ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

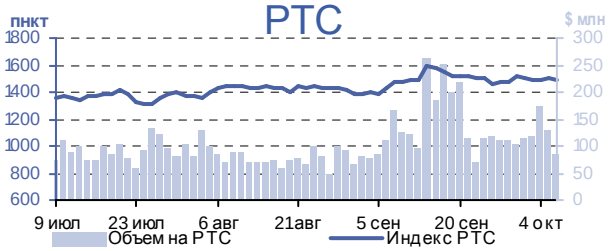
9 октября 2012г.

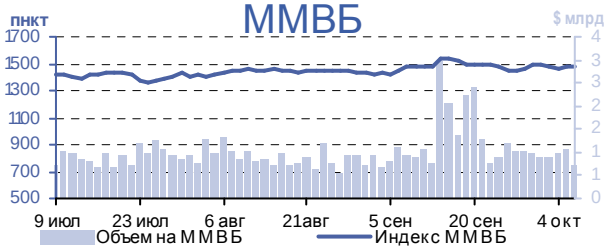
Комментарий по рынку акций

К открытию торгов на наших биржах во вторник складывается умеренно позитивный внешний фон. Значимых новостей, способных вызвать сильные движения на фондовых, сырьевых и валютных рынках за последние сутки не поступало. Вчера в США праздновался День Колумба, поэтому торговая активность не только на Уолл-стрит, но и в Европе, да и на Московской Бирже в понедельник была минимальной. На утро вторника американские фьючерсы торгуются примерно на уровнях предыдущей сессии. Позитивом для нас выступают выросшие цены на нефть (Brent $112,65/барр) и растущие фондовые индикаторы в Азии (MSCI Asia +0,57%). Ближайший уровень поддержки по индексу ММВБ

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



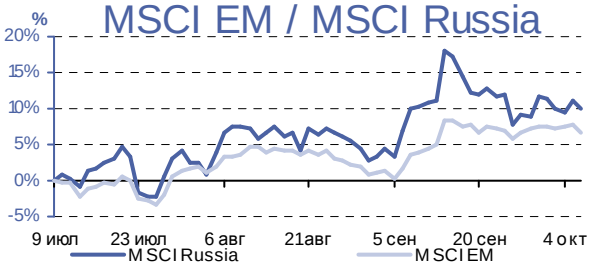


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 492,51	-1,07%	-1,41%	3,84%	9,28%
Индекс ММВБ	1 473,61	-0,27%	-1,11%	1,27%	6,72%
FTSE	5 841,74	-0,50%	0,37%	1,11%	8,20%
S&P 500	1 455,88	-0,35%	0,79%	1,66%	21,84%
Dow Jones Avg.	13 583,65	-0,19%	0,51%	2,19%	18,81%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	141,6000	2,49%	10,19%	58,21%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,9700	-1,49%	-1,00%	9,59%
Лукойл	61,9000	-1,28%	6,54%	14,42%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	997,93	-1,11%	5,00%	11,09%
Индекс MSCI BRAZIL	2704,30	0,72%	2,03%	-3,78%
Индекс MSCI RUSSIA	799,46	-1,01%	2,95%	11,26%
Индекс MSCI INDIA	429,09	-2,36%	15,00%	5,11%
Индекс MSCI CHINA	55,59	-1,25%	7,45%	13,99%

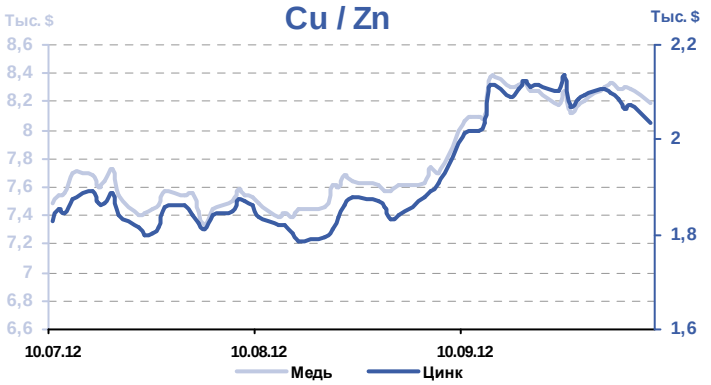
Обзор рынка

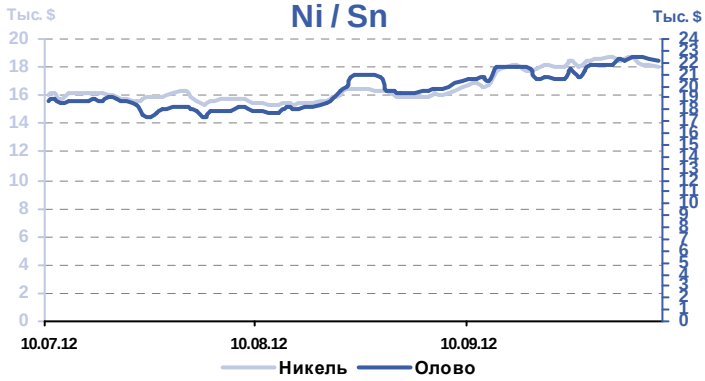
К открытию торгов на наших биржах во вторник складывается умеренно позитивный внешний фон. Значимых новостей, способных вызвать сильные движения на фондовых, сырьевых и валютных рынках за последние сутки не поступало. Вчера в США праздновался День Колумба, поэтому торговая активность не только на Уолл-стрит, но и в Европе, да и на Московской Бирже в понедельник была минимальной. На утро вторника американские фьючерсы торгуются примерно на уровнях предыдущей сессии. Позитивом для нас выступают выросшие цены на нефть (Brent $112,65/барр) и растущие фондовые индикаторы в Азии (MSCI Asia +0,57%). Ближайший уровень поддержки по индексу ММВБ сейчас сместился к отметке 1460 п., сопротивление – возле 1485 п. Думаю нам под силу сегодня еще раз попробовать пойти вверх.

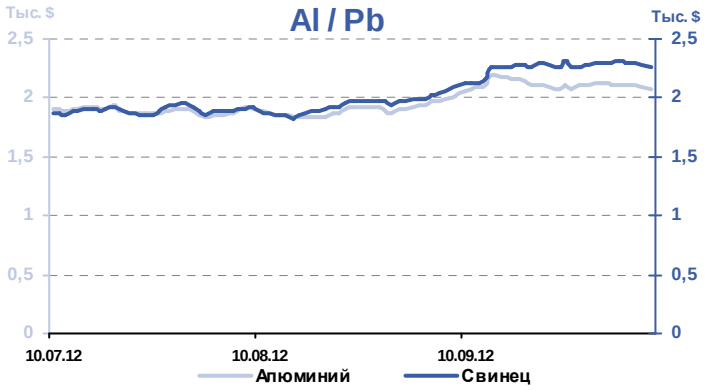
Накануне индекс ММВБ нашел в себе силы для того, чтобы к закрытию выйти в нейтральную зону (1474 п.; -0,2%) после утренней просадки. Будучи зажатыми, в рамках сужающегося бокового тренда по индексам участники рынка не торопятся активно играть ни на понижение, ни на повышение. Что может вывести рынок из этой зоны комфорта? Есть два важных момента. Во-первых, это начало сезона квартальной отчетности в Штатах. В тот раз количество слабых квартальных прогнозов по компаниям из состава индекса S&P-500 превысило число сильных в 4,3 раза (худший показатель с 3 квартала 2001 года). Выправить положение могут только традиционно сильно заниженные ожидания по прибылям. Вторым важным для рынков моментом будет являться запуск программы ЕЦБ по покупке бондов (OMT). С учетом того, что Испания пока не хочет принимать внешнюю финансовую помощь, поступление свежей ликвидности от ЕЦБ на рынки также откладывается. В результате мировые фондовые индикаторы сейчас замерли в фазе консолидации, и вяло реагируют лишь на локальные новости.

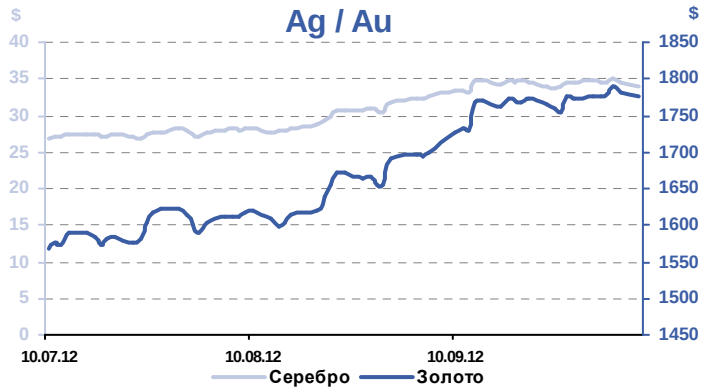
По итогам заседания Еврогруппы стало известно, об одобрении «Тройкой» действий правительства Португалии в плане снижения бюджетного дефицита. Некоторый позитив европейские инвесторы также найдут в официальном запуске механизма ESM. Сегодня в 12-30 ждем выступления главы ЕЦБ Марио Драги в Европарламенте. Важной макростатистики из Европы и Америки сегодня не выходит. Все внимание рынка будет сосредоточено на квартальном отчете алюминиевого гиганта Alcoa (ожидается, что по итогам 3 квартала компания удержится на пороге безубыточности), который выпустит релиз после завершения торгов на Уолл-стрит.

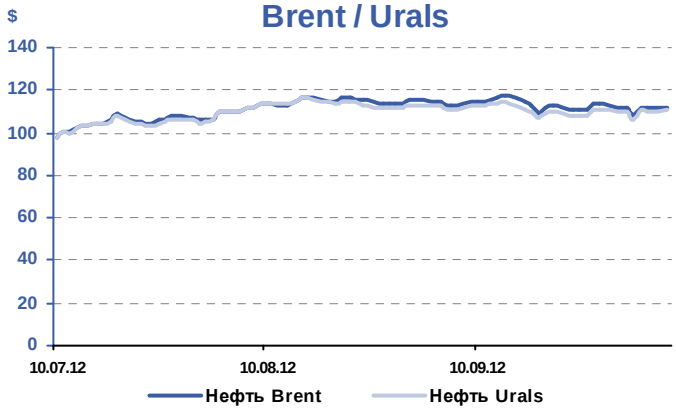
Commodities

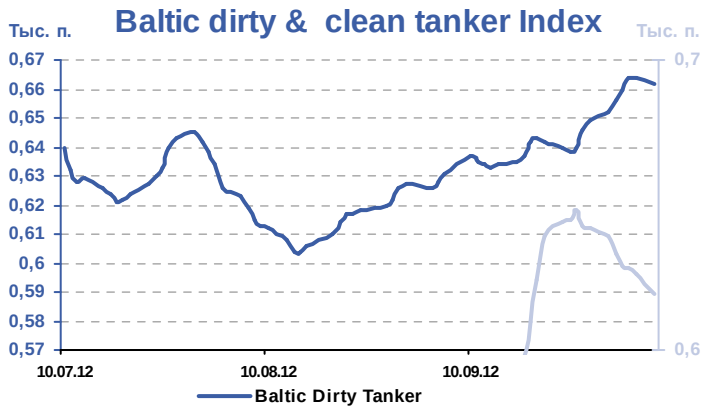












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 185,00	-1,33%	-1,38%	6,28%	9,21%
Цинк, $/t	2 034,00	-1,98%	-3,56%	6,55%	4,28%
Никель, $/t	18 075,00	-1,23%	-3,50%	12,55%	-6,73%
Олово, $/t	22 100,00	-1,34%	1,14%	12,04%	-4,12%
Алюминий, $/t	2 082,50	-1,30%	-2,05%	5,44%	-7,81%
Свинец, $/t	2 260,00	-1,22%	-1,40%	10,30%	12,72%
Серебро, $/oz	33,98	-1,56%	-1,95%	4,09%	5,88%
Золото, $/oz	1 774,95	-0,32%	-0,02%	4,39%	5,87%
Нефть Brent, $/	112,24	-0,02%	0,09%	-0,28%	3,32%
Нефть Urals, $/	110,42	0,12%	0,16%	-0,83%	2,73%

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	5,170	0,00%	0,00%	258 500		122 392
Лукойл	LKOH	61,900	-1,28%	0,00%	309 500		52 650
Мегионнефтегаз	MFGS	14,650	0,00%	0,00%	5 508		1 457
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,670		0,00%	67 000		5 160
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%	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
Северсталь-авто	SVAV	21,150	0,00%	0,00%	96 302		725
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	12,806	0,00%	0,00%	20 746		10 728
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	2,970	-1,49%	0,00%	594 000		64 113
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,400	0,00%	0,00%	21 000		1 555
Дальневосточное МП	FESH	0,315	0,00%	0,00%	31 500		930
Потребительский рынок							
Верофарм	VRPH	26,500	0,00%	0,00%	78 700		265
Дикси	DIXY	11,150	0,00%	0,00%	17 840		1 391
Магнит	MGNT	141,600	2,49%	0,00%	159 050		13 390
Разгуляй	GRAZ	0,453	0,00%	0,00%	6 795		72
Фармстандарт	PHST	46,200	0,00%	0,00%	10 857		1 746
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
Уголь							
Распадская	rasp	2,490	0,00%	0,00%	506 300		1 944

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	105,220	-0,45%	
Башнефть	AK6		EUR	227,000	0,36%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,578	-0,52%	2,90
ТГК-3	AOMD		USD	4,900	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	41,000	-1,96%	10 395,29
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,906	1,60%	
X5	FIVE		USD	21,000	-2,42%	17 457,92
Газпром	GAZ		EUR	7,849	-0,10%	521,19
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,016	-1,23%	0,54
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,700	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	62,100	-1,04%	85 799,83
Лукойл	LUK		EUR	47,800	-0,26%	66,47
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,000	-0,21%	5 266,78
МТС	MBT	5	USD	16,870	-1,29%	59 847,80
МТС	MKY	5	EUR	12,940	-1,33%	2,32
ТГК-3	MRO		EUR	3,541	-1,91%	7,09
Мечел	MTL	3	USD	6,980	1,45%	12 150,77
НорНикель	NILSY	1	USD	16,060	0,00%	181,43
НорНикель	NNIA		EUR	12,310	-0,36%	29,50
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,000	0,40%	165 656,20
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,038	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,850	-0,72%	
Газпром	OGZD		USD	10,180	-1,07%	127 290,20
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	25,760	-2,83%	2 119,54
Ростелеком	RTL		EUR	19,860	-2,36%	1,40
Газпромнефть	SCF		EUR	19,165	-0,85%	49,79
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,158	-0,03%	27,95
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,092	-3,08%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,720	-1,03%	3,36
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,270	-0,75%	38,16
АФКСистема	SSA	1	USD	20,850	-1,14%	19 499,07
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,405	-2,18%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,130	0,09%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	84,600	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,600	-1,36%	15 920,01
ВТБ	VTBR		USD	3,484	-1,41%	17 921,25
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.