ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

1 июля 2011г.

Комментарий по рынку акций

В последний день второго квартала и накануне Дня независимости американские фондовые индексы добавили еще более процента к своему предыдущему росту. Такого быстрого и уверенного 4-дневного роста на заокеанских биржах не было с сентября прошлого года. Участники рынка, почему-то связывают этот оптимизм с благоприятным разрешением греческого долгового кризиса. Думаю, биржевую публику просто порадовал рост индекса деловой активности PMI Чикаго до отметки 61,1 п. против прогноза 54,0 п. (больше всего выросла компонента новых заказов: 61,2 против 53,5). На слабые данные по заявкам по получение пособий по безработице (428 тыс. против прогноза

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 906,71	0,64%	4,19%	1,59%	42,36%
Индекс ММВБ	1 666,59	0,40%	3,65%	0,96%	27,29%
FTSE	5 945,71	1,53%	4,78%	0,29%	20,92%
S&P 500	1 320,64	1,01%	2,89%	0,46%	28,13%
Dow Jones Avg.	12 414,34	1,25%	3,02%	1,01%	27,01%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО АРМАДА	15,3000	7,97%	3,87%	91,25%
Сбербанк, п.	2,7500	7,95%	-1,79%	53,63%
Распадская	6,1500	7,14%	1,65%	25,51%
Сбербанк	3,6800	3,66%	4,78%	44,31%
Уралкалий	9,0100	2,97%	16,26%	80,20%
Башнефть, п.	44,2500	2,43%	6,63%	52,59%
Акрон	46,7500	2,19%	8,80%	57,04%
ОАО Группа ЛСР	34,5400	2,16%	-8,26%	27,93%

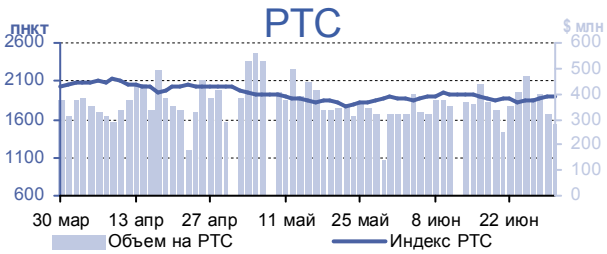
Лидеры снижения

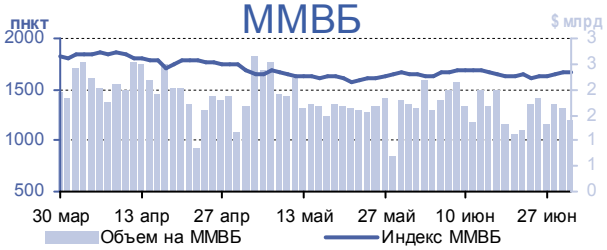
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-4	0,0003	-25,00%	-32,50%	-38,64%
МСЗ, Электросталь	160,0000	-20,97%	-27,27%	-39,62%

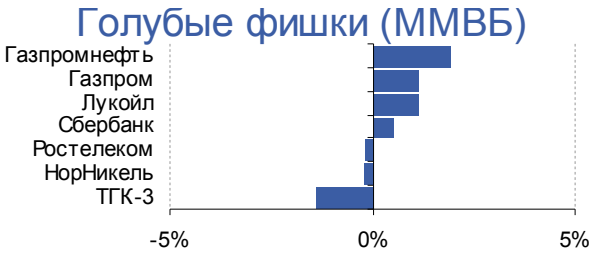
Индекс MSCI

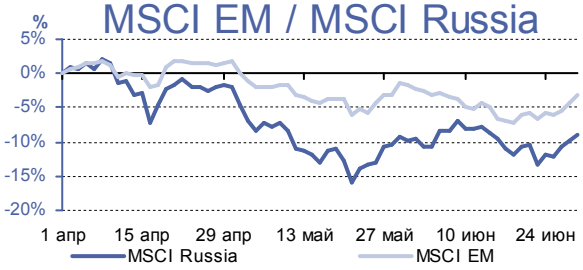
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1146,22	1,19%	-1,76%	24,86%
Индекс MSCI BRAZIL	3632,36	1,02%	0,96%	19,96%
Индекс MSCI RUSSIA	1007,07	0,92%	1,02%	42,35%
Индекс MSCI INDIA	508,26	1,24%	0,46%	6,60%
Индекс MSCI CHINA	65,78	1,43%	-4,40%	9,94%

Основные индикаторы









Обзор рынка

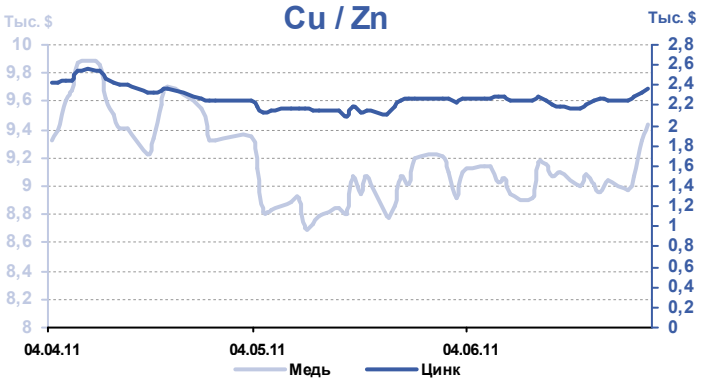
В последний день второго квартала и накануне Дня независимости американские фондовые индексы добавили еще более процента к своему предыдущему росту. Такого быстрого и уверенного 4-дневного роста на заокеанских биржах не было с сентября прошлого года. Участники рынка, почему-то связывают этот оптимизм с благоприятным разрешением греческого долгового кризиса. Думаю, биржевую публику просто порадовал рост индекса деловой активности PMI Чикаго до отметки 61,1 п. против прогноза 54,0 п. (больше всего выросла компонента новых заказов: 61,2 против 53,5). На слабые данные по заявкам по получение пособий по безработице (428 тыс. против прогноза 419 тыс.) инвесторы внимание обращать не стали. Лидерами роста вчера стали сектора акций промышленных и технологических компаний. Таким образом, индекс S&P-500 вчера сумел закрыться выше 50-дневной скользящей средней, проходящей на уровне 1317 п., а по итогам II квартала его потери составили лишь 0,4% (прирост на 5% с начала года).

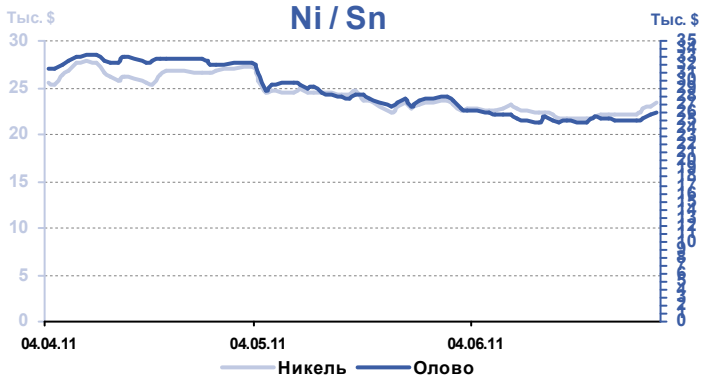
Под окончание недели на валютном рынке наблюдается относительное затишье (EUR/USD 1,4515) поскольку инвесторы ожидают результатов встречи Еврогруппы, которая пройдет в эти выходные. Поддерживать позиции единой европейской валюты будет ожидание того, что на следующей неделе ЕЦБ будет повышать процентные ставки, для сдерживания инфляции. После решительного роста в середине недели цены на нефть марки Brent продолжают торговлю в фазе консолидации ($111,7/барр). Цены на промышленные металлы в пятницу незначительно снижаются (медь -0,6%; никель -0,65%) по факту слабого индекса деловой активности в производственном секторе Китая в июне до 50,9 п. против прогноза 51,5 пункта (PMI Китая рассчитываемый HSBC в июне достиг 11-месячного минимума – 50,1 п.).

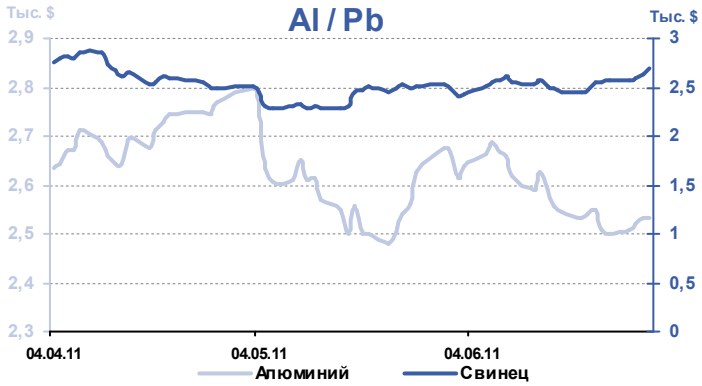
В пятницу мы ожидаем увидеть сохранение нейтрально-позитивной динамики в наших биржевых индексах. Акции в Европе и Штатах растут уже несколько дней кряду на ожиданиях того, что дефолта Греции удастся избежать. В России ситуация иная. Мы сейчас больше коррелируем с бразильским индексом Bovespa, потеряв взаимосвязь с FTSE или S&P-500. Но будем надеяться, что консолидация индекса ММВБ возле уровня сопротивления на 1667 пунктов выльется в прорыв вверх, с целью роста на 1690-1700 п. С 1 июля на LSE начнутся торги ADR Сбербанка. Мы надеемся, что этот факт обеспечит уверенный прорыв котировок банка выше отметки 100 руб., с целью роста 107-110 руб.

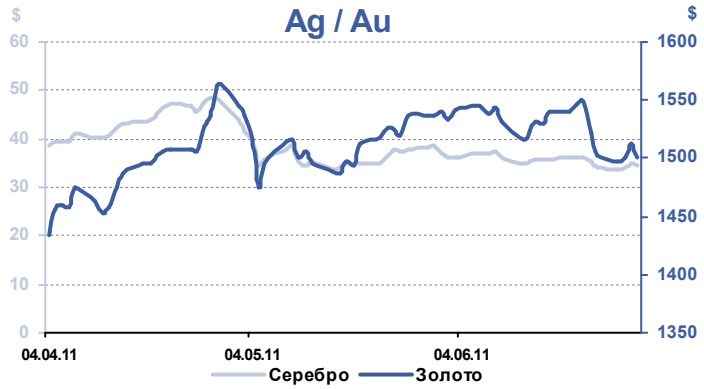
Сегодня в 17-55 университет Мичигана выдаст данные по индексу потребительского доверия США за июнь (прогноз: 72 п.). В 18-00 в США выходит индекс деловой активности в производственном секторе США (индекс ISM Manufacturing) за июнь (прогноз: снижение до 51,9 п.). В это же время будут опубликованы данные по объему расходов на строительство за май.

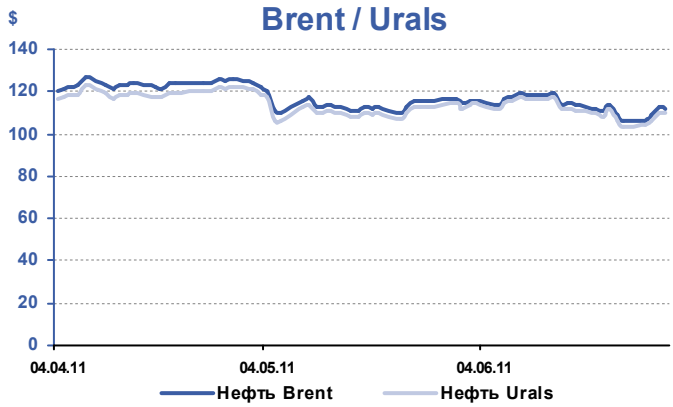
Commodities

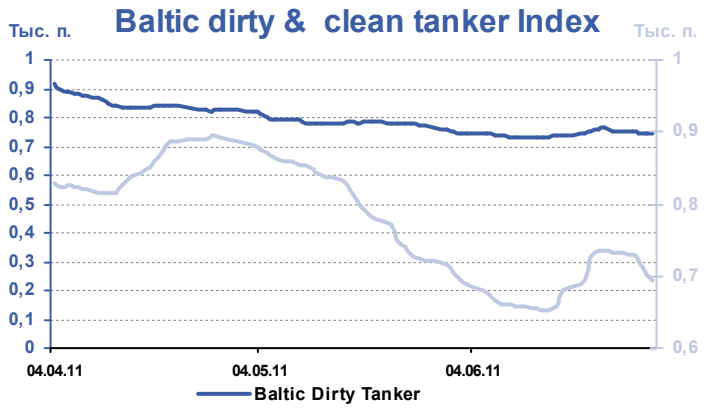












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 430,00	1,18%	5,25%	3,60%	44,74%
Цинк, $/t	2 365,00	2,07%	4,65%	4,74%	31,94%
Никель, $/t	23 425,00	1,52%	5,88%	0,75%	18,64%
Олово, $/t	26 050,00	0,79%	3,37%	-5,60%	49,50%
Алюминий, $/t	2 532,00	-0,04%	0,92%	-5,10%	28,04%
Свинец, $/t	2 684,00	1,90%	5,30%	7,36%	53,37%
Серебро, $/oz	34,69	-0,58%	-1,76%	-5,86%	86,36%
Золото, $/oz	1 500,35	-0,79%	-1,38%	-2,56%	20,78%
Нефть Brent, $/	111,68	-0,64%	2,37%	-2,30%	51,18%
Нефть Urals, $/	109,87	0,15%	3,82%	-1,96%	49,93%

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%	0,00%		7 159	243
БашИнСв	BISV	0,474	0,00%	1,52%		32 648	478
БашЭнрг	BEGY	1,558	0,00%	0,98%		6 174	1 609
ВМЗ	VSMZ	1812,389	0,00%	-3,79%		1 812	3 113
ДВМП	FESH	0,466	0,00%	0,58%		138 347	1 361
КазанскВЗ	KHEL	3,444	0,00%	-2,75%		3 963	531
Мечел	MTLR	25,002	0,00%	-0,60%		6 056 051	10 426
Мотовил	MOTZ	0,088	0,00%	1,65%		5 812	85
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	0,292	0,00%	0,43%		5 831	2 526
СинТЗ-ао	SNTZ	60,999	0,00%	0,00%		63 779	400
Славн-ЯНОС	JNOS	0,393	0,00%	7,35%		654	359
СТЗ-ао	SVTZ	6,136	0,00%	0,59%		65 288	306
ТАГМЕТ	TAMZ	0,825	0,00%	-0,48%		998	423
ТНК-ВР	TNBP	3,145	0,00%	0,74%		152 474	47 150
У-УАЗ	UUAZ	2,047	0,00%	0,44%		44 655	545
ЧМК	CHMK	255,155	0,00%	0,13%		4 083	807
ЧТПЗ	CHEP	2,619	0,00%	-0,01%		101 631	1 228
ЮжКузб.	UKUZ	55,218	0,00%	-2,91%		242 188	1 995
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	54,750	1,39%	0,00%	36 737		9 317
Газпром	GAZP	7,050	0,00%	1,17%	176 250	386 178 995	166 898
Газпромнефть	SIBN	4,650	0,00%	1,93%	23 250	8 275 429	22 047
Лукойл	LKOH	61,000	0,00%	1,16%	305 000	87 654 465	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	8,430	0,00%	-0,15%	84 300	63 842 244	89 343
Сургутнефтегаз	SNGS	0,961	0,00%	-0,29%	605 333	16 570 933	34 315
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,483	0,00%	1,03%	410 550	5 951 135	3 720
Татнефть	TATN	6,290	0,00%	0,00%	157 250		13 704
Татнефть, п.	TATNP	3,015	0,00%	0,00%	15 075		445
Транснефть, п.	TRNFP	1450,000	0,00%	0,39%	72 500	8 329 832	2 255
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,540		0,00%	17 710		1 606
Иркутскэнерго	IRGZ	0,752	0,00%	-8,67%	56 363	508 911	3 582
Ленэнерго	LSNG	0,612	0,00%	-2,17%		98 499	562
МОЭСК	MSRS	0,055	0,00%	0,40%	27 500	884 807	2 679
ОГК-2	OGKB	0,048	1,06%	0,00%	23 750		1 555
ОГК-3	OGKC	0,048	0,00%	-0,25%	24 000	223 263	2 279
ОГК-4	OGKD	0,088	0,00%	0,00%	40 662		5 548
ОГК-5	OGKE	0,084	0,00%	0,46%		259 848	2 983
Самараэнерго	SAGO	0,022	0,00%	0,00%	42 998		79
ТГК-3	MSNG	0,093	0,00%	-1,38%	93 000	964 332	3 697
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-10,08%		569 700	472
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-11,30%	6 800	399 917	559
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,120	0,00%	0,00%	16 240		16 779
Ростелеком	RTKM	5,702	0,00%	-0,17%	16 958	11 355 916	16 783
Ростелеком, п.	RTKMP	3,500	0,00%	0,54%	105 000	1 556 054	789
Таттелеком	TTLK	0,009	0,00%	8,86%		380 019	187
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,000	0,00%	1,76%	25 000	822 661	1 388
ГАЗ	GAZA	42,000	0,00%	0,00%	42 000		778
ИРКУТ	IRKT	0,308	0,00%	0,27%		17 380	301
Казанский ВЗ	KHEL	3,200	0,00%	0,00%	14 112		493
КАМАЗ	KMAZ	2,200	0,00%	0,10%		71 766	1 562
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,250		0,00%	11 250		90
ОМЗ	OMZZ	2,763	0,00%	0,26%		37 746	98

РКК Энергия	RKKE	300,000	0,00%	2,63%	14 700	40 109	337
Северсталь-авто	SVAV	18,680	0,00%	0,49%	24 284	140 372	640
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,470	0,00%	0,00%	23 500		234
ВСМПО	VSMO	160,000	0,00%	-2,00%	14 560	284 137	1 845
Мечел	MTLR	26,050	0,00%	0,00%	103 900		10 844
ММК	MAGN	0,980	0,00%	-0,21%	24 500	4 528 700	10 951
НЛМК	NLMK	3,540	0,00%	-1,55%	177 000	5 417 551	21 216
НорНикель	GMKN	261,800	0,00%	-0,21%	39 270	101 106 390	49 906
Полиметалл	PMTL	22,000	0,00%	-1,03%	379 800	1 867 290	8 587
Полюс Золото	PLZL	70,600	0,00%	-0,75%	353 000	6 254 797	13 458
Северсталь	CHMF	19,144	0,00%	0,45%	89 004	22 668 080	19 292
Тагмет	TAMZ	0,740	0,00%	0,00%	37 000		342
ТМК	TRMK	4,669	0,00%	1,28%		2 613 074	4 343
ЧТПЗ	CHEP	2,750	5,36%	0,00%	13 750		1 299
Банки							
Банк Москвы	MMBM	28,670	0,00%	1,85%		56 500	5 100
Возрождение	VZRZ	32,000	0,00%	-0,63%	272 000	103 910	760
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,19%	6 300	68 378 288	32 951
РОСБАНК	ROSB	3,707	0,00%	0,30%		840	4 543
Сбербанк	SBER	3,680	3,66%	0,00%	36 800		78 792
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,506	0,00%	0,36%	87 710	906 243	2 783
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	52 800		1 417
НМТП	NMTP	0,121	0,00%	0,24%		52 848	2 319
Приморское МП	PRIM	0,170	0,00%	0,17%		856	136
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,350		0,00%	6 700		352
Балтика	PKBA	48,749	0,00%	0,31%		8 684	7 239
Верофарм	VRPH	44,905	0,00%	0,00%	313 480		449
Вимм-Билль-Данн	WBDF	132,000	0,00%	-0,11%	33 132	2 921	5 808
ГУМ	GUMM	1,470	0,00%	0,00%	70 295		88
Дикси	DIXY	13,800	0,00%	-0,46%	27 500	72 037	1 722
Концерн Калина	KLNA	50,000	0,00%	-1,01%	100 000	13 404	488
Красный Октябрь	KROT	11,126	0,00%	-1,87%		4 692	105
Магнит	MGNT	132,000	0,00%	-1,06%	33 000	1 931 692	11 745
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,276	0,00%	-0,34%		11 846	21
Разгуляй	GRAZ	2,005	0,00%	1,62%		588 737	313
Фармстандарт	PHST	75,000	0,00%	-0,15%	7 500	168 437	2 834
Черкизово	GCHE	27,984	0,00%	0,63%		75 404	1 211
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,850	0,00%	2,16%	42 500	193 834	1 370
Уфанефтехим	UFNC	5,550	0,00%	0,00%	222 500		1 539
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	160,000	-20,97%	0,00%	86 100		251
ПИК	pikk	3,822	0,00%	0,72%	5 225	2 298 861	1 885
РБК ИС	RBCI	1,260	0,00%	0,00%	4 964		176
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	46,750	2,19%	1,48%	46 750	873 202	2 246
Дорогобуж	DGBZ	0,610	0,00%	-0,09%	30 805	40 695	440
Уралкалий	URKA	9,010	2,97%	-0,32%	90 100	29 519 141	27 883
Уголь							
Распадская	rasp	6,150	7,14%	-0,73%	107 664	4 361 025	4 802
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	164,500	2,17%	2,01
Башнефть	AK6		EUR	173,380	0,58%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,290	1,57%	6,87
ТГК-3	AOMD		USD	8,845	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	43,100	2,79%	15 597,30
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,774	2,50%	3,90
Бурятзолото	BYT		EUR	20,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	31,150	0,23%	30 464,16
X5	FIVE		USD	39,100	1,03%	48 835,14
Газпром	GAZ		EUR	10,045	1,98%	1 657,25
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,065	-7,14%	6,60
Иркутскэнерго	IRK		EUR	24,260	-1,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	5,600	-6,67%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,946	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	63,600	1,35%	176 986,70
Лукойл	LUK		EUR	43,200	-0,29%	307,63
Лукойл	LUKOY	1	USD	63,750	1,43%	4 053,71
МТС	MBT	5	USD	19,020	0,05%	51 656,02
МТС	MKY	5	EUR	12,980	-0,84%	1,34
МГТС	MOW		EUR	9,900	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,880	-0,42%	8,96
Мечел	MTL	3	USD	23,890	-1,24%	110 834,40
НорНикель	NILSY	1	USD	26,070	-0,19%	1 277,13
НорНикель	NNIA		EUR	17,900	0,56%	144,25
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	138,100	2,68%	42 404,54
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,650	-3,64%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	0,894	-4,99%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,850	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	14,580	1,67%	427 582,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,250	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,750	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	40,500	0,12%	58,98
Ростелеком	RTL		EUR	27,620	-1,06%	
Газпромнефть	SCF		EUR	15,800	2,27%	67,55
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,610	0,85%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,400	3,03%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,970	-1,58%	96,52
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,800	-1,51%	114,63
АФКСистема	SSA	1	USD	25,700	2,39%	6 418,35
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	373,000	0,07%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,760	-0,70%	246 086,00
ВТБ	VTBR		USD	6,165	1,40%	51 264,29
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.