ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

1 ноября 2010г.

Комментарий по рынку акций

В пятницу фондовые индексы США опять закрылись вблизи нулевых отметок. Можно сказать, что накануне таких важных событий, как выборы в Конгресс и заседание ФРС инвесторы заняли выжидательную позицию. Вышедшая в конце недели статистика показала, что ВВП США в III-м квартале подрос на 2,0% г/г, несколько превысив темпы роста по сравнению во II кварталом (1,7%). Позитивно то, что основной вклад в подъеме показателей ВВП внесли компоненты потребительских расходов (рост на 2,6% - максимальный подъем с IV квартала 2006 года) и корпоративных запасов. Индекс деловой активности в производственном секторе Среднего Запада в октябре составил

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 587,14	0,23%	-1,34%	3,61%	15,25%
Индекс ММВБ	1 523,39	1,11%	0,27%	4,66%	17,91%
FTSE	5 675,16	-0,05%	-1,15%	1,47%	10,46%
S&P 500	1 183,26	-0,04%	0,02%	3,23%	10,99%
Dow Jones Avg.	11 118,49	0,04%	-0,13%	2,67%	11,60%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	18,0000	11,94%	13,92%	22,45%
Транснефть, п.	1210,0000	3,95%	7,56%	49,38%
Казанский ВЗ	2,0747	3,06%	10,36%	59,60%
Сбербанк	3,3140	2,44%	13,49%	24,12%
Дальневосточное МП	0,4500	1,12%	5,88%	24,14%
Ленэнерго	0,8640	0,47%	12,21%	4,22%

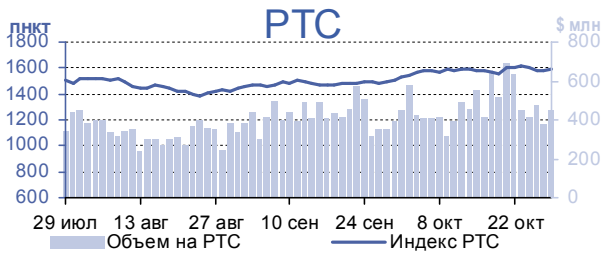
Лидеры снижения

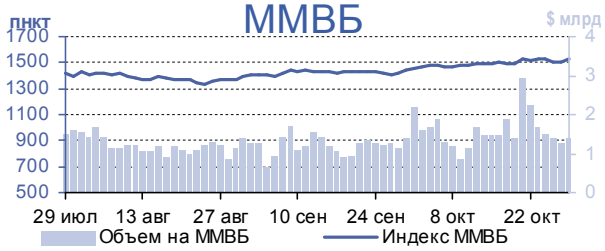
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-3	0,0520	-4,59%	-3,44%	6,12%
Распадская	5,8000	-3,33%	3,02%	23,67%
ПИК	3,6900	-2,64%	-5,38%	-8,71%
Акрон	29,0000	-2,52%	-3,97%	3,57%

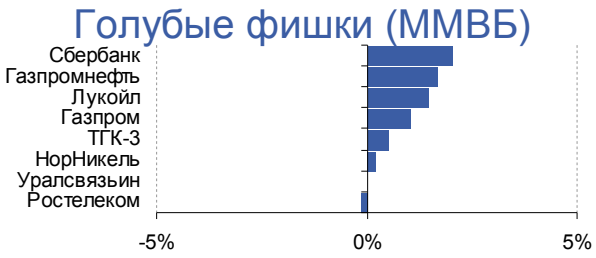
Индекс MSCI

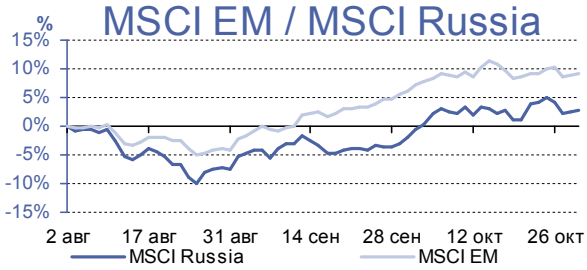
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1105,75	0,27%	1,81%	20,02%
Индекс MSCI BRAZIL	3710,81	1,39%	-0,31%	8,07%
Индекс MSCI RUSSIA	839,57	0,47%	3,35%	6,85%
Индекс MSCI INDIA	556,64	0,74%	-1,63%	33,12%
Индекс MSCI CHINA	68,43	-0,23%	3,82%	11,04%

Основные индикаторы









Обзор рынка

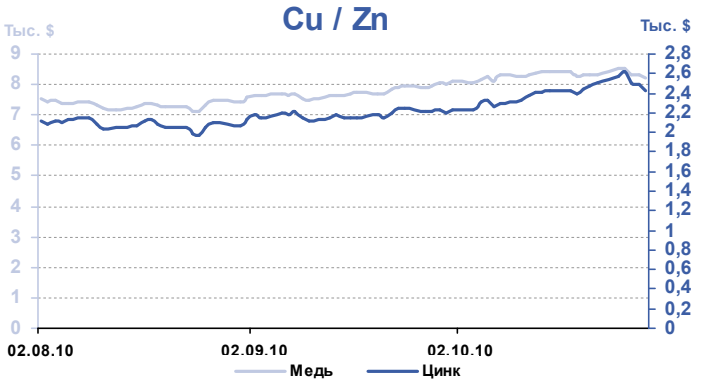
В пятницу фондовые индексы США опять закрылись вблизи нулевых отметок. Можно сказать, что накануне таких важных событий, как выборы в Конгресс и заседание ФРС инвесторы заняли выжидательную позицию. Вышедшая в конце недели статистика показала, что ВВП США в III-м квартале подрос на 2,0% г/г, несколько превысив темпы роста по сравнению во II кварталом (1,7%). Позитивно то, что основной вклад в подъеме показателей ВВП внесли компоненты потребительских расходов (рост на 2,6% - максимальный подъем с IV квартала 2006 года) и корпоративных запасов. Индекс деловой активности в производственном секторе Среднего Запада в октябре составил 60,6 пунктов, что превысило прогнозы аналитиков, ожидавших значение 58 пунктов.

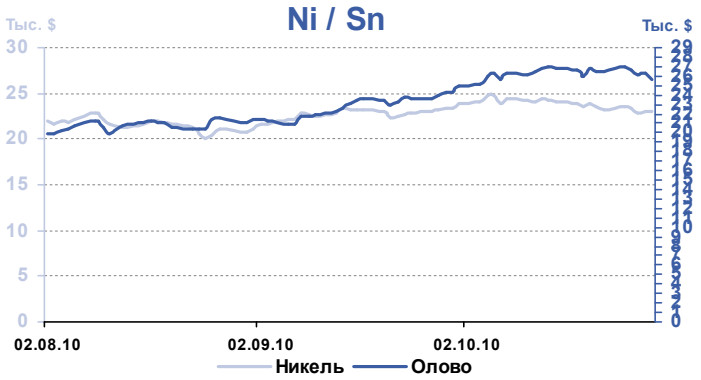
Курс единой европейской валюты против доллара в последние часы торгов в октябре и в начале ноября опять стремиться к покорению планки 1,4. Эксперты банка Morgan Stanley считают, что доллар будет оставаться под давлением из-за желания ФРС продолжить скупать активы для стимулирования экономического роста, поэтому к концу года американская валюта достигнет отметки $1,46 против евро. Ослабление позиций доллара снова начало разогревать цены на сырьевых рынках. С прошлого четверга цена золота поднялась уже на $35, достигнув у утру понедельника уровня $1363/унц. Аналогичные тенденции сегодня видны и на рынке промышленных металлов: медь +1,6%; никель +1,5%. А вот цены на нефть Brent вот уже неделю сохраняют стабильность, торгуясь возле отметки $83,3/барр. Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят в основном в позитивной зоне после выхода статистики по Китаю. Индекс деловой активности (PMI CFLP) в октябре показал рост до 54,7 п. против 53,8 п. в сентябре. Индекс PMI от банка поднялся до 54,8 п. против 52,9 п. в сентябре. Индекс PMI по Индии рассчитываемый HSBC за октябрь также показал рост до 57,2 после показателя 55,1 в сентябре. Это усилило спрос на рискованные активы и сырье на азиатских биржах.

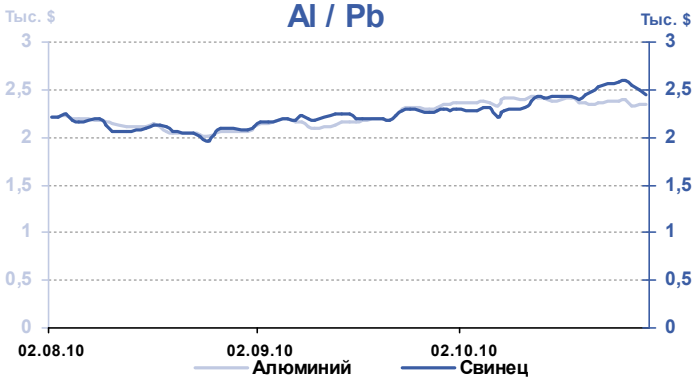
Открытие торгов на российских биржах мы ожидаем увидеть с гэпом вверх в пределах 0,8%. Игроки отчасти уже начали закладывать позитив в котировки еще в пятницы. Думаю, сегодня индекс ММВБ имеет право рассчитывать на подъем к уровню 1538-40 пунктов. Лидерами роста будут акции банков (Сбербанк и ВТБ), металлургических компаний (НЛМК, ГМК), а также сектор химических компаний. Из-за короткой торговой недели игроки могут попробовать в ближайшие пару дней сформировать задел по длинным позициям перед праздниками. Сигналов к развороту вниз не видно, а значит дорога к еще одному заходу вверх открыта.

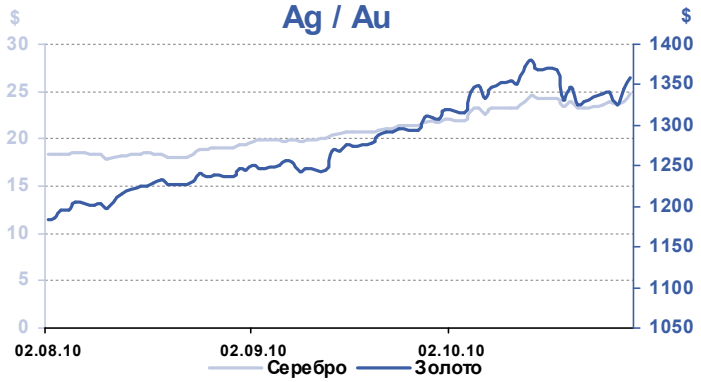
В выходные Россия и Европа перешли на зимнее время. Америка сдвинет свои стрелки на час назад лишь 7 ноября. Сегодня в 15-Министерство торговли США опубликует данные по личным расходам и доходам американских потребителей за сентябрь. В 17-00 Институт управления поставками выдаст данные по индексу деловой активности в производственном секторе США (индекс ISM Manufacturing) за октябрь. В это же время будут опубликованы данные по объёму расходов на строительство в США за сентябрь.

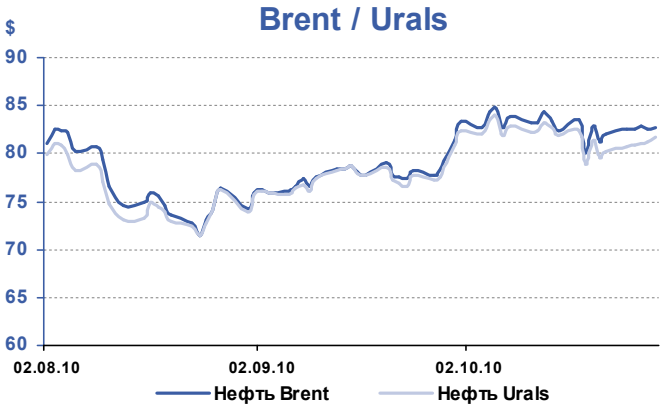
Commodities

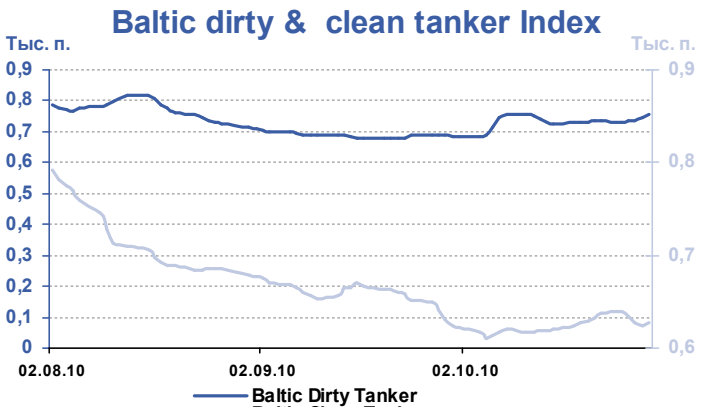












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 200,00	-1,68%	-1,61%	1,23%	23,04%
Цинк, $/t	2 423,00	-2,85%	-3,54%	8,70%	6,74%
Никель, $/t	22 990,00	-0,48%	-1,01%	-3,59%	23,01%
Олово, $/t	25 600,00	-2,48%	-3,03%	2,81%	70,10%
Алюминий, $/t	2 344,00	-0,13%	-0,89%	-0,64%	20,08%
Свинец, $/t	2 449,00	-2,26%	-3,20%	6,71%	3,55%
Серебро, $/oz	24,75	3,17%	6,26%	11,93%	48,31%
Золото, $/oz	1 359,40	1,14%	2,33%	3,06%	29,84%
Нефть Brent, $/	82,63	0,10%	0,73%	-0,92%	6,73%
Нефть Urals, $/	81,63	0,60%	1,67%	-0,96%	5,89%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,506	0,00%	-2,51%		95 046	254
БашИнСв	BISV	0,178	0,00%	-0,31%		3 711	164
БашЭнрг	BEGY	2,403	0,00%	-1,33%		193 313	2 461
ВМЗ	VSMZ	1354,023	0,00%	0,00%		5 384	2 311
ДВМП	FESH	0,445	0,00%	0,37%		69 358	1 310
КазанскВЗ	KHEL	2,117	0,00%	3,16%		165 862	319
КОМСТАР	CMST	6,428	0,00%	0,25%		186 081	2 683
Мечел	MTLR	23,220	0,00%	2,17%		1 058 825	9 621
Мотовил	MOTZ	0,090	0,00%	1,20%		393	89
Новсибэнрг	NVNG	36,495	0,00%	-0,70%		146	493
СилМашины	SILM	0,267	0,00%	-0,59%		18 265	2 326
Сильвинит	SILV	699,694	0,00%	1,04%		2 147 776	5 507
СинТЗ-ао	SNTZ	58,440	0,00%	0,56%		2 672	366
Славн-ЯНОС	JNOS	0,455	0,00%	0,00%		2 273	424
СТЗ-ао	SVTZ	5,677	0,00%	0,00%		177	275
ТАГМЕТ	TAMZ	0,710	0,00%	0,00%		284	361
У-УАЗ	UUAZ	1,711	0,00%	3,35%		94 924	444
ЧМК	CHMK	280,839	0,00%	1,76%		300 853	884
ЧТПЗ	CHEP	1,909	0,00%	-0,29%		18 090	912
ЮжКузб.	UKUZ	41,231	0,00%	0,77%		7 087	1 479
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	42,500	0,00%	0,00%	21 250		7 232
Газпром	GAZP	5,640	0,00%	1,03%	11 280	279 279 256	133 519
Газпромнефть	SIBN	3,925	0,00%	1,68%		5 947 968	18 429
Лукойл	LKOH	57,600	0,00%	1,47%	288 000	58 866 722	49 333
НОВАТЭК	NVTK	8,090	0,00%	0,00%	8 090		24 564
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,93%	1 833 500	56 013 323	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,983	0,00%	1,68%		13 899 640	34 879
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	1,51%	614 500	3 548 765	3 928
Транснефть, п.	TRNFP	1210,000	3,95%	-0,09%	12 100	10 551 689	1 860
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,420	0,00%	0,00%	24 200		2 523
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	1,10%	5 656	601 463	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,864	0,47%	2,52%	17 280	392 416	801
МОЭСК	MSRS	0,051	0,00%	2,63%	3 139 722	3 290 714	2 474
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,052	-4,59%	-0,12%	85 800	680 820	2 469
ОГК-4	OGKD	0,089	0,00%	0,00%	207 814		5 611
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-0,39%	197 340	195 186	3 173
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	0,52%	10 800	970 475	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,60%		107 085	663
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	1,26%	5 300	111 202	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%	-0,12%	45 800	1 488 339	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	-0,06%	30 000	6 155 223	728
СЗТ	SPTL	0,800	0,00%	0,41%	40 000	442 944	705
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	-0,61%		4 240	110
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	0,00%	584 850	2 694 096	1 259
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	0,86%	120 000	2 413 925	1 666
ГАЗ	GAZA	27,000	0,00%	0,00%	4 374		500
ИРКУТ	IRKT	0,289	0,00%	-0,06%		9 821	281
Казанский ВЗ	KHEL	2,075	3,06%	0,00%	103 737		320
КАМАЗ	KMAZ	2,342	0,00%	-0,03%		243 337	1 647
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%	0,41%	19 125	5 327	80
РКК Энергия	RKKE	357,136	0,00%	26,44%		120 234	371
Северсталь-авто	SVAV	18,000	11,94%	0,79%	60 575	404 278	617
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	95,500	0,00%	0,62%	95 500	318 421	1 101
Мечел	MTLR	23,200	0,00%	0,00%	23 200		9 657
ММК	MAGN	0,943	0,00%	0,70%	94 300	1 131 558	10 537
НЛМК	NLMK	3,474	0,00%	3,51%		1 790 531	20 491
НорНикель	GMKN	185,000	0,00%	0,19%	185 000	73 388 544	35 266
Полиметалл	PMTL	16,750	0,00%	-1,51%	16 750	2 036 898	6 690
Полюс Золото	PLZL	49,650	0,00%	0,59%	129 338	2 663 790	9 465
Северсталь	CHMF	14,250	0,00%	0,10%	14 250	20 486 225	14 360
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	4,89%	67 855	2 478 337	4 257
ЧТПЗ	CHEP	1,950	0,00%	0,00%	64 301		921
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,680	0,00%	0,09%		28 592	4 992
Возрождение	VZRZ	42,750	0,00%	0,11%	42 750	236 353	1 016
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	1,20%	5 100	74 655 487	35 566
РОСБАНК	ROSB	3,665	0,00%	0,78%		4 404	2 719
Сбербанк	SBER	3,314	2,44%	0,00%	983 900		71 453
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	15 336		1 293
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,380	0,00%	4,86%	119 000	2 938 735	2 643
Дальневосточное МП	FESH	0,450	1,12%	0,00%	22 500		1 328
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	0,59%	6 000	929 621	2 311
Приморское МП	PRIM	0,158	0,00%	0,31%		693	126
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	0,10%	16 950	76 718	5 143
Верофарм	VRPH	42,000		0,00%	42 000		420
Вимм-Билль-Данн	WBDF	62,000	-1,59%	0,16%	62 000	262 189	2 728
Дикси	DIXY	13,100	0,00%	0,92%	38 950	23 821	1 127
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	0,30%	72 150	99 803	190
Красный Октябрь	KROT	9,902	0,00%	-0,33%		1 923	91
Магнит	MGNT	115,000	0,00%	2,15%	174 750	491 888	10 232
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	1,39%	45 617	119 528	23
Разгуляй	GRAZ	1,510	0,00%	-1,50%	7 550	264 949	239
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	8 000		600
Фармстандарт	PHST	88,100	0,00%	-1,24%	8 810	108 465	3 330
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	-1,96%	601 000	558 877	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,180	0,00%	0,00%	1 800		321
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,510	0,00%	1,21%	25 500	49 982	822
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	3,690	-2,64%	1,22%	18 450	3 964 734	1 820
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	-0,29%	171 100	502 974	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	29,000	-2,52%	-0,52%	29 000	1 055 071	1 383
Дорогобуж	DGBZ	0,500	0,00%	0,27%		5 418	358
Сильвинит	SILV	700,000	0,00%	0,00%	70 000		5 478
Уралкалий	URKA	4,967	0,00%	1,43%		14 648 245	10 443
Уголь							
Белон	BLNG	0,870	0,00%	0,00%	8 700		1 001
Распадская	rasp	5,800	-3,33%	-0,01%	115 700	3 421 078	4 529

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	176,800	1,74%	
Башнефть	AK6		EUR	151,000	-0,66%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,760	-2,22%	5,10
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,550	-1,25%	4 466,46
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,034	0,20%	24,20
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	-2,44%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,015	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,480	0,86%	10 483,37
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,320	1,40%	10 406,89
X5	FIVE		USD	41,900	0,24%	8 320,25
Газпром	GAZ		EUR	15,715	-0,03%	529,87
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	0,00%	
ЮТК	KUE		EUR	6,200	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,050	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	0,88
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,720	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	55,800	0,00%	75 535,92
Лукойл	LUK		EUR	40,110	-0,05%	354,55
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,850	-0,30%	2 792,12
МТС	MBT	5	USD	21,650	0,60%	46 489,90
МТС	MKY	5	EUR	15,355	0,49%	
МГТС	MOW		EUR	9,350	-1,58%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,551	0,01%	1,89
Мечел	MTL	3	USD	23,550	3,15%	57 927,02
НорНикель	NILSY	1	USD	18,650	-1,48%	984,35
НорНикель	NNIA		EUR	13,500	-0,55%	109,53
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	95,650	1,54%	15 540,51
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,300	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,750	10,62%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,500	0,00%	2,65
Газпром	OGZD		USD	21,920	0,32%	221 675,30
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,780	-0,30%	2 135,82
Ростелеком	RTL		EUR	19,000	-0,78%	7,33
Газпромнефть	SCF		EUR	13,910	-0,29%	129,26
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,923	1,41%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,550	0,00%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,000	0,00%	282,50
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,690	0,52%	1 411,18
АФКСистема	SSA	1	USD	25,800	-0,73%	15 435,33
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	36,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	45,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	17,65%	8,00
Ukrnafta	UKAA		EUR	151,950	2,32%	0,62
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,515	0,00%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,200	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,330	2,82%	47 121,13
ВТБ	VTBR		USD	6,620	0,53%	16 766,52
Возрождение	VZY		EUR	30,750	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	25,360	2,09%	2 575,31
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	18,045	2,38%	

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.