ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

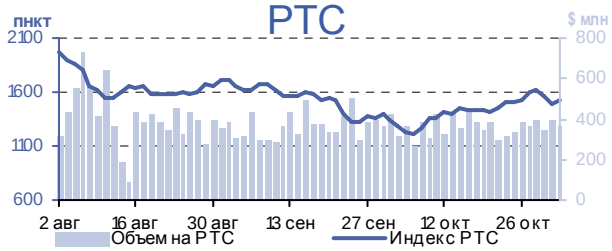
3 ноября 2011г.

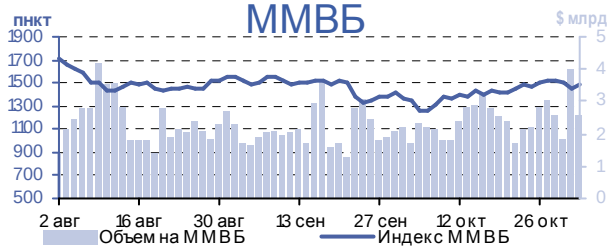
Комментарий по рынку акций

После двух дней падения, вчера фондовые рынки США восстановили часть утраченных позиций, завершив день ростом. Вышедшая вчера макростатистика удержала рынки в зеленой зоне. Согласно данным ADP уровень занятости в частном секторе в октябре вырос на 110 тыс., что оказалась лучше прогноза. По итогам заседания ФедРезерва FOMC сохранил целевую ставку по федеральным фондам на прежнем уровне 0,25%. При этом ФРС сокращает прогноз по ВВП на 2011 год с 2,7-2,9% до 1,6-1,7%, и повышает прогноз по безработице с 8,6-8,9% до 9,0-9,1%. Корректировка экономических прогнозов FOMC не оказала существенного влияния на динамику рынка, поскольку

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





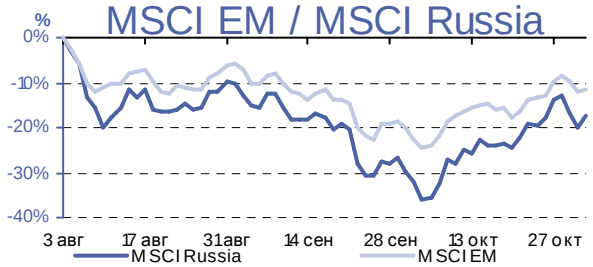
Голубые фишки (ММВБ)

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 526,19	2,78%	-0,26%	18,15%	-4,87%
Индекс ММВБ	1 488,86	2,24%	-0,73%	10,72%	-3,15%
FTSE	5 484,10	1,15%	-1,25%	8,05%	-4,75%
S&P 500	1 237,90	1,61%	-0,33%	12,62%	3,71%
Dow Jones Avg.	11 836,04	1,53%	-0,28%	11,08%	5,79%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Верофарм	32,0000	14,29%	-8,57%	-37,25%
ОАО Коршуновский ГОК	1400,0000	7,69%	-5,41%	-33,96%
ОГК-2	0,0312	7,59%	-21,01%	-48,85%
ОАО Группа ЛСР	19,4000	1,84%	23,17%	-41,03%
Башнефть	51,5000	0,98%	25,61%	16,52%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	3,0650	-8,51%	9,46%	-56,34%
Акрон	39,5000	-6,62%	7,92%	5,33%
Северсталь	14,2250	-3,15%	29,32%	-16,79%
Силовые машины	0,2000	-2,44%	-18,37%	-32,89%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	977,11	0,87%	14,65%	-13,08%
Индекс MSCI BRAZIL	2988,26	0,46%	18,78%	-20,26%
Индекс MSCI RUSSIA	817,41	3,52%	21,61%	-3,86%
Индекс MSCI INDIA	429,57	0,30%	8,60%	-24,12%
Индекс MSCI CHINA	56,05	2,44%	21,67%	-20,08%

Обзор рынка

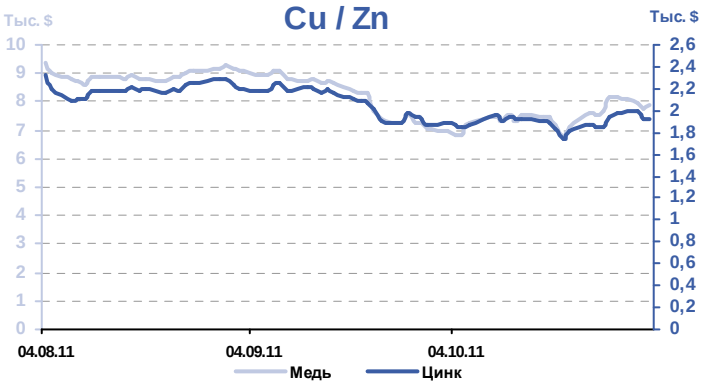
После двух дней падения, вчера фондовые рынки США восстановили часть утраченных позиций, завершив день ростом. Вышедшая вчера макростатистика удержала рынки в зеленой зоне. Согласно данным ADP уровень занятости в частном секторе в октябре вырос на 110 тыс., что оказалась лучше прогноза. По итогам заседания ФедРезерва FOMC сохранил целевую ставку по федеральным фондам на прежнем уровне 0,25%. При этом ФРС сокращает прогноз по ВВП на 2011 год с 2,7-2,9% до 1,6-1,7%, и повышает прогноз по безработице с 8,6- 8,9% до 9,0-9,1%. Корректировка экономических прогнозов FOMC не оказала существенного влияния на динамику рынка, поскольку основные проблемы неустойчивости сейчас исходят из еврозоны. В ходе своей пресс-конференции глава ФРС Бен Бернанке заявил о том, что дополнительные операции по выкупу ипотечных облигаций могут стать начаться вновь в случае ухудшения состояния американской экономики.

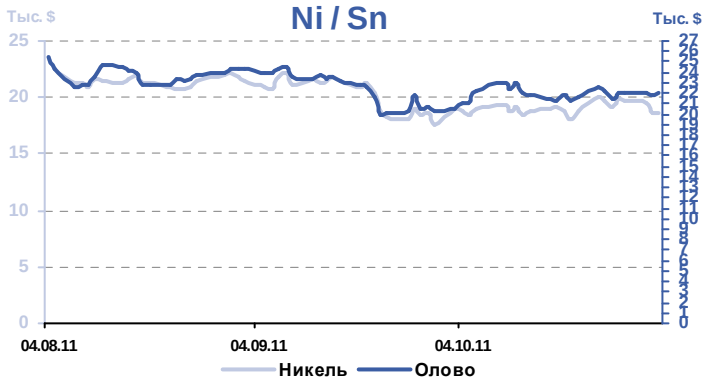
Сегодня ночью динамику фьючерсов на S&P (-1,1%) покосил очередной негатив из Европы: 4 декабря Греция проведет всенародный референдум по вопросу принятия европейскому плану спасения. Население Греции, недовольное урезанием социальных льгот может поставить страну на грань дефолта и даже вывести ее из состава еврозоны. Соответственно, выделение очередного кредитного транша в 8 млрд. евро пока отложено до окончания референдума. На этом фоне основные индикаторы кредитных рынков указывают на приближение «идеального шторма».

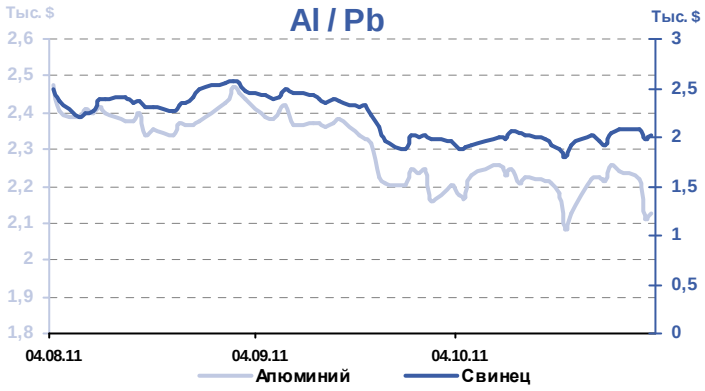
В четверг открытие торгов на наших биржах мы ожидаем увидеть в красной зоне. За последние сутки 15-минутный график индекса ММВБ сформировал треугольник, с верхней границей на 1490 п., и нижней на 1475 п. Если бы не негативный внешний фон, сегодня мы наверняка увидели прорыв вверх. Но, увы. Реакция в Европе на последние новости по Греции будет негативной. Неприятие риска окажет давление на товарный рынок и котировки акций. Индекс ММВБ может протестировать свой недавний минимум на 1440 п. В этой ситуации болтанку котировок вверх-вниз стоит воспринимать, как непременный атрибут этой осени. Что-то подобное можно было наблюдать у нас на рынке в середине октября. От агрессивных продаж нас удержат довольно высокие цены на нефть (Brent $108,7/барр) и желание местных инвестфондов видеть к концу года фондовые индексы выше.

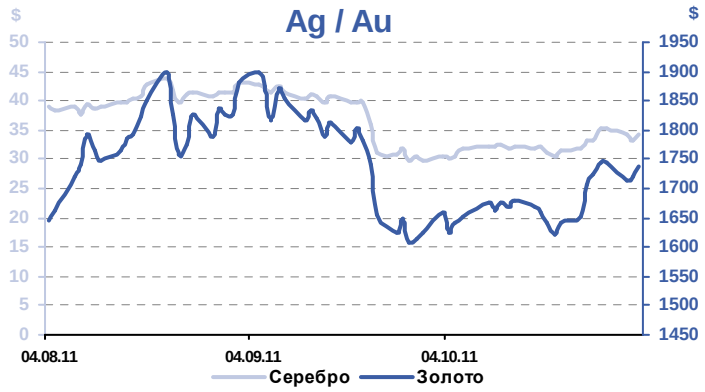
Сегодня в 17-30 ждем блока статистики из США по количеству обращений за пособием по безработице, уровню производительности труда в непроизводственном секторе на 3 квартал. В 16-45 свое решение по ставке озвучит ЕЦБ. В 17-30 начнется пресс-конференция главы ЕЦБ Марио Драги. В 18-00 в Штатах выходит индекс деловой активности в непроизводственном секторе (ISM Non-Manufacturing) за октябрь, а также данные по объему промышленных заказов за сентябрь

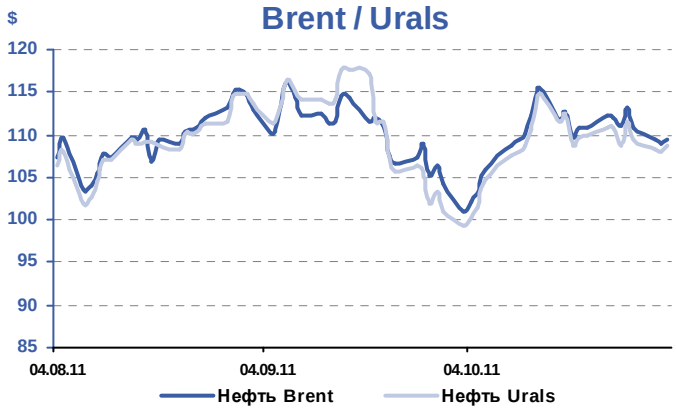
Commodities

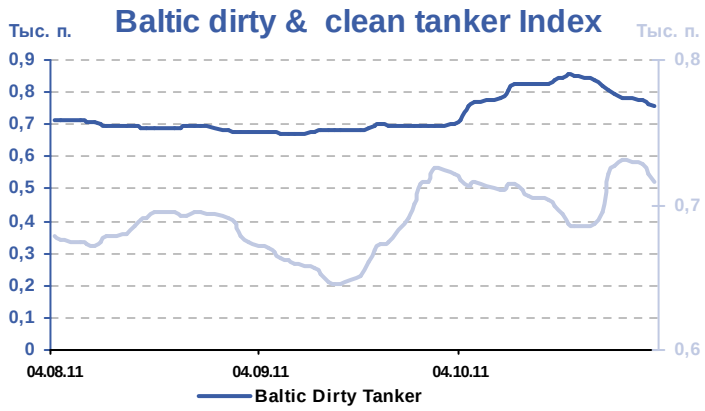












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 885,00	2,01%	2,67%	12,80%	-6,52%
Цинк, $/t	1 927,00	0,68%	3,88%	1,80%	-21,44%
Никель, $/t	18 580,00	-0,11%	-2,85%	-2,34%	-20,85%
Олово, $/t	22 000,00	1,03%	2,92%	7,32%	-14,73%
Алюминий, $/t	2 127,00	0,76%	-3,97%	-3,45%	-12,47%
Свинец, $/t	2 024,00	2,12%	5,20%	3,21%	-18,71%
Серебро, $/oz	34,27	2,86%	2,64%	12,69%	37,59%
Золото, $/oz	1 738,60	1,09%	0,80%	4,84%	28,08%
Нефть Brent, $/	109,53	0,57%	-1,40%	8,37%	28,12%
Нефть Urals, $/	108,70	0,72%	-0,05%	9,48%	29,40%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1290,000	0,00%	0,00%	12 900		2 215
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,066		0,00%	17 132		66
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,650	0,00%	0,00%	26 500		39 742
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,500	0,98%	0,00%	66 950		8 764
Газпром	GAZP	5,600	0,00%	0,00%	140 000		132 572
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	0,031	7,59%	0,00%	31 200		1 021
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	0,00%	0,00%	85 723		503
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	6,200	0,00%	0,00%	31 000		12 812
Ростелеком	RTKM	4,866	0,00%	0,00%	7 523		14 322
Ростелеком, п.	RTKMP	3,250	0,00%	0,00%	5 070		765
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%	5 880		109
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	32,000	0,00%	0,00%	4 832		593
Красный Котельщик	KRKO	0,300		0,00%	6 000		64
Нефтекамский автозавод	nfaz	10,500	0,00%	0,00%	10 500		84
Силовые машины	SILM	0,200	-2,44%	0,00%	10 000		1 742
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%	0,00%	414 750		16 571
НорНикель	GMKN	191,000	0,00%	0,00%	191 000		36 410
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	14,225	-3,15%	0,00%	45 458		14 335
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	0,00%	0,00%	26 500		629
Сбербанк	SBER	2,500	0,00%	0,00%	1 796 500		53 967
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,840	0,00%	0,00%	89 056		2 044
Дальневосточное МП	FESH	0,290	0,00%	0,00%	14 500		856
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	37,000	0,00%	0,00%	18 500		5 613
Верофарм	VRPH	32,000	14,29%	0,00%	5 120		320
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	1,110	0,00%	0,00%	37 774		175
Седьмой континент	SCON	4,200	0,00%	0,00%	6 300		315
Фармстандарт	PHST	66,800	0,00%	0,00%	57 434		2 525

Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,160	0,00%	0,00%	16 000		286
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,764	0,00%	0,00%	84 070		1 231
Уфанефтехим	UFNC	4,950	0,00%	0,00%	124 250		1 363
Уфаоргсинтез	UFOS	2,700	0,00%	0,00%	40 500		264
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	110,000	0,00%	0,00%	5 500		156
ПИК	pikk	2,839	0,00%	0,00%	5 002		1 400
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,500	-6,62%	0,00%	29 625		1 884
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	3,065	-8,51%	0,00%	75 522		2 393
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	124,180	-0,59%	
Башнефть	AK6		EUR	181,500	5,87%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,420	31,25%	5,77
ТГК-3	AOMD		USD	6,400	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	30,500	7,58%	17 702,06
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,650	0,00%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	16,450	1,98%	20 374,03
X5	FIVE		USD	27,720	4,21%	22 662,94
Газпром	GAZ		EUR	8,639	3,78%	1 452,60
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,013	0,00%	0,00
Иркутскэнерго	IRK		EUR	22,000	6,02%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	-1,64%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,700	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,800	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,500	1,68%	187 884,70
Лукойл	LUK		EUR	41,830	0,86%	296,73
Лукойл	LUKOY	1	USD	57,650	2,80%	4 768,09
МТС	MBT	5	USD	14,030	2,04%	24 738,68
МТС	MKY	5	EUR	10,145	0,20%	
МГТС	MOW		EUR	9,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,525	1,03%	
Мечел	MTL	3	USD	12,620	4,64%	37 841,45
НорНикель	NILSY	1	USD	18,110	-1,20%	4 307,06
НорНикель	NNIA		EUR	13,195	-1,35%	346,72
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	141,000	1,81%	61 316,47
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,600	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,790	-1,86%	
Газпром	OGZD		USD	11,900	4,85%	552 950,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	31,490	0,93%	2 175,33
Ростелеком	RTL		EUR	22,750	2,82%	10,45
Газпромнефть	SCF		EUR	14,600	-1,28%	160,21
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,297	4,12%	2,66
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,595	1,13%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,910	2,29%	61,37
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,750	4,79%	123,61
АФКСистема	SSA	1	USD	17,150	1,12%	3 155,57
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,348	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	18,290	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	26,580	-3,19%	
ЦУМ	THT		EUR	12,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	208,190	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,890	3,03%	19 624,27
ВТБ	VTBR		USD	4,724	2,70%	32 769,27
Возрождение	VZY		EUR	23,700	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.