ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

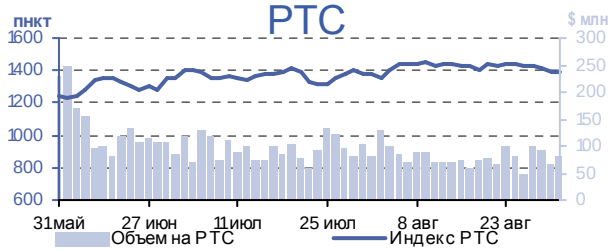
5 сентября 2012г.

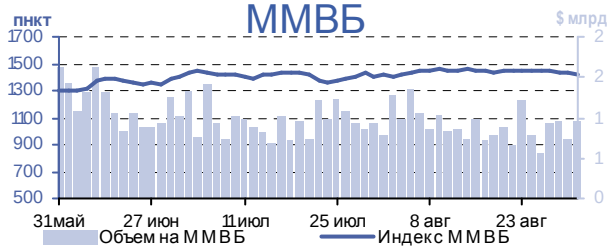
Комментарий по рынку акций

Вчера российские фондовые индексы, хоть и завершили сессию в красной зоне, но торговались они существенно более стабильно, чем рынки акций в Европе. Таким образом наши биржевые индикаторы уже больше месяца удерживают позиции в рамках узкого бокового тренда. Сил на то, чтобы выйти из него, пока нет ни у «быков», ни у «медведей». Внешний фон на утро среды складывается в пользу снижения из-за слабеющих американских фьючерсов (S&P -0,39%), падающих индексов в Азии (MSCI Asia -1,42%) и просевших цен на нефть (Brent $114/барр). Мы ждем, что на открытии торгов котировки ликвидных акций на ММВБ потеряют в цене в пределах половины процента

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



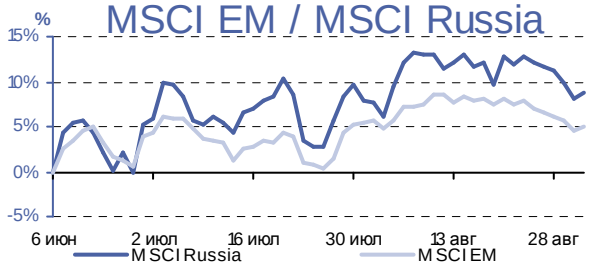


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 389,72	0,39%	-3,28%	-0,62%	-18,44%
Индекс ММВБ	1 422,91	-0,48%	-2,14%	0,11%	-8,29%
FTSE	5 711,48	-0,14%	-1,13%	-1,31%	5,40%
S&P 500	1 406,58	0,51%	-0,32%	1,12%	16,78%
Dow Jones Avg.	13 090,84	0,69%	-0,51%	-0,04%	13,90%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,9060	0,35%	2,14%	10,70%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	13,5000	-6,21%	-10,00%	9,49%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	947,33	0,31%	-0,57%	-8,74%
Индекс MSCI BRAZIL	2597,95	0,48%	-1,90%	-20,44%
Индекс MSCI RUSSIA	751,23	0,74%	-0,56%	-15,17%
Индекс MSCI INDIA	374,35	-1,09%	1,41%	-13,68%
Индекс MSCI CHINA	52,54	-0,46%	-2,56%	-11,67%

Обзор рынка

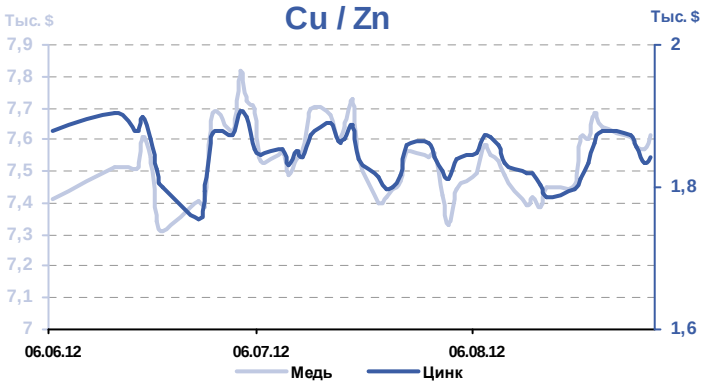
Вчера российские фондовые индексы, хоть и завершили сессию в красной зоне, но торговались они существенно более стабильно, чем рынки акций в Европе. Таким образом наши биржевые индикаторы уже больше месяца удерживают позиции в рамках узкого бокового тренда. Сил на то, чтобы выйти из него, пока нет ни у «быков», ни у «медведей». Внешний фон на утро среды складывается в пользу снижения из-за слабеющих американских фьючерсов (S&P -0,39%), падающих индексов в Азии (MSCI Asia -1,42%) и просевших цен на нефть (Brent $114/барр). Мы ждем, что на открытии торгов котировки ликвидных акций на ММВБ потеряют в цене в пределах половины процента.

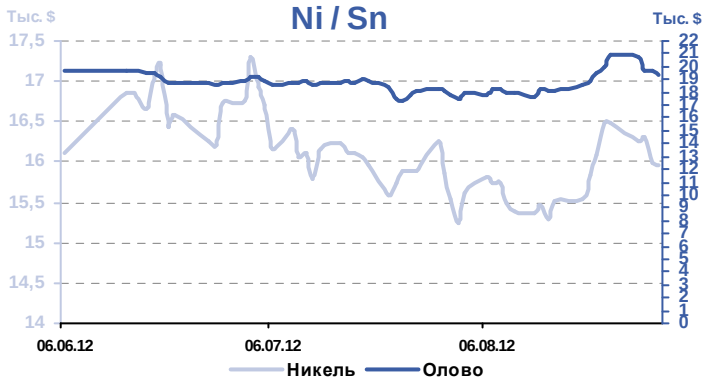
Ослабление позиций доллара (EUR/USD 1,2525) в купе публикацией слабых данных по индексу ISM в обрабатывающей промышленности США за август столкнуло цена на «черное золото» в область недельных минимумов. Цены на промышленные металлы в среду утром держатся довольно стабильно, даже, несмотря на то, что Китай в очередной раз выдал слабые статданные: деловая активность в секторе услуг Китая в августе снизилась до 52,0 п. против 53,1 п. Кстати, сегодня китайский фондовый индекс Shanghai Comp, опустившись к отметке 2030 п. обновил минимум с начала февраля 2009 года.

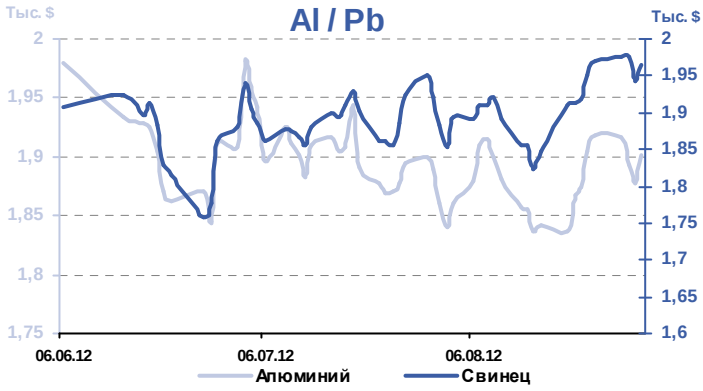
А вот американские инвесторы пока не спешат продавать свои акции по ряду причин. Во-первых, очень многие игроки ждут публикации в пятницу данных по рынку труда в США. В зависимости от них, рынок скорректирует свои ожидания относительно запуска новых стимулирующих программ в Америке. Во-вторых, Apple 12 сентября намерена провести презентацию 5-й версии iPhone. На ожиданиях этого события акции компании будут удерживать заокеанские индексы возле текущих отметок. Несколько подпортить эту тему может Motorola, которая совместно с Google 5 представит новую версию своего смартфона, а также Nokia, которая на базе Windows Phone 8 презентует следующее поколение смартфонов Lumia.

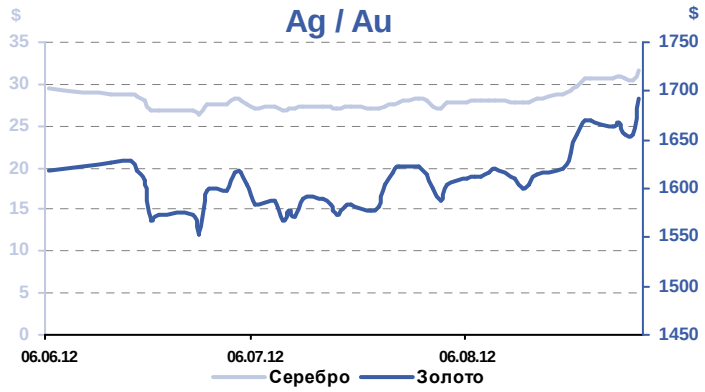
Таким образом, общая расстановка сил на мировых рынках не станет кардинально меняться до конца этой недели. Тем более, что завтра пройдет заседание ЕЦБ по учетной ставке. Поэтому дабы сохранить месячный тренд, локальные снижения участники рынка постараются в очередной раз выкупить. По индексу ММВБ ближайший сильный уровень поддержки по индексу ММВБ находится возле отметки 1420 п. Слабость будут сохранять акции наших банков. За счет ослабления курса рубля мы ожидаем просадку фьючерса РТС к уровню 139500 п. Пробой этого рубежа столкнет фьючерс опять на 138 тыс. п. Компания Дикси сегодня отчитается по МСФО за 2 квартал и 1 полугодие 2012 года. Днем ждем данных по деловой активности в секторе услуг ведущих стран еврозоны и по розничным продажам

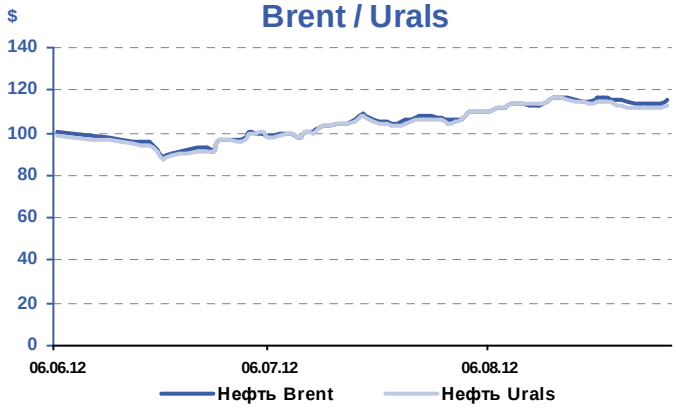
Commodities

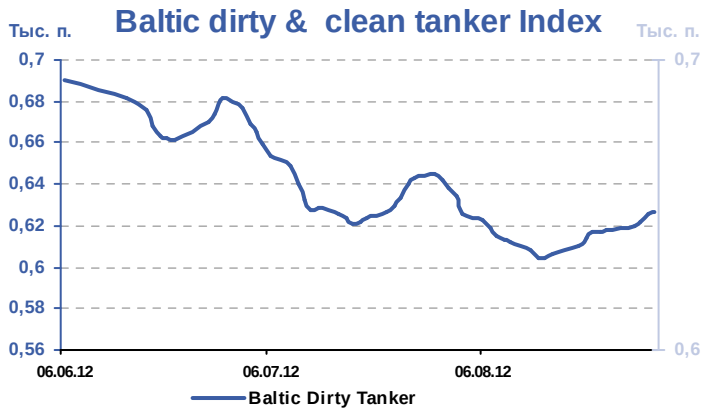












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 615,00	0,63%	-0,33%	2,28%	-16,73%
Цинк, $/t	1 841,00	0,38%	-2,02%	0,05%	-17,78%
Никель, $/t	15 950,00	-0,16%	-3,19%	2,18%	-26,67%
Олово, $/t	19 400,00	-1,02%	-7,18%	8,38%	-19,98%
Алюминий, $/t	1 902,00	1,33%	-0,83%	2,26%	-22,53%
Свинец, $/t	1 965,00	1,08%	-0,30%	3,69%	-22,94%
Серебро, $/oz	31,73	4,26%	3,10%	14,15%	-23,66%
Золото, $/oz	1 692,01	2,20%	1,28%	5,52%	-7,35%
Нефть Brent, $/	115,46	1,85%	0,28%	5,40%	0,69%
Нефть Urals, $/	113,20	1,33%	0,22%	3,09%	-1,34%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,637	0,00%	0,00%	27 952		39 547
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	50,700	0,00%	0,00%	36 504		8 628
Газпром	GAZP	4,880	0,00%	0,00%	244 000		115 527
Лукойл	LKOH	58,650	0,00%	0,00%	587 250		49 886
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,633	0,00%	0,00%	63 250		4 872
Татнефть	TATN	6,500	0,00%	0,00%	324 500		14 161
Транснефть, п.	TRNFP	1584,000	0,00%	0,00%	60 192		2 463
Электроэнергетика							
ТГК-3	MSNG	0,040	0,00%	0,00%	5 452		1 590
Телекоммуникации							
МГТС, п.	MGTSP	15,120	0,00%	0,00%	75 600		241
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	30,000	0,00%	0,00%	30 000		556
Северсталь-авто	SVAV	13,500	-6,21%	0,00%	13 500		463
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	165,000	0,00%	0,00%	33 000		1 902
НорНикель	GMKN	153,200	0,00%	0,00%	153 200		29 204
Северсталь	CHMF	12,492	0,00%	0,00%	12 492		12 588
СТЗ	SVTZ	3,000	0,00%	0,00%	6 000		144
Банки							
Сбербанк	SBER	2,906	0,35%	0,00%	2 001 763		62 732
Транспорт							
Дальневосточное МП	FESH	0,327	0,00%	0,00%	6 540		965
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	1,120	0,00%	0,00%	5 600		118
Верофарм	VRPH	25,400	0,00%	0,00%	25 400		254
Магнит	MGNT	128,500	0,00%	0,00%	642 500		12 151
Разгуляй	GRAZ	0,579	0,00%	0,00%	144 780		92
Фармстандарт	PHST	46,500	0,00%	0,00%	10 230		1 757
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,125	0,00%	0,00%	12 500		223
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	26 250		490
Химическая промышленность							
Дорогобуж	DGBZ	0,510	0,00%	0,00%	51 000		368
Уголь							
Распадская	rasp	2,324	0,00%	0,00%	19 619		1 815

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	109,822	1,69%	1,21
Башнефть	AK6		EUR	196,000	2,90%	19,60
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,490	22,50%	0,49
ТГК-3	AOMD		USD	3,910	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	38,170	-0,34%	24 727,30
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,796	-2,76%	
X5	FIVE		USD	20,380	2,00%	8 441,91
Газпром	GAZ		EUR	7,705	1,68%	647,27
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,012	-25,00%	0,18
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,650	-10,81%	
Лукойл	LKOD		USD	56,800	-1,39%	308 595,70
Лукойл	LUK		EUR	45,546	-0,34%	514,81
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,820	-1,18%	2 327,12
МТС	MBT	5	USD	18,410	2,56%	51 471,03
МТС	MKY	5	EUR	14,695	2,33%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,100	-1,59%	11,34
Мечел	MTL	3	USD	5,730	2,14%	11 818,82
НорНикель	NILSY	1	USD	14,860	-0,93%	311,81
НорНикель	NNIA		EUR	11,635	-2,60%	91,31
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	119,300	1,10%	43 450,82
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,692	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,950	1,46%	
Газпром	OGZD		USD	9,665	1,31%	226 117,40
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	22,900	-0,91%	2 939,63
Ростелеком	RTL		EUR	18,220	-1,46%	10,27
Газпромнефть	SCF		EUR	18,805	3,75%	11,90
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,883	-0,51%	26,68
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,045	0,54%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,400	0,63%	174,83
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,740	-1,24%	35,22
АФКСистема	SSA	1	USD	19,710	3,14%	8 404,81
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,881	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,080	-0,19%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	92,500	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,630	1,92%	27 300,78
ВТБ	VTBR		USD	3,270	1,55%	33 764,00
Возрождение	VZY		EUR	14,500	0,00%	

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

Наумов Александр
электроэнергетика

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Бохин Александр
abokhin@prsp.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Сильвестров Кирилл
ksilvestrov@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 ОАО "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.