Говорят на рынке . . .

. . . Банк России, желая ограничить активность спекулянтов на валютном рынке, расширил границы плавающего коридора курса рубля к бивалютной корзине с 3 руб до 4 руб, одновременно снизив объемы корректирующих интервенций с $700 млн до $650 млн. По мнению регулятора, это сделает курс национальной валюты более чувствительным к соотношению спроса и предложения, а также еще менее прогнозируемым. С точки зрения мировой тенденции перехода к свободной конвертации валют шаги ЦБ выглядят позитивно. Однако для компаний, работающих на основе среднесрочных валютных контрактов, могут возрасти риски получения убытков от курсовых разниц.

. . . "Норильский никель" не исключает продажи своей доли в "ОГК-3", которая на текущий момент превышает 60%. Один из ключевых акционеров ГМК Владимир Потанин полагает, что энергокомпания как непрофильный актив металлурга, к тому же показавший убыток по итогам первого полугодия 2010 г., не оказывает положительного влияния на стоимость "Норникеля". По оценкам Потанина, от продажи доли в "ОГК-3" компания может выручить порядка $2,5-$3 млрд.

. . . Petropavlovsk проведет IPO своего железорудного подразделения IRC в Гонконге 20 октября. Инвесторам будет предложено 132,5 млн акций по цене 1,8 HKD за бумагу. Помимо Petropavlovsk, в ближайшее время на биржу планируют выйти такие компании, как Mail.ru, "Окей", "Трансконтейнер. При этом заинтересованность инвесторов может привести к отвлечению средств из уже обращающихся бумаг в новые выпуски.

Российский рынок: внимание на США

В первой половине дня в среду отечественные инвесторы отыгрывали позитив, поступающий извне. Однако его не хватило на то, чтобы преодолеть очередное сопротивление на уровне 1500 п. по индексу ММВБ, и после обеда на рынке началась коррекция. Тем не менее, продажи не носили массового характера, а с открытием торгов в США "быки" вновь получили поддержку, воодушевившись, как и заокеанские инвесторы, квартальной прибылью банка J.P. Morgan, превысившей прогнозы.

Впрочем, однозначно сильным представленный релиз назвать нельзя, поскольку в квартальном исчислении прибыль банка сократилась. Это ослабило позиции российского банковского сектора и заставило некоторых игроков в очередной раз задуматься о замедлении темпов экономического восстановления как в США, так и в мировом масштабе. Таким образом, выходящие далее отчеты могут рассматриваться именно в этом ключе, и участникам рынка, конечно, хотелось бы увидеть улучшение финансовых результатов представителей различных секторов.

Сегодня представится возможность оценить ситуацию в высокотехнологичном сегменте – вслед за уже отчитавшейся Intel данные за III квартал представят компании AMD и Google.

Кроме того, судя по календарю макроэкономической статистики, в четверг Штаты компенсируют затишье последних дней, опубликовав данные по внешней торговле, производственным ценам, а также еженедельные отчеты по рынку труда и запасам энергоносителей. Таким образом, в течение дня нас ожидает достаточно насыщенный внешний фон, что может привести к росту волатильности и объемов торгов.

При этом близость максимумов текущего года может сдерживать рост индекса ММВБ, которому для преодоления очередного сопротивления могут понадобиться весомые поводы. На наш взгляд, одних благоприятных сигналов со стороны отчетности или макростатистики будет недостаточно. Дальнейшее повышение российского рынка требует, чтобы новостной фон был позитивно воспринят иностранными инвесторами и привел к росту уровня приятия рисков в целом.

Накануне

MSCI World	1 222.06	1.18%
MSCI North America	1 264.57	0.80%
MSCI Europe	92.24	1.42%
MSCI Pacific	2 107.05	0.22%
MSCI EM	1 117.69	1.71%
MSCI BRIC	362.29	1.86%
MSCI Russia	842.64	1.16%
Россия		
RTSI	1 574.20	-0.52%
RTSI (fut)	1 591.00	1.22%
MICEX	1 493.21	1.04%
MICEX 10	3 527.94	1.09%
лидеры торгов ММВБ		
Дагестанэнергосбыт	0.06	22.45%
МосЭС	0.56	7.27%
АвтоВАЗ	30.60	6.78%
Аптеки 36.6	116.60	4.95%
Дальневост. банк	205.01	-17.83%
США		
DJIA	11 096.08	0.69%
S&P 500	1 178.10	0.71%
Nasdaq	2 441.23	0.96%
Европа		
FTSE 100	5 747.35	1.51%
Xetra DAX	6 434.52	2.06%
CAC 40	3 828.34	2.12%

Утренний фон

Фьючерсы		
DJIA (fut)	11 075.00	0.99%
S&P 500 (fut)	1 177.90	1.04%
Nasdaq (fut)	2 063.00	1.10%
Азия		
Topix	837.34	1.79%
Nikkei 225	9 580.17	1.88%
Hang Seng	23 704.70	1.05%
Shanghai Comp.	2 895.95	1.21%
Сырье		
нефть Brent	85.49	0.75%
нефть Light Sweet	84.47	0.88%
золото	1 380.90	0.76%
Валюта		
EUR/USD	1.4080	0.85%
USD/RUB	29.89	-0.22%
доллар США (ЦБ РФ)	30.1269	0.17%
евро (ЦБ РФ)	42.0451	1.10%

Акции в составе индекса ММВБ

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (руб)
Аэрофлот	AFLT	66.46	69.50	66.46	69.50	4.59%	128 382 743.53
НЛМК	NLMK	104.69	112.48	104.69	112.40	4.17%	144 636 856.00
Полюс Золото	PLZL	1 554.50	1 599.00	1 549.03	1 585.00	3.00%	743 259 986.70
Уралкалий	URKA	139.00	143.68	139.00	143.10	2.95%	399 469 053.60
Уралсвязьинформ	URSI	1.195	1.228	1.189	1.221	2.35%	254 192 371.10
Сбербанк (ап)	SBERP03	64.50	65.97	64.36	65.55	2.18%	4 795 775 535.28
Полиметалл	PMTL	518.57	532.45	517.22	527.00	1.94%	103 921 734.41
Газпром нефть	SIBN	119.00	121.25	118.98	121.19	1.93%	296 805 831.41
Северсталь	CHMF	450.00	456.12	448.68	455.05	1.80%	524 377 863.13
Ростелеком	RTKM	138.13	139.30	136.02	138.40	1.56%	123 868 368.44
Лукойл	LKOH	1 765.00	1 791.00	1 764.00	1 785.00	1.56%	3 480 494 793.25
Банк ВТБ	VTBR	0.0913	0.0923	0.0910	0.0921	1.43%	2 127 037 818.20
РусГидро	HYDR	1.6090	1.6190	1.5940	1.6120	1.38%	1 654 055 197.00
ВолгаТелеком	VTEL	115.63	117.25	115.01	117.20	1.36%	28 743 251.53
Сургутнефтегаз	SNGS	30.300	30.750	30.259	30.643	1.27%	624 792 072.70
ММК	MAGN	29.5150	29.8850	29.5000	29.7000	1.18%	46 288 238.60
ОГК-3	OGKC	1.7400	1.7650	1.7200	1.7580	1.09%	137 577 561.10
Газпром	GAZP	163.86	165.03	162.84	164.74	1.07%	9 405 179 291.04
Транснефть (ап)	TRNFP	34 613.89	34 800.00	34 381.00	34 715.00	0.93%	425 399 377.24
Новатэк	NOTK	233.00	237.39	231.90	235.10	0.90%	76 186 031.52
Сургутнефтегаз (ап)	SNGSP	15.2510	15.4980	15.2510	15.4000	0.86%	343 939 805.20
Татнефть	RU14TATN3006	152.51	152.51	150.36	151.45	0.83%	262 725 059.75
Сбербанк	SBER03	91.61	92.54	90.73	91.30	0.44%	20 556 755 538.45
ГМК Норильский никель	GMKN	5 415.01	5 450.00	5 375.01	5 400.00	0.21%	3 257 207 148.83
МТС	MTSI	253.86	253.86	250.57	250.96	0.10%	217 599 687.13
ФСК ЕЭС	FEES	0.3680	0.3700	0.3650	0.3680	0.00%	268 469 258.80
Роснефть	ROSN	214.20	215.44	211.72	212.93	-0.08%	3 699 833 920.88
Распадская	RASP	174.25	178.00	172.54	173.00	-0.31%	114 605 503.00
Мосэнерго	MSNG	3.4050	3.4530	3.3700	3.3850	-0.56%	65 606 056.90
Интер РАО ЕЭС	IUES	0.0495	0.0497	0.0486	0.0490	-0.61%	471 137 564.00

данные биржи ММВБ

ADR и GDR российских компаний в Лондоне

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию
Ситроникс	SITR	0.90	5.25	0.70	0.90	5.88%
НЛМК	NLMK	35.96	41.00	24.84	37.50	5.19%
Полюс Золото	PLZL	30.68	34.60	21.72	31.55	4.89%
Уралкалий	URKA	23.25	25.36	14.76	23.70	2.95%
АФК Система	SSA	26.30	33.00	13.60	26.85	2.68%
Evraz Group	EVR	29.40	43.25	14.49	30.10	2.59%
Интегра	INTE	2.80	4.50	2.04	2.87	2.50%
ТМК	TMKS	17.76	25.00	13.75	18.00	2.27%
Магнит	MGNT	25.41	30.12	12.11	26.10	2.15%
Татнефть	ATAD	32.81	40.00	13.78	33.30	2.12%
Северсталь	SVST	15.04	24.00	5.08	15.18	2.08%
Сургутнефтегаз	SGGD	10.09	21.98	4.83	10.18	2.00%
Банк ВТБ	VTBR	6.11	6.48	2.84	6.15	1.65%
Ростелеком	RKMD	27.20	59.40	17.20	27.65	1.65%
Лукойл	LKOD	58.80	62.60	25.49	59.30	1.63%
Газпром	OGZD	21.74	27.33	10.63	21.90	1.39%
Газпром нефть	GAZ	19.85	31.69	16.53	19.98	1.22%
X5 Retail Group	FIVE	41.85	45.36	27.43	42.60	1.19%
ММК	MMK	12.79	20.38	7.50	12.80	1.11%
РусГидро	HYDR	5.32	9.13	3.11	5.39	1.03%
ГМК Норильский никель	MNOD	17.96	20.59	8.58	18.08	0.89%
Полиметалл	PMTL	17.44	18.10	8.53	17.48	0.58%
Комстар ОТС	CMST	6.35	7.50	0.81	6.38	0.47%
НМТП	NCSP	9.70	15.48	5.00	9.69	0.41%
Акрон	ACRN	3.05	4.21	2.25	3.06	0.33%
Фармстандарт	PHST	23.51	29.27	16.01	23.80	0.21%
Группа Черкизово	CHE	20.40	26.10	5.00	20.00	0.00%
Роснефть	ROSN	7.08	34.20	4.02	7.05	0.00%
Система Галс	HALS	1.35	2.15	0.80	1.35	0.00%
Новатэк	NVTK	89.90	96.95	36.55	88.50	-0.62%

данные Лондонской фондовой биржи (LSE)

Срочные контракты на FORTS

Контракт	Дата исполнения	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (ед)
Индексы						
Индекс РТС	дек'10	159 735	157 190	159 100	1.22%	979 725
Индекс РТС Стандарт	дек'10	10 270	10 113	10 226	1.04%	7 494
Акции						
Сбербанк	дек'10	9 298	9 120	9 176	0.43%	685 173
Газпром	дек'10	16 563	16 345	16 544	1.09%	165 919
Лукойл	дек'10	17 970	17 624	17 913	1.46%	60 072
Сбербанк (ап)	дек'10	6 638	6 443	6 587	2.19%	33 755
Банк ВТБ	дек'10	9 242	9 087	9 221	1.58%	11 539
Роснефть	дек'10	21 555	21 187	21 305	-0.21%	9 371
Уралсвязьинформ	дек'10	1 240	1 204	1 239	2.14%	7 292
ГМК Норильский никель	дек'10	54 300	53 560	53 800	0.19%	4 726
Сургутнефтегаз	дек'10	30 702	30 170	30 650	1.55%	1 621
РусГидро	дек'10	16 248	16 038	16 209	1.72%	422
Транснефть (ап)	дек'10	35 200	34 619	34 925	0.86%	395
Северсталь	дек'10	45 437	44 817	45 319	1.61%	153
Татнефть	дек'10	15 200	15 140	15 158	-0.05%	65
МТС	дек'10	25 183	25 049	25 066	-0.24%	52
Полюс Золото	дек'11	15 750	15 500	15 750	2.28%	25
Новатэк	дек'12	23 215	23 215	23 215	-	2
Валюта						
Курс евро / доллар США	дек'10	1.3997	1.3827	1.3930	0.72%	229 106
Курс доллар США / рубль	дек'10	30 348	30 070	30 218	-0.19%	558 499
Курс евро / рубль	дек'10	42 336	41 831	42 150	0.78%	7 516
Товарные контракты						
Нефть Brent	окт'10	84.68	83.18	84.44	1.53%	22 335
Золото в слитках	дек'10	1 376.80	1 349.40	1 376.80	1.83%	43 792
Серебро в слитках	дек'10	23.77	23.07	23.77	2.72%	3 079
Платина в слитках	дек'10	1 711.00	1 682.40	1 711.00	1.06%	577

данные биржи РТС

Статистика сырьевых рынков

Фьючерс	Еденица измерения	13.10.10	Предыдущее закрытие	Изменение
			Энергоносители	
Нефть Brent	$/баррель	84.25	82.79	1.76%
Нефть Light Sweet	$/баррель	83.80	81.95	2.26%
Нефть Urals (спот-цены)	$/баррель	82.56	80.84	2.13%
Нефть Rebco	$/баррель	82.99	81.85	1.39%
Природный газ	$/млн БТЕ *	3.665	3.660	0.14%

* БТЕ (Британская термическая единица). 1000 БТЕ = ~ 0,028 кубометра

данные Нью-Йоркской товарной биржи (NYMEX), за исключением Brent (данные ICE, Лондон) и Urals (данные Platts)

			Металлы	
Золото (Gold)	$/унция	1378.1	1355.4	1.67%
Серебро (Silver)	$/унция	24.30	23.48	3.51%
Палладий (Palladium)	$/унция	602.00	591.65	1.75%
Платина (Platinum)	$/унция	1718.00	1695.90	1.30%

данные Нью-Йоркской товарной биржи (NYMEX)

Медь (Copper)	$/тонна	8400.0	8266.0	1.62%
Никель (Nickel)	$/тонна	24110.0	24150.0	-0.17%
Олово (Tin)	$/тонна	26800.0	26600.0	0.75%
Свинец (Lead)	$/тонна	2408.0	2275.0	5.85%
Цинк (Zinc)	$/тонна	2381.0	2309.5	3.10%
Алюминий (Aluminium)	$/тонна	2390.0	2385.5	0.19%
Алюминиевый сплав (NASAAC)	$/тонна	2320.0	2271.0	2.16%
Сталь (Steel) *	$/тонна	450.0	420.0	7.14%

* Средиземноморье: поставка в Турцию, ОАЭ (Дубай)

данные Лондонской биржи металлов (LME)

			Сельскохозяйственные товары	
Зерно (Corn)	$/бушель	7.1040	7.0920	0.17%
Соевые бобы (Soybeans)	$/бушель	11.9020	11.7760	1.07%
Пшеница (Wheat)	$/бушель	5.7500	5.7860	-0.62%
Овес (Oats)	$/бушель	3.8260	3.8800	-1.39%
Неочищенный рис (Rough Rice)	$/CWT*	0.1346	0.1338	0.60%

* CWT (hundredweight) = ~0,045 тонны

данные Чикагской товарной биржи (CBOT)

Кофе (Coffee)	$/фунт	1.8615	1.8570	0.24%
Какао-бобы (Cocoa)	$/тонна	2867.0	2850.0	0.60%
Сахар (Sugar)	$/фунт	0.2760	0.2745	0.55%
Хлопок (Cotton)	$/фунт	1.1260	1.0929	3.03%

данные Нью-Йоркской товарной биржи (NYMEX)

Ежемесячные данные по рынку минеральных удобрений

	Единица измерения	Спот-цена (Сен'10)	Изменение к авг'10	Изменение к мар'09	Изменение к сен'09
Карбамид (азотные)	$/тонна	318.8	16.78%	14.37%	36.30%
Фосфаты (фосфорные)	$/тонна	125.0	0.00%	19.05%	38.89%
Ортофосфат натрия (фосфорные)	$/тонна	425.0	11.62%	19.93%	88.89%
Диаммофос (азотно-фосфорные)	$/тонна	518.5	4.51%	8.87%	63.68%
Хлористый калий (калийные)	$/тонна	337.5	-2.17%	8.00%	-21.31%

данные Всемирного Банка

Брокерская фирма "Ленстройматериалы"

191186, Санкт-Петербург
ул. Миллионная, д.8.
тел. 325-96-96 (доб. 6226)
http://www.brok.ru

Аналитические исследования

Руководитель аналитического подразделения
Черных Ольга olgac@brok.ru
Аналитики:
Евдокиенко Василий evdokienko@brok.ru
Белова Екатерина belova@brok.ru

Сведения, содержащиеся в настоящем обзоре, имеют только информационное значение и не могут рассматриваться как предложение о совершении сделок на финансовом рынке. Представленная аналитическая информация отражает исключительно собственное мнение аналитиков, участвовавших в его составлении, которое может не совпадать с мнением БФ "Ленстройматериалы".

Информация, на которой основан обзор, получена из открытых источников, которые мы считаем надежными. Тем не менее, БФ "Ленстройматериалы" и авторы обзора не несут ответственности за её достоверность и полноту, а также за убытки, возникшие в связи с использованием содержащейся в документе информации. При принятии инвестиционного решения необходимо помнить, что инвестирование в ценные бумаги сопряжено с риском, в связи с чем инвесторам необходимо провести самостоятельный анализ ситуации и объектов инвестирования.