ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

26 июля 2011г.

Комментарий по рынку акций

В понедельник американские фондовые индексы завершили торги в красной зоне. В конце июля все внимание биржевой публики по-прежнему приковано, как к проблемам греческих долгов, так и к отсутствию прогресса в части повышения лимита госдолга США. На такую статистику, как индекс национальной активности ФРБ Чикаго (снижение в июле составило -0.46 п. против прогноза -0.40) уже никто не обращает внимания.

Желая успокоить мировое финансовое сообщество, сегодня утром Президент США Барак Обама сообщил, что переговоры по повышению лимита госдолга Америки пока находятся в тупике

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 979,54	0,14%	3,95%	6,60%	34,88%
Индекс ММВБ	1 726,93	-0,11%	2,33%	5,69%	23,62%
FTSE	5 925,26	-0,16%	3,00%	3,99%	10,73%
S&P 500	1 337,43	-0,56%	2,45%	5,44%	19,95%
Dow Jones Avg.	12 592,80	-0,70%	1,68%	5,52%	19,64%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сургутнефтегаз, п.	0,5200	6,12%	7,66%	10,40%
ОГК-4	0,0975	4,84%	11,43%	9,55%
Башнефть, п.	52,2500	4,50%	21,23%	63,28%
ОГК-2	0,0489	2,52%	-4,86%	-5,96%
ОГК-6	0,0392	1,82%	-1,51%	-2,00%
Северсталь	18,7431	0,02%	-2,10%	31,90%

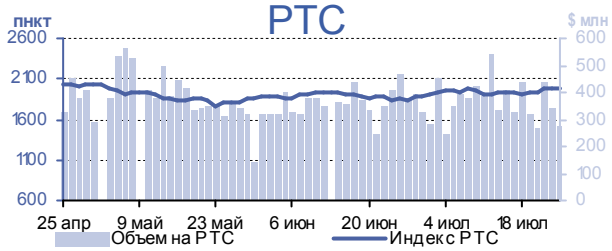
Лидеры снижения

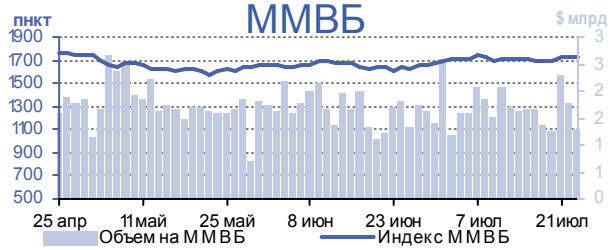
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Полюс Золото	58,0000	-7,20%	-17,85%	30,93%
ОГК-5	0,0895	-3,76%	4,68%	1,82%
Распадская	6,2100	-0,32%	8,19%	21,53%
Магнит	142,3000	-0,14%	3,87%	27,05%

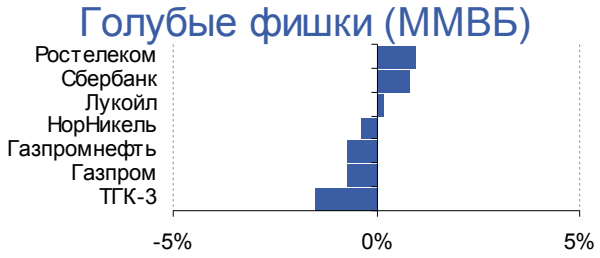
Индекс MSCI

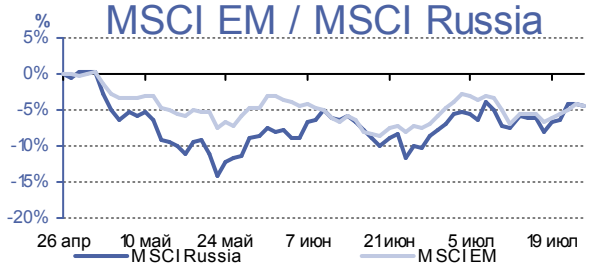
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1148,18	-0,43%	2,91%	16,51%
Индекс MSCI BRAZIL	3549,54	0,61%	2,20%	5,43%
Индекс MSCI RUSSIA	1034,62	-0,21%	6,13%	31,22%
Индекс MSCI INDIA	512,57	0,60%	4,68%	7,38%
Индекс MSCI CHINA	65,14	-1,25%	0,26%	5,22%

Основные индикаторы









Обзор рынка

В понедельник американские фондовые индексы завершили торги в красной зоне. В конце июля все внимание биржевой публики по-прежнему приковано, как к проблемам греческих долгов, так и к отсутствию прогресса в части повышения лимита госдолга США. На такую статистику, как индекс национальной активности ФРБ Чикаго (снижение в июле составило -0.46 п. против прогноза -0.40) уже никто не обращает внимания.

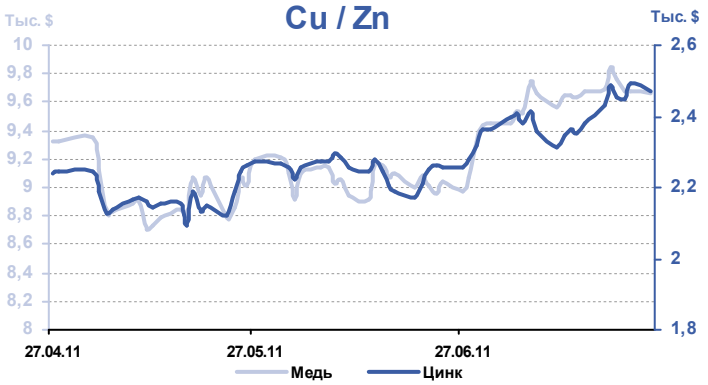
Желая успокоить мировое финансовое сообщество, сегодня утром Президент США Барак Обама сообщил, что переговоры по повышению лимита госдолга Америки пока находятся в тупике, однако он выразил уверенность в том, что решение будет найдено в ближайшее время. Эффект оказался обратным: на валютном рынке курс доллара начал резко дешеветь (EUR/USD 1,45). Белый Дом боится, что из-за несговорчивости Конгресса может быть снижен кредитный рейтинг США (AAA), а значит, вольготная жизнь в долг для Америки может закончиться. Индекс доллара DXY опустился до минимальных отметок с начала июня (73,63).

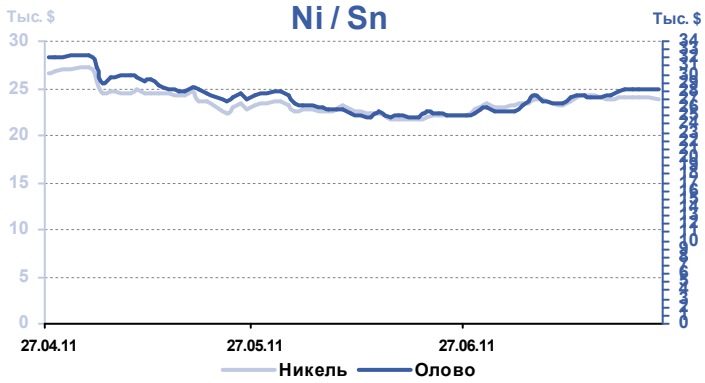
В условиях искусственного нагнетания напряженности на долговых рынках, инвесторы предпочитают переводить активы в золото ($1615/унц). Стоимость метрической тонны алюминия ($2628/т) поднялись сейчас до максимальных уровней более, чем за месяц. Цены на нефть марки Brent продолжают стабильную торговлю возле отметки $118/барр.

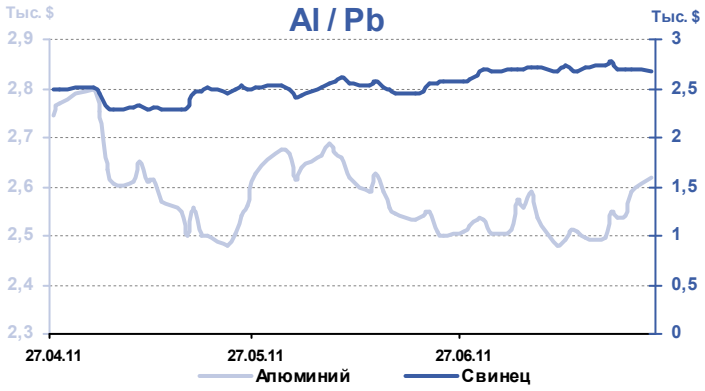
Во вторник мы ожидаем увидеть умеренно-позитивное открытие торгов на наших биржах. Вчерашняя слабость Газпрома (-0,74%) в сочетании с силой акций Сбербанка (+0,81%) не дают однозначных выводов о биржевом настрое рынка. Тем не менее, сегодня утром индекс ММВБ закроет свой вчерашний гэп на 1730 п., однако, как это уже бывало не раз за последние дни, днем нас может ждать очередная волна снижения в район 1715 п. Думаю, что большинство инвесторов предпочитают оставаться статистами для таких малозначительных колебаний в индексах, тем более, что игра «веришь – не веришь» пока не приводит к разрушению биржевых котировок, а выливается лишь в игру по ослаблению курса доллара и разогрева цен на золото.

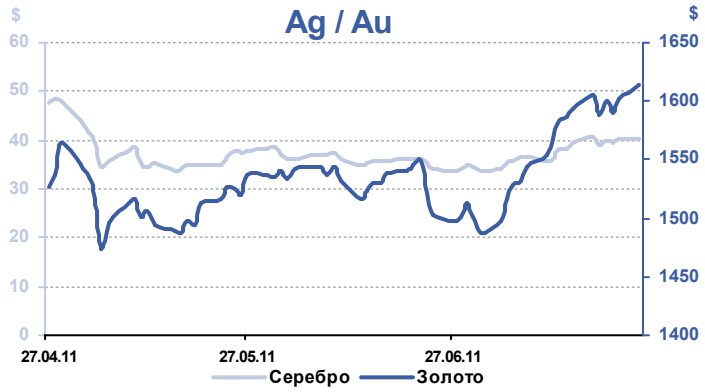
Сегодня квартальную отчетность представят много значимых компаний: 3M, Amazon.com, BP PLC, Deutsche Bank, Eastman Kodak, Fiat, Ford Motor, GlaxoSmithKline PLC, Lockheed Martin, UBS AG, UPS, US Steel, Valero Energy, Western Union. В 17-00 ждем данных от S&P/Case-Shiller по индексу цен на дома в 10-ти и 20-ти крупнейших городах США за май. В 18-00 компания Conference Board представит индекс потребительского доверия в США за июнь. В это же время выходит статистика по продажам новых домов за июнь.

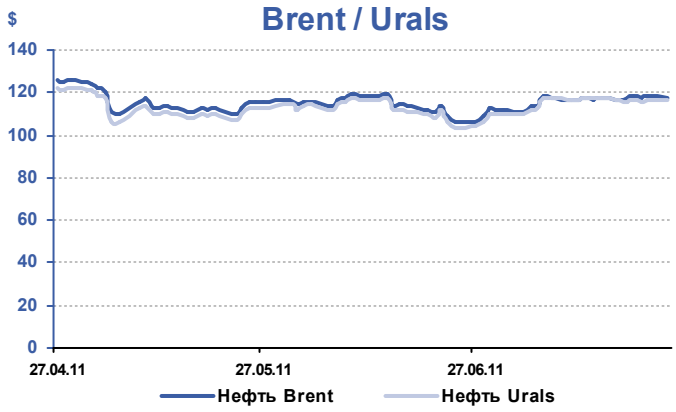
Commodities

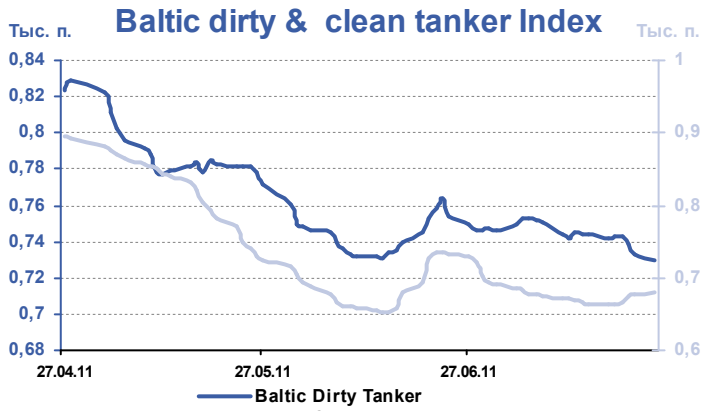












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 655,00	-0,21%	-0,40%	6,74%	35,05%
Цинк, $/t	2 470,00	-1,00%	1,60%	9,58%	26,41%
Никель, $/t	23 800,00	-0,73%	0,00%	7,45%	14,42%
Олово, $/t	28 150,00	-0,51%	2,83%	12,71%	45,10%
Алюминий, $/t	2 620,00	1,16%	4,93%	4,80%	27,43%
Свинец, $/t	2 675,00	-0,56%	-2,01%	3,68%	32,75%
Серебро, $/oz	40,35	0,65%	-0,49%	17,66%	122,12%
Золото, $/oz	1 614,15	0,80%	0,58%	7,42%	36,38%
Нефть Brent, $/	117,45	-0,71%	0,88%	10,65%	52,28%
Нефть Urals, $/	116,10	-0,45%	-0,38%	12,12%	53,59%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,487	0,00%	-0,36%		6 029	242
БашИнСв	BISV	0,471	0,00%	0,01%		84 968	447
БашЭнрг	BEGY	1,769	0,00%	-0,41%		26 721	1 845
ВМЗ	VSMZ	1985,072	0,00%	0,00%		1 985	3 409
ДВМП	FESH	0,484	0,00%	1,32%		4 418	1 449
КазанскВЗ	KHEL	3,537	0,00%	0,51%		2 228	545
Мечел	MTLR	25,189	0,00%	-0,84%		861 221	10 503
Мотовил	MOTZ	0,094	0,00%	6,93%		6 889	90
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	2000,000	0,00%	0,00%	100 000		3 435
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,084	0,00%	0,00%	1 518		84
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,210	0,00%	0,00%	32 100		48 140
СилМашины	SILM	0,294	0,00%	0,49%		73 441	2 556
СинТЗ-ао	SNTZ	58,570	0,00%	0,00%		233	367
Славн-ЯНОС	JNOS	0,386	0,00%	-2,73%		193	360
СТЗ-ао	SVTZ	5,745	0,00%	0,75%		4 313	266
ТАГМЕТ	TAMZ	0,720	0,00%	0,00%		72	366
ТНК-ВР	TNBP	3,221	0,00%	-0,45%		371 435	48 146
У-УАЗ	UUAZ	2,059	0,00%	0,07%		27 549	545
ЧМК	CHMK	254,234	0,00%	-1,40%		14 459	802
ЧТПЗ	CHEP	3,049	0,00%	3,01%		38 721	1 429
ЮжКузб.	UKUZ	59,556	0,00%	4,17%		254 656	2 110
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	58,250	0,00%	0,00%	64 630		9 912
Газпром	GAZP	7,280	0,00%	-0,74%	362 500	311 482 134	172 343
Газпромнефть	SIBN	5,000	0,00%	-0,71%	100 000	1 928 778	23 706
Лукойл	LKOH	65,050	0,00%	0,16%	325 250	96 707 839	55 329
Роснефть	ROSN	8,500	0,00%	0,29%	12 750	74 014 648	90 085
Сургутнефтегаз	SNGS	1,027	0,00%	0,21%		22 023 122	36 300
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,520	6,12%	1,14%	52 000	6 276 457	4 005
Татнефть	TATN	6,970	2,35%	0,00%	348 500		15 185
Татнефть, п.	TATNP	3,303	0,00%	0,00%	375 660		487
Транснефть, п.	TRNFP	1500,000	0,00%	0,20%	150 000	10 352 227	2 332
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,750	0,00%	0,00%	43 750		1 825
Иркутскэнерго	IRGZ	0,752	0,00%	-1,41%	56 363	53 855	3 582
Ленэнерго	LSNG	0,664	0,00%	-1,47%		58 915	614
МОЭСК	MSRS	0,056	0,00%	0,18%	28 000	40 070	2 728
ОГК-2	OGKB	0,049	2,52%	0,00%	38 310		1 601
ОГК-3	OGKC	0,047	0,00%	-0,28%	34 766	136 935	2 246
ОГК-4	OGKD	0,098	4,84%	0,00%	49 151		6 147
ОГК-5	OGKE	0,090	-3,76%	0,00%	69 923	388 152	3 166
ТГК-3	MSNG	0,095	0,00%	-1,50%	122 357	543 709	3 792
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-1,00%	251 264	6 886	517
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-1,68%	107 612	47 998	615
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,300	0,00%	0,00%	9 130		17 151
Ростелеком	RTKM	6,530	0,00%	0,98%	56 678	15 822 763	19 219
Ростелеком, п.	RTKMP	3,500	0,00%	0,41%	70 000	26 156 919	850
Таттелеком	TTLK	0,009	0,00%	-3,21%		27 898	182
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,110	0,00%	-1,30%		117 226	1 548
ГАЗ	GAZA	48,200	0,00%	0,00%	48 200		893
ИРКУТ	IRKT	0,318	0,00%	-0,62%		9 164	315
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	2,213	0,00%	-0,05%		86 209	1 555
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,250	0,00%	0,00%	11 250		90
ОМЗ	OMZZ	2,639	0,00%	0,18%		9 961	93
РКК Энергия	RKKE	298,880	0,00%	0,00%		52 247	335
Северсталь-авто	SVAV	19,000	0,00%	-0,79%	19 000	120 847	651

Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,478	0,00%	0,00%	143 337		238
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	180,000	0,00%	4,65%	90 000	551 958	2 075
Мечел	MTLR	23,350	0,00%	0,00%	35 025		9 720
ММК	MAGN	0,885	0,00%	-0,32%	88 500	1 403 949	9 889
НЛМК	NLMK	3,934	0,00%	0,45%		4 576 094	23 448
НорНикель	GMKN	267,000	0,00%	-0,35%	267 000	68 733 623	50 898
Полиметалл	PMTL	20,500	0,00%	1,23%	20 500	6 856 332	8 187
Полюс Золото	PLZL	58,000	-7,20%	3,44%	58 000	23 810 703	11 056
Северсталь	CHMF	18,743	0,02%	0,36%	46 858	17 286 551	18 887
ТМК	TRMK	4,551	0,00%	0,07%		417 736	4 269
ЧТПЗ	CHEP	2,750	0,00%	0,00%	13 750		1 299
Банки							
Банк Москвы	MMBM	28,946	0,00%	-0,61%		135 997	5 235
Возрождение	VZRZ	33,000	0,00%	-0,49%	322 116	49 346	784
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-1,14%		81 854 809	32 163
РОСБАНК	ROSB	3,655	0,00%	0,28%		548	4 546
Сбербанк	SBER	3,665	-0,14%	0,00%	2 329 194		79 116
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,550	0,00%	-0,14%	22 160	588 081	2 832
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	9 600		1 417
НМТП	NMTP	0,114	0,00%	-0,04%	8 926	594 408	2 190
Приморское МП	PRIM	0,183	0,00%	6,03%		2 506	143
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,085	0,00%	0,00%	15 425		324
Балтика	PKBA	46,000	0,00%	-1,49%	92 000	76 848	6 979
Вимм-Билль-Данн	WBDF	138,955	0,00%	0,00%		278	6 114
Дикси	DIXY	13,850	0,00%	-0,47%	219 387	53 750	1 728
Концерн Калина	KLNA	51,612	0,00%	2,08%		21 402	328
Красный Октябрь	KROT	10,250	0,00%	-0,15%	20 500	6 134	94
Магнит	MGNT	142,300	-0,14%	-0,08%	596 590	1 688 578	12 661
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,214	0,00%	-0,50%		3 677	20
Разгуляй	GRAZ	1,753	0,00%	0,04%		67 802	276
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	87,670	0,00%	-0,16%	8 767	26 346	3 313
Черкизово	GCHE	28,982	0,00%	-1,88%		16 625	1 247
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,220	0,00%	0,00%	185 869		392
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,952	0,00%	-1,40%	14 280	8 916	1 534
Салаватнефтеоргсинтез	SNOZ	130,000	0,00%	0,00%	52 000		2 412
Уфанефтехим	UFNC	5,800	0,00%	0,00%	495 750		1 597
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	180,000	0,00%	0,00%	5 400		251
ПИК	pikk	3,885	0,00%	-0,71%	10 001	1 103 845	1 916
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	53,000	0,00%	1,35%	26 500	946 631	2 527
Дорогобуж	DGBZ	0,642	0,00%	-1,06%		30 048	463
Уралкалий	URKA	9,230	0,00%	-0,86%	215 246	24 387 697	28 565
Уголь							
Распадская	rasp	6,210	-0,32%	-0,06%	124 200	3 128 277	4 849
УК Южный Кузбасс	UKUZ	55,000	0,00%	0,00%	71 500		1 986

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	169,950	0,00%	
Башнефть	AK6		EUR	199,000	-0,50%	
ТГК-3	AOMD		USD	9,300	0,87%	13,43
Татнефть	ATAD		USD	43,760	1,16%	18 240,95
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,960	1,41%	15,41
Бурятзолото	BYT		EUR	19,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	33,150	0,45%	16 641,51
X5	FIVE		USD	41,750	-0,60%	6 658,02
Газпром	GAZ		EUR	10,000	-1,96%	1 400,72
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,050	0,00%	4,71
Иркутскэнерго	IRK		EUR	26,750	0,94%	1,08
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,500	1,45%	2,80
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,890	10,24%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,860	-2,27%	11,26
Лукойл	LKOD		USD	67,600	0,30%	194 157,90
Лукойл	LUK		EUR	46,665	-0,82%	509,43
Лукойл	LUKOY	1	USD	67,520	0,01%	7 268,89
МТС	MBT	5	USD	18,370	-0,22%	27 704,65
МТС	MKY	5	EUR	12,510	-0,67%	
МГТС	MOW		EUR	10,250	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,319	0,37%	7,99
Мечел	MTL	3	USD	25,180	-1,87%	31 496,63
НорНикель	NILSY	1	USD	27,080	-0,51%	51,84
НорНикель	NNIA		EUR	18,550	-1,83%	91,66
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	156,700	-2,67%	60 184,92
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,440	9,96%	2,20
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,689	-3,49%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,625	0,00%	3,20
Газпром	OGZD		USD	14,490	-0,41%	348 576,50
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	13,64%	3,75
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	45,700	0,95%	162,19
Ростелеком	RTL		EUR	31,205	2,51%	23,38
Газпромнефть	SCF		EUR	17,110	-0,67%	90,14
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,986	2,10%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,450	0,73%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,240	0,96%	1 208,87
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,200	0,49%	57,13
АФКСистема	SSA	1	USD	24,750	-0,20%	5 350,64
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	14,090	-0,70%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	33,210	-0,60%	
СТЗ	SVY		EUR	39,375	-0,25%	
ЦУМ	THT		EUR	15,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	374,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,500	1,30%	58 944,97
ВТБ	VTBR		USD	6,100	-0,97%	55 585,76
Возрождение	VZY		EUR	23,200	5,45%	

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.