ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

2 ноября 2010г.

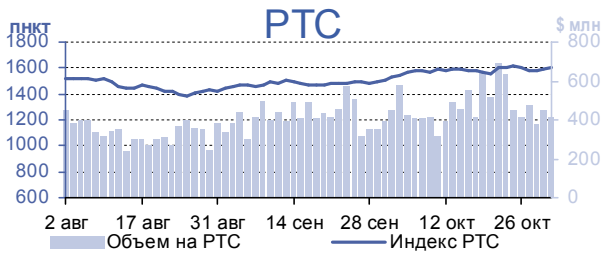
Комментарий по рынку акций

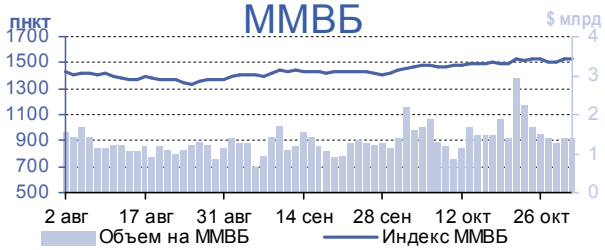
Во вторник американские инвесторы опять не смогли сдвинуть свои биржевые индексы с текущих позиций. Участники рынка предпочли воздержаться от агрессивных движений накануне двух важнейших событий этой осени: решением FOMC и выборами. Давление продаж в секторе банков уравновешивалось покупками в акциях высокотехнологических и сырьевых компаний. В итоге

На лентах информагентств все чаще появляются сообщения, касательно объемов количественного смягчения, которого стоит ждать от предстоящего заседания ФРС. Сегодня – это $500 млрд. Кстати, эксперты банка JPMorgan склоняются, что именно на эту

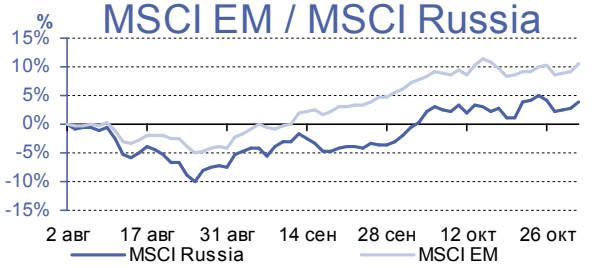
Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы









Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 600,36	0,83%	-1,24%	4,47%	18,64%
Индекс ММВБ	1 533,70	0,68%	0,36%	5,36%	21,12%
FTSE	5 694,62	0,34%	-1,00%	1,82%	11,56%
S&P 500	1 184,38	0,09%	-0,10%	3,33%	13,57%
Dow Jones Avg.	11 124,62	0,06%	-0,35%	2,72%	13,64%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Бурятзолото	30,0000	5,26%	7,14%	42,86%
Аэрофлот	2,4800	4,20%	15,89%	45,03%
ВТБ	0,0035	3,53%	28,94%	52,38%
МСЗ, Электросталь	279,0000	3,33%	-0,36%	28,57%
ПИК	3,7900	2,71%	-2,82%	-6,23%
Фармстандарт	90,0000	2,16%	19,60%	47,54%
Башнефть, п.	32,5000	0,78%	-7,12%	148,09%
Башнефть	42,7000	0,47%	-2,62%	64,23%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-13	0,0037	-5,12%	-7,25%	72,56%
ОГК-4	0,0845	-5,06%	-6,11%	58,54%
Газпром	5,5450	-1,68%	7,05%	-9,14%
Разгуляй	1,4850	-1,66%	2,41%	-0,34%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1120,85	1,37%	3,20%	23,01%
Индекс MSCI BRAZIL	3745,75	0,94%	0,63%	14,33%
Индекс MSCI RUSSIA	847,26	0,92%	4,30%	9,96%
Индекс MSCI INDIA	565,17	1,53%	-0,12%	35,26%
Индекс MSCI CHINA	69,95	2,22%	6,12%	11,17%

Обзор рынка

Во вторник американские инвесторы опять не смогли сдвинуть свои биржевые индексы с текущих позиций. Участники рынка предпочли воздержаться от агрессивных движений накануне двух важнейших событий этой осени: решением FOMC и выборами. Давление продаж в секторе банков уравновешивалось покупками в акциях высокотехнологических и сырьевых компаний. В итоге

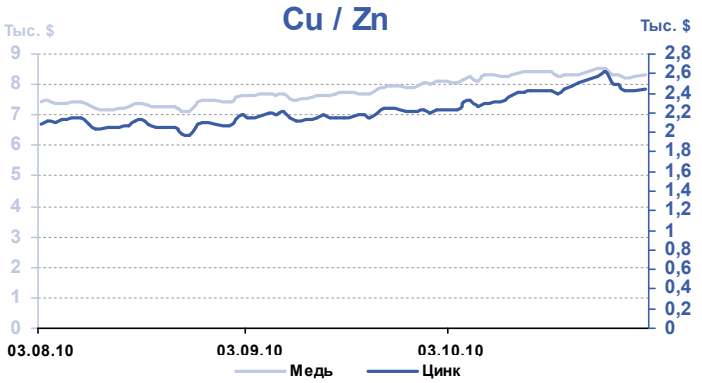
На лентах информагентств все чаще появляются сообщения, касательно объемов количественного смягчения, которого стоит ждать от предстоящего заседания ФРС. Сегодня – это $500 млрд. Кстати, эксперты банка JPMorgan склоняются, что именно на эту сумму ФедРезерв может купить долгосрочных казначейских облигаций в следующие 6 месяцев. При этом в итоговом заявлении FOMC будет выражена готовность и далее увеличивать объем покупок, если того потребуют экономические условия. Если ФРС решит сосредоточить свои покупки на государственных облигациях со сроком погашения до 10 лет кривая доходности на рынке US Treasuries станет круче, что даст банкам возможность привести в порядок свои балансы, что в конечном итоге должно способствовать к расширению банковского кредитования экономики.

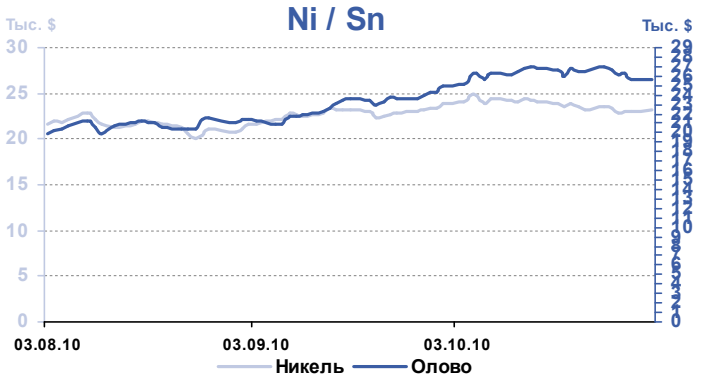
Резервный Банк Австралии сегодня неожиданно повысил ставку на 25 б.п. до 4,75%. На этом фоне сегодня курс австралийского доллара резко укрепился против доллара (0,9980). Центральный Банк Индии сегодня также решил повысить ставку репо на 25 б.п. до 6,25%, а обратного репо до 5,25%. Цены на нефть Brent вчера вечером резко пошли вверх, после того, как Министр нефти Саудовской Аравии указал на то, что он доволен ценовым диапазоном $70-90/барр., что дало повод нефтетрейдерам переставить котировки «черного золота» на $2 вверх. Сегодня азиатские биржевые индексы торгуются в разнополярных областях, что в целом дает «среднюю температуру по больнице» вблизи нуля: MSCI Asia +0,05%.

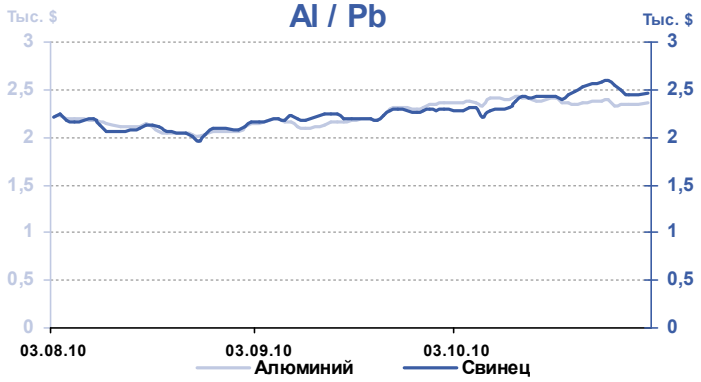
Во вторник мы увидим нейтральное открытие торгов на российских фондовых площадках. Вчера индекс ММВБ сумел выйти на новый годовой максимум (1542 п.), сегодня явных факторов для обновления рекорда уже не видно. Даже вчерашний рывок котировок нефти не смог побудить игроков к активным покупкам наших бумаг нефтегазового сектора. В тоже время, вчера было отмечено открытие крупными игроками очень больших объемов позиций по декабрьским фьючерсам на индекс РТС на уровне 161000, что говорит не в пользу роста. Однако пока еще рано однозначно говорить о развитии сценария снижения, поскольку свою лепту в расстановку сил может внести слабеющий курс американского доллара (пара EUR/USD опять готовится к росту выше 1,40).

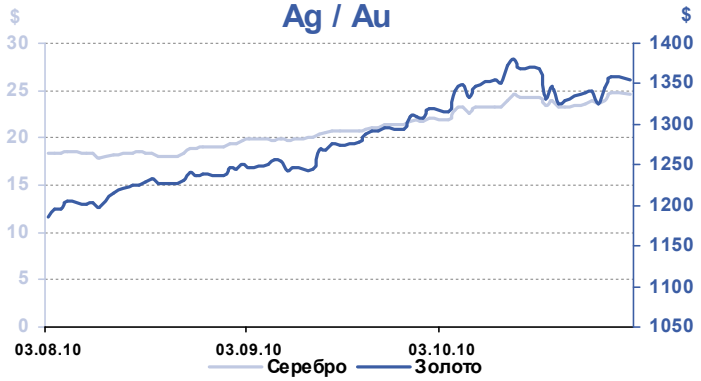
Во вторник в 12-55 будет опубликован индекс деловой активности в производственном секторе в Германии. Аналогичный индекс по еврозоне выходит в 13-00. На сегодня публикаций американской макростатистики не запланировано. Инвесторы будут следить за тем, как проходят выборы в США, в ходе которых американцам предстоит избрать полный состав палаты представителей (435 конгрессменов) и около трети членов Сената (37 сенаторов из 100).

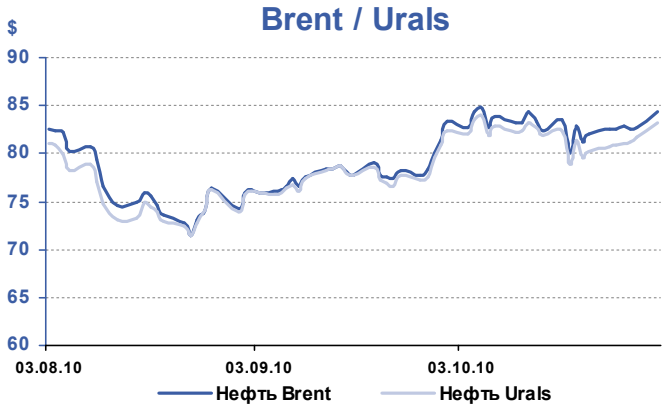
Commodities

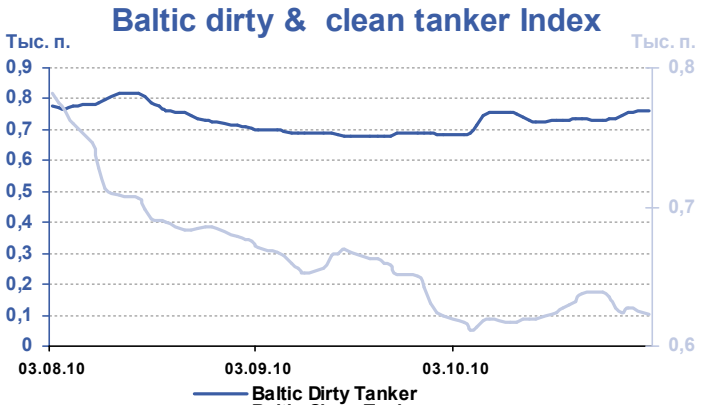












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 300,00	1,22%	-2,56%	2,47%	26,62%
Цинк, $/t	2 449,00	1,07%	-4,52%	9,87%	11,57%
Никель, $/t	23 245,00	1,11%	-1,40%	-2,52%	28,71%
Олово, $/t	25 600,00	0,00%	-4,83%	2,81%	73,27%
Алюминий, $/t	2 371,00	1,15%	-0,08%	0,51%	23,75%
Свинец, $/t	2 465,00	0,65%	-4,64%	7,41%	7,27%
Серебро, $/oz	24,68	-0,27%	4,34%	11,63%	49,97%
Золото, $/oz	1 353,85	-0,41%	1,04%	2,63%	27,78%
Нефть Brent, $/	84,37	2,11%	2,18%	1,16%	11,47%
Нефть Urals, $/	83,23	1,96%	3,17%	0,98%	11,24%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,503	0,00%	-0,63%		63 699	251
БашИнСв	BISV	0,176	0,00%	-0,86%		71	168
БашЭнрг	BEGY	2,327	0,00%	-3,11%		221 685	2 434
ВМЗ	VSMZ	1376,342	0,00%	2,17%		8 245	2 360
ДВМП	FESH	0,445	0,00%	0,00%		4 490	1 312
КазанскВЗ	KHEL	2,138	0,00%	1,00%		363 366	326
КОМСТАР	CMST	6,427	0,00%	0,00%		85 239	2 688
Мечел	MTLR	23,459	0,00%	1,05%		5 523 768	9 766
Мотовил	MOTZ	0,089	0,00%	-0,90%		12 830	87
Новсибэнрг	NVNG	36,068	0,00%	-1,15%		661	470
СилМашины	SILM	0,275	0,00%	3,13%		429 380	2 398
Сильвинит	SILV	702,778	0,00%	0,46%		1 280 556	5 497
СинТЗ-ао	SNTZ	58,440	0,00%	0,00%		2 672	366
Славн-ЯНОС	JNOS	0,438	0,00%	-3,57%		2 465	418
СТЗ-ао	SVTZ	5,677	0,00%	0,00%		177	275
ТАГМЕТ	TAMZ	0,710	0,00%	0,00%		284	361
У-УАЗ	UUAZ	1,769	0,00%	3,42%		164 072	468
ЧМК	CHMK	279,164	0,00%	-0,58%		201 102	888
ЧТПЗ	CHEP	1,902	0,00%	-0,36%		49 821	905
ЮжКузб.	UKUZ	40,809	0,00%	-1,01%		16 653	1 477
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	42,700	0,47%	0,00%	21 350		7 266
Газпром	GAZP	5,545	-1,68%	0,59%	249 525	255 040 080	131 270
Газпромнефть	SIBN	3,915	0,00%	-0,25%		4 151 031	18 652
Лукойл	LKOH	57,600	0,00%	0,92%	288 000	73 107 388	49 333
НОВАТЭК	NVTK	8,090	0,00%	0,00%	8 090		24 564
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,92%	1 833 500	69 026 052	74 717
Сургутнефтегаз	SNGS	0,993	0,00%	1,09%		17 723 215	35 564
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,510	0,00%	0,45%	614 500	9 315 491	3 928
Транснефть, п.	TRNFP	1201,000	-0,74%	-0,10%	1 203 600	15 381 351	1 867
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,400	-0,83%	0,00%	38 120		2 502
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	2,51%	5 656	249 338	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,864	0,00%	0,29%	17 280	101 653	801
МОЭСК	MSRS	0,051	0,00%	-1,53%	3 139 722	443 952	2 474
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,052	0,00%	1,23%	85 800	2 079 011	2 469
ОГК-4	OGKD	0,085	-5,06%	0,00%	42 250		5 328
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	1,84%	197 340	1 035 977	3 173
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	0,00%	10 800	1 349 787	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	1,20%		63 554	671
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	3,11%	5 300	241 642	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%	1,53%	45 800	5 496 418	3 337
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	1,94%	30 000	35 004 468	728
СЗТ	SPTL	0,800	0,00%	0,49%	40 000	509 395	705
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,61%		20 182	112
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	0,68%	584 850	1 853 784	1 259
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	0,72%	120 000	730 294	1 666
ГАЗ	GAZA	27,000	0,00%	0,00%	4 374		500
ИРКУТ	IRKT	0,289	0,00%	0,17%		89 717	283
Казанский ВЗ	KHEL	2,075	0,00%	0,00%	103 737		320
КАМАЗ	KMAZ	2,360	0,00%	0,78%		215 262	1 661
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%	0,54%	19 125	4 920	80
РКК Энергия	RKKE	310,002	0,00%	-13,18%		34 589	353
Северсталь-авто	SVAV	18,000	0,00%	1,50%	60 575	498 521	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	30,000	5,26%	0,00%	30 000		211
ВСМПО	VSMO	95,500	0,00%	0,34%	95 500	324 202	1 101
Мечел	MTLR	23,200	0,00%	0,00%	23 200		9 657
ММК	MAGN	0,943	0,00%	4,41%	94 300	4 017 396	10 537
НЛМК	NLMK	3,545	0,00%	2,06%		2 465 994	21 120
НорНикель	GMKN	182,799	-1,19%	0,51%	548 397	82 778 397	34 847
Полиметалл	PMTL	16,750	0,00%	-1,10%	16 750	2 230 100	6 690
Полюс Золото	PLZL	49,650	0,00%	0,79%	129 338	6 403 560	9 465
Северсталь	CHMF	14,250	0,00%	1,84%	14 250	28 163 577	14 360
СТЗ	SVTZ	5,750	0,00%	0,00%	5 750		277
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	-1,76%	67 855	506 049	4 257
ЧТПЗ	CHEP	1,950	0,00%	0,00%	64 301		921
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,747	0,00%	0,23%		24 746	4 999
Возрождение	VZRZ	42,600	-0,35%	-0,49%	85 200	196 583	1 012
ВТБ	VTBR	0,004	3,53%	2,37%	3 520	111 576 891	36 821
РОСБАНК	ROSB	3,647	0,00%	-0,48%		7 094	2 734
Сбербанк	SBER	3,320	0,18%	0,00%	1 996 100		71 669
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	15 336		1 293
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,480	4,20%	0,00%	272 400	1 987 741	2 754
Дальневосточное МП	FESH	0,450	0,00%	0,00%	22 500		1 328
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	0,85%	6 000	470 371	2 311
Приморское МП	PRIM	0,159	0,00%	0,29%		2 762	126
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,900	0,00%	0,79%	16 950	39 102	5 143
Верофарм	VRPH	42,000	0,00%	0,00%	42 000		420
Вимм-Билль-Данн	WBDF	62,000	0,00%	0,99%	62 000	119 773	2 728
Дикси	DIXY	13,000	-0,76%	-0,47%	13 000	285 856	1 118
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	3,71%	72 150	459 042	190
Красный Октябрь	KROT	9,982	0,00%	0,82%		1 743	92
Магнит	MGNT	115,000	0,00%	-0,44%	174 750	839 144	10 232
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	-1,24%	45 617	46 214	23
Разгуляй	GRAZ	1,485	-1,66%	0,00%	8 892	111 553	235
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	8 000		600
Фармстандарт	PHST	90,000	2,16%	1,80%	270 000	433 435	3 401
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	1,17%	601 000	118 396	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,178	-1,39%	0,00%	3 905		317
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,510	0,00%	0,30%	25 500	96 670	822
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	9 975		490
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	279,000	3,33%	0,00%	27 900		389
ПИК	pikk	3,790	2,71%	1,02%	10 004	4 283 064	1 869
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	0,43%	171 100	405 239	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	29,000	0,00%	0,58%	29 000	597 223	1 383
Дорогобуж	DGBZ	0,495	0,00%	-0,65%	39 600	15 309	357
Сильвинит	SILV	700,000	0,00%	0,00%	70 000		5 478
Уралкалий	URKA	4,986	0,00%	0,39%		9 524 296	10 583
Уголь							
Белон	BLNG	0,870	0,00%	0,00%	8 700		1 001
Распадская	rasp	5,820	0,34%	-1,19%	16 086	1 935 522	4 544

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	177,000	1,85%	108,73
Башнефть	AK6		EUR	152,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,670	-7,22%	27,48
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,990	0,13%	4 049,06
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,933	-2,31%	27,43
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	-2,44%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,015	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,460	0,54%	1 147,14
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,300	1,34%	13 056,10
X5	FIVE		USD	42,500	1,67%	15 318,32
Газпром	GAZ		EUR	15,810	0,57%	347,25
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	0,00%	45,15
ЮТК	KUE		EUR	6,200	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,920	-3,21%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,720	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,800	1,79%	154 989,80
Лукойл	LUK		EUR	41,020	2,22%	244,14
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,600	1,04%	3 241,48
МТС	MBT	5	USD	22,320	3,72%	55 070,70
МТС	MKY	5	EUR	15,835	3,63%	0,47
МГТС	MOW		EUR	9,350	-1,58%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,550	0,00%	1,59
Мечел	MTL	3	USD	23,680	3,72%	32 377,98
НорНикель	NILSY	1	USD	18,690	-1,27%	3 641,00
НорНикель	NNIA		EUR	13,475	-0,74%	95,91
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	98,100	4,14%	30 223,49
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,200	-1,89%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,713	5,16%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,910	11,71%	
Газпром	OGZD		USD	22,040	0,87%	248 968,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	15,00%	1,15
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,000	0,52%	439,26
Ростелеком	RTL		EUR	19,235	0,44%	13,17
Газпромнефть	SCF		EUR	13,930	-0,14%	57,12
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,026	2,91%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,529	-0,59%	1,77
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,050	1,00%	412,16
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,880	2,49%	1 059,09
АФКСистема	SSA	1	USD	26,110	0,46%	7 592,89
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	39,000	8,33%	
СТЗ	SVY		EUR	49,000	8,89%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	17,65%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	156,500	5,39%	7,79
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,500	-0,27%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,200	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,420	3,42%	76 076,26
ВТБ	VTBR		USD	6,760	2,66%	26 435,78
Возрождение	VZY		EUR	30,750	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	25,540	2,82%	3 268,77
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	18,180	3,15%	

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.