ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

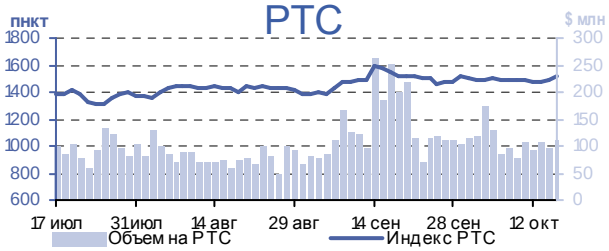
18 октября 2012г.

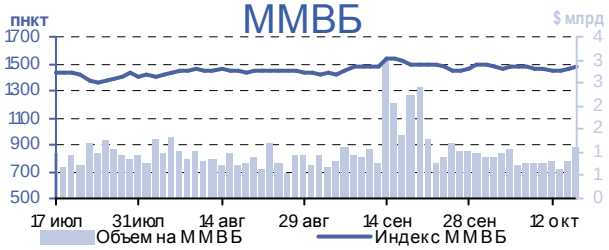
Комментарий по рынку акций

В ходе торгов в среду неплохая макростатистика по жилью в Америке добавила оптимизма индексам на Уолл-стрит. Решение агентства Moody's оставить рейтинг Испании на прежнем уровне опустило доходности по испанским и итальянским бондам до новых полугодовых минимумов. Улучшение настроений в еврозоне в свою очередь поддержало тягу игроков к покупкам рискованных активов, напротив вызвав отток средств с рынка US Treasuries. Плюс к этому, трейдеры скорректировали свои короткие позиции после того, как индекс S&P-500 стремительно отошел от нижней границы своего среднесрочного растущего тренда. Неслучайно ряд крупных американских банков за

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



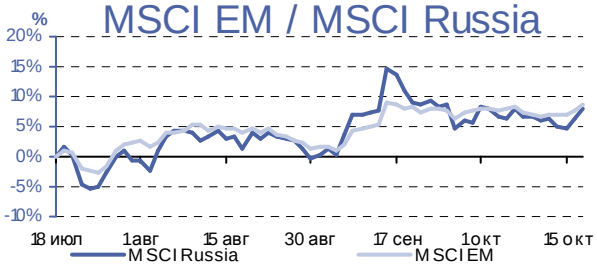


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 513,96	1,73%	2,03%	-2,18%	6,07%
Индекс ММВБ	1 474,30	1,25%	0,92%	-2,71%	3,44%
FTSE	5 910,91	0,69%	2,32%	0,73%	9,25%
S&P 500	1 460,91	0,41%	1,98%	0,11%	19,22%
Dow Jones Avg.	13 557,00	0,04%	1,59%	-0,06%	17,10%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Лукойл	64,4000	4,04%	-2,42%	25,78%
Сбербанк	3,0350	2,19%	-2,72%	16,15%
Северсталь	12,9642	2,10%	-7,51%	3,71%
Северсталь-авто	22,3000	1,50%	18,57%	129,90%
Газпром	5,0300	0,40%	-9,04%	-0,79%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1010,85	0,75%	0,40%	9,27%
Индекс MSCI BRAZIL	2710,65	-0,06%	-2,69%	-5,14%
Индекс MSCI RUSSIA	809,41	1,79%	-2,66%	7,77%
Индекс MSCI INDIA	422,56	0,26%	3,03%	2,98%
Индекс MSCI CHINA	57,96	0,95%	5,58%	14,48%

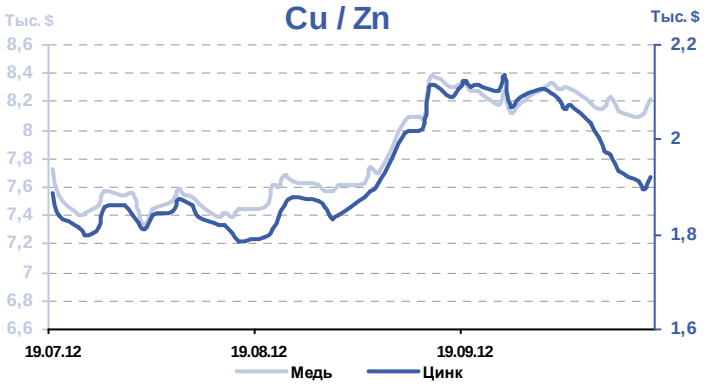
Обзор рынка

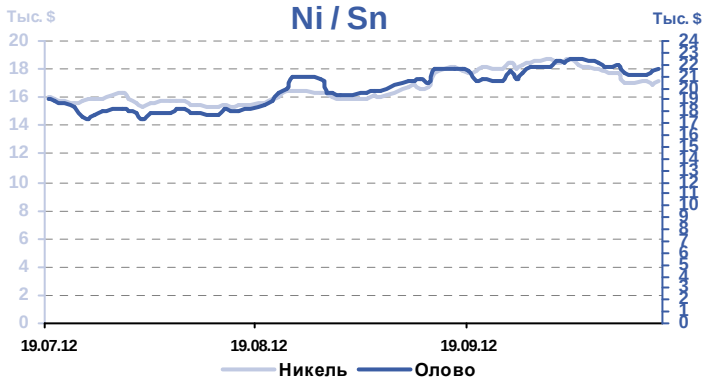
В ходе торгов в среду неплохая макростатистика по жилью в Америке добавила оптимизма индексам на Уолл-стрит. Решение агентства Moody's оставить рейтинг Испании на прежнем уровне опустило доходности по испанским и итальянским бондам до новых полугодовых минимумов. Улучшение настроений в еврозоне в свою очередь поддержало тягу игроков к покупкам рискованных активов, напротив вызвав отток средств с рынка US Treasuries. Плюс к этому, трейдеры скорректировали свои короткие позиции после того, как индекс S&P-500 стремительно отошел от нижней границы своего среднесрочного растущего тренда. Неслучайно ряд крупных американских банков за последнее время подняли прогнозы по росту индекса S&P в следующем году: Goldman Sachs ждет рынок на 1575 п.; Bank of America ожидает подъема до 1600 п.; Citigroup - до 1615 п.

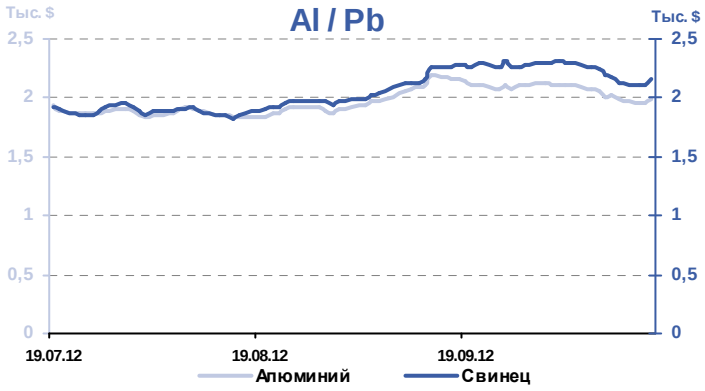
Что касается российского фондового рынка, то вчера стремительный подъем индекса ММВБ остановился возле отметки 1475 п. В ситуации, когда большие западные деньги, упорно набирают позиции на первичном и вторичном рынках российских облигаций, рынок акций становится необоснованно дешевым с точки зрения доходностей. Вчера мы видели крупные лимитированные покупки в отдельных ликвидных бумагах (Роснефть, Лукойл, Сбербанк, Северсталь). По традиции, на стремительном росте по акциям ВТБ и Газпрома можно было наблюдать закрытие коротких позиций. Думаю, сегодня днем наши фондовые индексы будут консолидироваться возле своих недельных максимумов. Волатильность фьючерса РТС вероятно будет ограничена диапазоном: 150000 – 151500 п. В свою очередь индекс ММВБ будет торговаться в районе 1470-80 п. Как правило, после фазы вялой консолидации стоит ждать продолжения предыдущего движения. Поэтому мы сохраняем прогноз на высокое закрытие по итогам этой недели.

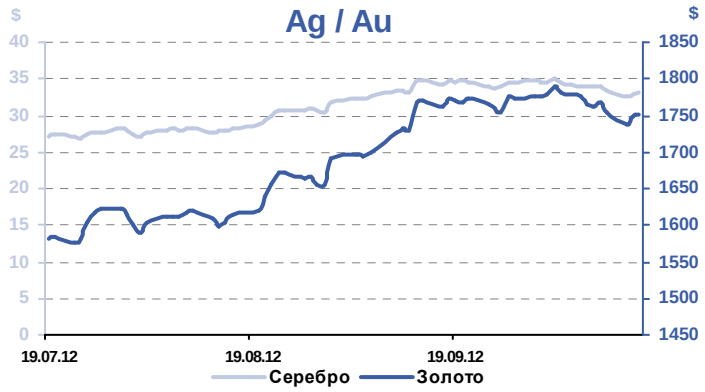
Этим утром европейские инвесторы будут реагировать на следующие новости: власти Греции достигли предварительных соглашений с Тройкой кредиторов, которая нужна стране для того, чтобы получить очередной транш финансовой помощи в 31,5 млрд. евро. Свежая статистика из Китая показала, что рост ВВП с июля по сентябрь составил 7,4%; объем промпроизводства вырос на 9,2% (ожидалось 9%); розничные продажи поднялись за квартал на 14,2% (1,46% м/м), превзойдя ожидания на 1%; инвестиции в основные средства оказались лучше прогнозов и выросли на 20,5%. Портит эту благоприятную картину решение агентства Standard & Poor's снизить кредитный рейтинг Кипра на 3 пункта: с «BB» до «B», прогноз – негативный, а также срезание рейтингов ряду испанский провинций.

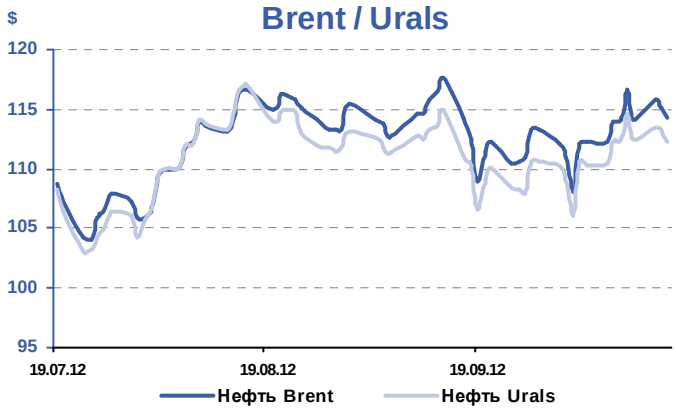
Commodities

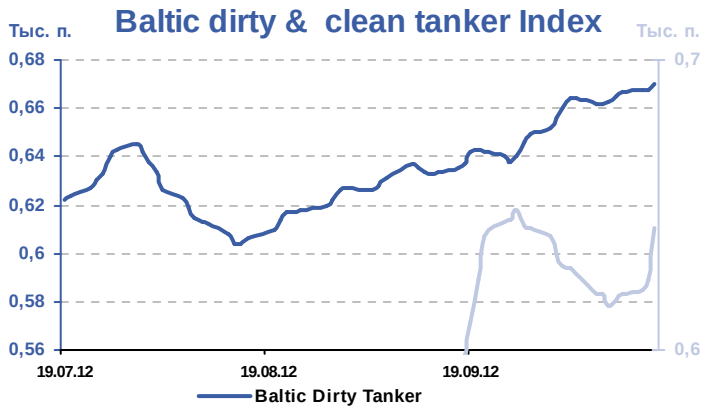












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 220,00	1,17%	0,67%	-1,19%	10,37%
Цинк, $/t	1 921,00	1,24%	-2,68%	-8,87%	2,07%
Никель, $/t	17 180,00	1,48%	-2,80%	-3,59%	-10,29%
Олово, $/t	21 570,00	0,33%	-1,17%	-0,12%	1,05%
Алюминий, $/t	1 989,00	1,64%	-0,95%	-7,92%	-9,92%
Свинец, $/t	2 159,00	2,15%	-1,73%	-5,06%	12,16%
Серебро, $/oz	33,22	0,83%	-2,23%	-4,57%	3,67%
Золото, $/oz	1 750,15	0,15%	-0,69%	-1,23%	5,57%
Нефть Brent, $/	114,29	-0,76%	0,14%	1,63%	1,43%
Нефть Urals, $/	112,21	-0,97%	-0,27%	1,79%	-0,21%

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	5,030	0,40%	0,00%	251 500		119 078
Лукойл	LKOH	64,400	4,04%	0,00%	543 525		54 776
Мегионнефтегаз	MFGS	14,650	0,00%	0,00%	5 508		1 457
Роснефть	ROSN	6,710	0,00%	0,00%	33 550		71 114
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,670	0,00%	0,00%	67 000		5 160
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	22,300	1,50%	0,00%	22 300		764
Металлургия							
Полюс Золото	PLZL	34,300	0,00%	0,00%	35 329		6 539
Северсталь	CHMF	12,964	2,10%	0,00%	12 964		10 860
Банки							
Возрождение	VZRZ	19,520	0,00%	0,00%	46 188		464
Сбербанк	SBER	3,035	2,19%	0,00%	909 000		65 516
Транспорт							
Дальневосточное МП	FESH	0,315	0,00%	0,00%	31 500		930
Потребительский рынок							
Дикси	DIXY	11,000	0,00%	0,00%	220 000		1 372
Магнит	MGNT	144,500	0,00%	0,00%	144 500		13 664
Разгуляй	GRAZ	0,453	0,00%	0,00%	6 795		72
Фармстандарт	PHST	45,000	0,00%	0,00%	10 035		1 701
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,113	0,00%	0,00%	7 669		1 829
Уголь							
Распадская	rasp	2,268	0,00%	0,00%	47 637		1 771

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	103,500	-0,26%	
Башнефть	AK6		EUR	220,480	0,65%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,620	-1,57%	4,93
ТГК-3	AOMD		USD	2,260	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	43,000	5,01%	16 395,94
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,840	-0,43%	
X5	FIVE		USD	19,250	0,00%	23 508,34
Газпром	GAZ		EUR	7,696	0,96%	929,08
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,013	-4,41%	0,26
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,700	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	64,450	2,14%	210 331,20
Лукойл	LUK		EUR	48,866	0,96%	297,99
Лукойл	LUKOY	1	USD	64,480	2,35%	14 120,64
МТС	MBT	5	USD	17,550	1,92%	55 109,72
МТС	MKY	5	EUR	13,395	1,63%	3,93
ТГК-3	MRO		EUR	1,818	4,18%	12,00
Мечел	MTL	3	USD	7,180	5,12%	17 339,98
НорНикель	NILSY	1	USD	15,930	0,50%	1 968,79
НорНикель	NNIA		EUR	12,185	0,33%	27,45
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	125,300	3,90%	36 478,25
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,038	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	7,050	0,36%	
Газпром	OGZD		USD	10,120	1,96%	229 782,60
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,610	2,07%	1 623,02
Ростелеком	RTL		EUR	20,275	1,48%	8,10
Газпромнефть	SCF		EUR	19,785	0,84%	15,10
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,123	1,58%	7,10
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,171	-0,81%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,800	2,26%	2 038,89
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,394	1,89%	139,18
АФКСистема	SSA	1	USD	19,720	0,00%	8 728,57
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	5,405	-2,58%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,096	-0,19%	
СТЗ	SVY		EUR	25,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	80,000	0,00%	4,00
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,030	0,00%	15 595,97
ВТБ	VTBR		USD	3,562	2,53%	27 537,83
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.