ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

10 ноября 2010г.

Комментарий по рынку акций

Вчера торги на американских фондовых биржах завершились снижением биржевых индексов. Продажи были отмечены в основном в секторе банков (индекс финансового сектора в S&P-500 рухнул на 2,2%), а также металлургических и химических компаний. Явных поводов к распродаже не было, однако, инвесторов насторожил рост доходности до пятимесячных максимумов 30-летних казначейских облигаций. При этом инвестиционный спрос в ходе вчерашнего аукциона по размещению 10-летних US Treasuries опустился до минимальных отметок с февраля этого года. Таким образом, американский рынок акций сейчас начинает входить в фазу формирования

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 659,48	1,91%	3,43%	5,91%	17,89%
Индекс ММВБ	1 594,72	1,69%	3,74%	8,88%	22,24%
FTSE	5 875,19	0,43%	2,05%	3,85%	12,23%
S&P 500	1 213,40	-0,81%	1,66%	4,14%	11,01%
Dow Jones Avg.	11 346,75	-0,53%	1,41%	3,09%	10,95%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Уралкалий	5,7500	15,00%	15,00%	39,94%
Нижнекамскнефтехим	0,5600	9,80%	0,70%	21,74%
Сильвинит	740,0000	5,71%	5,94%	-7,50%
ОАО Банк Санкт-	4,9900	5,61%	17,97%	81,45%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,3100	3,33%	14,24%	106,67%
Северсталь	14,8687	2,54%	-3,45%	76,17%
Уфаоргсинтез, п.	2,0958	1,25%	10,31%	90,53%
Газпром	5,7500	1,23%	5,50%	-5,78%

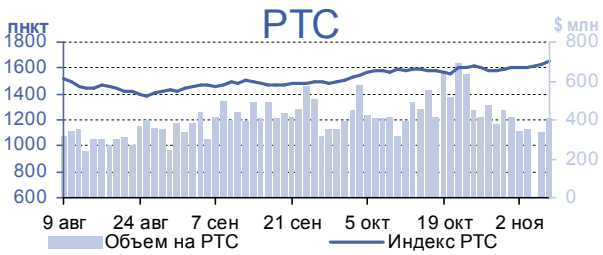
Лидеры снижения

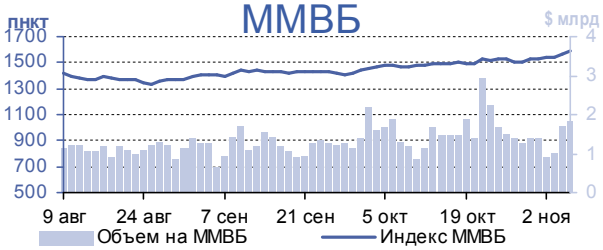
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Башкирэнерго	2,3374	-2,61%	5,77%	133,74%
Магнит	112,7000	-1,66%	-3,68%	57,07%
Северсталь-авто	16,9000	-1,31%	6,96%	14,97%
Ленэнерго	0,8500	-1,16%	1,31%	2,53%

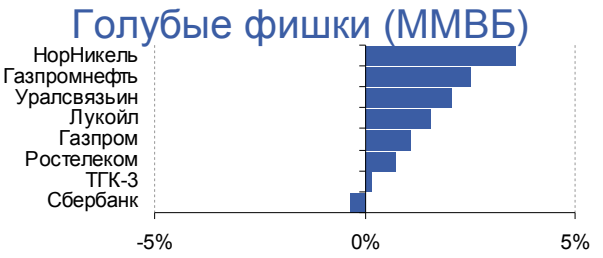
Индекс MSCI

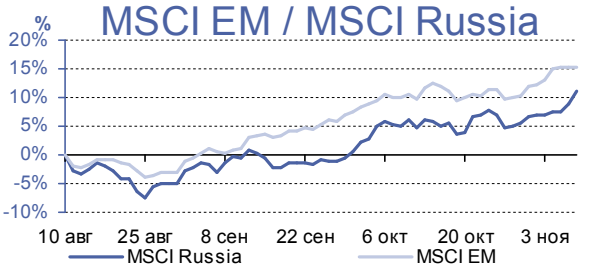
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1154,62	0,04%	4,84%	20,32%
Индекс MSCI BRAZIL	3795,27	-1,26%	0,92%	4,29%
Индекс MSCI RUSSIA	882,41	1,88%	5,75%	9,59%
Индекс MSCI INDIA	583,85	0,82%	3,43%	32,71%
Индекс MSCI CHINA	72,55	-0,97%	7,55%	11,44%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Вчера торги на американских фондовых биржах завершились снижением биржевых индексов. Продажи были отмечены в основном в секторе банков (индекс финансового сектора в S&P-500 рухнул на 2,2%), а также металлургических и химических компаний. Явных поводов к распродаже не было, однако, инвесторов насторожил рост доходности до пятимесячных максимумов 30-летних казначейских облигаций. При этом инвестиционный спрос в ходе вчерашнего аукциона по размещению 10-летних US Treasuries опустился до минимальных отметок с февраля этого года. Таким образом, американский рынок акций сейчас начинает входить в фазу формирования вершины восходящего тренда, когда рынок отыграл ключевые факторы роста и прощупывает уровни консолидации или даже ищет пути к отступлению.

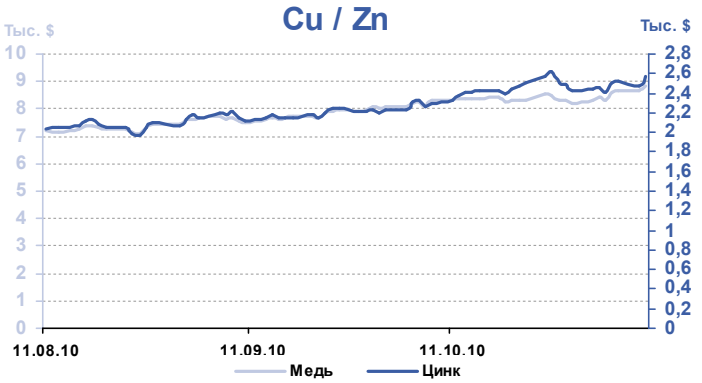
Игру в рост на рынке драгоценных металлов подкосило решение биржи CME Group (Чикаго) об увеличении гарантийных депозитов для фьючерсных контрактов на серебро. С учетом того, что в серебре за последнее время скопилось слишком много спекулятивных денег, цены на него вчера рухнули более чем на 5%. Котировки золота к середине недели также опустились ниже отметки $1400/унц. Цены на «черное золото» также остаются под давлением из-за усилений позиций доллара (EUR/USD 1,3764). После вчерашних попыток штурма высоты $89/барр, к утру среды котировки смеси Brent торгуются чуть ниже отметки $88/барр.

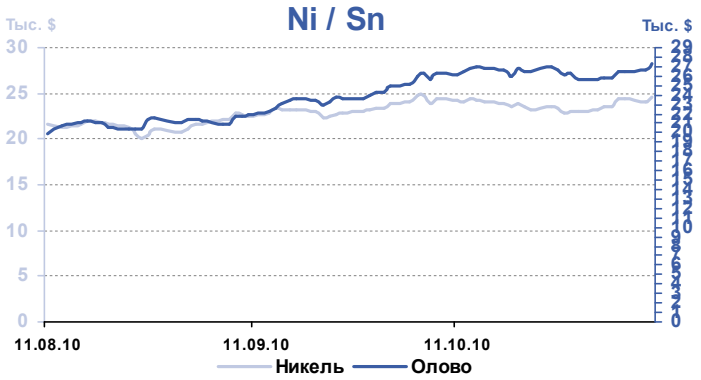
Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят преимущественно в негативной зоне (MSCI Asia -0,25%). Свежая статистика из Японии показала в октябре 4-е снижение подряд индекса потребительского доверия 40,9 против 41,2 в сентябре. Центральный Банк Китая с 15 ноября повысит резервные требования для ряда банков на 0,5%. При этом на рынке циркулируют слухи о том, что Китай может опять ужесточить кредитную политику в качестве превентивной меры в ответ на рост инфляции.

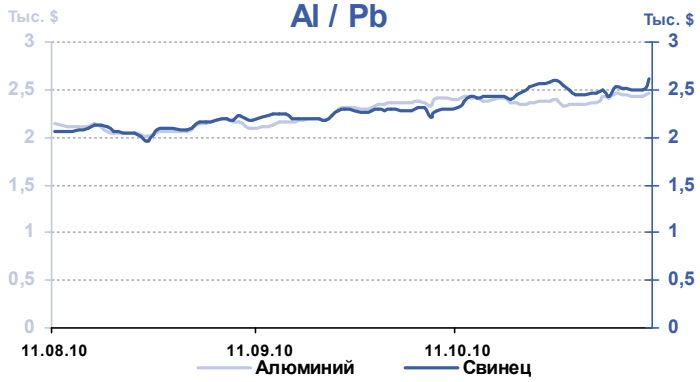
Открытие торгов на российском рынке акций в среду мы ожидаем увидеть с гэпом вниз в пределах 0,8%. Акции банков сегодня утром будут иметь слабую поддержку со стороны покупателей. Фиксацию прибыли стоит ждать также в бумагах золото- и горнодобывающих копаний (цены на медь и никель сегодня снижаются на 1,3%). В целом, ничего архинегативного на мировых биржах не замечено, поэтому не исключено, что после утренней просадки наш рынок стабилизируется, и будет ждать свежей статистики из США. Думаю, индекс ММВБ найдет поддержку на уровне 1575 пунктов.

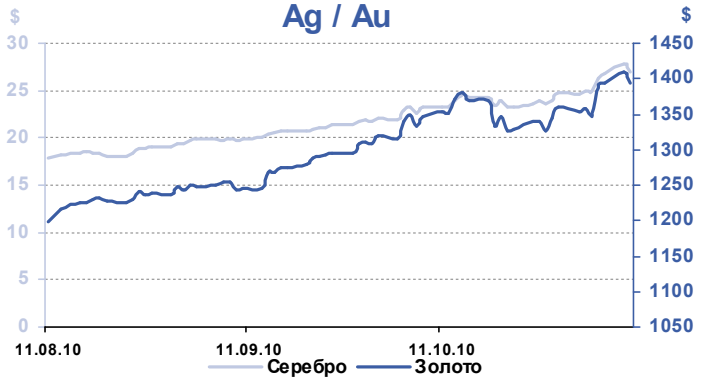
Днем основное внимание инвесторов будет приковано к запланированному аукциону по размещению бондов Португалии на сумму $1,25 млрд. Думаю, что слабый инвестиционный спрос со стороны частных покупателей может спровоцировать очередное ослабление позиций евро. Кстати, стратеги Bank of America ждут снижения пары EUR/USD к 1,25 в следующем году. Сегодня в 16-30 Министерство труда США опубликует отчёт по числу обращений за пособием по безработице (прогноз: 451 тыс.). В это же время выйдут данные торгового баланса США за сентябрь (прогноз: снижение дефицита до $45 млрд), а также данные по ценам на экспорт и импорт в США за октябрь. В 18-30 Минэнерго США опубликует отчёт по запасам нефти и нефтепродуктов.

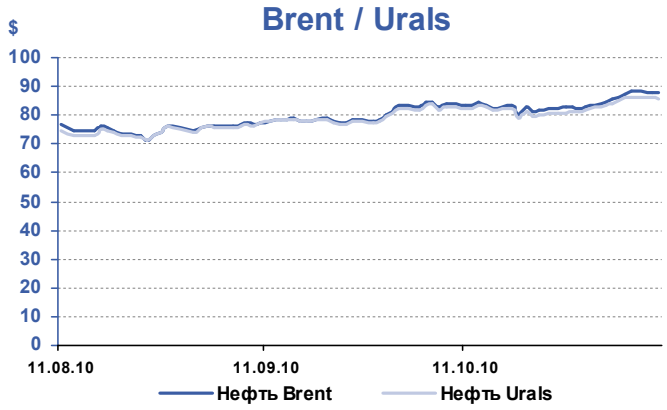
Commodities

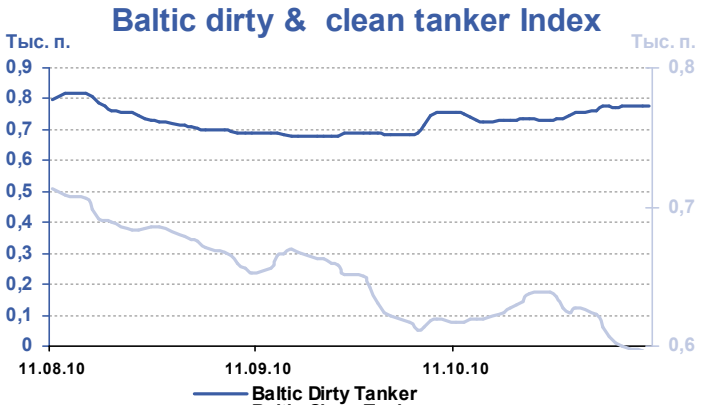












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 858,00	2,29%	5,01%	6,59%	35,46%
Цинк, $/t	2 580,00	4,05%	5,18%	12,66%	19,44%
Никель, $/t	24 620,00	2,05%	4,88%	0,90%	41,25%
Олово, $/t	27 350,00	2,82%	6,01%	3,80%	85,42%
Алюминий, $/t	2 469,00	1,60%	1,60%	2,02%	26,49%
Свинец, $/t	2 609,00	4,15%	4,78%	14,83%	13,43%
Серебро, $/oz	26,92	-2,97%	8,09%	15,78%	53,10%
Золото, $/oz	1 392,90	-1,18%	2,61%	3,43%	26,19%
Нефть Brent, $/	87,59	-0,53%	2,46%	4,41%	13,43%
Нефть Urals, $/	85,63	-0,95%	1,94%	3,41%	11,45%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,523	0,00%	0,38%		52 028	263
БашИнСв	BISV	0,175	0,00%	-2,55%		580	167
БашЭнрг	BEGY	2,344	0,00%	0,84%		405 922	2 451
ВМЗ	VSMZ	1400,168	0,00%	0,00%		76 653	2 484
ДВМП	FESH	0,462	0,00%	-0,84%		28 198	1 362
КазанскВЗ	KHEL	2,246	0,00%	1,38%		375 801	342
КОМСТАР	CMST	6,626	0,00%	0,49%		300 907	2 760
Мечел	MTLR	25,333	0,00%	2,64%		4 304 837	10 448
Мотовил	MOTZ	0,088	0,00%	-1,71%		7 821	84
Новсибэнрг	NVNG	35,818	0,00%	0,00%		13 327	484
СилМашины	SILM	0,275	0,00%	1,13%		119 769	2 410
Сильвинит	SILV	773,349	0,00%	3,26%		2 580 005	5 986
СинТЗ-ао	SNTZ	53,761	0,00%	-8,23%		269	338
Славн-ЯНОС	JNOS	0,449	0,00%	-0,36%		2 247	419
СТЗ-ао	SVTZ	5,214	0,00%	-0,84%		1 060	250
ТАГМЕТ	TAMZ	0,704	0,00%	0,00%		352	358
У-УАЗ	UUAZ	1,783	0,00%	0,49%		61 993	468
ЧМК	CHMK	306,083	0,00%	2,17%		2 388 226	966
ЧТПЗ	CHEP	1,954	0,00%	0,05%		184 074	925
ЮжКузб.	UKUZ	42,493	0,00%	1,17%		277 075	1 534
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	43,200	0,23%	0,00%	172 750		7 351
Газпром	GAZP	5,750	1,23%	1,09%	598 500	406 244 162	136 123
Газпромнефть	SIBN	4,148	0,00%	2,53%		14 483 199	19 581
Лукойл	LKOH	57,900	1,22%	1,58%	57 900	93 687 249	49 248
НОВАТЭК	NVTK	8,510	0,00%	0,00%	868 000		25 839
Роснефть	ROSN	7,284	0,00%	1,25%		95 540 290	77 036
Сургутнефтегаз	SNGS	0,995	0,51%	0,19%	3 858 787	19 479 914	35 547
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,499	0,00%	-0,19%	1 821 603	16 655 414	3 841
Транснефть, п.	TRNFP	1202,000	0,00%	0,08%	120 200	21 031 118	1 866
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	2,337	-2,61%	0,00%	23 374		2 437
Иркутскэнерго	IRGZ	0,808	0,00%	2,20%	5 656	390 833	3 852
Ленэнерго	LSNG	0,850	-1,16%	-1,17%	5 100	396 408	787
МОЭСК	MSRS	0,051	0,00%	2,01%	3 139 722	644 493	2 474
ОГК-2	OGKB	0,056	0,00%	0,00%	28 000		1 833
ОГК-3	OGKC	0,052	0,00%	0,78%	85 800	824 652	2 469
ОГК-4	OGKD	0,083	0,00%	0,00%	41 500		5 202
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	-0,39%		678 107	2 984
ТГК-3	MSNG	0,108	0,00%	0,15%	10 800	1 704 795	4 293
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-0,59%		16 839	673
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	1,24%	119 680	183 138	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
Комстар-ОТС	CMST	6,600	0,00%	0,00%	6 600		2 758
МТС	MTSS	8,200	0,00%	0,00%	32 800		16 345
Ростелеком	RTKM	4,591	0,00%	0,73%		3 235 219	3 361
Ростелеком, п.	RTKMP	3,000	0,00%	0,59%	30 000	19 326 132	728
СЗТ	SPTL	0,840	0,00%	2,14%		1 215 703	736
СибирьТелеком	ENCO	0,073	0,00%	0,00%	36 500		877
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,60%		17 459	112
Уралсвязьинформ	URSI	0,039	0,00%	2,06%	389 500	8 653 462	1 258
ЮТК	KUBN	0,173		0,00%	4 249		512
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,200	0,00%	3,12%	120 000	12 018 730	1 666
ГАЗ	GAZA	30,000	0,00%	0,00%	21 390		556
ИРКУТ	IRKT	0,295	0,00%	0,18%		34 244	289
Казанский ВЗ	KHEL	2,250	0,00%	0,00%	22 500		347

КАМАЗ	KMAZ	2,384	0,00%	0,99%		792 574	1 688
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%	1,51%	19 125	28 152	80
Подольский МСЗ	PDMS	1,900	0,00%	0,00%	5 130		40
РКК Энергия	RKKE	304,432	0,00%	1,51%		14 136	331
Северсталь-авто	SVAV	16,900	-1,31%	-2,45%	101 500	857 779	579
Силовые машины	SILM	0,271	0,00%	0,00%	9 776		2 360
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,500	0,00%	0,00%	6 607		249
Бурятзолото	BRZL	30,000	0,00%	0,00%	30 000		211
ВСМПО	VSMO	95,500	0,00%	-0,60%	95 500	726 449	1 101
Мечел	MTLR	23,200	0,00%	0,00%	23 200		9 657
ММК	MAGN	0,943	0,00%	4,17%	94 300	9 160 609	10 537
НЛМК	NLMK	3,943	0,00%	5,68%		6 025 685	23 018
НорНикель	GMKN	188,300	0,00%	3,58%	452 360	203 986 787	35 895
Полиметалл	PMTL	16,750	0,00%	5,16%	16 750	3 234 893	6 690
Полюс Золото	PLZL	50,043	0,00%	3,40%	6 806	20 714 907	9 540
Северсталь	CHMF	14,869	2,54%	3,64%	31 950	41 871 581	14 983
ТМК	TRMK	4,540	0,00%	1,33%	67 855	10 211 834	4 257
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,748	0,00%	-0,51%		10 725	5 025
Возрождение	VZRZ	42,500	0,00%	-0,76%	212 500	157 417	1 009
ВТБ	VTBR	0,004	0,00%	0,84%	35 200	115 881 679	36 821
РОСБАНК	ROSB	3,680	0,00%	-0,11%		21 649	2 764
Сбербанк	SBER	3,380	0,27%	0,00%	3 533 600		73 072
УРАЛСИБ	USBN	0,005	0,00%	0,00%	12 500		1 463
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,510	0,40%	-0,30%	62 750	2 584 631	2 788
Дальневосточное МП	FESH	0,450	0,00%	0,00%	45 000		1 328
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	-2,61%	6 000	1 089 283	2 311
Приморское МП	PRIM	0,160	0,00%	-0,20%		21 038	126
Ютэйр	TMAT	0,510	0,00%	0,00%	7 650		294
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,600	0,00%	0,00%	18 000		378
Балтика	PKBA	33,832	0,00%	1,36%		70 693	4 032
Верофарм	VRPH	42,100	0,24%	0,00%	25 260		421
Вимм-Билль-Данн	WBDF	61,000	0,00%	0,01%	122 500	70 210	2 684
Дикси	DIXY	12,830	0,00%	1,52%	102 910	143 311	1 103
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	-1,64%	72 150	24 252	190
Красный Октябрь	KROT	10,055	0,00%	1,91%		4 093	93
Магнит	MGNT	112,700	-1,66%	-0,88%	573 950	1 483 754	10 027
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,430	0,00%	-2,40%	45 617	119 209	23
Разгуляй	GRAZ	1,485	0,00%	-0,28%	8 892	143 269	235
Седьмой континент	SCON	8,000	0,00%	0,00%	8 000		600
Фармстандарт	PHST	92,200	0,00%	0,34%	55 220	70 533	3 484
Черкизово	GCHE	30,050	0,00%	-2,35%	601 000	100 362	1 294
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,178	0,00%	0,00%	3 905		317
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,560	9,80%	2,65%	28 000	93 652	902
Уфаоргсинтез	UFOS	3,500	0,00%	0,00%	2 713		342
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	9 975		490
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	276,000	0,00%	0,00%	86 614		384
ПИК	pikk	3,800	0,00%	-0,09%	5 001	2 596 907	1 874
РБК ИС	RBCI	1,141	0,00%	-1,32%	171 100	1 575 416	160
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	30,100	0,00%	0,08%	345 500	1 974 516	1 435
Дорогобуж	DGBZ	0,495	0,00%	2,04%	39 600	237 043	357
Сильвинит	SILV	740,000	5,71%	0,00%	37 000		5 869
Уралкалий	URKA	5,750	15,00%	7,47%	57 500	30 483 490	12 215
Уголь							
Белон	BLNG	0,870	0,00%	0,00%	8 700		1 001
Распадская	rasp	5,710	0,18%	0,74%	456 800	4 687 173	4 458

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	180,000	-0,12%	
Башнефть	AK6		EUR	153,000	0,00%	95,97
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,660	-0,60%	46,00
ТГК-3	AOMD		USD	11,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	34,090	1,76%	13 199,31
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	4,310	2,38%	40,87
Бурятзолото	BYT		EUR	12,000	-41,46%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,012	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,590	1,23%	4 979,19
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	33,500	1,82%	38 188,90
X5	FIVE		USD	42,380	1,15%	10 254,45
Газпром	GAZ		EUR	16,530	1,54%	1 842,84
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,240	3,60%	1,74
ЮТК	KUE		EUR	5,900	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	3,90%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,100	2,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,700	-2,78%	
Лукойл	LKOD		USD	58,500	1,74%	178 570,00
Лукойл	LUK		EUR	42,165	2,54%	392,52
Лукойл	LUKOY	1	USD	58,050	0,35%	30 200,20
МТС	MBT	5	USD	22,530	-0,92%	50 233,91
МТС	MKY	5	EUR	16,470	1,86%	10,06
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,550	0,00%	
Мечел	MTL	3	USD	25,340	-0,67%	77 958,50
НорНикель	NILSY	1	USD	20,680	4,39%	5 051,49
НорНикель	NNIA		EUR	15,050	5,36%	1 715,48
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	108,300	5,66%	59 242,05
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,400	-1,82%	4,98
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,700	-1,82%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,800	2,70%	7,80
Газпром	OGZD		USD	23,000	1,55%	375 364,90
ОМЗ	OMZD		USD	2,300	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,650	0,99%	27,65
Ростелеком	RTL		EUR	19,400	-0,51%	3,92
Газпромнефть	SCF		EUR	14,800	2,07%	288,09
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,050	0,79%	15,04
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,529	-0,59%	3,55
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,990	-1,19%	68,29
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,950	0,71%	4,00
АФКСистема	SSA	1	USD	26,300	1,15%	10 433,97
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	43,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	48,500	5,43%	
ЦУМ	THT		EUR	25,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	34,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	183,350	2,72%	35,78
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,600	2,75%	8,43
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,200	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,890	1,08%	55 792,98
ВТБ	VTBR		USD	7,080	1,58%	48 183,87
Возрождение	VZY		EUR	30,000	0,00%	44,83
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	24,830	-0,08%	12 355,08
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	17,755	0,97%	11,72

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

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@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.