ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

27 июня 2011г.

Комментарий по рынку акций

В пятницу американские фондовые индексы завершили торги с потерями около одного процента. Беспокойство биржевой публики было связано с сообщением агентства Moody's о постановке на пересмотр кредитных рейтингов крупнейших итальянских банков, а также рисками разрастания долгового кризиса в Греции. Давление на акции технологического сектора было обусловлено не очень сильной квартальной отчетностью компаний Oracle и Micron Technology. Опубликованная в пятницу макростатистика не оказала влияния на рынок: пересмотренные темпы роста ВВП США в I квартале 2011 года составили 1,9% в годовом исчислении (предыдущая оценка 1,8%); объема заказов

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 857,04	1,48%	-1,15%	-0,07%	32,36%
Индекс ММВБ	1 633,99	1,62%	-0,72%	-0,25%	19,87%
FTSE	5 697,72	0,41%	-0,30%	-4,06%	11,71%
S&P 500	1 268,45	-1,17%	-0,24%	-4,71%	18,14%
Dow Jones Avg.	11 934,58	-0,96%	-0,58%	-4,08%	17,55%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	3,4100	2,40%	-1,45%	33,73%
Газпром	7,0500	1,59%	5,22%	30,80%

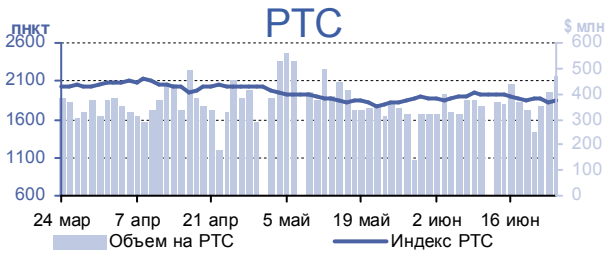
Лидеры снижения

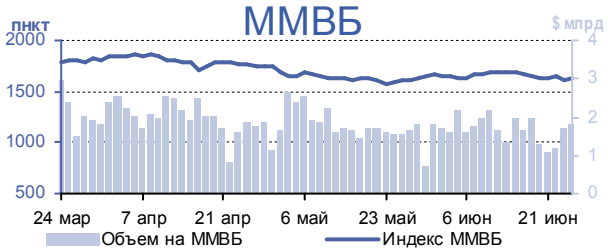
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Башнефть, п.	43,1000	-1,26%	7,75%	48,62%
НорНикель	251,2760	-0,09%	-1,07%	49,57%

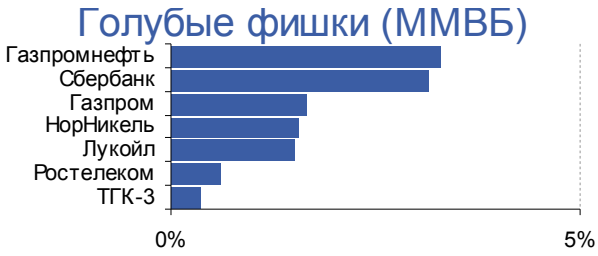
Индекс MSCI

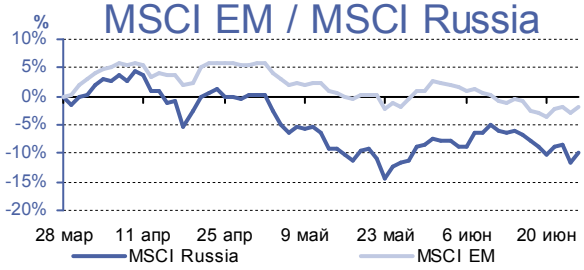
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1115,67	0,94%	-2,80%	17,18%
Индекс MSCI BRAZIL	3472,98	-0,61%	-3,81%	8,76%
Индекс MSCI RUSSIA	974,89	1,79%	-1,25%	31,41%
Индекс MSCI INDIA	489,66	2,63%	-0,32%	2,48%
Индекс MSCI CHINA	64,97	2,63%	-3,62%	5,13%

Основные индикаторы









Обзор рынка

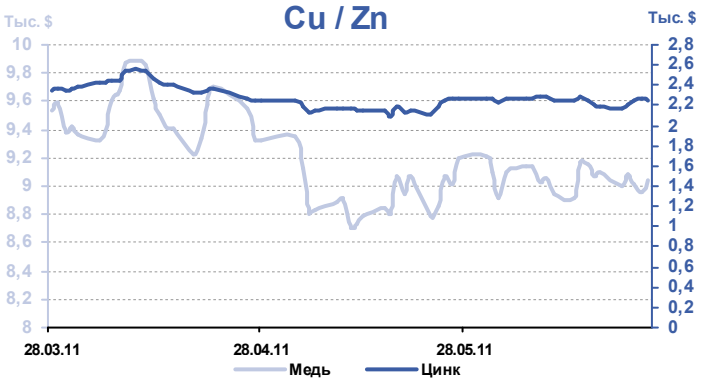
В пятницу американские фондовые индексы завершили торги с потерями около одного процента. Беспокойство биржевой публики было связано с сообщением агентства Moody's о постановке на пересмотр кредитных рейтингов крупнейших итальянских банков, а также рисками разрастания долгового кризиса в Греции. Давление на акции технологического сектора было обусловлено не очень сильной квартальной отчетностью компаний Oracle и Micron Technology. Опубликованная в пятницу макростатистика не оказала влияния на рынок: пересмотренные темпы роста ВВП США в I квартале 2011 года составили 1,9% в годовом исчислении (предыдущая оценка 1,8%); объема заказов на товары длительного пользования в мае вырос на 1,9% м/м в основном за счет роста составляющей транспортных заказов. Тем не менее, индекс S&P-500 сумел закрыться выше важной отметки - 1263,5 п., где сейчас проходит уровень 200-дневной скользящей средней.

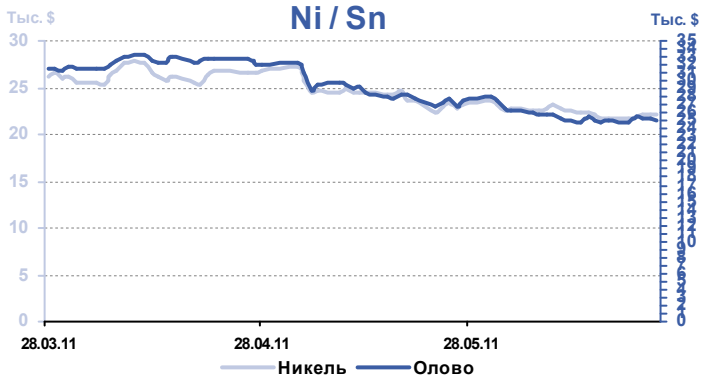
Позиции доллара в ходе утренних торгов в Азии укрепляются (DXY 75,90), поскольку трейдеры не уверены в позитивном исходе голосования (30 июня) в греческом Парламенте по вопросу сокращения бюджета страны. В противном случае, дефолт по долговым обязательствам Греции станет реальностью. Валютная пара EUR/USD движется вниз, пробив минимум прошлой недели, приближаясь к важной отметке 1,4080, прорыв которой будет означать движение к 1,3980. Усиление позиций доллара в купе со снижением американских индексов наложило отпечаток на котировки энергоносителей. Стоимость августовского фьючерсного контракта по нефти Brent сегодня утром опустилась до уровня $103,6/барр – минимум с середины февраля этого года.

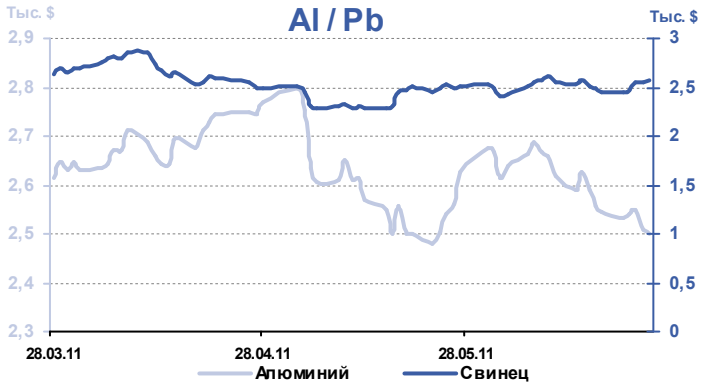
Открытие торгов на российском рынке акций в понедельник мы ожидаем увидеть в красной зоне. В первой половине торгов индекс ММВБ может потерять около одного процента из-за продаж бумаг нефтяного сектора. Однако фактор снижения цен на нефть может усилить позиции отечественных авиаперевозчиков из-за сокращения затрат на топливо. С 27 июня Сбербанк запускает спонсируемую программу американских депозитарных расписок (ADR) первого уровня на свои акции (одна расписка – четыре акции). Новые бумаги Сбера имеют возможность учувствовать в электронных торгах на Лондонской фондовой бирже, а позже могут быть допущенными там, на процедуру листинга. А пока ADR банка будут котироваться в системе внебиржевой торговли США «Pink Sheets». Мы надеемся, что запуск этого механизма торгов станет среднесрочным катализатором роста акций Сбербанка. Таким образом, в начале этой недели индекс ММВБ продолжит торговаться в сформировавшемся диапазоне: 1610-1640 пунктов, при этом активность покупателей в ближайшие три дня будет ограничена низкими ценами на нефть и неопределенностью ситуации вокруг греческих долгов.

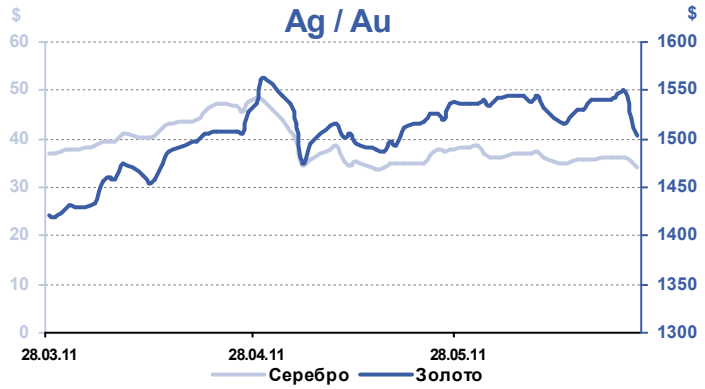
Сегодня состоятся годовые собрания акционеров Северстали, МТС и Ростелекома. В 16-30 Министерство торговли США выдаст данные по личным доходам/расходам американцев за май. В 18-30 ФРБ Далласа опубликует индекс деловой активности в производственном секторе штата Техас за июнь.

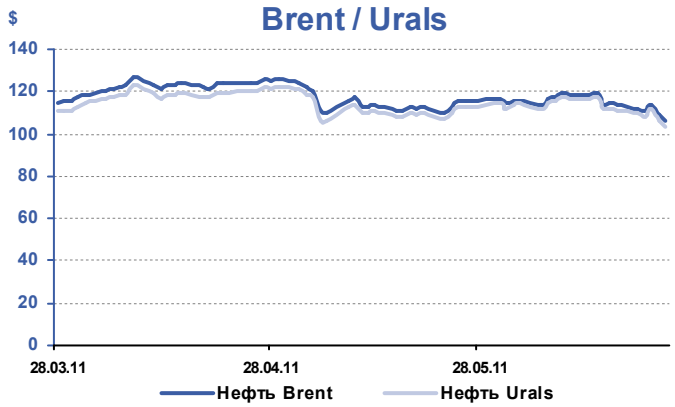
Commodities

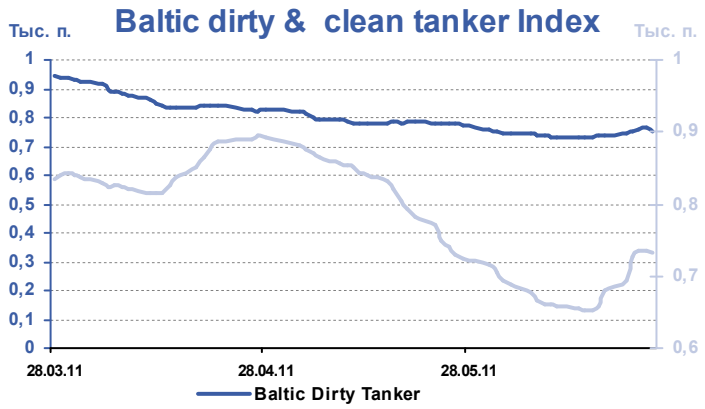












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 045,00	0,95%	-0,55%	-1,67%	35,12%
Цинк, $/t	2 254,00	-0,27%	3,02%	-0,88%	20,21%
Никель, $/t	22 150,00	0,11%	2,43%	-4,07%	14,18%
Олово, $/t	24 975,00	-0,89%	-0,12%	-9,18%	37,60%
Алюминий, $/t	2 500,00	-0,36%	-1,77%	-4,76%	27,23%
Свинец, $/t	2 580,00	1,22%	5,31%	2,99%	41,76%
Серебро, $/oz	34,29	-2,88%	-4,42%	-9,74%	83,33%
Золото, $/oz	1 502,65	-1,23%	-2,39%	-2,20%	20,85%
Нефть Brent, $/	106,15	-2,70%	-6,47%	-7,85%	41,21%
Нефть Urals, $/	103,55	-2,15%	-6,81%	-8,49%	39,76%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,478	0,00%	-0,95%		83 519	237
БашИнСв	BISV	0,461	0,00%	0,00%		7 396	439
БашЭнрг	BEGY	1,508	0,00%	1,43%		16 711	1 556
ВМЗ	VSMZ	1841,205	0,00%	0,99%		9 205	3 162
ДВМП	FESH	0,469	0,00%	1,20%		55 500	1 375
КазанскВЗ	KHEL	3,487	0,00%	2,71%		14 227	537
Мечел	MTLR	25,485	0,00%	1,19%		1 881 077	10 565
Мотовил	MOTZ	0,083	0,00%	1,61%		1 997	83
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,082	0,00%	0,00%	8 200		81
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,100	0,00%	0,00%	15 500		46 491
СилМашины	SILM	0,289	0,00%	0,55%		40 989	2 500
СинТЗ-ао	SNTZ	60,182	0,00%	0,00%		19 824	394
Славн-ЯНОС	JNOS	0,361	0,00%	-2,87%		2 296	335
СТЗ-ао	SVTZ	6,018	0,00%	6,26%		113 388	284
ТАГМЕТ	TAMZ	0,779	0,00%	10,00%		11 889	395
ТНК-ВР	TNBP	3,133	0,00%	1,72%		695 959	47 314
У-УАЗ	UUAZ	1,982	0,00%	1,08%		48 371	528
ЧМК	CHMK	250,250	0,00%	-1,82%		6 609	804
ЧТПЗ	CHEP	2,549	0,00%	1,24%		39 696	1 194
ЮжКузб.	UKUZ	53,455	0,00%	0,57%		11 279	1 930
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	54,000	0,00%	0,00%	37 800		9 189
Газпром	GAZP	7,050	1,59%	1,67%	176 250	536 377 069	166 898
Газпромнефть	SIBN	4,444	0,00%	3,30%		4 982 283	21 013
Лукойл	LKOH	61,000	0,00%	1,51%	614 750	95 741 192	51 884
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%	1,04%	42 170	80 634 436	95 640
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	2,00%	605 333	26 409 183	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,483	0,00%	1,81%	410 550	8 149 164	3 720
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%	-0,01%	15 750	13 483 783	2 449
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,750	0,00%	2,00%		103 865	3 542
Ленэнерго	LSNG	0,647	0,00%	-0,81%		76 107	600
МОЭСК	MSRS	0,052	0,00%	4,14%	2 598 939	1 447 172	2 532
ОГК-2	OGKB	0,051	0,00%	0,00%	102 600		1 683
ОГК-3	OGKC	0,048	0,00%	0,00%	24 000	202 688	2 279
ОГК-4	OGKD	0,088	0,00%	0,00%	43 750		5 517
ОГК-5	OGKE	0,086	0,00%	1,24%	8 550	146 858	3 024
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,093	0,00%	0,37%	93 000	1 613 019	3 697
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,80%		124 023	526
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,05%		59 532	669
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,235	0,00%	0,00%	82 350		17 017
Ростелеком	RTKM	5,800	0,00%	0,62%	116 000	6 380 195	17 071
Ростелеком, п.	RTKMP	3,300	0,00%	1,23%	33 000	1 473 122	796
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	3,08%		42 765	169
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,000	0,00%	1,49%	25 000	561 462	1 388
ГАЗ	GAZA	42,000	0,00%	0,00%	42 000		778
ИРКУТ	IRKT	0,304	0,00%	0,92%		16 017	297
КАМАЗ	KMAZ	2,189	0,00%	0,54%		37 977	1 553
ОМЗ	OMZZ	2,630	0,00%	-0,31%		12 405	94
РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	2,08%	14 700	22 704	337
Северсталь-авто	SVAV	18,680	0,00%	1,60%	24 284	77 019	640
Металлургия							

ВСМПО	VSMO	158,000	0,00%	2,61%	15 800	3 672 636	1 822
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	0,00%	-0,59%	24 500	4 766 827	10 951
НЛМК	NLMK	3,540	0,00%	3,96%	177 000	12 438 689	21 216
НорНикель	GMKN	251,276	-0,09%	1,55%	53 773	128 849 847	47 900
Полиметалл	PMTL	22,000	0,00%	1,28%	379 800	1 862 455	8 587
Полюс Золото	PLZL	70,600	0,00%	-0,78%	353 000	4 632 170	13 458
Северсталь	CHMF	19,144	0,00%	1,27%	89 004	27 564 914	19 292
Тагмет	TAMZ	0,740	0,00%	0,00%	37 000		342
ТМК	TRMK	4,595	0,00%	-0,51%		1 711 024	4 375
ЧТПЗ	CHEP	2,610	0,00%	0,00%	15 650		1 233
Банки							
Банк Москвы	MMBM	27,687	0,00%	0,96%		71 135	4 959
Возрождение	VZRZ	32,750	0,00%	-0,15%	32 750	33 679	778
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,80%	6 300	83 600 491	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,664	0,00%	-0,96%		16 989	4 477
Сбербанк	SBER	3,410	2,40%	0,00%	1 637 764		73 611
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,506	0,00%	1,28%	87 710	855 867	2 783
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	52 800		1 417
НМТП	NMTP	0,119	0,00%	-1,16%		33 534	2 298
Приморское МП	PRIM	0,170	0,00%	0,95%		20 140	134
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,200	0,00%	0,00%	40 240		326
Балтика	PKBA	48,429	0,00%	1,57%		250 522	7 354
Верофарм	VRPH	44,905	0,00%	0,00%	313 480		449
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	-1,05%	33 132	3 395	5 808
ГУМ	GUMM	1,470	0,00%	0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	13,550	0,00%	2,89%	13 550	1 105 482	1 690
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	1,60%	100 000	59 100	488
Красный Октябрь	KROT	11,141	0,00%	0,07%		1 670	103
Магнит	MGNT	137,000	0,00%	-0,05%	81 950	4 458 790	12 190
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,256	0,00%	-1,14%		27 062	20
Разгуляй	GRAZ	2,040	0,00%	1,48%	20 400	113 383	323
Фармстандарт	PHST	76,500	0,00%	0,55%	153 000	233 317	2 882
Черкизово	GCHE	27,436	0,00%	0,01%		3 182	1 181
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,850	0,00%	-0,43%	42 500	17 997	1 370
Уфанефтехим	UFNC	5,550	0,00%	0,00%	222 500		1 539
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	202,466	0,00%	0,00%	6 074		282
ПИК	pikk	3,677	0,00%	0,19%	5 001	1 440 014	1 814
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	0,00%	4 964	1 115 118	200
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,750	0,00%	0,12%	45 750	971 809	2 182
Дорогобуж	DGBZ	0,610	0,00%	1,40%	30 805	20 691	440
Уралкалий	URKA	8,850	0,00%	1,75%	88 500	21 935 086	18 801
Уголь							
Белон	BLNG	0,663	0,00%	0,00%	5 399		762
Распадская	rasp	5,740	0,00%	-0,20%	57 400	4 604 369	4 482
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	166,000	-1,37%	33,23
Башнефть	AK6		EUR	185,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,160	-3,33%	4,26
ТГК-3	AOMD		USD	8,845	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	40,600	2,76%	39 674,36
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,856	1,85%	11,46
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,400	2,43%	67 907,18
X5	FIVE		USD	39,310	0,61%	24 690,07
Газпром	GAZ		EUR	9,925	1,38%	1 320,40
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,084	-50,59%	330,85
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,250	-1,94%	7,58
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,110	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,600	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,946	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	61,900	2,06%	256 730,30
Лукойл	LUK		EUR	43,545	1,41%	359,26
Лукойл	LUKOY	1	USD	61,650	0,82%	5 846,64
МТС	MBT	5	USD	18,680	-0,69%	48 684,64
МТС	MKY	5	EUR	13,350	1,87%	10,01
МГТС	MOW		EUR	9,900	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,210	0,08%	2,95
Мечел	MTL	3	USD	24,960	-0,48%	36 604,89
НорНикель	NILSY	1	USD	25,050	0,20%	802,81
НорНикель	NNIA		EUR	17,690	1,09%	68,44
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	134,000	3,80%	73 270,02
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	3,040	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,062	-3,45%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,950	3,48%	
Газпром	OGZD		USD	14,090	1,81%	785 440,90
ОМЗ	OMZD		USD	2,250	12,50%	4,73
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	38,900	1,51%	146,61
Ростелеком	RTL		EUR	26,900	0,09%	
Газпромнефть	SCF		EUR	15,700	2,28%	44,65
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,739	0,72%	0,68
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,423	1,88%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,900	2,73%	130,79
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,650	0,84%	97,83
АФКСистема	SSA	1	USD	24,560	-2,92%	12 969,06
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	372,730	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,670	-1,63%	20 965,54
ВТБ	VTBR		USD	5,795	0,78%	87 729,22
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.