

Комментарий по рынку акций

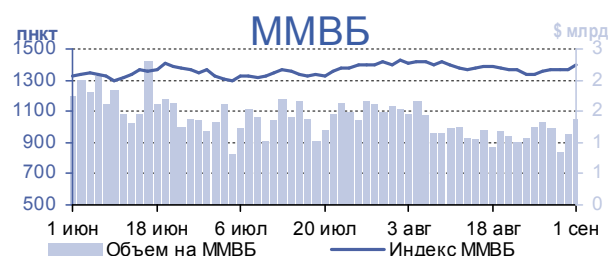
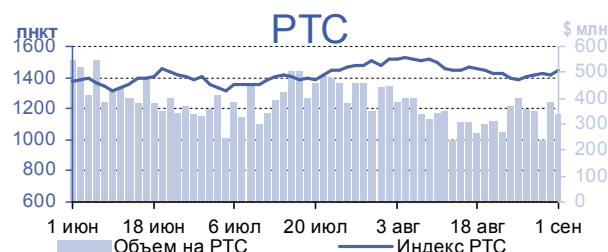
Основные индикаторы

В среду американские фондовые индексы завершили торги самым сильным дневным ростом за последние 8 недель, взлетев на 2,5-3%. Серьезно улучшила настроения инвесторов макростатистика, которая показала рост индекса деловой активности (ISM) в производственном секторе США в августе до 56,3% п. против 55,5% в июле (прогноз 53,2 п.). Эти данные лишь усилили рост на рынке, который уже вчера с утра имел большую тягу к росту. Видимо поэтому игроки проигнорировали отчет компании ADP, показавшей сокращение числа рабочих мест в частном секторе США в августе на -10 тыс. (прогноз + 20 тыс.). На

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс PTC	1 449,99	2,03%	4,63%	-4,80%	35,06%
Индекс MMBБ	1 394,57	1,88%	4,49%	-2,43%	26,21%
FTSE	5 366,41	2,70%	5,03%	-0,57%	11,34%
S&P 500	1 080,29	2,95%	2,37%	-4,05%	8,24%
Dow Jones Avg.	10 269,47	2,54%	2,08%	-3,79%	10,30%



Голубые фишки (MMBБ)

Лидеры роста

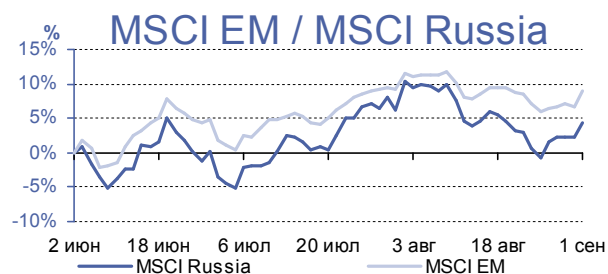
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Полиметалл	12,6000	4,13%	-2,33%	41,57%
Аэрофлот	2,0500	3,54%	0,24%	41,38%
Сбербанк	2,6000	2,77%	-10,03%	15,56%
НорНикель	172,5000	2,68%	2,68%	30,68%
Роснефть	6,4500	1,90%	-5,91%	-16,23%
Северсталь	12,2500	0,28%	0,16%	63,33%
Башнефть, п.	29,7500	0,24%	12,26%	310,34%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Транснефть, п.	1077,0000	-6,35%	-6,35%	23,79%
Газпром	5,2500	-2,60%	-6,75%	-13,22%
МТС	8,0800	-1,70%	0,37%	13,64%
Акрон	28,5000	-0,87%	0,00%	-1,72%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	989,76	2,03%	-2,29%	17,53%
Индекс MSCI BRAZIL	3444,26	3,77%	-2,03%	24,23%
Индекс MSCI RUSSIA	772,47	2,19%	-5,36%	23,30%
Индекс MSCI INDIA	481,39	1,94%	-1,00%	24,16%
Индекс MSCI CHINA	61,11	0,67%	-4,11%	6,82%



Обзор рынка

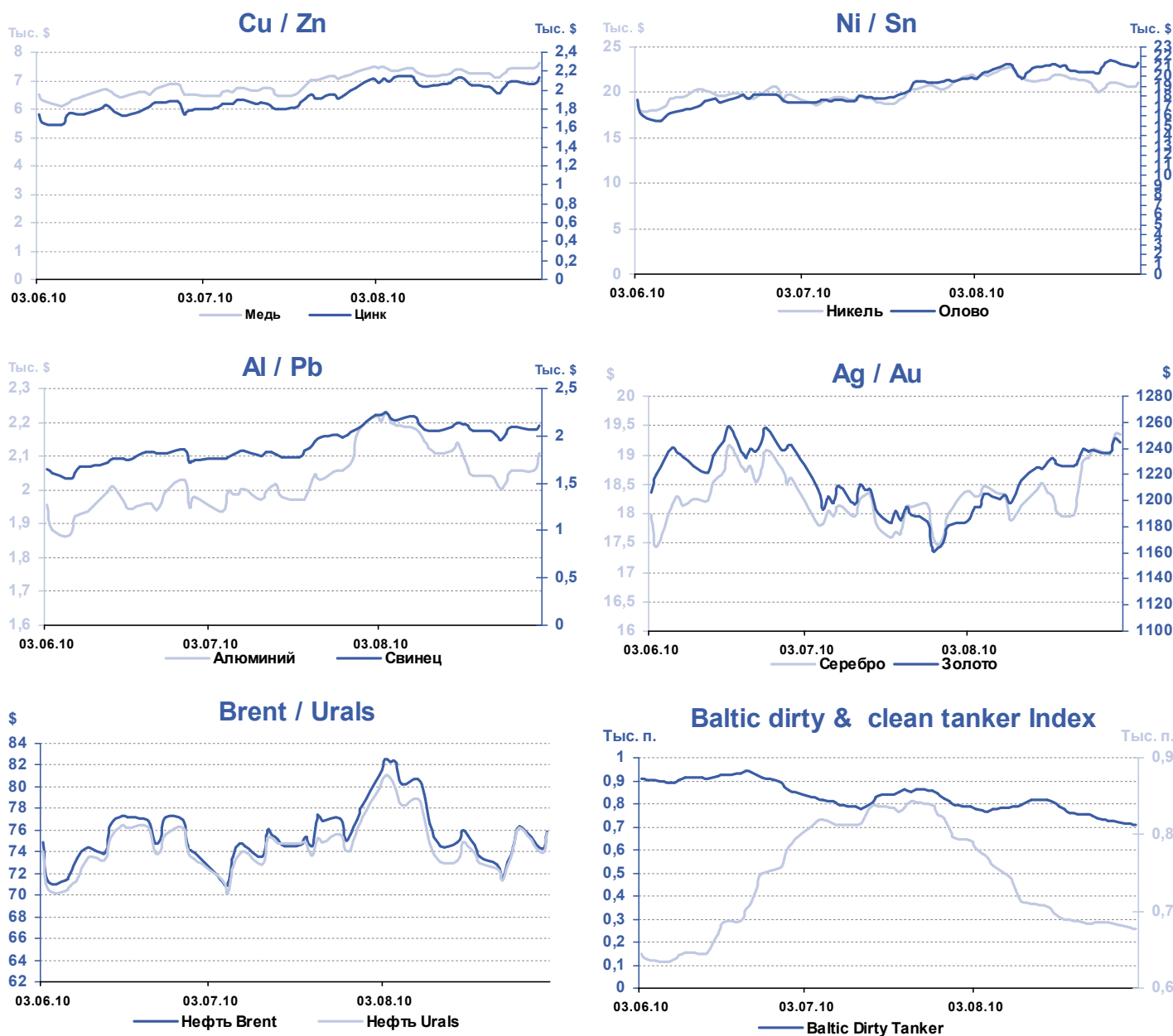
В среду американские фондовые индексы завершили торги самым сильным дневным ростом за последние 8 недель, взлетев на 2,5-3%. Серьезно улучшила настроения инвесторов макростатистика, которая показала рост индекса деловой активности (ISM) в производственном секторе США в августе до 56,3% п. против 55,5% в июле (прогноз 53,2 п.). Эти данные лишь усилили рост на рынке, который уже вчера с утра имел большую тягу к росту. Видимо поэтому игроки проигнорировали отчёт компании ADP, показавшей сокращение числа рабочих мест в частном секторе США в августе на -10 тыс. (прогноз + 20 тыс.). Не радует и падение продаж автомобилей на внутреннем рынке США до 11,47 млн. против 14 млн. в августе 2009 г. Тем не менее, индекс S&P-500 вчера закрылся выше 14-дневной скользящей средней, преодолев сопротивление на уровне 1068 п., а в лидерах роста были бумаги финансового, производственного и нефтяного секторов.

Пара EUR/USD вчера совершила агрессивный забег вверх, преодолев планку 1,28. После непродолжительной консолидации курс единой европейской валюты может пойти выше, в диапазон 1,29-1,2925. Цены на нефть вчера поднялись вслед за фондовыми биржами к максимальным недельным уровням (Brent \$76,7/барр). Однако преодолеть эту довольно низкую планку котировкам «черного золота» пока оказалось не под силу. Сегодняшние торги в Азии проходят сейчас в умеренно позитивной зоне: MSCI Asia +0,8%. Фьючерсы на американские индексы корректируются: S&P -0,37%.

Открытие торгов на российских биржах в четверг мы увидим в нейтральной зоне. После сильного вчерашнего роста, сегодня рынок может войти в фазу консолидации и частичной фиксации прибыли. В целом позитив на мировых рынках сохранится как минимум до вечера пятницы, поэтому, думаю, стоит держать длинные позиции в бумагах, купленных ранее (Сбербанк, ВТБ, Газпром). Индекс ММВБ, сумев вчера преодолеть сильное сопротивление на 1380 п., в ближайшие дни будет биться за отметку 1400 п.

Сегодня в 13-00 выходят данные по ВВП еврозоны за 2-й квартал (прогноз: +1% к/к; 1,7% г/г), в это же время публикуются данные по индексу производственных цен за июль (прогноз: +0,3% м/м). В 15-45 свое решение по ставке объявит ЕЦБ (прогноз: 1,0%). В 16-30 начнется традиционная пресс-конференция главы ЕЦБ, которая может носить довольно жесткий характер. Ж.-К. Трише может подтвердить приоритет сокращения госдолга и госрасходов в еврозоне. В 16-30 выходит отчёт по числу обращений за пособием по безработице в США. (прогноз: 476 тыс.). В этом же время будет опубликован отчёт по производительности труда и стоимости затрат на единицу рабочего места за II квартал. В 18-00 изучаем отчёт по объёму производственных заказов в США за июль (прогноз: +0,4%). В это же время выходят данные по индексу незавершённых продаж на вторичном рынке недвижимости в США (прогноз: -1,3%).

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	7 606,00	2,23%	7,11%	1,28%	22,68%
Цинк, \$/t	2 133,00	3,29%	8,60%	0,52%	15,05%
Никель, \$/t	21 050,00	1,69%	4,78%	-4,10%	15,34%
Олово, \$/t	21 450,00	2,14%	5,41%	7,90%	56,57%
Алюминий, \$/t	2 108,00	2,43%	5,24%	-4,92%	14,25%
Свинец, \$/t	2 115,00	2,17%	7,85%	-4,47%	1,88%
Серебро, \$/oz	19,36	0,04%	2,37%	5,40%	28,88%
Золото, \$/oz	1 244,30	-0,25%	0,34%	5,20%	30,11%
Нефть Brent, \$/	75,85	2,07%	3,78%	-6,51%	11,53%
Нефть Urals, \$/	75,71	2,42%	4,17%	-5,15%	13,53%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, т\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,404	0,00%	0,00%		15 930	201
БашИнСв	BISV	0,137	0,00%	0,00%		834	130
БашЭнрг	BEGY	1,530	0,00%	0,00%		9 955	1 583
ВМЗ	VSMZ	1373,680	0,00%	0,00%		67 153	2 354
ДВМП	FESH	0,391	0,00%	0,00%		20 548	1 156
КазанскВЗ	KHEL	1,743	0,00%	0,00%		15 948	270
КОМСТАР	CMST	6,607	0,00%	0,00%		9 889	2 753
Мечел	MTLR	22,719	0,00%	0,00%		808 983	9 429
Мотовил	MOTZ	0,091	0,00%	0,00%		13 572	90
Новсибэнрг	NVNG	30,589	0,00%	0,00%		31	414
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1400,000	0,00%	0,00%	7 000		2 404
СилМашины	SILM	0,232	0,00%	0,00%		103 033	2 011
Сильвинит	SILV	656,983	0,00%	0,00%		4 013 498	5 138
СинТЗ-ао	SNTZ	65,095	0,00%	0,00%		130	410
Славн-ЯНОС	JNOS	0,475	0,00%	0,00%		38 004	443
СТЗ-ао	SVTZ	5,940	0,00%	0,00%		659	286
ТАГМЕТ	TAMZ	0,690	0,00%	0,00%		8 207	366
У-УАЗ	UUAZ	1,278	0,00%	0,00%		4 922	346
ЧМК	CHMK	259,414	0,00%	0,00%		128 068	826
ЧТПЗ	CHPZ	1,613	0,00%	0,00%		62 153	764
ЮжКузб.	UKUZ	43,938	0,00%	0,00%		1 927	1 582

Нефть и газ

Башнефть	BANE	37,250	0,00%	0,00%	74 064		6 339
Газпром	GAZP	5,175	-2,60%	0,00%	131 250	165 043 786	122 938
Газпромнефть	SIBN	3,790	0,00%	0,00%	18 950	1 677 675	17 970
Лукойл	LKOH	53,000	0,00%	0,00%	132 500	39 570 292	45 080
Роснефть	ROSN	6,379	1,90%	0,00%	64 500	33 065 209	68 079
Сургутнефтегаз	SNGS	0,921	0,00%	0,00%	92 000	8 144 049	33 045
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,418	0,00%	0,00%	10 450	3 404 470	3 219
Транснефть, п.	TRNFP	1078,089	-6,35%	0,00%	969 300	18 625 693	1 688

Электроэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,600	0,00%	0,00%	80 000		1 668
Иркутскэнерго	IRGZ	0,700	0,00%	0,00%	35 000	539 920	3 310
Ленэнерго	LSNG	0,731	0,00%	0,00%	14 620	11 274	677
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	0,00%	142 851	151 109	2 319
ОГК-2	OGKB	0,050	0,00%	0,00%	6 188		1 620
ОГК-3	OGKC	0,050	0,00%	0,00%	6 188	2 175 259	2 351
ОГК-4	OGKD	0,075	0,00%	0,00%	5 222		4 703
ОГК-5	OGKE	0,083	0,84%	0,00%	42 000	123 538	2 938
ТГК-3	MSGN	0,098	0,00%	0,00%	5 018	293 352	3 911
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	0,00%	4 625	35 960	664
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	153 445	102 854	894

Телекоммуникации

ВолгаТелеком	NNSI	3,378	0,82%	0,00%	675 520		831
МТС	MTSS	8,080	-1,70%	0,00%	1 050 400		16 106
Ростелеком	RTKM	3,901	0,00%	0,00%		36 294 524	2 789
Ростелеком, п.	RTKMP	3,307	0,00%	0,00%		75 549 946	772
СЗТ	SPTL	0,670	0,00%	0,00%	5 025	738 466	590
СибирьТелеком	ENCO	0,059	0,00%	0,00%	5 265		703
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,00%		73 005	102
Уралсвязьинформ	URSI	0,035	0,00%	0,00%	69 600	14 542 511	1 137
ЦентрТелеком	ESMO	0,700	0,00%	0,00%	5 250		1 105

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,650	0,00%	0,00%		2 438 512	882
ГАЗ	GAZA	26,000	0,00%	0,00%	41 834		482
ИРКУТ	IRKT	0,295	0,00%	0,00%		21 204	287
Казанский ВЗ	KHEL	1,840	0,00%	0,00%	69 552		284
КАМАЗ	KMAZ	2,360	0,00%	0,00%		218 766	1 660
Красный Котельщик	KRKO	0,550	0,00%	0,00%	11 000		117

ОМЗ	OMZZ	2,208	0,00%	0,00%		11 043	77
РКК Энергия	RKKE	325,000	0,00%	0,00%	32 500	303	365
Северсталь-авто	SVAV	15,100	0,00%	0,00%	67 950	623 450	517
Силовые машины	SILM	0,230	0,00%	0,00%	51 750		2 003

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,428		0,00%	59 500		213
Бурятзолото	BRZL	22,400	0,00%	0,00%	5 600		157
ВСМПО	VSMO	94,000	0,00%	0,00%	5 640	108 568	1 084
Мечел	MTLR	22,500	0,00%	0,00%	11 250		9 366
ММК	MAGN	0,856	0,00%	0,00%		776 465	9 578
НЛМК	NLMK	3,000	0,00%	0,00%	74 250	1 257 147	17 980
НорНикель	GMKN	171,738	2,68%	0,00%	510 000	89 497 852	32 650
Полиметалл	PMTL	11,752	4,13%	0,00%	24 900	110 367	4 688
Полюс Золото	PLZL	45,200	0,00%	0,00%	5 062	1 625 078	8 616
Северсталь	CHMF	12,059	0,28%	0,00%	49 000	16 999 948	12 265
ТМК	TRMK	4,050	0,00%	0,00%	34 093	446 463	3 797

Банки

Банк Москвы	MMBM	31,767	0,00%	0,00%		5 020	5 000
Возрождение	VZRZ	35,000	0,00%	0,00%	64 410	55 727	831
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,00%	26 500	24 599 007	27 272
РОСБАНК	ROSB	3,671	0,00%	0,00%		3 237	2 736
Сбербанк	SBER	2,600	2,77%	0,00%	832 500		56 126

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	1,985	3,54%	0,00%	224 550	1 456 785	2 212
Дальневосточное МП	FESH	0,401	0,00%	0,00%	40 100		1 183
НМТП	NMTP	0,145	0,00%	0,00%	5 800	24 123	2 793
Приморское МП	PRIM	0,180	0,00%	0,00%		403	146

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	2,645	0,00%	0,00%	132 261		278
Балтика	PKBA	32,486	0,00%	0,00%		11 518	3 857
Верофарм	VRPH	38,850	0,00%	0,00%	38 850		388
Вимм-Билль-Данн	WBDF	45,500	0,00%	0,00%	4 550	13 756	2 002
Дикси	DIXY	9,878	0,00%	0,00%		6 697	852
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	0,00%	19 500	4 328	190
Красный Октябрь	KROT	10,514	0,00%	0,00%		700	96
Магнит	MGNT	103,000	0,00%	0,00%	10 300	278 251	9 164
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,110	0,00%	0,00%		13 721	18
Разгуляй	GRAZ	1,550	0,00%	0,00%	7 750	233 164	245
Фармстандарт	PHST	79,000	0,00%	0,00%	7 900	24 816	2 986
Черкизово	GCHE	22,946	0,00%	0,00%		7 912	979

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,185	0,00%	0,00%	9 259		331
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,490	0,00%	0,00%	24 500	769	790
Уфанефтехим	UFNC	4,650	0,00%	0,00%	46 500		1 280
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	38 850		490

Другие сектора

ПИК	pikk	3,550	0,00%	0,00%	5 002	484 936	1 751
РБК ИС	RBCI	1,152	0,00%	0,00%		574 149	162

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	29,342	-0,87%	0,00%	5 130	266 082	1 422
Дорогобуж	DGBZ	0,493	0,00%	0,00%		19 803	356
Сильвинит	SILV	640,000	0,00%	0,00%	32 000		5 008
Уралкалий	URKA	5,000	0,00%	0,00%	25 000	5 985 204	10 622

Уголь

Распадская	rasp	4,700	0,00%	0,00%	372 600	2 318 127	3 723
УК Южный Кузбасс	UKUZ	44,000	0,00%	0,00%	65 875		1 589

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	157,540	2,89%	
Башнефть	AK6		EUR	138,000	0,00%	6,90
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,730	-0,57%	1,63
ТГК-3	AOMD		USD	9,700	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,000	3,75%	9 786,05
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,700	17,39%	115,29
Бурятзолото	BYT		EUR	16,000	-5,88%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,018	-10,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,500	0,46%	3 077,92
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	27,270	4,72%	38 176,02
Х5	FIVE		USD	36,000	-1,10%	11 094,47
Газпром	GAZ		EUR	16,390	0,99%	603,09
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,950	4,85%	94,40
ЮТК	KUE		EUR	5,300	-10,17%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,400	0,00%	14,25
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	4,900	-3,92%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,830	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	53,700	0,75%	103 843,40
Лукойл	LUK		EUR	42,135	0,99%	487,37
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,000	2,18%	11 060,78
МТС	MBT	5	USD	21,150	1,29%	64 874,10
МТС	MKY	5	EUR	16,350	1,24%	8,84
МГТС	MOW		EUR	8,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,600	1,33%	3,04
Мечел	MTL	3	USD	24,320	6,90%	95 118,89
НорНикель	NILSY	1	USD	17,400	3,08%	1 693,29
НорНикель	NNIA		EUR	13,400	1,02%	78,19
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	74,200	1,09%	31 629,08
ВолгаТелеком	NZH		EUR	4,750	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,400	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,600	-5,51%	
Газпром	OGZD		USD	21,050	1,69%	237 852,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	23,260	-3,49%	25,84
Ростелеком	RTL		EUR	18,010	-1,58%	9,26
Газпромнефть	SCF		EUR	14,800	1,37%	6,39
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,443	2,37%	38,87
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,290	3,46%	3,42
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,270	4,40%	1 153,26
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,700	7,78%	78,64
АФКСистема	SSA	1	USD	26,400	2,52%	6 506,81
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	40,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	45,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	22,000	-12,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	26,000	-5,45%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	156,600	-0,79%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,225	0,97%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,250	1,19%	4,25
Вымпелком	VIP	1	EUR	15,200	1,67%	17 898,86
ВТБ	VTBR		USD	5,380	4,26%	39 142,54
Возрождение	VZY		EUR	27,000	1,12%	0,93
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	18,800	2,56%	7 830,45
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	14,280	0,32%	

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

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hnp@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@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.