ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

28 октября 2010г.

Комментарий по рынку акций

В среду фондовые индексы США завершили торги в разнополярных областях в близи уровней закрытия предыдущего дня. Выходящая корпоративная отчетность, макростатистика и новостной фон не давали поводов для яркой коррекции. Так, объем заказов на товары длительного пользования в США в сентябре вырос на +3,3%, правда, в основном за счет увеличения заказов на гражданские самолеты. Продажи новых домов в сентябре выросли на +6,6% (307 тыс. домов), что так же оказалось лучше прогноза (+4,2%). Продажи, которые были заметны на заокеанских биржах в первой половине торгов, не носили агрессивного характера, поэтому индексам удалось

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 583,17	-1,65%	1,70%	6,71%	11,39%
Индекс ММВБ	1 507,05	-1,17%	0,91%	6,87%	13,03%
FTSE	5 646,02	-1,07%	-1,45%	1,21%	8,56%
S&P 500	1 182,45	-0,27%	0,36%	3,03%	11,19%
Dow Jones Avg.	11 126,28	-0,39%	0,16%	2,47%	12,59%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Банк Санкт-	4,7250	5,00%	21,15%	65,79%
ОАО Компания М.видео	7,5000	3,45%	16,28%	88,92%
ПИК	3,7900	0,53%	-6,19%	-6,23%

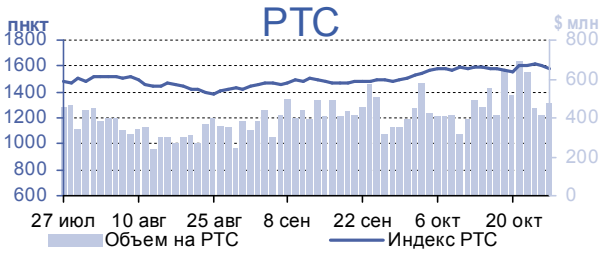
Лидеры снижения

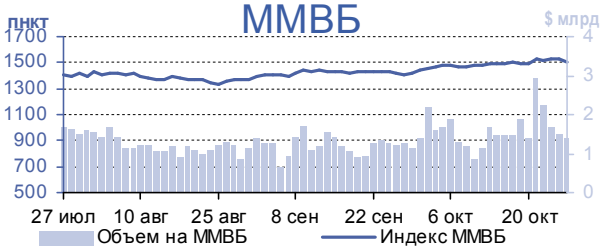
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	115,0000	-2,54%	2,68%	60,28%
Башнефть, п.	31,4000	-1,87%	-2,64%	136,98%
Аэрофлот	2,3800	-1,65%	11,21%	51,59%
Сбербанк	3,2600	-1,21%	18,76%	18,76%

Индекс MSCI

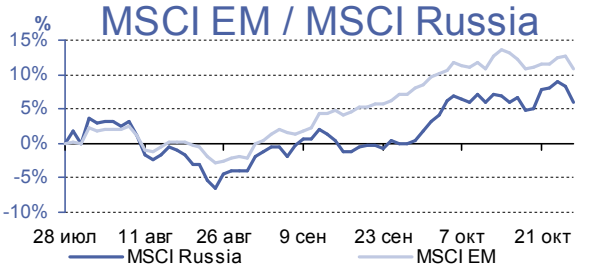
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1098,93	-1,58%	3,54%	16,05%
Индекс MSCI BRAZIL	3671,10	-1,10%	2,07%	7,36%
Индекс MSCI RUSSIA	833,63	-2,08%	6,09%	3,53%
Индекс MSCI INDIA	556,32	-1,11%	1,90%	29,26%
Индекс MSCI CHINA	68,43	-2,24%	5,18%	5,77%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В среду фондовые индексы США завершили торги в разнополярных областях в близи уровней закрытия предыдущего дня. Выходящая корпоративная отчетность, макростатистика и новостной фон не давали поводов для яркой коррекции. Так, объем заказов на товары длительного пользования в США в сентябре вырос на +3,3%, правда, в основном за счет увеличения заказов на гражданские самолеты. Продажи новых домов в сентябре выросли на +6,6% (307 тыс. домов), что так же оказалось лучше прогноза (+4,2%). Продажи, которые были заметны на заокеанских биржах в первой половине торгов, не носили агрессивного характера, поэтому индексам удалось удержаться в рамках растущих трендовых показателей.

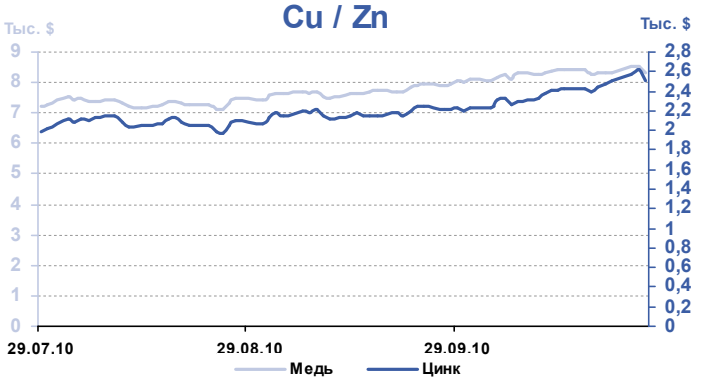
На фоне нейтральной динамики на заокеанских фондовых биржах основная валютная пара EUR/USD вчера не нашла в себе сил уйти существенно ниже уровня 1,38. Над валютным рынком по-прежнему витает интрига возможных объемов количественного смягчения, которая будет оглашена ФРС в начале следующей недели. Цены на нефть, хоть и испытывают высокую волатильность, но все равно остаются в рамках бокового тренда. Сегодня утром котировки смеси Brent торгуются на среднем уровне вчерашнего дня – $83,2/барр. В четверг Южная Корея сообщила о расширении платежного баланса в сентябре, а Новая Зеландия сообщает о высоких экспортных ценах. Эти факторы сегодня поддерживают спрос на акции в азиатско-тихоокеанских биржах. Банк Японии решил оставить процентную ставку (0,1%) и денежно-кредитную политику без изменения.

Открытие торгов на российских биржах в четверг мы увидим с гэпом вверх в пределах полпроцента. То, что вчера российские индексы ММВБ и основные ликвидные бумаги завершили сессию на минимальных дневных отметках позволяет рассчитывать, что давление продаж на наших биржах будет ощущаться в течение первого часа торгов. Нейтрально-позитивная динамика в американских фьючерсах (S&P +0,13%), отсутствие негатива в Азии (MSCI Asia +0,6%) и плавное восстановление цен на рынке сырьевых контрактов (медь +0,46%; никель +0,2%) – все эти факторы легко могут вывести наши индексы в зону опять в зону роста ближе к обеду. Причем отскок можно будет увидеть в акциях банков, которые вчера понесли существенные потери. Мы также рассчитываем увидеть сохранение спроса в акциях энергетических компаний. В целом можно сказать, что когда рынок выносит хорошую позицию против правил – это значит, что рынок не определился. Высокая волатильность внутри дня наказывает как покупателей, так и продавцов. В такой ситуации нужно либо побыть некоторое время вне рынка, либо сохранять позиции расширив границы по стоп-заявкам.

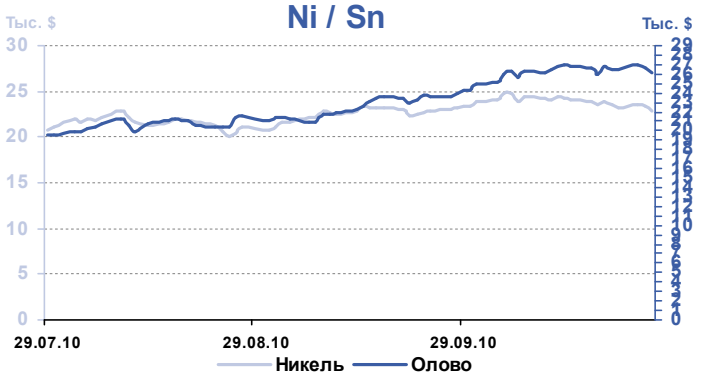
Сегодня в 12-30 ждем выступления главы ЕЦБ Ж-К. Трише. В 16-30 ждем данных из США по числу обращений за пособием по безработице в США. Свою квартальную отчётность в четверг представят компании: 3M, Barrick Gold, Colgate-Palmolive, Dow Chemical, Eastman Kodak, Exxon Mobil, Microsoft, Motorola, Sony.

Commodities

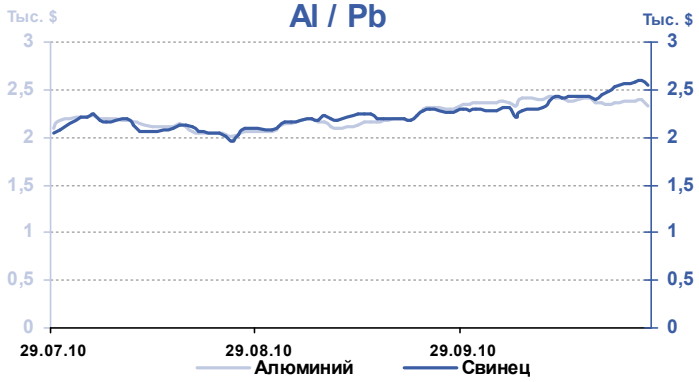
Cu / Zn



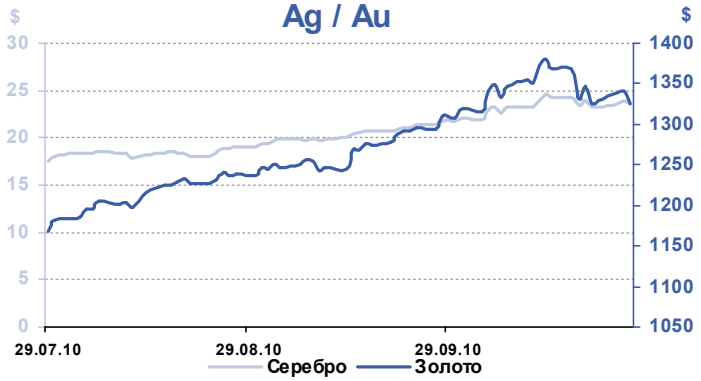
Ni / Sn



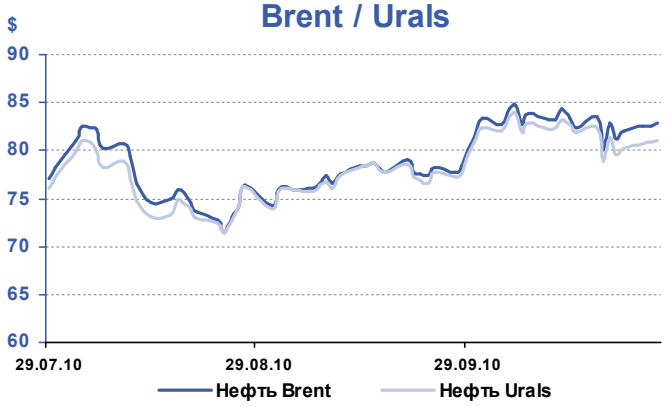
Al / Pb



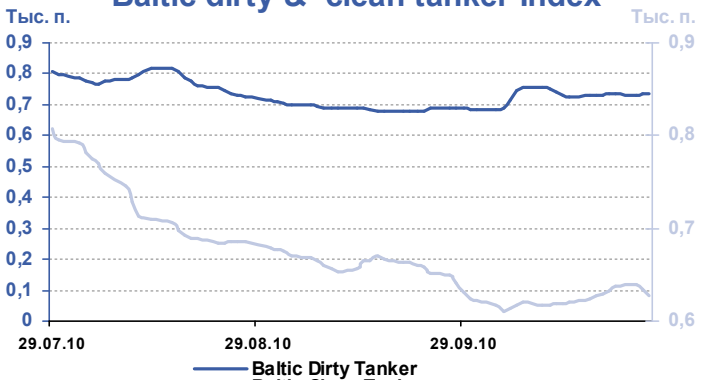
Ag / Au



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	8 300,00	-2,47%	-0,48%	4,39%	26,14%
Цинк, $/t	2 510,00	-4,02%	2,87%	13,06%	8,52%
Никель, $/t	22 805,00	-2,12%	-4,76%	-1,60%	22,28%
Олово, $/t	26 050,00	-2,43%	-2,62%	8,54%	69,21%
Алюминий, $/t	2 323,00	-2,80%	-1,65%	0,61%	17,03%
Свинец, $/t	2 544,00	-1,89%	3,84%	11,53%	12,05%
Серебро, $/oz	23,59	-1,20%	-1,50%	8,53%	41,22%
Золото, $/oz	1 325,35	-1,13%	-1,55%	1,25%	27,43%
Нефть Brent, $/	82,81	0,25%	-0,10%	5,72%	7,55%
Нефть Urals, $/	81,01	0,12%	-0,42%	4,34%	5,91%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,514	0,00%	-1,62%		12 181	259
БашИнСв	BISV	0,176	0,00%	-4,54%		2 779	168
БашЭнрг	BEGY	2,279	0,00%	0,55%		450 441	2 355
ВМЗ	VSMZ	1379,119	0,00%	-0,01%		1 379	2 369
ДВМП	FESH	0,438	0,00%	1,82%		151 843	1 294
КазанскВЗ	KHEL	2,010	0,00%	-1,12%		23 927	310
КОМСТАР	CMST	6,376	0,00%	0,01%		41 516	2 667
Мечел	MTLR	22,998	0,00%	-0,97%		802 224	9 663
Мотовил	MOTZ	0,088	0,00%	1,16%		14 923	87
Новсибэнрг	NVNG	36,822	0,00%	7,60%		328	492
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1325,000	0,00%	0,00%	6 625		2 276
СилМашины	SILM	0,270	0,00%	-1,31%		63 357	2 347
Сильвинит	SILV	695,723	0,00%	-0,42%		1 737 863	5 482
СинТЗ-ао	SNTZ	58,785	0,00%	0,00%		1 733	364
Славн-ЯНОС	JNOS	0,445	0,00%	0,00%		3 557	415
СТЗ-ао	SVTZ	5,424	0,00%	0,00%		168	269
ТАГМЕТ	TAMZ	0,716	0,00%	0,00%		4 142	363
У-УАЗ	UUAZ	1,616	0,00%	1,39%		211 184	429
ЧМК	CHMK	274,932	0,00%	-2,29%		672 780	877
ЧТПЗ	CHEP	1,887	0,00%	0,42%		103 988	873
ЮжКузб.	UKUZ	41,141	0,00%	-0,26%		34 604	1 484
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	41,700	0,00%	0,00%	49 640		7 096
Газпром	GAZP	5,640	0,00%	-0,85%	11 280	233 956 792	133 519
Газпромнефть	SIBN	3,810	0,00%	-1,01%	457 750	1 907 655	18 064
Лукойл	LKOH	57,600	0,00%	-0,57%	288 000	71 535 654	49 333
НОВАТЭК	NVTK	8,090	0,00%	0,00%	8 090		24 564
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	-1,88%	1 833 500	86 024 815	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,974	0,00%	-0,84%		19 309 284	35 000
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	-1,28%	614 500	7 348 243	3 928
Транснефть, п.	TRNFP	1164,000	0,00%	1,73%	1 164 000	53 182 198	1 810
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,288	0,00%	0,00%	5 720		2 386
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	-0,40%	5 656	50 620	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,864	-0,46%	-0,89%	25 980	33 912	800
МОЭСК	MSRS	0,051	0,00%	1,59%	3 139 722	2 797 995	2 474
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,055	0,00%	0,00%	81 750	715 363	2 588
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	207 814		5 611
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-0,46%	197 340	156 184	3 173
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	-0,73%	10 800	397 131	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,61%		83 322	656
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-1,26%	5 300	85 546	987
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,189	0,00%	0,00%	18 900		179
ВолгаТелеком	NNSI	3,750	0,00%	0,00%	37 500		922
МТС	MTSS	8,200	0,00%	0,00%	32 800		16 345
Ростелеком	RTKM	4,580	0,00%	-0,28%	45 800	1 574 094	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	-0,74%	30 000	8 561 834	728
СЗТ	SPTL	0,800	0,00%	0,39%	40 000	39 550	705
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	-0,60%		5 920	111
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	0,08%	584 850	1 443 614	1 259
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	-4,83%	120 000	1 611 585	1 666
ГАЗ	GAZA	27,000	0,00%	0,00%	4 374		500
ИРКУТ	IRKT	0,289	0,00%	0,28%		14 607	281
Казанский ВЗ	KHEL	2,013	0,00%	0,00%	105 693		310
КАМАЗ	KMAZ	2,361	0,00%	-2,20%		490 276	1 683

Кировский завод	KIRZ	10,000	0,00%	0,00%	10 000		109
Красный Котельщик	KRKO	0,500	0,00%	0,00%	7 500		107
Нефтекамский автозавод	nfaz	9,000	0,00%	0,00%	9 000		72
ОМЗ	OMZZ	2,250	0,00%	-1,16%	19 125	9 944	80
РКК Энергия	RKKE	289,115	0,00%	-0,38%		7 836	326
Северсталь-авто	SVAV	16,080	0,00%	1,85%	6 802	912 876	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	96,000	-0,52%	-0,80%	9 600	138 539	1 107
Мечел	MTLR	23,300	0,00%	0,00%	70 100		9 699
ММК	MAGN	0,943	0,00%	-3,19%	94 300	1 509 785	10 537
НЛМК	NLMK	3,325	0,00%	-3,33%		3 024 934	20 228
НорНикель	GMKN	185,000	0,00%	-1,13%	185 000	77 469 365	35 266
Полиметалл	PMTL	16,750	0,00%	-3,40%	16 750	3 415 679	6 690
Полюс Золото	PLZL	49,650	0,00%	-0,46%	129 338	9 128 697	9 465
Северсталь	CHMF	14,250	0,00%	-2,23%	14 250	33 629 429	14 360
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	-2,35%	67 855	148 925	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	31,714	0,00%	-0,49%		19 949	5 007
Возрождение	VZRZ	42,750	-0,58%	1,30%	42 750	263 412	1 016
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-2,05%	5 100	98 522 013	35 566
РОСБАНК	ROSB	3,600	0,00%	-0,09%	6 120	14 944	2 687
Сбербанк	SBER	3,260	-1,21%	0,00%	3 989 275		70 373
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,380	-1,65%	0,07%	119 000	3 767 403	2 643
Дальневосточное МП	FESH	0,445	0,00%	0,00%	22 250		1 313
НМТП	NMTP	0,121	0,00%	1,11%	6 000	250 650	2 314
Приморское МП	PRIM	0,159	0,00%	-0,89%		476	126
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	-0,36%	16 950	37 512	5 143
Вимм-Билль-Данн	WBDF	63,000	-0,40%	0,14%	63 000	63 819	2 772
Дикси	DIXY	12,000	0,00%	0,50%	24 000	101 722	1 032
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	0,19%	72 150	2 223	190
Красный Октябрь	KROT	10,051	0,00%	-1,05%		17 930	92
Магнит	MGNT	115,000	-2,54%	-0,93%	174 750	973 770	10 232
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	3,91%	45 617	182 281	23
Разгуляй	GRAZ	1,505	0,00%	-0,87%	7 525	306 607	238
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	8 000		600
Фармстандарт	PHST	82,500	0,00%	0,77%	41 250	542 629	3 118
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	0,54%	601 000	16 950	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,180	0,00%	0,00%	1 800		321
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,510	0,00%	-1,79%	25 500	27 700	822
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	3,790	0,53%	0,76%	10 005	7 334 164	1 869
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	-1,10%	171 100	263 298	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	29,750	0,00%	-0,22%	113 368	979 241	1 419
Дорогобуж	DGBZ	0,488	0,00%	-0,94%		7 502	354
Сильвинит	SILV	700,000	0,00%	0,00%	70 000		5 478
Уралкалий	URKA	4,723	0,00%	-1,88%		20 273 506	10 152
Уголь							
Белон	BLNG	0,903	0,00%	0,00%	27 093		1 039
Распадская	rasp	6,000	0,00%	-1,21%	60 000	2 916 166	4 685
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	172,170	0,05%	2,96
Башнефть	AK6		EUR	151,000	0,33%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,800	-6,74%	33,09
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,600	-2,80%	2 385,07
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,969	-3,20%	70,68
Бурятзолото	BYT		EUR	20,250	1,25%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,015	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,450	1,18%	9 402,82
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	29,950	-2,38%	21 454,40
X5	FIVE		USD	41,520	-1,03%	3 107,97
Газпром	GAZ		EUR	15,800	-1,40%	699,67
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,250	0,00%	16,35
ЮТК	KUE		EUR	6,200	6,90%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,100	-1,20%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,720	2,86%	1,43
Лукойл	LKOD		USD	56,200	-1,92%	130 262,50
Лукойл	LUK		EUR	41,020	-0,50%	165,22
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,000	-0,44%	4 017,38
МТС	MBT	5	USD	21,300	-4,23%	68 004,47
МТС	MKY	5	EUR	15,385	-2,44%	3,43
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,391	-3,39%	
Мечел	MTL	3	USD	23,140	-1,03%	51 956,39
НорНикель	NILSY	1	USD	18,740	-1,88%	883,95
НорНикель	NNIA		EUR	13,595	-1,49%	76,71
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	93,100	-1,48%	16 477,94
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,300	-0,93%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,713	-4,93%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,440	-13,57%	
Газпром	OGZD		USD	21,780	-1,89%	200 497,60
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	11,76%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,830	-0,81%	1 346,28
Ростелеком	RTL		EUR	19,290	4,27%	8,69
Газпромнефть	SCF		EUR	14,030	0,14%	21,38
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,948	-0,98%	4,51
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,625	1,26%	3,62
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,900	-2,00%	537,32
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,850	-0,30%	278,97
АФКСистема	SSA	1	USD	25,350	-0,59%	8 287,57
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	35,000	16,67%	
СТЗ	SVY		EUR	45,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	32,000	2,40%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	150,000	1,01%	45,00
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,475	-1,17%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,200	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,860	-1,65%	35 945,35
ВТБ	VTBR		USD	6,550	-3,25%	34 896,96
Возрождение	VZY		EUR	30,250	1,68%	5,05
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	24,920	-2,01%	11 253,51
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,920	-1,27%	0,90

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.