ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

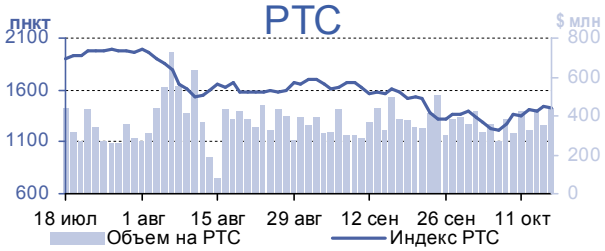
18 октября 2011г.

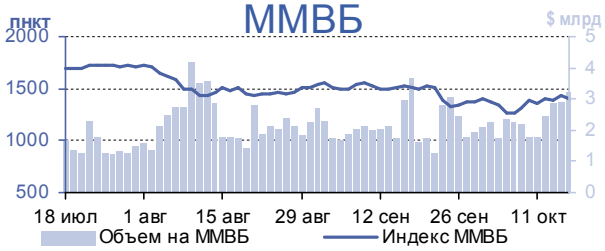
Комментарий по рынку акций

В понедельник американские фондовые индексы снизились, так и не сумев выйти за границы рынки двухмесячного бокового тренда. Фиксация прибыли по факту выхода квартальных отчетов в купе с разочарованием относительно очередной проволочки в решении европейского долгового кризиса – вот основные поводы к вчерашним продажам акций на Уолл-стрит. Лидеры Евросоюза не представят плана окончательного решения всех проблем на саммите 23 октября. На повестке будут лишь координация условий рекапитализации европейских банков и обсуждение эффективности работы EFSF. Вчерашние отчеты крупнейших американских банков показали, что в третьем квартале 2011 года

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





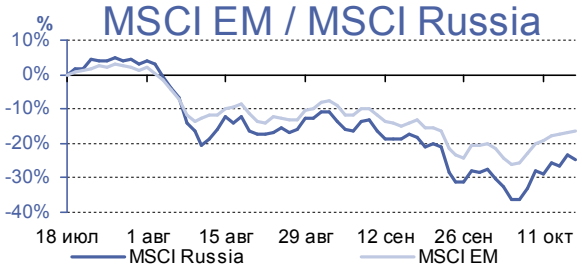
Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 427,31	-1,52%	4,51%	-9,37%	-9,84%
Индекс ММВБ	1 403,05	-2,02%	1,61%	-7,17%	-6,50%
FTSE	5 436,70	-0,54%	0,70%	1,27%	-5,33%
S&P 500	1 200,86	-1,94%	0,50%	-1,25%	1,36%
Dow Jones Avg.	11 397,00	-2,13%	-0,32%	-0,97%	2,27%

Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Концерн Калина	116,1646	70,88%	132,33%	364,66%
Ленэнерго, п.	0,8390	15,64%	-11,69%	-27,05%
Магнит	93,0000	9,93%	-10,47%	-27,91%
Верофарм	29,5000	9,26%	-4,38%	-37,57%
ОАО Синергия	20,1700	7,86%	-33,32%	-56,72%
Сбербанк	2,6650	4,72%	0,95%	-23,70%
Газпром	5,4300	3,63%	-6,86%	-15,55%
Полиметалл	15,7000	1,29%	-30,22%	-5,23%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ЧТПЗ	2,8000	-20,00%	3,70%	33,33%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	941,02	0,59%	-3,67%	-15,41%
Индекс MSCI BRAZIL	2837,30	-2,42%	-6,57%	-26,32%
Индекс MSCI RUSSIA	747,97	-1,83%	-7,82%	-10,95%
Индекс MSCI INDIA	420,03	-0,11%	-2,69%	-25,58%
Индекс MSCI CHINA	53,37	2,77%	-3,37%	-23,32%

Обзор рынка

В понедельник американские фондовые индексы снизились, так и не сумев выйти за границы рынки двухмесячного бокового тренда. Фиксация прибыли по факту выхода квартальных отчетов в купе с разочарованием относительно очередной проволочки в решении европейского долгового кризиса – вот основные поводы к вчерашним продажам акций на Уолл-стрит. Лидеры Евросоюза не представят плана окончательного решения всех проблем на саммите 23 октября. На повестке будут лишь координация условий рекапитализации европейских банков и обсуждение эффективности работы EFSF. Вчерашние отчеты крупнейших американских банков показали, что в третьем квартале 2011 года чистая прибыль Wells Fargo выросла на 22%, прибыль Citigroup за тот же период взлетела на 74%, однако это привело к продажам акций этих банков на 8,4% и 1,6%, соответственно.

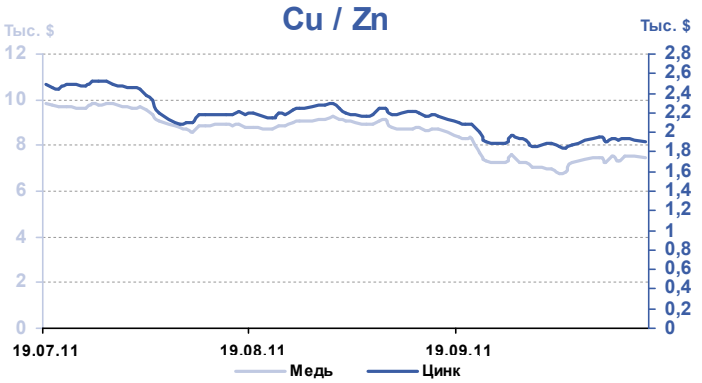
После завершения торгов отчитался IBM: прибыль составила $3,28/акция (ожидание: $3,22). А вот выручка ($26,2 млрд) не дотянула до прогнозов аналитиков, в результате чего котировки компании теряют сейчас почти 4%.

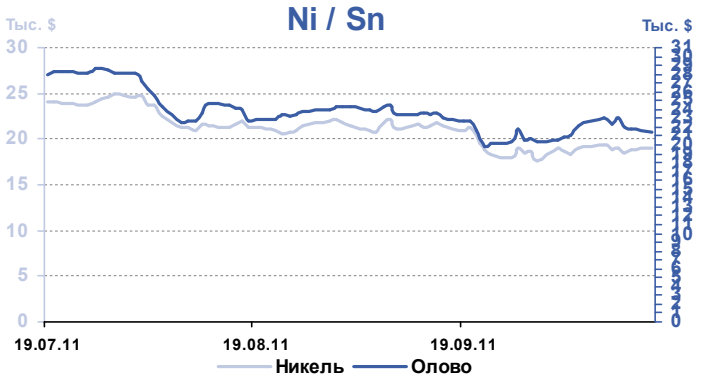
Цены на нефть марки Brent съехали вниз вместе с фондовыми индексами и во вторник утром торгуются возле отметки $108,6/барр. Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят в красной зоне (MSCI Asia -2,62%). Вышедшая статистика по Китаю за 3-й квартал оказалась вполне пристойной: розничные продажи: +17,7% г/г (прогноз: +17,0%), промышленное производство +13,8% г/г (прогноз: +13,4%), прирост ВВП +9,1% г/г (прогноз: +9,3%).

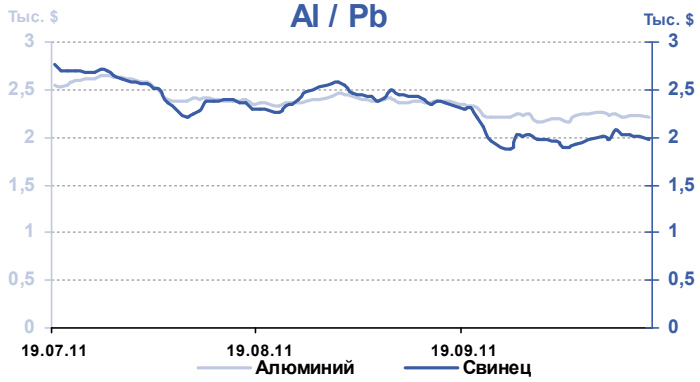
Открытие торгов на ММВБ во вторник мы ожидаем увидеть с небольшим гэпом вниз (в пределах полпроцента). Вчера вечером индекс ММВБ пробив наклонную линию поддержки на 1412 п. закрыл сессию возле отметки 1400 п. Вчерашним снижением наши биржевые индикаторы сняли локальную перекупленность, ведь за последние полторы недели индекс ММВБ подрос на 14%. События развиваются по обычному сценарию: рынок обратил внимание на негативные новости, когда в силу технических факторов не смог продолжить рост. Чего ждать дальше? Уверенный уход индексов от своих максимумов в понедельник может привести к тому, что в ближайшее время спекулянты будут тянуть снижение к уровню 1390 п. по ММВБ. Фьючерс РТС опустившись ниже отметки 140 тыс. п. может продолжить движение до уровня 135 тыс. п. При подходе рынка к этим точкам покупатели могут опять показать свою силу, и опять в ликвидных бумагах. Не думаю, что биржевые «быки» не попытаются взять реванш во второй половине недели.

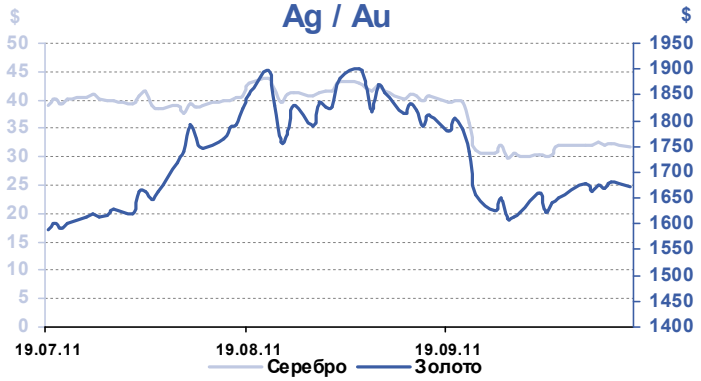
Большой блок статистики по Европе и США выходящий сегодня, а также масса квартальных отчетов крупнейших американских компаний говорят о том, что биржевые торги во вторник будут волатильными.

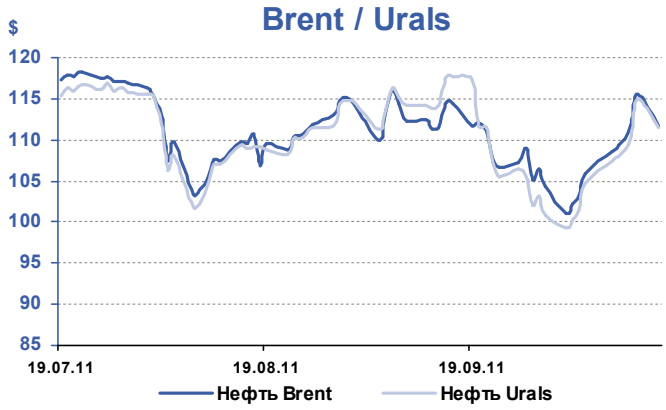
Commodities

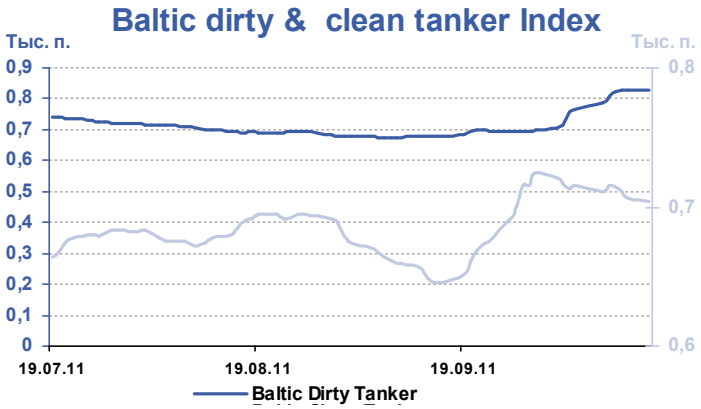












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 495,00	-0,66%	0,00%	-13,81%	-11,23%
Цинк, $/t	1 905,00	-1,35%	-2,33%	-11,76%	-21,44%
Никель, $/t	18 975,00	0,53%	-2,09%	-11,79%	-20,31%
Олово, $/t	21 495,00	-1,40%	-6,75%	-6,95%	-19,34%
Алюминий, $/t	2 216,00	-0,40%	-1,90%	-6,89%	-8,05%
Свинец, $/t	1 985,50	-2,00%	-0,97%	-16,05%	-18,54%
Серебро, $/oz	31,80	-1,25%	-0,93%	-21,87%	30,74%
Золото, $/oz	1 670,85	-0,59%	-0,34%	-7,78%	22,10%
Нефть Brent, $/	111,68	-3,31%	2,81%	-2,36%	33,70%
Нефть Urals, $/	111,47	-2,99%	3,70%	-5,21%	35,30%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1340,000	0,00%	0,00%	13 400		2 301
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,500	0,00%	0,00%	25 000		37 492
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	48,500	0,00%	0,00%	48 375		8 253
Газпром	GAZP	5,430	3,63%	0,00%	135 750		128 547
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	12,150	0,00%	0,00%	1 831 700		36 891
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	0,00%	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	0,074		0,00%	31 843		4 691
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
ТГК-6	TGKF	0,000		0,00%	86 312		484
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
КАМАЗ	KMAZ	1,220	0,00%	0,00%	12 200		863
Кировский завод	KIRZ	4,000	0,00%	0,00%	5 000		43
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,500	0,00%	0,00%	10 500		84
Силовые машины	SILM	0,195	0,00%	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	0,00%	0,00%	212 000		40 413
Полиметалл	PMTL	15,700	1,29%	0,00%	78 500		6 270
Полюс Золото	PLZL	59,000	0,00%	0,00%	17 700		11 247
Северсталь	CHMF	12,596	0,00%	0,00%	30 544		12 693
ТМК	TRMK	2,100	0,00%	0,00%	16 800		1 969
ЧМЗ	CHMZ	6,300	0,80%	0,00%	5 103		99
ЧТПЗ	CHEP	2,800	-20,00%	0,00%	14 000		1 323
Банки							
Возрождение	VZRZ	24,000	0,00%	0,00%	12 000		570
Сбербанк	SBER	2,665	4,72%	0,00%	2 160 000		57 529
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,530	0,00%	0,00%	201 050		1 699
Дальневосточное МП	FESH	0,235	0,00%	0,00%	70 500		694
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,650	0,00%	0,00%	5 001		252
Верофарм	VRPH	29,500	9,26%	0,00%	29 500		295

Дикси	DIXY	7,030	0,00%	0,00%	70 300		877
Концерн Калина	KLNA	116,165	70,88%	0,00%	348 912		748
Магнит	MGNT	93,000	9,93%	0,00%	137 000		8 186
Разгуляй	GRAZ	1,000	0,00%	0,00%	47 430		157
Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
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	38,340	0,00%	0,00%	34 889		1 828
Дорогобуж	DGBZ	0,500	0,00%	0,00%	50 000		361
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	0,00%	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	120,660	-0,41%	
Башнефть	AK6		EUR	175,000	1,74%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,420	5,00%	4,35
ТГК-3	AOMD		USD	6,375	2,82%	5,29
Татнефть	ATAD		USD	26,480	-1,78%	12 346,20
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,610	8,70%	0,52
Бурятзолото	BYT		EUR	18,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	18,350	-2,13%	59 715,37
X5	FIVE		USD	23,490	5,48%	45 933,80
Газпром	GAZ		EUR	7,436	-2,68%	2 252,64
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,016	-46,67%	0,39
Иркутскэнерго	IRK		EUR	20,200	-1,46%	10,42
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,140	-12,78%	0,63
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,510	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	54,200	-1,45%	163 494,40
Лукойл	LUK		EUR	39,310	-2,08%	474,95
Лукойл	LUKOY	1	USD	53,700	-3,94%	2 048,42
МТС	MBT	5	USD	14,070	-2,09%	48 951,64
МТС	MKY	5	EUR	10,110	-1,65%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,410	-3,80%	10,05
Мечел	MTL	3	USD	11,100	-6,64%	47 963,43
НорНикель	NILSY	1	USD	20,860	-4,84%	15 546,46
НорНикель	NNIA		EUR	15,100	-4,13%	1 081,05
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,300	-2,36%	51 429,43
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,900	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	10,370	-1,71%	454 496,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	27,920	-2,38%	3 529,17
Ростелеком	RTL		EUR	20,000	-4,31%	2,05
Газпромнефть	SCF		EUR	13,405	0,37%	119,96
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,712	-4,39%	3,53
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,302	-2,10%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,500	-4,86%	167,88
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,900	-5,84%	103,90
АФКСистема	SSA	1	USD	17,900	2,87%	27 308,64
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,828	-5,74%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	17,850	-5,25%	
СТЗ	SVY		EUR	27,720	-8,01%	
ЦУМ	THT		EUR	12,500	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	235,000	3,98%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	9,940	-2,17%	28 398,45
ВТБ	VTBR		USD	4,246	-1,48%	62 713,46
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.