ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

29 июля 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг американские фондовые индексы преимущественно снижались (индекс DJIA без остановки падает уже 5 сессий подряд). Инвесторы остаются в напряженном волнении за 5 дней до возможного наступления дефолта на рынке госдолга США. Палата представителей Конгресса США отложила до пятницы голосование по бюджетному плану спикера Джона Бонера. Если и сегодня ничего не выйдет, то Палата представителей продолжит сессию на выходных. Интересно, что на страсти вокруг лимита госдолга США реагирует в основном рынок акций, в то время как тот же рынок госдолга США чувствует себя прекрасно: по итогам вчерашнего аукциона по размещению 7-летних казначейских

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 985,11	0,45%	0,64%	4,78%	34,59%
Индекс ММВБ	1 720,38	0,83%	-0,50%	3,64%	23,33%
FTSE	5 873,21	0,28%	-0,45%	0,29%	10,41%
S&P 500	1 300,67	-0,32%	-3,21%	-0,52%	17,59%
Dow Jones Avg.	12 240,11	-0,51%	-3,81%	-0,17%	16,60%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Ростелеком, п.	3,6500	4,29%	10,61%	25,86%
Ростелеком	6,8000	4,13%	17,24%	58,14%
УК Южный Кузбасс	66,0000	3,94%	24,53%	50,00%
Северсталь	19,4579	3,81%	1,64%	34,96%
Акрон	55,0000	3,77%	20,22%	89,66%
Сбербанк, п.	3,0100	0,33%	18,16%	53,57%
Северсталь-авто	18,2500	0,27%	-2,30%	8,10%

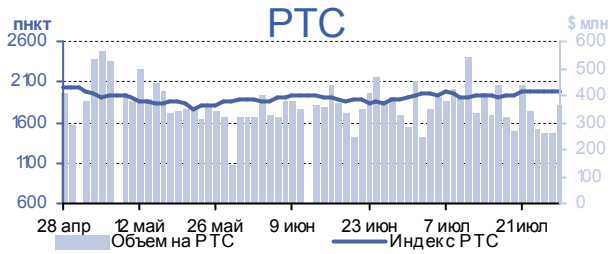
Лидеры снижения

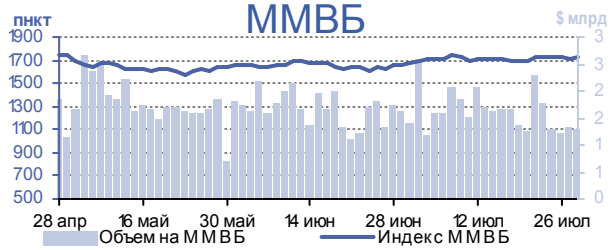
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО АРМАДА	14,7500	-3,59%	4,09%	103,45%
ОАО РОСИНТЕР	12,3000	-2,38%	-5,38%	-16,04%
Казаньоргсинтез	0,2150	-2,08%	-2,27%	17,72%
Башнефть, п.	49,0000	-2,00%	13,43%	53,13%

Индекс MSCI

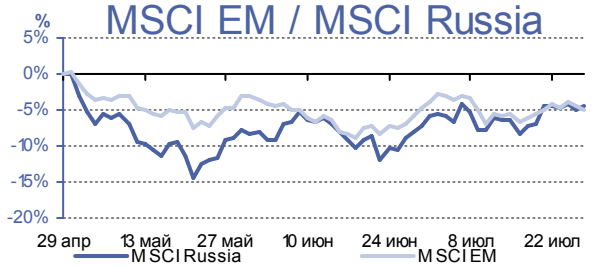
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1145,40	-0,31%	1,11%	15,55%
Индекс MSCI BRAZIL	3445,60	0,66%	-4,17%	1,12%
Индекс MSCI RUSSIA	1037,68	0,53%	3,99%	31,91%
Индекс MSCI INDIA	499,91	-1,24%	-0,42%	4,43%
Индекс MSCI CHINA	65,84	-0,36%	1,52%	5,21%

Основные индикаторы









Обзор рынка

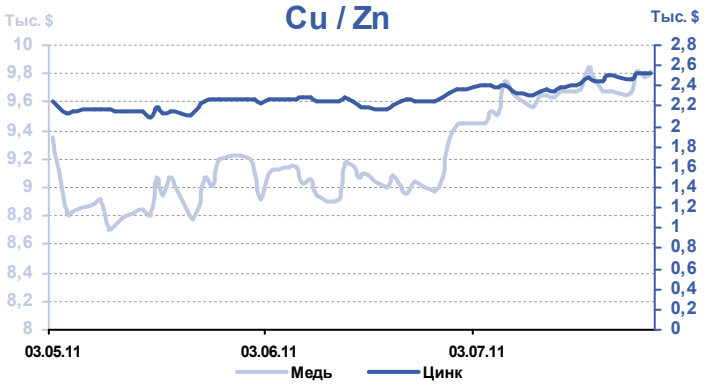
В четверг американские фондовые индексы преимущественно снижались (индекс DJIA без остановки падает уже 5 сессий подряд). Инвесторы остаются в напряженном волнении за 5 дней до возможного наступления дефолта на рынке госдолга США. Палата представителей Конгресса США отложила до пятницы голосование по бюджетному плану спикера Джона Бонера. Если и сегодня ничего не выйдет, то Палата представителей продолжит сессию на выходных. Интересно, что на страсти вокруг лимита госдолга США реагирует в основном рынок акций, в то время как тот же рынок госдолга США чувствует себя прекрасно: по итогам вчерашнего аукциона по размещению 7-летних казначейских бондов на сумму $29 млрд. их доходность опустилась до 2,28% - минимальный уровень с ноября прошлого года. Есть ощущение, что американский фондовый рынок просто корректируется по факту завершения периода квартальной отчетности, которая в целом не принесла неприятных сюрпризов, а возня вокруг лимита госдолга США – лишь повод к фиксации прибыли.

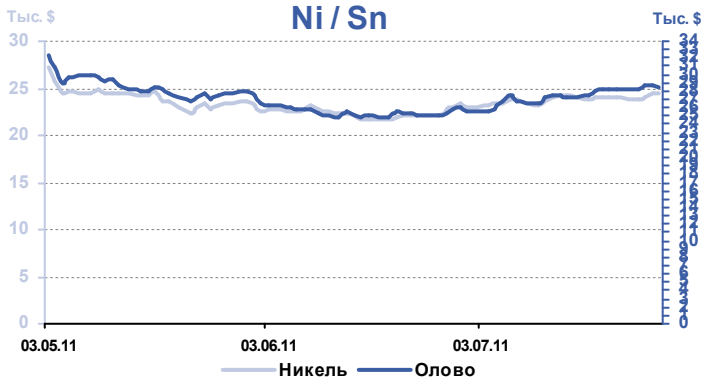
В конце недели сохраняется волатильность на валютном рынке. Позиции единой европейской валюты сегодня утром в очередной раз ослабли (EUR/USD 1,4300) после того, как агентство Moody's поместило рейтинг Испании (AA2) на пересмотр с целью возможного понижения. Цены на нефть марки Brent хоть и торгуются в пятницу несколько ниже вчерашних уровней, по-прежнему остаются зажатыми в узком боковом тренде (115-119 $/барр), который длится уже 3 недели. Азиатские фондовые индексы сегодня показывают неагрессивное снижение (MSCI Asia -0,85%), отчасти из-за слабых макроэкономических данных из Японии за июнь (уровень безработицы вырос до 4,6%; расходы домохозяйств -4,2% г/г; промышленное производство 3,9% м/м против 6,2% м/м в мае), отчасти из-за опасений по поводу проблемы увеличения лимита государственного долга США.

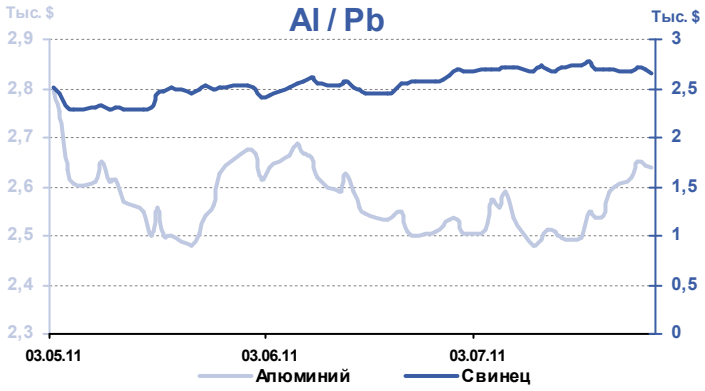
К открытию торгов на наших биржах в пятницу сложился умеренно-негативный внешний фон. Утром потери индекса ММВБ могут составить около полупроцента. Тот рывок вверх, который мы наблюдали вчера под закрытие сессии может не получить должного продолжения, а индекс ММВБ так и останется в фазе консолидации с границами: 1700-1730 п. На стороне биржевых «быков» остается спекулятивных спрос в таких индексных бумагах, как Сбербанк и Газпром (мы также ждем сохранения спроса в акциях Северстали), но вот негатив на европейских биржах, может опять нарушить планы спекулянтов на рост. Сегодня Роснефть отчитывается по US GAAP 2 полугодие. Распадская представит свою отчетность по МСФО за 1 полугодие. Дикси опубликует операционные результаты за 6 месяцев.

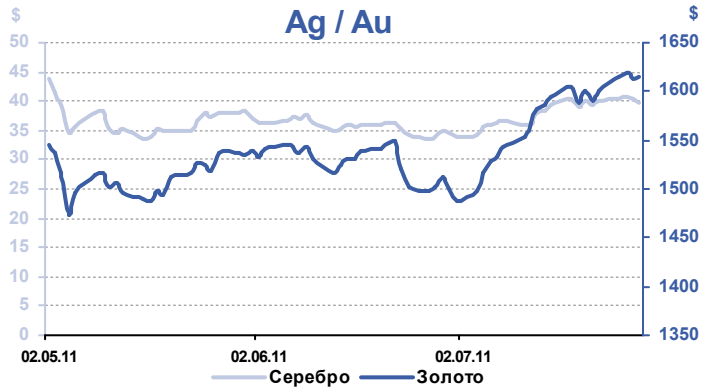
Сегодня в 16-30 Министерство торговли США представит отчет с предварительными данными ВВП США за II квартал (прогноз: рост ВВП на 1,7%). В это же время ждем данных по индексу стоимости рабочей силы за II квартал. В 17-45 выходит Индекс деловой активности в производственном секторе Среднего Запада (ISM-Chicago) за июль. В 17-55 Университет Мичигана выдаст окончательные данные по индексу потребительского доверия США за июль.

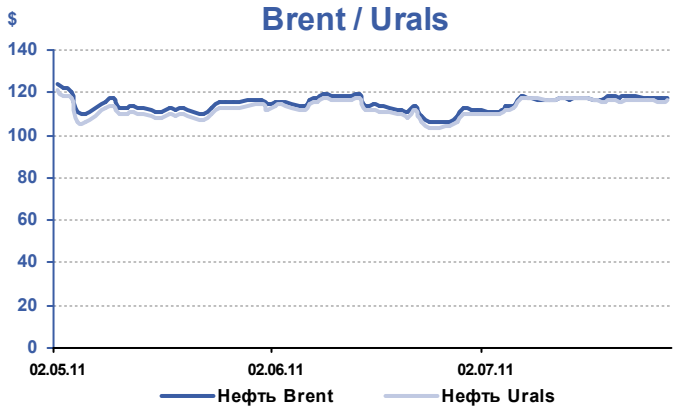
Commodities

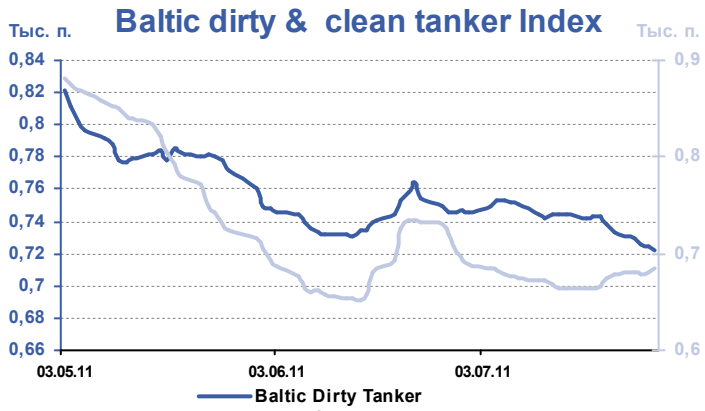












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 814,00	0,36%	1,38%	5,30%	36,88%
Цинк, $/t	2 520,00	-0,08%	2,86%	8,76%	28,90%
Никель, $/t	24 555,00	0,66%	2,53%	6,41%	20,34%
Олово, $/t	28 500,00	-0,85%	0,71%	10,27%	45,97%
Алюминий, $/t	2 638,00	-0,23%	3,86%	4,15%	27,56%
Свинец, $/t	2 655,50	-1,28%	-1,65%	0,82%	31,62%
Серебро, $/oz	39,77	-1,27%	0,91%	13,97%	127,63%
Золото, $/oz	1 615,95	0,14%	1,59%	6,85%	38,88%
Нефть Brent, $/	117,14	0,03%	-0,43%	4,22%	54,91%
Нефть Urals, $/	116,33	0,27%	0,26%	6,04%	56,82%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,471	0,00%	0,00%		36 541	233
БашИнСв	BISV	0,465	0,00%	-0,81%		9 783	442
БашЭнрг	BEGY	1,765	0,00%	0,41%		39 755	1 834
ВМЗ	VSMZ	1997,835	0,00%	0,00%		1 998	3 431
ДВМП	FESH	0,481	0,00%	0,94%		13 687	1 412
КазанскВЗ	KHEL	3,614	0,00%	0,00%		34 053	545
Мечел	MTLR	25,138	0,00%	0,39%		526 378	10 441
Мотовил	MOTZ	0,093	0,00%	-5,76%		1 755	92
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	3,260	-0,61%	0,00%	9 780		48 890
СилМашины	SILM	0,286	0,00%	-1,26%		76 674	2 492
СинТЗ-ао	SNTZ	56,349	0,00%	0,00%		113	355
Славн-ЯНОС	JNOS	0,373	0,00%	-3,74%		1 885	352
СТЗ-ао	SVTZ	5,825	0,00%	0,00%		291	280
ТАГМЕТ	TAMZ	0,720	0,00%	0,00%		72	366
ТНК-ВР	TNBP	3,261	0,00%	-0,06%		324 921	48 877
У-УАЗ	UUAZ	2,036	0,00%	-0,74%		49 123	543
ЧМК	CHMK	255,109	0,00%	-0,09%		1 273	805
ЧТПЗ	CHEP	3,019	0,00%	0,74%		85 129	1 421
ЮжКузб.	UKUZ	66,288	0,00%	-0,69%		603 024	2 392
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	57,000	-0,87%	0,00%	86 000		9 700
Газпром	GAZP	7,280	0,00%	1,11%	362 500	305 776 359	172 343
Газпромнефть	SIBN	5,000	0,00%	0,36%	100 000	566 729	23 706
Лукойл	LKOH	65,050	0,00%	0,67%	325 250	75 061 429	55 329
Мегионнефтегаз	MFGS	16,000		0,00%	528		1 592
НОВАТЭК	NVTK	14,400		0,00%	516 800		43 723
Роснефть	ROSN	8,500	0,00%	0,85%	12 750	44 336 605	90 085
Сургутнефтегаз	SNGS	1,029	0,00%	1,65%		15 398 175	36 340
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,520	0,00%	0,08%	52 000	6 746 991	4 005
Татнефть	TATN	6,870	-1,43%	0,00%	685 250		14 968
Татнефть, п.	TATNP	3,303	0,00%	0,00%	375 660		487
Транснефть, п.	TRNFP	1600,000	0,00%	0,27%	16 000	8 999 019	2 488
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,750	0,00%	0,00%	43 750		1 825
Иркутскэнерго	IRGZ	0,752	0,00%	2,49%	56 363	413 409	3 582
Ленэнерго	LSNG	0,668	0,00%	-0,10%		27 657	619
МОЭСК	MSRS	0,056	0,00%	0,31%	28 000	134 800	2 728
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,049	0,00%	0,00%	38 310		1 601
ОГК-3	OGKC	0,047	0,00%	0,16%	34 766	128 705	2 246
ОГК-4	OGKD	0,098	0,00%	0,00%	49 151		6 147
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-0,92%	69 923	503 240	3 166
ТГК-3	MSNG	0,095	0,00%	0,14%	122 357	203 092	3 792
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,27%	251 264	34 227	517
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,83%	107 612	10 802	615
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,300	0,00%	0,00%	9 130		17 151
Ростелеком	RTKM	6,800	4,13%	-2,35%	173 713	14 057 566	20 014
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	4,29%	-0,45%	194 728	17 840 643	886
Таттелеком	TTLK	0,009	0,00%	-0,40%		3 891	180
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,089	0,00%	-0,92%		127 646	1 515
ГАЗ	GAZA	48,200	0,00%	0,00%	48 200		893
ИРКУТ	IRKT	0,322	0,00%	0,98%		24 163	313
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	2,178	0,00%	-0,40%		84 643	1 539
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,250	0,00%	0,00%	11 250		90

ОМЗ	OMZZ	2,645	0,00%	1,04%		7 677	94
РКК Энергия	RKKE	301,854	0,00%	0,36%		911	341
Северсталь-авто	SVAV	18,250	0,27%	0,60%	7 446	139 633	625
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	175,000	0,00%	1,66%	57 375	386 894	2 018
Мечел	MTLR	23,350	0,00%	0,00%	35 025		9 720
ММК	MAGN	0,885	0,00%	0,16%	88 500	2 615 801	9 889
НЛМК	NLMK	3,865	0,00%	-0,05%		6 345 888	23 127
НорНикель	GMKN	270,750	0,00%	-0,07%	676 875	72 205 115	51 612
Полиметалл	PMTL	20,500	0,00%	-0,61%	20 500	3 063 569	8 187
Полюс Золото	PLZL	58,000	0,00%	-0,59%	58 000	13 993 752	11 056
Северсталь	CHMF	19,458	3,81%	3,54%	86 064	37 071 462	19 608
ТМК	TRMK	4,457	0,00%	-0,53%		8 169 830	4 171
ЧТПЗ	CHEP	2,750	0,00%	0,00%	13 750		1 299
Банки							
Банк Москвы	MMBM	29,718	0,00%	1,80%		97 508	5 375
Возрождение	VZRZ	33,000	0,00%	0,70%	33 000	29 655	784
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,37%	15 097	69 111 321	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,660	0,00%	1,00%		8 574	4 481
Сбербанк	SBER	3,705	-0,71%	0,00%	6 284 455		79 980
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,550	0,00%	-0,64%	22 160	2 494 762	2 832
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	9 600		1 417
НМТП	NMTP	0,114	0,00%	-0,33%	8 926	157 981	2 190
Приморское МП	PRIM	0,172	0,00%	-0,36%		172	137
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,085	0,00%	0,00%	15 425		324
Балтика	PKBA	46,000	0,00%	0,14%	262 200	7 969	6 979
Вимм-Билль-Данн	WBDF	139,512	0,00%	0,00%		1 256	6 139
Дикси	DIXY	13,750	-0,36%	-0,69%	6 875	83 236	1 715
Концерн Калина	KLNA	52,902	0,00%	1,38%		39 909	338
Красный Октябрь	KROT	10,250	0,00%	0,23%	20 500	819	94
Магнит	MGNT	144,000	0,00%	-1,20%	165 736	2 023 878	12 812
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,209	0,00%	0,36%		20 061	19
Разгуляй	GRAZ	1,786	0,00%	0,57%		438 277	281
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	87,670	0,00%	0,85%	8 767	104 120	3 313
Черкизово	GCHE	28,990	0,00%	-0,61%		31 534	1 236
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,215	-2,08%	0,00%	21 550		384
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,952	0,00%	0,76%	14 280	85 749	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	3,900	0,00%	1,20%	5 004	2 254 106	1 924
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	55,000	3,77%	0,13%	27 500	654 696	2 635
Дорогобуж	DGBZ	0,649	0,00%	1,25%		63 090	467
Уралкалий	URKA	9,230	0,00%	1,45%	215 246	29 316 400	28 565
Уголь							
Распадская	rasp	6,210	0,00%	0,08%	124 200	3 472 225	4 849
УК Южный Кузбасс	UKUZ	66,000	3,94%	0,00%	13 200		2 383

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	175,500	3,24%	
Башнефть	AK6		EUR	198,000	0,51%	179,32
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,130	-11,72%	0,17
ТГК-3	AOMD		USD	9,200	-1,08%	4,60
Татнефть	ATAD		USD	42,700	-1,54%	13 185,93
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,804	0,85%	
Бурятзолото	BYT		EUR	19,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	33,440	0,42%	43 431,93
X5	FIVE		USD	42,400	-0,24%	17 274,48
Газпром	GAZ		EUR	10,035	-0,20%	2 005,03
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,063	45,46%	16,03
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,250	3,81%	6,64
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,200	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,890	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	12,50%	
Лукойл	LKOD		USD	67,400	0,00%	146 870,60
Лукойл	LUK		EUR	46,470	-0,38%	303,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	66,950	0,16%	4 478,25
МТС	MBT	5	USD	18,690	-0,85%	37 352,68
МТС	MKY	5	EUR	12,990	0,62%	4,83
МГТС	MOW		EUR	10,250	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,380	-0,51%	3,10
Мечел	MTL	3	USD	24,850	-0,68%	31 184,28
НорНикель	NILSY	1	USD	26,500	-1,05%	318,28
НорНикель	NNIA		EUR	18,600	0,54%	157,75
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	154,200	1,18%	46 454,06
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,381	-4,76%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,800	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,475	0,39%	65,88
Газпром	OGZD		USD	14,600	0,48%	359 172,10
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	42,800	-3,17%	77,10
Ростелеком	RTL		EUR	30,475	-2,59%	35,68
Газпромнефть	SCF		EUR	17,270	0,64%	36,90
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,930	-0,23%	9,15
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,450	0,00%	39,28
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,190	-1,14%	203,62
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,250	0,89%	44,80
АФКСистема	SSA	1	USD	24,910	0,20%	5 589,68
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	13,790	-0,72%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	32,610	-0,61%	
СТЗ	SVY		EUR	39,075	-0,26%	
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	12,470	-0,48%	29 726,96
ВТБ	VTBR		USD	6,120	-0,65%	39 744,69
Возрождение	VZY		EUR	23,800	9,43%	

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.