ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

23 июня 2011г.

Комментарий по рынку акций

В среду американские фондовые индексы завершили торги в минусе. Инвесторы негативно отреагировали на снижение прогноза перспектив американской экономики со стороны ФРС на 2011 и ближайшие годы и повысила прогноз безработице и инфляции. Не порадовало рынок отсутствие намеков на возможное начало нового монетарного стимулирования. Программа покупок облигаций (QE-2), как и планировалось закончиться 30 июня. При этом низкие процентные ставки будут сохранены еще, как минимум на 2-3 заседания ФРС. В итоге почти все сектора американских акций завершили торговую сессию в красной зоне. Лидерами снижения стали бумаги сектора

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 878,38	0,32%	-2,12%	6,42%	30,90%
Индекс ММВБ	1 640,13	0,29%	-2,30%	4,26%	18,16%
FTSE	5 772,99	-0,04%	0,53%	-1,08%	10,03%
S&P 500	1 287,14	-0,65%	1,72%	-2,29%	17,51%
Dow Jones Avg.	12 109,67	-0,66%	1,79%	-2,19%	17,64%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскшина	1,4000	3,70%	16,67%	40,00%
ОГК-2	0,0514	2,39%	-9,03%	3,84%
Башнефть	54,4000	2,16%	2,64%	49,66%
Магнит	137,0000	0,59%	3,63%	33,01%
Газпром	7,2400	0,56%	8,06%	34,32%
Акрон	46,7500	0,54%	6,25%	57,04%
ВСМПО	148,8837	0,26%	17,23%	58,39%
Сбербанк	3,4270	0,20%	6,10%	34,92%

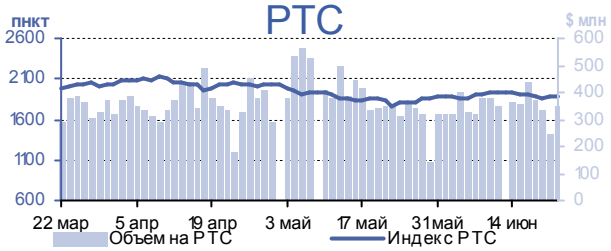
Лидеры снижения

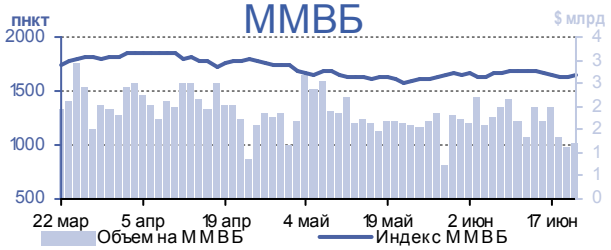
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Банк Санкт-	5,2000	-3,17%	4,00%	55,69%
Возрождение	32,7500	-0,76%	-12,32%	-6,43%
Башнефть, п.	43,7000	-0,68%	9,25%	53,06%
НорНикель	251,5000	-0,59%	-2,52%	47,94%

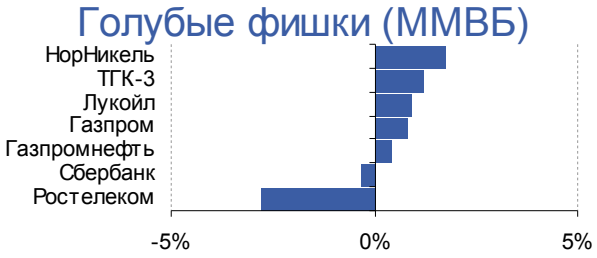
Индекс MSCI

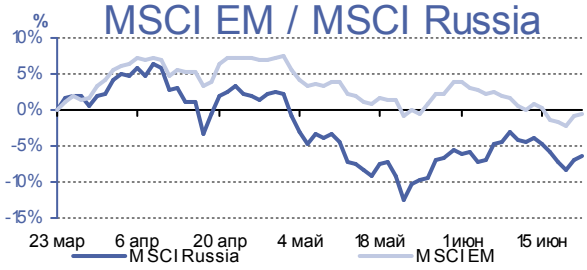
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1116,25	0,29%	0,22%	15,36%
Индекс MSCI BRAZIL	3503,09	0,04%	1,81%	6,04%
Индекс MSCI RUSSIA	991,87	0,47%	6,88%	30,14%
Индекс MSCI INDIA	474,54	-0,17%	-1,58%	-0,95%
Индекс MSCI CHINA	63,62	0,36%	-3,80%	2,03%

Основные индикаторы









Обзор рынка

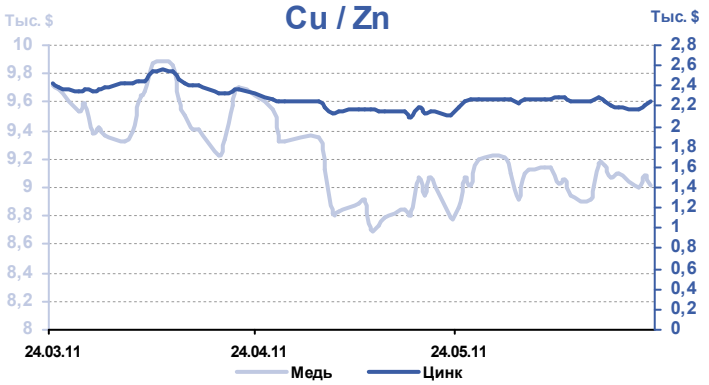
В среду американские фондовые индексы завершили торги в минусе. Инвесторы негативно отреагировали на снижение прогноза перспектив американской экономики со стороны ФРС на 2011 и ближайшие годы и повысила прогноз безработице и инфляции. Не порадовало рынок отсутствие намеков на возможное начало нового монетарного стимулирования. Программа покупок облигаций (QE-2), как и планировалось закончиться 30 июня. При этом низкие процентные ставки будут сохранены еще, как минимум на 2-3 заседания ФРС. В итоге почти все сектора американских акций завершили торговую сессию в красной зоне. Лидерами снижения стали бумаги сектора финансовых услуг и розничной торговли. Во IIквартале крупнейшие инвестбанки США могут снизить свои доходы из-за слабой выручки от торговых операций на рынках сырья, акций и инструментов с фиксированным доходом.

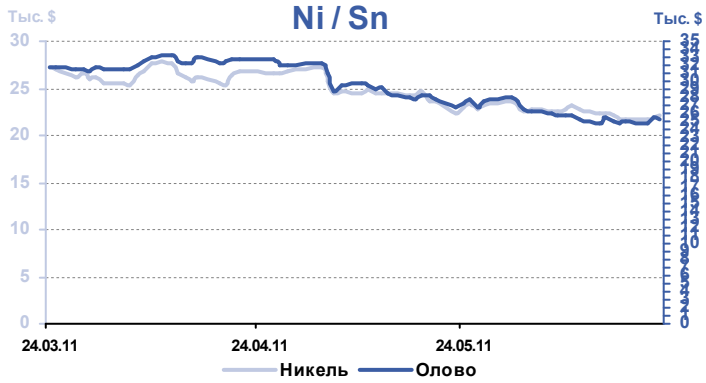
Курс доллара пошел на укрепление против евро (EUR/USD1,43) и иены (USD/JPY 80,5) после вчерашних комментариев главы ФРС Бена Бернанке, из которых стало ясно, что дальнейшего смягчения денежной политики со стороны ФРС ждать не стоит. Цены на нефть марки Brentна утро четверга не изменили своих значений и торгуются на уровне $113/барр. Сектор промышленных металлов на торгах в Азии окрашен в красный цвет (медь -0,9%; никель -0,4%; алюминий -0,65%) из-за слабых данных по индексу деловой активности (PMI) в обрабатывающей промышленности Китая в июне, составившей всего 50,1 пункта, против 51,6 за май, 51,8 в апреле и 54,5 в феврале. Налицо тенденция на замедление экономического роста в Поднебесной. При этом издание China Securities Journal сообщает, что Народный Банк Китая может повысить учетную ставку в самое ближайшее время.

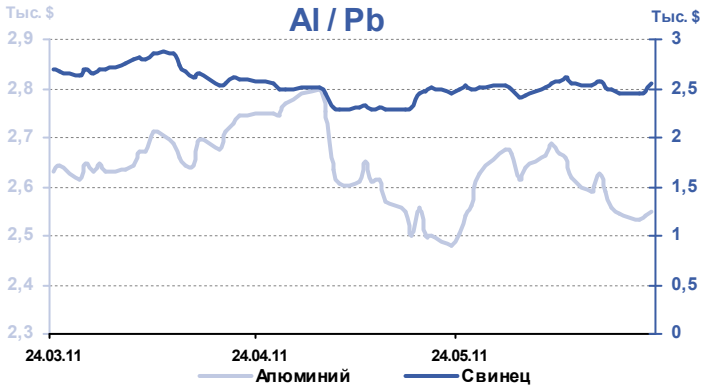
В четверг мы ждем открытия торгов на наших биржах в красной зоне. Вечерний заход нашего рынка наверх под ожидание позитива со стороны ФРС, не оправдался. Сегодня мы ждем возврата индекса ММВБ к поддержке на уровне 1624 п. Хаотичные движения акций вследствие реакции на поступающие новости продолжат держать в напряжении всех инвесторов. От подобных колебаний рынка профит получают только спекулянты. Однако пока цены на нефть Brentсохраняют позиции выше $110/барр бояться за судьбу российского рынка акций преждевременно.

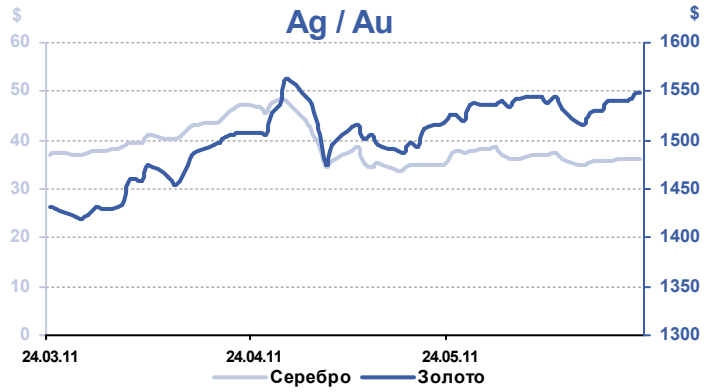
Сегодня состоятся годовые собрания акционеров таких компаний, как Лукойл, Татнефть, АвтоВАЗ, Магнит, М-Видео, Челябинский цинковый завод. В 11-30 ждем публикации индексов деловой активности в промышленности и секторе услуг в Германии за июнь. В 12-00 аналогичные данные будут опубликованы по еврозоне. В 16-30 в США выходят данные по первичным обращениям за пособиями по безработице. В 18-00 ждем статистики по продажам новых домов за май.

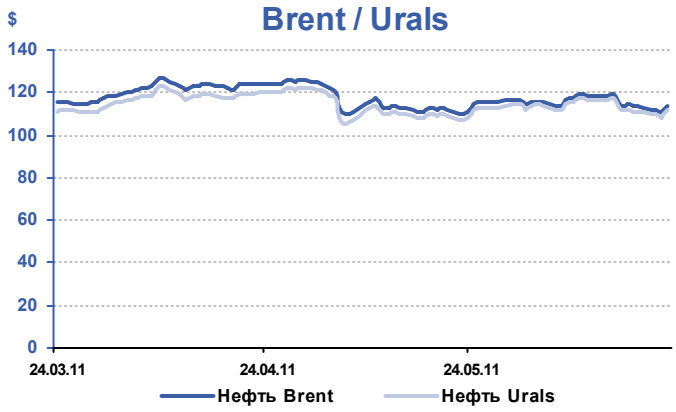
Commodities

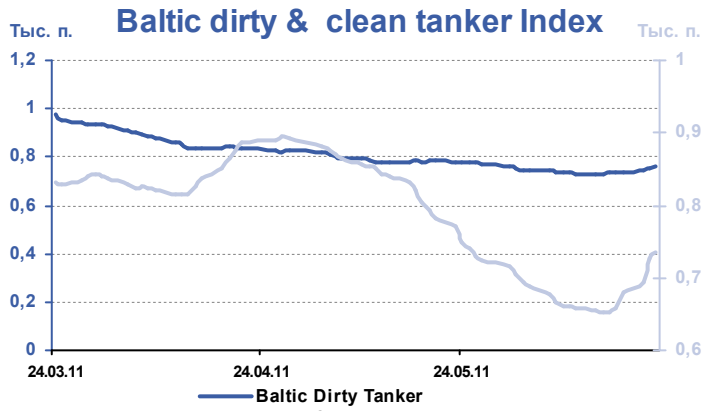












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 015,00	-0,72%	-1,52%	2,51%	36,38%
Цинк, $/t	2 252,00	1,81%	0,27%	6,28%	25,53%
Никель, $/t	22 150,00	1,23%	0,54%	-1,09%	12,72%
Олово, $/t	25 375,00	-0,29%	0,89%	-5,05%	39,81%
Алюминий, $/t	2 550,00	0,35%	-1,58%	2,91%	30,17%
Свинец, $/t	2 544,00	3,41%	1,03%	3,88%	39,17%
Серебро, $/oz	36,35	0,00%	1,52%	3,62%	93,19%
Золото, $/oz	1 548,95	0,17%	1,18%	2,10%	24,91%
Нефть Brent, $/	113,87	2,45%	-0,22%	3,46%	48,66%
Нефть Urals, $/	111,58	3,15%	-0,13%	3,81%	46,93%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,488	0,00%	-0,73%		93 915	246
БашИнСв	BISV	0,472	0,00%	-0,54%		10 306	449
БашЭнрг	BEGY	1,525	0,00%	0,35%		9 754	1 589
ВМЗ	VSMZ	1780,786	0,00%	-4,33%		133 559	3 058
ДВМП	FESH	0,481	0,00%	-0,36%		107 570	1 401
КазанскВЗ	KHEL	3,540	0,00%	3,68%		7 373	541
Мечел	MTLR	26,381	0,00%	1,00%		1 161 268	10 928
Мотовил	MOTZ	0,085	0,00%	-0,27%		1 265	84
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	0,292	0,00%	-0,76%		41 089	2 527
СинТЗ-ао	SNTZ	62,641	0,00%	6,06%		13 461	385
Славн-ЯНОС	JNOS	0,376	0,00%	0,16%		1 709	354
СТЗ-ао	SVTZ	5,369	0,00%	-3,23%		692	256
ТАГМЕТ	TAMZ	0,694	0,00%	-0,51%		3 780	377
ТНК-ВР	TNBP	3,123	0,00%	-1,91%		227 478	47 057
У-УАЗ	UUAZ	2,014	0,00%	-1,23%		26 824	539
ЧМК	CHMK	257,758	0,00%	-0,04%		13 659	815
ЧТПЗ	CHEP	2,582	0,00%	0,17%		32 050	1 221
ЮжКузб.	UKUZ	54,229	0,00%	0,53%		30 528	1 961
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	54,400	2,16%	0,00%	32 640		9 257
Газпром	GAZP	7,240	0,56%	0,79%	360 000	409 420 013	171 396
Газпромнефть	SIBN	4,389	0,00%	0,41%		2 434 735	20 790
Лукойл	LKOH	62,400	0,00%	0,92%	312 000	89 841 558	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%	-0,47%	42 170	60 666 262	95 640
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	0,05%	605 333	20 106 031	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,498	0,00%	-1,47%		10 654 033	3 834
Татнефть	TATN	6,140	0,00%	0,00%	2 747 000		13 355
Татнефть, п.	TATNP	3,050	0,00%	0,00%	227 625		450
Транснефть, п.	TRNFP	1575,000	0,00%	0,17%	15 750	6 884 342	2 449
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,550	0,00%	0,00%	14 438		1 616
Иркутскэнерго	IRGZ	0,770	0,00%	-0,47%		46 034	3 682
Ленэнерго	LSNG	0,670	0,00%	-0,74%	5 360	17 998	620
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	-1,59%	20 771	557 017	2 584
ОГК-2	OGKB	0,051	2,39%	0,00%	102 600		1 683
ОГК-3	OGKC	0,048	0,00%	-0,55%	24 000	476 053	2 279
ОГК-4	OGKD	0,088	-0,57%	0,00%	43 750		5 517
ОГК-5	OGKE	0,086	0,00%	-2,12%	8 550	1 136 217	3 024
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,093	0,00%	1,19%	93 000	1 619 976	3 697
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-1,32%		18 029	546
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,23%	60 344	67 044	689
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,250	0,00%	0,00%	123 750		17 048
Ростелеком	RTKM	5,800	0,00%	-2,78%	116 000	14 957 327	17 071
Ростелеком, п.	RTKMP	3,300	0,00%	-1,04%	33 000	2 902 854	796
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	1,79%		13 053	168
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,000	0,00%	1,00%	25 000	659 139	1 388
ГАЗ	GAZA	41,900	0,00%	0,00%	4 190		776
ИРКУТ	IRKT	0,319	0,00%	0,06%		8 252	312
КАМАЗ	KMAZ	2,237	0,00%	-0,71%		129 108	1 602
ОМЗ	OMZZ	2,718	0,00%	1,08%		22 407	96
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	-0,30%	14 700	14 934	337
Северсталь-авто	SVAV	18,680	0,00%	-0,15%	24 284	237 692	640

Металлургия							
ВСМПО	VSMO	148,884	0,26%	2,68%	22 333	2 162 368	1 717
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	0,00%	-0,57%	24 500	1 438 048	10 951
НЛМК	NLMK	3,540	0,00%	1,59%	177 000	3 837 152	21 216
НорНикель	GMKN	251,500	-0,59%	1,75%	500 500	137 983 807	47 943
Полиметалл	PMTL	22,000	0,00%	0,26%	379 800	1 153 352	8 587
Полюс Золото	PLZL	70,600	0,00%	-0,58%	353 000	7 065 956	13 458
Северсталь	CHMF	19,144	0,00%	-0,16%	89 004	15 846 311	19 292
Тагмет	TAMZ	0,740	0,00%	0,00%	37 000		342
ТМК	TRMK	4,709	0,00%	0,43%		219 492	4 405
ЧТПЗ	CHEP	2,610	0,00%	0,00%	15 650		1 233
Банки							
Банк Москвы	MMBM	28,707	0,00%	-0,73%		11 432	5 170
Возрождение	VZRZ	32,750	-0,76%	-1,34%	32 750	63 654	778
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-1,42%	6 300	66 178 744	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,691	0,00%	1,08%		3 270	4 570
Сбербанк	SBER	3,427	0,20%	0,00%	309 607		73 978
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,477	0,00%	-0,36%	662 703	2 354 165	2 751
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	52 800		1 417
НМТП	NMTP	0,120	0,00%	-1,17%		77 682	2 316
Приморское МП	PRIM	0,173	0,00%	0,00%		173	138
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,200	0,00%	0,00%	40 240		326
Балтика	PKBA	48,750	0,00%	2,61%	48 750	13 199	7 396
Верофарм	VRPH	44,905	0,00%	0,00%	313 480		449
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	-0,46%	33 132	20 624	5 808
ГУМ	GUMM	1,470	0,00%	0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	14,200	0,00%	0,05%	28 400	18 407	1 221
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	-1,71%	100 000	138 855	488
Красный Октябрь	KROT	11,000	0,00%	-1,50%	69 509	7 319	101
Магнит	MGNT	137,000	0,59%	0,87%	81 950	3 037 041	12 190
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,313	0,00%	-0,05%		2 503	21
Разгуляй	GRAZ	2,040	0,00%	0,50%	20 400	50 741	323
Фармстандарт	PHST	76,500	0,00%	-0,94%	153 000	52 038	2 882
Черкизово	GCHE	27,741	0,00%	-0,51%		59 792	1 187
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,850	0,00%	2,58%	42 500	31 800	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	0,00%	0,11%	496 600	1 482 785	1 884
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	0,00%	4 964	1 115 118	200
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	46,750	0,54%	0,88%	35 063	1 779 691	2 229
Дорогобуж	DGBZ	0,610	0,00%	0,88%	30 805	25 369	440
Уралкалий	URKA	8,850	0,00%	1,03%	88 500	25 437 551	18 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,663	0,00%	0,00%	5 399		762
Распадская	rasp	5,760	0,00%	-0,22%	18 662	2 596 179	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	172,030	4,70%	
Башнефть	AK6		EUR	186,000	9,41%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,240	3,33%	12,67
ТГК-3	AOMD		USD	9,160	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	40,570	2,55%	14 901,83
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,802	0,42%	131,45
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	31,100	-2,14%	96 007,43
X5	FIVE		USD	40,600	1,00%	17 404,48
Газпром	GAZ		EUR	10,025	-0,10%	1 294,41
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,150	0,67%	15,34
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,750	-0,77%	25,63
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,200	2,89%	0,32
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,120	-2,86%	30,54
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,946	7,50%	
Лукойл	LKOD		USD	62,900	1,13%	121 742,40
Лукойл	LUK		EUR	43,560	0,54%	314,74
Лукойл	LUKOY	1	USD	62,050	-0,45%	7 695,39
МТС	MBT	5	USD	18,920	-2,57%	38 879,92
МТС	MKY	5	EUR	13,175	-2,23%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,400	0,39%	19,20
Мечел	MTL	3	USD	25,680	-2,36%	42 180,98
НорНикель	NILSY	1	USD	25,000	1,58%	934,48
НорНикель	NNIA		EUR	17,375	1,31%	197,75
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	135,100	2,35%	78 729,26
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	3,040	9,99%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,855	-5,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,850	4,46%	5,85
Газпром	OGZD		USD	14,500	1,12%	418 852,20
ОМЗ	OMZD		USD	2,000	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	39,500	-5,50%	1 106,09
Ростелеком	RTL		EUR	26,875	-4,87%	30,74
Газпромнефть	SCF		EUR	15,300	1,19%	100,09
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,744	-0,07%	4,72
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,352	-4,56%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,960	-1,98%	76,92
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,750	1,04%	38,87
АФКСистема	SSA	1	USD	25,790	-0,81%	4 675,56
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	375,000	-1,14%	4,94
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,000	-1,37%	45 612,99
ВТБ	VTBR		USD	5,980	-1,64%	55 881,63
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

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.