ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

15 октября 2012г.

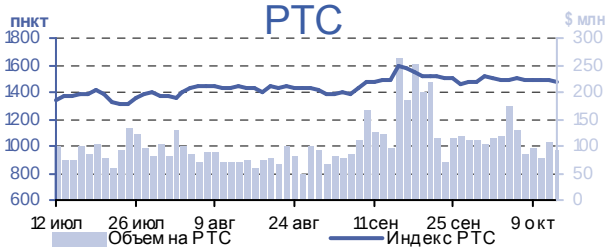
Комментарий по рынку акций

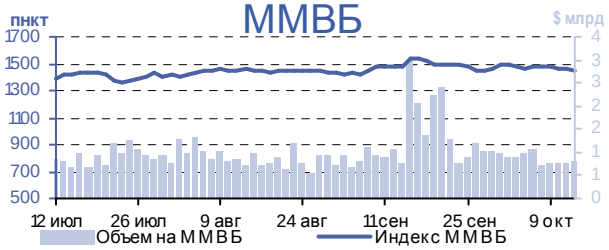
Предыдущую торговую неделю российский рынок акций завершил на минорной ноте, опустившись до важного уровня поддержки по индексу ММВБ на 1440 п. – минимум с конца сентября. Даже с учетом стабильно высоких цен на нефть (Brent $114,1/барр) и крепкого рубля (USD/RUR 31,15) индекс ММВБ закрылся ниже своей 200-дневной скользящей средней (1457 п.), что традиционно воспринимается рядом игроков, как сигнал к среднесрочным продажам. Но все ли так плохо?

Пятничные торги в Америке не показали ничего выразительного. Несмотря на то, что индекс S&P-500 в пятницу потерял -0,3%

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





Значение основных индексов

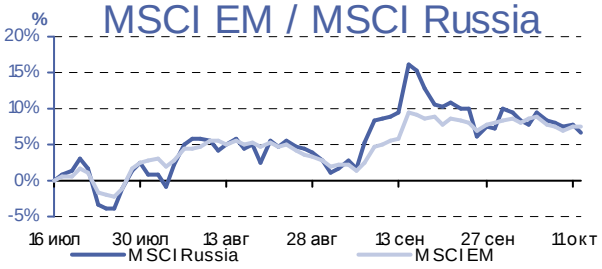
	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 472,36	-1,21%	-2,41%	-7,36%	5,45%
Индекс ММВБ	1 446,01	-1,17%	-2,14%	-5,82%	4,12%
FTSE	5 793,32	-0,62%	-1,32%	-2,07%	7,22%

Главные новости

- Совет рынка все-таки отменила итоги КОМ в первой ценовой зоне

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	143,5000	1,54%	-1,03%	66,74%
Северсталь-авто	21,4724	1,43%	14,17%	121,36%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	2,3600	-0,51%	1,55%	-28,48%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	996,70	0,08%	-1,71%	7,12%
Индекс MSCI BRAZIL	2675,66	-0,27%	-5,03%	-6,34%
Индекс MSCI RUSSIA	786,45	-1,12%	-8,24%	7,61%
Индекс MSCI INDIA	425,05	-1,01%	4,86%	2,32%
Индекс MSCI CHINA	57,33	0,84%	3,44%	8,02%

Обзор рынка

Предыдущую торговую неделю российский рынок акций завершил на минорной ноте, опустившись до важного уровня поддержки по индексу ММВБ на 1440 п. – минимум с конца сентября. Даже с учетом стабильно высоких цен на нефть (Brent $114,1/барр) и крепкого рубля (USD/RUR 31,15) индекс ММВБ закрылся ниже своей 200-дневной скользящей средней (1457 п.), что традиционно воспринимается рядом игроков, как сигнал к среднесрочным продажам. Но все ли так плохо?

Пятничные торги в Америке не показали ничего выразительного. Несмотря на то, что индекс S&P-500 в пятницу потерял -0,3%, закрывшись на отметке 1428,5 п., он четко пришел на нижнюю границу своего наклонного растущего тренда, начатого в мае этого года. Особых поводов к обвалу российского рынка акций в ближайшее время мы также не видим. Явный аутсайдер прошлой недели – акции Газпрома в пятницу нашли покупки на уровне промежуточной поддержки на 151,3 руб. (более сильный уровень расположен на 148 руб.). Фьючерс РТС пока что держит позиции выше важной отметки 145 тыс. п. Все эти факторы отчасти говорят о том, что в данный момент наши биржевые индикаторы находятся возле своих локальных минимумов, от которых возможен коррекционный подъем. На часовом графике индекса ММВБ просматривается очевидное сопротивление на 1468 п., пробой которого вверх может сломать нисходящую формацию последних 4-х недель.

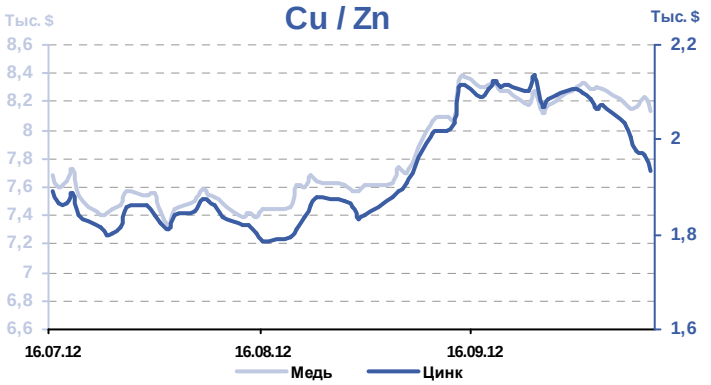
Вышедшая в субботу статистика из Китая показала, что экспорт из страны вырос сильнее (+9,9%), чем ожидалось (+5,5%), что косвенно говорит о стабильном спросе на китайские товары со стороны основных торговых партнеров. Денежная масса росла самыми быстрыми темпами с июня 2011 г., а без нее невозможен подъем ВВП Китая. Азиатские фондовые индексы сегодня в основном демонстрируют смешанную динамику торгов (Nikkei +0,4%; Shanghai Composite -0,6; Kospi -0,1%). Определенный негатив для нашего рынка сегодня идет со стороны слабеющего курса евро (EUR/USD 1,29) и небольшой утренней просадки в ценах на нефть. На этом фоне сегодня стоит ждать фьючерс РТС на уровне 145 тыс. п.

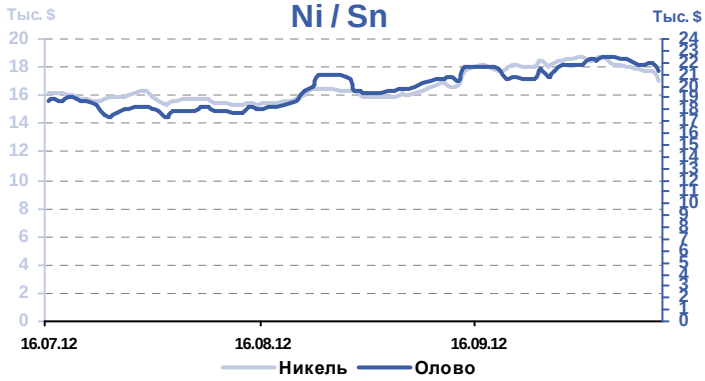
Не забываем, что 15 октября пройдет экспирация коротких опционов на индекс РТС, поэтому некоторая рисовка «нужных» уровней под закрытие сессии вполне вероятна. Сегодня в 16-30 в США выходит индекс деловой активности в производственном секторе Нью-Йорка за октябрь, а также важные данные по динамике розничных продаж за сентябрь. В 18-00 ждем данных по объемам промышленных заказов за август. До начала торгов на Уолл-стрит квартальную отчетность представит Citigroup

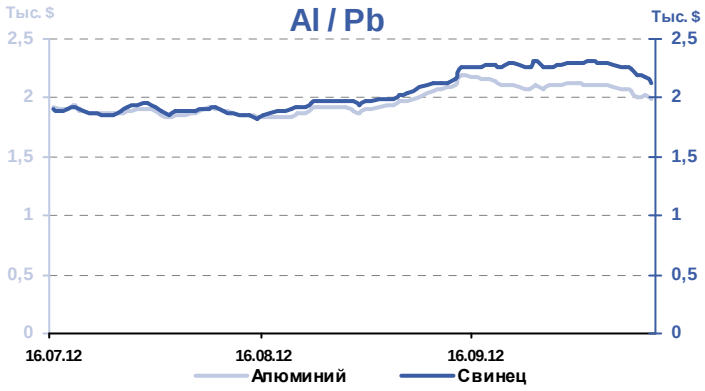
Электроэнергетика

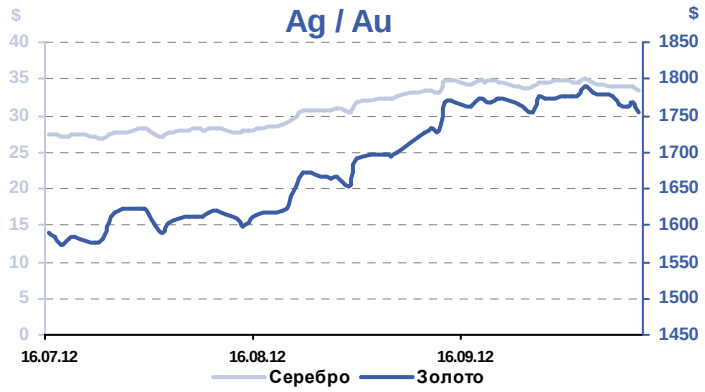
Наблюдательный совет НП «Совет рынка» на очередном заседании принял решение отменить результаты проведения конкурентного отбора мощности (КОМ) в Европейской части РФ и на Урале (Первая ценовая зона) и проведении повторного отбора по причине манипулирования в ЗСП Волга.
В соответствии с Правилами работы оптового рынка ОАО «СО ЕЭС» в 10? дневный срок проведет повторный КОМ в соответствующей ценовой зоне. Причиной повышенного уровня КОМ в ЗСП Волги, как мы считаем, является высокий процент когенерационных установок в общей мощности ЗСП. В результате, вероятно, КОМ по остальным ЗСП вряд ли сильно изменится. Что же касается ЗСП Волги, то тут цена КОМ будет понижена до приблизительно 130 тыс. рублей в месяц за МВт.

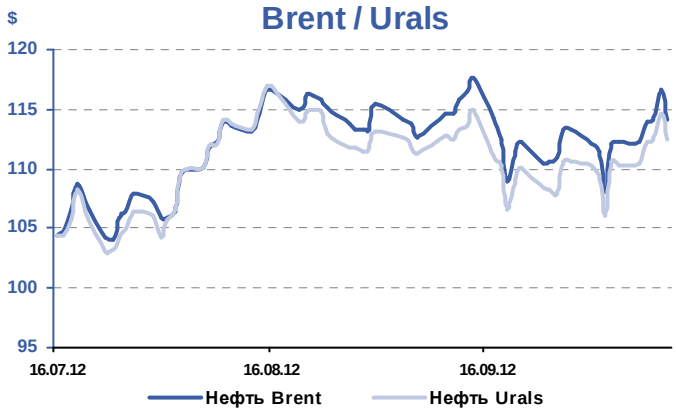
Commodities

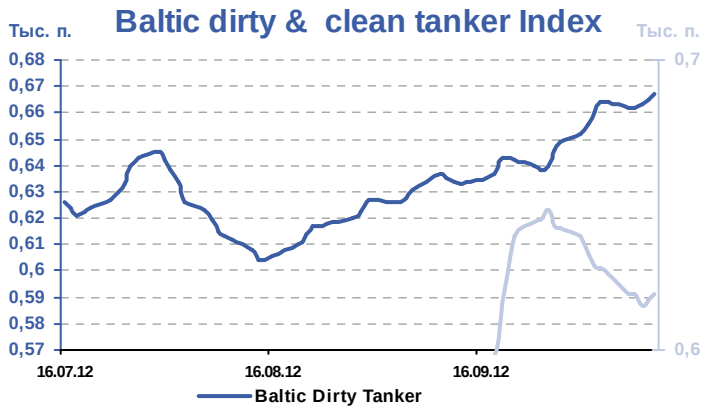












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 130,00	-1,33%	-1,99%	-2,98%	11,22%
Цинк, $/t	1 935,00	-1,63%	-6,75%	-8,55%	0,60%
Никель, $/t	17 075,00	-3,67%	-6,69%	-3,94%	-7,48%
Олово, $/t	21 315,00	-2,67%	-4,84%	-1,66%	-3,11%
Алюминий, $/t	1 994,00	-1,09%	-5,50%	-9,36%	-9,65%
Свинец, $/t	2 131,00	-2,43%	-6,86%	-5,92%	4,67%
Серебро, $/oz	33,52	-1,40%	-2,92%	-3,30%	5,11%
Золото, $/oz	1 754,48	-0,73%	-1,47%	-0,90%	5,18%
Нефть Brent, $/	114,21	-2,09%	1,74%	-2,87%	1,83%
Нефть Urals, $/	112,41	-1,89%	1,92%	-2,25%	1,72%

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	59,000	0,00%	0,00%	29 500		10 040
Газпром	GAZP	5,010	0,00%	0,00%	250 500		118 604
Лукойл	LKOH	61,900	0,00%	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%	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%	2 081		135
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	1 156		186
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	21,472	1,43%	0,00%	7 644		736
Металлургия							
НорНикель	GMKN	167,921	0,00%	0,00%	33 584		32 010
Полюс Золото	PLZL	34,300		0,00%	35 329		6 539
Северсталь	CHMF	12,698	0,00%	0,00%	12 698		10 637
Банки							
Возрождение	VZRZ	19,520	0,00%	0,00%	46 188		464
Сбербанк	SBER	2,995	0,00%	0,00%	598 000		64 653
Транспорт							
Дальневосточное МП	FESH	0,315	0,00%	0,00%	31 500		930
Потребительский рынок							
Дикси	DIXY	10,880	0,00%	0,00%	27 635		1 357
Магнит	MGNT	143,500	1,54%	0,00%	286 500		13 570
Разгуляй	GRAZ	0,453	0,00%	0,00%	6 795		72
Фармстандарт	PHST	46,000	0,00%	0,00%	10 028		1 738
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,113	0,00%	0,00%	7 669		1 829
Уголь							
Распадская	rasp	2,360	-0,51%	0,00%	165 200		1 843

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	105,516	-0,01%	
Башнефть	AK6		EUR	222,860	-5,17%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,535	1,00%	6,29
ТГК-3	AOMD		USD	2,260	-0,88%	4,56
Татнефть	ATAD		USD	40,020	-1,62%	9 147,42
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,883	-0,58%	
X5	FIVE		USD	19,330	-0,87%	7 643,26
Газпром	GAZ		EUR	7,533	-1,75%	2 082,99
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,014	0,00%	0,37
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,700	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	62,050	-0,80%	93 521,75
Лукойл	LUK		EUR	47,915	-0,30%	148,15
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,006	-0,42%	2 498,33
МТС	MBT	5	USD	17,130	-0,52%	24 752,38
МТС	MKY	5	EUR	13,285	0,00%	1,99
ТГК-3	MRO		EUR	1,739	-5,23%	13,03
Мечел	MTL	3	USD	6,810	-3,27%	14 475,56
НорНикель	NILSY	1	USD	15,580	0,26%	289,73
НорНикель	NNIA		EUR	11,940	-1,00%	50,46
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	121,300	-0,98%	28 539,28
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,038	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,950	0,36%	
Газпром	OGZD		USD	9,790	-1,21%	224 230,50
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	25,700	-1,53%	1 200,56
Ростелеком	RTL		EUR	19,760	-2,08%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,295	-0,44%	56,51
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,012	-1,61%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,199	1,72%	26,00
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,700	1,21%	362,49
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,130	-1,93%	64,17
АФКСистема	SSA	1	USD	19,900	-0,20%	7 547,75
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	5,834	-2,39%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,109	-0,24%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	77,057	-4,76%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,390	0,35%	5 938,29
ВТБ	VTBR		USD	3,432	-1,52%	14 893,19
Возрождение	VZY		EUR	14,500	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.