

Комментарий по рынку акций

В пятницу американские фондовые индексы завершили торги умеренным ростом. Лучше остальных выглядели акции компаний высокотехнологического сектора (Nasdaq +0,54%) после оптимистичного прогноза от компании Oracle. Вышедший отчет университета Мичигана по индексу потребительского доверия в США за сентябрь показал снижение до 66,6 пункта (минимальный уровень более чем за год) против 68,9 в августе, и прогнозе 70,2 пункта. В ходе пятничной торговой сессии индекс S&P-500 так и не сумел закрепиться выше ключевого уровня 1130 пунктов и остался в границах устоявшегося торгового диапазона.

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс PTC	1 464,18	0,02%	-1,54%	2,75%	18,90%
Индекс MMBB	1 417,65	-0,94%	-1,13%	3,76%	17,64%
FTSE	5 508,45	-0,57%	0,12%	6,03%	6,67%
S&P 500	1 125,59	0,08%	1,45%	5,03%	5,64%
Dow Jones Avg.	10 607,85	0,12%	1,39%	3,86%	8,42%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-4	0,0895	6,74%	19,97%	62,73%
ОАО Синергия	40,0000	5,26%	9,59%	82,23%
ВолгаТелеком	3,6200	3,43%	18,69%	50,83%
СЗТ	0,7800	2,50%	16,42%	56,63%
Аэрофлот	2,1600	0,47%	10,71%	48,97%
Магнит	110,0000	0,46%	6,80%	76,00%
НорНикель	161,4000	0,25%	-5,06%	10,02%
Полюс Золото	45,2000	0,22%	0,00%	-22,74%

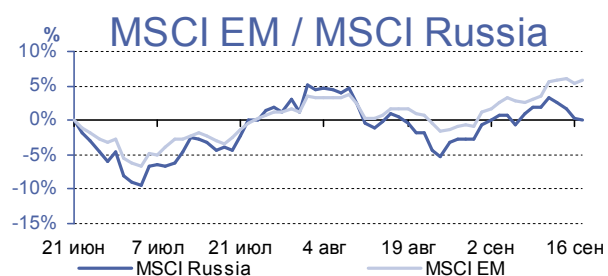
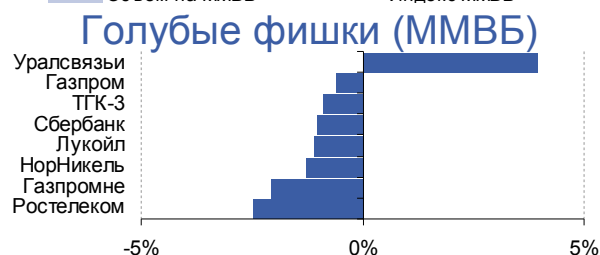
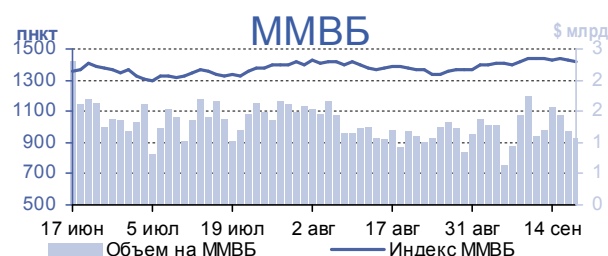
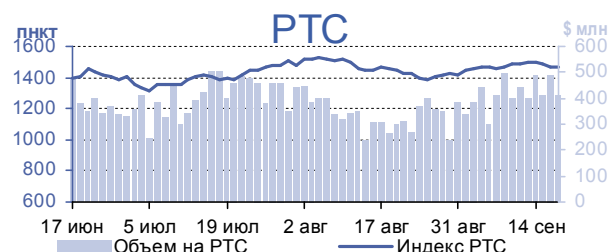
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
РБК ИС	1,2100	-4,72%	8,33%	-24,38%
ОАО Группа ЛСР	27,3000	-4,21%	-1,09%	48,77%
ОГК-3	0,0500	-2,91%	1,01%	-1,96%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1035,94	0,47%	4,84%	12,62%
Индекс MSCI BRAZIL	3474,85	-0,66%	3,12%	11,39%
Индекс MSCI RUSSIA	777,17	-0,10%	1,89%	8,06%
Индекс MSCI INDIA	526,94	1,52%	7,55%	24,41%
Индекс MSCI CHINA	64,67	1,34%	3,99%	3,35%

Основные индикаторы



Обзор рынка

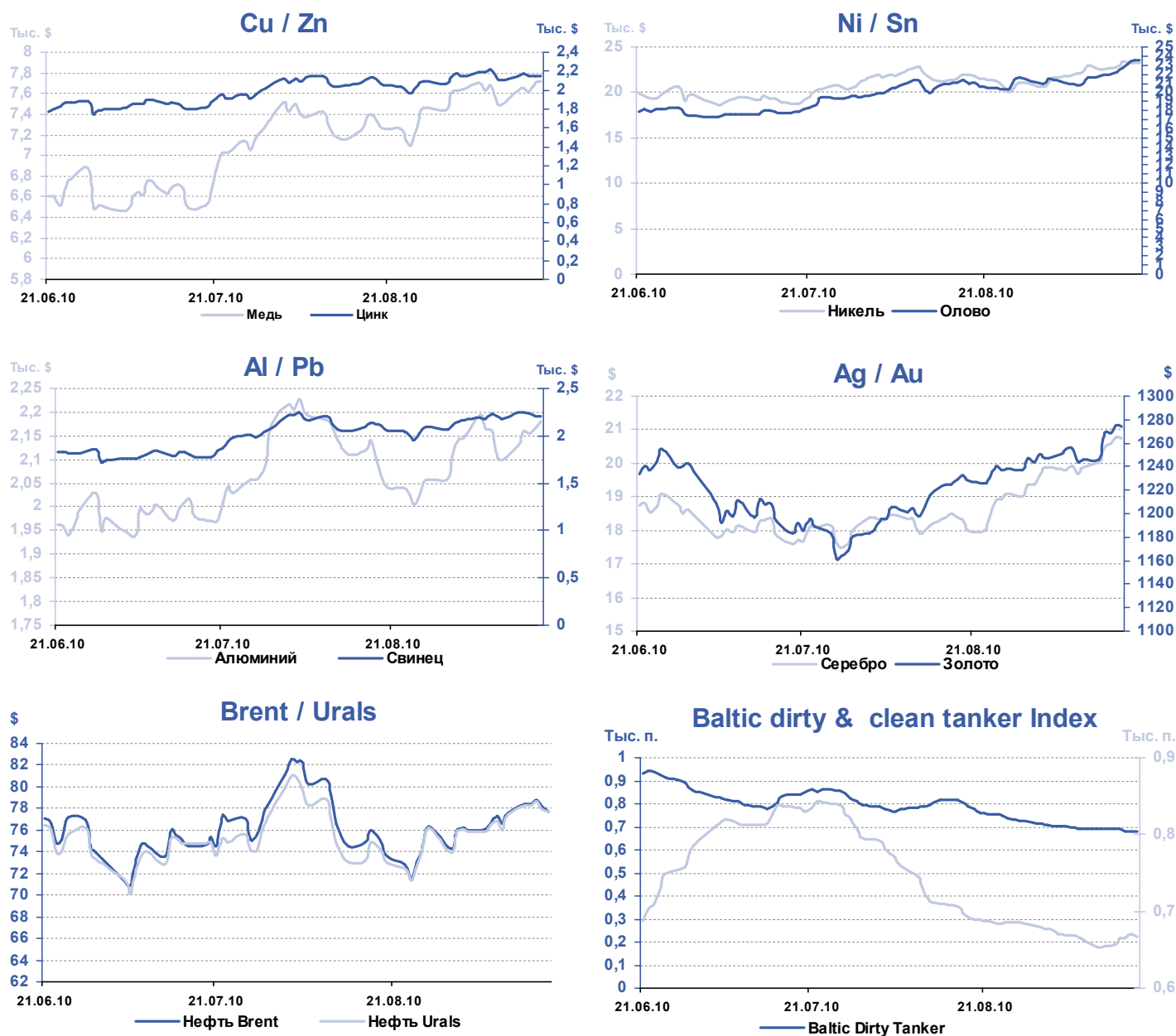
В пятницу американские фондовые индексы завершили торги умеренным ростом. Лучшие остальных выглядели акции компаний высокотехнологического сектора (Nasdaq +0,54%) после оптимистичного прогноза от компании Oracle. Вышедший отчет университета Мичигана по индексу потребительского доверия в США за сентябрь показал снижение до 66,6 пункта (минимальный уровень более чем за год) против 68,9 в августе, и прогнозе 70,2 пункта. В ходе пятничной торговой сессии индекс S&P-500 так и не сумел закрепиться выше ключевого уровня 1130 пунктов и остался в границах устоявшегося торгового диапазона.

В пятницу курс евро попал под давление в связи с возможным ухудшением ситуации в финансовом секторе Ирландии. До рекордных отметок расширилась разница в доходностях (389 б.п.) между 10-летними ирландскими и германскими гособлигациями. В пятницу также выросли в цене суверенные CDS по Ирландии, Португалии и Испании. В понедельник утром валютная пара EUR/USD торгуется возле отметки 1,3070. Цены на нефть марки Brent за последние два дня ведут себя крайне нестабильно, сохраняя позиции возле уровня \$78,5/барр. Сегодняшние торги на азиатских биржах в основном проходят в нейтрально-позитивной зоне (MSCI Asia +0,21%). Торги в Японии сегодня не проводятся в связи с празднованием Дня почитания пожилых людей.

Открытие торгов на российских биржах в понедельник мы увидим в зоне незначительного роста. Возникшая в пятницу относительная перепроданность по отдельным ликвидным бумагам сегодня утром будет нивелирована. С учетом относительного затишья на мировых фондовых и сырьевых биржах не стоит ждать чего-то особенного на российских площадках - торги будут очень вялыми. Сегодня утром индекс ММВБ вернется к пробитой поддержке на 1422 п. С учетом довольно слабого закрытия наших индексов на прошлой неделе, на этой мы, скорее всего, увидим попытки продать наш рынок ниже. Сильная поддержка по индексу ММВБ проходит на уровне 1390 п., возле которой мы рекомендуем аккуратные покупки индексных бумаг.

Понедельник будет крайне скуп на данные статистики. Сегодня в 18-00 Национальная ассоциация домостроительных компаний США (NAHB) опубликует данные индекса рынка недвижимости за сентябрь (прогноз: 14 пунктов).

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	7 720,00	0,26%	3,13%	6,41%	20,91%
Цинк, \$/t	2 151,00	0,14%	1,94%	4,52%	9,83%
Никель, \$/t	23 200,00	-0,22%	3,11%	7,66%	32,01%
Олово, \$/t	23 600,00	0,45%	7,89%	14,29%	59,46%
Алюминий, \$/t	2 180,00	0,67%	3,81%	6,86%	10,89%
Свинец, \$/t	2 202,50	0,02%	0,80%	7,13%	-3,23%
Серебро, \$/oz	20,76	-0,18%	4,36%	15,31%	20,21%
Золото, \$/oz	1 274,30	-0,07%	2,25%	3,79%	25,72%
Нефть Brent, \$/	77,67	-0,56%	0,10%	5,54%	10,41%
Нефть Urals, \$/	77,70	-0,26%	0,40%	6,47%	10,40%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, т\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,492	0,00%	-1,27%		30 876	246
БашИнСв	BISV	0,140	0,00%	-0,05%		8 846	128
БашЭнрг	BEGY	1,719	0,00%	-0,32%		82 001	1 789
ВМЗ	VSMZ	1367,155	0,00%	0,00%		21 855	2 346
ДВМП	FESH	0,405	0,00%	0,56%		32 009	1 200
КазанскВЗ	KHEL	1,902	0,00%	0,00%		7 626	294
КОМСТАР	CMST	6,578	0,00%	-1,47%		2 618	2 749
Мечел	MTLR	23,964	0,00%	-0,80%		712 286	10 012
Мотовил	MOTZ	0,094	0,00%	2,11%		6 758	93
Новсибэнрг	NVNG	28,665	0,00%	-1,22%		143	388
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1400,000	0,00%	0,00%	7 000		2 404
СилМашины	SILM	0,234	0,00%	2,24%		247 119	2 026
Сильвинит	SILV	634,744	0,00%	-0,60%		945 285	5 005
СинТЗ-ао	SNTZ	59,371	0,00%	0,00%		356	374
Славн-ЯНОС	JNOS	0,451	0,00%	-0,02%		3 205	421
СТЗ-ао	SVTZ	6,258	0,00%	0,00%		63	301
ТАГМЕТ	TAMZ	0,742	0,00%	0,00%		293	373
У-УАЗ	UUAZ	1,313	0,00%	-0,66%		5 974	347
ЧМК	CHMK	268,924	0,00%	-0,71%		608 497	862
ЧТПЗ	CHEP	1,789	0,00%	2,72%		102 983	840
ЮжКузб.	UKUZ	41,935	0,00%	0,04%		3 690	1 514

Нефть и газ

Башнефть	BANE	40,000	0,00%	0,00%	239 950		6 807
Газпром	GAZP	5,255	0,00%	-0,61%	131 375	200 671 463	124 404
Газпромнефть	SIBN	3,796	0,00%	-2,09%		5 677 697	18 245
Лукойл	LKOH	56,000	0,00%	-1,12%	56 000	60 275 830	47 632
НОВАТЭК	NVTK	7,510	0,00%	0,00%	7 510		22 803
Роснефть	ROSN	6,649	0,00%	-1,84%	13 510	66 645 817	70 463
Сургутнефтегаз	SNGS	0,995	0,00%	-2,05%	99 500	11 605 756	35 547
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,471	0,00%	-0,87%	353 250	7 048 700	3 628
Татнефть, п.	TATNP	2,345	0,00%	0,00%	259 641		346
Транснефть, п.	TRNFP	1150,000	0,00%	-1,68%	115 000	32 037 712	1 788

Электрэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,630	0,00%	0,00%	11 410		1 700
Иркутскэнерго	IRGZ	0,720	0,00%	-0,21%	14 832	93 899	3 432
Ленэнерго	LSNG	0,768	0,00%	0,00%	7 680	8 384	711
МОЭСК	MSRS	0,045	0,00%	0,71%		61 118	2 205
ОГК-2	OGKB	0,052	0,00%	0,00%	15 746		1 715
ОГК-3	OGKC	0,050	-2,91%	-0,58%	150 000	1 130 922	2 374
ОГК-4	OGKD	0,090	6,74%	0,00%	44 750		5 643
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	0,92%	42 000	1 283 754	2 971
ТГК-3	MSGN	0,106	0,00%	-0,89%	35 587	736 779	4 213
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-0,59%	5 500	46 664	677
ТГК-6	TGKF	0,001	0,00%	-0,65%	8 859	28 199	950

Телекоммуникации

Башинформсвязь	BISV	0,144	0,00%	0,00%	14 427		137
ВолгаТелеком	NNSI	3,620	3,43%	0,00%	108 400		890
МТС	MTSS	8,419	0,00%	0,00%	1 683 770		16 744
Ростелеком	RTKM	4,510	0,00%	-2,46%	33 072	7 586 949	3 286
Ростелеком, п.	RTKMP	3,020	0,00%	0,26%	1 741 040	11 406 562	733
СЗТ	SPTL	0,780	2,50%	5,89%	39 000	2 345 259	687
СибирьТелеком	ENCO	0,066	0,00%	0,00%	7 304		798
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	0,62%		16 085	111
Уралсвязьинформ	URSI	0,035	0,00%	3,97%	69 600	44 031 908	1 137
ЦентрТелеком	ESMO	0,775	0,00%	0,00%	8 187		1 223

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,925	0,00%	-0,22%	291 450	563 515	1 284
ГАЗ	GAZA	31,900	0,00%	0,00%	9 570		589
ИРКУТ	IRKT	0,293	0,00%	1,45%		36 481	286

Казанский ВЗ	KHEL	1,925	0,00%	0,00%	38 500		297
КАМАЗ	KMAZ	2,407	0,00%	0,64%	120 325	164 696	1 702
ОМЗ	OMZZ	2,600	0,00%	-2,81%	13 000	3 930	92
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	-1,22%	30 000	1 723	337
Северсталь-авто	SVAV	16,883	0,00%	-0,71%	185 715	321 729	574
Силовые машины	SILM	0,231		0,00%	46 200		2 012

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,495	0,00%	0,00%	49 500		247
Бурятзолото	BRZL	25,000	0,00%	0,00%	25 000		176
ВСМПО	VSMO	93,000	0,00%	-0,52%	9 300	159 549	1 072
Мечел	MTLR	24,450	0,00%	0,00%	29 390		10 178
ММК	MAGN	0,903	0,00%	1,09%		1 561 845	10 103
НЛМК	NLMK	3,199	0,00%	0,82%		2 276 631	19 451
НорНикель	GMKN	161,400	0,25%	-1,28%	322 900	70 948 445	30 767
Полиметалл	PMTL	13,400	0,00%	1,10%	87 100	469 723	5 352
Полюс Золото	PLZL	45,200	0,22%	-2,05%	180 600	7 663 033	8 616
Северсталь	CHMF	13,500	0,00%	-0,50%	5 400	9 186 304	13 604
ТМК	TRMK	4,050	0,00%	1,50%	31 396	505 119	3 797
ЧТПЗ	CHEP	1,730	0,00%	0,00%	25 950		817

Банки

Банк Москвы	MMBM	30,928	0,00%	-0,19%		10 527	4 932
Возрождение	VZRZ	36,000	0,00%	0,80%	108 500	460 256	855
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-2,13%	5 585 831	79 109 804	28 557
РОСБАНК	ROSB	3,687	0,00%	0,28%		8 025	2 739
Сбербанк	SBER	2,665	0,00%	0,00%	1 077 000		57 529

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,160	0,47%	1,78%	161 250	5 400 664	2 399
Дальневосточное МП	FESH	0,413	0,00%	0,00%	8 250		1 217
НМТП	NMTP	0,134	0,00%	-3,82%		1 283 692	2 634
Приморское МП	PRIM	0,189	0,00%	0,07%		823	152

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,450	0,00%	0,00%	172 500		362
Балтика	PKBA	32,245	0,00%	-0,50%		114 680	3 871
Верофарм	VRPH	37,450	0,00%	0,00%	524 300		375
Вимм-Билль-Данн	WBDF	48,500	0,00%	0,33%	48 500	182 122	2 134
Дикси	DIXY	10,180	0,00%	-0,28%	101 800	64 726	875
Концерн Калина	KLNA	19,000	0,00%	0,84%	30 400	2 389	185
Красный Октябрь	KROT	10,286	0,00%	2,88%		36	84
Магнит	MGNT	110,000	0,46%	1,31%	769 000	588 484	9 876
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,250	0,00%	-0,22%	313	17 808	20
Разгуляй	GRAZ	1,490	0,00%	-0,02%	22 350	138 552	234
Фармстандарт	PHST	77,000	0,00%	0,04%	84 900	138 023	2 910
Черкизово	GCHE	24,000	2,56%	3,72%	24 000	214 402	1 034

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,186	0,00%	0,00%	39 865		332
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,550	0,00%	-2,63%	27 500	254 395	886
Уфанефтехим	UFNC	4,600	0,00%	0,00%	46 000		1 267

Другие сектора

ПИК	pikk	4,050	0,00%	0,08%	5 002	1 921 170	1 998
РБК ИС	RBCI	1,210	-4,72%	-0,27%	33 880	475 991	169

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	29,500	0,00%	-0,43%	29 500	363 840	1 407
Дорогобуж	DGBZ	0,515	0,00%	0,00%	5 150	18 309	371
Сильвинит	SILV	652,000	0,00%	0,00%	65 200		5 102
Уралкалий	URKA	5,000	0,00%	-1,05%	25 000	7 366 237	10 622

Уголь

Распадская	rasp	4,950	0,00%	-0,36%	252 000	7 345 942	3 865
------------	------	-------	-------	--------	---------	-----------	-------

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в ADR	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	162,770	1,44%	7,15
Башнефть	AK6		EUR	146,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,660	-3,49%	27,40
ТГК-3	AOMD		USD	10,430	2,25%	2,09
Татнефть	ATAD		USD	29,980	-1,83%	12 486,83
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,770	0,00%	0,09
Бурятзолото	BYT		EUR	18,750	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,019	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,400	-1,54%	5 805,41
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	27,550	-0,90%	31 071,66
Х5	FIVE		USD	36,780	-0,59%	10 768,60
Газпром	GAZ		EUR	16,050	0,16%	508,23
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,020	3,39%	
ЮТК	KUE		EUR	6,200	5,98%	1,82
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,350	-2,25%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,000	-0,99%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,810	-1,22%	0,42
Лукойл	LKOD		USD	55,000	-0,54%	276 485,20
Лукойл	LUK		EUR	42,045	-0,38%	164,02
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,950	-0,83%	2 556,99
МТС	MBT	5	USD	19,910	-6,13%	124 452,20
МТС	MKY	5	EUR	15,500	-3,79%	0,29
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,900	-0,13%	36,00
Мечел	MTL	3	USD	23,950	-1,36%	28 524,05
НорНикель	NILSY	1	USD	15,830	-1,80%	596,54
НорНикель	NNIA		EUR	12,205	0,08%	145,83
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	83,800	1,70%	47 155,03
ВолгаТелеком	NZH		EUR	5,200	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,500	25,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAQ		EUR	4,100	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	20,850	-0,43%	287 141,20
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	1,00
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	-10,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	26,000	-3,20%	280,40
Ростелеком	RTL		EUR	19,500	-4,88%	7,41
Газпромнефть	SCF		EUR	14,350	-1,71%	130,21
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,134	-2,13%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,490	0,75%	5,65
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,690	0,64%	4 070,37
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,550	-2,35%	338,83
АФКСистема	SSA	1	USD	23,700	-3,38%	41 381,45
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	25,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	49,000	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	24,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	22,000	-20,58%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	149,400	-1,97%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,820	4,39%	16,25
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,550	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,600	1,04%	78 830,44
ВТБ	VTBR		USD	5,620	-2,09%	37 512,20
Возрождение	VZY		EUR	28,100	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	20,860	-1,09%	16 839,24
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	15,850	-0,50%	

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.