ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

10 июня 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг американские фондовые индексы все же сумели завершить торговую сессию ростом впервые за 7 последних дней. Это был небольшой отскок вверх на низких объемах (торговый оборот вчера составил 6,31 млрд. акций, что на 20% ниже среднегодового уровня), с сохранением перевеса «медвежьих» настроений на биржах. Ряд аналитиков ждет, что в июне индекс S&P-500 опустится к своему мартовскому минимуму – 1250 п., где сейчас проходит 200-дневная скользящая средняя. Из вышедшей вчера статистики можно выделить очередные слабые данные с рынка труда: рост числа первичных обращений за пособием по безработице на 1 тыс. до 427 тыс. Дефицит

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 940,98	1,55%	3,07%	0,68%	45,44%
Индекс ММВБ	1 692,34	1,65%	2,05%	0,85%	28,68%
FTSE	5 856,34	0,82%	0,14%	-2,70%	15,15%
S&P 500	1 289,00	0,74%	-1,82%	-5,02%	22,10%
Dow Jones Avg.	12 124,36	0,63%	-1,01%	-4,98%	22,48%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ММК	0,9800	6,75%	0,51%	20,99%
ОАО Банк Санкт-	5,3700	6,34%	7,40%	59,82%
Северсталь	19,1442	3,45%	5,07%	51,98%
Уралкалий	8,8500	2,49%	1,14%	95,80%
Сбербанк	3,5350	2,32%	0,00%	26,70%
Акрон	45,9000	2,00%	2,91%	61,05%
Башнефть, п.	42,4500	1,31%	-4,97%	57,54%
ОГК-4	0,0863	0,94%	-5,68%	7,88%

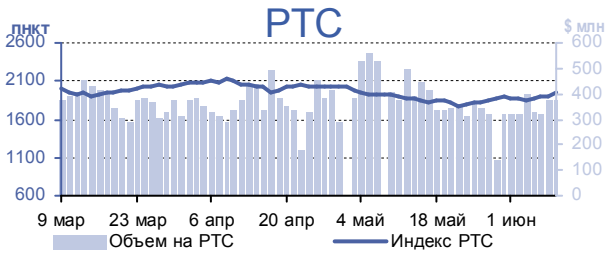
Лидеры снижения

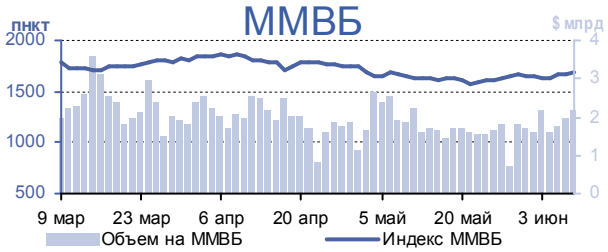
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	137,0000	-4,20%	7,03%	31,10%
ОГК-3	0,0497	-1,80%	4,85%	-15,76%
Распадская	6,0000	-1,64%	-4,00%	31,58%
Башнефть	53,1000	-0,36%	-6,84%	43,90%

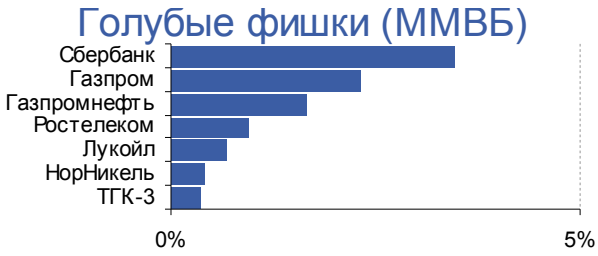
Индекс MSCI

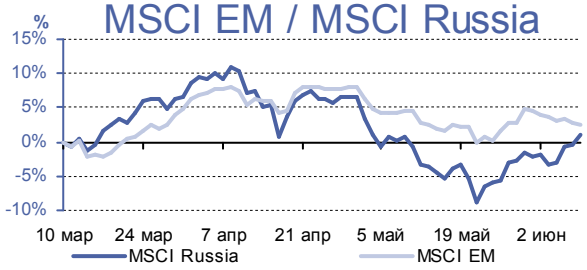
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1142,24	-0,28%	-2,09%	27,59%
Индекс MSCI BRAZIL	3580,63	0,13%	-1,73%	17,57%
Индекс MSCI RUSSIA	1029,48	1,64%	0,47%	44,45%
Индекс MSCI INDIA	499,63	-0,18%	-0,25%	12,73%
Индекс MSCI CHINA	65,13	-1,03%	-4,08%	12,61%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В четверг американские фондовые индексы все же сумели завершить торговую сессию ростом впервые за 7 последних дней. Это был небольшой отскок вверх на низких объемах (торговый оборот вчера составил 6,31 млрд. акций, что на 20% ниже среднегодового уровня), с сохранением перевеса «медвежьих» настроений на биржах. Ряд аналитиков ждет, что в июне индекс S&P-500 опустится к своему мартовскому минимуму – 1250 п., где сейчас проходит 200-дневная скользящая средняя. Из вышедшей вчера статистики можно выделить очередные слабые данные с рынка труда: рост числа первичных обращений за пособием по безработице на 1 тыс. до 427 тыс. Дефицит торгового баланса США сократился в апреле с $46,8 до $43,7 млрд. из-за прироста экспорта на 1,3% до $175,6 млрд. В итоге вчера на NYSE в лидерах роста были акции банков и нефтяников.

На своей вчерашней пресс-конференции глава ЕЦБ Ж.-К. Трише четко дал понять, что его ведомство готово в следующем месяце повысить процентную ставку. Поэтому внятного объяснения существенному ослаблению позиций евро против доллара (EUR/USD 1,4495), кроме как фиксация длинных позиций по евро, пока мы не видим.

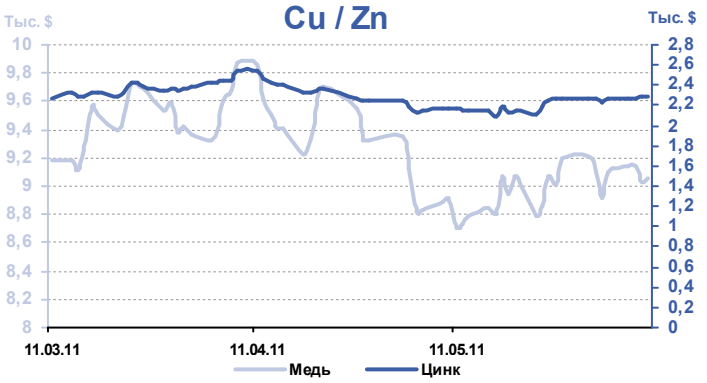
Цены на нефть продолжают лететь вверх благодаря ОПЕК. Якобы участники нефтяного картеля не смогли договориться в части оценки перспектив роста мировой экономики, а значит и объемов потребления нефти. Поэтому в пятницу утром мы видим котировки нефти марки Brent возле уровня $120/барр.

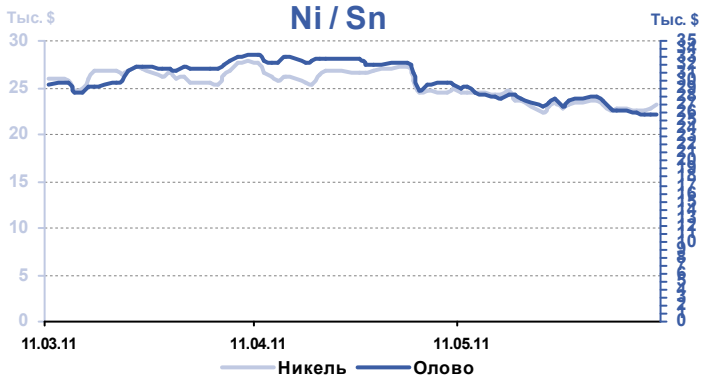
Торги на азиатских биржах сегодня проходят в основном в красной зоне: MSCI Asia -1,3%. Банк Кореи сегодня принял решение ужесточить денежно-кредитную политику и поднял процентную ставку с 3% до 3,25%. Китайская статистика по внешней торговле за май показывает тенденцию на сокращение экспорта: +19,4% г/г против +29,9% в апреле и росту импорта: +28,4% г/г против +21,8% в апреле.

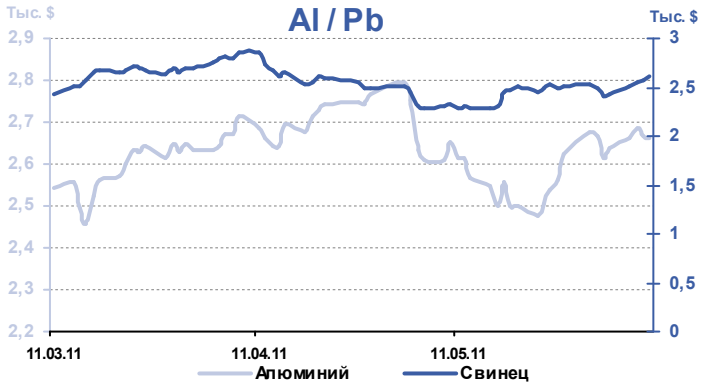
Открытие торгов на российских биржах в пятницу мы увидим в нейтральной зоне. Вчера индексу ММВБ удалось закрепиться выше уровня 1675 п., однако рубеж обороны «медведей» на уровне 1695 п. рынок сходу взять не смог. Всю неделю наши биржевые индикаторы разгонялись вверх бумагами Газпрома и Роснефти. Вчера к ним присоединились акции Сбербанка. То есть пока мы видим лишь спекулятивный спрос в тяжеловесных «индексных» акциях, и такой рост не выглядит прочным. Во втором эшелоне бумаг можно ждать увеличения спроса на акции производителей минеральных удобрений по факту снижения прогноза по объемам производства зерна от Министерства сельского хозяйства США.

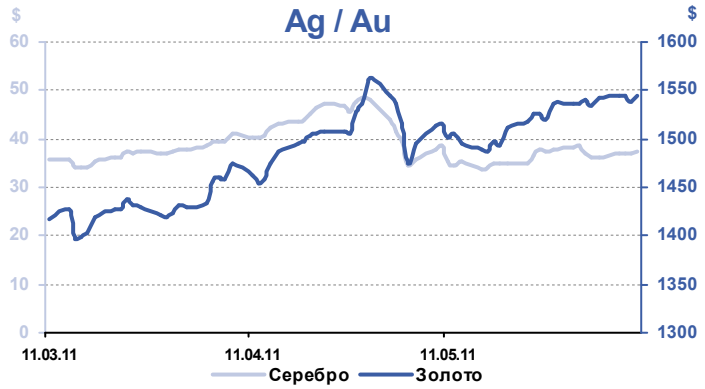
Сегодня в 16-30 ждем данных из США по ценам на экспорт и импорт за май. В 22-00 Минфин США опубликует отчет об исполнении федерального бюджета за май.

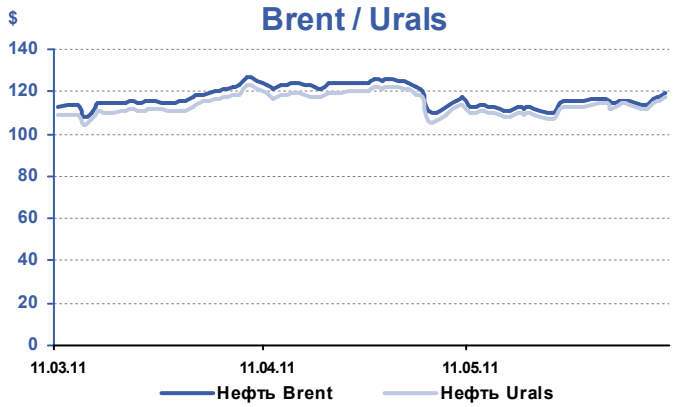
Commodities

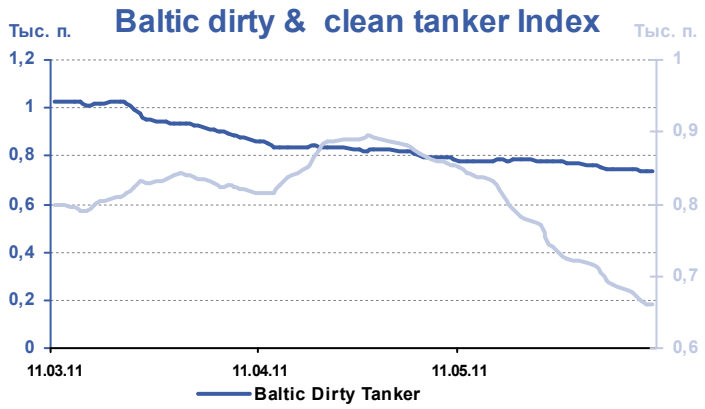












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 055,00	0,27%	1,51%	1,63%	42,82%
Цинк, $/t	2 285,00	-0,35%	2,93%	5,15%	30,27%
Никель, $/t	23 200,00	2,18%	2,77%	-6,64%	20,39%
Олово, $/t	25 705,00	0,04%	-3,36%	-13,16%	57,46%
Алюминий, $/t	2 660,00	-0,30%	1,68%	0,30%	37,97%
Свинец, $/t	2 609,00	1,24%	8,48%	11,73%	55,30%
Серебро, $/oz	37,56	1,98%	3,80%	-2,46%	107,09%
Золото, $/oz	1 544,10	0,42%	0,69%	1,83%	25,18%
Нефть Brent, $/	119,35	1,64%	3,07%	1,50%	62,56%
Нефть Urals, $/	117,27	1,49%	3,23%	2,93%	64,11%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,495	0,00%	0,99%		43 614	246
БашИнСв	BISV	0,465	0,00%	2,91%		13 484	440
БашЭнрг	BEGY	1,586	0,00%	-0,02%		42 011	1 635
ВМЗ	VSMZ	1892,818	0,00%	0,96%		9 464	3 251
ДВМП	FESH	0,496	0,00%	1,51%		23 126	1 465
КазанскВЗ	KHEL	3,609	0,00%	-1,59%		15 552	556
Мечел	MTLR	27,185	0,00%	2,20%		1 964 209	11 180
Мотовил	MOTZ	0,084	0,00%	1,29%		3 104	83
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,130	0,00%	0,00%	1 337 658		47 240
СилМашины	SILM	0,300	0,00%	0,56%		43 510	2 588
СинТЗ-ао	SNTZ	59,519	0,00%	0,59%		60	375
Славн-ЯНОС	JNOS	0,361	0,00%	1,33%		7 916	336
СТЗ-ао	SVTZ	5,588	0,00%	0,00%		464	248
ТАГМЕТ	TAMZ	0,812	0,00%	0,00%		5 996	407
ТНК-ВР	TNBP	3,263	0,00%	2,67%		3 733 889	48 831
У-УАЗ	UUAZ	2,059	0,00%	-1,14%		117 304	553
ЧМК	CHMK	288,291	0,00%	14,23%		175 408	840
ЧТПЗ	CHEP	2,625	0,00%	-1,09%		50 877	1 239
ЮжКузб.	UKUZ	55,524	0,00%	0,65%		277 366	1 992
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,100	-0,36%	0,00%	1 662 327		9 036
Газпром	GAZP	7,490	0,00%	2,32%	187 250	680 523 536	177 315
Газпромнефть	SIBN	4,500	0,00%	1,67%	90 000	5 176 844	21 336
Лукойл	LKOH	64,400	0,47%	0,67%	322 000	138 470 693	54 776
Мегионнефтегаз	MFGS	15,900	0,00%	0,00%	3 959		1 582
НОВАТЭК	NVTK	13,400	0,00%	0,00%	53 600		40 687
Роснефть	ROSN	9,050	0,00%	1,59%		118 691 385	95 188
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	1,45%	605 333	36 819 161	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,500	0,00%	1,26%	350 000	4 782 278	3 851
Татнефть	TATN	5,480	0,00%	0,00%	137 000		11 939
Татнефть, п.	TATNP	2,890	0,00%	0,00%	1 391 800		426
Транснефть, п.	TRNFP	1525,000	0,00%	0,58%	76 250	15 210 025	2 371
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,550	0,00%	0,00%	14 438		1 616
Иркутскэнерго	IRGZ	0,772	0,00%	1,76%		119 913	3 671
Ленэнерго	LSNG	0,670	0,00%	0,00%	5 360	4 473	620
МОЭСК	MSRS	0,045	0,00%	2,19%	6 798	242 220	2 206
ОГК-2	OGKB	0,048	0,00%	0,00%	56 551		1 584
ОГК-3	OGKC	0,050	-1,80%	-1,34%	69 033	534 458	2 360
ОГК-4	OGKD	0,086	0,94%	0,00%	19 849		5 441
ОГК-5	OGKE	0,086	0,00%	-0,83%	8 550	750 536	3 024
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,095	0,00%	0,37%	23 750	835 445	3 776
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-0,35%		122 364	575
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,93%	60 344	114 727	689
Телекоммуникации							
МГТС, п.	MGTSP	15,250	0,00%	0,00%	15 250		243
МТС	MTSS	8,200	0,00%	0,00%	98 400		16 945
Ростелеком	RTKM	5,500	0,00%	0,94%	177 348	2 296 154	16 188
Ростелеком, п.	RTKMP	3,300	0,00%	-0,77%	33 000	1 652 523	796
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	1,50%		41 330	165
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,913	0,00%	0,72%	58 494	96 015	1 267
ГАЗ	GAZA	42,500	0,00%	0,00%	21 250		787
ИРКУТ	IRKT	0,330	0,00%	0,83%		14 952	321
КАМАЗ	KMAZ	2,078	0,00%	1,28%	55 070	61 677	1 470
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	3,440	0,00%	0,00%	1 066 400	146 309	122
РКК Энергия	RKKE	292,040	0,00%	-0,83%		2 920	328

Северсталь-авто	SVAV	18,760	0,00%	1,26%	52 668	524 035	643
Силовые машины	SILM	0,290	0,00%	0,00%	11 629		2 526
УМПО	UFMO	0,630	0,00%	0,00%	2 016		179
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,470	0,00%	0,00%	11 750		234
ВСМПО	VSMO	147,500	0,00%	-0,62%	36 875	1 216 823	1 701
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	6,75%	5,61%	24 500	5 075 081	10 951
НЛМК	NLMK	3,580	0,00%	2,97%	322 500	11 220 708	21 456
НорНикель	GMKN	250,167	0,00%	0,41%	11 758	94 989 185	47 689
Полиметалл	PMTL	17,400	0,00%	1,34%	143 196	2 564 529	6 989
Полюс Золото	PLZL	71,750	0,00%	-0,28%	97 913	7 916 974	13 678
Северсталь	CHMF	19,144	3,45%	2,41%	89 004	40 555 913	19 292
ТМК	TRMK	4,893	0,00%	1,21%		367 122	4 568
ЧТПЗ	CHEP	2,600	0,00%	0,00%	26 000		1 228
Банки							
Банк Москвы	MMBM	32,388	0,00%	-1,96%		88 744	5 860
Возрождение	VZRZ	35,750	0,70%	0,78%	35 750	181 508	849
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	2,44%	6 300	71 991 897	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,801	0,00%	0,00%		13 451	4 713
Сбербанк	SBER	3,535	2,32%	0,00%	1 792 670		76 634
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,500	0,00%	0,46%	125 000	6 742 336	2 777
Дальневосточное МП	FESH	0,493	0,00%	0,00%	24 625		1 453
НМТП	NMTP	0,122	0,00%	-0,44%		223 808	2 336
Приморское МП	PRIM	0,175	0,00%	-0,12%		7 162	139
Ютэйр	TMAT	0,520	0,00%	0,00%	52 000		300
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,200	0,00%	0,00%	40 240		326
Балтика	PKBA	48,750	0,00%	0,44%	48 750	332 819	7 396
Верофарм	VRPH	43,200	-0,12%	0,00%	259 200		432
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	0,21%	33 132	17 955	5 808
ГУМ	GUMM	1,470		0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	14,200	0,78%	0,52%	28 400	131 097	1 221
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	1,77%	100 000	461 039	488
Красный Октябрь	KROT	11,000	0,00%	2,16%	69 509	9 557	101
Магнит	MGNT	137,000	-4,20%	0,62%	1 233 000	1 069 980	12 190
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,356	0,00%	1,62%		57 768	22
Разгуляй	GRAZ	2,040	0,00%	0,69%	20 400	135 422	323
Фармстандарт	PHST	77,750	0,32%	1,87%	77 875	48 731	2 938
Черкизово	GCHE	28,162	0,00%	-2,11%		32 062	1 218
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,220	0,00%	0,00%	11 000		393
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,895	0,00%	-0,61%	204 284	33 416	1 442
Уфанефтехим	UFNC	5,650	0,00%	0,00%	56 500		1 556
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	205,000	0,00%	0,00%	8 200		286
ПИК	pikk	3,860	0,00%	0,74%	10 004	2 950 619	1 904
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	0,00%	4 964	1 115 118	200
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,900	2,00%	1,12%	375 459	2 212 403	2 189
Дорогобуж	DGBZ	0,597	0,00%	1,88%		46 574	424
Уралкалий	URKA	8,850	2,49%	2,04%	88 500	63 844 028	18 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,663	0,00%	0,00%	5 399		762
Распадская	rasp	6,000	-1,64%	-0,72%	60 000	15 077 356	4 685
УК Южный Кузбасс	UKUZ	55,000	0,00%	0,00%	135 575		1 986

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	177,400	3,14%	
Башнефть	AK6		EUR	179,000	0,51%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,220	1,67%	5,19
ТГК-3	AOMD		USD	9,580	1,91%	11,44
Татнефть	ATAD		USD	40,090	0,48%	7 612,68
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,126	0,32%	9,38
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	34,250	4,23%	60 131,43
X5	FIVE		USD	40,660	-0,39%	14 288,51
Газпром	GAZ		EUR	10,535	3,08%	3 015,25
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,500	6,25%	5,10
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,300	0,00%	6,60
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	4,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,850	-10,15%	0,17
Лукойл	LKOD		USD	64,750	0,47%	225 811,60
Лукойл	LUK		EUR	44,575	0,77%	454,38
Лукойл	LUKOY	1	USD	64,790	1,20%	3 909,54
МТС	MBT	5	USD	19,710	0,92%	40 433,19
МТС	MKY	5	EUR	13,575	1,57%	12,55
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,440	-0,39%	45,95
Мечел	MTL	3	USD	27,040	2,85%	40 814,62
НорНикель	NILSY	1	USD	25,350	0,64%	140,66
НорНикель	NNIA		EUR	17,465	0,95%	38,10
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	143,100	1,42%	49 855,51
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	3,438	-0,03%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,850	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,950	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	15,300	2,41%	563 541,10
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	-5,26%	
Ростелеком	RKMD		USD	35,000	0,43%	223,87
Ростелеком	RTL		EUR	24,120	1,56%	
Газпромнефть	SCF		EUR	15,735	0,22%	104,63
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,750	2,20%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,580	2,05%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,150	0,78%	142,43
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,770	0,93%	147,18
АФКСистема	SSA	1	USD	26,050	0,00%	13 265,10
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	15,360	-0,49%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	35,280	-0,49%	
СТЗ	SVY		EUR	41,785	13,53%	
ЦУМ	THT		EUR	18,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	33,700	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	372,920	-4,76%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	14,030	1,15%	33 027,59
ВТБ	VTBR		USD	6,235	2,21%	43 132,22
Возрождение	VZY		EUR	23,500	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

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@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.