ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

# Ежедневный обзор рынка акций

24 октября 2012г.

## Комментарий по рынку акций

Самое неприятное движение рынка то, причины которого не совсем понятны. Тем более, неприятно, когда активное снижение проходит сразу после дня роста. Это очень похоже на попытки слома растущего тренда. Что-то подобное на наших биржах мы видели в апреле этого года, когда локальные движения вверх были слишком краткосрочными, а недельные минимумы становились постепенно все ниже.

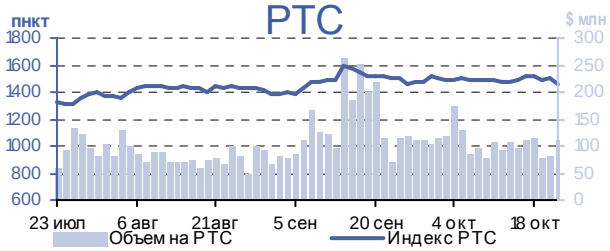
Фундаментальных причин для обвала рынков вроде бы нет: американский ЦБ продолжает печатать деньги (за последнюю неделю баланс ФРС вырос на $36 млрд.) ; доходности

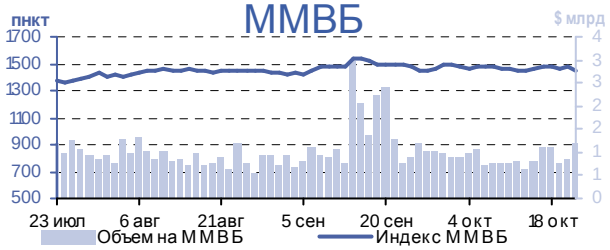
*Полный текст на 2 стр.*

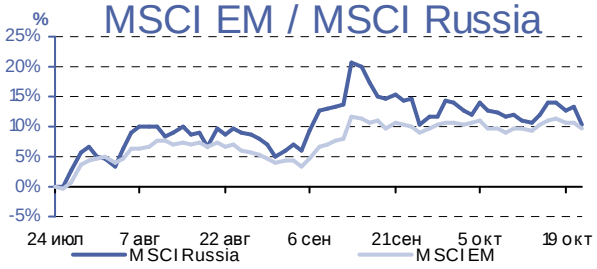
## Значение основных индексов

| | Значение | Δ, день | Δ, нед | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|---|
| Индекс РТС | 1 456,73 | -2,73% | -2,11% | -3,50% | -3,45% |
| Индекс ММВБ | 1 455,31 | -1,33% | -0,05% | -2,32% | -1,85% |
| FTSE | 5 797,91 | -1,44% | -1,24% | -0,70% | 4,50% |
| S&P 500 | 1 413,11 | -1,44% | -2,87% | -3,01% | 12,67% |
| Dow Jones Avg. | 13 102,53 | -1,82% | -3,32% | -3,37% | 9,98% |

## Основные индикаторы




## Лидеры снижения

| | Цена | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Распадская | 2,0900 | -8,33% | -10,07% | -35,49% |
| Сбербанк | 2,9700 | -2,08% | -1,66% | 15,56% |
| Северсталь-авто | 22,0744 | -1,01% | 17,37% | 127,57% |
| Лукойл | 63,3000 | -0,55% | -0,31% | 23,63% |

## Индекс *MSCI*

| | Значение | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Индекс MSCI EM | 996,82 | -1,04% | -0,75% | 5,00% |
| Индекс MSCI BRAZIL | 2624,54 | -1,69% | -5,39% | -10,13% |
| Индекс MSCI RUSSIA | 783,07 | -2,55% | -3,51% | -2,06% |
| Индекс MSCI INDIA | 416,75 | -0,94% | -0,72% | 1,55% |
| Индекс MSCI CHINA | 59,19 | 0,00% | 7,08% | 12,84% |

# Обзор рынка

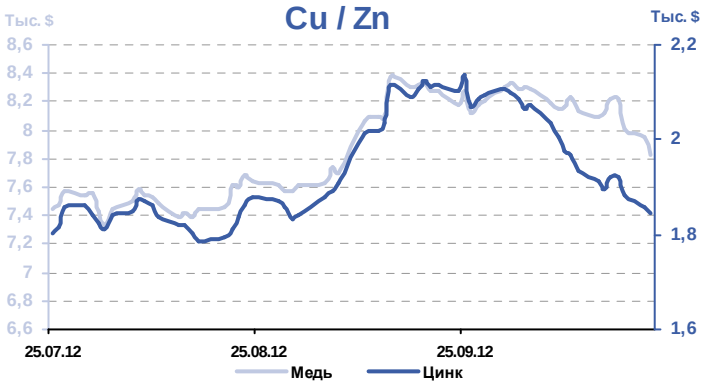
Самое неприятное движение рынка то, причины которого не совсем понятны. Тем более, неприятно, когда активное снижение проходит сразу после дня роста. Это очень похоже на попытки слома растущего тренда. Что-то подобное на наших биржах мы видели в апреле этого года, когда локальные движения вверх были слишком краткосрочными, а недельные минимумы становились постепенно все ниже.

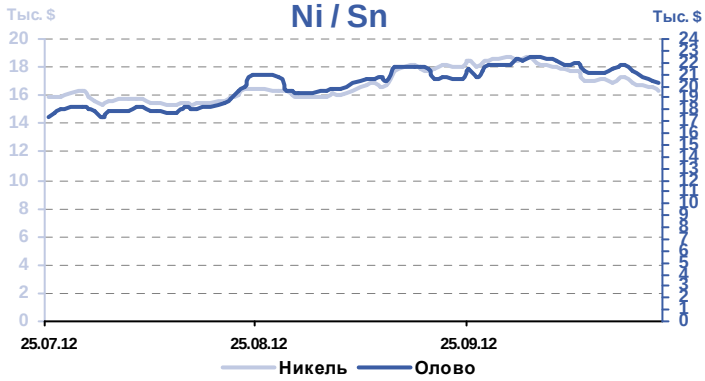
Фундаментальных причин для обвала рынков вроде бы нет: американский ЦБ продолжает печатать деньги (за последнюю неделю баланс ФРС вырос на $36 млрд.).; доходности «проблемных» стран еврозоны далеки от месячных максимумов; курс евро торгуется в диапазоне 1,2950 – 1,3120; цены на нефть Brent во вторник сходили на нижнюю границу (107-115 $/барр.) бокового диапазона последних месяцев. Тем не менее, рынки наполнены неопределенностями в части способности ведущих компаний поддерживать темпы роста своих прибылей, предстоящих президентских выборов в США, Fiscal Cliff и т.п. Поэтому мы имеем волатильность на фондовых биржах и резкие смены настроений биржевых игроков.

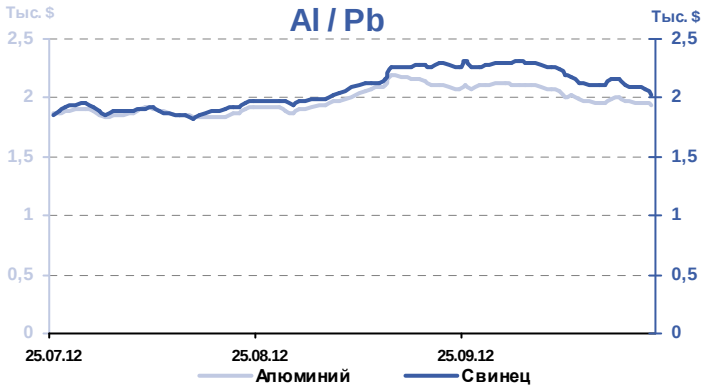
Слабость цен на нефть вкупе с укреплением курса доллара дала толчок к росту валютной пары USD/RUR до отметки в 31,40. Эти факторы вчера вечером обвалили фьючерс РТС до минимальных уровней с конца сентября (144600 п.). Однако закрытие основной торговой сессии состоялось ровно на отметке 145 тыс. п. Примечательно, что и индекс ММВБ благодаря акциям Роснефти (+2,85%), Сбербанка (-0,54%) и ГМК (+0,06%) сумел удержаться по итогам дня (1455 п.; -1,29%) выше уровня выше минимума понедельника. Даже, несмотря на продажи и негативный внешний фон наш рынок акций вчера торговался сильнее ведущих европейских бирж (германский DAX вчера рухнул до 1,5-месячных минимумов).

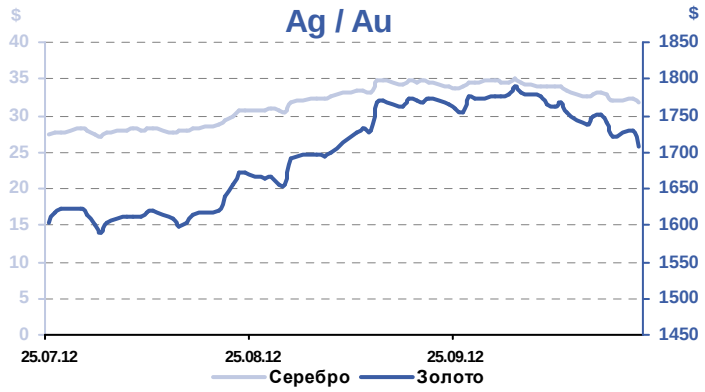
В среду мы ждем открытия торгов на нашем рынке акций в зеленой зоне благодаря плюсующим американским фьючерсам (S&P+0,35%), восстановлению цен на нефть (Brent $109/барр) и нейтрально-негативной динамике торгов в Азии (MSCI Asia -0,3%). Согласно данным банка HSBC китайский индекс деловой активности PMI в обрабатывающей промышленности в октябре вырос до отметки 49,1 п., против 47,9 п. в сентябре. Сегодня утром выходит целая серия отчетов по индексам PMI по обрабатывающей промышленности, сфере услуг и деловому доверию IFO ведущих стран еврозоны. Будем надеяться, эти данные помогут восстановить рынкам утраченные вчера позиции

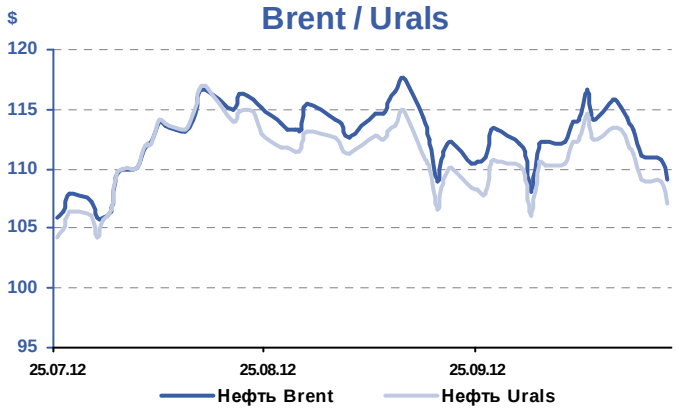
# Commodities

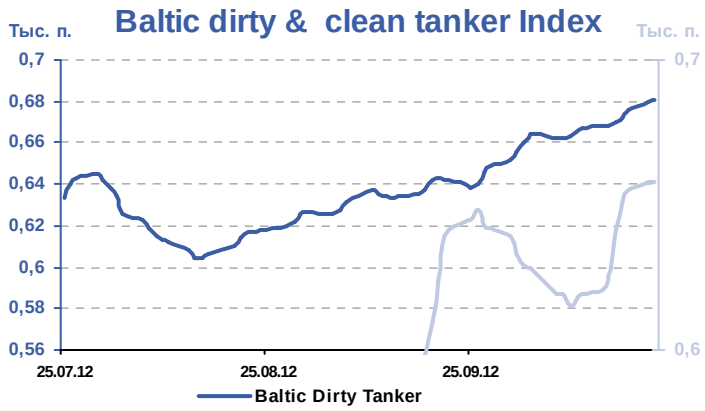



## Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

| | Значение | Δ за день, % | Δ за нед,% | Δ за мес,% | Δ ytd,% |
|---|---|---|---|---|---|
| Медь, $/t | 7 831,00 | -1,53% | -3,62% | -4,30% | 2,57% |
| Цинк, $/t | 1 847,00 | -0,48% | -2,66% | -12,17% | -1,55% |
| Никель, $/t | 16 355,00 | -1,42% | -3,40% | -9,01% | -18,20% |
| Олово, $/t | 20 255,00 | -1,05% | -5,79% | -1,91% | -10,16% |
| Алюминий, $/t | 1 947,00 | -0,66% | -0,51% | -6,39% | -12,22% |
| Свинец, $/t | 2 023,00 | -2,13% | -4,28% | -10,76% | 0,20% |
| Серебро, $/oz | 31,69 | -2,26% | -3,83% | -6,77% | -0,24% |
| Золото, $/oz | 1 707,65 | -1,21% | -2,29% | -3,22% | 3,28% |
| Нефть Brent, $/ | 109,09 | -1,49% | -5,28% | -1,20% | -2,73% |
| Нефть Urals, $/ | 107,01 | -1,70% | -5,56% | -1,25% | -3,55% |

# Российский рынок акций

| Эмитент | Тикер | Цена закрытия, $ | Δ РТС | Δ ММВБ | Объем на РТС, $ | Объем на ММВБ, $ | Капитализация, m$ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ОАО ТНК-ВР Холдинг | TNBP | 2,050 | -18,97% | 0,00% | 1 751 500 | | 30 744 |
| **Нефть и газ** | | | | | | | |
| Башнефть | BANE | 59,000 | 0,00% | 0,00% | 29 500 | | 10 040 |
| Газпром | GAZP | 5,030 | 0,00% | 0,00% | 251 500 | | 119 078 |
| Лукойл | LKOH | 63,300 | -0,55% | 0,00% | 316 500 | | 53 841 |
| Мегионнефтегаз | MFGS | 16,100 | 0,00% | 0,00% | 6 440 | | 1 602 |
| 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 | RTKM | 4,397 | 0,00% | 0,00% | 4 956 | | 12 943 |
| 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 | 22,074 | -1,01% | 0,00% | 28 697 | | 756 |
| **Металлургия** | | | | | | | |
| Полюс Золото | PLZL | 34,300 | 0,00% | 0,00% | 35 329 | | 6 539 |
| Северсталь | CHMF | 12,918 | 0,00% | 0,00% | 43 456 | | 10 822 |
| **Банки** | | | | | | | |
| Возрождение | VZRZ | 19,520 | 0,00% | 0,00% | 46 188 | | 464 |
| Сбербанк | SBER | 2,970 | -2,08% | 0,00% | 4 682 773 | | 64 113 |
| **Транспорт** | | | | | | | |
| Аэрофлот | AFLT | 1,300 | | 0,00% | 19 500 | | 1 444 |
| Дальневосточное МП | FESH | 0,320 | 0,00% | 0,00% | 32 000 | | 944 |
| **Потребительский рынок** | | | | | | | |
| Дикси | DIXY | 10,850 | -1,36% | 0,00% | 10 850 | | 1 354 |
| Магнит | MGNT | 147,700 | 0,00% | 0,00% | 75 302 | | 13 967 |
| Разгуляй | GRAZ | 0,453 | 0,00% | 0,00% | 6 795 | | 72 |
| Фармстандарт | PHST | 44,000 | 0,00% | 0,00% | 10 032 | | 1 663 |
| **Нефтехимия и нефтепереработка** | | | | | | | |
| Ярославнефтеоргсинтез | JNOS | 0,610 | 0,00% | 0,00% | 122 061 | | 569 |
| **Химическая промышленность** | | | | | | | |
| Акрон | AKRN | 45,113 | 0,00% | 0,00% | 7 669 | | 1 829 |
| **Уголь** | | | | | | | |
| Распадская | rasp | 2,090 | -8,33% | 0,00% | 128 800 | | 1 616 |

*Источник: РТС, 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.