ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУПП

Ежедневный обзор рынка акций

21 октября 2010г.

Комментарий по рынку акций

Американские фондовые индексы в среду завершили торговую сессию хорошим ростом, который позволил им компенсировать большую часть потерь, понесенных в предыдущий день. В лидерах роста вчера были акции компаний сырьевого сектора (металлургия, нефтянка, химия). Толчком к росту покупок в этом секторе стал резкий набор высоты ценами на сырьевые товары, которые в свою очередь пошли вверх после очередной волны ослабления позиций американского доллара.

Вечером в СМИ просочились подробности специально отчета

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 556,74	-0,88%	-2,02%	5,31%	7,65%
Индекс ММВБ	1 493,49	0,20%	0,02%	4,16%	9,67%
FTSE	5 728,93	0,44%	-0,32%	2,74%	9,26%
S&P 500	1 178,17	1,05%	0,01%	3,37%	7,98%
Dow Jones Avg.	11 107,97	1,18%	0,11%	3,22%	10,62%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аэрофлот	2,4200	2,54%	12,04%	59,21%
Транснефть, п.	1270,0000	1,60%	15,56%	58,16%
Дальневосточное МП	0,4300	1,18%	4,24%	21,99%
Полюс Золото	50,5000	1,00%	11,73%	-5,61%
ОАО Банк Санкт-	4,3100	0,02%	18,08%	52,03%

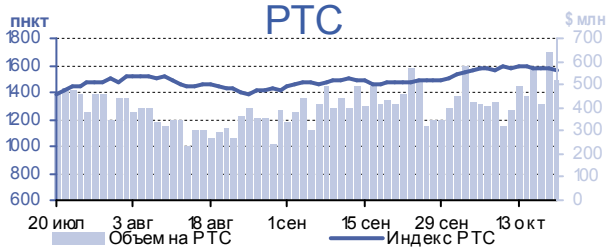
Лидеры снижения

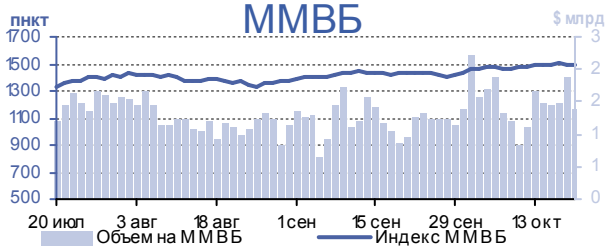
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь	14,5000	-6,51%	7,41%	76,83%
Концерн Калина	19,5000	-4,88%	8,33%	25,81%
Башнефть, п.	32,0000	-4,05%	3,39%	140,60%
ВолгаТелеком	3,7500	-3,85%	3,59%	50,00%

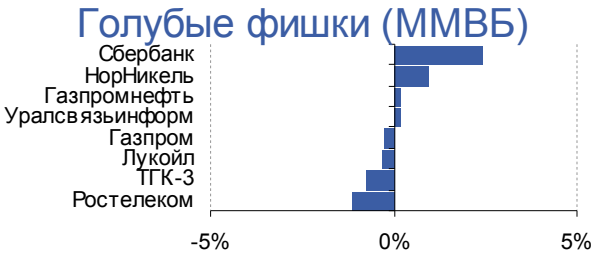
Индекс MSCI

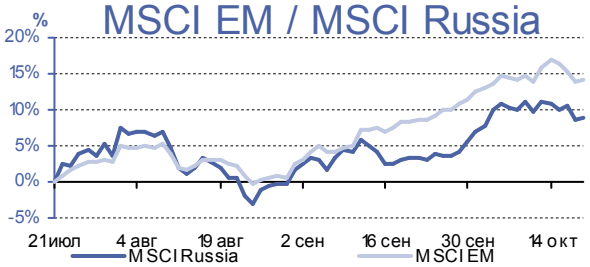
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1101,28	0,33%	5,49%	13,28%
Индекс MSCI BRAZIL	3744,91	1,56%	7,99%	7,28%
Индекс MSCI RUSSIA	825,69	0,10%	5,22%	-1,13%
Индекс MSCI INDIA	555,60	-0,75%	2,83%	20,32%
Индекс MSCI CHINA	69,40	-1,24%	6,91%	7,36%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Американские фондовые индексы в среду завершили торговую сессию хорошим ростом, который позволил им компенсировать большую часть потерь, понесенных в предыдущий день. В лидерах роста вчера были акции компаний сырьевого сектора (металлургия, нефтянка, химия). Толчком к росту покупок в этом секторе стал резкий набор высоты ценами на сырьевые товары, которые в свою очередь пошли вверх после очередной волны ослабления позиций американского доллара.

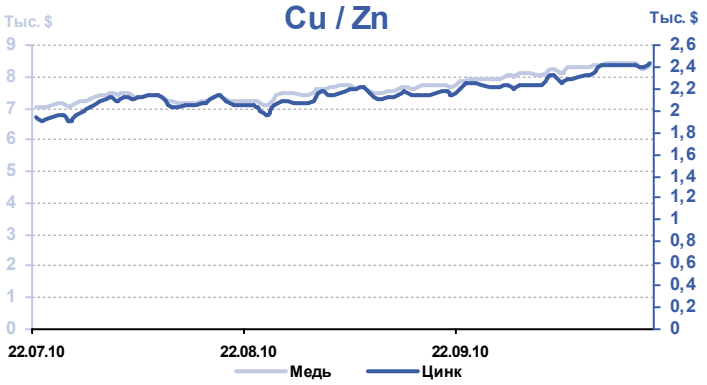
Вечером в СМИ просочились подробности специально отчета компании Medley Global Advisors, в котором сообщалось, что ФРС готовит агрессивное расширение программы количественного смягчения на общую сумму в $1500 трлн. На этом фоне пара EUR/USD взлетела до отметки 1,3980. Однако, несколько охладила пыл валютных спекулянтов статья в Wall Street Journal Министра финансов США Тимоти Гайтнера, из которой следует, что он не видит необходимости в дальнейшем ослаблении доллара против евро и йены. В итоге сегодня курс евро опять опустился к уровню $1,39. Такие резкие колебания валют не могли не привести к изменению цен на сырьевых рынках. Так, в ходе вчерашних торгов котировки смеси Brent выросли на 2,4%, поднявшись до отметки $83,3/барр. То что цены на золото ($1341/унц) довольно вяло отреагировали на шумиху вокруг валют говорит о том, что нынешний заход на ослабление доллара может не получить продолжения.

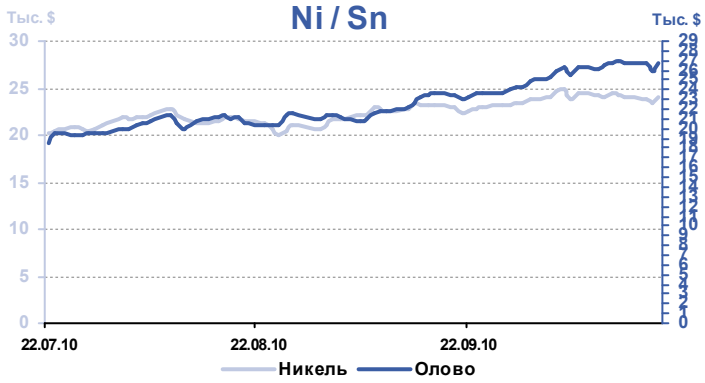
Вышедшие сегодня данные из Китая показали, что его ВВП в 3-м квартале показал минимальный прирост за год - 9,6%, в то время как инфляция в сентябре ускорилась до самого высокого уровня за 23 месяца (+3,6% г/г; против +3,5% г/г в августе).

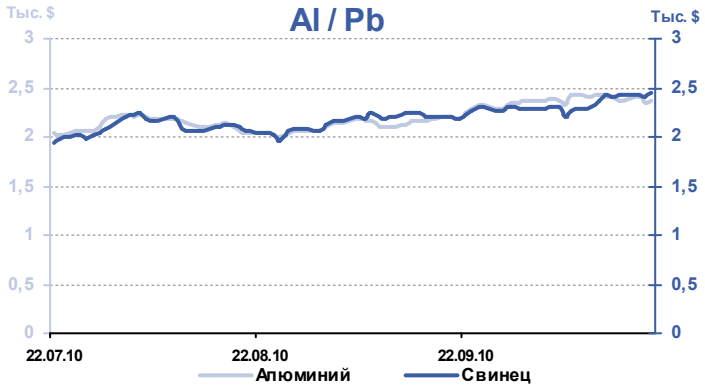
Открытие торгов на российских биржах в четверг мы ожидаем увидеть в умеренно-позитивной зоне. Думаю, вечерний взлет котировок акций Сбербанка сегодня будет иметь недолгое продолжение. Именно на нем индекс ММВБ может подняться до отметки 1497-1500 пунктов. Мы рекомендуем сегодня частично фиксировать прибыль по спекулятивным позициям в лонгах. Вчера после закрытия торгов стало известно, что государство пока не планирует приватизацию компании Транснефть. Оно готово снизить свою долю в капитале Сбербанка до контрольной в период с 2011 до 2014 года, может в следующем году продать 10% акций в банке ВТБ, а в 2012-2015 годах может выйти на продажу 15% акций Роснефти. Эти известия наиболее чувствительно сегодня отзовутся на котировках привилегированных бумаг Транснефти.

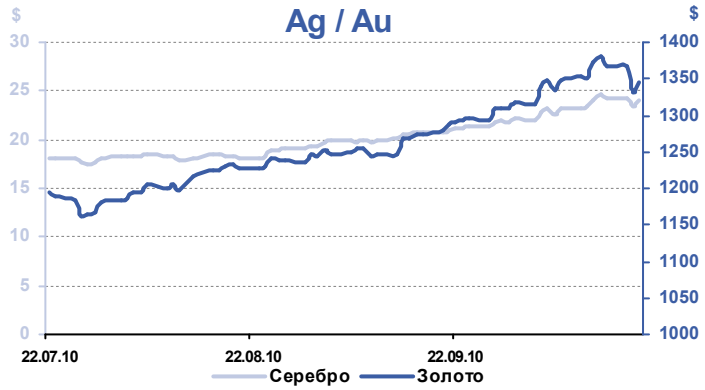
Сегодня в 11-30 ждем статистику из Германии по индексу деловой активности в производственном секторе и секторе услуг. Аналогичные показатели по еврозоне выходят в 12-00. В 16-30 ждем выхода данных из США по количеству заявок за пособиями по безработице. В 18-00 выходит индекс деловой активности от ФРБ Филадельфии

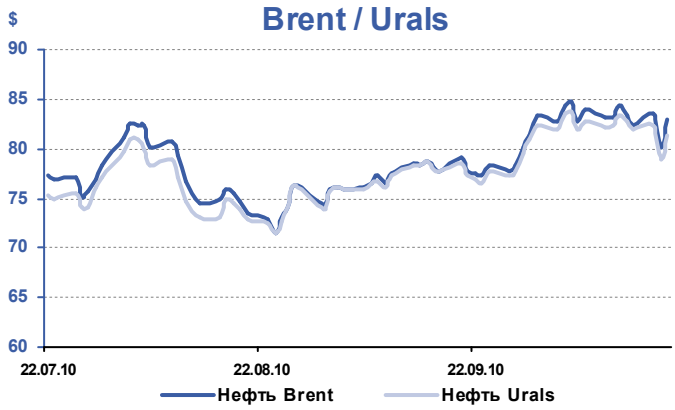
Commodities

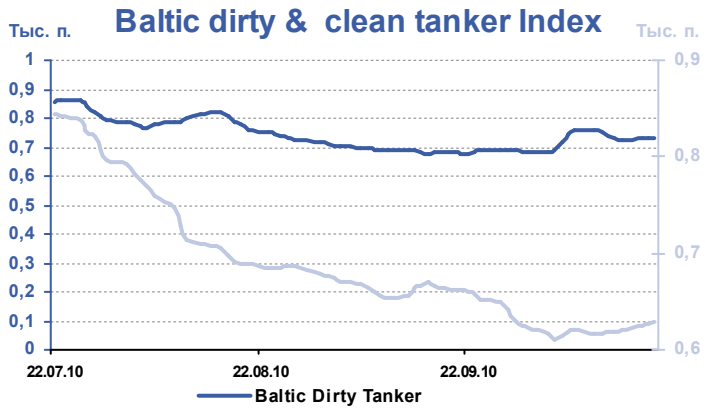












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 340,00	0,97%	-0,26%	8,59%	29,99%
Цинк, $/t	2 440,00	2,01%	1,24%	13,91%	14,55%
Никель, $/t	23 945,00	2,00%	-1,86%	7,11%	27,03%
Олово, $/t	26 750,00	3,28%	-0,09%	16,30%	85,76%
Алюминий, $/t	2 362,00	0,28%	-2,28%	8,60%	23,41%
Свинец, $/t	2 450,00	2,08%	0,62%	12,64%	6,57%
Серебро, $/oz	23,95	2,50%	-0,19%	14,21%	36,90%
Золото, $/oz	1 346,25	1,07%	-1,89%	4,59%	27,58%
Нефть Brent, $/	82,89	3,48%	-1,78%	6,68%	9,53%
Нефть Urals, $/	81,35	3,05%	-2,29%	5,35%	7,27%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,531	0,00%	-2,80%		25 817	266
БашИнСв	BISV	0,175	0,00%	-0,37%		19 221	160
БашЭнрг	BEGY	2,278	0,00%	-0,43%		201 516	2 371
ВМЗ	VSMZ	1352,809	0,00%	0,97%		132 270	2 417
ДВМП	FESH	0,429	0,00%	2,26%		138 159	1 263
КазанскВЗ	KHEL	2,037	0,00%	1,30%		1 202 998	315
КОМСТАР	CMST	6,356	0,00%	-1,02%		22 852	2 655
Мечел	MTLR	24,090	0,00%	-0,81%		670 848	10 012
Мотовил	MOTZ	0,090	0,00%	0,00%		912	88
Новсибэнрг	NVNG	34,880	0,00%	-3,78%		7 481	466
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,258	0,00%	-0,25%		55 191	2 245
Сильвинит	SILV	691,041	0,00%	1,53%		1 201 234	5 347
СинТЗ-ао	SNTZ	55,416	0,00%	0,00%		554	349
Славн-ЯНОС	JNOS	0,453	0,00%	0,03%		4 984	423
СТЗ-ао	SVTZ	5,380	0,00%	-5,69%		144	267
ТАГМЕТ	TAMZ	0,714	0,00%	0,00%		71	363
У-УАЗ	UUAZ	1,592	0,00%	-0,91%		337 665	427
ЧМК	CHMK	264,042	0,00%	0,87%		58 337	831
ЧТПЗ	CHEP	1,907	0,00%	-3,16%		103 133	907
ЮжКузб.	UKUZ	41,171	0,00%	0,24%		13 795	1 483
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	42,500	-1,28%	0,00%	338 307		7 232
Газпром	GAZP	5,390	0,00%	-0,23%	2 695 000	210 731 799	127 600
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	0,21%	457 750	1 568 049	18 064
Лукойл	LKOH	57,600	0,00%	-0,30%	288 000	75 072 251	49 333
НОВАТЭК	NVTK	7,934	0,00%	0,00%	15 851		24 090
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,35%	1 833 500	67 891 176	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,969	0,00%	-1,20%		13 400 205	34 652
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	-1,52%	614 500	6 865 439	3 928
Транснефть, п.	TRNFP	1270,000	1,60%	1,23%	127 000	68 952 413	1 975
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,288	0,00%	0,00%	5 720		2 386
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	0,42%	5 656	41 987	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,865	-1,70%	0,34%	17 300	46 558	801
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	-0,07%	8 708	215 295	2 353
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,057	0,00%	-1,93%	85 800	2 023 577	2 707
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	207 814		5 611
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-0,04%	197 340	130 253	3 173
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	-0,73%	10 800	887 175	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%		91 963	654
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	0,00%	5 300	34 105	987
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,189	0,00%	0,00%	18 900		179
ВолгаТелеком	NNSI	3,750	-3,85%	0,00%	37 500		922
МТС	MTSS	8,300	0,00%	0,00%	434 090		16 545
Ростелеком	RTKM	4,580	0,00%	-1,11%	45 800	3 573 647	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	-0,11%	30 000	10 376 364	728
СЗТ	SPTL	0,800	0,00%	0,24%	40 000	321 644	705
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	-0,60%		22 735	113
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	0,17%	584 850	4 454 100	1 259
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,907	0,00%	5,80%	12 695	5 805 014	1 259
ГАЗ	GAZA	27,000	0,00%	0,00%	4 374		500
ИРКУТ	IRKT	0,289	0,00%	-0,17%		5 410	281
Казанский ВЗ	KHEL	1,880	0,00%	0,00%	57 274		290
КАМАЗ	KMAZ	2,412	0,00%	2,72%		917 581	1 703
Кировский завод	KIRZ	11,000	0,00%	0,00%	11 000		120

Красный Котельщик	KRKO	0,500	0,00%	0,00%	7 500		107
Нефтекамский автозавод	nfaz	8,000	0,00%	0,00%	9 256		64
ОМЗ	OMZZ	2,250	-2,17%	0,13%	19 125	43 917	80
РКК Энергия	RKKE	309,516	0,00%	2,10%		2 104	338
Северсталь-авто	SVAV	16,080	0,00%	-0,55%	6 802	1 314 493	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	96,500	-0,52%	-2,06%	48 250	798 616	1 113
Мечел	MTLR	24,650	0,00%	0,00%	73 650		10 261
ММК	MAGN	0,943	0,00%	0,58%	94 300	1 189 393	10 537
НЛМК	NLMK	3,488	0,00%	-1,20%		2 069 137	21 004
НорНикель	GMKN	180,000	0,00%	0,96%	180 000	77 171 116	34 313
Полиметалл	PMTL	18,000	0,00%	-1,85%	18 000	628 540	6 989
Полюс Золото	PLZL	50,500	1,00%	-0,84%	50 500	7 559 182	9 627
Северсталь	CHMF	14,500	-6,51%	-1,24%	29 100	30 037 331	14 612
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	1,69%	67 855	5 045 043	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	32,133	0,00%	0,38%		108 748	5 036
Возрождение	VZRZ	40,250	-0,62%	1,54%	120 450	375 649	956
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,97%		85 560 359	31 780
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	0,00%	6 120	4 602	2 687
Сбербанк	SBER	3,140	-0,63%	0,00%	663 905		67 999
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	965		1 287
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,420	2,54%	0,28%	60 500	5 323 394	2 688
Дальневосточное МП	FESH	0,430	1,18%	0,00%	215 000		1 269
НМТП	NMTP	0,127	0,00%	0,73%		838 714	2 431
Приморское МП	PRIM	0,164	0,00%	-0,40%		1 206	130
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	-0,51%	16 950	114 641	5 143
Вимм-Билль-Данн	WBDF	64,500	0,00%	0,10%	64 500	138 438	2 838
Дикси	DIXY	11,500	-3,36%	-0,30%	23 000	130 759	989
Концерн Калина	KLNA	19,500	-4,88%	-1,14%	72 150	27 407	190
Красный Октябрь	KROT	10,210	0,00%	0,06%		5 312	93
Магнит	MGNT	117,500	-2,49%	0,16%	353 150	1 143 274	10 455
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	-1,24%	45 617	33 478	23
Разгуляй	GRAZ	1,460	0,00%	-0,34%	7 300	105 945	231
Седьмой континент	SCON	8,750	0,00%	0,00%	35 000		656
Фармстандарт	PHST	82,500	0,00%	-0,04%	41 250	1 316 283	3 118
Черкизово	GCHE	28,100	0,00%	0,95%	140 500	190 799	1 210
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,180	0,00%	0,00%	1 800		321
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,552	0,00%	0,00%	55 200	14 829	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	3,770	0,00%	0,75%	10 004	4 353 277	1 860
РБК ИС	RBCI	1,160	0,00%	-0,54%	11 600	784 823	162
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,150	0,00%	1,40%	60 700	723 681	1 438
Дорогобуж	DGBZ	0,489	0,00%	-0,07%		5 664	355
Сильвинит	SILV	700,000	0,00%	0,00%	70 000		5 478
Уралкалий	URKA	4,649	0,00%	1,86%		7 706 945	9 778
Уголь							
Белон	BLNG	0,930	0,00%	0,00%	7 977		1 070
Распадская	rasp	5,720	-1,38%	-0,01%	139 996	2 893 470	4 466
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	172,050	-1,38%	6,06
Башнефть	AK6		EUR	151,000	-2,58%	35,60
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,350	0,15%	6 052,02
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,610	3,80%	5,09
Бурятзолото	BYT		EUR	19,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,016	-5,88%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,290	-0,47%	3 230,97
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	29,340	-2,20%	21 119,44
X5	FIVE		USD	41,000	-0,97%	6 296,75
Газпром	GAZ		EUR	15,200	-1,39%	1 594,77
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,500	-1,79%	3,29
ЮТК	KUE		EUR	5,800	-6,45%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	5,26%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,700	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,800	-0,87%	136 520,00
Лукойл	LUK		EUR	40,600	-2,06%	490,27
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,050	0,78%	2 721,72
МТС	MBT	5	USD	22,190	-0,31%	57 389,33
МТС	MKY	5	EUR	15,630	-3,58%	9,67
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,600	-2,56%	10,56
Мечел	MTL	3	USD	23,820	-0,25%	81 207,00
НорНикель	NILSY	1	USD	18,360	2,00%	1 048,28
НорНикель	NNIA		EUR	13,275	0,76%	149,31
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	87,500	-1,19%	13 311,66
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,250	-0,94%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,750	12,78%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,850	4,05%	
Газпром	OGZD		USD	21,090	-0,80%	323 910,30
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	-15,79%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,200	0,00%	4 301,33
Ростелеком	RTL		EUR	19,350	1,84%	1,94
Газпромнефть	SCF		EUR	13,935	-0,82%	82,91
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,800	-2,84%	6,97
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,490	-4,38%	21,85
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,010	0,40%	185,03
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,650	-0,21%	154,32
АФКСистема	SSA	1	USD	25,700	-1,72%	4 564,93
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	29,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	146,550	-0,03%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,525	-0,45%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,500	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,840	0,00%	48 222,89
ВТБ	VTBR		USD	6,130	0,16%	11 136,76
Возрождение	VZY		EUR	28,500	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	25,400	-0,43%	27 459,64
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,925	-3,55%	

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.