ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

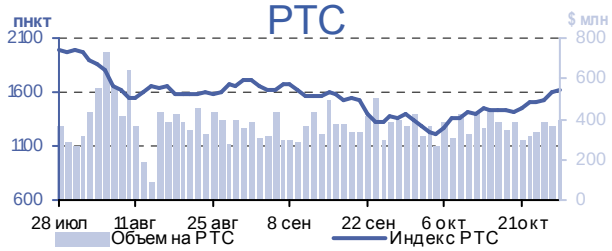
1 ноября 2011г.

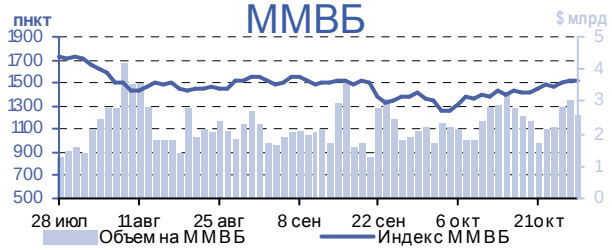
Комментарий по рынку акций

Вчера фондовые индексы США показали серьезное снижение. Эйфория в части быстрого разрешения долгового кризиса в Европе сошла на нет. Европейские долговые бумаги вновь начали падать в цене, что напомнило биржевым «быкам» о том, что системные проблемы в европейской экономике сохраняются. Новость о дефолте одного из крупнейших брокеров на рынке деривативов MF Global (с активами $40 млрд.) подкосило котировки в секторе акций финансовых компаний и банков. В результате индекс S&P-500 вчера завершил торги на минимальных дневных уровнях, тем не менее, сохранив позиции в границах восходящего тренда.

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





Голубые фишки (ММВБ)

Значение основных индексов

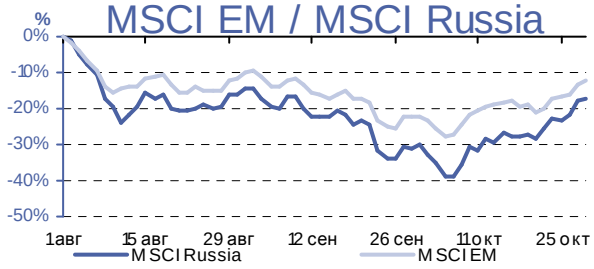
	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 610,32	1,09%	10,54%	20,08%	1,70%
Индекс ММВБ	1 526,57	0,07%	5,50%	11,71%	1,33%
FTSE	5 702,24	-0,20%	3,89%	11,19%	0,43%
S&P 500	1 285,09	0,04%	3,78%	13,58%	8,56%
Dow Jones Avg.	12 231,11	0,18%	3,58%	12,07%	10,05%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Возрождение	26,5000	10,42%	-11,67%	-40,78%
ОАО АРМАДА	10,2000	10,19%	-27,14%	-12,07%
ГАЗ	32,0000	6,67%	6,67%	-13,51%
Фармстандарт	71,6000	5,29%	-24,63%	-28,76%
ТГК-6	0,0003	3,85%	3,85%	-50,00%
Газпром	6,3000	2,69%	35,48%	-1,15%
Разгуляй	1,1900	0,85%	32,22%	-19,59%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,8650	-0,69%	30,82%	-15,91%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1010,12	1,64%	14,73%	-8,41%
Индекс MSCI BRAZIL	3159,39	2,59%	20,31%	-13,67%
Индекс MSCI RUSSIA	858,29	0,86%	23,57%	2,71%
Индекс MSCI INDIA	441,14	4,76%	8,89%	-20,16%
Индекс MSCI CHINA	56,94	0,58%	16,46%	-16,98%

Обзор рынка

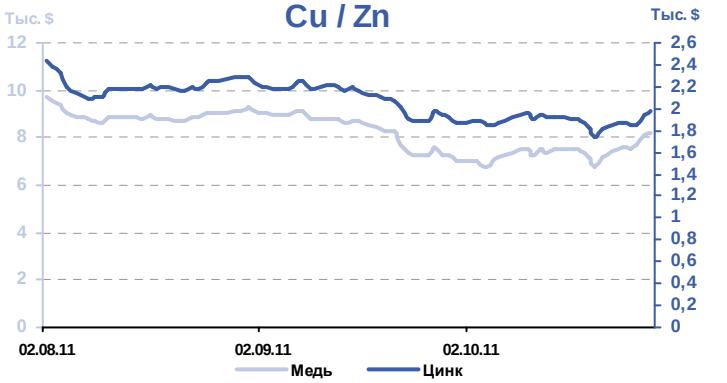
Вчера фондовые индексы США показали серьезное снижение. Эйфория в части быстрого разрешения долгового кризиса в Европе сошла на нет. Европейские долговые бумаги вновь начали падать в цене, что напомнило биржевым «быкам» о том, что системные проблемы в европейской экономике сохраняются. Новость о дефолте одного из крупнейших брокеров на рынке деривативов MF Global (с активами $40 млрд.) подкосило котировки в секторе акций финансовых компаний и банков. В результате индекс S&P-500 вчера завершил торги на минимальных дневных уровнях, тем не менее, сохранив позиции в границах восходящего тренда.

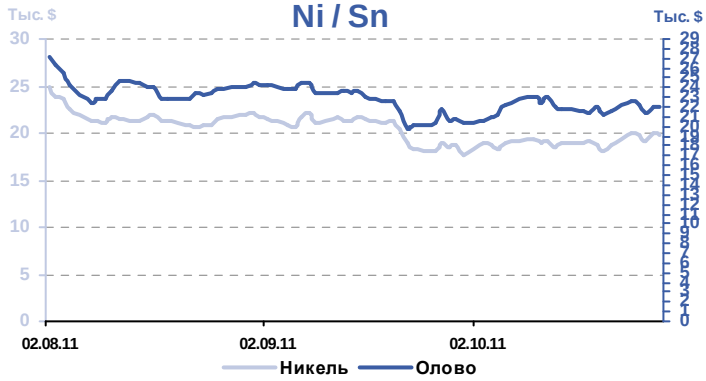
Вчера мы стали свидетелями сильнейшего падения курса евро. Во-первых, переговоры по расширению капитала Европейского фонда финансовой стабильности за счет Китая зашли в тупик. Во-вторых, давление на единую валюту усилилось в связи с перспективами референдума Греции. Население этой южной страны должно решить, стоит ли в обмен на жесткие меры по сокращению бюджетных расходов принимать списание 100 млрд. евро греческих обязательств перед частными организациями и дополнительные кредиты от МВФ. К утру вторника пара EUR/USD опустилась к отметке 1,38. Это в свою очередь, вызвало падение цен на рынках сырьевых товаров: Brent $108/барр; медь -1,1%; никель -0,9%.

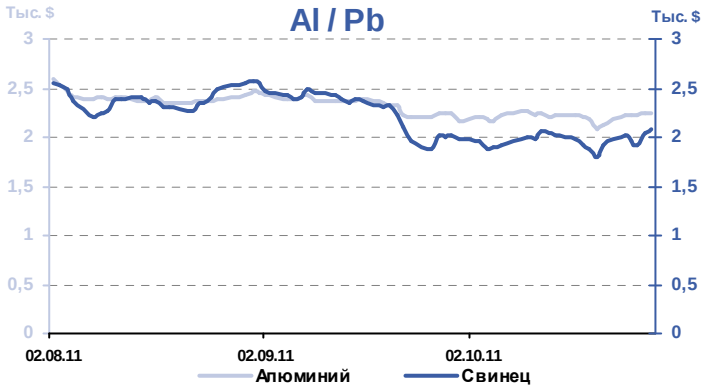
Сегодня утром вышли статданные по Китаю за октябрь показавшие, что текущая экономическая активность очень невысока: индекс производственной активности PMI (CFLP) снизился до 50,4 п. против прогноза 51,8 п., при этом экспортные заказы ушли в зону сокращения 48,6 п., а компонента новых заказов опустилась до 50,5 п. – минимум с февраля 2009 г. Эти результаты настраивают инвесторов на дальнейшее замедление китайского экономического роста в 4-м кв.

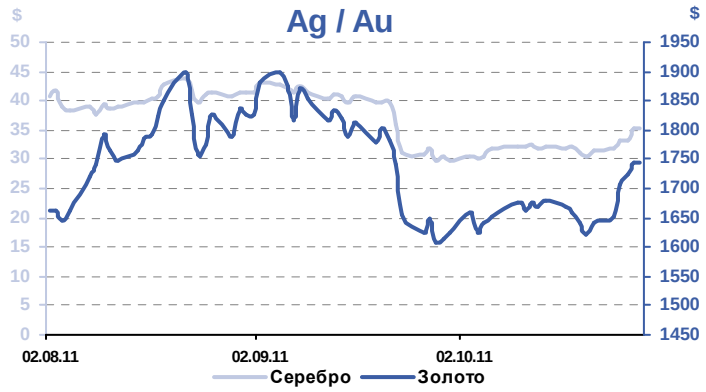
Открытие торгов на российских биржах во вторник мы ожидаем увидеть с гэпом вниз около процента. Фьючерс РТС сломает свою растущую формацию, если он уйдет ниже отметки 150 тыс. п. Ближайший сильный уровень поддержку по индексу ММВБ находится возле уровня 1475 п. С учетом того, что ни в западных индексах, ни в наших растущий тренд пока не сломан, «быки» постараются удержать рынок выше этих отметок. Тем более, что вчерашние торги показали нежелание инвесторов расставаться с недавно купленными бумагами, а значит, новые покупки возможно не за горами. Сырьевые компании и банки сегодня будут смотреться хуже рынка. Вчера вечером Совет директоров Ростелекома одобрил buyback на сумму до $500 млн., что должно поддержать котировки акций компании. Сегодня же на срочном рынке возобновляются торги поставочными фьючерсными контрактами на обыкновенные акции Ростелекома

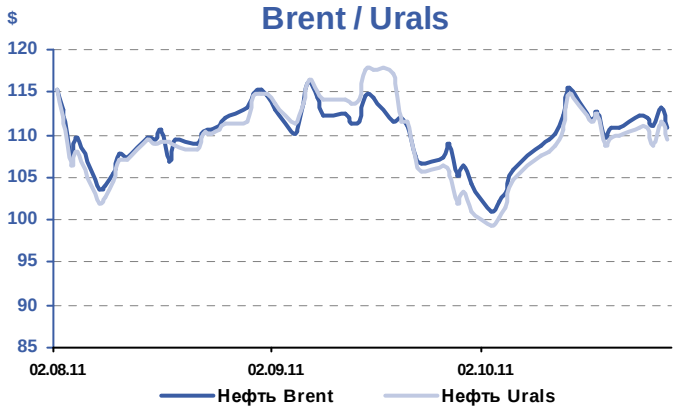
Commodities

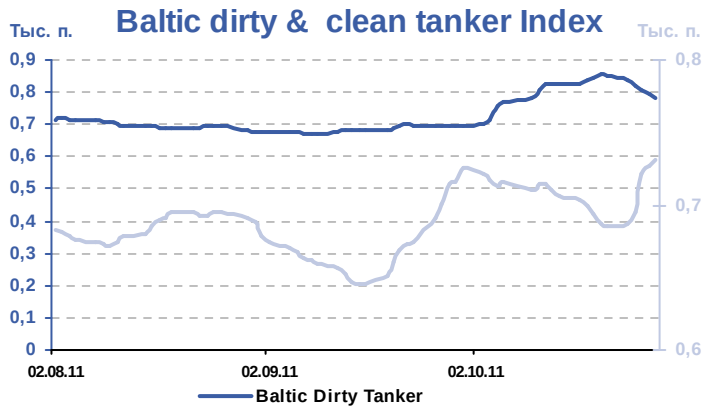












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 175,00	0,37%	14,42%	16,48%	-1,98%
Цинк, $/t	1 985,00	2,06%	9,97%	6,72%	-20,41%
Никель, $/t	19 700,00	-1,01%	4,79%	11,93%	-14,72%
Олово, $/t	22 100,00	0,23%	1,96%	8,60%	-15,81%
Алюминий, $/t	2 242,00	-0,58%	5,51%	3,94%	-4,47%
Свинец, $/t	2 090,00	2,45%	9,14%	5,29%	-16,58%
Серебро, $/oz	35,32	0,62%	12,54%	18,02%	47,27%
Золото, $/oz	1 743,75	-0,06%	6,17%	7,38%	29,74%
Нефть Brent, $/	110,83	-2,13%	0,05%	6,30%	34,26%
Нефть Urals, $/	109,53	-1,90%	-0,27%	8,54%	34,99%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлур	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	53,000	0,00%	0,00%	79 375		9 019
Газпром	GAZP	6,300	2,69%	0,00%	157 500		149 143
Газпромнефть	SIBN	3,250	0,00%	0,00%	65 000		15 409
Лукойл	LKOH	57,400	0,00%	0,00%	287 000		48 822
НОВАТЭК	NVTK	12,920	0,00%	0,00%	5 167 000		39 229
Роснефть	ROSN	7,050	0,00%	0,00%	211 500		74 717
Татнефть	TATN	4,450	0,00%	0,00%	89 000		9 695
Транснефть, п.	TRNFP	976,000	0,00%	0,00%	9 760		1 518
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,600	0,00%	0,00%	59 000		2 860
Ленэнерго	LSNG	0,426	0,00%	0,00%	131 317		395
МОЭСК	MSRS	0,049	0,00%	0,00%	12 388		2 401
ОГК-2	OGKB	0,029	0,00%	0,00%	14 500		949
ОГК-4	OGKD	0,074	0,00%	0,00%	31 843		4 691
ОГК-5	OGKE	0,065	0,00%	0,00%	32 500		2 299
ТГК-6	TGKF	0,000	3,85%	0,00%	85 723		503
Телекоммуникации							
Ростелеком	RTKM	4,866	0,00%	0,00%	7 523		14 322
Ростелеком, п.	RTKMP	2,994	0,00%	0,00%	8 981		727
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%	5 880		109
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	32,000	6,67%	0,00%	4 832		593
КАМАЗ	KMAZ	1,220	0,00%	0,00%	12 200		863
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,500	0,00%	0,00%	10 500		84
Силовые машины	SILM	0,205	0,00%	0,00%	205 000		1 785
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	142,170	0,00%	0,00%	92 411		1 639
Мечел	MTLR	12,900	0,00%	0,00%	6 450		5 370
ММК	MAGN	0,480	0,00%	0,00%	334 750		5 364
НЛМК	NLMK	2,765		0,00%	414 750		16 571
НорНикель	GMKN	205,000	0,00%	0,00%	205 000		39 079
Полиметалл	PMTL	16,395	0,00%	0,00%	57 448		6 548
Полюс Золото	PLZL	59,000	0,00%	0,00%	17 700		11 247
Северсталь	CHMF	12,420	0,00%	0,00%	38 128		12 516
ТМК	TRMK	2,960	0,00%	0,00%	236 800		2 775
ЧМЗ	CHMZ	6,300	0,00%	0,00%	5 103		99
ЧТПЗ	CHEP	2,800	0,00%	0,00%	14 000		1 323
Банки							
Возрождение	VZRZ	26,500	10,42%	0,00%	26 500		629
Сбербанк	SBER	2,865	-0,69%	0,00%	286 500		61 847
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,709	0,00%	0,00%	170 680		1 898
Дальневосточное МП	FESH	0,293	0,00%	0,00%	107 386		863
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	37,000	-2,06%	0,00%	18 500		5 613
Верофарм	VRPH	28,000	0,00%	0,00%	28 000		280
Дикси	DIXY	8,820	0,00%	0,00%	8 820		1 100
Концерн Калина	KLNA	114,440	0,00%	0,00%	721 532		737
Магнит	MGNT	110,000	0,00%	0,00%	243 320		9 787
Разгуляй	GRAZ	1,190	0,85%	0,00%	23 800		182
Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
Фармстандарт	PHST	71,600	5,29%	0,00%	14 100		2 683
Нефтехимия и нефтепереработка							

Казаньоргсинтез	KZOS	0,160	0,00%	0,00%	16 000		286
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,700	0,00%	0,00%	3 500		1 128
Уфанефтехим	UFNC	4,850	0,00%	0,00%	48 750		1 349
Уфаоргсинтез	UFOS	2,750	10,00%	0,00%	13 750		269
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	42,300	0,00%	0,00%	55 413		2 027
Уралкалий	URKA	7,730	0,00%	0,00%	97 398		23 922
Химпром, НЧ	HIMC	0,020	0,00%	0,00%	582		14
Уголь							
Распадская	rasp	3,480	0,00%	0,00%	207 000		2 717
УК Южный Кузбасс	UKUZ	50,300	0,00%	0,00%	239 435		1 816

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	125,000	0,20%	
Башнефть	AK6		EUR	184,000	1,10%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,440	0,00%	7,95
ТГК-3	AOMD		USD	6,450	-1,60%	11,09
Татнефть	ATAD		USD	30,980	1,94%	17 371,40
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,738	4,66%	2,10
Бурятзолото	BYT		EUR	18,250	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	18,450	0,82%	52 499,48
X5	FIVE		USD	30,000	5,82%	52 086,37
Газпром	GAZ		EUR	8,799	-1,23%	3 159,49
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,015	24,00%	0,07
Иркутскэнерго	IRK		EUR	21,500	0,00%	2,15
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	-10,45%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,800	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	59,200	0,94%	206 596,80
Лукойл	LUK		EUR	41,815	-0,82%	303,59
Лукойл	LUKOY	1	USD	59,470	-0,32%	5 580,67
МТС	MBT	5	USD	15,010	0,13%	30 033,18
МТС	MKY	5	EUR	10,505	-0,52%	
МГТС	MOW		EUR	9,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,514	-1,03%	6,69
Мечел	MTL	3	USD	14,400	3,97%	52 128,34
НорНикель	NILSY	1	USD	20,530	-2,14%	1 610,57
НорНикель	NNIA		EUR	14,430	-1,50%	412,00
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	147,000	-1,08%	183 141,70
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,900	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	12,440	0,73%	543 565,90
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	31,890	2,84%	2 053,13
Ростелеком	RTL		EUR	22,755	2,80%	4,50
Газпромнефть	SCF		EUR	14,950	-0,33%	35,02
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,210	0,44%	2,02
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,558	4,43%	4,79
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,000	2,04%	219,43
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,960	0,11%	90,03
АФКСистема	SSA	1	USD	17,700	-0,56%	12 716,42
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,167	4,16%	0,78
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,195	1,08%	
СТЗ	SVY		EUR	29,340	-6,28%	
ЦУМ	THT		EUR	12,500	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	220,000	-14,89%	5,76
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,500	-2,04%	36 245,93
ВТБ	VTBR		USD	4,948	3,08%	57 224,21
Возрождение	VZY		EUR	22,900	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.