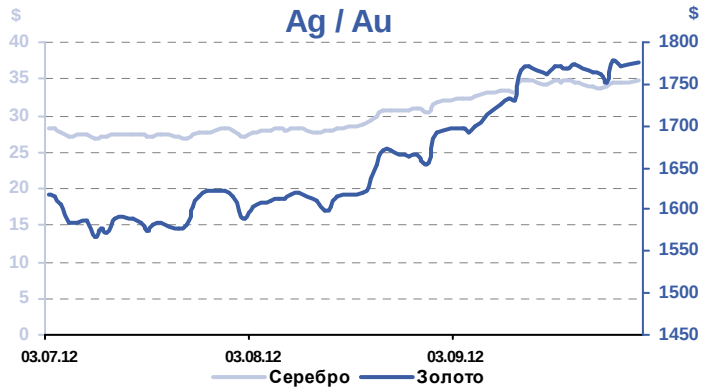
Во вторник Мечел отчитается по US GAAP за 1 полугодие 2012 года. А в 13-00 в еврозоне выходит данные по индексу цен производителей за август. Календарь статистики из США сегодня практически пуст.

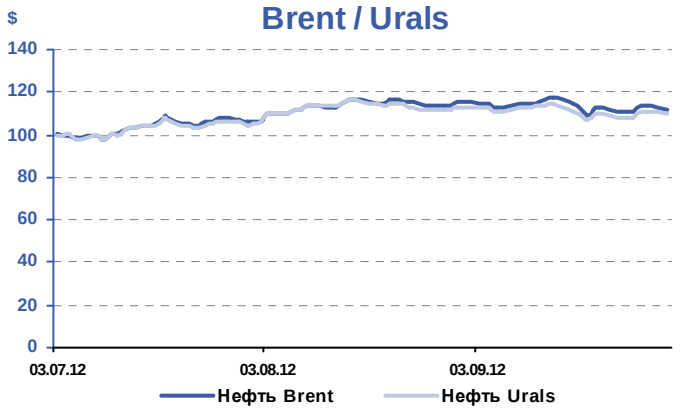
Commodities

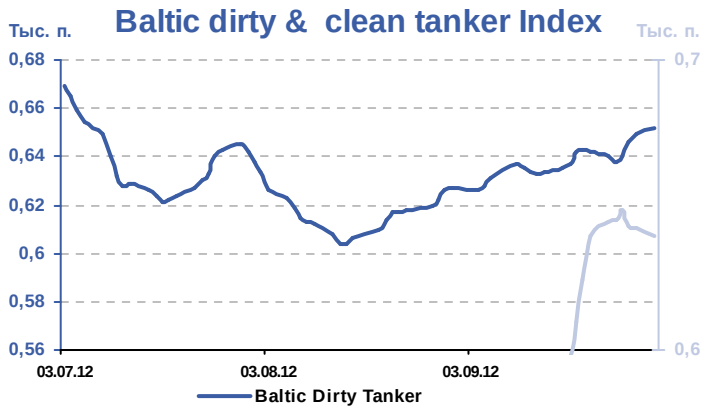












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 299,50	1,15%	1,42%	8,99%	18,73%
Цинк, $/t	2 109,00	0,62%	0,29%	14,56%	11,41%
Никель, $/t	18 730,00	1,38%	4,20%	17,43%	-1,55%
Олово, $/t	21 850,00	0,23%	5,81%	12,63%	6,59%
Алюминий, $/t	2 126,00	0,66%	2,21%	11,78%	-3,50%
Свинец, $/t	2 292,00	0,53%	1,10%	16,64%	16,88%
Серебро, $/oz	34,66	0,35%	1,97%	9,23%	13,98%
Золото, $/oz	1 775,30	0,18%	0,61%	4,92%	7,05%
Нефть Brent, $/	112,14	-0,98%	1,57%	-2,88%	10,95%
Нефть Urals, $/	110,24	-0,40%	1,73%	-2,61%	11,03%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,702	-1,17%	0,00%	27 024		40 528
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%	0,00%	33 005		2 851
Электроэнергетика							
ТГК-3	MSNG	0,046	9,53%	0,00%	6 344		1 813
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	0,00%	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	19,520	0,88%	0,00%	46 188		464
Сбербанк	SBER	2,940	0,51%	0,00%	3 709 273		63 466
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,400	0,00%	0,00%	21 000		1 555
Дальневосточное МП	FESH	0,310	0,00%	0,00%	15 500		915
Потребительский рынок							
Верофарм	VRPH	26,500	0,00%	0,00%	78 700		265
Магнит	MGNT	135,000	0,00%	0,00%	189 225		12 766
Разгуляй	GRAZ	0,500	0,00%	0,00%	25 000		79
Фармстандарт	PHST	44,620	0,00%	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	105,269	-1,02%	
Башнефть	AK6		EUR	235,000	4,33%	
ТГК-3	AOMD		USD	4,513	-3,98%	1,22
Татнефть	ATAD		USD	42,090	1,50%	9 260,97
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,901	-1,45%	
X5	FIVE		USD	21,920	4,33%	9 283,79
Газпром	GAZ		EUR	7,983	1,19%	632,91
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,651	0,06%	
Лукойл	LKOD		USD	62,900	2,11%	139 540,50
Лукойл	LUK		EUR	48,452	1,54%	445,07
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,255	1,16%	6 155,26
МТС	MBT	5	USD	17,700	1,03%	51 235,31
МТС	MKY	5	EUR	13,840	1,58%	4,12
ТГК-3	MRO		EUR	3,620	2,72%	1,09
Мечел	MTL	3	USD	6,900	-1,99%	26 501,33
НорНикель	NILSY	1	USD	16,160	2,21%	154,20
НорНикель	NNIA		EUR	12,570	1,74%	17,04
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	125,000	5,66%	53 614,95
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,290	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	7,000	-0,71%	
Газпром	OGZD		USD	10,310	2,79%	289 420,50
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,900	6,32%	1 439,87
Ростелеком	RTL		EUR	20,860	6,02%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,245	1,21%	3,78
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,225	3,17%	59,75
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,267	3,78%	62,89
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,700	2,17%	2 895,68
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,310	2,26%	63,18
АФКСистема	SSA	1	USD	20,950	2,90%	10 016,33
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,300	6,09%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,036	-0,05%	
СТЗ	SVY		EUR	28,000	7,69%	4,20
Ukrnafta	UKAA		EUR	90,000	6,45%	18,90
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,860	-0,34%	35 763,20
ВТБ	VTBR		USD	3,429	2,97%	64 649,50
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.