ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

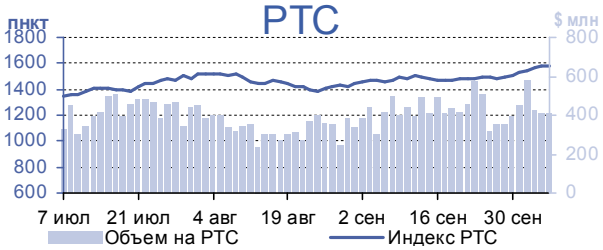
8 октября 2010г.

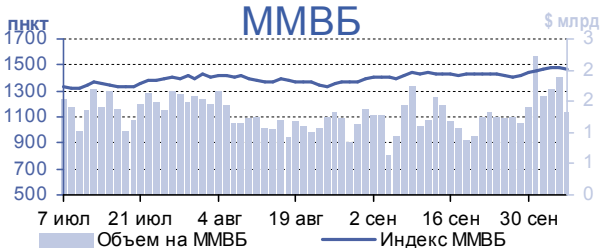
Комментарий по рынку акций

Укрепление доллара и как следствие, снижение цен на сырьевые товары оказали негативное влияние на американские фондовые индексы в ходе торгов в четверг. Инвесторов не слишком воодушевил отчёт Министерства труда США, из которого видно, что число первоначальных обращений за пособием по безработице сократилось на -11 тыс. до 445 тыс. (прогноз: +1 тыс.). Снижение числа повторных обращений на прошлой неделе на 48 тыс. было нивелировано пересмотром данных за позапрошлую неделю в сторону увеличения на 53 тыс. Августовские данные по потребительскому кредитованию показали снижение уже 7-й месяц подряд (на -$3,3 млрд.), при

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





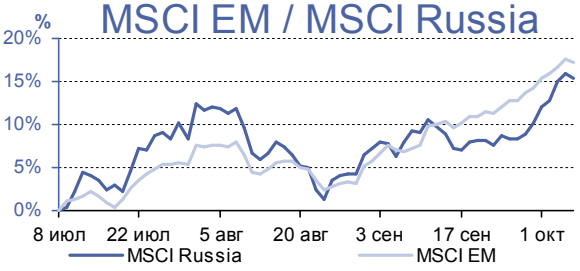
Голубые фишки (ММВБ)

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 584,29	0,38%	5,08%	7,91%	23,06%
Индекс ММВБ	1 468,31	-0,46%	1,94%	3,25%	19,75%
FTSE	5 662,13	-0,34%	2,05%	4,28%	10,83%
S&P 500	1 158,06	-0,16%	1,48%	5,39%	9,50%
Dow Jones Avg.	10 948,58	-0,17%	1,49%	5,41%	12,58%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Полиметалл	18,0000	12,50%	42,86%	85,57%
Полюс Золото	50,0000	9,29%	6,43%	-9,09%
Сургутнефтегаз, п.	0,5100	8,28%	15,91%	8,51%
ОАО Компания М.видео	6,7000	5,35%	3,88%	72,68%
Сильвинит	690,0000	5,08%	7,81%	-12,66%
АМЗ	0,5750	4,55%	21,05%	91,67%
Северсталь	15,4000	3,81%	23,84%	86,22%
Вимм-Билль-Данн	61,0000	3,39%	33,48%	43,53%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
МСЗ, Электросталь	270,0000	-3,57%	1,89%	24,42%
Акрон	30,0000	-1,64%	0,67%	0,00%
ОГК-3	0,0610	-1,61%	18,45%	23,23%
Транснефть, п.	1140,0000	-1,30%	5,85%	56,16%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1102,82	-0,36%	9,78%	18,72%
Индекс MSCI BRAZIL	3716,03	-0,67%	8,08%	11,64%
Индекс MSCI RUSSIA	837,64	-0,38%	6,84%	13,62%
Индекс MSCI INDIA	569,12	-0,49%	15,03%	28,34%
Индекс MSCI CHINA	67,46	-0,26%	7,93%	9,94%

Обзор рынка

Укрепление доллара и как следствие, снижение цен на сырьевые товары оказали негативное влияние на американские фондовые индексы в ходе торгов в четверг. Инвесторов не слишком воодушевил отчёт Министерства труда США, из которого видно, что число первоначальных обращений за пособием по безработице сократилось на -11 тыс. до 445 тыс. (прогноз: +1 тыс.). Снижение числа повторных обращений на прошлой неделе на 48 тыс. было нивелировано пересмотром данных за позапрошлую неделю в сторону увеличения на 53 тыс. Августовские данные по потребительскому кредитованию показали снижение уже 7-й месяц подряд (на -$3,3 млрд.), при этом баланс по кредитным картам демонстрирует сокращение в течение 2-х лет подряд. После окончания торговой сессии корпоративный отчет представил алюминиевый гигант Alcoa, прибыль которого за 3-й кв. составила 9 центов на акцию против прогноза 6 центов.

На валютном рынке по-прежнему беспокойно. После того, как пара EUR/USD достигла вчера уровня 1,40 спекулянты решили зафиксировать короткие позиции по открытые против американского доллара. Усилило снижение курса евро (1,3860) вчерашнее выступление главы ЕЦБ Ж-К. Трише в котором он не двусмысленно дал понять, что его финансовое ведомство готово к нестандартным шагам в монетарной политике, если это потребуется. Укрепление американской валюты вызвало резкую просадку в ценах на сырьевые товары. За 2 часа торгов перегретые цены на золото рухнули на $30. Сегодня утром драгметалл торгуется на отметке $1334/унц. Снижение коснулось и цен на нефть: ноябрьские фьючерсы по смеси Brent потеряли со вчерашних уровней около $2, опустившись к уровню $83,5/барр. Дальнейшая диспозиция на валютном и сырьевом рынке, через сегодняшний отчет по рынку труда США, связана с ожиданиями дальнейшего курса в монетарной политике ФРС.

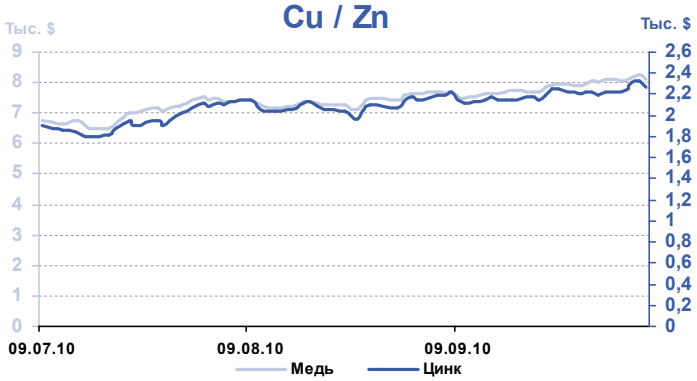
Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят в смешанной динамике основных индексов. Сильный рост отмечен в фондовых индексах Китая (Shanghai Comp +3,2%). Здесь инвесторов порадовал резкий рост розничных продаж за время завершившейся в четверг «Золотой недели», а также заявление агентства Moody's о возможном повышении суверенных рейтингов КНР.

Открытие торгов на российских фондовых биржах мы ожидаем увидеть в зоне умеренного снижения. Падение цен на нефть перевешивает нейтральное закрытие торгов в Штатах. Думаю, просадка котировок ликвидных бумаг, которая вчера имело место, сегодня утром будет продолжена. Тем не менее, сильного движения вниз мы не ждем. Индекс ММВБ может опуститься к уровню 1463 п. Чуть более слабые позиции могут быть в бумагах Роснефти и Лукойла, а также в акциях сталепроизводителей. В ожидании выхода сегодня ключевых данных по рынку труда США участники рынка традиционно займут выжидательную позицию. Очень интересно, как поведет себя рынок по факту выхода слабого отчёта NFP. Мы не исключаем, что в этом случае американская валюта может вновь пойти на ослабление, а фондовые индексы и сырье вверх, так как игроки будут наверняка ожидать запуска QE-2.

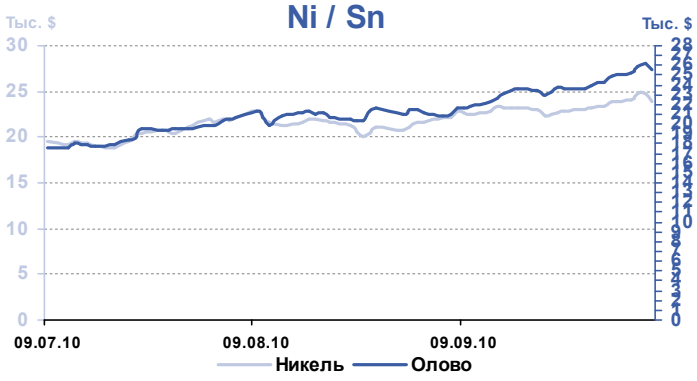
Сегодня в 12-30 Великобритания опубликует индекс производственных цен на выходе (PPI). В 16-30 Министерство труда США опубликует отчёт по числу вновь созданных рабочих мест вне сельскохозяйственного сектора США (NFP) и уровню безработицы за сентябрь. В 18-00 ждем данных по объёму товарных запасов на оптовых складах в США и по объёму оптовых продаж за август. В пятницу состоится открытие саммита руководителей центральных банков и министров финансов стран G-20.

Commodities

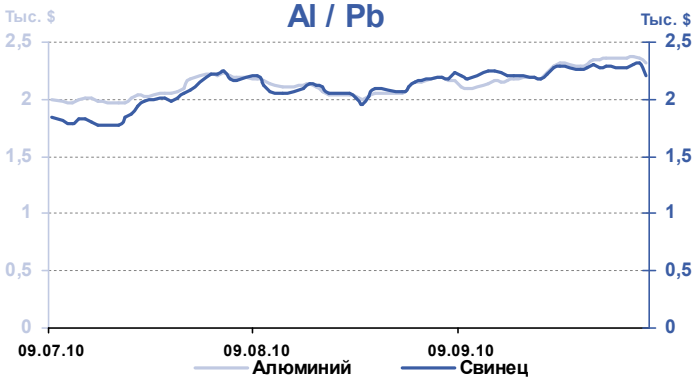
Cu / Zn



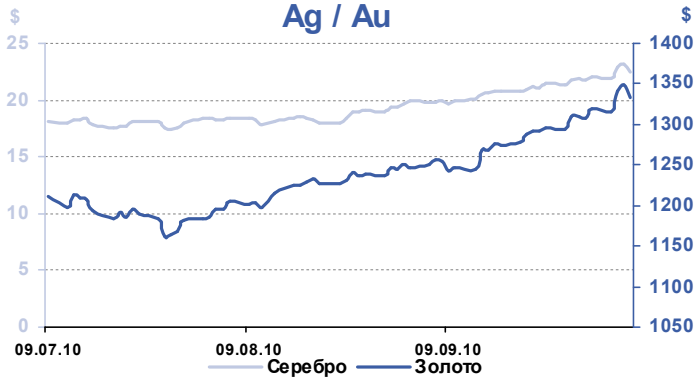
Ni / Sn



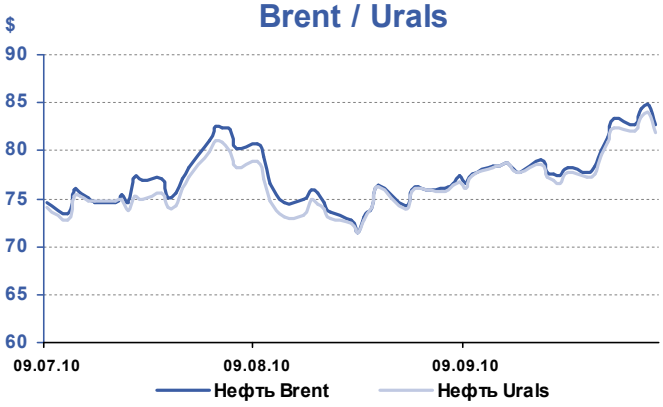
Al / Pb



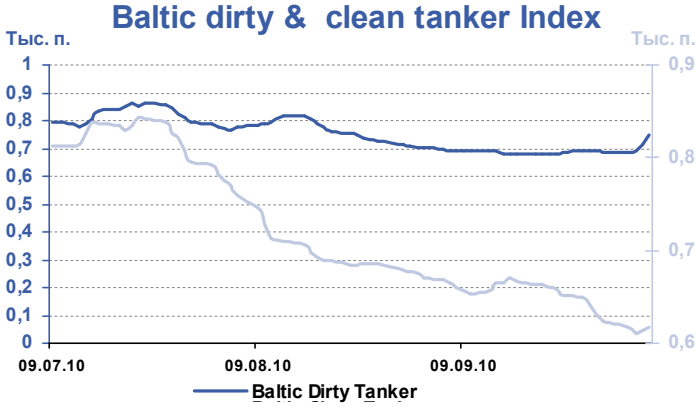
Ag / Au



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	8 100,00	-1,93%	1,07%	5,54%	32,90%
Цинк, $/t	2 261,00	-3,13%	3,01%	1,89%	16,79%
Никель, $/t	23 900,00	-3,63%	2,14%	4,37%	28,15%
Олово, $/t	25 600,00	-2,48%	5,57%	18,11%	74,45%
Алюминий, $/t	2 325,00	-1,69%	-1,11%	7,64%	26,15%
Свинец, $/t	2 209,00	-4,62%	-3,03%	-1,16%	2,51%
Серебро, $/oz	22,51	-2,89%	3,48%	13,07%	28,15%
Золото, $/oz	1 333,55	-1,15%	1,93%	6,26%	27,71%
Нефть Brent, $/	82,76	-2,31%	1,65%	6,97%	23,28%
Нефть Urals, $/	81,93	-2,25%	1,27%	6,69%	22,50%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,569	0,00%	2,65%		65 811	284
БашИнСв	BISV	0,148	0,00%	1,54%		222	140
БашЭнрг	BEGY	2,278	0,00%	-1,45%		451 394	2 380
ВМЗ	VSMZ	1379,922	0,00%	-0,48%		1 380	2 370
ДВМП	FESH	0,415	0,00%	-4,62%		45 611	1 242
КазанскВЗ	KHEL	1,976	0,00%	3,22%		173 815	305
КОМСТАР	CMST	6,570	0,00%	-1,67%		139 483	2 750
Мечел	MTLR	24,821	0,00%	-1,57%		622 461	10 411
Мотовил	MOTZ	0,092	0,00%	-0,72%		816	90
Новсибэнрг	NVNG	35,804	0,00%	4,80%		1 989	480
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,248	0,00%	0,34%		11 905	2 151
Сильвинит	SILV	693,328	0,00%	3,16%		765 857	5 454
СинТЗ-ао	SNTZ	61,698	0,00%	0,00%		247	388
Славн-ЯНОС	JNOS	0,467	0,00%	-0,36%		31 769	436
СТЗ-ао	SVTZ	6,252	0,00%	0,00%		31	301
ТАГМЕТ	TAMZ	0,737	0,00%	-1,35%		1 326	375
У-УАЗ	UUAZ	1,515	0,00%	8,34%		290 835	398
ЧМК	CHMK	275,649	0,00%	0,37%		430 064	882
ЧТПЗ	CHEP	2,032	0,00%	1,13%		301 009	961
ЮжКузб.	UKUZ	42,637	0,00%	-0,93%		2 477	1 542
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	45,000	2,27%	0,00%	179 400		7 658
Газпром	GAZP	5,450	0,00%	0,03%	109 000	237 758 202	129 021
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	-1,27%	457 750	4 004 006	18 064
Лукойл	LKOH	56,300	0,00%	-0,64%	84 350	61 261 205	47 887
НОВАТЭК	NVTK	7,740	0,00%	0,00%	7 740		23 501
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	-2,89%	1 833 500	106 398 749	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,995	0,00%	-0,52%	99 500	16 515 309	35 547
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	8,28%	1,00%	614 500	10 097 169	3 928
Татнефть, п.	TATNP	2,345	0,00%	0,00%	259 641		346
Транснефть, п.	TRNFP	1140,000	-1,30%	-2,42%	114 000	24 682 605	1 773
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,210	0,00%	0,00%	11 050		2 304
Иркутскэнерго	IRGZ	0,780	0,00%	-1,41%	39 000	35 497	3 718
Ленэнерго	LSNG	0,790	0,00%	6,58%	15 800	271 113	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	-1,39%		208 850	2 326
ОГК-2	OGKB	0,052	0,00%	0,00%	667 756		1 702
ОГК-3	OGKC	0,061	-1,61%	-5,69%	5 490	3 471 948	2 897
ОГК-4	OGKD	0,090	0,00%	0,00%	24 041		5 674
ОГК-5	OGKE	0,088	0,00%	0,00%	34 192	30 227	3 109
ТГК-3	MSNG	0,113	0,00%	-2,58%		1 494 496	4 489
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-0,61%		52 477	672
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-0,63%	8 859	47 824	950
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,149	0,00%	0,00%	41 570		141
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	8,380	0,00%	0,00%	83 800		16 704
Ростелеком	RTKM	4,580	0,00%	2,72%	45 800	2 680 290	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	2,910	0,00%	-1,56%	14 550	6 509 399	707
СЗТ	SPTL	0,780	0,00%	-0,28%	39 000	192 195	687
СибирьТелеком	ENCO	0,066	0,00%	0,00%	7 304		798
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%		4 000	111
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,51%	-1,10%	176 400	4 363 171	1 266
ЦентрТелеком	ESMO	0,840	0,00%	0,00%	4 200		1 326
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,919	0,00%	-2,39%		562 091	1 287
ГАЗ	GAZA	29,500	0,00%	0,00%	14 750		546

ИРКУТ	IRKT	0,297	0,00%	-0,39%		84 467	289
Казанский ВЗ	KHEL	1,880	0,00%	0,00%	57 274		290
КАМАЗ	KMAZ	2,407	0,00%	1,07%	120 325	1 117 122	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%	0,00%	9 256		64
ОМЗ	OMZZ	2,600	0,00%	0,63%	13 000	12 444	92
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	-5,66%	30 000	1 671	337
Северсталь-авто	SVAV	15,800	0,00%	1,28%	101 373	129 167	541
Силовые машины	SILM	0,230	0,00%	0,00%	64 400		2 003
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,575	4,55%	0,00%	28 750		287
Бурятзолото	BRZL	28,500	1,79%	0,00%	7 125		200
ВСМПО	VSMO	94,500	0,00%	-0,48%	47 250	776 240	1 090
Мечел	MTLR	24,450	0,00%	0,00%	171 150		10 178
ММК	MAGN	0,981	0,00%	-0,83%		1 003 318	11 073
НЛМК	NLMK	3,473	0,00%	-2,63%		1 818 005	20 856
НорНикель	GMKN	180,000	1,12%	1,11%	180 000	107 209 597	34 313
Полиметалл	PMTL	18,000	12,50%	10,20%	18 000	5 383 393	6 989
Полюс Золото	PLZL	50,000	9,29%	9,12%	50 000	42 977 677	9 531
Северсталь	CHMF	15,400	3,81%	-0,06%	77 000	41 558 577	15 519
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,378	0,00%	-1,34%		1 133 744	3 840
ЧМЗ	CHMZ	10,000	0,00%	0,00%	10 500		23
ЧТПЗ	CHEP	1,950	0,00%	0,00%	64 301		921
Банки							
Банк Москвы	MMBM	32,555	0,00%	-0,79%		3 942	5 160
Возрождение	VZRZ	37,250	2,34%	1,08%	37 250	45 021	885
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-1,31%		63 198 673	31 777
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	-0,01%	6 120	1 926	2 687
Сбербанк	SBER	3,095	1,48%	0,00%	618 000		66 812
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	965		1 287
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,220	0,91%	0,03%	55 500	1 512 284	2 466
Дальневосточное МП	FESH	0,425	0,00%	0,00%	6 375		1 254
НМТП	NMTP	0,129	0,00%	-2,93%		320 275	2 499
Приморское МП	PRIM	0,169	0,00%	0,12%		2 609	134
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,650	0,00%	0,00%	16 425		383
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	-1,31%	16 950	42 857	5 143
Верофарм	VRPH	37,450	0,00%	0,00%	524 300		375
Вимм-Билль-Данн	WBDF	61,000	3,39%	9,07%	60 500	349 603	2 684
Дикси	DIXY	11,000	2,33%	1,79%	11 000	6 937	946
Концерн Калина	KLNA	18,000	0,00%	5,30%	450 000	341 203	176
Красный Октябрь	KROT	10,483	0,00%	-0,64%		2 857	97
Магнит	MGNT	116,000	0,00%	-1,60%	58 000	865 261	10 321
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,250	0,00%	-0,05%	313	14 130	20
Разгуляй	GRAZ	1,450	0,00%	-1,77%	65 250	65 292	229
Фармстандарт	PHST	77,000	0,00%	-1,08%	27 951	161 977	2 910
Черкизово	GCHE	28,100	0,00%	-0,66%	140 500	100 887	1 210
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,183	0,00%	0,00%	160 705		326
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,556	0,00%	0,00%	278 055	81 222	896
Уфанефтехим	UFNC	4,550	0,00%	0,00%	9 055		1 253
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	270,000	-3,57%	0,00%	5 130		376
ПИК	pikk	4,040	0,00%	-2,48%	15 007	1 392 624	1 993
РБК ИС	RBCI	1,160	0,00%	-1,04%	192 560	493 160	162
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,000	-1,64%	-3,30%	5 700	1 265 578	1 431
Дорогобуж	DGBZ	0,515	0,00%	1,03%	5 150	36 915	371
Сильвинит	SILV	690,000	5,08%	0,00%	131 500		5 400
Уралкалий	URKA	4,550	0,00%	2,09%		7 315 501	9 653
Уголь							
Белон	BLNG	0,860	0,00%	0,00%	86 000		989

Распадская	rasp	5,600	0,00%	0,00%	168 000	2 355 115	4 372
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	155,150	0,04%	
Башнефть	AK6		EUR	154,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,910	-1,04%	24,45
ТГК-3	AOMD		USD	11,490	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,500	-1,81%	16 011,97
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,210	-2,73%	
Бурятзолото	BYT		EUR	19,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,021	5,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,490	0,00%	7 994,57
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	29,890	-0,37%	26 959,69
X5	FIVE		USD	42,100	-1,41%	7 370,32
Газпром	GAZ		EUR	15,615	-0,89%	679,15
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,500	-1,72%	
ЮТК	KUE		EUR	6,200	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,950	0,00%	0,17
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,750	-3,85%	
Лукойл	LKOD		USD	58,400	-1,02%	154 790,80
Лукойл	LUK		EUR	41,885	-1,07%	128,30
Лукойл	LUKOY	1	USD	58,150	-2,10%	3 408,04
МТС	MBT	5	USD	22,670	-1,18%	42 447,28
МТС	MKY	5	EUR	16,140	0,65%	7,53
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	8,050	0,00%	1,60
Мечел	MTL	3	USD	24,530	-1,84%	34 408,26
НорНикель	NILSY	1	USD	17,950	-0,39%	645,62
НорНикель	NNIA		EUR	12,775	-1,16%	136,88
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	91,400	-1,72%	18 226,68
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,350	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,618	-4,92%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,990	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	21,840	0,18%	202 388,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,330	0,48%	40,93
Ростелеком	RTL		EUR	19,200	-1,03%	18,39
Газпромнефть	SCF		EUR	14,235	-1,25%	34,77
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,096	0,08%	11,08
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,551	-0,03%	0,71
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,970	-1,58%	50,71
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,050	1,01%	6,33
АФКСистема	SSA	1	USD	26,700	-1,11%	4 776,81
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	28,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	147,600	0,07%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,590	0,00%	2,79
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,350	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,220	1,86%	49 820,44
ВТБ	VTBR		USD	6,125	-0,41%	16 872,72
Возрождение	VZY		EUR	26,000	-0,95%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	24,280	-3,69%	37 614,18
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,250	-1,20%	6,05

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.