ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

15 октября 2010г.

Комментарий по рынку акций

В четверг американские фондовые рынки закрылись в зоне умеренного снижения. Вчера в США вышла неблагоприятная макроэкономическая статистика, показавшая рост индекса производственной инфляции (+0,4% м/м; +4,0% г/г) на фоне нового роста числа первоначальных обращений за пособием по безработице (+13 тыс.; 462 тыс.). Не порадовал и отчет Министерства торговли, сообщивший об увеличении торгового дефицита США в августе на 8,8% до $46,3 млрд. (прогноз: $43,5 млрд.) благодаря рекордному дисбалансу торговли с Китаем. Давление на акции американских банков оказало решение генеральных прокуроров всех американских штатов провести

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 586,94	-0,12%	0,17%	6,90%	10,11%
Индекс ММВБ	1 489,06	-0,28%	1,41%	3,67%	9,26%
FTSE	5 727,21	-0,35%	1,15%	3,09%	8,96%
S&P 500	1 173,81	-0,36%	1,36%	4,33%	7,49%
Dow Jones Avg.	11 094,57	-0,01%	1,33%	4,94%	10,77%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Ростелеком, п.	3,0500	10,91%	-2,24%	45,58%
Белон	0,9300	8,14%	-1,06%	50,00%
ВолгаТелеком	3,9000	7,73%	11,43%	89,32%
Транснефть, п.	1200,0000	5,73%	11,42%	64,38%
Аптечная сеть 36,6	3,8000	4,40%	10,14%	-66,22%
Иркутскэнерго	0,8080	3,59%	12,22%	83,64%
ОАО ОПИН	31,7500	3,25%	-2,91%	-29,44%
ОАО РОСИНТЕР	19,3000	1,95%	28,67%	152,29%

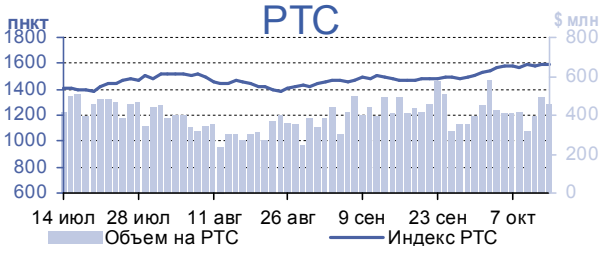
Лидеры снижения

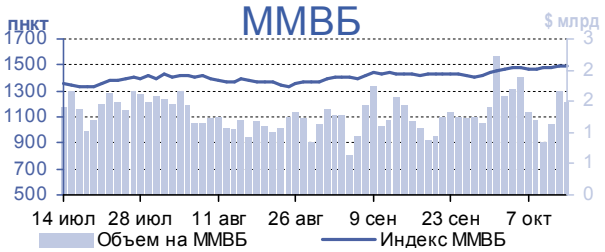
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-3	0,0586	-3,93%	13,79%	19,59%
ГАЗ	28,5000	-1,72%	-10,94%	20,00%
Северсталь	15,1692	-1,50%	12,36%	83,42%
ОАО Компания М.видео	6,8000	-1,45%	4,62%	70,00%

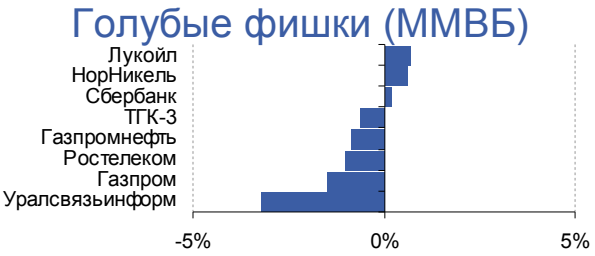
Индекс MSCI

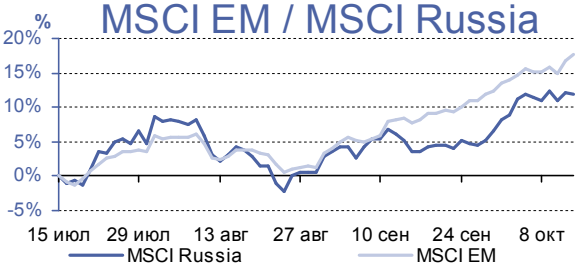
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1127,19	0,85%	8,58%	15,95%
Индекс MSCI BRAZIL	3856,12	0,16%	9,25%	7,11%
Индекс MSCI RUSSIA	841,21	-0,17%	6,53%	0,50%
Индекс MSCI INDIA	576,58	0,17%	10,71%	24,90%
Индекс MSCI CHINA	70,50	1,60%	9,92%	11,29%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В четверг американские фондовые рынки закрылись в зоне умеренного снижения. Вчера в США вышла неблагоприятная макроэкономическая статистика, показавшая рост индекса производственной инфляции (+0,4% м/м; +4,0% г/г) на фоне нового роста числа первоначальных обращений за пособием по безработице (+13 тыс.; 462 тыс.). Не порадовал и отчет Министерства торговли, сообщивший об увеличении торгового дефицита США в августе на 8,8% до $46,3 млрд. (прогноз: $43,5 млрд.) благодаря рекордному дисбалансу торговли с Китаем. Давление на акции американских банков оказало решение генеральных прокуроров всех американских штатов провести расследование в части нарушений, допущенных банками при лишении жилья должников по ипотеке. В целом можно сказать, что сейчас заокеанские фондовые индексы входят в фазу консолидации вблизи максимальных уровней с весны этого года и осенний растущий тренд остается в силе.

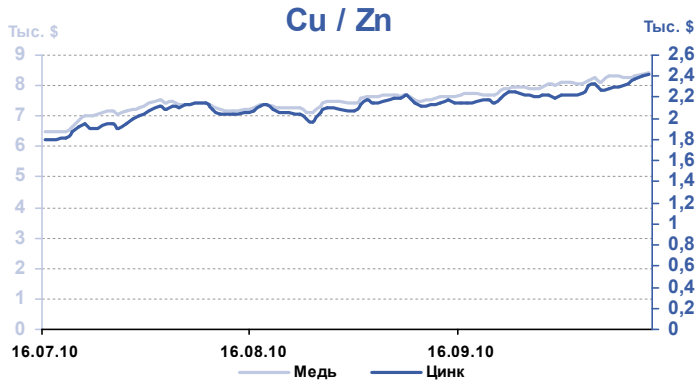
После закрытия регулярных торгов в США компания Google в своем квартальном отчете известила о росте прибыли до $2,17 млрд. ($6,72/акция), что оказалось немного выше прогноза. Высокотехнологичная компания AMD сообщила о росте доходов до $1,62 млрд. и прибыли 15 центов/акция, что также оказалось лучше ожиданий.

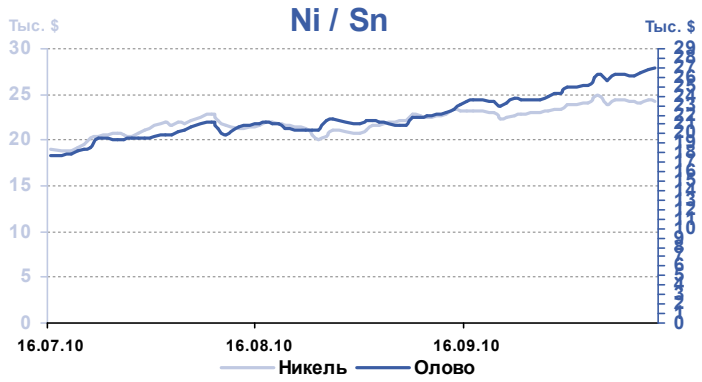
Курс американской валюты постепенно возвращает свои позиции против евро. Вчера глава ФРБ Ричмонда Дж. Лейкер заявил, что не поддержит дополнительное смягчение монетарной политики ФРС в ноябре. Пара EUR/USD вчера получила отпор на уровне 1,4120, и в ближайшее время может опять скатиться ниже уровня 1,40. Ценам на золото ($1381/унц) такое поведение доллара не мешает сегодня торговаться в непосредственной близости от исторических максимумов. Кстати, крупнейший в мире обеспеченный золотом биржевой фонд, сообщил об оттоке капитала, зафиксированного в октябре. Это заставляет задуматься о приближении коррекции в ценах на этот биржевой актив. Цены на нефть Brent ($84/барр) к утру пятницы немного снизились относительно вчерашних уровней, но пока сохраняют движение в боковом тренде с границами 85,5 – 82,5 $/барр. Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят в зоне умеренного снижения, за исключением Китая (Shanghai Comp +2%). Согласно последним данным, в сентябре цены на китайскую недвижимость выросли еще на +0,5% м/м, +9,1% г/г., а индекс опережающих индикаторов Conference Board за август вырос на +0,7%.

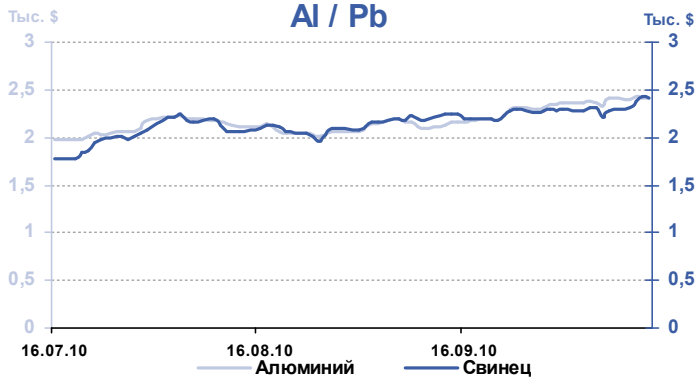
Открытие торгов на российских биржах в пятницу мы увидим в зоне умеренного снижения. Не думаю, что сейчас стоит строить агрессивные стратегии в игре на понижение. По крайней мере, американский рынок акций к этому не готов, а значит и у нас коррекция к росту может смениться фазой консолидации. Индекс ММВБ вчера нашел поддержку на уровне 1484 пункта. Думаю этот уровень можно использовать в качестве опоры в спекулятивной игре наверх. На фоне слабости в ценах на нефть, думаю, акции нефтянки будут оставаться под давлением продаж, а вот бумаги горнодобывающих и химических компаний будут чувствовать себя хорошо.

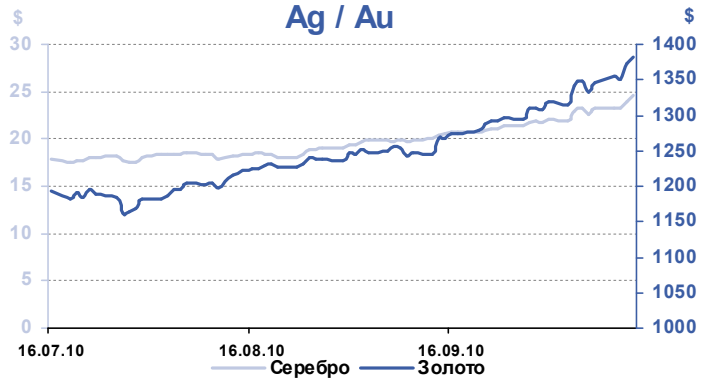
Сегодня свою квартальную финансовую отчётность представят компании: Charles Schwab, General Electric и Mattel. В 16-15 ожидается выступление главы ФРС Бена Бернанке. В 16-30 ждем статистику по индексу потребительских цен США за сентябрь (прогноз: +0,2% м/м). В это же время ФРБ Нью-Йорка опубликует данные индекса деловой активности в производственном секторе региона (Empire Manufacturing index) за октябрь. В 16-30 Министерство торговли опубликует ключевой отчёт по розничным продажам в США за сентябрь (прогноз: +0,5%). В 17-55 Университет Мичигана выдаст данные по индексу потребительского доверия США за октябрь

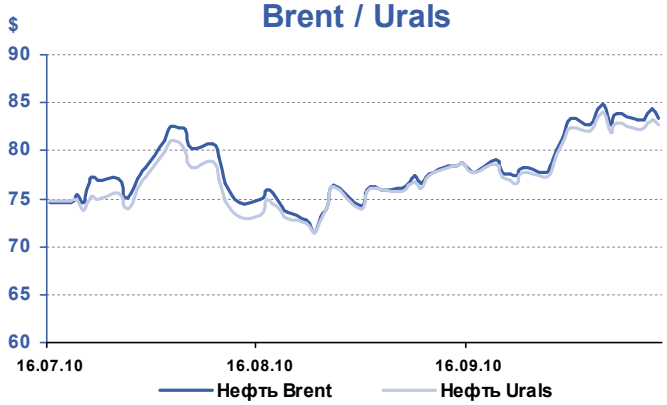
Commodities

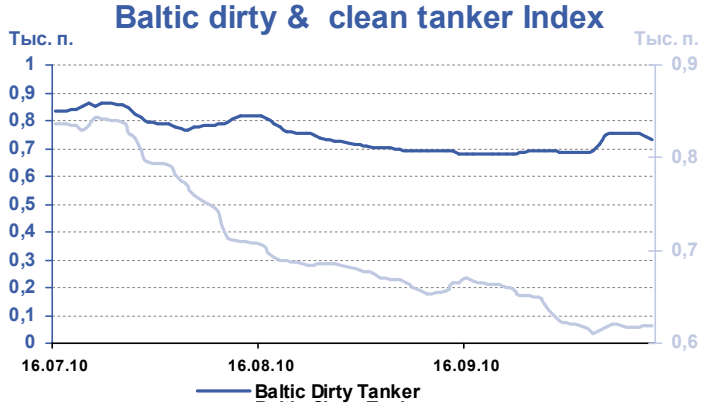












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 400,00	0,45%	3,70%	10,24%	35,05%
Цинк, $/t	2 414,00	0,17%	6,77%	12,54%	18,68%
Никель, $/t	24 305,00	-0,39%	1,69%	4,74%	31,02%
Олово, $/t	26 950,00	0,65%	5,27%	16,41%	88,79%
Алюминий, $/t	2 413,00	-0,17%	3,78%	12,02%	26,67%
Свинец, $/t	2 411,00	-0,99%	9,14%	7,75%	10,34%
Серебро, $/oz	24,65	2,72%	9,50%	19,73%	37,85%
Золото, $/oz	1 381,15	0,66%	3,57%	8,92%	30,00%
Нефть Brent, $/	83,38	-1,20%	0,75%	5,80%	14,36%
Нефть Urals, $/	82,74	-0,62%	0,99%	5,13%	14,25%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,552	0,00%	-2,35%		56 993	279
БашИнСв	BISV	0,151	0,00%	1,00%		163	141
БашЭнрг	BEGY	2,252	0,00%	0,36%		353 588	2 332
ВМЗ	VSMZ	1347,193	0,00%	0,70%		208 732	2 313
ДВМП	FESH	0,424	0,00%	-1,16%		145 275	1 252
КазанскВЗ	KHEL	2,042	0,00%	4,07%		1 181 454	311
КОМСТАР	CMST	6,486	0,00%	-1,58%		103 517	2 714
Мечел	MTLR	24,782	0,00%	1,23%		2 386 386	10 331
Мотовил	MOTZ	0,090	0,00%	-1,64%		12 603	90
Новсибэнрг	NVNG	34,927	0,00%	-0,94%		11 420	471
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,246	0,00%	1,22%		125 650	2 148
Сильвинит	SILV	705,198	0,00%	-1,37%		116 370	5 519
СинТЗ-ао	SNTZ	59,679	0,00%	0,00%		3 091	374
Славн-ЯНОС	JNOS	0,459	0,00%	-2,94%		2 435	429
СТЗ-ао	SVTZ	5,755	0,00%	-1,14%		194	267
ТАГМЕТ	TAMZ	0,733	0,00%	0,00%		73	373
У-УАЗ	UUAZ	1,583	0,00%	0,74%		152 952	422
ЧМК	CHMK	274,613	0,00%	-1,49%		71 921	865
ЧТПЗ	CHEP	2,046	0,00%	-1,55%		64 415	972
ЮжКузб.	UKUZ	42,378	0,00%	0,16%		22 539	1 510
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,600	0,35%	0,00%	21 800		7 419
Газпром	GAZP	5,440	0,00%	-1,48%	136 000	307 247 164	128 784
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	-0,86%	457 750	5 468 987	18 064
Лукойл	LKOH	57,600	0,00%	0,67%	288 000	76 711 960	49 333
НОВАТЭК	NVTK	7,740	0,00%	0,00%	7 740		23 501
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	-0,81%	1 833 500	103 438 196	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	1,009	0,00%	-0,99%		14 983 655	36 264
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	-1,04%	614 500	5 578 471	3 928
Транснефть, п.	TRNFP	1200,000	5,73%	2,13%	152 500	86 645 580	1 866
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,210	0,00%	0,00%	11 050		2 304
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	3,59%	0,45%	5 656	316 794	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,860	0,00%	-0,06%	8 600	97 318	796
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	2,87%	8 708	825 164	2 353
ОГК-2	OGKB	0,052	0,00%	0,00%	667 756		1 702
ОГК-3	OGKC	0,059	-3,93%	0,06%	5 274	3 167 005	2 783
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	207 814		5 611
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-0,97%	197 340	48 525	3 173
ТГК-3	MSNG	0,116	0,00%	-0,59%	144 351	2 272 324	4 611
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%		144 113	675
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-1,27%	5 300	48 515	987
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,149	0,00%	0,00%	41 570		141
ВолгаТелеком	NNSI	3,900	7,73%	0,00%	39 000		959
МГТС	MGTS	13,000	0,00%	0,00%	13 000		1 038
МТС	MTSS	8,400	0,00%	0,00%	84 000		16 744
Ростелеком	RTKM	4,580	0,00%	-1,01%	45 800	8 628 244	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	3,050	10,91%	6,15%	763 500	93 154 516	741
СЗТ	SPTL	0,800	0,00%	-1,35%	40 000	891 933	705
СибирьТелеком	ENCO	0,066	0,00%	0,00%	7 304		798
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%		9 895	110
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	-3,19%	176 400	9 549 074	1 266
ЦентрТелеком	ESMO	0,840	0,00%	0,00%	4 200		1 326
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,907	0,00%	-1,54%	12 695	1 694 705	1 259
ГАЗ	GAZA	28,500	-1,72%	0,00%	14 250		528
ИРКУТ	IRKT	0,293	0,00%	-0,83%		35 466	288

Казанский ВЗ	KHEL	1,880	0,00%	0,00%	57 274		290
КАМАЗ	KMAZ	2,399	0,00%	-1,50%		335 777	1 700
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	2,350	0,00%	-1,53%	11 750	6 876	83
РКК Энергия	RKKE	337,297	0,00%	2,22%		997	374
Северсталь-авто	SVAV	16,080	0,00%	-0,76%	6 802	370 960	551
Силовые машины	SILM	0,243	0,00%	0,00%	121 515		2 117
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,600	0,00%	0,00%	60 000		294
Бурятзолото	BRZL	28,500	0,00%	0,00%	7 125		200
ВСМПО	VSMO	94,500	0,00%	-0,37%	47 250	274 794	1 090
Мечел	MTLR	24,600	0,00%	0,00%	24 600		10 240
ММК	MAGN	0,980	1,03%	-1,41%	49 000	1 076 731	10 951
НЛМК	NLMK	3,809	0,00%	1,87%		3 531 423	22 695
НорНикель	GMKN	179,100	0,00%	0,61%	179 100	125 345 418	34 141
Полиметалл	PMTL	18,000	0,00%	0,57%	18 000	1 906 473	6 989
Полюс Золото	PLZL	50,000	0,00%	0,95%	50 000	21 695 405	9 531
Северсталь	CHMF	15,169	-1,50%	-0,45%	63 711	17 680 256	15 286
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	1,97%	67 855	1 333 587	4 257
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	32,399	0,00%	-0,61%		56 071	5 127
Возрождение	VZRZ	37,250	0,00%	0,01%	37 250	122 557	885
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,98%		62 101 131	31 873
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	-1,20%	6 120	1 822	2 687
Сбербанк	SBER	3,040	0,66%	0,00%	4 444 400		65 624
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	965		1 287
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,310	0,43%	-1,12%	115 500	1 703 738	2 566
Дальневосточное МП	FESH	0,425	0,00%	0,00%	6 375		1 254
НМТП	NMTP	0,128	0,00%	-0,88%		411 795	2 472
Приморское МП	PRIM	0,166	0,00%	-1,13%		20 898	129
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,800	4,40%	0,00%	69 800		399
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	-0,29%	16 950	4 025	5 143
Вимм-Билль-Данн	WBDF	65,000	0,00%	0,00%	131 000	3 191 965	2 860
Дикси	DIXY	11,680	0,00%	1,13%	70 080	392 351	1 004
Концерн Калина	KLNA	20,500	0,00%	0,04%	20 500	66 541	200
Красный Октябрь	KROT	10,477	0,00%	-0,95%		3 877	97
Магнит	MGNT	117,000	-0,85%	-1,92%	422 404	850 546	10 410
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	9,21%	45 617	236 126	23
Разгуляй	GRAZ	1,450	0,00%	0,79%	65 250	137 840	229
Седьмой континент	SCON	9,250	0,00%	0,00%	377 000		694
Фармстандарт	PHST	83,000	0,00%	-0,68%	41 500	568 418	3 137
Черкизово	GCHE	28,100	0,00%	0,88%	140 500	23 860	1 210
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,180	0,00%	0,00%	1 800		321
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,552	0,00%	-0,18%	55 200	555	889
Уфанефтехим	UFNC	4,550	0,00%	0,00%	9 055		1 253
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	9 975		490
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	270,000	0,00%	0,00%	5 130		376
ПИК	pikk	3,853	0,00%	-0,63%	57 795	2 239 684	1 901
РБК ИС	RBCI	1,160	0,00%	-0,58%	192 560	979 337	162
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,500	0,00%	-0,05%	15 250	407 221	1 454
Дорогобуж	DGBZ	0,507	0,00%	-1,61%		68 676	367
Сильвинит	SILV	698,536	0,00%	0,00%	30 037		5 467
Уралкалий	URKA	4,790	0,00%	0,63%		8 515 022	10 138
Уголь							
Белон	BLNG	0,930	8,14%	0,00%	7 977		1 070

Распадская	rasp	5,770	0,35%	0,23%	689 800	5 143 335	4 505
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	159,940	-2,18%	
Башнефть	AK6		EUR	153,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,960	0,51%	20,32
ТГК-3	AOMD		USD	11,490	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,970	-0,99%	24 881,81
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,367	-2,32%	0,99
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	1,27%	8,00
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,011	-47,62%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,350	-0,47%	3 875,90
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,600	1,66%	24 273,75
X5	FIVE		USD	42,470	-0,31%	9 291,28
Газпром	GAZ		EUR	15,335	-1,70%	1 656,42
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,250	0,89%	
ЮТК	KUE		EUR	6,000	-3,23%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	8,11%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,700	16,67%	
Лукойл	LKOD		USD	59,650	0,59%	152 346,60
Лукойл	LUK		EUR	42,290	0,00%	139,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	59,500	0,17%	20 391,18
МТС	MBT	5	USD	23,070	-0,26%	54 854,57
МТС	MKY	5	EUR	16,210	-1,04%	1,16
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	8,070	0,88%	0,45
Мечел	MTL	3	USD	24,810	-1,78%	53 491,05
НорНикель	NILSY	1	USD	18,350	2,06%	3 180,51
НорНикель	NNIA		EUR	12,905	0,08%	124,45
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	88,450	-0,06%	29 021,85
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,350	-0,93%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,650	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,990	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	21,620	-1,28%	349 036,20
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,540	-0,40%	324,15
Ростелеком	RTL		EUR	19,700	2,60%	4,57
Газпромнефть	SCF		EUR	14,210	0,07%	95,60
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,049	-1,66%	17,83
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,570	0,28%	9,16
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,050	-0,59%	233,38
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,050	-1,28%	454,28
АФКСистема	SSA	1	USD	26,650	-0,74%	4 276,19
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	45,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	27,250	0,93%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	149,050	0,00%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,575	-0,89%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,350	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,830	0,20%	43 397,82
ВТБ	VTBR		USD	6,120	-0,49%	30 180,86
Возрождение	VZY		EUR	26,750	1,90%	24,21
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	25,860	1,13%	8 253,55
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	18,115	0,17%	

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.