ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

22 июня 2011г.

Комментарий по рынку акций

Вчера американские фондовые индексы завершились торги уверенным ростом. Набор позитивных корпоративных новостей и постепенный уход от критической точки на уровне 200-дневной средней скользящей оживили покупки по всем секторам заокеанского рынка акций. Как это обычно бывает в период эйфории на биржах, негативная статистика была проигнорирована: продажи на вторичном рынке жилья в США в мае упали до самого низкого уровня за шесть месяцев (-3,8% м/м), что доказывает факт сохранения глубокого спада активности в жилищном секторе. На этом фоне инвесторы надеются на то, что ФРС США отложит на более длительный срок

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 872,45	0,76%	-2,76%	2,58%	28,43%
Индекс ММВБ	1 635,38	0,57%	-2,75%	1,96%	16,30%
FTSE	5 775,31	1,44%	-0,48%	-2,91%	8,99%
S&P 500	1 295,52	1,34%	0,59%	-2,83%	16,38%
Dow Jones Avg.	12 190,01	0,91%	0,94%	-2,57%	16,74%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскшина	1,3500	8,00%	12,50%	35,00%
Татнефть, п.	3,0500	5,54%	-0,65%	27,08%
Акрон	46,5000	2,76%	5,68%	56,20%
ПИК	3,8200	1,87%	-0,37%	7,91%
Сбербанк	3,4200	1,33%	2,55%	34,65%
Газпром	7,2000	0,70%	3,15%	33,58%
Фармстандарт	76,5000	0,39%	-8,93%	-3,77%
Магнит	136,2000	0,37%	3,03%	32,23%

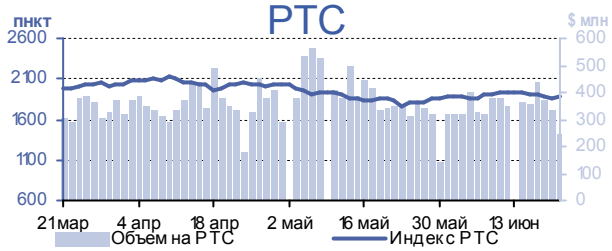
Лидеры снижения

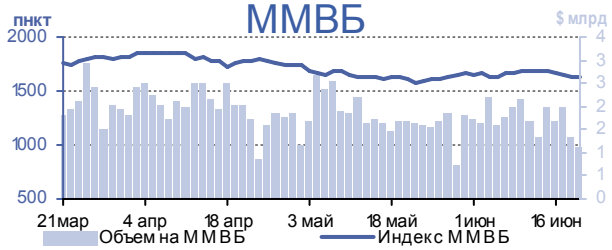
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Возрождение	33,0000	-7,04%	-11,65%	-5,71%
Нижнекамскнефтехим	0,8500	-5,03%	3,34%	73,47%
ОГК-4	0,0880	-3,30%	7,98%	17,96%
Аэрофлот	2,4771	-0,92%	2,78%	26,96%

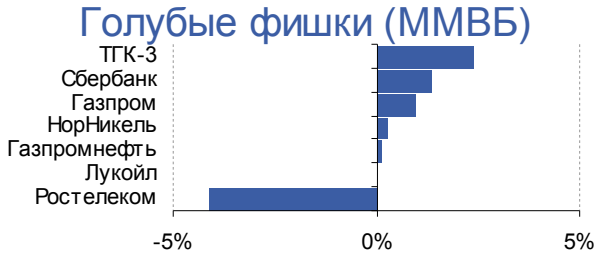
Индекс MSCI

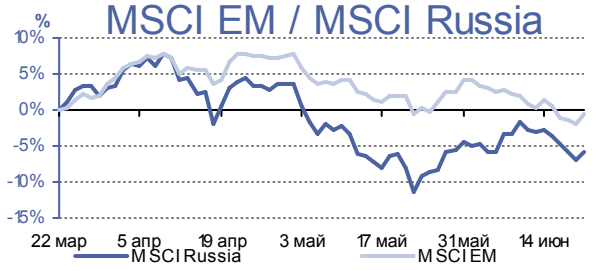
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1113,03	1,34%	-2,41%	13,74%
Индекс MSCI BRAZIL	3501,62	0,95%	0,29%	5,51%
Индекс MSCI RUSSIA	987,19	1,36%	2,47%	27,11%
Индекс MSCI INDIA	475,36	0,78%	-3,73%	-2,53%
Индекс MSCI CHINA	63,39	1,25%	-6,36%	0,99%

Основные индикаторы









Обзор рынка

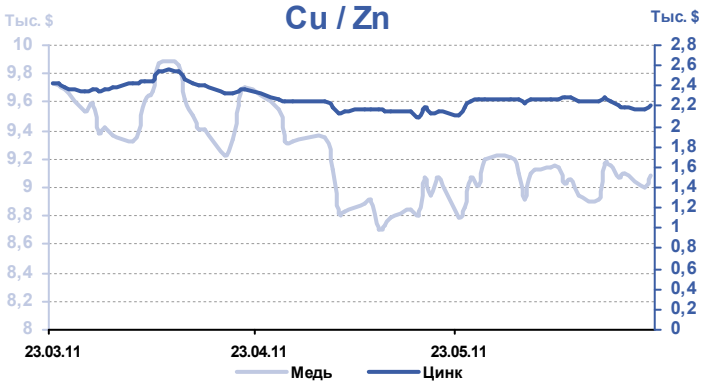
Вчера американские фондовые индексы завершились торги уверенным ростом. Набор позитивных корпоративных новостей и постепенный уход от критической точки на уровне 200-дневной средней скользящей оживили покупки по всем секторам заокеанского рынка акций. Как это обычно бывает в период эйфории на биржах, негативная статистика была проигнорирована: продажи на вторичном рынке жилья в США в мае упали до самого низкого уровня за шесть месяцев (-3,8% м/м), что доказывает факт сохранения глубокого спада активности в жилищном секторе. На этом фоне инвесторы надеются на то, что ФРС США отложит на более длительный срок выход из программы мер по монетарному стимулированию экономики. По окончании регулярных торгов квартальный отчет представила компания Adobe Systems, которая зафиксировала рост чистой прибыли за 2-й фискальный квартал с окончанием 3 июня до $229,4 млн., или 55 центов на акцию (прогноз 51 цент); рост продаж составил 9% ($1,02 млрд), что также выше прогнозов.

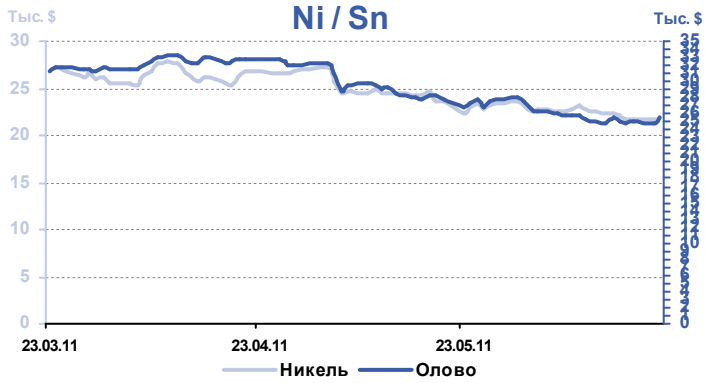
Курс евро к доллару сегодня ночью вышел к отметке 1,44 по факту вынесения вотума доверия кабинету министров Греции. Теперь на следующей неделе парламент страны должен проголосовать по поводу экономического плана страны вывода страны из кризиса. В ценах на сырье нынешнее ослабление позиций доллара не сказалось. Интересно, что вчера котировки нефти Brentне пошли вверх за американскими фондовыми индексами, а даже снизились до отметки $110/барр. Трейдеры связывают это с заявлением МЭА, которое увидело признаки увеличения добычи нефти Саудовской Аравией. Кстати, отсутствие спроса сейчас можно наблюдать в других сырьевых сегментах: медь, алюминий, натуральный газ.

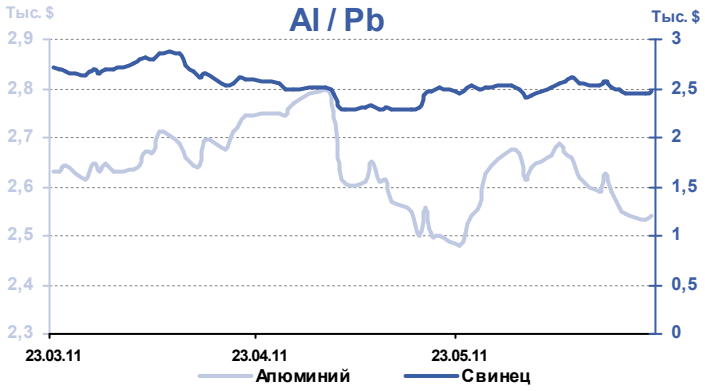
Открытие торгов на российских биржах в среду мы увидим с небольшим гэпом вверх. Начало этой недели показало, что пока отечественные инвесторы находятся в выжидательной позиции, поскольку по факту нет никакой реакции на позитив, идущий с фондовых бирж Европы и США. Без притока свежих денег нашему рынку пока достается роль пассивного статиста, которого переставляют то вверх, то вниз в зависимости от внешнего фона. Сегодня днем оживления активности на наших биржах, скорее всего мы также не увидим, поскольку инвесторы будут осторожничать в преддверии пресс-конференции руководства ФРС по монетарной политике. В такой ситуации нам остается просто держать в портфелях тех бумаги, которые мы купили несколькими днями раньше. Думаю, сегодня утром индекс ММВБ опять встретит сопротивление на уровне 1642-45 п.

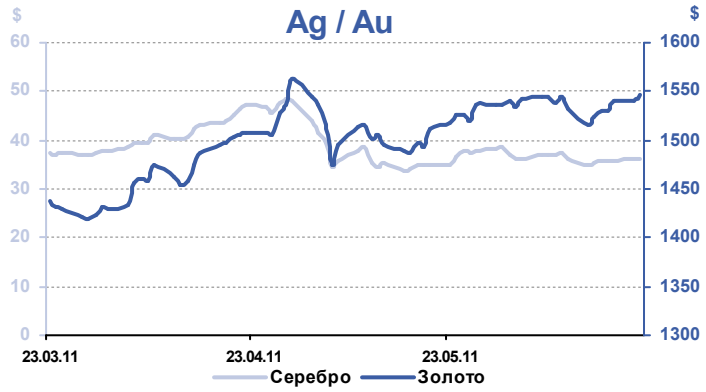
Сегодня в 18-30 выходит статистика из США по запасам нефти. В 20-30 будет опубликовано решение FOMC ФРС по ключевой процентной ставке, а также сопроводительное заявление. В это же время стоит последить за выступлением президента ЕЦБ, а также главы Банка Англии. В 22-15 начнется пресс-конференция руководителя ФРС Бена Бернанке. Подавляющее большинство аналитиков прогнозируют, что ФедРезерв до конца года будет держать свое обещание сохранять процентные ставки на рекордно низком уровне «в течение длительного периода»

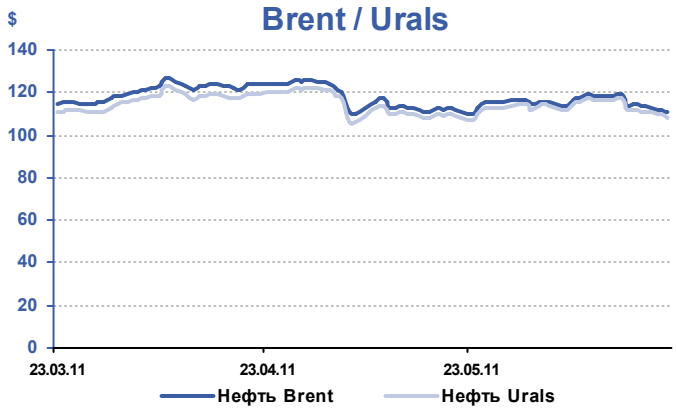
Commodities

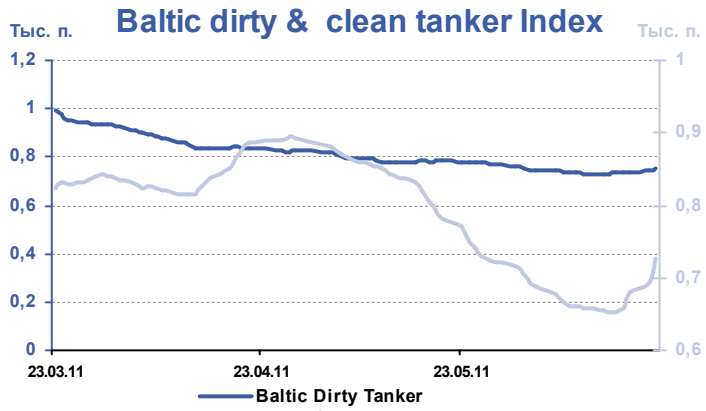












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 080,00	0,83%	-0,97%	0,10%	37,49%
Цинк, $/t	2 212,00	1,84%	-2,98%	2,84%	24,62%
Никель, $/t	21 880,00	1,06%	-1,95%	-7,05%	10,23%
Олово, $/t	25 450,00	2,62%	-0,78%	-8,29%	42,18%
Алюминий, $/t	2 541,00	0,40%	-3,27%	1,64%	29,58%
Свинец, $/t	2 460,00	0,41%	-4,65%	-1,99%	34,21%
Серебро, $/oz	36,35	0,78%	2,64%	3,64%	94,13%
Золото, $/oz	1 546,30	0,36%	1,48%	2,25%	25,34%
Нефть Brent, $/	111,15	-0,56%	-7,02%	-1,45%	44,24%
Нефть Urals, $/	108,17	-1,22%	-7,93%	-1,95%	41,47%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,492	0,00%	-0,44%		2 834	244
БашИнСв	BISV	0,475	0,00%	-4,89%		12 642	467
БашЭнрг	BEGY	1,520	0,00%	0,76%		12 991	1 575
ВМЗ	VSMZ	1862,498	0,00%	0,00%		55 875	3 199
ДВМП	FESH	0,483	0,00%	-1,46%		6 912	1 427
КазанскВЗ	KHEL	3,416	0,00%	-3,58%		13 525	529
Мечел	MTLR	26,136	0,00%	0,55%		1 270 381	10 845
Мотовил	MOTZ	0,086	0,00%	-3,42%		1 091	83
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,082	0,00%	0,00%	8 200		81
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,100	0,00%	0,00%	18 746		46 491
СилМашины	SILM	0,294	0,00%	-0,24%		8 495	2 569
СинТЗ-ао	SNTZ	58,818	0,00%	0,00%		18 806	378
Славн-ЯНОС	JNOS	0,374	0,00%	0,00%		5 297	348
СТЗ-ао	SVTZ	5,552	0,00%	3,34%		36 259	289
ТАГМЕТ	TAMZ	0,694	0,00%	0,00%		1 180	353
ТНК-ВР	TNBP	3,186	0,00%	2,65%		320 632	47 189
У-УАЗ	UUAZ	2,040	0,00%	1,01%		3 252	543
ЧМК	CHMK	258,028	0,00%	2,00%		25 492	814
ЧТПЗ	CHEP	2,563	0,00%	0,00%		37 262	1 222
ЮжКузб.	UKUZ	53,977	0,00%	-0,46%		5 719	1 948
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,250	0,00%	0,00%	304 111		9 079
Газпром	GAZP	7,200	0,70%	0,98%	180 000	299 850 579	170 449
Газпромнефть	SIBN	4,374	0,00%	0,13%		1 512 585	20 801
Лукойл	LKOH	62,400	-0,32%	0,01%	312 000	68 796 621	53 075
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%	-0,88%	42 170	63 744 509	95 640
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	-0,18%	605 333	16 415 079	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,505	0,00%	0,06%		4 349 749	3 900
Татнефть	TATN	6,140	0,00%	0,00%	2 747 000		13 355
Татнефть, п.	TATNP	3,050	5,54%	0,00%	227 625		450
Транснефть, п.	TRNFP	1575,000	0,00%	0,94%	15 750	4 389 837	2 449
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,550	0,00%	0,00%	14 438		1 616
Иркутскэнерго	IRGZ	0,774	0,00%	0,93%		25 832	3 687
Ленэнерго	LSNG	0,670	0,00%	-1,41%	5 360	49 159	620
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	0,53%	20 771	1 365 080	2 584
ОГК-2	OGKB	0,050	0,00%	0,00%	50 200		1 643
ОГК-3	OGKC	0,048	0,00%	-0,40%	24 000	259 920	2 279
ОГК-4	OGKD	0,088	-3,30%	0,00%	44 000		5 548
ОГК-5	OGKE	0,086	0,00%	0,44%	8 550	103 201	3 024
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,093	0,00%	2,39%	93 000	2 007 895	3 697
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%		9 860	559
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,25%	60 344	74 807	689
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,250	0,00%	0,00%	123 750		17 048
Ростелеком	RTKM	5,800	0,00%	-4,10%	116 000	22 039 510	17 071
Ростелеком, п.	RTKMP	3,300	0,00%	-0,30%	33 000	10 246 980	796
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	-2,36%		18 031	169
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,000	0,00%	4,85%	25 000	656 869	1 388
ГАЗ	GAZA	41,900	0,00%	0,00%	4 190		776
ИРКУТ	IRKT	0,319	0,00%	-0,06%		17 215	312
КАМАЗ	KMAZ	2,078	0,00%	2,06%	55 070	114 137	1 470
ОМЗ	OMZZ	2,691	0,00%	0,47%		58 462	96
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	0,43%	14 700	1 176	337
Северсталь-авто	SVAV	18,680	0,00%	1,32%	24 284	354 539	640

Силовые машины	SILM	0,290	0,00%	0,00%	11 629		2 526
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	148,500	0,00%	1,00%	37 125	66 191	1 712
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	0,00%	0,20%	24 500	1 605 153	10 951
НЛМК	NLMK	3,540	0,00%	1,00%	177 000	3 111 927	21 216
НорНикель	GMKN	253,000	0,00%	0,26%	253 000	77 342 790	48 229
Полиметалл	PMTL	22,000	0,00%	-0,80%	379 800	2 256 345	8 587
Полюс Золото	PLZL	70,600	0,00%	-2,74%	353 000	10 799 293	13 458
Северсталь	CHMF	19,144	0,00%	0,53%	89 004	13 317 315	19 292
Тагмет	TAMZ	0,740	0,00%	0,00%	37 000		342
ТМК	TRMK	4,692	0,00%	-0,16%		305 626	4 419
ЧТПЗ	CHEP	2,610	0,00%	0,00%	15 650		1 233
Банки							
Банк Москвы	MMBM	28,937	0,00%	-0,99%		54 970	5 249
Возрождение	VZRZ	33,000	-7,04%	-2,62%	33 000	154 764	784
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	1,20%	6 300	55 034 579	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,654	0,00%	-0,28%		256	4 551
Сбербанк	SBER	3,420	1,33%	0,00%	1 528 272		73 827
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,477	-0,92%	0,52%	662 703	235 436	2 751
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	52 800		1 417
НМТП	NMTP	0,122	0,00%	-0,01%		221 676	2 346
Приморское МП	PRIM	0,174	0,00%	1,32%		868	138
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,200	0,00%	0,00%	40 240		326
Балтика	PKBA	48,750	0,00%	1,25%	48 750	5 219	7 396
Верофарм	VRPH	44,905	0,00%	0,00%	313 480		449
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	0,16%	33 132	5 181	5 808
ГУМ	GUMM	1,470	0,00%	0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	14,200	0,00%	0,46%	28 400	118 783	1 221
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	0,00%	100 000	9 128	488
Красный Октябрь	KROT	11,000	0,00%	0,60%	69 509	1 847	101
Магнит	MGNT	136,200	0,37%	-0,32%	54 480	3 999 117	12 118
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,314	0,00%	-2,26%		12 621	21
Разгуляй	GRAZ	2,040	0,00%	-0,91%	20 400	86 907	323
Фармстандарт	PHST	76,500	0,39%	0,00%	153 000	95 054	2 882
Черкизово	GCHE	27,902	0,00%	0,19%		32 925	1 202
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,850	-5,03%	-1,14%	42 500	9 885	1 370
Уфанефтехим	UFNC	5,600	0,00%	0,00%	336 000		1 542
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	205,000	0,00%	0,00%	8 200		286
ПИК	pikk	3,820	1,87%	0,71%	496 600	1 602 848	1 884
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	0,00%	4 964	1 115 118	200
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	46,500	2,76%	1,09%	92 750	2 215 492	2 217
Дорогобуж	DGBZ	0,610	0,00%	0,00%	30 805	17 279	440
Уралкалий	URKA	8,850	0,00%	1,35%	88 500	25 242 056	18 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,663	0,00%	0,00%	5 399		762
Распадская	rasp	5,760	0,35%	0,87%	18 662	3 774 481	4 497
УК Южный Кузбасс	UKUZ	53,000	0,00%	0,00%	16 000		1 914

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	164,300	-4,40%	
Башнефть	AK6		EUR	170,000	-9,09%	
ТГК-3	AOMD		USD	9,160	-0,87%	2,75
Татнефть	ATAD		USD	39,560	2,67%	5 554,10
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,786	6,62%	257,03
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	31,780	1,05%	13 973,51
X5	FIVE		USD	40,200	1,41%	8 408,17
Газпром	GAZ		EUR	10,035	0,90%	1 296,05
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,149	-0,67%	36,58
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,950	0,19%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,110	-4,31%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,300	0,00%	1,89
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,880	-10,20%	
Лукойл	LKOD		USD	62,200	0,81%	143 810,00
Лукойл	LUK		EUR	43,325	0,55%	477,88
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,330	0,78%	13 834,81
МТС	MBT	5	USD	19,420	1,57%	26 568,58
МТС	MKY	5	EUR	13,475	-2,28%	3,39
МГТС	MOW		EUR	10,000	33,33%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,375	-1,77%	1,60
Мечел	MTL	3	USD	26,300	2,90%	36 476,23
НорНикель	NILSY	1	USD	24,610	0,20%	408,22
НорНикель	NNIA		EUR	17,150	0,00%	125,94
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	132,000	5,60%	73 251,33
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,764	0,25%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,900	10,70%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,600	-6,67%	0,84
Газпром	OGZD		USD	14,340	1,13%	351 986,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	5,56%	
Ростелеком	RKMD		USD	41,800	-1,65%	16,72
Ростелеком	RTL		EUR	28,250	-4,16%	10,23
Газпромнефть	SCF		EUR	15,120	-0,40%	41,20
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,749	-0,43%	2,34
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,512	0,11%	2,74
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,060	1,00%	56,14
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,650	-1,03%	636,34
АФКСистема	SSA	1	USD	26,000	0,93%	6 390,57
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	14,785	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	34,610	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	40,075	0,00%	
ЦУМ	THT		EUR	15,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	379,330	-4,52%	7,78
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,180	0,69%	31 291,16
ВТБ	VTBR		USD	6,080	1,76%	36 533,22
Возрождение	VZY		EUR	23,500	-2,08%	1,18

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

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@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.