



СОБЫТИЯ ДНЯ

- ✓ В Люксембурге завершится встреча министров финансов стран ЕС.
- ✓ 12:30 – публикация значения индекса деловой активности (PMI Construction) в строительном секторе Великобритании за сентябрь.
- ✓ 13:00 – обнародование значения индекса цен производителей (PPI) в еврозоне за август.
- ✓ 17:00 – президент ЕЦБ Ж.-К. Трише проведет пресс-конференцию в Базеле.
- ✓ 18:00 – состоится полугодовое выступление главы ФРС Б. Бернанке на заседании объединенной экономической комиссии Конгресса США.
- ✓ 18:00 – Министерство торговли США опубликует данные об объеме заказов промышленных предприятий за август.
- ✓ Как ожидается, Yum! Brands Inc. опубликует финансовую отчетность за прошедший квартал.
- ✓ Биржи Китая закрыты в связи с празднованием 62-й годовщины со дня образования КНР.

КОММЕНТАРИЙ ПО РЫНКУ АКЦИЙ

Российский рынок акций. Вчера на фоне ухудшающейся конъюнктуры зарубежных рынков негативные настроения на российском рынке усилились. По итогам дня индекс ММВБ снизился на 1,60%, закрывшись на отметке 1344,66 п. Среди «фишек» негативная динамика наблюдалась практически по всему спектру бумаг: «Газпром» (-1,53%), «ЛУКОЙЛ» (-1,99%), «Норильский никель» (-4,75%), «Северсталь» (-2,62%), «РусГидро» (+1,90%), «Сбербанк»-ао (-3,18%), «ВТБ» (-1,51%).

Развитые рынки. Давление на европейские рынки оказали неутрачивающие страхи по поводу возможного дефолта Греции. Опасения усилились после воскресного заявления правительства страны, объявившего параметры бюджета до 2012 года (бюджетный дефицит в ближайшие два года превысит запланированные ранее уровни). В результате этого основные фондовые индексы региона завершили день в «минусе»: FTSE 100 (-1,03%), CAC 40 (-1,85%), DAX (-2,28%).

В США обнародованные данные по деловой активности в производственном секторе оказались значительно лучше ожиданий: индекс ISM Manufacturing вырос в сентябре до 51,6 п. с 50,6 п. в августе (ожидалось снижение до 50,5 п.). Однако негатив из Европы все же не позволил ключевым индексам страны закрыться в «зеленой зоне»: Dow Jones (-2,36%), S&P 500 (-2,85%), NASDAQ (-3,29%).

Ожидания перед началом торгов. Сегодня в первой половине дня мы ожидаем падения котировок большинства ликвидных акций на ММВБ. В начале торгов давление на рынок окажет ухудшение конъюнктуры на рынке акций США, а также сообщение СМИ о том, что министры финансов стран еврозоны отложили принятие решения по очередному траншу для Греции до конца октября. Кроме того, цены на нефть Brent продолжают снижение и вплотную приближаются к отметке 100 долл./барр.

В течение дня инвесторы будут внимательно следить за новостями из еврозоны, а также заявлениями глав ЕЦБ и ФРС. Кроме того, влияние на динамику рынка окажут данные об объеме заказов промпредприятий в США за август. Как ожидается, данный показатель не изменился по сравнению с июльским уровнем. С учетом сохраняющейся напряженности вокруг долгового кризиса в Греции, мы полагаем, что негативные настроения на рынках сохранятся до конца торгов.



НОВОСТИ КОМПАНИЙ

ГАЗПРОМ

Событие. Вчера глава «Газпрома» А. Миллер на встрече с премьер-министром РФ В. Путиным сообщил, что экспорт российского газа за 9 месяцев 2011 года вырос на 25 млрд. куб. м. Речь идет об общем экспорте газа из России — как в Европу, так и в страны СНГ.

По данным ЦДУ ТЭК, данный показатель увеличился на 25,92 млрд. куб. м., достигнув 181 млрд. куб. м. Половина прироста экспорта была обеспечена Украиной, дополнительно закупившей у «Газпрома» 12,1 млрд. куб. м газа для расчетов с RosUkrEnergo. Оставшаяся часть — за счет органического роста поставок в Европу. Экспорт в дальнее зарубежье за январь-сентябрь увеличился на 12,9% (12,8 млрд. куб. м) — до 111,7 млрд. куб. м.

Среди других важных заявлений, сделанных А. Миллером, можно отметить следующие: сводное ТЭО проекта «Южный поток» показало его экономическую эффективность и техническую реализуемость, и компания уже приступила к разработке проектной документации; запуск «Северного потока» запланирован на 8 ноября; «Газпром» рассматривает возможность создания дополнительных ниток «Северного потока» в рамках уже созданного коридора.

Также вчера из сообщений СМИ стало известно, что турецкая трубопроводная монополия Botas уведомила «Газпром экспорт» об отказе продлевать контракт на 6 млрд. куб. м газа. В «Газпром экспорте» Агентству газовой информации (АГИ) подтвердили получение соответствующего документа в субботу. Ранее министр энергетики Турции Т. Йылдыз грозил невозобновлением контракта, если «Газпром» не снизит цену, а собеседник АГИ отметил, что турецкая сторона просила «значительно снизить цену на газ». Зампред правления «Газпрома» А. Медведев заявил, что российский концерн готов поставлять указанный объем существующим и новым партнерам — частным компаниям.

Наш комментарий. Заявления А. Миллера в отношении увеличения объемов экспортных поставок в январе-сентябре 2011 года, то они не стали «сюрпризом» для инвесторов. В этой связи наиболее важным считаем сохранение тенденции органического роста поставок в страны ЕС на фоне восстановления потребления «голубого топлива» в регионе. По нашему мнению, несмотря на замедление темпов роста экономики еврозоны, данная тенденция в настоящее время является достаточно устойчивой.

Что касается отказа Botas от продления контракта с «Газпромом», то данная новость является нейтральной для котировок российской компании. На фоне высокого спроса на газ в Турции концерн вряд ли столкнется с серьезными трудностями в поиске контрагентов. Пожалуй, единственным существенным риском для «Газпрома» является возможное сокращение поставок в эту страну (если указанный объем будет выставлен на аукцион по переуступке контрактов на поставку российского газа, и в ходе него победителями тендера станут другие российские или зарубежные компании).

Источник информации Интерфакс.



ВТБ, БАНК МОСКВЫ

Событие. Вчера в интервью телеканалу «Россия 24» президент-председатель правления «ВТБ» А. Костин сообщил, что в ближайшие месяцы группа планирует довести свою долю в капитале «Банка Москвы» с 80,57% до 100%. По его словам, в настоящее время банк готовит схему выкупа бумаг у владельцев небольших пакетов, при этом данный процесс завершится «достаточно быстро, в течение нескольких месяцев».

А. Костин напомнил, что «ВТБ» планирует израсходовать на покупку всего 100% пакета акций столичного банка и его оздоровление до 258 млрд. руб. Данная сумма включает до 100 млрд. руб. на докапитализацию банка и 92,8 млрд. руб. на уже состоявшееся в начале года приобретение пакета в «Банке Москвы» у правительства Москвы (46,48%), а также выкуп оставшейся части пакета. Он отказался назвать сумму расходов на приобретение доли у В. Юсуфова и С. Керимова и отметил, что «ВТБ» не планирует приобретать акции у экс-главы «Банка Москвы» А. Бородина (около 4,5%).

Наш комментарий. На сегодняшний день доля «ВТБ» в капитале столичного банка (с учетом доли «Столичной страховой группы», также подконтрольной группе) составляет около 94%. Всего на выкуп бумаг у миноритариев планировалось направить 65 млрд. руб., однако оценка пакетов В. Юсуфова и С. Керимова не раскрывается.

Мы полагаем, что в обозримом будущем «ВТБ» выставит оферту миноритарным акционерам, однако цена выкупа окажется на уровне текущих рыночных котировок, либо незначительно выше их. В связи с этим мы нейтрально оцениваем сообщение главы «ВТБ» в отношении планов по консолидации 100% акций «Банка Москвы» с точки зрения динамики котировок акций последнего.

Источник информации: Интерфакс.



МИРОВЫЕ ИНДЕКСЫ

Индекс	Дата закрытия торгов	Значение	Изменение	Изменение, %
Развитые рынки				
Dow Jones (США)	03.10.11	10 655,30	-258,08	-2,36
S&P 500 (США)	03.10.11	1 099,23	-32,19	-2,85
NASDAQ (США)	03.10.11	2 335,83	-79,57	-3,29
FTSE 100 (Великобрит.)	03.10.11	5 075,50	-52,98	-1,03
CAC 40 (Франция)	03.10.11	2 926,83	-55,13	-1,85
DAX (Германия)	03.10.11	5 376,70	-125,32	-2,28
Nikkei 225 (Япония)	03.10.11	8 545,48	-154,81	-1,78
Рынки стран БРИК				
ММВБ	03.10.11	1 344,66	-21,88	-1,60
PTC (основная сессия)	03.10.11	1 291,70	-49,39	-3,68
PTC (вечерняя сессия)	03.10.11	1 279,85	-11,85	-0,92
Bovespa (Бразилия)	03.10.11	50 791,53	-1 532,89	-2,93
BSE Sensex 30 (Индия)	03.10.11	16 151,45	-302,31	-1,84
Shanghai Comp. (Китай)	29.09.11	2 365,34	-26,72	-1,12
Развивающиеся рынки				
Merval (Аргентина)	03.10.11	2 291,68	-171,95	-6,98
IPC (Мексика)	03.10.11	33 133,88	-369,40	-1,10
Kospi (Юж. Корея)	03.10.11	1 769,65	0,36	0,02
Hang Seng (Гонконг)	03.10.11	16 822,15	-770,26	-4,38
Straits Times (Сингапур)	03.10.11	2 621,40	-53,76	-2,01

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 ММВБ
Газпром (ОТС)	03.10.11	9,15	-4,19	2	149,09	-2,88
Газпром нефть (ОТС)	03.10.11	16,92	-3,48	5	110,28	-1,53
ЛУКОЙЛ (ОТС)	03.10.11	48,59	-3,19	1	1 583,50	-1,34
Роснефть (LSE)*	03.10.11	5,680	-3,32	1	185,11	-1,01
Сургутнефтегаз (ОТС)	03.10.11	8,05	1,26	10	26,23	-0,81
ГМК НорНикель (ОТС)	03.10.11	20,30	-5,58	0,1	6 615,57	-0,96
Мечел (NYSE)	03.10.11	9,22	-9,52	1	300,47	-6,25
ММК (LSE)*	03.10.11	4,79	0,13	13	12,01	0,04
Северсталь (LSE)*	03.10.11	10,05	-4,65	1	327,52	-1,11
РусГидро (LSE)	03.10.11	3,307	-3,87	100	1,08	1,00
ВТБ (LSE)*	03.10.11	4,030	-2,61	2000	0,07	-0,44
МТС (NYSE)	03.10.11	11,98	-2,60	2	195,21	11,51
Ростелеком (LSE)	03.10.11	26,80	-2,15	6	145,56	-2,31

СЫРЬЕВЫЕ РЫНКИ

Товар	Дата закрытия торгов	Цена, долл.	Изменение, долл.	Изменение, %
Нефть				
Brent	03.10.11	101,71	-1,05	-1,02
Urals	30.09.11	101,13	-2,91	-2,80
Металлы (LME)				
Золото	03.10.11	1 655,50	35,50	2,19
Платина	03.10.11	1 501,00	-10,00	-0,66
Серебро	03.10.11	31,05	0,60	1,97
Палладий	03.10.11	595,00	-19,00	-3,09
Алюминий	03.10.11	2 124,50	-85,50	-3,87
Медь	03.10.11	6 801,0	-339,50	-4,75
Никель	03.10.11	18 110	-205,00	-1,12
Цинк	03.10.11	1 851,5	-58,50	-3,06

ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ

Ставка	Значение на 03.10.11	Изменение
MOSPRIME O/N (1 день)	5,34	0,03
MOSPRIME 1W (1 нед.)	5,68	0,04
MOSPRIME 1M (1 мес.)	6,31	0,09
MOSPRIME 3M (3 мес.)	6,61	0,07
MOSPRIME 6M (6 мес.)	6,83	0,11

ВАЛЮТА

Официальный курс ЦБ РФ	Значение на 04.10.11
USD/RUR	32,5890
EUR/RUR	43,4411
EUR/USD	1,3330

Вся информация изданной 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	Закрытие на 03.10.11	Изменение, %	Мин. цена	Макс. цена	Объем торгов, руб.	Количество сделок, шт.
Нефть и газ						
Газпром ао	153,52	-1,53	150,18	154,83	9 442 385 711	75 732
Газпром нефть ао	111,99	-0,85	108,27	112,61	33 809 217	4 108
ЛУКОЙЛ ао	1 605,00	-1,99	1 591,50	1 647,80	4 873 757 876	57 387
НОВАТЭК ао	362,11	-0,30	348,10	369,40	552 804 593	6 282
Роснефть ао	186,99	-1,73	182,90	189,20	2 853 282 899	38 103
Сургутнефтегаз ао	26,448	0,95	25,080	26,590	1 065 735 703	26 031
Сургутнефтегаз ап	13,940	0,43	13,500	14,119	400 610 176	8 841
Татнефть ао	132,50	-2,21	127,10	135,44	273 205 298	6 429
Татнефть ап	74,77	-0,65	73,50	76,30	27 715 644	213
ТНК-ВР Холдинг ао	77,90	-0,76	76,00	78,50	16 408 176	855
ТНК-ВР Холдинг ап	68,00	1,46	65,65	68,00	5 296 775	375
Транснефть ап	31 189,00	-4,21	30 720,00	32 308,00	446 414 952	3 810
Металлургия						
ГМК НорНикель ао	6 680,00	-4,75	6 677,00	7 010,00	3 636 984 244	38 722
Мечел ао	320,50	-5,40	318,10	333,00	75 990 360	2 640
ММК ао	12,000	-0,06	11,411	12,130	86 942 917	3 938
НЛМК ао	66,23	0,20	62,11	66,90	530 555 294	12 330
Полиметалл ао	497,00	-0,20	470,00	508,00	141 302 841	2 806
Полюс Золото ао	1 854,50	0,06	1 850,10	1 864,80	35 481 143	411
Северсталь ао	331,20	-2,62	318,00	338,40	1 009 648 433	16 523
Угольный сектор						
Белон ао	11,700	-4,10	11,075	12,000	776 162	98
Распадская ао	90,30	-5,94	88,99	94,00	95 716 174	4 351
Электроэнергетика						
Интер РАО ЕЭС ао	0,034300	2,03	0,031650	0,034867	328 205 666	5 364
Мосэнерго ао	1,9297	-0,80	1,8650	1,9433	8 723 135	676
РусГидро ао	1,0670	1,90	1,0051	1,0799	680 431 099	15 301
ФСК ЕЭС ао	0,24500	2,08	0,22855	0,24890	648 285 411	9 902
Банковский сектор						
ВТБ ао	0,06596	-1,51	0,06411	0,06704	1 999 646 691	31 652
Сбербанк ао	68,20	-3,18	67,07	69,87	21 675 758 595	132 766
Сбербанк ап	53,33	-2,09	51,21	53,83	1 313 999 060	14 253
Телекоммуникационный сектор						
МТС ао	175,06	-1,17	171,00	178,09	505 243 903	6 498
Ростелеком ао	149,00	0,24	141,74	149,40	588 198 156	11 735
Ростелеком ап	74,56	-4,09	73,01	76,00	138 705 133	1 968
Прочее						
Аэрофлот ао	50,77	-2,83	49,25	51,77	77 156 379	2 528
Уралкалий ао	207,82	-6,81	202,60	217,43	2 577 601 119	37 469