ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

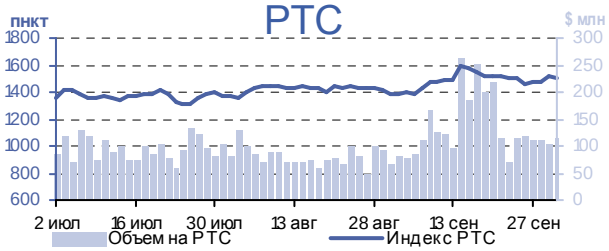
3 октября 2012г.

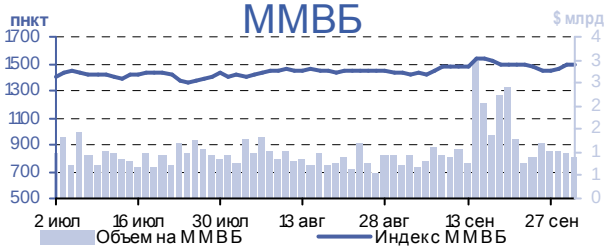
Комментарий по рынку акций

Во вторник американский рынок акций завершил торги в нейтральной зоне. Про расстановку сил на заокеанских биржах в начале октября нельзя сказать ничего определенного. Индекс S&P-500 вчера завершил торги в середине полуторанедельного торгового диапазона. Снизу индекс поддерживает наклонная линия растущего тренда (на уровне 1440 п.), сверху не дает расти сопротивление на 1455 п. Формальным поводом для нежелания покупать рискованные активы является Испания. Страна пока не планирует обращаться с просьбами о финансовой помощи от внешних кредиторов, пытаясь решить свои проблемы самостоятельно. Соответственно агентство Moody's не спешит с

Полный текст на 2 стр.

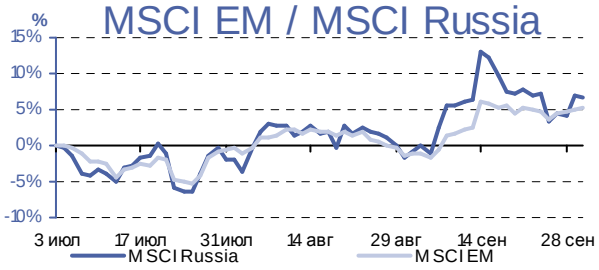
Основные индикаторы





Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 507,77	-0,40%	-0,21%	8,49%	16,73%
Индекс ММВБ	1 485,63	-0,31%	0,20%	4,41%	10,48%
FTSE	5 809,45	-0,19%	-0,86%	1,72%	14,46%
S&P 500	1 445,75	0,09%	0,29%	2,78%	31,52%
Dow Jones Avg.	13 482,36	-0,24%	0,18%	2,99%	26,53%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1006,23	0,11%	6,22%	18,07%
Индекс MSCI BRAZIL	2692,14	0,17%	3,63%	7,01%
Индекс MSCI RUSSIA	808,16	-0,47%	7,58%	20,24%
Индекс MSCI INDIA	431,15	0,00%	15,17%	9,00%
Индекс MSCI CHINA	55,69	-0,01%	6,00%	20,88%

Обзор рынка

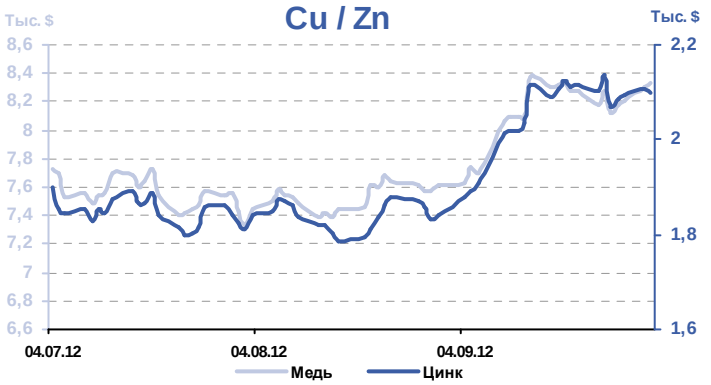
Во вторник американский рынок акций завершил торги в нейтральной зоне. Про расстановку сил на заокеанских биржах в начале октября нельзя сказать ничего определенного. Индекс S&P-500 вчера завершил торги в середине полуторанедельного торгового диапазона. Снизу индекс поддерживает наклонная линия растущего тренда (на уровне 1440 п.), сверху не дает расти сопротивление на 1455 п. Формальным поводом для нежелания покупать рискованные активы является Испания. Страна пока не планирует обращаться с просьбами о финансовой помощи от внешних кредиторов, пытаясь решить свои проблемы самостоятельно. Соответственно агентство Moody's не спешит с понижением рейтинга, однако оно пообещало представить отчет по Испании в этом месяце. Официальный запрос Мадрида о финансовой поддержке запустил бы механизм программы ЕЦБ (Outright Monetary Transactions) по покупке суверенных бондов. Пока Европа не решит свои долговые проблемы, в свою очередь, Китай не будет покупать европейские гособлигации. Круг замкнулся.

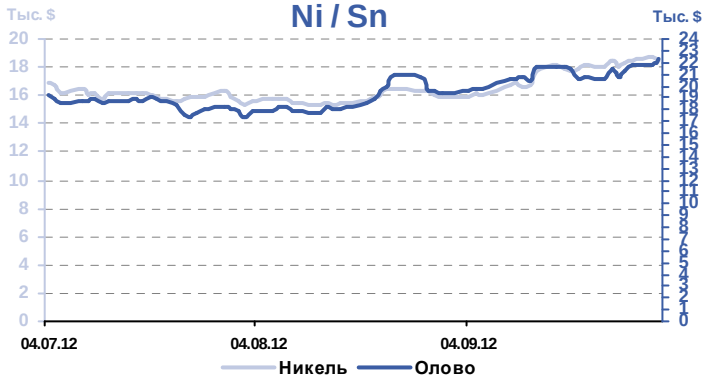
В этой ситуации фондовые индикаторы не показывают ничего выдающегося. Наконец, приближение очередного сезона квартальной отчетности в Штатах также вызывает много фундаментальных вопросов. В целом приходится признать, что если бы не скоординированные действия мировых центробанков в начале этой осени, и фондовые индексы и высоко рискованные валюты торговались бы значительно ниже текущих уровней.

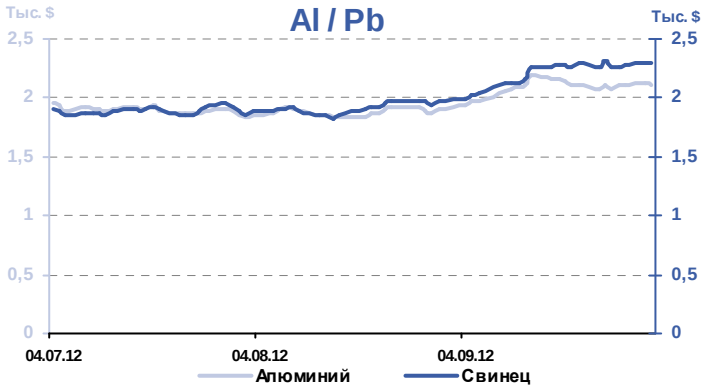
В среду открытие торгов на российском рынке акций мы ожидаем увидеть в умеренно-негативной зоне. Индекс ММВБ в качестве поддержки имеет линию наклонного тренда последних 4 дней, проходящую через отметку 1475 п. Хотя в целом диапазон 1470-90 п. примерно соответвует диапазону цен на нефть марки Brent 110-112 $/барр. Все остальные достижения к нам могут придти только в случае повышения температуры на внешних фондовых рынках. Зоны ключевого сопротивления по индексу ММВБ находится в районе 1490-1510 п. Котировки ноябрьских контрактов на поставку нефти Brent утром в среду снизились к уровню $111/барр., что в купе с ослаблением валютной пары EUR/USD может создать небольшое давление на позиции рубля. Согласно последним данным от API запасы нефти в США на прошлой неделе выросли на 0,462 млн. барр., запасы дистиллятов уменьшились на 0,321 млн. барр.

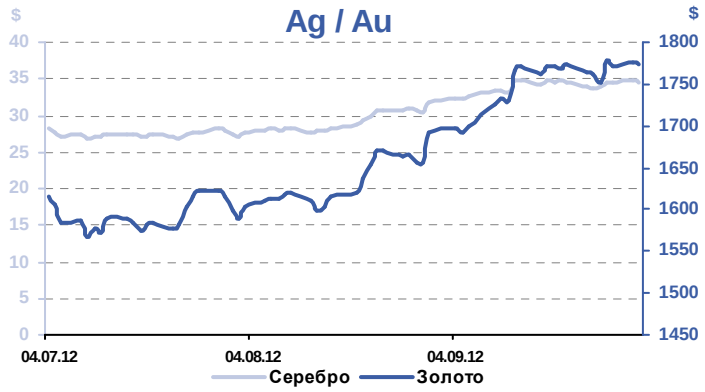
В конце этой недели инвесторов ждет публикация важной макростатистики с американского рынка труда. Даже если сегодня мы увидим волатильность по факту выхода отчета с данными по числу новых рабочих мест в частном секторе США за сентябрь от компании ADP (16-15 мск), думаю, основная масса инвесторов будет ждать до пятницы. В 12-00 в еврозоне выходит индекс деловой активности в секторе услуг за сентябрь. Аналогичный показатель по Китаю в сентябре снизился до отметки 53,7 п. против 56,3 п. в августе. В 18-00 ждем выхода Индекса деловой активности в непроизводственном секторе США (ISM Non-Manufacturing) за сентябрь. Наконец, в 18-30 EIA представит отчет по запасам нефти и нефтепродуктов.

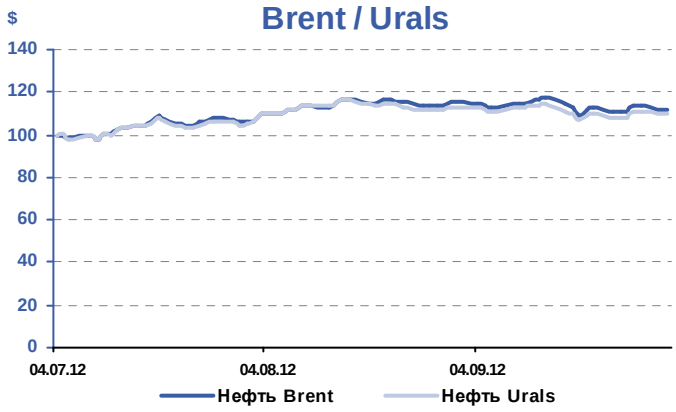
Commodities

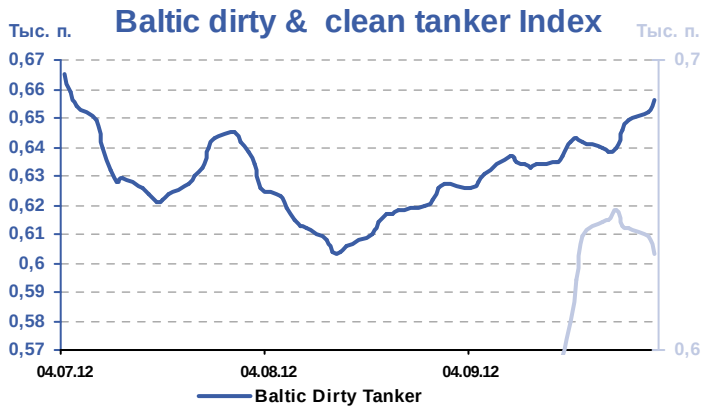












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 325,50	0,31%	0,61%	9,33%	19,11%
Цинк, $/t	2 098,00	-0,52%	-1,78%	13,96%	10,83%
Никель, $/t	18 450,00	-1,49%	0,27%	15,67%	-3,02%
Олово, $/t	22 290,00	2,01%	3,92%	14,90%	8,73%
Алюминий, $/t	2 107,00	-0,89%	0,10%	10,78%	-4,36%
Свинец, $/t	2 300,00	0,35%	-0,86%	17,05%	17,29%
Серебро, $/oz	34,62	-0,12%	2,54%	9,09%	13,84%
Золото, $/oz	1 774,70	-0,03%	0,80%	4,89%	7,02%
Нефть Brent, $/	111,40	-0,66%	0,66%	-3,52%	10,22%
Нефть Urals, $/	109,50	-0,67%	1,13%	-3,27%	10,28%

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	0,00%	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	0,00%	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	0,00%	0,00%	46 188		464
Сбербанк	SBER	2,940	0,00%	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	105,831	0,53%	
Башнефть	AK6		EUR	226,670	-3,54%	
ТГК-3	AOMD		USD	4,513	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	42,140	0,12%	11 498,91
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,788	-5,94%	4,07
X5	FIVE		USD	22,030	0,50%	9 172,13
Газпром	GAZ		EUR	7,868	-1,44%	801,11
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,017	13,33%	0,34
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,700	2,97%	
Лукойл	LKOD		USD	63,050	0,24%	183 887,50
Лукойл	LUK		EUR	48,761	0,64%	813,45
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,670	0,67%	4 883,38
МТС	MBT	5	USD	17,630	-0,40%	45 894,76
МТС	MKY	5	EUR	13,630	-1,52%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,870	6,91%	7,65
Мечел	MTL	3	USD	7,030	1,88%	26 402,52
НорНикель	NILSY	1	USD	16,180	0,12%	181,01
НорНикель	NNIA		EUR	12,590	0,16%	93,97
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	126,800	1,44%	47 777,42
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,038	-19,53%	3,69
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	7,175	2,50%	
Газпром	OGZD		USD	10,190	-1,16%	305 509,80
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,660	-0,89%	798,55
Ростелеком	RTL		EUR	20,620	-1,15%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,325	0,42%	14,43
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,189	-0,50%	3,60
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,350	1,58%	2,94
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,770	1,04%	5 935,71
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,230	-0,86%	1 470,41
АФКСистема	SSA	1	USD	21,000	0,24%	8 932,56
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,881	-5,74%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,035	-0,05%	
СТЗ	SVY		EUR	27,000	-3,57%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	85,714	-4,76%	19,95
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,040	1,52%	22 883,94
ВТБ	VTBR		USD	3,476	1,37%	75 491,47
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.