

Комментарий по рынку акций

Американские биржи завершили пятничные торги очередным сильным ростом фондовых индексов. Оптимизм инвесторы черпали из отчёта Министерства труда США, сообщившего, что число новых рабочих мест вне сельскохозяйственного сектора США (NFP) в августе сократилось на -54 тыс., при прогнозе снижения на -100 тыс. Важно, что сокращение 114 тыс. сотрудников пришлось на госсектор, который ранее нанимал сотрудников для проведения переписи населения. В тоже время число сотрудников в частном секторе США в августе выросло на +67 тыс. (прогноз: +42 тыс.). Уровень безработицы в Америке в

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 467,62	0,82%	3,25%	-2,80%	36,64%
Индекс ММВБ	1 410,16	0,60%	3,20%	0,50%	28,29%
FTSE	5 428,15	1,06%	4,36%	1,80%	13,16%
S&P 500	1 104,51	1,32%	3,75%	-1,53%	10,09%
Dow Jones Avg.	10 447,93	1,24%	2,93%	-1,93%	11,81%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аптечная сеть 36,6	3,0000	13,41%	13,21%	-75,00%
ГАЗ	28,0500	7,88%	7,88%	3,89%
Башнефть	40,0000	7,38%	8,40%	168,46%
Мечел	24,0000	6,67%	6,19%	50,00%
Сургутнефтегаз, п.	0,4415	5,62%	2,67%	1,49%
Полюс Золото	46,9800	3,94%	0,38%	-9,65%
ВТБ	0,0028	3,77%	7,42%	37,50%
Сбербанк	2,6870	1,78%	-3,69%	24,40%

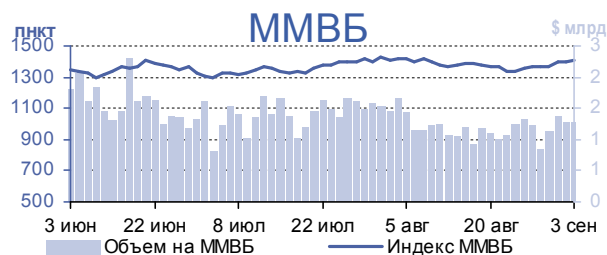
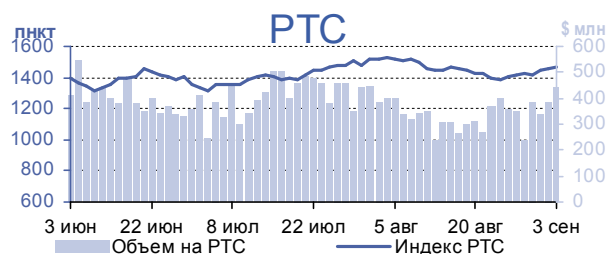
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО ЦМТ	0,3550	-6,33%	1,43%	-1,39%
Магнит	98,0000	-1,01%	-6,22%	64,71%
Дальневосточное МП	0,3980	-0,75%	-8,08%	24,38%

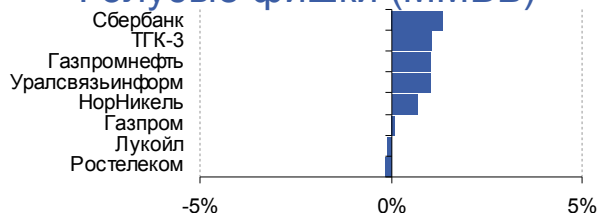
Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1003,75	0,85%	-0,71%	19,35%
Индекс MSCI BRAZIL	3459,46	0,87%	-0,29%	25,06%
Индекс MSCI RUSSIA	783,29	0,73%	-2,92%	25,95%
Индекс MSCI INDIA	484,34	0,20%	-0,80%	25,21%
Индекс MSCI CHINA	62,42	0,76%	-2,10%	8,50%

Основные индикаторы



Голубые фишки (ММВБ)



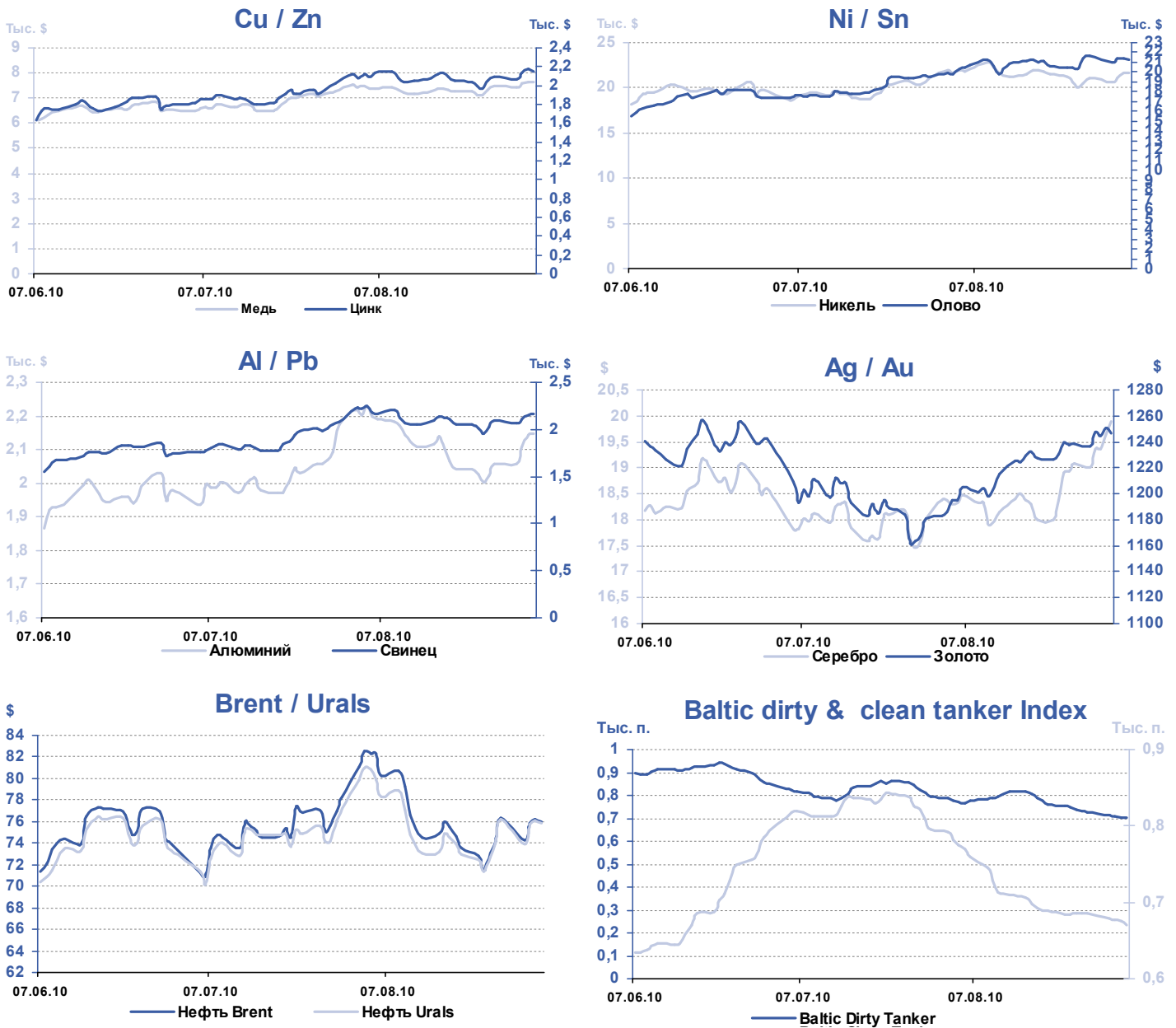
Обзор рынка

Американские биржи завершили пятничные торги очередным сильным ростом фондовых индексов. Оптимизм инвесторы черпали из отчёта Министерства труда США, сообщившего, что число новых рабочих мест вне сельскохозяйственного сектора США (NFP) в августе сократилось на -54 тыс., при прогнозе снижения на -100 тыс. Важно, что сокращение 114 тыс. сотрудников пришлось на госсектор, который ранее нанимал сотрудников для проведения переписи населения. В тоже время число сотрудников в частном секторе США в августе выросло на +67 тыс. (прогноз: +42 тыс.). Уровень безработицы в Америке в августе вырос до 9,6% (+0,1% м/м). Несколько снизил рост на рынке, вышедший индекс активности в секторе услуг США замедлила темпы роста максимально за 7 месяцев, что стало свидетельством того, что во втором полугодии экономика будет восстанавливаться очень вяло. Индекс ISM Services снизился в августе до 51,5 п. против 54,3 п. в июле (прогноз: 53,2 п.). Показательно, что наиболее важные компоненты: занятости в секторе услуг, новых заказов, индекс экспортных заказов оказались существенно хуже значений предыдущего месяца. Тем не менее, участники рынка проигнорировали статистику ISM Services и к концу сессии вывели индексы к максимальным дневным отметкам. Индекс S&P500 (1104,5 п.) приблизился к сильному уровню сопротивления - 1116 п. где проходит 200-дневная скользящая средняя.

На фоне роста аппетита к риску на фондовых биржах, отмечен подъем курса единой европейской валюты до \$1,29. К сожалению этим тенденциям не следуют цены на нефть. Котировки октябрьских фьючерсов по смеси Brent после высокой волатильности в пятницу так и остались на отметке \$76,5/барр. В сырьевом сегменте лишь цены на медь продолжают неудержимый набор высоты (\$7750/т). Сегодняшние торги на азиатских биржах в основном проходят в зоне хорошего роста: MSCI Asia +1,12%.

Открытие торгов на российских биржах в понедельник мы ожидаем увидеть с полупроцентным гэпом вверх. Сильное закрытие предыдущей торговой недели дает задел для роста в начале текущей. Индекс ММВБ в пятницу сумел закрепиться выше отметки 1400 п. Таким образом можно ждать выхода этого показателя к отметкам 1425-30 п., преодолеть которые на нестабильной нефти нам будет довольно сложно. На этих отметках мы советуем зафиксировать прибыль, по бумагам, купленным неделю назад. Сегодня по сути делать на рынке будет нечего: никакой макроэкономической статистики в понедельник и вторник не выходит. Плюс, сегодня в США выходной (День труда) и все биржи закрыты. Поэтому основное внимание устремляем на валютные рынки, на фоне встречи министров финансов стран еврозоны в Брюсселе для обсуждения вопросов экономического управления.

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	7 646,00	0,14%	2,51%	3,74%	22,24%
Цинк, \$/t	2 151,00	-1,06%	2,67%	1,03%	13,63%
Никель, \$/t	21 600,00	-0,23%	2,61%	-2,26%	18,68%
Олово, \$/t	21 200,00	-1,05%	-2,03%	2,29%	46,71%
Алюминий, \$/t	2 147,00	0,09%	4,32%	-2,01%	15,87%
Свинец, \$/t	2 168,00	0,60%	3,73%	0,32%	-4,91%
Серебро, \$/oz	19,89	1,20%	4,16%	7,69%	23,36%
Золото, \$/oz	1 246,75	-0,34%	0,70%	3,43%	25,70%
Нефть Brent, \$/	75,98	-0,28%	-0,50%	-5,24%	13,74%
Нефть Urals, \$/	75,87	-0,38%	-0,45%	-3,04%	13,70%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PТС	Δ ММВБ	Объем на PТС, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, m\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,462	0,00%	0,27%		50 448	235
БашИнСв	BISV	0,137	0,00%	0,00%		96	130
БашЭнрг	BEGY	1,577	0,00%	-0,17%		6 665	1 625
ВМЗ	VSMZ	1428,609	0,00%	4,19%		180 422	2 384
ДВМП	FESH	0,402	0,00%	0,08%		36 457	1 190
КазанскВЗ	KHEL	1,958	0,00%	10,02%		135 644	287
КОМСТАР	CMST	6,611	0,00%	-0,13%		16 691	2 763
Мечел	MTLR	24,091	0,00%	0,58%		1 195 118	10 063
Мотовил	MOTZ	0,089	0,00%	0,00%		706	88
Новсибэнрг	NVNG	30,345	0,00%	2,71%		334	410
ОАО Выксунский металл	VSMZ	1400,000	0,00%	0,00%	7 000		2 404
СилМашины	SILM	0,229	0,00%	0,56%		52 079	2 002
Сильвинит	SILV	664,356	0,00%	0,64%		1 604 490	5 210
СинТЗ-ао	SNTZ	60,396	0,00%	-7,50%		604	380
Славн-ЯНОС	JNOS	0,482	0,00%	0,00%		844	438
СТЗ-ао	SVTZ	6,366	0,00%	0,00%		13	306
ТАГМЕТ	TAMZ	0,718	0,00%	-6,34%		3 521	366
У-УАЗ	UUAZ	1,361	0,00%	0,06%		35 411	361
ЧМК	CHMK	275,863	0,00%	-0,94%		567 372	876
ЧТПЗ	CHPZ	1,632	0,00%	-1,01%		144 742	771
ЮжКузб.	UKUZ	43,637	0,00%	0,00%		8 088	1 570

Нефть и газ

Башнефть	BANE	40,000	7,38%	0,00%	14 800		6 807
Газпром	GAZP	5,300	0,00%	0,12%	132 500	263 011 367	125 470
Газпромнефть	SIBN	3,790	0,00%	1,03%	18 950	3 163 963	17 970
Лукойл	LKOH	54,500	0,37%	-0,12%	54 500	61 292 130	46 356
Роснефть	ROSN	6,650	0,76%	0,52%	66 500	65 454 947	70 478
Сургутнефтегаз	SNGS	0,990	1,54%	1,37%	99 000	20 177 963	35 369
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,442	5,62%	1,52%	220 875	8 924 151	3 389
Транснефть, п.	TRNFP	1077,000	0,00%	-1,23%	969 300	57 179 906	1 675

Электроэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,600	0,00%	0,00%	80 000		1 668
Иркутскэнерго	IRGZ	0,700	0,00%	0,22%	35 000	236 950	3 337
Ленэнерго	LSNG	0,731	0,00%	-0,41%	14 620	23 571	677
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	0,58%	142 851	271 802	2 319
ОГК-2	OGKB	0,050	0,00%	0,00%	6 188		1 620
ОГК-3	OGKC	0,050	0,00%	1,36%	6 188	1 014 943	2 351
ОГК-4	OGKD	0,075	0,00%	0,00%	5 222		4 703
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	1,29%	42 000	279 242	2 971
ТГК-3	MSGN	0,098	0,00%	1,08%	5 018	1 103 920	3 911
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	2,40%	4 625	482 873	664
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,63%	153 445	209 996	894

Телекоммуникации

ВолгаТелеком	NNSI	3,409	0,00%	0,00%	13 977		839
МТС	MTSS	8,080	0,00%	0,00%	1 050 400		16 106
Ростелеком	RTKM	3,799	0,00%	-0,16%	16 144	7 097 237	2 768
Ростелеком, п.	RTKMP	3,360	3,07%	-3,14%	236 950	18 932 899	816
СЗТ	SPTL	0,745	0,00%	0,61%	148 920	169 736	656
СибирьТелеком	ENCO	0,059	0,00%	0,00%	5 265		703
Таттелеком	TTLK	0,005	0,00%	-2,41%		52 270	110
Уралсвязьинформ	URSI	0,035	0,00%	1,01%	69 600	4 481 521	1 137
ЦентрТелеком	ESMO	0,700	0,00%	0,00%	5 250		1 105

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	1,020	22,89%	22,89%	305 500	27 579 654	1 416
ГАЗ	GAZA	28,050	7,88%	0,00%	101 952		556
ИРКУТ	IRKT	0,295	0,00%	1,63%		62 325	284
Казанский ВЗ	KHEL	1,840	0,00%	0,00%	69 552		284
КАМАЗ	KMAZ	2,396	0,00%	0,55%		175 879	1 705
Красный Котельщик	KRKO	0,550	0,00%	0,00%	11 000		117

ОМЗ	OMZZ	2,285	0,00%	0,42%		20 256	81
РКК Энергия	RKKE	325,000	0,00%	0,00%	32 500	303	365
Северсталь-авто	SVAV	15,100	0,00%	0,95%	67 950	445 483	517
Силовые машины	SILM	0,230	0,00%	0,00%	51 750		2 003

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,475	1,50%	0,00%	21 275		237
Бурятзолото	BRZL	23,000	2,68%	0,00%	11 500		162
ВСМПО	VSMO	94,000	0,00%	-0,07%	5 640	387 142	1 084
Мечел	MTLR	24,000	6,67%	0,00%	12 000		9 990
ММК	MAGN	0,893	0,00%	3,60%		2 049 868	9 782
НЛМК	NLMK	3,000	0,00%	2,23%	74 250	2 775 526	17 980
НорНикель	GMKN	173,000	1,17%	0,70%	173 000	82 032 867	32 979
Полиметалл	PMTL	12,600	0,00%	3,03%	24 900	1 159 999	5 032
Полюс Золото	PLZL	46,980	3,94%	0,34%	234 900	3 944 089	8 956
Северсталь	CHMF	12,435	0,00%	2,34%	22 383	21 197 376	12 531
ТМК	TRMK	4,050	0,00%	-0,02%	31 396	550 731	3 797

Банки

Банк Москвы	MMBM	31,732	0,00%	-0,10%		5 819	5 036
Возрождение	VZRZ	35,000	0,00%	0,85%	64 410	452 249	831
ВТБ	VTBR	0,003	3,77%	1,93%	27 500	80 194 296	28 766
РОСБАНК	ROSB	3,726	0,00%	-0,77%		23 489	2 784
Сбербанк	SBER	2,687	1,78%	0,00%	1 335 500		58 004

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,060	0,49%	0,40%	51 500	768 820	2 288
Дальневосточное МП	FESH	0,398	-0,75%	0,00%	20 537		1 175
НМТП	NMTP	0,145	0,00%	-1,98%	5 800	8 406	2 793
Приморское МП	PRIM	0,181	0,00%	1,56%		307	144

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	13,41%	0,00%	208 478		315
Балтика	PKBA	32,739	0,00%	0,34%		15 003	3 882
Верофарм	VRPH	38,850	0,00%	0,00%	38 850		388
Вимм-Билль-Данн	WBDF	45,800	0,66%	-0,40%	67 692	59 434	2 015
Дикси	DIXY	10,349	0,00%	0,66%		38 170	893
Концерн Калина	KLNA	19,500	0,00%	-0,83%	19 500	9 504	190
Красный Октябрь	KROT	10,460	0,00%	0,44%		2 402	96
Магнит	MGNT	98,000	-1,01%	0,62%	116 130	1 015 241	8 720
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,121	0,00%	0,97%		96 602	18
Разгуляй	GRAZ	1,550	0,00%	-0,09%	7 750	314 909	245
Фармстандарт	PHST	79,000	0,00%	0,46%	23 700	78 488	2 986
Черкизово	GCHE	23,505	0,00%	1,55%		6 209	1 002

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,185	0,00%	0,00%	9 259		331
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,490	0,00%	-1,96%	24 500	3 807	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%	3,06%	5 002	5 033 267	1 751
РБК ИС	RBCI	1,200	0,00%	2,62%	12 000	1 683 352	168

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	28,500	0,00%	0,32%	5 130	256 618	1 371
Дорогобуж	DGBZ	0,506	0,00%	0,19%		11 252	364
Сильвинит	SILV	640,000	0,00%	0,00%	32 000		5 008
Уралкалий	URKA	5,000	0,00%	-0,33%	25 000	7 257 808	10 622

Уголь

Распадская	rasp	5,000	0,00%	1,31%	70 200	4 339 976	3 904
УК Южный Кузбасс	UKUZ	44,000	0,00%	0,00%	65 875		1 589

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в ADR	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	157,020	0,10%	
Башнефть	AK6		EUR	143,000	0,00%	
ТГК-3	AOMD		USD	10,000	3,09%	6,55
Татнефть	ATAD		USD	30,700	-0,94%	4 691,28
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,750	33,93%	118,26
Бурятзолото	BYT		EUR	16,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,018	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,400	-2,88%	502,12
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	26,500	-0,93%	62 147,95
X5	FIVE		USD	36,650	-0,14%	7 679,65
Газпром	GAZ		EUR	16,410	-0,64%	1 964,38
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	4,65%	102,03
ЮТК	KUE		EUR	5,200	0,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,500	-0,22%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,200	6,12%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,830	0,00%	1,22
Лукойл	LKOD		USD	54,500	0,18%	67 519,09
Лукойл	LUK		EUR	42,100	-0,46%	52,30
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,500	-0,73%	4 125,05
МТС	MBT	5	USD	21,470	1,32%	44 456,54
МТС	MKY	5	EUR	16,435	0,74%	2,80
МГТС	MOW		EUR	8,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	7,760	0,45%	4,67
Мечел	MTL	3	USD	24,390	-0,45%	44 399,96
НорНикель	NILSY	1	USD	17,210	0,35%	664,45
НорНикель	NNIA		EUR	13,340	-0,07%	271,55
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	74,100	-0,80%	15 116,88
ВолгаТелеком	NZH		EUR	4,750	0,00%	5,70
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,400	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	3,850	11,92%	
Газпром	OGZD		USD	21,180	-0,09%	211 200,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	24,000	2,13%	2 841,24
Ростелеком	RTL		EUR	18,010	-2,65%	12,37
Газпромнефть	SCF		EUR	15,000	1,35%	18,17
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,502	0,39%	23,41
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,340	1,27%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,350	1,16%	51,46
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,830	0,00%	42,41
АФКСистема	SSA	1	USD	26,920	2,75%	10 366,03
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	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	26,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	157,900	0,00%	
Уралсвязьинформ	URL		EUR	5,225	0,00%	
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	4,500	-1,10%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,910	-0,20%	30 037,39
ВТБ	VTBR		USD	5,530	2,03%	25 803,77
Возрождение	VZY		EUR	25,000	0,00%	
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	19,360	-0,21%	5 595,77
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	14,815	-1,59%	

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.