



СОБЫТИЯ ДНЯ

- ✓ «ММК» обнародует финансовую отчетность по МСФО за I полугодие 2010 года.
- ✓ 12:30 — Национальное статуправление Великобритании опубликует данные о розничных продажах за август.
- ✓ 16:30 — Министерство труда США опубликует данные о динамике цен производителей за август.
- ✓ 16:30 — Министерство труда США обнародует данные о числе граждан, впервые обратившихся за пособием по безработице на прошлой неделе.
- ✓ 16:30 — Министерство торговли США опубликует баланс счета текущих операций за II квартал 2010 года.
- ✓ 17:00 — Министерство финансов США опубликует данные об объеме покупок нерезидентами американских активов за июль.
- ✓ 18:00 — Федеральный резервный банк Филадельфии опубликует значение индекса производственной активности в округе за сентябрь.
- ✓ Сегодня, как ожидается, FedEx, Oracle, Research In Motion Limited опубликуют финансовую отчетность за II квартал 2010 года.

КОММЕНТАРИЙ ПО РЫНКУ АКЦИЙ

Российский рынок акций. Вчера торги на российском рынке проходили под знаком высокой волатильности. На внешнем позитиве индекс ММВБ вышел к окончанию сессии «в плюс», прибавив 0,22% и достигнув 1436,38 пункта. Среди «фишек» не было единой динамики: «Газпром» (+0,53%), «Роснефть» (-1,62%), «Норильский никель» (-2,03%), «Северсталь» (-0,08%), «РусГидро» (+0,25%), «ФСК ЕЭС» (+1,10%), «Сбербанк»-ао (-0,06%). Среди ликвидных бумаг наибольшим спросом пользовались «префы» «Транснефти» (+4,05%) на новостях о предстоящем приобретении совместно с «Сумма капитал» контрольного пакета «НМТП». На ожиданиях сегодняшней публикации консолидированной отчетности «ММК» акции компании выросли на 2,93%.

Развитые рынки. На фоне слабой макростатистики из Еврозоны основные индексы региона закрылись в небольшом «минусе»: FTSE 100 (-0,21%), CAC 40 (-0,50%), DAX (-0,22%). Статданные из США оказались противоречивыми, однако информация об активизации сделок M&A поддержала американские индексы: Dow Jones (+0,44%), S&P 500 (+0,35%), NASDAQ (+0,50%).

Ожидания перед началом торгов. Сегодня утром мы ожидаем умеренно-негативной динамики котировок большинства ликвидных акций на ММВБ. Фьючерсы на американские индексы торгуются в «минусе», цены на нефть Brent также демонстрируют снижение. Давление на рынок также окажут ожидания инвесторов относительно предстоящей публикации статданных.

По прогнозам экспертов, цены производителей США выросли в августе на 0,3% относительно июля и на 3% — в годовом выражении. Количество первичных заявок на пособие по безработице, как ожидается, увеличилось на прошлой неделе на 7 тыс. — до 458 тыс. Дефицит счета текущих операций, согласно прогнозам, вырос во II квартале до 125 млрд. долл. со 109 млрд. долл. в I квартале. Кроме того, ожидается приток чистых инвестиций в активы США в июле 47,5 млрд. долл. против 44,4 млрд. долл. в июне. Значение индекса производственной активности в Филадельфии за сентябрь прогнозируется на уровне 0,3 пункта (в августе индекс упал до -7,7 пункта).



НОВОСТИ КОМПАНИЙ

СБЕРБАНК

Вчера «Сбербанк» обнародовал финансовую отчетность по РСБУ за 8 месяцев 2010 года. Чистая прибыль кредитной организации за указанный период составила 88,5 млрд. руб. против 7,4 млрд. руб. годом ранее. Таким образом, финансовые результаты банка за январь-август выросли в 12 раз.

С начала текущего года «Сбербанк» предоставил кредиты российским корпоративным заемщикам на сумму более 2,4 трлн. руб. За август корпоративный портфель кредитов банка увеличился на 96 млрд. руб., или на 2,3%, и составил на конец отчетного периода около 4,3 трлн. руб. Портфель розничных кредитов «Сбербанка» возрос с начала года на 5,2%, или на 61 млрд. руб., и составил 1,2 трлн. руб.

Доля просроченной задолженности в совокупном кредитном портфеле банка за август не изменилась и составила на 1 сентября 5,8%. По сравнению с 1 января 2010 года данный показатель увеличился на 1,4 процентного пункта. Объем созданных резервов на возможные потери по кредитам составляет 671 млрд. руб., что превышает объем просроченной задолженности более чем в 2 раза.

Источник информации: Интерфакс, данные банка.

АФК «СИСТЕМА», РУССНЕФТЬ

Вчера АФК «Система» обнародовала финансовую отчетность по US GAAP за II квартал 2010 года. Чистая прибыль корпорации за указанный период составила 144 млн. долл., что на 41,5% меньше значения данного показателя за аналогичный период прошлого года.

Консолидированная выручка АФК «Система» за отчетный период составила 6,9 млрд. долл., увеличившись на 11,5% по сравнению с I кварталом 2010 года. Операционная прибыль компании возросла за тот же период на 21,9% и составила по итогам II квартала 1,1 млрд. долл.; операционная маржа составила 16,4%. Показатель OIBDA вырос по сравнению с уровнем I квартала на 14,3%, достигнув 1,9 млрд. долл.; маржа по OIBDA составила 27%.

Глава АФК «Система» Л. Меламед вчера сообщил, что реструктуризация долга «Русснефти» находится на финальной стадии. По его словам, в данном процессе задействованы все заинтересованные стороны — кредиторы нефтяной компании и ее акционеры. В настоящее время продолжается due dilligence «Русснефти» и работа над стратегией развития данного актива, которая, по словам Л. Меламеда, может быть завершена до конца 2010 года.

Сообщение об успешности проведения процесса реструктуризации долга «Русснефти» является позитивной новостью для АФК «Система» в свете реализации компанией стратегии развития бизнес-единицы «ТЭК».

Источник информации: Интерфакс, данные компании.



ВТБ

Вчера вице-премьер, министр финансов РФ А. Кудрин сообщил, что Правительство РФ ведет с несколькими инвесторами переговоры о продаже части госдоли в капитале «ВТБ». Он не назвал инвесторов и отказался комментировать появившиеся в последнее время сообщения о переговорах по продаже пакета акций «ВТБ» группе инвесторов во главе с американским фондом TPG Capital.

Напомним, что в начале недели газета «Коммерсантъ» сообщила, что группа инвесторов во главе с фондом прямых инвестиций TPG может приобрести 10% акций госбанка. Источник в правительстве сообщил, что в понедельник данная сделка обсуждалась на совещании у первого вице-премьера РФ И. Шувалова.

В настоящее время государству принадлежит 85,5% акций «ВТБ». Ранее чиновники заявляли, что госпакет в капитале банка может быть сокращен в текущем году на 10%. Мы позитивно оцениваем сообщение А. Кудрина о проведении переговоров с инвесторами о продаже части акций «ВТБ», поскольку в случае согласования сделки ее цена, скорее всего, будет включать в себя премию к текущим рыночным котировкам. Однако конкретные параметры и участники вероятной сделки пока неизвестны. Прояснение ситуации по данному вопросу может оказать существенное влияние на динамику котировок акций «ВТБ».

Источник информации: Интерфакс.



МИРОВЫЕ ИНДЕКСЫ

Индекс	Дата закрытия торгов	Значение	Изменение	Изменение, %
Развитые рынки				
Dow Jones (США)	15.09.10	10 572,73	46,24	0,44
S&P 500 (США)	15.09.10	1 125,07	3,97	0,35
NASDAQ (США)	15.09.10	2 301,32	11,55	0,50
FTSE 100 (Великобрит.)	15.09.10	5 555,56	-11,85	-0,21
CAC 40 (Франция)	15.09.10	3 755,64	-18,76	-0,50
DAX (Германия)	15.09.10	6 261,87	-13,54	-0,22
Nikkei 225 (Япония)	15.09.10	9 516,56	217,25	2,34
Рынки стран БРИК				
MMББ	15.09.10	1 436,38	3,16	0,22
PTC (основная сессия)	15.09.10	1 484,50	-8,71	-0,58
PTC (вечерняя сессия)	15.09.10	1 489,45	4,95	0,33
Bovespa (Бразилия)	15.09.10	68 106,85	415,00	0,61
BSE Sensex 30 (Индия)	15.09.10	19 502,11	155,15	0,80
Shanghai Comp. (Китай)	15.09.10	2 652,50	-36,02	-1,34
Развивающиеся рынки				
Merival (Аргентина)	15.09.10	2 439,28	-3,55	-0,15
Bolsa (Мексика)	15.09.10	33 046,69	-11,31	-0,03
Kospi (Юж. Корея)	15.09.10	1 823,88	8,63	0,48
Hang Seng (Гонконг)	15.09.10	21 725,64	29,60	0,14
Straits Times (Сингапур)	15.09.10	3 071,03	22,38	0,73

ADR/GDR*

Эмитент	Дата закрытия торгов	Значение, долл.	Изменение, %	Кол-во акций в 1 ADR/GDR	Цена 1 акции в ADR/GDR, руб.	Отклонение, в % к ММББ
Газпром (ОТС)	15.09.10	21,20	0,24	4	162,93	-0,58
Газпром нефть (ОТС)	15.09.10	19,45	-0,87	5	119,58	-1,49
ЛУКОЙЛ (ОТС)	15.09.10	55,50	0,27	1	1 706,11	-0,86
Роснефть (LSE)*	15.09.10	6,44	-1,98	1	197,97	-1,30
Сургутнефтегаз (ОТС)	15.09.10	9,96	0,00	10	30,62	-0,43
ГМК НорНикель (ОТС)	15.09.10	15,99	-3,03	0,1	4 915,44	-1,23
Мечел (NYSE)	15.09.10	24,45	-1,61	1	751,61	-0,05
ММК (LSE)*	15.09.10	11,87	1,63	13	28,07	0,25
Северсталь (LSE)*	15.09.10	13,72	-0,22	1	421,76	0,78
РусГидро (LSE)	15.09.10	5,28	-1,12	100	1,62	-0,36
ВТБ (LSE)*	15.09.10	5,83	-0,85	2000	0,09	0,01
МТС (NYSE)	15.09.10	21,74	-0,28	2	334,15	29,12
Ростелеком (ОТС)	15.09.10	27,50	-0,90	6	140,89	-0,94

СЫРЬЕВЫЕ РЫНКИ

Товар	Дата закрытия торгов	Цена, долл.	Изменение, долл.	Изменение, %
Нефть				
Brent	15.09.10	79,42	0,26	0,33
Urals	15.09.10	78,68	0,23	0,29
Металлы (LME)				
Золото	15.09.10	1 267,00	1,50	0,12
Платина	15.09.10	1 585	15,50	0,99
Серебро	15.09.10	20,44	0,13	0,64
Палладий	15.09.10	546,00	2,00	0,37
Алюминий	15.09.10	2 121,50	17,00	0,81
Медь	15.09.10	7 602,0	79,00	1,05
Никель	15.09.10	23 199	347,00	1,52
Цинк	15.09.10	2 123,0	-12,00	-0,56

ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ

Ставка	Значение на 15.09.10	Изменение
MOSPRIME O/N (1 день)	2,91	0,19
MOSPRIME 1W (1 нед.)	2,99	0,00
MOSPRIME 1M (1 мес.)	3,25	-0,01
MOSPRIME 3M (3 мес.)	3,74	-0,01
MOSPRIME 6M (6 мес.)	4,25	0,00

ВАЛЮТА

Официальный курс ЦБ РФ	Значение на 16.09.10
USD/RUR	30,7407
EUR/RUR	39,9107
EUR/USD	1,2983

Вся информация изданий Агентства «Интерфакс», размещенная на сайте www.ddinvest.ru, не подлежит дальнейшему воспроизведению и/или распространению в какой-либо форме, иначе как с письменного разрешения агентства «Интерфакс-Поволжье» (www.ifx.ru).



ДИНАМИКА РЫНКА АКЦИЙ (ММВБ)

Бумага	Заккрытие на 15.09.10	Изменение, %	Мин. цена	Макс. цена	Объем торгов, руб.	Количество сделок, шт.
Нефть и газ						
Газпром ао	163,87	0,53	161,62	164,13	7 148 892 463	43 304
Газпром нефть ао	121,39	-0,17	120,00	122,99	79 999 494	1 760
ЛУКОЙЛ ао	1 720,98	1,06	1 690,32	1 724,00	2 407 584 760	19 148
НОВАТЭК ао	233,71	0,86	230,50	234,25	97 926 292	573
Роснефть ао	200,57	-1,62	199,30	204,30	2 895 094 905	26 014
Сургутнефтегаз ао	30,750	-0,05	30,581	30,868	631 154 629	7 104
Сургутнефтегаз ап	14,690	1,28	14,401	14,855	361 946 184	3 934
Татнефть ао	147,00	0,80	145,22	147,25	188 766 917	4 494
Татнефть ап	73,23	0,45	72,51	73,45	17 027 521	253
Транснефть ап	35 600,00	4,05	33 967,58	35 646,98	2 648 474 592	11 698
Металлургия						
ГМК НорНикель ао	4 976,69	-2,03	4 948,00	5 105,00	6 459 955 955	35 968
Мечел ао	752,00	-1,44	745,01	774,00	44 421 328	378
ММК ао	27,998	2,93	27,048	28,200	85 853 386	2 027
НЛМК ао	99,40	1,75	97,07	99,40	61 464 979	754
Полиметалл ао	459,98	2,29	440,02	459,98	11 269 071	390
Полюс Золото ао	1 404,93	0,53	1 376,05	1 407,00	165 401 057	2 630
Северсталь ао	418,50	-0,08	412,55	420,49	356 882 840	6 499
Угольный сектор						
Белон ао	26,40	-0,56	25,95	26,79	14 894 285	851
Распадская ао	153,20	0,87	150,00	153,50	56 550 631	508
Электроэнергетика						
Интер РАО ЕЭС ао	0,0472	-1,05	0,0463	0,0479	377 944 182	5 488
Мосэнерго ао	3,264	-0,34	3,250	3,289	27 280 978	374
РусГидро ао	1,629	0,25	1,602	1,635	795 852 206	10 313
ФСК ЕЭС ао	0,368	1,10	0,361	0,373	573 754 327	5 277
Банковский сектор						
ВТБ ао	0,0896	-0,33	0,0886	0,0900	2 085 980 817	15 734
Сбербанк ао	84,45	-0,06	83,37	84,67	13 319 787 334	110 497
Сбербанк ап	60,05	-0,41	59,35	60,67	1 752 842 676	19 827
Телекоммуникационный сектор						
МТС ао	258,80	0,41	256,45	259,80	137 055 280	2 977
Ростелеком ао	142,23	-0,86	138,30	147,76	858 377 494	14 349
Ростелеком ап	93,25	-2,24	92,73	97,80	745 851 018	11 033
Уралсвязьинформ ао	1,136	0,09	1,115	1,147	177 076 723	2 151
Уралсвязьинформ ап	0,978	0,31	0,961	0,980	9 138 620	239
Прочее						
Аэрофлот ао	66,43	0,93	64,50	66,80	118 368 881	1 690
Уралкалий ао	147,00	0,55	144,01	147,00	163 179 574	2 193