Говорят на рынке . . .

. . . По данным Росстата, в сентябре промышленное производство выросло на 6,2% по сравнению с аналогичным периодом прошлого года, тогда как средние прогнозы по показателю составляли 5,4%. Если подобная тенденция в ближайшие месяцы сохранится, это может убедить Банк России в устойчивости экономического восстановления и привести к росту процентных ставок.

. . . В правительственную программу приватизации могут быть включены госдоли в таких компаниях, как "Аэрофлот" и "Связьинвест". При этом приоритетным остается участие государства в капитале нефтяных компаний. Планы по продаже активов будут обсуждаться на совещании у премьер-министра РФ Владимира Путина на этой неделе.

. . . В III квартале 2010 г. Evraz Group снизила выпуск стали на 8,7% в годовом исчислении до 3,868 млн тонн. Тем не менее, компания повысила прогноз по прибыли EBITDA на отчетный период с $480-$550 млн до $550-$600 млн, объясняя это сокращением сроков ремонтных работ и ростом цен на прокат на внутреннем рынке.

Российский рынок: волатильность сохраняется

В пятницу финансовые площадки находились в ожидании очередных комментариев ФРС США относительно перспектив монетарного смягчения. На этот раз Бен Бернанке оказался более откровенен и указал на необходимость принятия новых мер в условиях высокой безработицы. Эту позицию подтвердила и макроэкономическая статистика: замедление темпов роста потребительских цен не дает забыть о риске дефляции, но одновременно развязывает Федрезерву руки в сохранении либерального денежно-кредитного курса.

Тем не менее, инвесторы неоднозначно отреагировали на подобные сообщения, и в результате основные мировые фондовые индексы завершили день разнонаправленными изменениями. Однако неделя в целом осталась за "быками". Среди российских бумаг в большей степени выросли котировки машиностроительного, металлургического и потребительского секторов. Позиции электроэнергетических компаний, напротив, несколько ослабли, что может быть связано с коррекцией в бумагах сетевых компаний после утверждения решения о переходе на пятилетний период регулирования.

Однако внутренние сообщения сейчас менее интересны участникам рынка, нежели зарубежная корпоративная отчетность и макростатистика. Начавшаяся неделя, по всей видимости, не станет исключением, поскольку на ближайшие дни приходится пик западных релизов за III квартал 2010 г. Кроме того, до начала ноября рынки продолжат обсуждать увеличение антикризисных вливаний со стороны США и неоднозначную реакцию центробанков других стран на подобные перспективы. В этом контексте в ближайшие дни повышенным вниманием могут пользоваться выступление главы ЕЦБ, протоколы последнего заседания Банка Англии, заседание Банка Канады, а также экономический обзор Федрезерва "Бежевая книга".

Поступающие сообщения будут поддерживать волатильность как на валютных, так и на фондовых площадках. И несмотря на то, что новостной фон уже складывается в более-менее понятную картину, инвесторы, вероятно, не смогут определиться с направлением дальнейшего движения до принятия официальных решений. Подобная нестабильность может сыграть против российского рынка, поскольку ситуация не способствует повышению интереса к рискам. Более того, "быков" может смущать близость годовых максимумов. Однако в случае сохранения давления на доллар, снижение котировок будет сдерживаться. Таким образом, пока мы не видим поводов для существенных изменений по рынку в целом, хотя не исключаем повышенной активности в отдельных бумагах, особенно учитывая, что на этой неделе многие российские компании будут подводить операционные и финансовые итоги минувшего квартала.

Накануне

MSCI World	1 223.43	-0.22%
MSCI North America	1 261.45	0.14%
MSCI Europe	92.12	0.08%
MSCI Pacific	2 130.31	-0.95%
MSCI EM	1 121.43	-0.51%
MSCI BRIC	362.40	-0.62%
MSCI Russia	833.87	-0.87%
Россия		
RTSI	1 581.90	-0.32%
RTSI (fut)	1 577.60	-0.49%
MICEX	1 491.48	0.16%
MICEX 10	3 553.82	0.90%
лидеры торгов ММВБ		
Башинформсвязь	5.85	28.71%
Силовые машины	7.81	5.59%
МосЭС	0.62	4.92%
Транснефть (ап)	37 097.90	4.63%
Финанс-Лизинг	17.23	-9.17%
США		
DJIA	11 062.78	-0.29%
S&P 500	1 176.19	0.20%
Nasdaq	2 468.77	1.37%
Европа		
FTSE 100	5 703.37	-0.42%
Xetra DAX	6 492.30	0.57%
CAC 40	3 827.37	0.21%

Утренний фон

Фьючерсы		
DJIA (fut)	10 974.00	-0.69%
S&P 500 (fut)	1 168.70	-0.37%
Nasdaq (fut)	2 087.25	0.92%
Азия		
Topix	831.17	0.58%
Nikkei 225	9 518.87	0.20%
Hang Seng	23 517.95	-1.01%
Shanghai Comp.	2 979.22	0.27%
Сырье		
нефть Brent	81.98	-0.58%
нефть Light Sweet	81.39	-0.65%
золото	1 361.62	-0.76%
Валюта		
EUR/USD	1.3880	-0.68%
USD/RUB	30.26	0.68%
доллар США (ЦБ РФ)	30.1243	0.64%
евро (ЦБ РФ)	42.3939	0.56%

Акции в составе индекса ММВБ

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию	Объем (руб)
Транснефть (ап)	TRNFP	35 362.50	37 688.00	35 362.50	37 097.87	4.63%	3 136 348 902.68
Северсталь	CHMF	453.00	470.60	450.37	469.04	3.54%	861 887 930.68
Распадская	RASP	173.02	177.94	172.67	177.94	2.62%	143 457 923.00
Аэрофлот	AFLT	69.31	71.71	68.51	69.98	1.83%	128 566 767.62
Сбербанк	SBER03	91.21	92.53	90.54	92.53	1.16%	15 324 716 639.95
ГМК Норильский никель	GMKN	5 425.00	5 540.00	5 422.19	5 492.00	1.09%	4 778 105 635.69
ФСК ЕЭС	FEES	0.3630	0.3670	0.3620	0.3670	0.82%	186 484 204.90
Сургутнефтегаз (ап)	SNGSP	15.3540	15.4900	15.1550	15.3600	0.79%	214 222 193.30
Уралсвязьинформ	URSI	1.185	1.197	1.179	1.191	0.76%	156 207 965.60
МТС	MTSI	250.00	250.99	248.70	250.96	0.75%	156 046 368.61
Новатэк	NOTK	233.62	237.90	232.19	235.70	0.73%	38 685 700.50
Полюс Золото	PLZL	1 600.00	1 618.92	1 592.88	1 606.99	0.44%	297 632 611.93
Банк ВТБ	VTBR	0.0910	0.0921	0.0902	0.0916	0.44%	1 953 672 943.50
Интер РАО ЕЭС	IUES	0.0481	0.0487	0.0479	0.0483	0.42%	209 128 101.10
Сбербанк (ап)	SBERP03	65.19	66.12	65.11	65.52	0.32%	2 475 701 650.64
РусГидро	HYDR	1.5940	1.6110	1.5860	1.5980	0.25%	755 778 940.90
Ростелеком	RTKM	137.72	138.40	136.30	137.20	0.15%	64 348 741.84
ВолгаТелеком	VTEL	115.72	116.73	114.75	116.00	0.06%	6 131 562.13
ОГК-3	OGKC	1.7410	1.7680	1.7260	1.7540	-0.28%	16 474 478.70
Татнефть	RU14TATN3006	151.60	151.60	149.36	150.30	-0.30%	94 903 107.94
Газпром нефть	SIBN	120.37	120.50	119.20	119.77	-0.32%	74 817 470.10
ММК	MAGN	29.7150	29.7150	28.8100	29.1470	-0.45%	50 958 533.80
Лукойл	LKOH	1 790.10	1 826.70	1 777.00	1 785.00	-0.67%	5 237 912 662.52
Газпром	GAZP	162.45	163.12	160.63	161.00	-0.80%	7 144 705 756.43
Сургутнефтегаз	SNGS	30.330	30.550	29.950	30.087	-0.83%	453 633 239.00
Мосэнерго	MSNG	3.3650	3.3750	3.3220	3.3360	-0.86%	42 844 627.80
Роснефть	ROSN	211.00	212.12	207.92	209.09	-1.00%	3 658 661 870.93
Уралкалий	URKA	143.91	145.00	141.02	141.89	-1.47%	211 905 491.99
НЛМК	NLMK	114.70	115.10	112.40	112.50	-1.75%	53 440 910.00
Полиметалл	PMTL	533.46	534.90	517.78	520.00	-1.89%	47 157 254.24

данные биржи ММВБ

ADR и GDR российских компаний в Лондоне

Эмитент	Тикер	Цена открытия	Дневной максимум	Дневной минимум	Цена закрытия	Изменение к пред. закрытию
Северсталь	SVST	15.23	24.00	5.08	15.53	2.17%
Фармстандарт	PHST	23.15	29.27	16.01	23.50	2.00%
Группа ЛСР	LSRG	7.83	12.30	3.95	8.05	1.71%
ГМК Норильский никель	MNOD	18.29	20.59	8.58	18.52	1.09%
НМТП	NCSP	9.65	15.48	5.00	9.70	0.73%
ТМК	TMKS	18.40	25.00	13.75	18.48	0.49%
Комстар ОТС	CMST	6.35	7.50	0.81	6.37	0.31%
Магнит	MGNT	26.95	30.12	12.11	26.65	0.19%
Акрон	ACRN	3.05	4.21	2.25	3.05	0.00%
Ситроникс	SITR	0.90	5.25	0.70	0.90	0.00%
Система Галс	HALS	1.35	2.15	0.80	1.35	0.00%
Evraz Group	EVR	31.55	43.25	14.49	30.55	-0.16%
Татнефть	ATAD	32.75	40.00	13.78	32.85	-0.36%
Банк ВТБ	VTBR	6.06	6.48	2.84	6.09	-0.49%
Полюс Золото	PLZL	32.10	34.60	21.72	31.63	-0.75%
Новатэк	NVTK	88.55	96.95	36.55	87.40	-1.19%
РусГидро	HYDR	5.35	9.13	3.11	5.31	-1.21%
Ростелеком	RKMD	27.20	59.40	17.20	27.20	-1.23%
Сургутнефтегаз	SGGD	9.99	21.98	4.83	9.94	-1.24%
Газпром нефть	GAZ	19.84	31.69	16.53	19.65	-1.26%
Лукойл	LKOD	59.80	62.60	25.49	58.75	-1.51%
Газпром	OGZD	21.53	27.33	10.63	21.25	-1.71%
Уралкалий	URKA	24.01	25.36	14.76	23.58	-1.95%
Полиметалл	PMTL	17.55	18.10	8.53	17.20	-1.99%
НЛМК	NLMK	37.88	41.00	24.84	37.51	-2.06%
АФК Система	SSA	26.13	33.00	13.60	26.08	-2.14%
Интегра	INTE	2.85	4.50	2.04	2.85	-2.73%
ММК	MMK	12.70	20.38	7.50	12.35	-2.76%
Роснефть	ROSN	6.99	34.20	4.02	6.82	-2.85%
X5 Retail Group	FIVE	41.50	45.36	27.43	41.10	-3.23%

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	159 520	157 065	157 720	-0.51%	1 027 364
Индекс РТС Стандарт	дек'10	10 271	10 130	10 209	0.28%	10 532
						Акции
Газпром	дек'10	16 369	16 130	16 162	-0.69%	165 213
Лукойл	дек'10	18 333	17 851	17 934	-0.32%	94 008
Роснефть	дек'10	21 231	20 782	20 782	-1.82%	21 478
Сбербанк	дек'10	6 654	6 490	6 595	0.44%	14 857
Банк ВТБ	дек'10	9 242	9 047	9 165	0.26%	11 891
ГМК Норильский никель	дек'10	55 237	53 810	54 735	1.21%	6 177
Уралсвязьинформ	дек'10	1 211	1 182	1 211	1.68%	1 639
Транснефть (ап)	дек'10	37 797	35 001	37 230	4.48%	1 364
Сургутнефтегаз	дек'10	30 495	29 933	30 100	-1.11%	1 044
Северсталь	дек'10	46 944	45 245	46 782	3.91%	572
РусГидро	дек'10	16 179	15 985	16 000	-0.32%	230
Татнефть	дек'10	15 135	15 050	15 050	-0.67%	151
МТС	дек'10	25 295	24 910	24 961	0.49%	125
Новатэк	дек'10	23 000	23 000	23 000	-	10
Полюс Золото	дек'10	16 000	15 800	15 800	-1.25%	5
						Валюта
Курс евро / доллар США	дек'10	1.4149	1.3978	1.4020	-0.36%	428 494
Курс доллар США / рубль	дек'10	30 474	30 152	30 432	0.88%	509 707
Курс евро / рубль	дек'10	42 840	42 400	42 675	0.53%	8 577
						Товарные контракты
Нефть Brent	окт'10	85.58	83.28	83.61	-1.48%	46 176
Золото в слитках	дек'10	1 389.00	1 365.80	1 372.30	-0.63%	49 211
Серебро в слитках	дек'10	24.82	24.14	24.30	-1.26%	5 028
Платина в слитках	дек'10	1 715.00	1 690.00	1 699.50	-0.61%	694

данные биржи РТС

Статистика сырьевых рынков

Фьючерс	Еденица измерения	15.10.10	Предыдущее закрытие	Изменение
			Энергоносители	
Нефть Brent	$/баррель	84.23	85.06	-0.98%
Нефть Light Sweet	$/баррель	81.35	82.83	-1.79%
Нефть Urals (спот-цены)	$/баррель	81.85	82.80	-1.15%
Нефть Rebco	$/баррель	80.80	82.55	-2.12%
Природный газ	$/млн БТЕ *	3.525	3.649	-3.40%

* 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	1364.7	1380.1	-1.12%
Серебро (Silver)	$/унция	24.29	24.68	-1.58%
Палладий (Palladium)	$/унция	589.45	601.55	-2.01%
Платина (Platinum)	$/унция	1694.30	1712.50	-1.06%

данные Нью-Йоркской товарной биржи (NYMEX)

Медь (Copper)	$/тонна	8362.5	8412.0	-0.59%
Никель (Nickel)	$/тонна	24250.0	24355.0	-0.43%
Олово (Tin)	$/тонна	26855.0	27600.0	-2.70%
Свинец (Lead)	$/тонна	2377.0	2402.0	-1.04%
Цинк (Zinc)	$/тонна	2380.0	2399.0	-0.79%
Алюминий (Aluminium)	$/тонна	2368.0	2402.0	-1.42%
Алюминиевый сплав (NASAAC)	$/тонна	2276.0	2301.0	-1.09%
Сталь (Steel) *	$/тонна	475.5	466.0	2.04%

* Средиземноморье: поставка в Турцию, ОАЭ (Дубай)

данные Лондонской биржи металлов (LME)

			Сельскохозяйственные товары	
Зерно (Corn)	$/бушель	7.0600	7.0560	0.06%
Соевые бобы (Soybeans)	$/бушель	11.8460	12.0340	-1.56%
Пшеница (Wheat)	$/бушель	5.6220	5.7420	-2.09%
Овес (Oats)	$/бушель	3.7040	3.7600	-1.49%
Неочищенный рис (Rough Rice)	$/CWT*	0.1355	0.1359	-0.29%

* CWT (hundredweight) = ~0,045 тонны

данные Чикагской товарной биржи (CBOT)

Кофе (Coffee)	$/фунт	1.8665	1.8760	-0.51%
Какао-бобы (Cocoa)	$/тонна	2802.0	2880.0	-2.71%
Сахар (Sugar)	$/фунт	0.2698	0.2794	-3.44%
Хлопок (Cotton)	$/фунт	1.1000	1.1750	-6.38%

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.