ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

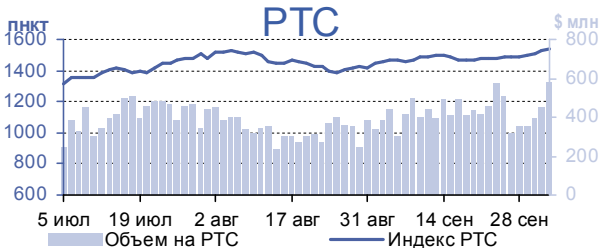
5 октября 2010г.

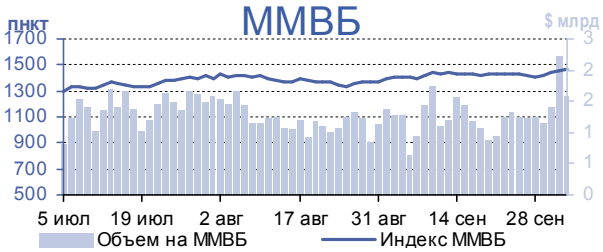
Комментарий по рынку акций

В понедельник фондовые индексы США закрылись с потерями около 1%. Беспокойство инвесторов в части госдолга ряда «проблемных» стран еврозоны, а также слабые макроэкономические данные обусловили нежелание участников рынка покупать рискованные активы. Снижение рекомендаций со стороны Goldman Sachs по акциях таких знаковых компаний, как Microsoft и Macy's игроки не смогли проигнорировать накануне приближающегося сезона корпоративной отчётности. Статистика по объему промышленных заказов за август показала снижение на 0,5% м/м (хуже прогноза), в то время, как продажи на вторичном рынке жилья выросли в августе на 4,3%, хотя и

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





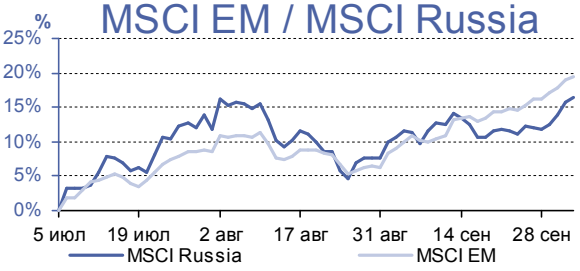
Голубые фишки (ММВБ)

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 542,58	0,70%	3,68%	5,11%	25,70%
Индекс ММВБ	1 465,09	0,65%	3,27%	3,90%	24,35%
FTSE	5 555,97	-0,66%	-0,31%	2,35%	10,58%
S&P 500	1 137,03	-0,80%	-0,45%	2,94%	9,28%
Dow Jones Avg.	10 751,27	-0,72%	-0,56%	2,90%	12,00%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Вимм-Билль-Данн	54,0000	8,32%	17,90%	27,06%
Иркутскэнерго	0,7800	4,70%	11,43%	77,27%
Роснефть	7,0000	2,49%	5,26%	-17,84%
Ленэнерго, п.	1,0500	2,44%	16,67%	34,62%
НорНикель	173,2253	2,20%	0,13%	19,88%
Сбербанк	2,9600	1,37%	10,16%	17,93%
Уралсвязьинформ	0,0390	1,30%	10,80%	63,18%
Нижнекамскнефтехим	0,5561	1,11%	13,49%	26,39%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Синергия	39,0000	-2,50%	6,85%	85,71%
ОАО Компания М.видео	6,3000	-2,33%	1,61%	66,23%
ГАЗ	30,2500	-1,79%	7,84%	31,52%
Башнефть, п.	34,4000	-1,69%	15,63%	194,02%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1090,76	0,43%	8,67%	20,26%
Индекс MSCI BRAZIL	3729,93	0,20%	7,82%	13,08%
Индекс MSCI RUSSIA	818,29	0,73%	4,47%	15,52%
Индекс MSCI INDIA	567,30	0,25%	17,13%	30,38%
Индекс MSCI CHINA	66,92	1,53%	7,22%	14,59%

Обзор рынка

В понедельник фондовые индексы США закрылись с потерями около 1%. Беспокойство инвесторов в части госдолга ряда «проблемных» стран еврозоны, а также слабые макроэкономические данные обусловили нежелание участников рынка покупать рискованные активы. Снижение рекомендаций со стороны Goldman Sachs по акциях таких знаковых компаний, как Microsoft и Macy's игроки не смогли проигнорировать накануне приближающегося сезона корпоративной отчётности. Статистика по объему промышленных заказов за август показала снижение на 0,5% м/м (хуже прогноза), в то время, как продажи на вторичном рынке жилья выросли в августе на 4,3%, хотя и остались на 20,1% слабее по сравнению с этим же периодом прошлого года.

В своем вчерашнем выступлении глава ФРС Б. Бернанке признал, что программа покупки облигаций в свое время помогла снизить процентные ставки и поддержала экономику, а значит, дополнительные покупки ценных бумаг также должны улучшить финансовые условия в стране. При этом Бен Бернанке признался, что не имеет возможности сокращать дефицит бюджета США в долгосрочной перспективе. При этом руководитель американского ЦБ подчеркнул, что если ФРС не сможет справиться с дефицитом, возникнет угроза экономическому будущему страны.

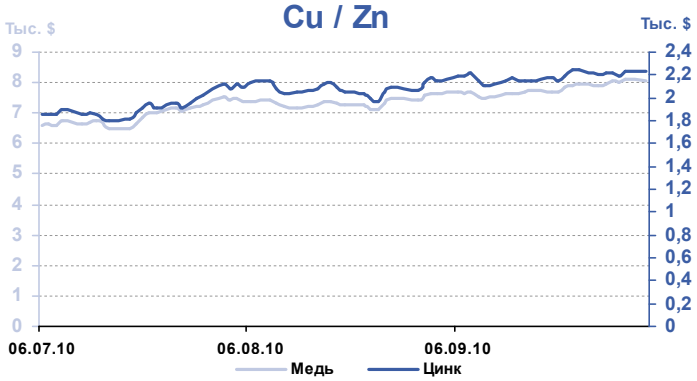
По сути, накачка дешевыми деньгами стагнирующей экономики с одновременным ослаблением курса национальной валюты – это единственный путь, которому будут следовать крупнейшие Центробанки мира в обозримой перспективе. Лишнее подтверждение этому, сегодняшнее решение Банка Японии, который понизил учетную ставку с 0,1% до 0%. Банк Японии также создает специальный фон для выкупа активов в общей сумме 35 трлн. йен. На этом фоне курс японской йены начал стремительно терять свои позиции против евро (114,6) и доллара (83,8). Подобные новости с финансовых рынков толкнули вверх азиатские фондовые индексы (Nikkei +1,45%), а также цены на сырьевые товары и особенно золото ($1318/унц).

Открытие торгов во вторник на российских фондовых биржах мы увидим в нейтральной зоне. Слабые итоги торгов в Штатах и небольшое охлаждение цен на нефть (Brent $83,2/барр) сегодня компенсируется растущими фьючерсами (S&P +0,12%) и сохранением доминирующего положения «быков» на наших биржах. Индекс ММВБ вчера сохранил свои позиции выше уровня 1455 п. Это открывает дорогу к новому рубежу на 1485 п. На ожиданиях новых монетарных стимулов цена на сырье и сырьевые акции могут опять пойти в рост. Все внимание на то, как воспримут последние заявления со стороны ФРС и БЯ европейские инвесторы.

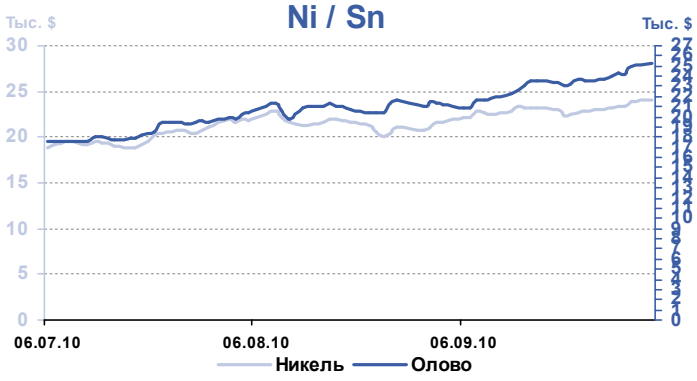
Сегодня в 12-00 мы ждем публикации индекса деловой активности в секторе услуг (PMI Services) по еврозоне. Аналогичный показатель по Великобритании выходит в 12-30. В 18-00 ждем статистики из США по индексу деловой активности в сфере услуг США (индекс ISM Non-Manufacturing) за сентябрь (прогноз: 52,1 пункт). Особое внимание здесь обращаем на компоненту занятости, которая является опережающим индикатором для пятничного отчёта по рынку труда (NFP) США за сентябрь.

Commodities

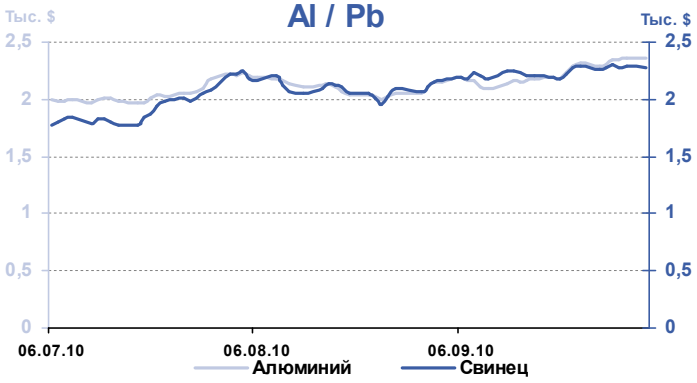
Cu / Zn



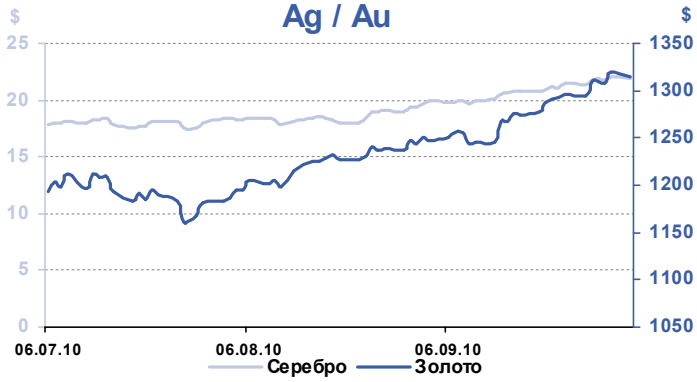
Ni / Sn



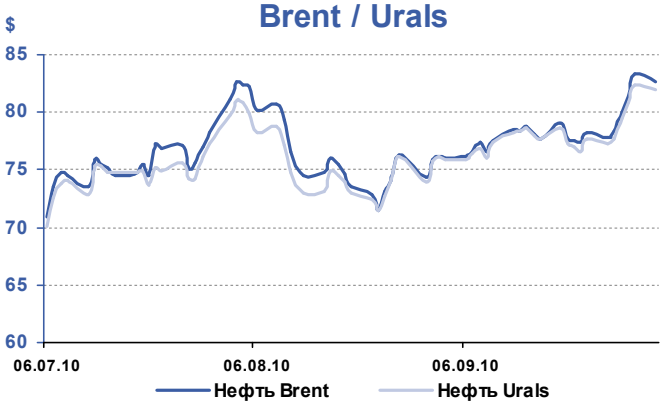
Al / Pb



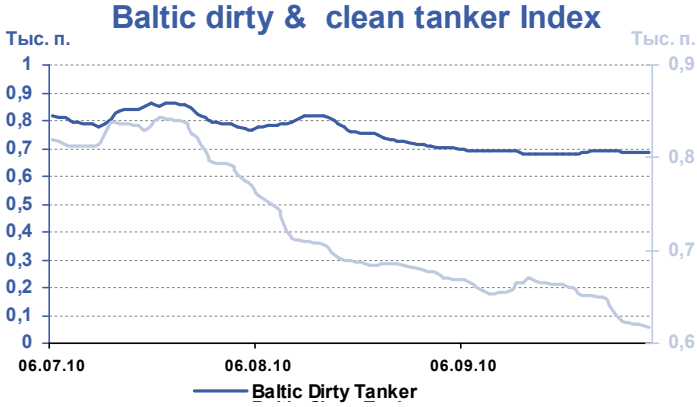
Ag / Au



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	8 064,00	-0,44%	1,95%	5,47%	36,22%
Цинк, $/t	2 230,00	0,04%	1,02%	3,67%	19,12%
Никель, $/t	24 140,00	1,24%	4,55%	11,76%	37,55%
Олово, $/t	25 200,00	1,20%	6,55%	18,87%	77,46%
Алюминий, $/t	2 363,00	0,17%	3,05%	10,06%	32,01%
Свинец, $/t	2 277,00	-0,78%	0,35%	5,03%	8,92%
Серебро, $/oz	21,95	-0,71%	2,49%	10,39%	31,96%
Золото, $/oz	1 315,25	-0,29%	1,61%	5,49%	29,29%
Нефть Brent, $/	82,70	-0,84%	6,34%	8,84%	22,52%
Нефть Urals, $/	82,02	-0,49%	6,19%	8,11%	22,04%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,558	0,00%	0,00%		18 423	280
БашИнСв	BISV	0,141	0,00%	0,00%		1 583	135
БашЭнрг	BEGY	2,225	0,00%	0,00%		310 040	2 284
ВМЗ	VSMZ	1346,359	0,00%	0,00%		98 352	2 314
ДВМП	FESH	0,418	0,00%	0,00%		26 261	1 260
КазанскВЗ	KHEL	1,856	0,00%	0,00%		147 605	287
КОМСТАР	CMST	6,551	0,00%	0,00%		88 279	2 744
Мечел	MTLR	25,116	0,00%	0,00%		1 268 981	10 433
Мотовил	MOTZ	0,089	0,00%	0,00%		849	90
Новсибэнрг	NVNG	32,838	0,00%	0,00%		4 251	463
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,238	0,00%	0,00%		44 264	2 073
Сильвинит	SILV	660,036	0,00%	0,00%		243 890	5 172
СинТЗ-ао	SNTZ	61,698	0,00%	0,00%		247	388
Славн-ЯНОС	JNOS	0,460	0,00%	0,00%		6 974	422
СТЗ-ао	SVTZ	6,252	0,00%	0,00%		31	301
ТАГМЕТ	TAMZ	0,732	0,00%	0,00%		942	368
У-УАЗ	UUAZ	1,363	0,00%	0,00%		10 790	360
ЧМК	CHMK	270,618	0,00%	0,00%		94 710	856
ЧТПЗ	CHEP	1,962	0,00%	0,00%		68 338	929
ЮжКузб.	UKUZ	42,460	0,00%	0,00%		45 988	1 531
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,850	0,00%	0,00%	76 299		7 462
Газпром	GAZP	5,180	0,00%	0,00%	777 000	322 101 912	122 629
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	0,00%	457 750	6 243 134	18 064
Лукойл	LKOH	56,300	0,00%	0,00%	84 350	104 450 966	47 887
НОВАТЭК	NVTK	7,740	0,00%	0,00%	7 740		23 501
Роснефть	ROSN	6,913	2,49%	0,00%	70 000	174 570 607	72 371
Сургутнефтегаз	SNGS	0,995	0,00%	0,00%	99 500	19 917 003	35 547
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,471	0,00%	0,00%	353 250	8 753 877	3 628
Татнефть, п.	TATNP	2,345	0,00%	0,00%	259 641		346
Транснефть, п.	TRNFP	1125,000	0,00%	0,00%	168 750	26 491 136	1 749
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,000	0,00%	0,00%	19 750		2 085
Иркутскэнерго	IRGZ	0,775	4,70%	0,00%	39 000	346 566	3 654
Ленэнерго	LSNG	0,770	0,00%	0,00%	38 500	6 667	713
МОЭСК	MSRS	0,046	0,00%	0,00%		204 012	2 258
ОГК-2	OGKB	0,052	0,00%	0,00%	667 756		1 702
ОГК-3	OGKC	0,054	0,00%	0,00%	91 545	1 080 075	2 557
ОГК-4	OGKD	0,090	0,00%	0,00%	45 000		5 674
ОГК-5	OGKE	0,088	0,00%	0,00%	34 192	121 701	3 109
ТГК-3	MSNG	0,106	0,00%	0,00%	35 587	2 612 530	4 213
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%	5 500	47 610	677
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,00%	8 859	27 273	950
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,145	0,00%	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	8,200	0,00%	0,00%	82 000		16 345
Ростелеком	RTKM	4,420	0,00%	0,00%	217 900	3 584 369	3 221
Ростелеком, п.	RTKMP	2,910	0,00%	0,00%	14 550	14 039 454	707
СЗТ	SPTL	0,780	0,00%	0,00%	39 000	223 613	687
СибирьТелеком	ENCO	0,066	0,00%	0,00%	7 304		798
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%		2 485	108
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	1,30%	0,00%	780 000	5 267 237	1 255
ЦентрТелеком	ESMO	0,840	0,00%	0,00%	4 200		1 326
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,925	0,00%	0,00%	291 450	1 614 060	1 284
ГАЗ	GAZA	30,250	-1,79%	0,00%	15 125		560

ИРКУТ	IRKT	0,291	0,00%	0,00%		22 616	284
Казанский ВЗ	KHEL	1,880	0,00%	0,00%	57 274		290
КАМАЗ	KMAZ	2,407	0,00%	0,00%	120 325	47 808	1 702
Кировский завод	KIRZ	11,000	0,00%	0,00%	11 000		120
Красный Котельщик	KRKO	0,550	0,00%	0,00%	2 750		117
Нефтекамский автозавод	nfaz	8,000		0,00%	9 256		64
ОМЗ	OMZZ	2,600	0,00%	0,00%	13 000	10 859	92
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	0,00%	30 000	2 052	337
Северсталь-авто	SVAV	15,800	0,00%	0,00%	101 373	283 227	541
Силовые машины	SILM	0,230	0,00%	0,00%	64 400		2 003
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,563	0,00%	0,00%	26 799		281
Бурятзолото	BRZL	28,000	0,00%	0,00%	28 000		197
ВСМПО	VSMO	91,250	0,00%	0,00%	92 125	723 000	1 052
Мечел	MTLR	24,450	0,00%	0,00%	171 150		10 178
ММК	MAGN	0,991	0,00%	0,00%		2 090 321	11 002
НЛМК	NLMK	3,602	0,00%	0,00%		1 802 409	21 810
НорНикель	GMKN	172,554	2,20%	0,00%	31 354	133 142 736	32 701
Полиметалл	PMTL	16,000	0,00%	0,00%	16 000	1 502 840	6 390
Полюс Золото	PLZL	45,750	0,00%	0,00%	312 061	7 846 012	8 721
Северсталь	CHMF	14,864	0,00%	0,00%	20 824	26 215 059	14 978
СТЗ	SVTZ	5,750		0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,384	0,00%	0,00%		1 272 201	3 835
ЧМЗ	CHMZ	10,000	0,00%	0,00%	10 500		23
ЧТПЗ	CHEP	1,950	12,72%	0,00%	64 301		921
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,951	0,00%	0,00%		78 686	4 971
Возрождение	VZRZ	36,400	0,00%	0,00%	36 400	33 326	864
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,00%	5 585 831	139 362 110	28 557
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	0,00%	6 120	8 230	2 687
Сбербанк	SBER	2,960	1,37%	0,00%	1 330 000		63 897
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	965		1 287
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,140	0,00%	0,00%	53 500	2 673 210	2 377
Дальневосточное МП	FESH	0,425	0,00%	0,00%	6 375		1 254
НМТП	NMTP	0,129	0,00%	0,00%		185 659	2 468
Приморское МП	PRIM	0,166	0,00%	0,00%		252 838	131
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,650	0,00%	0,00%	16 425		383
Балтика	PKBA	33,412	0,00%	0,00%		9 685	3 965
Верофарм	VRPH	37,450	0,00%	0,00%	524 300		375
Вимм-Билль-Данн	WBDF	50,798	8,32%	0,00%	136 950	235 597	2 260
Дикси	DIXY	10,650	0,00%	0,00%	10 650	408 463	916
Концерн Калина	KLNA	18,000	0,00%	0,00%	450 000	4 111	176
Красный Октябрь	KROT	10,541	0,00%	0,00%		39 640	96
Магнит	MGNT	116,000	0,00%	0,00%	58 000	1 554 618	10 321
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,250	0,00%	0,00%	313	23 836	20
Разгуляй	GRAZ	1,455	0,00%	0,00%	65 250	368 845	229
Фармстандарт	PHST	75,250	0,00%	0,00%	212 130	147 574	2 844
Черкизово	GCHE	27,748	17,08%	0,00%	140 500	92 635	1 198
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,183	0,00%	0,00%	160 705		326
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,529	1,11%	0,00%	278 055	2 122	855
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	3,849	-0,77%	0,00%	5 000	2 339 571	1 903
РБК ИС	RBCI	1,160	0,00%	0,00%	192 560	1 189 932	162
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,200	0,00%	0,00%	501 803	459 276	1 440
Дорогобуж	DGBZ	0,515	0,00%	0,00%	5 150	11 496	371
Сильвинит	SILV	656,614	0,00%	0,00%	65 661		5 139
Уралкалий	URKA	4,407	0,00%	0,00%		13 760 227	9 403
Уголь							
Белон	BLNG	0,860	0,00%	0,00%	86 000		989

Распадская	rasp	5,608	-0,53%	0,00%	168 000	2 735 827	4 395
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	158,120	1,67%	1,57
Башнефть	AK6		EUR	154,000	-1,91%	3,20
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,640	5,81%	58,01
ТГК-3	AOMD		USD	11,490	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,600	3,07%	7 325,56
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,019	-2,61%	29,66
Бурятзолото	BYT		EUR	19,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,020	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,400	-0,62%	14 130,23
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	31,150	1,80%	28 547,76
X5	FIVE		USD	40,900	-1,33%	9 311,51
Газпром	GAZ		EUR	15,550	1,44%	1 172,15
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,500	3,45%	
ЮТК	KUE		EUR	6,000	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,579	-5,82%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	21,95%	2,88
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,780	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,350	0,09%	146 302,40
Лукойл	LUK		EUR	41,755	0,37%	315,84
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,150	-0,87%	2 077,08
МТС	MBT	5	USD	22,300	3,15%	85 387,35
МТС	MKY	5	EUR	15,975	3,57%	5,42
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	8,200	0,00%	42,16
Мечел	MTL	3	USD	24,720	-1,94%	31 299,14
НорНикель	NILSY	1	USD	17,400	0,06%	965,72
НорНикель	NNIA		EUR	12,630	1,00%	242,78
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	90,850	3,77%	32 727,72
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,350	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,618	-4,92%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,440	-10,65%	
Газпром	OGZD		USD	21,280	1,24%	260 173,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	17,65%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,050	-0,42%	401,45
Ростелеком	RTL		EUR	18,500	-1,60%	1,86
Газпромнефть	SCF		EUR	14,310	2,21%	29,27
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,037	1,25%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,465	0,87%	0,14
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,730	-0,21%	16,96
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,720	0,31%	4,67
АФКСистема	SSA	1	USD	26,400	0,53%	2 795,04
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	49,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	28,500	29,55%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	149,500	3,03%	24,79
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,600	-0,36%	11,05
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,350	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,400	-2,17%	121 534,60
ВТБ	VTBR		USD	5,900	0,51%	19 475,39
Возрождение	VZY		EUR	26,250	0,96%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	23,600	2,56%	7 637,92
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,070	3,49%	

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.