

Индекс	Закр.	Изм., %
Акции		
Азия		
NIKKEI 225	7 176,70	-6,18
KOSPI COMPOSITE	927,90	-1,16
TSEC WEIGHTED	4 366,87	-4,65
HANG SENG	12 086,27	-4,22
США		
DOW JONES IND.	8 378,95	-3,59
S&P 500	876,77	-3,45
NASDAQ COMPOSITE	1 552,0	-3,23
Европа		
FTSE 100	3 883,36	-5,00
CAC 40	3 193,79	-3,54
DAX	4 295,67	-4,96
Россия и BRIC		
IBOVESPA SAO PAULO	31 481,55	-6,91
SSE COMPOSITE	1 744,031	-5,20
BSE SENSEX	8 261,67	-5,05
ММВБ	513,62	-14,24
Объем, Фондовый рынок, млн. долл.	3 108,35	
РТС	549,43	-13,68
Объем, млн. долл.	9,634	
MSCI Russia	344,35	-16,98
MSCI Emerg. Markets	473,98	-7,84
Валюта		
EUR/USD	1,2718	-0,76
EUR/RUR	34,4144	-0,47
USD/RUR	27,0596	0,30

Сырье, металлы, долл.		
Brent, Dec 08	62,05	-5,87
Light, Dec 08	64,15	-5,44
Золото	729,10	2,22
Серебро	9,500	0,51
Медь	3 764,00	-6,79
Алюминий	1 931,00	-1,86
Никель	9 866,00	7,09
Цинк	1 143,25	-2,83

Ликвидность и рынок МБК

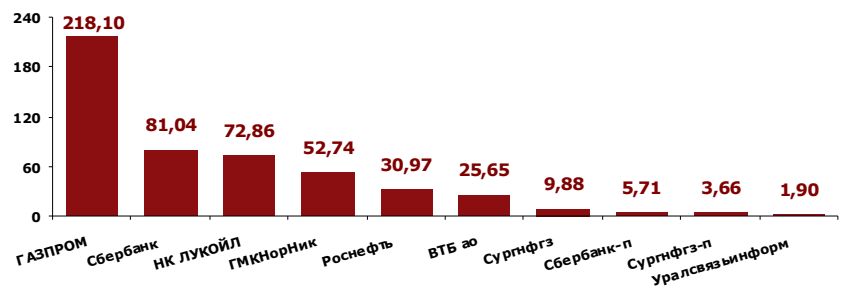


Лидеры роста и падения предыдущего дня, 24 октября

ММВБ, ликвидные акции, %		
Рост	Падение	
	Сбербанк	-22,81
	МТС-ао	-21,29
	ГМК Норник	-20,71
	СевСт-ао	-20,43
	Сбербанк-п	-18,76

РТС, классический и биржевой рынки, %		
Рост	Падение	
	Сбербанк России, ао (SBER)	-22,62
	Газпром, ао (GAZP)	-21,62
	Лукойл, ао (LKOH)	-19,94
	НК Ростнефть (ROSN)	-18,18
	РусГидро, ао (HYDR)	-11,76

Лидеры по объему торгов: ММВБ, млн. долл.



Главные новости сегодня*:

- **18.00 МСК** – продажи нового жилья (новостроек) в США за сентябрь

* все новости представлены в Календаре событий

Прогноз на сегодня:

внешний новостной фон по-прежнему крайне неудачный для формирования положительной динамики на отечественных площадках. Рекомендуем тщательно следить за сообщениями информационных агентств до 10.30 на случай, если торги все же будут открыты

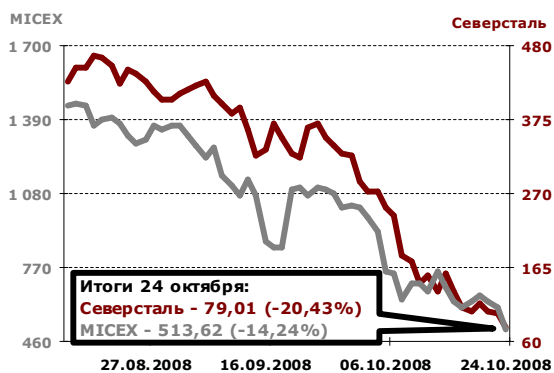
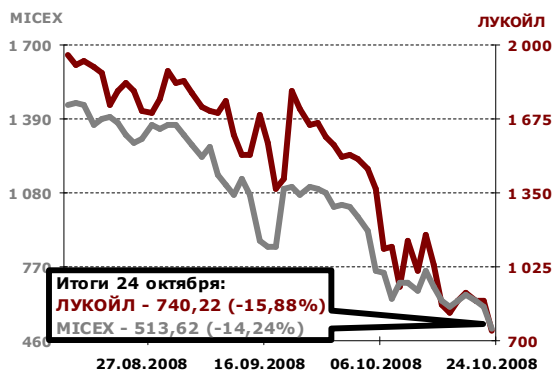
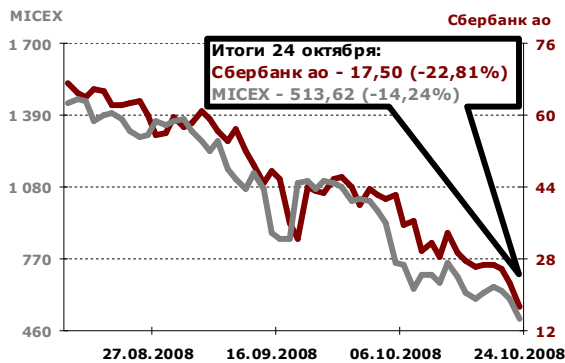
Факторы внешних рынков

отрицательная динамика фьючерсов на американские индексы (в настоящий момент порядка -1,5 %), текущее снижение цен на нефть (на уровне 1 %), отрицательная динамика азиатских бирж, негативное закрытие США и Европы по итогам пятницы

Итоги предыдущего дня, 24 октября	2
Календарь событий на сегодня	5
Итоги торгов, ММВБ, 24 октября	6
Итоги торгов российскими ADR/GDR, 24 октября	7

Итоги предыдущего дня, 24 октября

Российский фондовый рынок



В последний день недели на фоне сильного падения на внешних торговых площадках (в особенности на площадках Америки, которые продолжают свое снижение на фоне негативных данных статистики и отрицательной отчетности компаний) российский рынок ушел в зону сильного снижения, торги на нем были остановлены во второй половине дня в связи с падением значения технического индекса акций более чем на 10%. Фондовая биржа ММВБ приостановила торги акциями в режиме основных торгов с 14.10 МСК пятницы до вторника 28 октября или до особого распоряжения ФСФР. За период торгов индексы ММВБ и РТС потеряли 14,24% и 13,68% соответственно.

Макроэкономический фон

Остатки денежных средств кредитных организаций на депозитных счетах в Банке России на 27 октября составляют 229,7 млрд. руб. Остатки на корсчетах коммерческих банков на начало операционного дня 27 октября составили по России 506,1 млрд. руб. Объем денежной базы в узком определении в России на 20 октября составил 4 527,1 млрд. руб. Между тем, на 13 октября денежная база в России составляла 4476,7 млрд. руб., рост за неделю 1,13%.

Банки

Банковский сектор, на фоне негативного внешнего фона, демонстрировал отрицательную динамику. За период торгов отраслевой индекс MICEX FNL потерял 8,72%. Акции Сбербанка стали дешевле на 22,62%, акции ВТБ потеряли 9,39%.

Нефть и газ

Нефтегазовый сектор российского рынка также отыгрывал внешний фон. За время торгов отраслевой индекс MICEX O&G потерял 11,31%. Акции Лукойла и Роснефти за период торгов стали дешевле на 19,94% и 18,18%, бумаги Газпрома потеряли 21,62%. Усилило негативную ситуацию в секторе отрицательная динамика цены на нефть, которая подешевела на 7%.

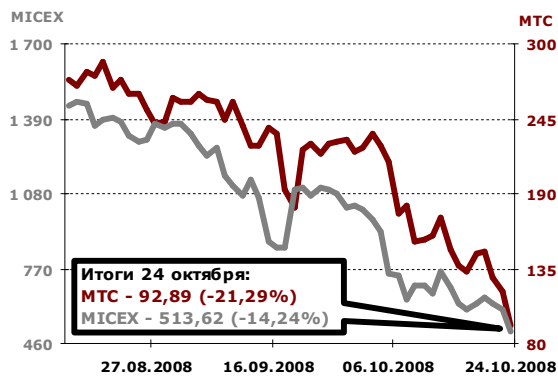
Металлургия

Отраслевой индекс MICEX M&M потерял за короткое время торгов в пятницу 15,48%. Акции Полюс Золота и ГМК Норильский никель стали дешевле на 11,76% и 24,03%. Равно как и в нефтегазовом секторе, сильное давление на бумаги компаний оказывает снижение цен на сырьевые товары.

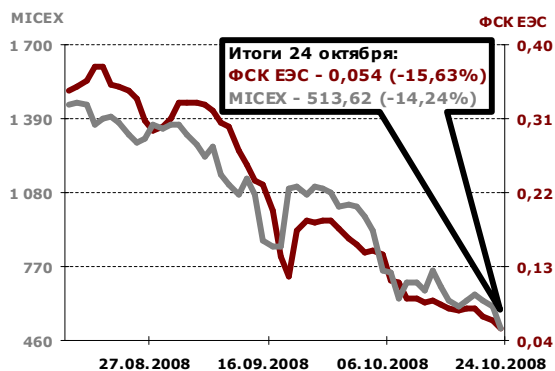
Телекоммуникации

Отрасль телекоммуникаций также показывала движение внутри красной зоны. Отраслевой индекс MICEX TLC потерял за время торгов 10,9%. Акции МТС потеряли за время торгов 21,29%, тогда как акции компании Сибирьтелекома потеряли 5,49%.

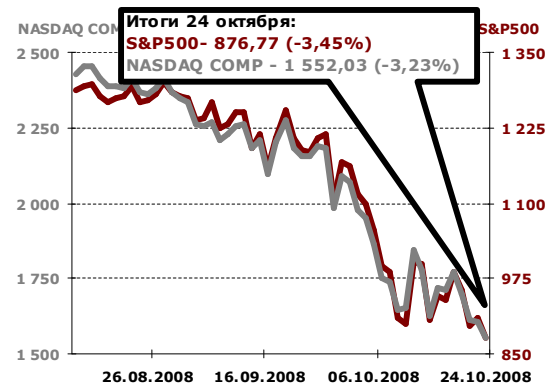
Энергетика



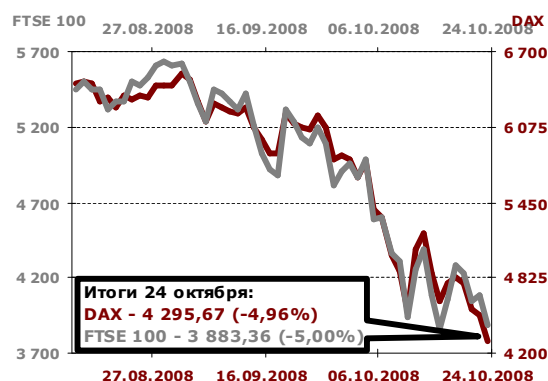
За время торгов отраслевой индекс электроэнергетики опустился на 14,5 %. Акции ТГК-4, ТГК-2 и ОГК-2 потеряли за время торгов 24,29 %, 18,75 % и 16,67 % от уровней закрытия предыдущего дня. Акции ОГК-5 показали менее сильное снижение, потеряв за период торгов 8,67 %



Зарубежные фондовые рынки



Распродажи бумаг во всем мире продолжаются. Американский фондовый рынок по итогам пятницы вновь закрылся в красной зоне: DJIA потерял в стоимости 3,59 %, S&P 500 упал до минимума с апреля 2003 г., просев на 3,45 %; NASDAQ снизился на 3,23 %. Правительство США на фоне ускоряющегося падения финансового рынка предпринимает новые попытки по спасению национальной экономики. На этот раз Минфин США рассматривает возможность выкупа долей в капиталах страховых компаний, на балансе которых находится до 1,3 трлн. долл. обязательств корпоративного долга. Этот шаг будет направлен, в первую очередь, на укрепление доверия населения к американской экономике.

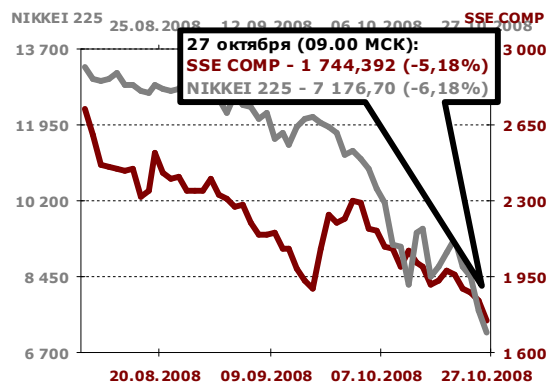


Участники нефтяного рынка также продолжили закрывать длинные позиции. По итогам торгов в пятницу цены на нефть марки WTI просели еще на 5,5 % до 64 долл. за баррель несмотря на принятие решения странами ОПЕК о снижении добычи нефти на 1,5 млн. баррелей в сутки. Нефтяные котировки неожиданно откатились вниз сразу после обнародования решения ОПЕК: по видимому, ожидания уже были заложены в текущих уровнях цен на нефть. Представители картеля также заявили о том, что до конца года возможно еще одно сокращение добычи ОПЕК (до 1,8 млн. сутки).

Европейские индексы продолжили следовать общемировой отрицательной динамике: FTSE 100 упал на 5,00 %, DAX – на 4,96 %.

В минусе с утра торгуются и азиатские рынки (Nikkei 225 -6,10 %, HANG SENG -4,20 %). Нефтяные фьючерсы и фьючерсы на индексы США также припадают в среднем на 1 % и 1,5 % соответственно.

Еще одна неделя завершилась для мировых фондовых и сырьевых рынков значительным снижением котировок. Стимулов к росту нет – падение рынков продолжится



Календарь событий на сегодня:

Макроэкономика

Германия: индекс текущей экономической ситуации (IFO)

13.00 МСК – индекс текущей экономической ситуации в Германии за октябрь (IFO). Прогноз – значение индекса на уровне 97,0. Значение за предыдущий месяц (сентябрь) – значение 99,8

Германия: индекс экономических ожиданий (IFO)

13.00 МСК – индекс экономических ожиданий в Германии за октябрь (IFO). Прогноз – значение индекса на уровне 85,0. Значение за предыдущий месяц (сентябрь) – значение 86,5

США: продажи нового жилья

18.00 МСК – продажи нового жилья (новостроек) в США за сентябрь. Прогноз – 455 тыс. домов (снижение на 1,1 % к уровню предыдущего месяца). Значение за предыдущий месяц (август) – 460 тыс. домов (снижение к июлю на 11,5 %)

Итоги торгов, ММВБ, 24 октября:

	Закр.	Макс.	Мин.	Объем, тыс. руб.	Изм., %/ день	Изм., %/ нач.нед.	Изм., %/ нач.мес.	Изм., %/ нач.год.
Нефть и газ								
Газпром	86,6	100,04	84	5 705 127	-15,92	-16,21	-56,26	-74,74
Роснефть	84	94,75	80,1	807 749	-14,29	-13,40	-50,99	-63,75
ЛУКОЙЛ	740,22	875	735	1 900 737	-15,88	-10,38	-51,30	-64,19
Сургутнефтегаз ао	12,999	13,643	12,4	258 017	-4,42	0,77	-3,28	-55,94
Сургутнефтегаз ап	4,541	5,1	4,45	95 773	-13,01	-19,70	-35,11	-70,80
Татнефть ао	27,94	32,44	27,51	48 618	-17,04	-14,32	-69,11	-81,12
Татнефть апЗ	17	18,38	16,45	5 309	-6,9	-6,34	-64,17	-80,46
Газпром нефть	40,15	45,2	35,02	26 079	-11,15	-7,10	-63,47	-73,76
Металлургия								
Нор.Никель	1570	1900	1525	1 374 505	-20,71	-13,02	-54,87	-75,70
Полюс Золото	420	463,3	417,54	42 021	-11,58	-7,89	-45,81	-62,73
Северсталь	79,01	98,5	75	30 435	-20,43	-26,84	-70,95	-85,88
ММК	4,511	5,201	4,308	3 354	-14,97	-16,46	-68,67	-85,68
НЛМК	18,01	22,11	18	6 491	-19,09	-15,72	-64,69	-81,90
Полиметалл	70,5	79,09	70,15	1 680	-12,42	-18,91	-43,15	-59,30
Белон	720	829,99	720	142	-13,57	-28,00	-75,60	-68,42
ТМК	48,01	55,5	48,01	71	-17,22	-31,31	-67,79	-82,28
ВСМПО-АВИСМА	1797	1939	1700	529	-7,28	-10,19	-33,93	-77,40
Распадская	37	43,09	35,55	6 593	-15,04	-25,22	-65,39	-76,58
Банки								
Сбербанк	17,5	21,77	17,05	2 117 912	-22,81	-33,16	-59,95	-82,84
Сбербанк ап	7,9	9,5	7,5	148 804	-18,56	-30,21	-68,15	-88,71
Банк ВТБ	0,0299	0,0341	0,0293	668 982	-9,39	-3,24	-40,79	-76,25
Банк Москвы	602	630	602	452	-4,14	-10,15	-24,01	-54,67
Банк Возрождение ао	280	309,97	270	444	-13,04	-15,92	-61,64	-83,23
Банк Возрождение ап	85	97,99	71	27	-11,46	-15,00	-70,59	-89,95
Телекоммуникации								
МТС	92,89	113,02	89,2	43 647	-21,29	-29,93	-58,46	-75,39
Ростелеком ао	177	190	173,03	5 145	-7,18	-3,15	-3,28	-38,67
Ростелеком ап	14,28	16,13	13,91	18 631	-10,75	-4,99	-28,10	-79,46
СЗТ ао	7,25	7,75	7,25	575	-5,84	-4,61	-51,67	-82,40
СЗТ ап	7,21	7,6	7,2	1 295	-6,36	-0,55	-39,91	-76,01
Сибирьтелеком ао	0,428	0,48	0,383	1 658	-10,83	-2,51	-43,68	-85,23
Сибирьтелеком ап	0,328	0,369	0,32	322	-11,35	-11,83	-50,45	-83,45
Уралсвязьинформ ао	0,313	0,343	0,297	49 704	-9,54	8,68	-32,69	-79,16
Уралсвязьинформ ап	0,233	0,272	0,22	1 762	-9,34	1,75	-31,07	-76,98
ВолгаТелеком ао	18,12	22,5	18,12	2 642	-19,43	3,60	-52,78	-87,38
ВолгаТелеком ап	15,79	17,3	15	788	-10,39	-9,15	-52,14	-84,67
Дальсвязь ао	15,13	17,68	15,12	341	-15,94	-24,35	-63,80	-88,36
Дальсвязь ап	14	15,45	14	569	-7,89	-15,15	-64,00	-87,04
Центр.телеком ао	4,25	0	0	0	0	-2,99	-43,33	-80,23
Центр.телеком ап	3,5	3,8	3,5	41	-10,94	-22,22	-35,41	-76,97
Энергетика								
ОГК-1	0,17	0,219	0,17	652	-26,09	-38,18	-76,39	-94,44
ОГК-2	0,24	0,295	0,24	1 131	-16,67	-21,31	-48,94	-93,59
ОГК-3	0,33	0,458	0,301	860	-29,79	-38,32	-59,31	-91,01
ОГК-4	0,514	0	0	0	0	-27,09	-54,91	-84,26
ОГК-5	1,169	1,25	1,15	3 260	-8,67	-8,17	-28,28	-72,93
ОГК-6	0,196	0,229	0,18	2 371	-14,41	-29,24	-60,96	-94,38
ТГК-1	0,0025	0,003	0,0024	1 029	-16,67	-24,24	-72,22	-92,19
ТГК-2 ао	0,0065	0,0079	0,0062	16	-18,75	-32,99	-70,32	-73,14
ТГК-4 ао	0,0106	0,0132	0,0105	119	-24,29	17,78	-56,91	-64,31

	Закр.	Макс.	Мин.	Объем, тыс. руб.	Изм., %, день	Изм., %, нач.нед.	Изм., %, нач.мес.	Изм., %, нач.год.
ТГК-5	0,0031	0,0038	0,0029	2 187	-18,42	10,71	-50,00	-85,84
ТГК-6	0,0031	0,0037	0,0028	517	-18,42	10,71	-48,33	-88,77
ТГК-8	0,0317	0,0343	0,0317	2 346	-3,94	40,27	-10,20	-8,12
ТГК-9	0,0013	0,0014	0,0012	1 568	-7,14	18,18	-48,00	-83,54
ТГК-10	25,04	41,65	24,5	231	-21,75	-23,82	-41,77	-73,92
ТГК-11	0,0081	0	0	0	0	-26,36	-48,41	-73,00
ТГК-13	0,0403	0,0415	0,033	709	0	-5,18	-32,72	-84,40
ТГК-14	0,002	0,0022	0,002	573	0	-23,08	-62,26	-76,47
МосЭнерго	0,691	0,91	0,69	4 180	-23,73	-26,49	-54,24	-88,35
ИркЭнерго	8,361	9,001	7,3	486	-4,99	-0,92	-39,85	-71,65
ФСК ЕЭС	0,054	0,063	0,05	7 495	-15,63	-29,87	-65,38	-84,75
Русгидро	0,409	0,471	0,395	26 128	-13,89	8,49	-53,52	-80,56
МОЭСК	0,785	0,9	0,7	215	-18,99	-41,20	-56,34	-67,96
Мосэнергосбыт	0,072	0,077	0,067	208	-7,69	-19,10	-55,83	-83,75
Московская теплосетевая компания	0,55	0,55	0,458	2 038	-2,83	4,17	12,24	-34,05
Машиностроение								
Автоваз ао	5,9	6,35	5,9	494	-8,94	-7,67	-49,70	-87,45
Автоваз ап	2,21	2,6	2,16	1 146	-17,47	-23,79	-58,69	-87,86
КАМАЗ	37	41	37	351	-9,76	-10,86	-37,18	-70,65
СОЛЛЕРС	252,11	299,99	250,02	229	-21,21	-24,52	-66,83	-81,20
ОМЗ	75,85	0	0	0	0	-21,80	-42,53	-60,70
ИРКУТ	3,5	4,779	3,333	15	-18,6	-30,00	-53,34	-84,69
Химия								
Уралкалий	87,99	96,08	86,01	26 898	-11,03	-10,52	-43,56	-52,18
Акрон	436,8	554,41	435,04	2 279	-17,59	-16,48	-56,32	-64,63

Итоги торгов российскими ADR/GDR, 24 октября:

Биржа	Тип	Закр.	Макс.	Мин.	Объем, млн. долл.	Изм., %, день	Изм., %, нач.нед.	Изм., %, нач.мес.	Изм., %, нач.год.	Кол-во акций в ADR, шт.	Цена 1 акции ис- ходя из цены DR, руб.	
Нефть и газ												
Газпром	LSE	ADR	12,00	15,03	11,20	460,240	-21,05	-22,23	-61,23	-78,84	4	80,94
Роснефть	LSE	GDR	2,62	3,39	2,47	79,880	-24,28	-20,36	-61,01	-72,99	1	70,69
Сургутнефтегаз ао	LSE	ADR	5,35	5,35	4,39	53,817	2,88	10,31	3,88	-56,36	10	14,43
Металлургия												
ГМК Норильский Никель	LSE	ADR	4,85	6,19	4,85	35,760	-19,17	-30,71	-64,52	-82,09	0,1	1 308,50
Северсталь	LSE	GDR	3,23	3,50	2,60	6,947	-0,13	-15,45	-68,94	-86,08	1	87,14
Мечел	NYSE	ADR	5,40	6,34	5,11	5,095	-26,13	-34,70	-69,93	-83,32	1	145,69
Банки												
Сбербанк	FWB	GDR	83,00	96,00	77,6	0,925	-18,63	-30,25	-55,33	-77,63	100	22,39
Телекоммуникации												
МТС	NYSE	GDR	22,16	24,89	21,05	34,902	-20,83	-48,18	-60,44	-78,23	5	119,57
Вымпелком	NYSE	ADR	7,39	7,87	6,39	31,555	-17,89	-46,95	-63,60	-82,24	0,05	3 987,54
Прочие												
Вимм-Билль-Данн	NYSE	ADR	33,96	35,00	31,05	1,773	-6,52	-33,88	-52,17	-74,08	1	916,22

Контакты

ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство»
197198, Санкт-Петербург, Большой пр. ПС, 48-А,
Тел.: + 7 (812) 329-81-81, факс: + 7 (812) 329-81-80
info@bfa.ru
www.bfa.ru

Аналитический отдел

Дзугаев Роман ведущий аналитик	r.dzugaev@bfa.ru
Плешаков Георгий ведущий аналитик	g.pleshakov@bfa.ru
Микрюкова Мария аналитик	m.mikryukova@bfa.ru

Управление по работе с клиентами

client@bfa.ru

Константинова Виктория начальник управления	+7 (812) 329-81-91 v.konstantinova@bfa.ru
Кукушкина Екатерина начальник клиентского отдела	+7 (812) 329-81-96 e.kukushkina@bfa.ru
Щекина Елена специалист клиентского отдела	+7 (812) 329-81-71 e.schekina@bfa.ru
Вящеславова Вероника специалист клиентского отдела	+7 (812) 329-81-71 v.vyascheslavova@bfa.ru
Ефанова Александра специалист клиентского отдела	+7 (812) 329-81-73 a.efanova@bfa.ru

Отдел брокерских операций

+7 (812) 329-81-95

Шевцов Павел начальник отдела	p.shevtsov@bfa.ru
Тураев Дмитрий заместитель начальника отдела	d.turaev@bfa.ru
Мишарев Андрей специалист отдела брокерских операций	a.misharev@bfa.ru

Настоящий обзор подготовлен аналитическим отделом ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и носит исключительно информационный характер. Данная информация не может рассматриваться как обязательство компании по заключению сделок с инвестиционными инструментами, упоминаемыми в публикации. Информация, содержащаяся в обзоре, получена из источников, признаваемых нами достоверными, однако ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» не несет ответственности за точность представленных данных. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство», ее клиенты и сотрудники могут иметь позицию или какой-либо интерес в любых сделках и инвестициях прямо или косвенно упоминаемых в настоящей публикации. ЗАО «Балтийское Финансовое Агентство» и ее сотрудники не несут ответственности за прямой или косвенный ущерб, наступивший в результате использования настоящей публикации или ее содержания.

Закрытое акционерное общество «Балтийское Финансовое Агентство»
Аналитический отдел
Тел. (812) 329-81-81