ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

8 ноября 2010г.

Комментарий по рынку акций

3 ноября ФРС приняла решение оставить уровень учетной ставки неизменной (0,25%) при этом было решено дополнительно выкупить долгосрочные казначейские обязательства на сумму $600 млрд до конца второго квартала 2011 года. В свою очередь ФРБ Нью-Йорка в конце прошлой недели объявил о намеченном на этот период реинвестировании средств, полученных от погашения агентских облигаций, на сумму от 250 млрд до 300 млрд долл. Имея такую поддержу от монетарных властей, в четверг мы видели сильнейший рост котировок на американских фондовых биржах. В пятницу американские индексы также закрылись в позитивной зоне. Ключевая статистика недели

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 602,53	-0,12%	1,22%	2,28%	22,79%
Индекс ММВБ	1 540,11	0,18%	2,19%	5,15%	26,40%
FTSE	5 748,97	-0,15%	1,82%	1,61%	14,13%
S&P 500	1 197,96	0,37%	1,31%	2,82%	14,59%
Dow Jones Avg.	11 215,13	0,24%	0,80%	1,90%	14,77%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Силовые машины	0,2710	11,51%	17,83%	36,87%
Казанский ВЗ	2,2500	8,45%	19,68%	73,08%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,2980	6,41%	9,80%	98,63%
Акрон	30,1000	3,79%	0,33%	7,50%
Башнефть	43,2000	0,47%	-2,92%	66,15%
Магнит	114,5000	0,44%	-2,14%	59,58%
Ленэнерго, п.	1,0540	0,38%	-1,50%	42,24%
Сбербанк	3,3500	0,15%	11,67%	19,26%

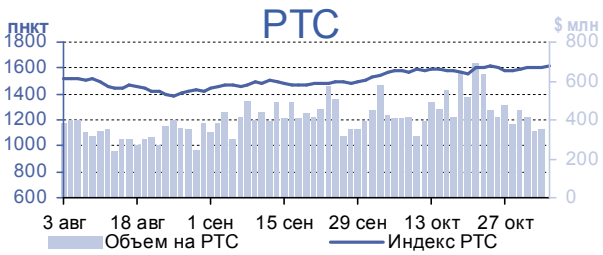
Лидеры снижения

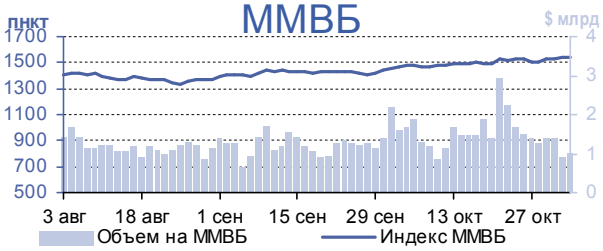
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	5,6200	-3,44%	-1,23%	19,83%
ОГК-4	0,0830	-1,78%	-6,74%	55,72%
ОАО Компания М.видео	7,6000	-1,30%	14,29%	91,44%

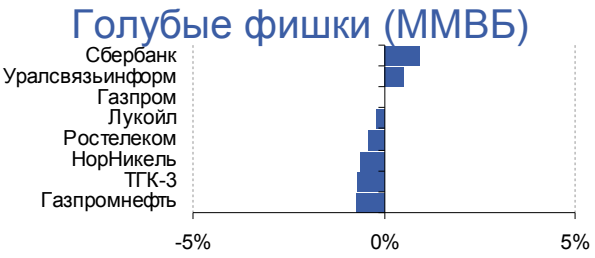
Индекс MSCI

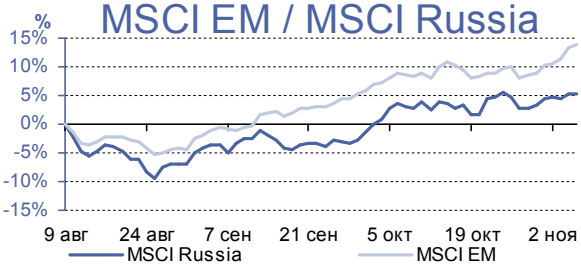
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1132,44	0,73%	2,83%	25,34%
Индекс MSCI BRAZIL	3773,06	0,68%	0,32%	11,87%
Индекс MSCI RUSSIA	849,35	-0,10%	1,79%	14,53%
Индекс MSCI INDIA	569,61	0,62%	0,90%	42,61%
Индекс MSCI CHINA	71,36	1,75%	5,78%	15,32%

Основные индикаторы









Обзор рынка

3 ноября ФРС приняла решение оставить уровень учетной ставки неизменной (0,25%) при этом было решено дополнительно выкупить долгосрочные казначейские обязательства на сумму $600 млрд до конца второго квартала 2011 года. В свою очередь ФРБ Нью-Йорка в конце прошлой недели объявил о намеченном на этот период реинвестировании средств, полученных от погашения агентских облигаций, на сумму от 250 млрд до 300 млрд долл. Имея такую поддержу от монетарных властей, в четверг мы видели сильнейший рост котировок на американских фондовых биржах. В пятницу американские индексы также закрылись в позитивной зоне. Ключевая статистика недели показала, что число рабочих мест вне сельскохозяйственного сектора США (NFP) в прошлом месяце выросло на +151 тыс. (при прогнозе +60 тыс.), при этом на 159 тыс. выросло число сотрудников в частном секторе, а вот государственный сектор потерял 8 тыс. рабочих мест. Уровень безработицы в октябре сохранился на уровне 9,6%.

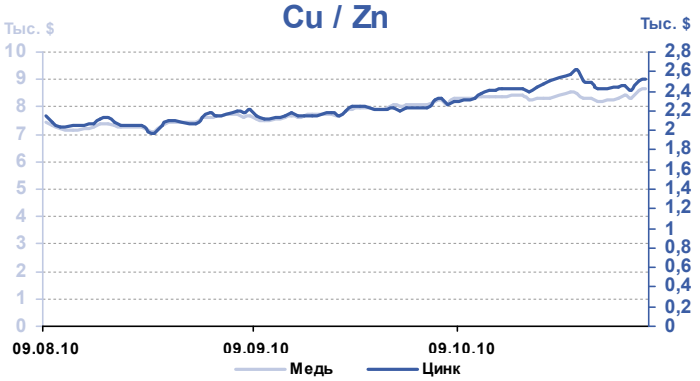
Сильные данные по занятости в США ослабили давление на курс доллара. Пара EUR/USD, которая еще в четверг торговавшаяся на уровне 1,4260, к утру понедельника опустилась на уровень начала прошлой недели – 1,3965. Давление на позиции евро продолжает оказывать сообщение ЕЦБ о возобновлении покупок государственных облигаций: в пятницу были отмечены поддерживающие покупки 3-х и 5-летних бондов Португалии. Рост аппетитов к риску на фондовых биржах отозвался повышением цен на сырье. В пятницу цены на золото обновили годовой максимум, достигнув рубежа $1398/унц. Котировки нефтяных контрактов по смеси Brent сегодня торгуются возле отметки $88,20/барр., что почти на $3 выше средних уровней среды.

Подарок из-за океана получили те инвесторы, которые рискнули уйти на праздники в акциях. Сегодня мы ожидаем открытия торгов на российских биржах в зоне сильного роста. Относительно уровней закрытия среды депозитарные расписки Газпрома в Лондоне подросли на +4,9%; Роснефти +5,1%; Лукойла +2,7%; ВТБ +9%; ГМК +6,6%. Думаю сегодня стоит зафиксировать большую часть прибыли, набежавшую за эти выходные. Не стоит ждать более щедрых подарков, который инвесторы получили за последние дни. При том, что ситуация на рынке труда США постепенно улучшается, экономика страны имеет дополнительную поддержку со стороны ФРС. В Европе ситуация отличается от этого кардинальным образом. Думаю, крупные инвесторы скоро обратят снимание на этот дисбаланс. Кризисные явления на рынке гособлигаций «проблемных» стран еврозоны в ближайшее время усилят позиции доллара, что столкнет цены на сырье и акции на более низкие уровни.

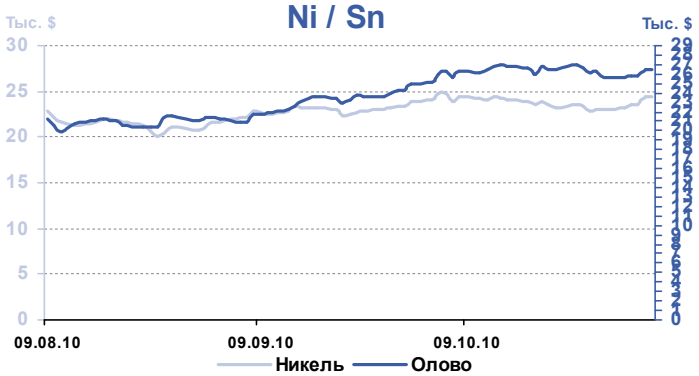
Сегодня в 14-00 выходят сентябрьские данные по промышленному производству из Германии. В остальном, понедельник будет скуден на статистику, поэтому все внимание обращаем сегодня на рынок госдолгов Европы и ситуацию на валютном рынке.

Commodities

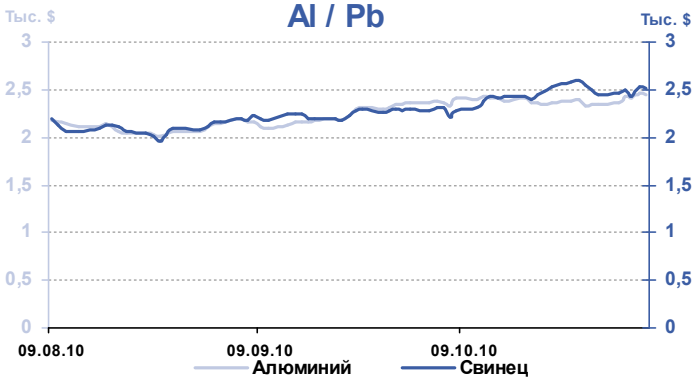
Cu / Zn



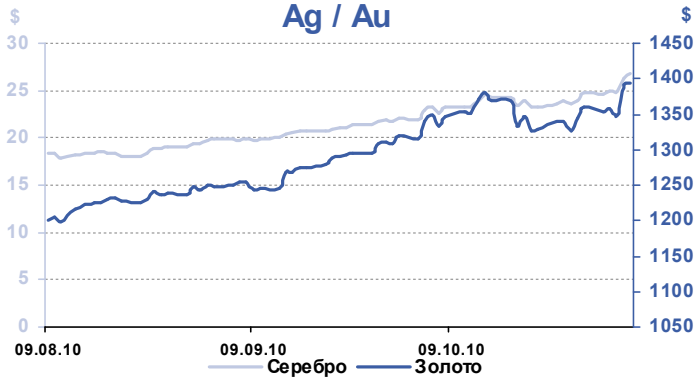
Ni / Sn



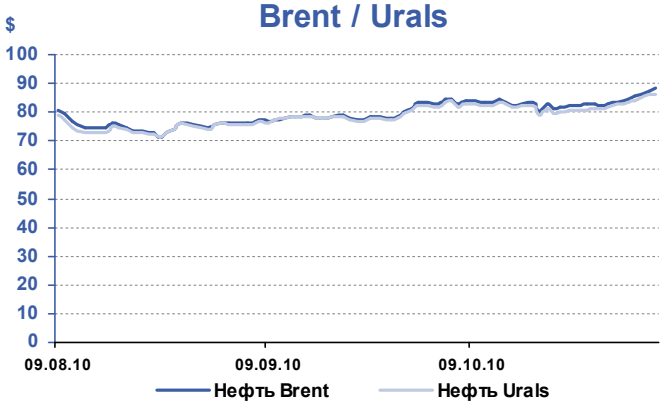
Al / Pb



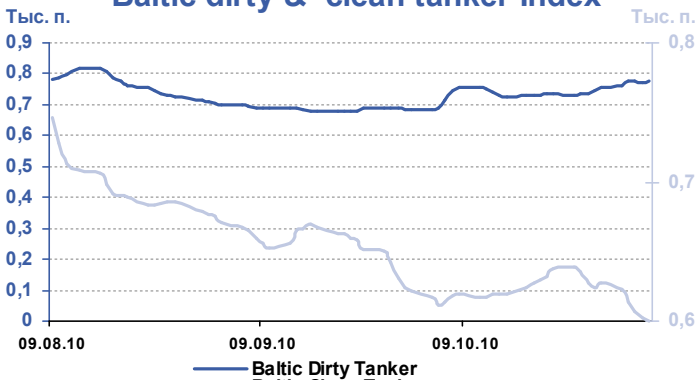
Ag / Au



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	8 320,00	-1,36%	0,24%	0,12%	28,79%
Цинк, $/t	2 405,00	-1,96%	-4,18%	5,02%	10,32%
Никель, $/t	23 550,00	0,32%	3,27%	-3,48%	32,30%
Олово, $/t	25 850,00	0,19%	-0,77%	-1,90%	74,78%
Алюминий, $/t	2 418,00	-0,49%	4,09%	-0,08%	26,73%
Свинец, $/t	2 436,00	-2,17%	-4,25%	7,22%	7,31%
Серебро, $/oz	24,86	-0,19%	5,38%	6,91%	44,41%
Золото, $/oz	1 348,55	-0,66%	1,75%	0,13%	24,36%
Нефть Brent, $/	86,11	0,73%	3,99%	2,65%	11,21%
Нефть Urals, $/	84,85	1,01%	4,74%	2,46%	11,28%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,504	0,00%	-0,96%		97 401	249
БашИнСв	BISV	0,178	0,00%	1,70%		546	167
БашЭнрг	BEGY	2,351	0,00%	-0,55%		347 865	2 454
ВМЗ	VSMZ	1394,492	0,00%	2,38%		132 576	2 422
ДВМП	FESH	0,447	0,00%	0,58%		28 177	1 322
КазанскВЗ	KHEL	2,216	0,00%	1,97%		86 661	342
КОМСТАР	CMST	6,525	0,00%	0,60%		88 805	2 722
Мечел	MTLR	23,480	0,00%	-0,89%		624 524	9 832
Мотовил	MOTZ	0,089	0,00%	0,40%		916	87
Новсибэнрг	NVNG	35,673	0,00%	-0,68%		4 348	490
СилМашины	SILM	0,270	0,00%	-0,88%		23 221	2 363
Сильвинит	SILV	725,622	0,00%	3,16%		1 980 894	5 621
СинТЗ-ао	SNTZ	58,342	0,00%	-0,06%		1 384	349
Славн-ЯНОС	JNOS	0,443	0,00%	1,18%		2 339	412
СТЗ-ао	SVTZ	5,189	0,00%	-3,03%		778	250
ТАГМЕТ	TAMZ	0,704	0,00%	-0,23%		352	358
У-УАЗ	UUAZ	1,767	0,00%	0,13%		26 545	470
ЧМК	CHMK	281,817	0,00%	0,00%		40 723	888
ЧТПЗ	CHEP	1,920	0,00%	1,84%		54 616	904
ЮжКузб.	UKUZ	40,923	0,00%	0,50%		5 741	1 470
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,200	0,47%	0,00%	43 200		7 351
Газпром	GAZP	5,545	0,00%	0,02%	249 525	187 119 772	131 270
Газпромнефть	SIBN	3,927	0,00%	-0,71%		3 805 771	18 693
Лукойл	LKOH	57,200	0,00%	-0,18%	57 200	73 156 479	48 652
НОВАТЭК	NVTK	8,090	0,00%	0,00%	8 090		24 564
Роснефть	ROSN	7,034	0,00%	-0,28%		41 256 209	74 676
Сургутнефтегаз	SNGS	0,987	0,00%	-0,29%		10 317 033	35 359
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,499	0,00%	0,33%	1 821 603	5 313 069	3 841
Транснефть, п.	TRNFP	1175,000	0,00%	-0,93%	117 500	13 236 786	1 827
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,400	0,00%	0,00%	38 120		2 502
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	0,05%	5 656	61 405	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,865	0,12%	-0,64%	8 650	226 639	801
МОЭСК	MSRS	0,051	0,00%	1,01%	3 139 722	372 235	2 474
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,052	0,00%	-0,60%	85 800	2 670 385	2 469
ОГК-4	OGKD	0,083	-1,78%	0,00%	41 500		5 202
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	-0,57%		165 157	2 994
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	-0,67%	10 800	1 024 227	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%		182 798	678
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-0,61%	119 680	42 021	1 006
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	4,482	0,00%	-0,39%		1 148 642	3 281
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	0,34%	30 000	23 118 710	728
СЗТ	SPTL	0,811	0,00%	0,20%		125 234	715
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%		5 522	111
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	0,50%	584 850	3 044 044	1 259
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	0,83%	120 000	4 203 496	1 666
ГАЗ	GAZA	30,000	0,00%	0,00%	21 390		556
ИРКУТ	IRKT	0,290	0,00%	0,91%		37 545	282
Казанский ВЗ	KHEL	2,250	8,45%	0,00%	22 500		347
КАМАЗ	KMAZ	2,327	0,00%	-0,55%		134 634	1 649
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%	-0,30%	19 125	1 152	80
РКК Энергия	RKKE	298,684	0,00%	-0,97%		4 825	339
Северсталь-авто	SVAV	17,125	0,00%	0,38%	6 507	85 778	587
Силовые машины	SILM	0,271	11,51%	0,00%	9 776		2 360
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,500		0,00%	6 607		249
Бурятзолото	BRZL	30,000	0,00%	0,00%	30 000		211
ВСМПО	VSMO	95,500	0,00%	-0,52%	95 500	152 702	1 101
Мечел	MTLR	23,200	0,00%	0,00%	23 200		9 657
ММК	MAGN	0,943	0,00%	-1,30%	94 300	951 067	10 537
НЛМК	NLMK	3,514	0,00%	0,11%		1 486 215	21 028
НорНикель	GMKN	182,298	0,00%	-0,62%	79 393	99 634 658	34 751
Полиметалл	PMTL	16,750	0,00%	-0,70%	16 750	929 347	6 690
Полюс Золото	PLZL	50,043	0,00%	-1,12%	6 806	3 513 276	9 540
Северсталь	CHMF	14,250	0,00%	0,58%	14 250	14 247 770	14 360
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	2,52%	67 855	1 622 790	4 257
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,775	0,00%	-0,02%		20 730	4 997
Возрождение	VZRZ	42,750	0,00%	-1,21%	16 673	73 859	1 015
ВТБ	VTBR	0,004	0,00%	-0,10%	3 520	63 102 308	36 821
РОСБАНК	ROSB	3,692	0,00%	0,90%		11 803	2 746
Сбербанк	SBER	3,350	0,15%	0,00%	1 338 150		72 316
УРАЛСИБ	USBN	0,004	0,00%	0,00%	15 336		1 293
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,470	0,00%	0,67%	61 750	1 365 269	2 743
Дальневосточное МП	FESH	0,450	0,00%	0,00%	45 000		1 328
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	1,28%	6 000	370 421	2 311
Приморское МП	PRIM	0,159	0,00%	-0,10%		987	125
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,468	0,00%	0,68%		53 848	3 994
Верофарм	VRPH	42,000	0,00%	0,00%	42 000		420
Вимм-Билль-Данн	WBDF	62,000	0,00%	-1,50%	62 000	15 515	2 728
Дикси	DIXY	13,000	0,00%	-2,01%	13 000	16 346	1 118
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	3,96%	72 150	34 919	190
Красный Октябрь	KROT	9,895	0,00%	-0,61%		2 546	91
Магнит	MGNT	114,500	0,44%	0,68%	229 250	464 919	10 188
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	-0,74%	45 617	34 913	23
Разгуляй	GRAZ	1,485	0,00%	-0,41%	8 892	152 646	235
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	8 000		600
Фармстандарт	PHST	90,000	0,00%	0,72%	270 000	38 571	3 401
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	-0,11%	601 000	6 499	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,178	0,00%	0,00%	3 905		317
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,510	0,00%	0,30%	25 500	25 094	822
Уфаоргсинтез	UFOS	3,500		0,00%	2 713		342
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	9 975		490
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	279,000	0,00%	0,00%	27 900		389
ПИК	pikk	3,790	0,00%	0,28%	10 004	2 014 312	1 869
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	-0,14%	171 100	463 625	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,100	3,79%	3,35%	345 500	5 802 355	1 435
Дорогобуж	DGBZ	0,495	0,00%	2,70%	39 600	78 720	357
Сильвинит	SILV	700,000	0,00%	0,00%	70 000		5 478
Уралкалий	URKA	5,000	0,00%	6,11%	25 000	37 534 190	10 622
Уголь							
Белон	BLNG	0,870	0,00%	0,00%	8 700		1 001
Распадская	rasp	5,620	-3,44%	-0,29%	202 320	3 589 699	4 388

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	177,570	1,83%	
Башнефть	AK6		EUR	151,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,780	5,95%	7,21
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,100	0,63%	3 049,57
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,212	2,43%	47,80
Бурятзолото	BYT		EUR	20,500	2,50%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,014	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,490	0,93%	10 356,19
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,500	-0,16%	21 714,38
X5	FIVE		USD	41,700	-0,12%	13 321,51
Газпром	GAZ		EUR	15,695	-0,38%	509,45
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	-0,92%	
ЮТК	KUE		EUR	5,900	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,900	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,720	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,850	-0,61%	144 942,30
Лукойл	LUK		EUR	40,470	-0,43%	320,69
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,400	0,42%	4 846,44
МТС	MBT	5	USD	22,460	-0,13%	41 874,13
МТС	MKY	5	EUR	15,695	-0,79%	
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,550	-0,66%	9,79
Мечел	MTL	3	USD	23,590	-1,30%	32 685,82
НорНикель	NILSY	1	USD	18,950	-0,16%	16 330,53
НорНикель	NNIA		EUR	13,395	-1,33%	463,44
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	98,450	-0,51%	31 734,52
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,100	-1,92%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,713	-4,93%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,910	0,00%	0,20
Газпром	OGZD		USD	22,060	-0,27%	227 675,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	18,75%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,000	-0,37%	46,96
Ростелеком	RTL		EUR	19,100	0,00%	5,83
Газпромнефть	SCF		EUR	13,900	-0,36%	107,61
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,876	-2,47%	6,73
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,461	-0,23%	6,39
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,050	1,41%	1 304,07
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,050	2,03%	926,07
АФКСистема	SSA	1	USD	26,130	-0,83%	10 119,63
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	42,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	49,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	40,000	15,94%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	159,500	0,31%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,500	0,00%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,200	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,810	2,40%	116 463,80
ВТБ	VTBR		USD	6,760	-0,52%	28 218,94
Возрождение	VZY		EUR	30,000	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	24,900	-4,08%	9 129,52
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,500	-4,37%	

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.