ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

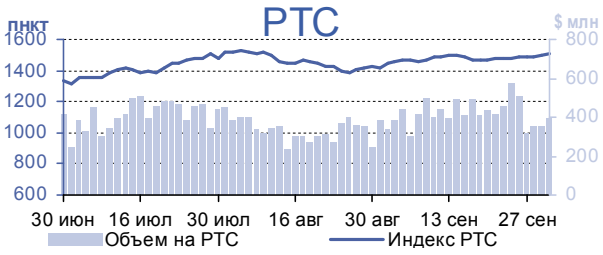
1 октября 2010г.

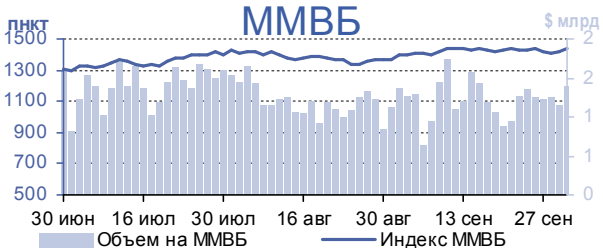
Комментарий по рынку акций

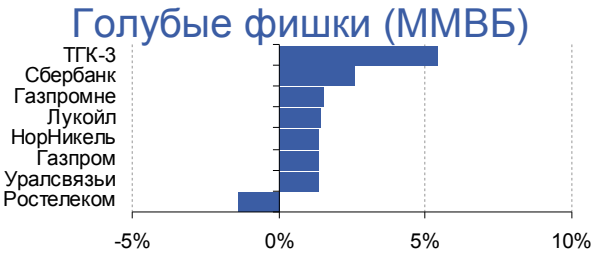
Когда заокеанские инвесторы разрывают рынки вверх на явном негативе, а через день снижаются на очевидном позитиве, это вводит в заблуждение неискушенную биржевую публику. Так получилось и вчера: фондовые площадки США завершили день снижением биржевых индексов даже, несмотря на благоприятные данные статистики. Тем не менее, любому поведению рынка, постфактум можно дать логичное объяснение. Итак, в сентябре уровень деловой активности в США вырос, на что указал рост индекса PMI до отметки 60,4 п. по сравнению с 56,7 п. в прошлом месяце. Статистика по числу первоначальных обращений за пособием по безработице в США на прошлой неделе показала

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы







MSCI EM / MSCI Russia

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 507,66	0,85%	2,07%	3,98%	20,18%
Индекс ММВБ	1 440,30	1,49%	0,71%	3,28%	20,31%
FTSE	5 548,62	-0,37%	0,03%	3,40%	8,08%
S&P 500	1 141,20	-0,31%	1,46%	5,64%	7,96%
Dow Jones Avg.	10 788,05	-0,44%	1,18%	5,05%	11,08%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО РОСИНТЕР	18,0000	22,87%	20,00%	150,00%
ОАО Красный Октябрь, п.	7,0000	12,00%	-22,22%	-41,67%
ОГК-3	0,0539	4,97%	8,79%	5,59%
НорНикель	169,5000	4,63%	0,89%	22,83%
Аптечная сеть 36,6	3,6500	4,29%	37,98%	-67,56%
Ленэнерго, п.	1,0250	3,54%	13,89%	31,41%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,2714	3,37%	35,68%	69,59%
Дальневосточное МП	0,4250	2,41%	5,99%	32,81%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
РБК ИС	1,1600	-4,13%	3,85%	-27,50%
ОАО Группа ЛСР	27,0000	-3,57%	0,00%	51,69%
Газпром	5,1800	-0,71%	-3,90%	-10,69%
ОГК-1	0,0360	-0,50%	3,51%	41,25%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1075,53	0,48%	8,67%	17,67%
Индекс MSCI BRAZIL	3665,23	1,04%	6,42%	13,39%
Индекс MSCI RUSSIA	800,10	1,25%	3,58%	11,08%
Индекс MSCI INDIA	548,52	0,46%	13,94%	25,85%
Индекс MSCI CHINA	65,87	-0,24%	7,79%	11,32%

Обзор рынка

Когда заокеанские инвесторы разрывают рынки вверх на явном негативе, а через день снижаются на очевидном позитиве, это вводит в заблуждение неискушенную биржевую публику. Так получилось и вчера: фондовые площадки США завершили день снижением биржевых индексов даже, несмотря на благоприятные данные статистики. Тем не менее, любому поведению рынка, постфактум можно дать логичное объяснение. Итак, в сентябре уровень деловой активности в США вырос, на что указал рост индекса PMI до отметки 60,4 п. по сравнению с 56,7 п. в прошлом месяце. Статистика по числу первоначальных обращений за пособием по безработице в США, на прошлой неделе показала снижение на 16 тыс. до 453 тыс., что также оказалось лучше прогноза. Видимо инвесторы посчитали, что такие позитивные данные снижают желание ФРС принимать меры дополнительного стимулирования экономики. Плюс к этому Бен Бернанке заявил вчера, что ФРС больше не будет предоставлять средства спасения, подобно тому, как это было с AIG.

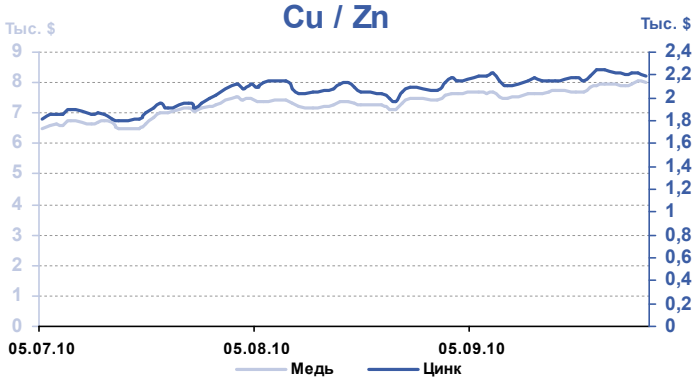
За последние сутки валютная пара EUR/USD так и не смогла преодолеть планку 1,3670. На фоне последней сильной статистике из США участники валютного рынка уже не решаются активно играть против ослабления доллара. Кстати, согласно последнему отчету МВФ, доля доллара в мировых валютных резервах во 2-м квартале возросла до 62,1% по сравнению с 61,7% в 1 кв. Цены на золото после вчерашнего рекорда ($1316/унц) к утру пятницы стабилизировались на отметке $1309/унц. А вот цены на нефть Brent продолжают рост, начатый в среду. Сегодня котировки североморской нефти поднялись к отметке $82,8/барр. Думаю, нефтетрейдерам будет под силу дотянуть цены до ближайшего уровня сопротивления на $83,2/барр. Сегодняшние торги на азиатско-тихоокеанских биржах проходят в разнополярных областях. Вышедшая статистика из Китая показала, что активность в секторе обрабатывающей промышленности страны в сентябре выросла сильнее, чем ожидали аналитики: PMI 53,8 против 51,7 в августе.

Открытие торгов на российских биржах мы ожидаем увидеть в умеренно-позитивной зоне. Снижение заокеанских индексов компенсируется растущими фьючерсами (S&P+0,2%) и новыми месячными максимумами цен на «черное золото». Думаю, что слабый доллар в купе с сильным движением вверх в ценах на нефть способны поднять индекс ММВБ к 1450 пунктам. В этой игре на повышение наиболее выигрышно смотрятся такие индексные бумаги, как Сбербанк, Газпром, ГМК, Роснефть. По итогам этой недели мы рассчитываем увидеть сильное закрытие наших индексов, что автоматически повышает шансы на рост в начале следующей.

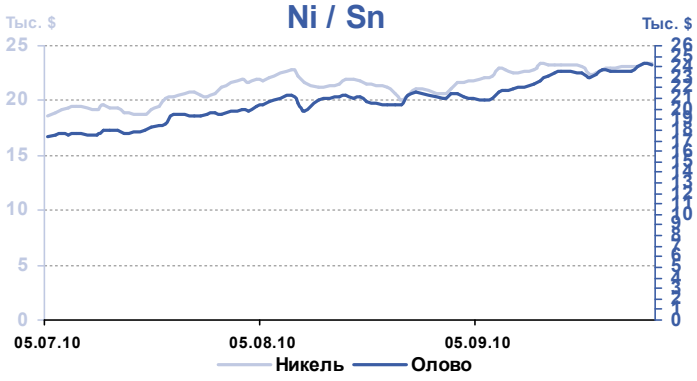
В пятницу днем ждем блока статистики из еврозоны, которая может изменить расстановку сил по паре EUR/USD. В 12-00 ждем данных из еврозоны по индекс деловой активности в производственном секторе (PMI Manufacturing). Аналогичный индикатор из Великобритании выходит в 12-30. В 13-00 ждем статистики по безработице из еврозоны. В 16-30 Министерство торговли США опубликует данные по личным расходам и доходам американцев за август. В 17-55 университет Мичигана выпустит отчёт по индексу потребительского доверия США за сентябрь (прогноз: 67,1 п.). В 18-00 выйдут данные индекса деловой активности в производственном секторе США (индекс ISM Manufacturing) за сентябрь. В 18-00 выходит статистика по объёму расходов на строительство в США за август (прогноз: -0,4%).

Commodities

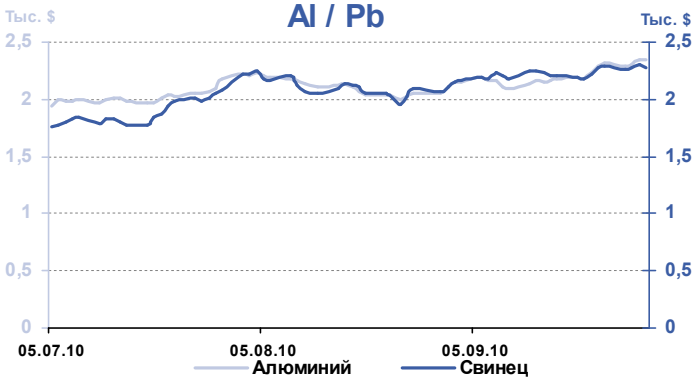
Cu / Zn



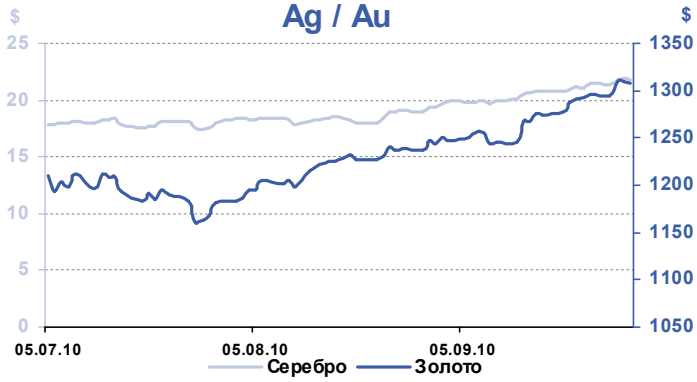
Ni / Sn



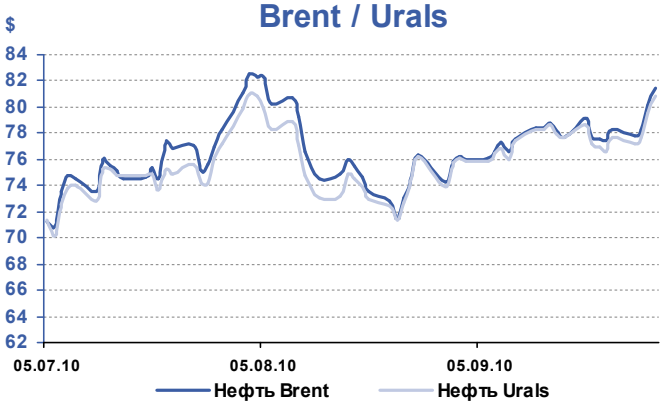
Al / Pb



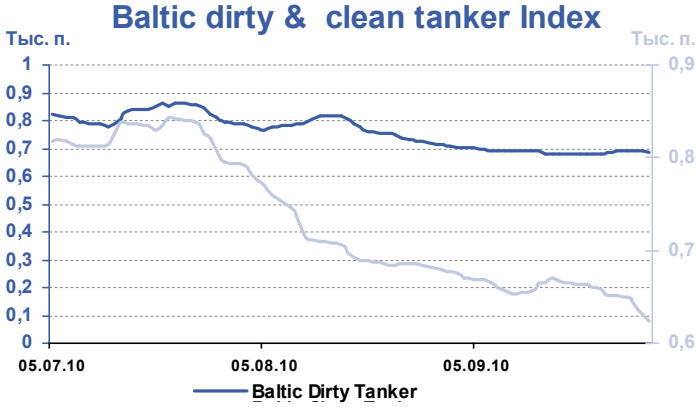
Ag / Au



Brent / Urals



Baltic dirty & clean tanker Index



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 014,00	-0,62%	1,64%	5,36%	30,12%
Цинк, $/t	2 195,00	-1,35%	-2,44%	2,91%	11,48%
Никель, $/t	23 400,00	0,21%	2,86%	11,16%	30,76%
Олово, $/t	24 250,00	-0,31%	2,34%	13,05%	62,75%
Алюминий, $/t	2 351,00	0,43%	2,57%	11,53%	24,39%
Свинец, $/t	2 278,00	-0,96%	0,13%	7,71%	-0,26%
Серебро, $/oz	21,75	-0,75%	2,98%	12,37%	30,68%
Золото, $/oz	1 308,35	-0,11%	1,23%	5,15%	29,84%
Нефть Brent, $/	81,42	1,70%	5,18%	7,34%	20,32%
Нефть Urals, $/	80,90	1,71%	5,67%	6,86%	18,40%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,545	0,00%	0,18%		23 536	273
БашИнСв	BISV	0,141	0,00%	-2,16%		215	136
БашЭнрг	BEGY	2,248	0,00%	3,08%		299 020	2 269
ВМЗ	VSMZ	1350,909	0,00%	1,85%		43 229	2 320
ДВМП	FESH	0,426	0,00%	-0,46%		42 404	1 256
КазанскВЗ	KHEL	1,854	0,00%	-1,22%		688 162	286
КОМСТАР	CMST	6,550	0,00%	-0,01%		385	2 729
Мечел	MTLR	25,053	0,00%	2,82%		720 497	10 306
Мотовил	MOTZ	0,090	0,00%	-0,44%		4 630	89
Новсибэнрг	NVNG	32,873	0,00%	1,40%		645	436
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,238	0,00%	-1,27%		185 852	2 113
Сильвинит	SILV	653,349	0,00%	0,50%		642 912	5 150
СинТЗ-ао	SNTZ	61,698	0,00%	0,00%		247	388
Славн-ЯНОС	JNOS	0,460	0,00%	0,00%		322	429
СТЗ-ао	SVTZ	6,252	0,00%	0,00%		31	301
ТАГМЕТ	TAMZ	0,742	0,00%	0,48%		74	377
У-УАЗ	UUAZ	1,365	0,00%	2,41%		46 546	362
ЧМК	CHMK	274,112	0,00%	2,09%		169 690	857
ЧТПЗ	CHEP	1,947	0,00%	1,52%		275 877	921
ЮжКузб.	UKUZ	41,919	0,00%	0,79%		18 734	1 510
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,000	0,00%	0,00%	297 119		7 317
Газпром	GAZP	5,180	-0,71%	1,36%	777 000	284 997 332	122 629
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	1,52%	457 750	3 520 375	18 064
Лукойл	LKOH	56,300	0,00%	1,46%	84 350	94 284 776	47 887
НОВАТЭК	NVTK	7,740	0,00%	0,00%	7 740		23 501
Роснефть	ROSN	6,628	-0,32%	1,57%	22 872	99 848 737	70 241
Сургутнефтегаз	SNGS	0,995	0,00%	1,25%	99 500	17 188 321	35 547
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,471	0,00%	0,77%	353 250	8 252 443	3 628
Татнефть, п.	TATNP	2,345	0,00%	0,00%	259 641		346
Транснефть, п.	TRNFP	1160,000	1,75%	1,12%	34 800	24 810 615	1 734
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,000	0,00%	0,00%	19 750		2 085
Иркутскэнерго	IRGZ	0,745	0,00%	0,31%	132 375	158 973	3 551
Ленэнерго	LSNG	0,770	0,65%	0,85%	38 500	47 937	713
МОЭСК	MSRS	0,046	0,00%	0,36%		253 762	2 246
ОГК-2	OGKB	0,052	0,00%	0,00%	667 756		1 702
ОГК-3	OGKC	0,054	4,97%	0,30%	91 545	558 061	2 557
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	44 500		5 611
ОГК-5	OGKE	0,088	0,00%	1,64%	34 192	179 638	3 109
ТГК-3	MSNG	0,106	0,00%	5,41%	35 587	12 514 853	4 213
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-0,60%	5 500	253 361	677
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	4,55%	8 859	324 079	950
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,145	0,30%	0,00%	185 663		137
ВолгаТелеком	NNSI	3,620	0,00%	0,00%	108 400		890
МГТС	MGTS	13,000	0,00%	0,00%	13 000		1 038
МТС	MTSS	8,280	1,47%	0,00%	82 800		16 505
Ростелеком	RTKM	4,420	0,00%	-1,41%	217 900	3 288 588	3 221
Ростелеком, п.	RTKMP	2,900	0,00%	-0,46%	6 574	6 633 642	704
СЗТ	SPTL	0,780	0,00%	0,04%	39 000	438 532	687
СибирьТелеком	ENCO	0,066	0,00%	0,00%	7 304		798
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	-1,24%		7 827	108
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	1,36%	77 000	5 255 678	1 244
ЦентрТелеком	ESMO	0,840	0,00%	0,00%	4 200		1 326
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,925	0,00%	0,19%	291 450	2 102 745	1 284
ГАЗ	GAZA	31,900	0,00%	0,00%	9 570		589

ИРКУТ	IRKT	0,291	0,00%	0,53%		36 562	281
Казанский ВЗ	KHEL	1,880	0,00%	0,00%	57 274		290
КАМАЗ	KMAZ	2,407	0,00%	0,42%	120 325	38 284	1 702
Кировский завод	KIRZ	11,000	0,00%	0,00%	11 000		120
Красный Котельщик	KRKO	0,550		0,00%	2 750		117
ОМЗ	OMZZ	2,600	0,00%	0,78%	13 000	8 801	92
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	0,00%	30 000	2 013	337
Северсталь-авто	SVAV	15,930	0,00%	-0,37%	54 959	378 503	546
Силовые машины	SILM	0,230	0,00%	0,00%	64 400		2 003
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,550	0,00%	0,00%	82 500		274
Бурятзолото	BRZL	28,000	0,00%	0,00%	28 000		197
ВСМПО	VSMO	91,250	0,00%	1,10%	92 125	75 306	1 052
Мечел	MTLR	24,450	1,24%	0,00%	171 150		10 178
ММК	MAGN	0,984	0,00%	0,17%		3 172 332	11 011
НЛМК	NLMK	3,578	0,00%	1,36%		2 385 908	21 359
НорНикель	GMKN	169,500	4,63%	1,39%	169 500	111 813 911	32 311
Полиметалл	PMTL	16,000	0,00%	1,39%	16 000	1 990 176	6 390
Полюс Золото	PLZL	44,300	0,00%	1,65%	88 800	8 241 808	8 445
Северсталь	CHMF	14,864	0,00%	-0,61%	20 824	22 942 214	14 978
ТМК	TRMK	4,050	0,00%	1,04%	31 396	1 026 543	3 797
ЧТПЗ	CHEP	1,730	0,00%	0,00%	25 950		817
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,177	0,00%	-0,79%		43 074	4 954
Возрождение	VZRZ	36,000	0,00%	0,63%	108 000	92 385	855
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	3,17%	5 585 831	89 081 998	28 557
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	-0,01%	6 120	10 920	2 687
Сбербанк	SBER	2,805	1,08%	0,00%	3 310 708		60 551
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	965		1 287
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,140	0,00%	2,15%	53 500	1 478 190	2 377
Дальневосточное МП	FESH	0,425	2,41%	0,00%	6 375		1 254
НМТП	NMTP	0,127	0,00%	1,83%		462 620	2 449
Приморское МП	PRIM	0,178	0,00%	1,78%		4 580	139
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,650	4,29%	0,00%	16 425		383
Балтика	PKBA	33,077	0,00%	-0,30%		59 562	3 954
Верофарм	VRPH	37,450	0,00%	0,00%	524 300		375
Вимм-Билль-Данн	WBDF	49,850	0,00%	0,60%	49 850	67 534	2 200
Дикси	DIXY	10,350	1,67%	0,94%	37 374	138 236	890
Концерн Калина	KLNA	18,000	0,00%	3,40%	450 000	10 344	176
Красный Октябрь	KROT	10,217	0,00%	0,97%		4 847	93
Магнит	MGNT	116,000	1,75%	3,46%	58 000	541 447	10 321
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,250	0,00%	0,15%	313	2 156	20
Разгуляй	GRAZ	1,490	0,00%	-0,02%	14 900	220 212	236
Фармстандарт	PHST	76,000	0,00%	-1,16%	76 125	470 226	2 872
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	1,21%	24 000	238 766	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,183	0,00%	0,00%	160 705		326
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,550	0,00%	-1,04%	27 500	2 822	886
Уфанефтехим	UFNC	4,550	0,00%	0,00%	9 055		1 253
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	280,000	0,00%	0,00%	28 000		390
ПИК	pikk	3,900	0,00%	0,00%	5 004	2 142 273	1 924
РБК ИС	RBCI	1,160	-4,13%	0,87%	192 560	700 418	162
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,200	1,00%	1,09%	501 803	967 833	1 440
Дорогобуж	DGBZ	0,515	0,00%	0,00%	5 150	2 988	371
Сильвинит	SILV	652,000	0,00%	0,00%	65 200		5 102
Уралкалий	URKA	4,378	0,00%	-1,25%		11 048 202	9 334
Уголь							
Белон	BLNG	0,860	0,00%	0,00%	86 000		989
Распадская	rasp	5,630	0,00%	0,54%	329 300	6 388 990	4 396
УК Южный Кузбасс	UKUZ	40,000	0,00%	0,00%	14 000		1 444

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	156,920	1,49%	
Башнефть	AK6		EUR	157,000	0,64%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,540	-0,65%	4,74
ТГК-3	AOMD		USD	11,480	11,46%	108,80
Татнефть	ATAD		USD	31,290	2,19%	8 040,36
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,100	2,11%	4,25
Бурятзолото	BYT		EUR	19,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,020	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,450	-0,31%	1 853,60
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	29,850	3,65%	56 549,94
X5	FIVE		USD	40,000	1,27%	10 561,57
Газпром	GAZ		EUR	15,350	0,95%	1 042,00
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,050	-0,84%	5,40
ЮТК	KUE		EUR	6,000	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	-4,76%	0,42
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	4,500	12,50%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,810	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,800	1,07%	218 008,90
Лукойл	LUK		EUR	41,460	0,63%	502,95
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,700	0,60%	6 236,56
МТС	MBT	5	USD	21,230	1,00%	63 058,50
МТС	MKY	5	EUR	15,315	0,26%	2,10
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,860	3,42%	241,09
Мечел	MTL	3	USD	24,900	1,18%	56 568,35
НорНикель	NILSY	1	USD	16,950	0,12%	557,57
НорНикель	NNIA		EUR	12,380	-0,04%	15,48
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	85,900	3,25%	27 628,34
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,400	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,618	-4,92%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,950	-3,66%	
Газпром	OGZD		USD	20,990	1,40%	297 248,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,200	-16,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,450	0,00%	
Ростелеком	RTL		EUR	19,200	-1,54%	
Газпромнефть	SCF		EUR	13,850	-0,36%	66,29
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,000	2,19%	3,05
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,420	0,88%	29,72
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,680	1,08%	10 478,80
АФКСистема	SSA	1	USD	27,000	5,06%	26 191,92
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	45,000	-8,16%	0,59
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	22,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	155,000	4,03%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,560	0,00%	0,55
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,350	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,850	2,34%	31 065,61
ВТБ	VTBR		USD	5,755	2,95%	62 692,31
Возрождение	VZY		EUR	26,250	1,94%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	22,620	0,35%	16 048,17
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	16,250	-1,40%	

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

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Синельщикова Екатерина
skat@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 ЗАО "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.