ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

15 июня 2011г.

Комментарий по рынку акций

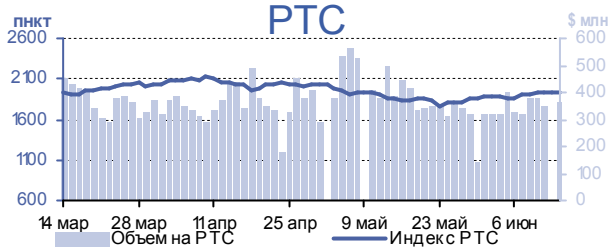
Во вторник фондовые индексы США показали хорошую коррекцию вверх после продолжительной серии снижения. Не думаю, что инвесторов очень порадовала статистика по розничным продажам: снижение в мае на -0,2% м/м (прогноз -0,5% м/м) или рост индекса цен производителей на +0,2% м/м, +7,3% г/г (прогноз 0,0% м/м, +6,6% г/г). Просто индексы вошли в фазу перепроданности в начале этой недели, и им нужно было немного скорректироваться. Лидерами роста вчера стали бумаги строительного сектора, автомобильных компаний и сектора добычи природных ресурсов.

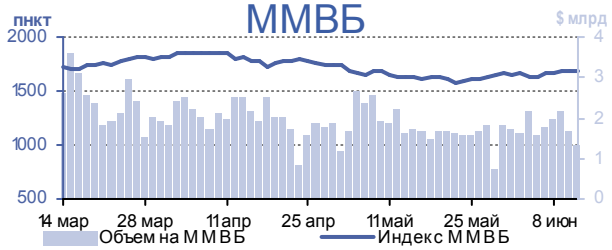
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 925,56	-0,02%	1,12%	3,18%	37,88%
Индекс ММВБ	1 681,66	-0,14%	1,14%	3,03%	22,63%
FTSE	5 803,13	0,65%	-1,05%	-2,07%	11,55%
S&P 500	1 287,87	1,33%	0,23%	-3,73%	18,19%
Dow Jones Avg.	12 076,11	1,04%	0,04%	-4,13%	18,50%

Основные индикаторы





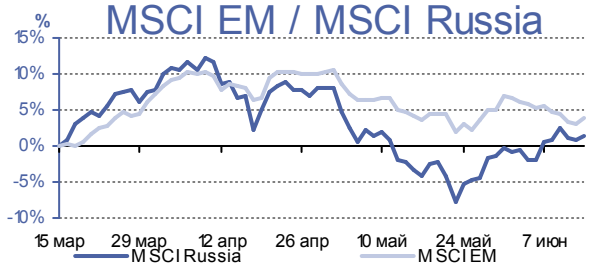
Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Татнефть	6,0400	10,22%	7,28%	25,83%
ОГК-2	0,0518	7,02%	-8,32%	-1,89%
Башнефть, п.	44,5000	4,09%	5,95%	58,36%
ОГК-4	0,0910	4,00%	11,66%	13,75%
Башнефть	54,5000	2,64%	-3,37%	49,93%
Транснефть, п.	1555,0000	1,97%	7,24%	52,75%
Акрон	46,4500	1,20%	5,81%	57,46%
НорНикель	253,0000	1,13%	-2,69%	51,04%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Группа ЛСР	35,0000	-7,04%	-2,78%	30,31%
ТГК-3	0,0936	-1,47%	-4,97%	-7,33%
ГАЗ	41,9000	-1,41%	-6,89%	61,15%
ОГК-3	0,0492	-1,01%	3,80%	-16,61%



Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1134,40	0,49%	-0,90%	21,94%
Индекс MSCI BRAZIL	3548,68	0,62%	2,20%	11,55%
Индекс MSCI RUSSIA	1018,99	0,15%	3,78%	40,95%
Индекс MSCI INDIA	497,70	0,13%	-0,57%	6,78%
Индекс MSCI CHINA	64,86	0,42%	-4,17%	8,99%

Обзор рынка

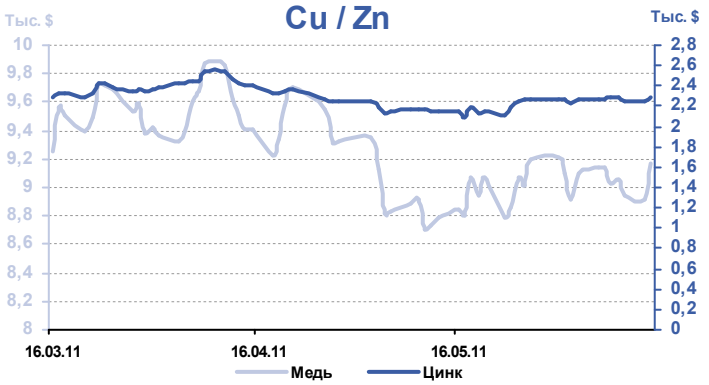
Во вторник фондовые индексы США показали хорошую коррекцию вверх после продолжительной серии снижения. Не думаю, что инвесторов очень порадовала статистика по розничным продажам: снижение в мае на -0,2% м/м (прогноз -0,5% м/м) или рост индекса цен производителей на +0,2% м/м, +7,3% г/г (прогноз 0,0% м/м, +6,6% г/г). Просто индексы вошли в фазу перепроданности в начале этой недели, и им нужно было немного скорректироваться. Лидерами роста вчера стали бумаги строительного сектора, автомобильных компаний и сектора добычи природных ресурсов.

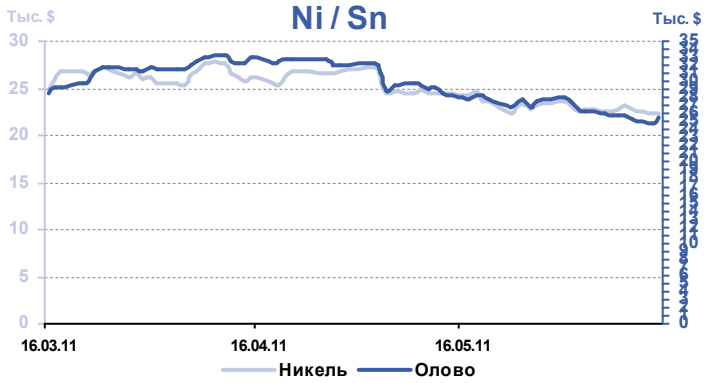
На валютном рынке в среду утром мы видим возврат пары EUR/USD к отметке 1,44, во-первых, по факту безрезультатного совещания министров финансов Евросоюза по вопросу помощи Греции; во-вторых, выступая вчера в Конгрессе, глава ФРС Б. Бернанке обошел стороной тему монетарной политики и даже не стал затрагивать тему запуска QE-3. Усиление позиций доллара не мешает ценам на нефть марки Brent торговаться возле отметки $120/барр. Согласно последним данным от Американского института нефти (API) запасы нефти в США снизились на 3,03 млн. барр.; а вот запасы бензина выросли на 1,126 млн. барр. Сегодняшние торги на фондовых площадках Азии проходят не имеют единой динамики движения индексов: MSCIAsia -0,11%.

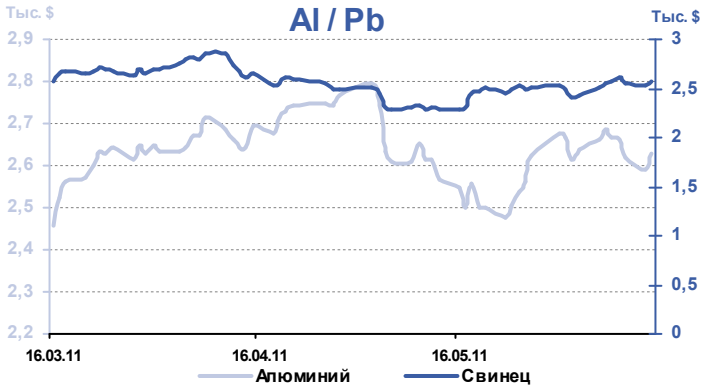
В среду мы ждем открытия торгов на наших биржах в нейтральной зоне. Два последних торговых дня рост российских индексов застопорился, даже, несмотря на позитивный внешний фон. Либо мы сейчас имеем дело с очевидной подготовкой рынка к сегодняшней экспирации по фьючерсам и опционам, либо просто наши индексы вошли в фазу вялой консолидации, где максимум по индексу ММВБ ограничен сопротивлением на 1695 п., а минимум – поддержкой на 1670 п. Чтобы развеять эти сомнения достаточно будет понаблюдать за поведением наших индексов сегодня после 16 часов. До этого часа крупные игроки могут принудительно тянуть наш рынок в любую сторону и торговых идей искать на таком рынке не стоит.

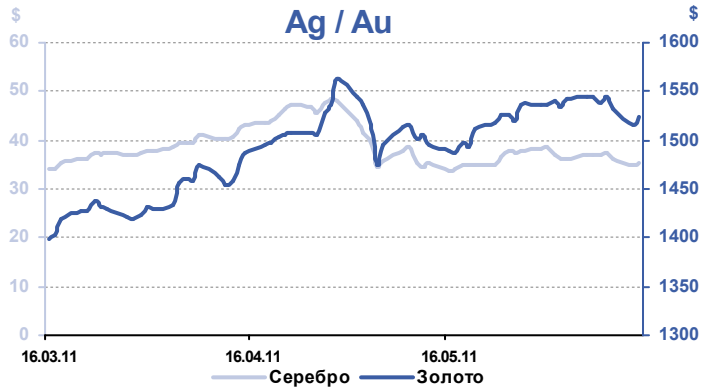
Сегодня АФК Система опубликует отчетность по US GAAP за I квартал 2011 года. В 13-00 ждем данных из еврозоны по объемам промышленного производства за апрель. В 16-30 ждем выхода индекса потребительских цен в США за май. В это же время выходит индекс производственной активности Нью-Йорка за июнь (наиболее важные данные за среду). В 17-15 оцениваем данные по загруженности производственных мощностей и промышленному производству за май. В 18-00 будет опубликован индекс цен на дома от NAHB в июне. И, наконец, в 18-30 выходит статистика по запасам нефти от Минэнерго США.

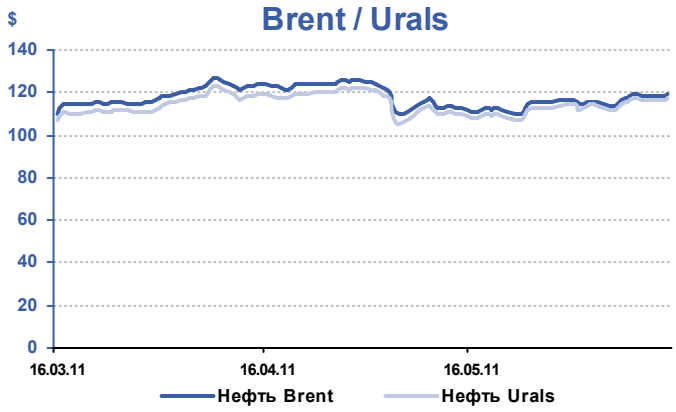
Commodities

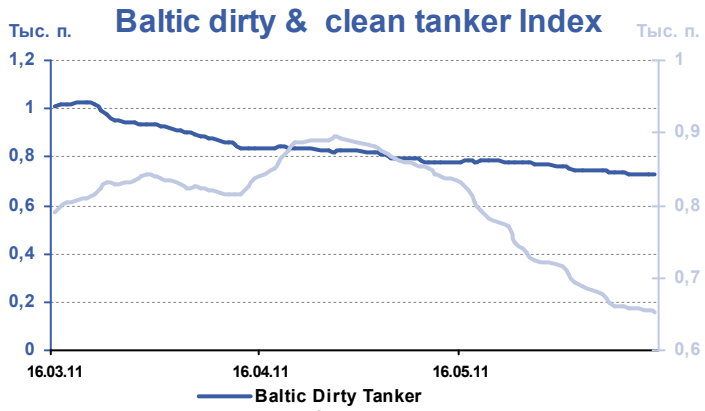












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 169,00	2,58%	0,32%	4,34%	37,67%
Цинк, $/t	2 280,00	1,11%	0,35%	5,85%	26,88%
Никель, $/t	22 315,00	-2,34%	-1,37%	-8,55%	9,93%
Олово, $/t	25 650,00	1,18%	-0,68%	-10,31%	51,33%
Алюминий, $/t	2 627,00	0,31%	-2,23%	2,30%	31,75%
Свинец, $/t	2 580,00	1,38%	1,26%	12,61%	50,44%
Серебро, $/oz	35,42	-2,12%	-4,70%	0,01%	94,32%
Золото, $/oz	1 523,78	-0,51%	-1,32%	1,92%	24,77%
Нефть Brent, $/	119,54	1,13%	2,45%	5,04%	61,76%
Нефть Urals, $/	117,49	1,13%	2,57%	5,56%	60,33%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,491	0,00%	0,00%		6 533	247
БашИнСв	BISV	0,465	0,00%	0,00%		2 172	439
БашЭнрг	BEGY	1,573	0,00%	0,00%		470	1 632
ВМЗ	VSMZ	1860,357	0,00%	0,00%		13 012	3 192
ДВМП	FESH	0,493	0,00%	0,00%		141 394	1 455
КазанскВЗ	KHEL	3,610	0,00%	0,00%		11 418	555
Мечел	MTLR	26,767	0,00%	0,00%		1 329 346	11 196
Мотовил	MOTZ	0,083	0,00%	0,00%		1 330	82
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,210	2,56%	0,00%	829 410		48 140
СилМашины	SILM	0,312	0,00%	0,00%		25 193	2 682
СинТЗ-ао	SNTZ	59,519	0,00%	0,00%		60	375
Славн-ЯНОС	JNOS	0,357	0,00%	0,00%		71	333
СТЗ-ао	SVTZ	5,361	0,00%	0,00%		32 382	258
ТАГМЕТ	TAMZ	0,786	0,00%	0,00%		6 920	400
ТНК-ВР	TNBP	3,217	0,00%	0,00%		1 620 493	48 209
У-УАЗ	UUAZ	2,037	0,00%	0,00%		48 793	546
ЧМК	CHMK	267,098	0,00%	0,00%		72 285	856
ЧТПЗ	CHEP	2,618	0,00%	0,00%		105 270	1 246
ЮжКузб.	UKUZ	55,221	0,00%	0,00%		241 516	1 990
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	54,500	2,64%	0,00%	161 750		9 274
Газпром	GAZP	7,520	0,00%	0,00%	377 250	550 904 302	178 025
Газпромнефть	SIBN	4,587	0,00%	0,00%		2 451 966	21 757
Лукойл	LKOH	63,803	-0,39%	0,00%	320 750	126 145 394	54 566
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	9,024	0,00%	0,00%	42 170	95 343 652	95 640
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	0,00%	605 333	26 202 099	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,500	0,00%	0,00%	350 000	6 116 467	3 851
Татнефть	TATN	6,040	10,22%	0,00%	362 400		13 159
Татнефть, п.	TATNP	2,890	0,00%	0,00%	1 391 800		426
Транснефть, п.	TRNFP	1522,598	1,97%	0,00%	294 950	12 629 957	2 368
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,550	0,00%	0,00%	14 438		1 616
Иркутскэнерго	IRGZ	0,761	0,00%	0,00%		169 377	3 662
Ленэнерго	LSNG	0,670	0,00%	0,00%	5 360	125 919	620
МОЭСК	MSRS	0,045	0,00%	0,00%	6 798	255 378	2 206
ОГК-2	OGKB	0,052	7,02%	0,00%	11 609		1 696
ОГК-3	OGKC	0,049	-1,01%	0,00%	14 297	441 491	2 338
ОГК-4	OGKD	0,091	4,00%	0,00%	217 005		5 737
ОГК-5	OGKE	0,086	0,00%	0,00%	8 550	398 758	3 024
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,093	-1,47%	0,00%	22 169	634 949	3 708
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%		45 125	573
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	60 344	117 532	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%	0,00%	177 348	1 599 768	16 188
Ростелеком, п.	RTKMP	3,300	0,00%	0,00%	33 000	3 706 837	796
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	0,00%		52 919	170
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,913	0,00%	0,00%	58 494	88 771	1 267
ГАЗ	GAZA	41,900	-1,41%	0,00%	4 190		776
ИРКУТ	IRKT	0,324	0,00%	0,00%		49 887	318
КАМАЗ	KMAZ	2,078	0,00%	0,00%	55 070	172 733	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	50 597	122
РКК Энергия	RKKE	285,934	0,00%	0,00%	14 700	21 052	324

Северсталь-авто	SVAV	18,760	0,00%	0,00%	52 668	380 238	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%	0,00%	36 875	5 854 335	1 701
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	0,00%	0,00%	24 500	3 327 095	10 951
НЛМК	NLMK	3,580	0,00%	0,00%	322 500	5 595 979	21 456
НорНикель	GMKN	254,302	1,13%	0,00%	253 000	122 094 585	48 280
Полиметалл	PMTL	17,400	0,00%	0,00%	143 196	1 862 244	6 989
Полюс Золото	PLZL	70,600	0,00%	0,00%	353 000	4 897 042	13 458
Северсталь	CHMF	19,144	0,00%	0,00%	89 004	24 635 054	19 292
Тагмет	TAMZ	0,740		0,00%	37 000		342
ТМК	TRMK	4,861	0,00%	0,00%		572 288	4 552
ЧТПЗ	CHEP	2,600	0,00%	0,00%	26 000		1 228
Банки							
Банк Москвы	MMBM	31,631	0,00%	0,00%		278 380	5 707
Возрождение	VZRZ	35,349	0,00%	0,00%	71 000	41 592	846
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,00%	6 300	111 439 315	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,721	0,00%	0,00%		74	4 628
Сбербанк	SBER	3,520	0,00%	0,00%	352 000		75 986
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,500	0,00%	0,00%	125 000	2 424 248	2 777
Дальневосточное МП	FESH	0,493	0,00%	0,00%	24 625		1 453
НМТП	NMTP	0,122	0,00%	0,00%		83 032	2 341
Приморское МП	PRIM	0,173	0,00%	0,00%		3 324	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%	0,00%	48 750	269 067	7 396
Верофарм	VRPH	43,200	0,00%	0,00%	259 200		432
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	0,00%	33 132	395	5 808
ГУМ	GUMM	1,470	0,00%	0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	14,200	0,00%	0,00%	28 400	19 480	1 221
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	0,00%	100 000	149 928	488
Красный Октябрь	KROT	11,000	0,00%	0,00%	69 509	909	101
Магнит	MGNT	138,142	1,09%	0,00%	276 500	2 298 812	12 348
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,340	0,00%	0,00%		19 931	21
Разгуляй	GRAZ	2,040	0,00%	0,00%	20 400	176 364	323
Фармстандарт	PHST	80,044	0,00%	0,00%	40 000	180 418	3 025
Черкизово	GCHE	27,778	0,00%	0,00%		19 319	1 202
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,220	0,00%	0,00%	11 000		393
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,895	0,00%	0,00%	204 284	25 391	1 442
Уфанефтехим	UFNC	5,600	0,00%	0,00%	56 000		1 542
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	205,000	0,00%	0,00%	8 200		286
ПИК	pikk	3,860	0,00%	0,00%	10 004	8 214 925	1 904
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	0,00%	4 964	1 115 118	200
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,821	1,20%	0,00%	276 400	1 297 066	2 170
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	0,00%		5 670	426
Уралкалий	URKA	8,850	0,00%	0,00%	88 500	38 489 113	18 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,663	0,00%	0,00%	5 399		762
Распадская	rasp	6,000	0,00%	0,00%	60 000	5 152 097	4 685
УК Южный Кузбасс	UKUZ	54,500	-0,91%	0,00%	10 900		1 968

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	176,510	-0,90%	
Башнефть	AK6		EUR	187,300	2,91%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,200	0,00%	1,98
ТГК-3	AOMD		USD	9,150	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	40,250	-1,06%	13 823,39
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,171	1,44%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	33,230	-1,37%	22 778,50
X5	FIVE		USD	41,400	2,22%	20 083,24
Газпром	GAZ		EUR	10,380	0,68%	1 707,22
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,220	10,00%	9,43
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,750	2,18%	5,07
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,200	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	7,14%	63,66
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	5,88%	0,45
Лукойл	LKOD		USD	63,650	-0,47%	320 024,50
Лукойл	LUK		EUR	44,025	-0,92%	418,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	63,750	0,33%	10 096,56
МТС	MBT	5	USD	19,500	0,57%	31 958,89
МТС	MKY	5	EUR	13,425	-0,56%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,500	1,09%	
Мечел	MTL	3	USD	26,990	0,11%	36 294,10
НорНикель	NILSY	1	USD	25,400	0,47%	2 338,34
НорНикель	NNIA		EUR	17,515	-0,20%	47,63
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	139,500	-1,55%	30 104,48
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	3,175	-7,60%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,808	-4,94%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,800	-2,52%	8,65
Газпром	OGZD		USD	15,030	0,20%	542 430,80
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	35,550	2,04%	222,21
Ростелеком	RTL		EUR	24,950	3,33%	11,94
Газпромнефть	SCF		EUR	15,900	0,00%	75,72
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,748	-0,79%	1,35
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,642	1,51%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,230	2,55%	196,69
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,830	2,40%	98,08
АФКСистема	SSA	1	USD	26,330	0,88%	4 660,65
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	15,085	-0,49%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	34,910	-0,48%	
СТЗ	SVY		EUR	46,475	-0,49%	
ЦУМ	THT		EUR	18,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	33,000	-2,08%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	372,730	-0,01%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,400	-1,98%	49 189,25
ВТБ	VTBR		USD	6,325	0,72%	73 013,89
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.