ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

14 октября 2011г.

Комментарий по рынку акций

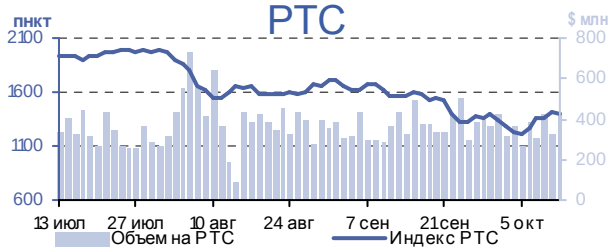
Вчера основные фондовые индексы США завершили торги в разнополярных областях. На фоне повышения спроса на акции технологических компаний (Nasdaq +0,6%), были замечены хорошие продажи в бумагах банков. Вчера вышла отчетность одного из крупнейших банков Америки J.P. Morgan Chase. В ней инвесторы усмотрели явные «старания» бухгалтеров банка, чтобы на бумаге получить дополнительные $1,2 млрд. дохода от переоценки своих долговых обязательств, без учета которых квартальная прибыль составила бы лишь $0,73 на акцию. В результате вчера акции J.P. Morgan просели в цене на 4,8%. Вышедший после окончания торгов отчет интернет-поисковика

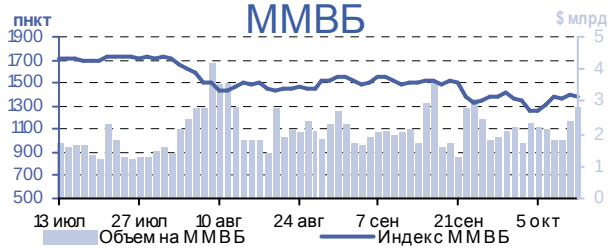
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 396,27	-0,82%	9,79%	-11,09%	-12,12%
Индекс ММВБ	1 388,77	-0,55%	5,35%	-7,72%	-6,99%
FTSE	5 403,38	-0,71%	2,12%	3,37%	-5,98%
S&P 500	1 203,66	-0,30%	3,32%	1,26%	2,17%
Dow Jones Avg.	11 478,13	-0,35%	3,19%	2,06%	3,44%

Основные индикаторы





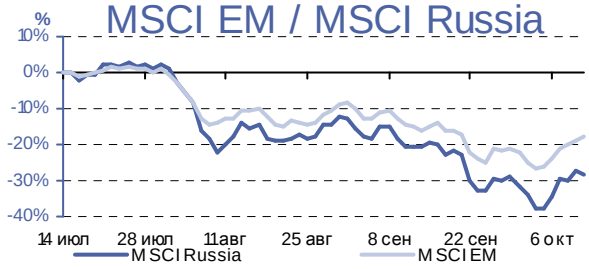
Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
НорНикель	212,0000	8,97%	-14,65%	-1,62%
Распадская	2,7500	7,42%	-32,76%	-55,65%
Газпром	5,2400	5,65%	-10,12%	-15,21%
Сбербанк	2,4200	1,26%	-9,02%	-28,82%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Транснефть, п.	976,0000	-7,92%	-27,70%	-26,28%
Силовые машины	0,1950	-4,88%	-20,41%	-33,22%
Магнит	84,6000	-2,76%	-11,92%	-34,42%
Башнефть, п.	35,5000	-1,39%	-8,39%	6,77%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	930,47	0,79%	-2,32%	-16,75%
Индекс MSCI BRAZIL	2856,89	2,11%	-3,34%	-25,79%
Индекс MSCI RUSSIA	730,84	-1,23%	-9,56%	-13,27%
Индекс MSCI INDIA	415,43	-0,60%	-1,60%	-27,83%
Индекс MSCI CHINA	53,08	3,31%	-1,96%	-23,51%

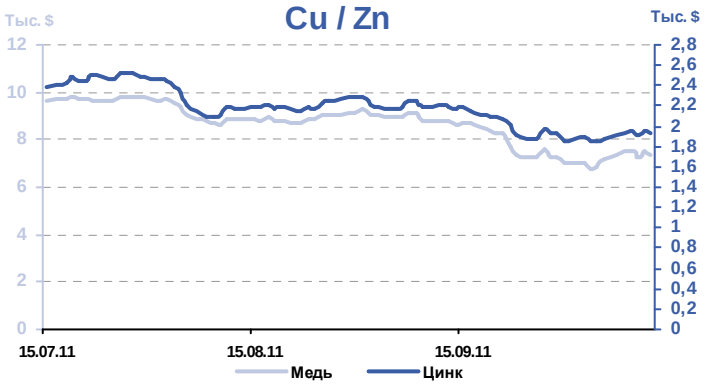
Обзор рынка

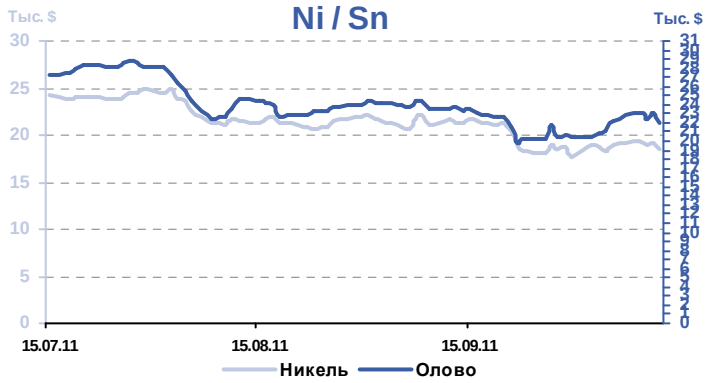
Вчера основные фондовые индексы США завершили торги в разнополярных областях. На фоне повышения спроса на акции технологических компаний (Nasdaq +0,6%), были замечены хорошие продажи в бумагах банков. Вчера вышла отчетность одного из крупнейших банков Америки J.P. Morgan Chase. В ней инвесторы усмотрели явные «старания» бухгалтеров банка, чтобы на бумаге получить дополнительные $1,2 млрд. дохода от переоценки своих долговых обязательств, без учета которых квартальная прибыль составила бы лишь $0,73 на акцию. В результате вчера акции J.P. Morgan просели в цене на 4,8%. Вышедший после окончания торгов отчет интернет-поисковика Google показал, что его чистая прибыль в III квартале 2011 г. выросла на 26% ($2,73 млрд.) по сравнению с прошлым годом, а выручка за этот же период поднялась на 33%.

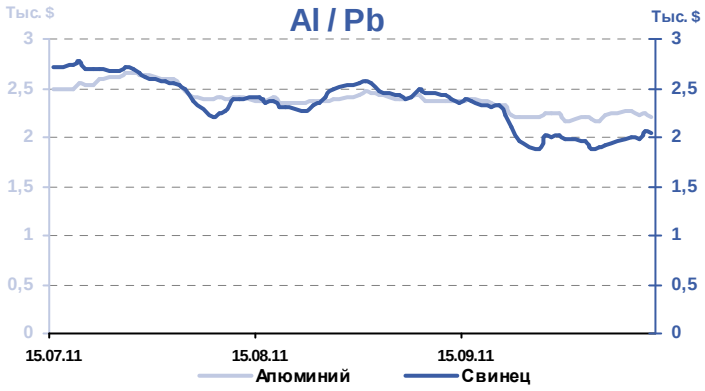
На валютном рынке за последние сутки наблюдается высокая волатильность в узком торговом диапазоне. С одной стороны на позиции евро позитивно влияет ратификация Словакией реформы EFSF. С другой стороны давит новость о том, что агентство S&P понизило кредитный рейтинг Испании с AA до AA- с негативным прогнозом. Но кардинальных движений по паре EUR/USD мы пока не видим (1,3770). Цены на нефть марки Brent после недолгой просадки к утру пятницы вернулись на уровень $111/барр. Китайская статистика по потребительской (CPI +6,1 % г/г против прогноза +6,3% г/г) и производственной (PPI +6,5% г/г против прогноза +6,8% г/г) инфляции за сентябрь оказалась лучше прогноза, что является следствием, как общего охлаждения мировых цен на сырье, так и следствием ужесточения монетарной политики в стране.

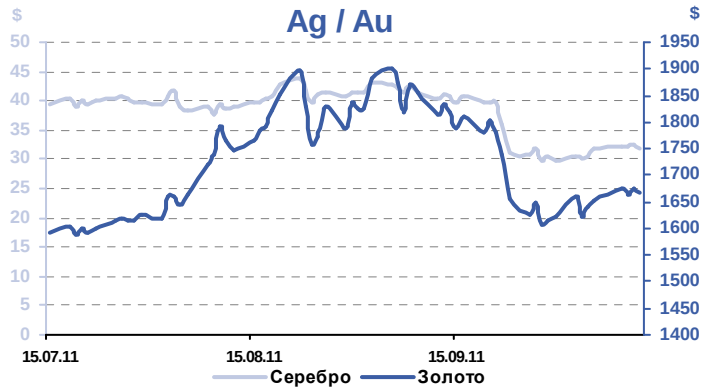
В пятницу мы ждем открытия торгов на наших биржах с умеренно-позитивными настроениями. Мы обратили внимание на то, что череда негативных новостей идущих с западных рынков в последние дни нас почти не коснулась. Сегодня утром инвесторам предстоит «переварить» очередную порцию негатива от рейтинговых агентств: Fitch понизило рейтинг банка UBS с A+ до A, а рейтинги таких гигантов, как Morgan Stanley, Goldman Sachs и Deutsche Bank поставлены на пересмотр с негативным прогнозом. Понижение рейтинга Испании также может подпортить игру рынка наверх. Но в целом, никаких кардинальных движений в биржевых котировках под занавес недели не видно, а значит, рынки могут продолжить развивать основную тему последних дней – консолидация с попытками роста. Сегодня вечером в Штатах выходит блок важной макростатистики (розничные продажи за сентябрь), ожидания по которой довольно позитивные. Вчера индекс ММВБ завершил день ниже отметки 1400 п., но сегодня будут предприняты попытки вернуть его выше этого уровня. Настрой на рост в бумагах Сбербанка говорит о желании крупных игроков на следующей неделе поднять их к отметке 79 руб. Новость о том, что корпорация Unilever намерена приобрести российский концерн «Калина» за $850 млн., несомненно, скажется на позициях отечественного производителя косметики. Сегодня ждем публикации отчетности Холдинга МРСК по МСФО за 1 полугодие 2011 года

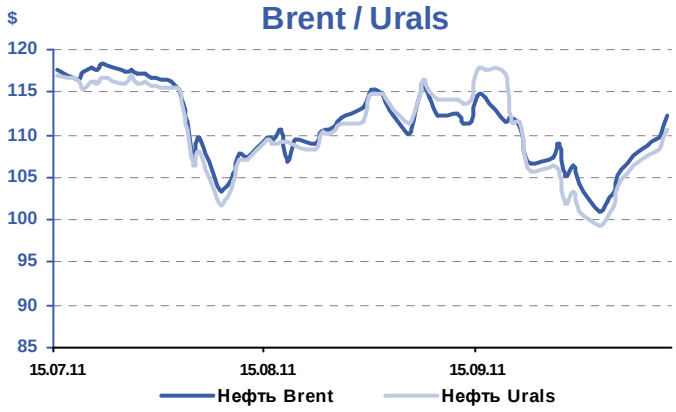
Commodities

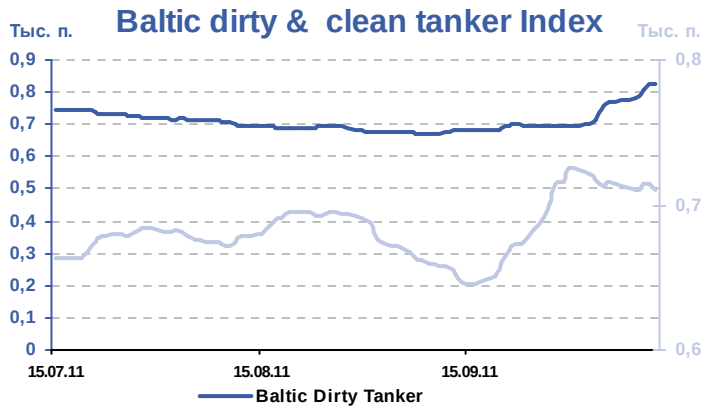












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 310,00	-2,86%	1,18%	-15,30%	-12,58%
Цинк, $/t	1 923,50	-1,11%	3,03%	-10,99%	-20,19%
Никель, $/t	18 455,00	-3,28%	-2,61%	-13,66%	-24,36%
Олово, $/t	22 000,00	-4,35%	-0,65%	-5,98%	-17,83%
Алюминий, $/t	2 207,00	-1,82%	-0,94%	-6,44%	-8,69%
Свинец, $/t	2 036,00	-1,64%	5,93%	-13,10%	-16,39%
Серебро, $/oz	31,89	-2,24%	-0,36%	-21,66%	32,88%
Золото, $/oz	1 668,14	-0,47%	1,01%	-8,33%	21,57%
Нефть Brent, $/	112,16	1,80%	5,91%	0,56%	32,91%
Нефть Urals, $/	110,51	1,54%	5,56%	-3,15%	32,73%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,500	0,00%	0,00%	25 000		37 492
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,500	-1,04%	0,00%	142 500		8 083
Газпром	GAZP	5,240	5,65%	0,00%	131 000		124 049
Газпромнефть	SIBN	3,250	0,00%	0,00%	65 000		15 409
Лукойл	LKOH	48,500	0,00%	0,00%	145 500		41 252
НОВАТЭК	NVTK	11,000	0,00%	0,00%	200 900		33 399
Роснефть	ROSN	5,750	0,00%	0,00%	115 000		60 940
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,432	0,00%	0,00%	216 000		3 327
Татнефть	TATN	4,310	0,00%	0,00%	8 620		9 390
Татнефть, п.	TATNP	2,450	0,00%	0,00%	24 500		361
Транснефть, п.	TRNFP	976,000	-7,92%	0,00%	9 760		1 518
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,250	0,00%	0,00%	6 250		1 303
Иркутскэнерго	IRGZ	0,600	0,00%	0,00%	59 000		2 860
Ленэнерго	LSNG	0,338	0,00%	0,00%	253 536		313
МОЭСК	MSRS	0,047	0,00%	0,00%	10 357		2 303
ОГК-2	OGKB	0,029	0,00%	0,00%	14 500		949
ОГК-3	OGKC	0,029	0,00%	0,00%	14 500		1 377
ОГК-4	OGKD	0,077	0,00%	0,00%	353 481		4 855
ОГК-5	OGKE	0,060	0,00%	0,00%	30 000		2 122
Самараэнерго	SAGO	0,018	0,00%	0,00%	18 000		64
ТГК-3	MSNG	0,068	0,00%	0,00%	33 750		2 683
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,325	0,00%	0,00%	32 500		308
МТС	MTSS	5,760	0,00%	0,00%	5 760		11 903
Ростелеком	RTKM	4,586	0,00%	0,00%	6 549		13 497
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	0,00%	0,00%	5 001		656
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%	5 880		109
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	29,000	0,00%	0,00%	20 300		537
Казанский ВЗ	KHEL	2,693	0,00%	0,00%	11 960		415
КАМАЗ	KMAZ	1,220	0,00%	0,00%	12 200		863
Кировский завод	KIRZ	4,000	0,00%	0,00%	5 000		43
Силовые машины	SILM	0,195	-4,88%	0,00%	9 750		1 698
УМПО	UFMO	0,562	0,00%	0,00%	27 823		160
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,250	0,00%	0,00%	12 500		125
ВСМПО	VSMO	133,000	0,00%	0,00%	15 960		1 533
Мечел	MTLR	10,000	0,00%	0,00%	25 000		4 163
НорНикель	GMKN	212,000	8,97%	0,00%	212 000		40 413
Полиметалл	PMTL	15,100	0,00%	0,00%	15 100		6 031
Полюс Золото	PLZL	59,000	0,00%	0,00%	17 700		11 247
Северсталь	CHMF	12,246	0,00%	0,00%	27 150		12 341
ТМК	TRMK	2,100	0,00%	0,00%	16 800		1 969
ЧМЗ	CHMZ	6,250	0,00%	0,00%	5 000		98
ЧТПЗ	CHEP	3,500	0,00%	0,00%	52 500		1 653
Банки							
Возрождение	VZRZ	23,000	0,00%	0,00%	11 500		546
Сбербанк	SBER	2,420	1,26%	0,00%	962 000		52 240
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,530	0,00%	0,00%	201 050		1 699
Дальневосточное МП	FESH	0,313	0,00%	0,00%	79 346		922
Приморское МП	PRIM	0,120	0,00%	0,00%	12 000		96
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,650	0,00%	0,00%	5 001		252
Дикси	DIXY	7,030	0,00%	0,00%	70 300		877
Магнит	MGNT	84,600	-2,76%	0,00%	126 725		7 527

Разгуляй	GRAZ	1,000	0,00%	0,00%	47 430		157
Седьмой континент	SCON	4,000	0,00%	0,00%	6 000		300
Фармстандарт	PHST	66,150	0,00%	0,00%	6 615		2 500
Черкизово	GCHE	20,950	0,00%	0,00%	104 750		902
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,110	0,00%	0,00%	5 500		187
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,600	0,00%	0,00%	30 000		967
Уфанефтехим	UFNC	4,700	0,00%	0,00%	47 000		1 294
Уфаоргсинтез	UFOS	2,500	0,00%	0,00%	37 500		244
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,330	0,00%	0,00%	29 700		308
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	110,000	0,00%	0,00%	5 500		156
ПИК	pikk	2,830	0,00%	0,00%	5 001		1 396
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	28,000	0,00%	0,00%	46 000		1 335
Дорогобуж	DGBZ	0,500	0,00%	0,00%	50 000		361
Уралкалий	URKA	9,205	0,00%	0,00%	12 887		28 625
Химпром, НЧ	HIMC	0,020	0,00%	0,00%	582		14
Уголь							
Белон	BLNG	0,400	0,00%	0,00%	8 000		460
Распадская	rasp	2,750	7,42%	0,00%	164 100		2 147

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	120,000	-0,25%	
Башнефть	AK6		EUR	170,000	0,00%	
ТГК-3	AOMD		USD	5,850	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	26,300	-1,76%	6 219,14
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,344	-2,78%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	17,150	-0,81%	48 794,18
X5	FIVE		USD	21,950	-1,92%	57 240,98
Газпром	GAZ		EUR	7,405	-2,23%	1 425,74
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,018	-10,00%	0,33
Иркутскэнерго	IRK		EUR	20,500	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,600	20,00%	2,04
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,900	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,510	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	53,450	-1,38%	184 789,60
Лукойл	LUK		EUR	39,005	-1,17%	278,96
Лукойл	LUKOY	1	USD	53,640	-1,60%	5 009,70
МТС	MBT	5	USD	14,230	0,42%	39 802,16
МТС	MKY	5	EUR	10,280	0,29%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,460	-4,70%	33,80
Мечел	MTL	3	USD	11,590	1,67%	73 490,62
НорНикель	NILSY	1	USD	21,120	4,04%	10 589,14
НорНикель	NNIA		EUR	15,310	3,24%	867,60
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	123,000	-0,40%	119 146,20
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,900	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,170	-2,12%	418 677,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	28,530	-0,94%	1 478,45
Ростелеком	RTL		EUR	20,500	-3,30%	
Газпромнефть	SCF		EUR	13,150	-2,16%	7,29
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,905	-2,19%	8,96
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,296	-0,33%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,500	0,00%	35,72
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,200	-2,61%	1 233,77
АФКСистема	SSA	1	USD	16,300	1,88%	10 181,30
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,681	-0,01%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	19,880	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	29,635	-7,26%	
ЦУМ	THT		EUR	12,500	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	225,000	1,02%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,090	-1,27%	42 155,60
ВТБ	VTBR		USD	4,166	-2,09%	89 105,89
Возрождение	VZY		EUR	23,000	0,00%	

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

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@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 ОАО "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.