ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

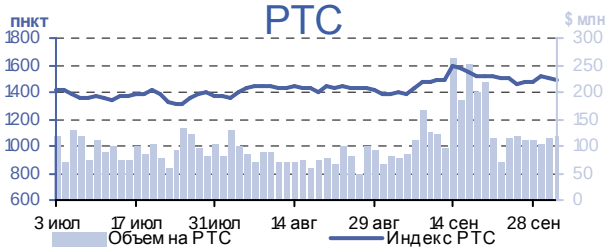
4 октября 2012г.

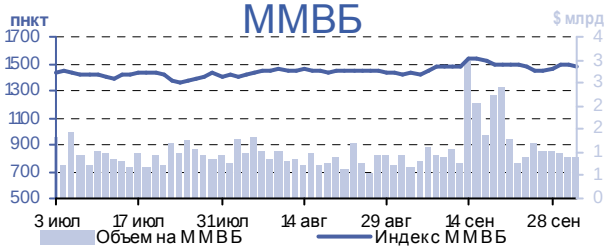
Комментарий по рынку акций

Самым интересным событием торгов в среду стало падение цен на «черное золото». Котировки нефти марки Brent вчера вечером рухнули на 3% ($108/барр), цены в Нью-Йорке на WTI обвалились на 4% ($88/барр). Явных причин для этого падения не было. Напротив, за последние сутки серьезно обострился конфликт между Сирией и Турцией из-за артиллерийского обстрела сопредельных территорий с обеих сторон. Свежие данные по запасам нефти в США тоже не назовешь «медвежьими»: на прошлой неделе они снизились на 0,48 млн. барр., при ожиданиях роста на 1,5 млн. барр. Возможно, на рынке энергоносителей мы видели запоздалую реакцию на слабую макроэкономическую

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



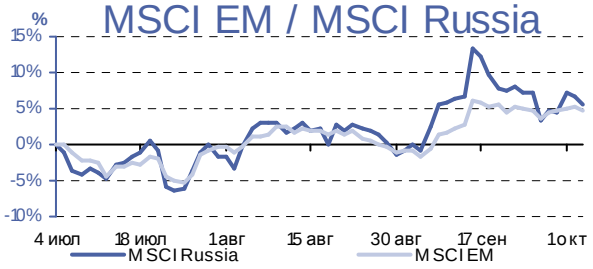


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 492,30	-1,03%	2,42%	6,16%	21,83%
Индекс ММВБ	1 472,50	-0,88%	1,88%	2,50%	16,15%
FTSE	5 825,81	0,28%	1,00%	2,71%	17,83%
S&P 500	1 450,99	0,36%	1,23%	3,28%	29,10%
Dow Jones Avg.	13 494,61	0,09%	0,60%	3,52%	24,85%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,9550	0,51%	1,69%	0,17%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1002,50	-0,37%	5,82%	20,61%
Индекс MSCI BRAZIL	2662,14	-1,11%	4,04%	5,85%
Индекс MSCI RUSSIA	798,64	-1,18%	5,35%	26,07%
Индекс MSCI INDIA	436,06	1,14%	16,19%	12,71%
Индекс MSCI CHINA	55,72	0,06%	6,50%	25,25%

Обзор рынка

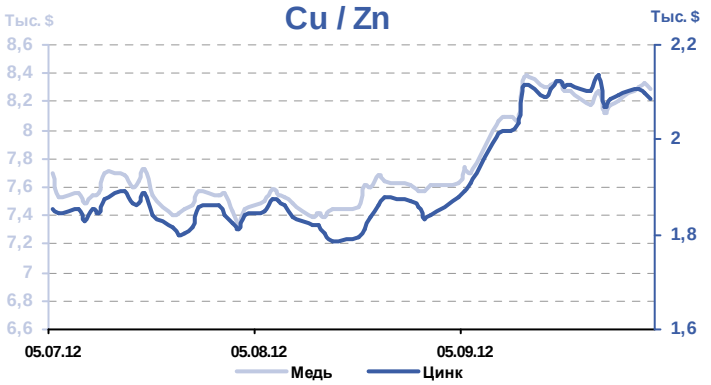
Самым интересным событием торгов в среду стало падение цен на «черное золото». Котировки нефти марки Brent вчера вечером рухнули на 3% ($108/барр), цены в Нью-Йорке на WTI обвалились на 4% ($88/барр). Явных причин для этого падения не было. Напротив, за последние сутки серьезно обострился конфликт между Сирией и Турцией из-за артиллерийского обстрела сопредельных территорий с обеих сторон. Свежие данные по запасам нефти в США тоже не назовешь «медвежьими»: на прошлой неделе они снизились на 0,48 млн. барр., при ожиданиях роста на 1,5 млн. барр. Возможно, на рынке энергоносителей мы видели запоздалую реакцию на слабую макроэкономическую статистику, опубликованную вчера утром в Европе и Китае. Как бы там ни было, но сегодня котировки нефти Brent просто обязаны сходить на ретест своих сентябрьских минимумов, опустившись до отметки $107,2/барр.

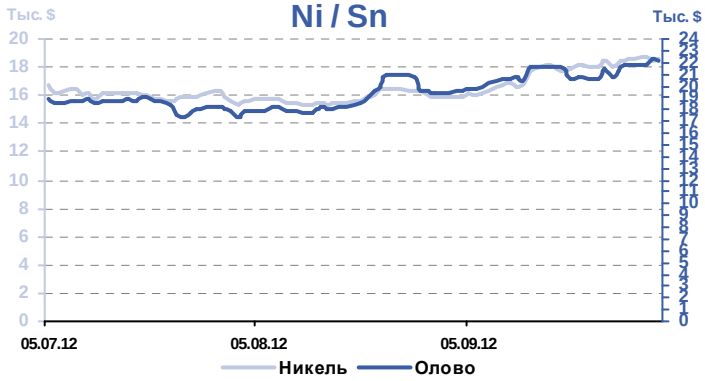
Не думаю, что текущее снижение температуры в секторе энергоносителей вызовет серьезную просадку в наших биржевых индексах. Вообще, пока Brent торгуется в диапазоне 106-116 $/барр, инвесторы не паникуют на счет перспектив российского рынка акций. Например, 20 сентября мы видели котировки североморской нефти возле уровня $107/барр, в этот день индекс ММВБ был возле отметки 1500 п.; напротив, когда неделю назад наш индекс уходил на 1440 п., цены на нефть были возле отметки $110,5/барр. Гораздо важнее внешний фон, идущий с западных фондовых бирж.

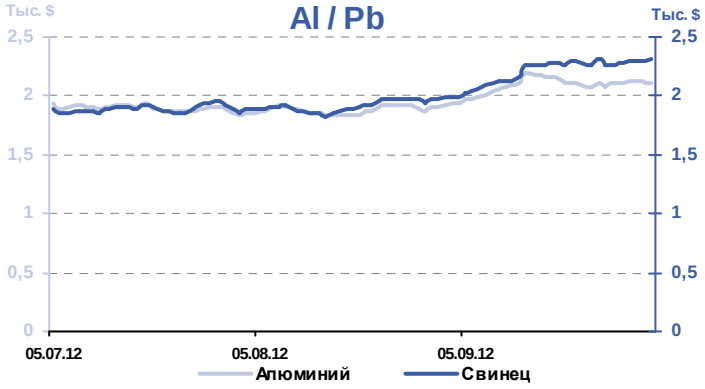
На утро четверга мы видим, что внешний фон преимущественно окрашен в зеленые цвета. Индекс S&P-500 в среду смог завершить торги возле важной отметки 1450 п. Азиатские биржевые индексы сегодня утром в основном растут. Неплохо прибавляет утром и американские фьючерсы (S&P +0,45%). Думаю, по этому наш рынок акций сохранит движение в рамках широкого бокового тренда последних двух недель. То есть индекс ММВБ сегодня не пойдет ниже отметки 1450 п., при этом прорыва выше 1500 п. тоже вряд ли стоит ожидать. Фьючерс РТС в качестве сильной поддержки имеет уровень 147 тыс. п., а сопротивление на 149-150 тыс.п. Днем основное внимание участников рынка по традиции будет обращено на результаты заседаний Европейского Центробанка и Банка Англии.

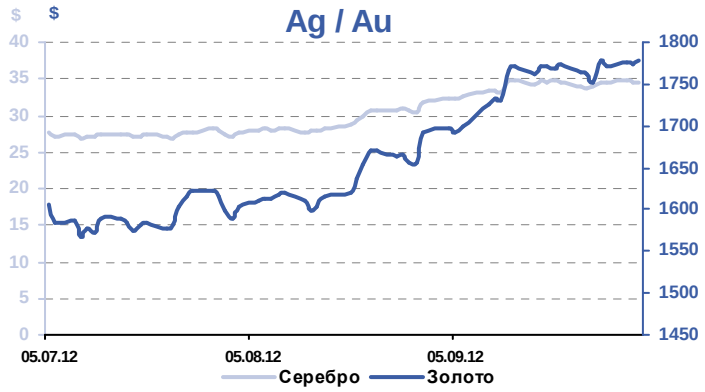
В четверг в 15-00 Банк Англии объявит решение по процентной ставке и по объемам покупки активов. В 15-45 аналогичное решение опубликует ЕЦБ. В этот раз никто не ждет дополнительных мер смягчения в монетарной политике от этих Центробанков. В 16-30 начнется пресс-конференция главы ЕЦБ Марио Драги. В 16-30 в США выходит отчет по числу обращений за пособием по безработице. В 18-00 ждем статистики по объемам производственных заказов в США за август. В 22-00 ФРС опубликует протоколы предыдущего заседания FOMC.

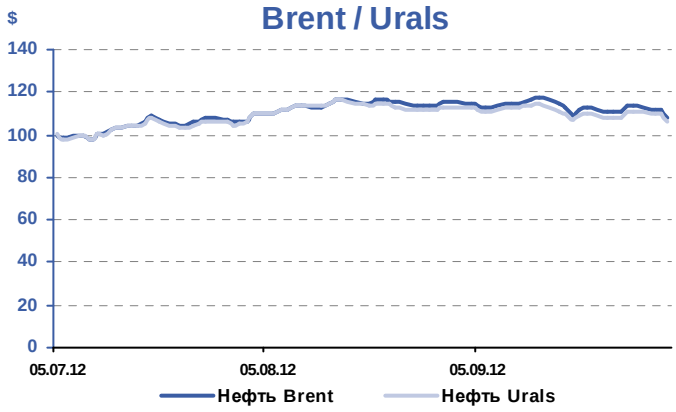
Commodities

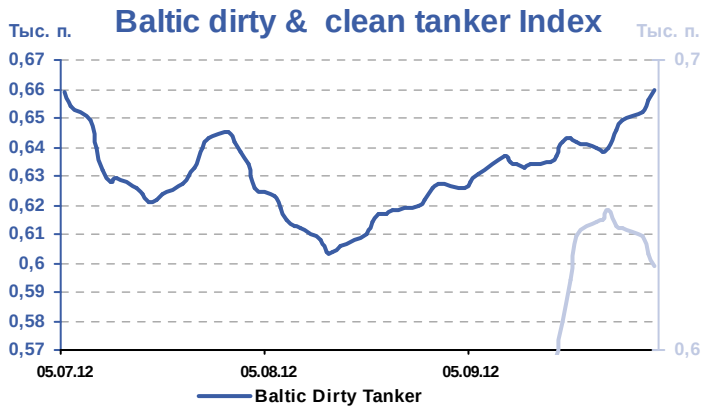












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 290,00	-0,43%	2,09%	8,58%	21,91%
Цинк, $/t	2 085,00	-0,62%	0,68%	11,08%	12,10%
Никель, $/t	18 525,00	0,41%	2,60%	16,14%	-1,20%
Олово, $/t	22 125,00	-0,74%	6,37%	12,74%	5,38%
Алюминий, $/t	2 102,50	-0,21%	1,47%	8,10%	-3,29%
Свинец, $/t	2 306,00	0,26%	1,86%	15,59%	22,27%
Серебро, $/oz	34,60	-0,05%	1,90%	6,98%	15,01%
Золото, $/oz	1 778,00	0,19%	1,44%	4,85%	9,49%
Нефть Brent, $/	108,02	-3,03%	-2,57%	-5,40%	5,72%
Нефть Urals, $/	106,10	-3,11%	-1,68%	-5,75%	5,74%

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							
ОГК-2	OGKB	0,013		0,00%	11 889		1 083
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	2,955	0,51%	0,00%	1 982 075		63 789
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	100,000	-5,51%	7,54
Башнефть	AK6		EUR	224,760	-0,84%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,610	3,95%	1,21
ТГК-3	AOMD		USD	4,513	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	41,310	-1,97%	10 940,30
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,907	6,66%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	21,350	-3,09%	14 670,90
Газпром	GAZ		EUR	7,800	-0,86%	1 171,00
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,012	-29,41%	0,06
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,700	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	62,800	-0,40%	226 870,30
Лукойл	LUK		EUR	48,490	-0,56%	44,63
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,310	-0,57%	6 977,54
МТС	MBT	5	USD	17,440	-1,08%	33 722,40
МТС	MKY	5	EUR	13,560	-0,51%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,630	-6,20%	10,26
Мечел	MTL	3	USD	6,780	-3,56%	16 691,48
НорНикель	NILSY	1	USD	15,970	-1,30%	239,53
НорНикель	NNIA		EUR	12,390	-1,59%	15,23
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,200	-2,05%	15 593,99
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,038	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	7,175	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,130	-0,59%	206 371,60
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,440	-0,83%	1 691,23
Ростелеком	RTL		EUR	20,445	-0,85%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,365	0,21%	2,90
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,149	-0,56%	59,50
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,202	-2,77%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,770	0,00%	3 400,34
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,230	0,00%	29,66
АФКСистема	SSA	1	USD	21,120	0,57%	5 758,45
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,881	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,034	-0,05%	
СТЗ	SVY		EUR	27,250	0,93%	1,23
Ukrnafta	UKAA		EUR	85,714	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,260	1,83%	46 533,10
ВТБ	VTBR		USD	3,477	0,03%	56 180,64
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.