ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

15 августа 2011г.

Комментарий по рынку акций

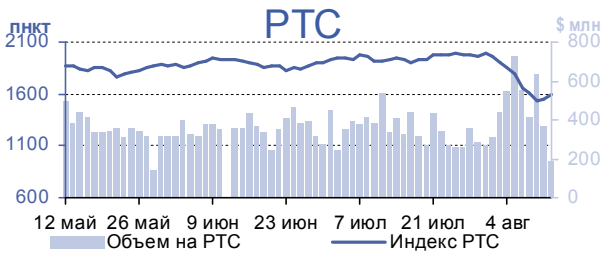
В пятницу американские фондовые индексы завершили торги в зеленой зоне. Позитивные данные по розничным продажам (рост в июле составил 0,5%) позволили участникам рынка проигнорировать крайне слабые данные по индексу потребительских настроений от Мичиганского университета (в августе значение рухнуло до 54,9 п.). Таким образом, после крайне волатильной недели за ведущие американские биржевые индикаторы просели на 1,6-2,7%. Не слишком много по сравнению с потерями европейских и особенно российских индексов.

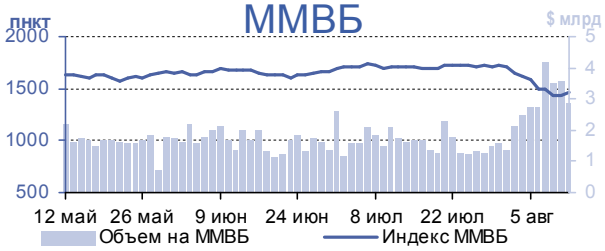
Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 594,68	3,71%	-11,35%	-17,74%	10,33%
Индекс ММВБ	1 470,56	2,74%	-7,34%	-14,23%	7,23%
FTSE	5 320,03	6,25%	1,39%	-8,96%	0,85%
S&P 500	1 178,81	5,18%	-1,72%	-10,43%	9,22%
Dow Jones Avg.	11 269,02	5,12%	-1,53%	-9,70%	9,37%

Основные индикаторы





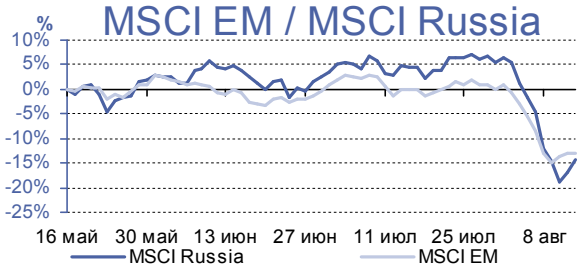
Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	4,5000	18,42%	-27,77%	-21,74%
Аэрофлот	2,0000	12,99%	-21,57%	-13,04%
ПИК	3,7480	8,64%	-0,05%	-2,73%
Возрождение	31,2000	0,65%	-6,59%	-16,24%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Ростелеком	4,8000	-28,36%	-15,82%	4,80%
Магнит	108,0000	-10,00%	-23,73%	-8,47%
Сбербанк	2,9250	-4,10%	-22,04%	-3,15%
ОАО Группа ЛСР	27,4000	-0,72%	-24,20%	-4,70%



Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	989,74	0,92%	-12,84%	0,95%
Индекс MSCI BRAZIL	3009,95	3,34%	-12,61%	-10,07%
Индекс MSCI RUSSIA	834,23	5,47%	-17,89%	8,61%
Индекс MSCI INDIA	446,14	-1,92%	-11,50%	-7,41%
Индекс MSCI CHINA	56,68	-0,57%	-12,45%	-8,26%

Обзор рынка

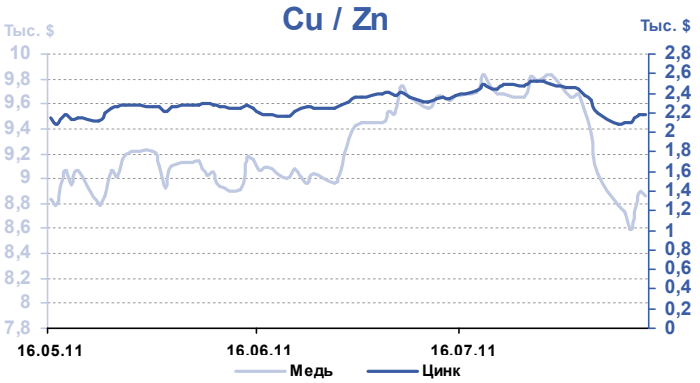
В пятницу американские фондовые индексы завершили торги в зеленой зоне. Позитивные данные по розничным продажам (рост в июле составил 0,5%) позволили участникам рынка проигнорировать крайне слабые данные по индексу потребительских настроений от Мичиганского университета (в августе значение рухнуло до 54,9 п.). Таким образом, после крайне волатильной недели за ведущие американские биржевые индикаторы просели на 1,6-2,7%. Не слишком много по сравнению с потерями европейских и особенно российских индексов.

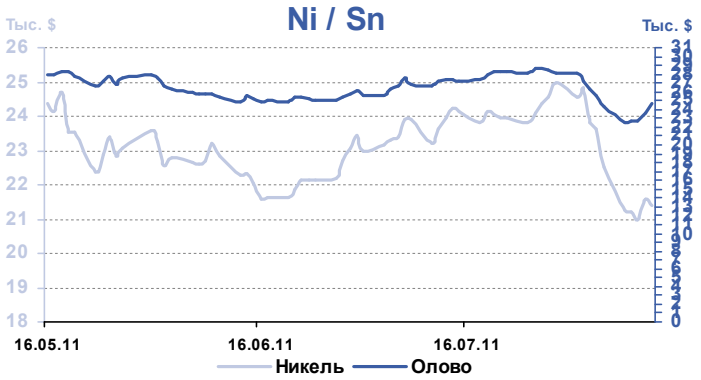
Курс единой европейской валюты в начале недели немного растет (EUR/USD 1,4310), в целом сохраняя движение в рамках бокового тренда с границами 1,41 - 1,44. Цены на нефть марки Brent сегодня устойчиво торгуются возле отметки $108,1/барр. Азиатские биржевые индексы в понедельник показывают неплохой рост: MSCI Asia +1,7%.

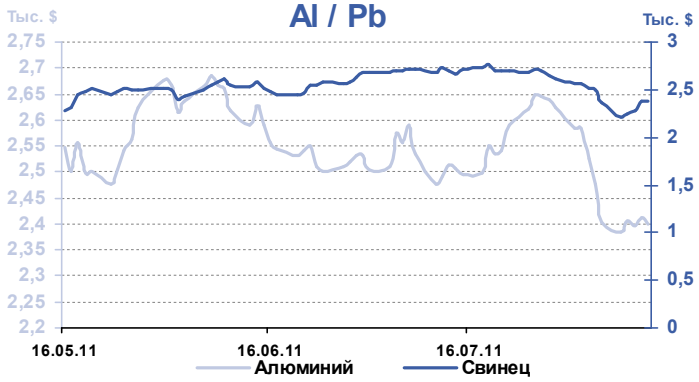
В понедельник мы ждем открытия торгов на российских биржах в позитивной зоне. Думаю, в ближайшее время стоит ждать возврата индекса ММВБ к отметке 1505 п., что соответствует 38% коррекции по фибо от августовского падения. Очевидно, что быстрой и агрессивной коррекции вверх ждать не стоит, поскольку инвесторы, которые вывели деньги с нашего рынка в начале августа не станут делать их резкий возврат не убедившись, что ситуация не ухудшится вновь. В ближайшие две недели станет ясно, прошла ли острая фаза кризиса на фондовых биржах, или нам предстоит пережить еще одну волну падения. На наш взгляд ничего экстраординарного в мировой экономике за это время не произошло. Исключительно новостном фоне биржевая публика шарахается из крайности в крайность, выводя средства из одних активов, пытаясь найти спасения в других. По большей части кризис в головах инвесторов, поскольку в традиционно спокойный август никто не ждал целой серии «страшилок» из США и Европы. Думаю, до конца месяца рынки будут привыкать к более низким уровням, чтобы попробовать возобновить рост с приходом осени. Поэтому, возле уровня 1400 п. по ММВБ мы рекомендуем совершать аккуратные покупки наиболее интересных бумаг из нефтяного, энергетического и потребительского секторов.

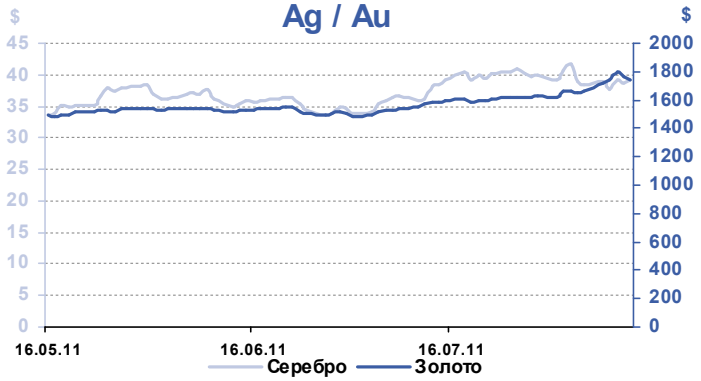
Сегодня ФСК ЕЭС опубликует отчет по РСБУ за II квартал 2011 год. В 16-30 ждем выхода в США индекса деловой активности в производственном секторе Нью-Йорка за август. В 18-00 выйдет индекс деловой активности на рынке жилья от NAHB.

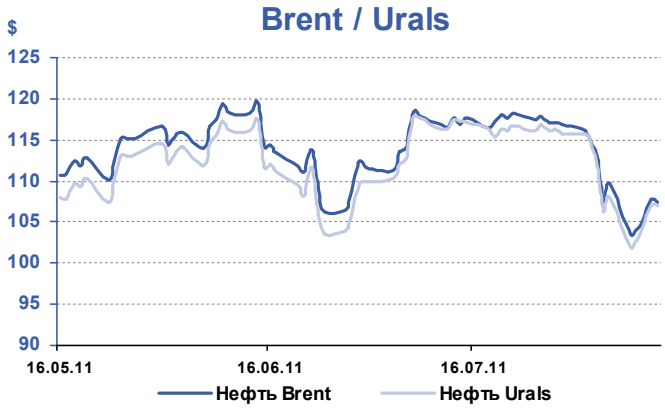
Commodities

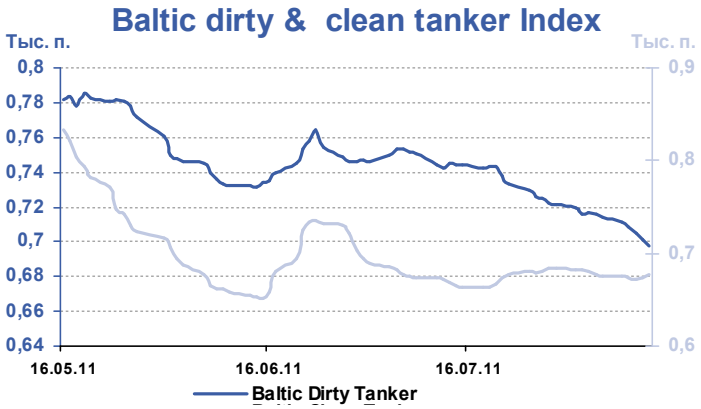












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 865,00	3,14%	-1,95%	-8,34%	23,88%
Цинк, $/t	2 177,00	3,64%	-1,05%	-8,43%	6,35%
Никель, $/t	21 400,00	2,05%	-4,91%	-11,41%	0,59%
Олово, $/t	24 700,00	8,60%	1,44%	-9,19%	18,75%
Алюминий, $/t	2 400,00	0,17%	-0,08%	-3,77%	13,74%
Свинец, $/t	2 380,00	4,62%	0,80%	-12,11%	15,70%
Серебро, $/oz	39,10	-0,46%	1,95%	-0,53%	115,47%
Золото, $/oz	1 746,90	-2,57%	4,99%	9,62%	43,72%
Нефть Brent, $/	107,34	1,88%	-2,20%	-8,82%	43,95%
Нефть Urals, $/	106,99	2,43%	-0,93%	-8,58%	46,48%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,365	0,00%	0,00%		81 712	166
БашИнСв	BISV	0,351	0,00%	0,00%		3 081	329
БашЭнрг	BEGY	1,275	0,00%	0,00%		199 609	1 374
ВМЗ	VSMZ	1646,356	0,00%	0,00%		30 490	2 756
ДВМП	FESH	0,360	0,00%	0,00%		71 369	1 064
КазанскВЗ	KHEL	2,678	0,00%	0,00%		62 548	398
Мечел	MTLR	19,670	0,00%	0,00%		3 860 074	7 770
Мотовил	MOTZ	0,071	0,00%	0,00%		4 064	68
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,560	0,00%	0,00%	25 600		38 392
СилМашины	SILM	0,222	0,00%	0,00%		137 053	1 909
СинТЗ-ао	SNTZ	61,918	0,00%	0,00%		2 860	265
Славн-ЯНОС	JNOS	0,301	0,00%	0,00%		3 147	280
СТЗ-ао	SVTZ	4,826	0,00%	0,00%		530	213
ТАГМЕТ	TAMZ	0,658	0,00%	0,00%		66	335
ТНК-ВР	TNBP	2,535	0,00%	0,00%		1 669 554	38 142
У-УАЗ	UUAZ	1,607	0,00%	0,00%		231 531	384
ЧМК	CHMK	190,775	0,00%	0,00%		151 524	522
ЧТПЗ	CHEP	2,420	0,00%	0,00%		528 027	1 139
ЮжКузб.	UKUZ	46,760	0,00%	0,00%		101 536	1 552
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,000	-0,32%	0,00%	70 500		7 998
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	0,00%	292 200	1 022 840 250	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,00%	85 000	5 864 151	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	0,00%	745 300	288 462 708	44 910
Мегионнефтегаз	MFGS	15,500	0,00%	0,00%	7 750		1 542
НОВАТЭК	NVTK	12,810	0,00%	0,00%	441 745		38 895
Роснефть	ROSN	6,550	0,00%	0,00%	131 000	214 814 665	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	0,00%	347 000	67 461 627	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	0,00%	145 000	25 166 908	3 119
Татнефть	TATN	5,080	0,00%	0,00%	1 315 000		11 068
Транснефть, п.	TRNFP	1250,000	0,00%	0,00%	250 000	44 804 767	1 944
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,683	0,00%	0,00%		145 266	3 276
Ленэнерго	LSNG	0,491	0,00%	0,00%		128 615	460
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	0,00%	35 093	2 031 467	2 589
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,032	0,00%	0,00%	32 000		1 048
ОГК-3	OGKC	0,036	0,00%	0,00%		1 173 656	1 590
ОГК-4	OGKD	0,074	0,00%	0,00%	152 035		4 666
ОГК-5	OGKE	0,080	0,00%	0,00%	40 000	1 566 122	2 759
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	0,00%	18 750	3 647 441	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,00%	6 996	101 199	406
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,00%	110 812	191 014	652
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,374	-28,36%	0,00%	48 000	19 820 793	3 759
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	0,00%	48 000	35 332 636	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	0,00%		65 889	136
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,826	0,00%	0,00%		323 755	1 088
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,232	0,00%	0,00%		108 305	219
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	1,673	0,00%	0,00%		402 973	1 088
ОМЗ	OMZZ	1,839	0,00%	0,00%		62 539	64
РКК Энергия	RKKE	234,285	0,00%	0,00%		395 845	266
Северсталь-авто	SVAV	13,053	0,00%	0,00%	9 030	2 119 814	392

Силовые машины	SILM	0,224	0,00%	0,00%	29 635		1 951
УМПО	UFMO	0,620	0,00%	0,00%	62 250		176
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,443	0,00%	0,00%	22 125		221
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	127,000	0,00%	0,00%	12 700	823 690	1 464
Мечел	MTLR	20,500	0,00%	0,00%	9 307		8 534
ММК	MAGN	0,800	0,00%	0,00%	52 000	9 041 790	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	0,00%	39 750	17 228 274	15 882
НорНикель	GMKN	208,100	0,00%	0,00%	549 050	245 538 138	39 670
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	0,00%	62 400	5 774 490	8 307
Полюс Золото	PLZL	57,800	0,00%	0,00%	259 850	12 238 759	11 018
Северсталь	CHMF	14,663	0,00%	0,00%	44 873	90 522 728	14 189
ТМК	TRMK	3,481	0,00%	0,00%		16 194 425	3 199
ЧМЗ	CHMZ	6,000	-1,64%	0,00%	5 400		94
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346
Банки							
Банк Москвы	MMBM	26,769	0,00%	0,00%		159 079	4 544
Возрождение	VZRZ	31,629	0,65%	0,00%	31 200	674 398	736
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,00%	15 097	212 771 002	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,380	0,00%	0,00%		83 756	3 677
Сбербанк	SBER	2,925	-4,10%	0,00%	2 911 250		63 142
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,961	12,99%	0,00%	334 000	4 517 918	2 100
Дальневосточное МП	FESH	0,430	0,00%	0,00%	44 000		1 269
НМТП	NMTP	0,090	-20,77%	0,00%	5 264	368 475	1 749
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	0,00%	15 500	26 901	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	0,00%	41 000	79 777	6 220
Вимм-Билль-Данн	WBDF	129,861	0,00%	0,00%		56 843	5 710
Дикси	DIXY	10,000	0,00%	0,00%	10 000	709 441	1 216
Концерн Калина	KLNA	43,510	0,00%	0,00%		54 896	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	0,00%	10 100	24 591	93
Магнит	MGNT	118,414	-10,00%	0,00%	54 000	8 099 754	10 212
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,809	0,00%	0,00%		49 274	12
Разгуляй	GRAZ	1,288	0,00%	0,00%		772 146	192
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	67,019	0,00%	0,00%	7 265	292 713	2 436
Черкизово	GCHE	23,000	0,00%	0,00%	68 500	89 548	991
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	0,00%	46 000	115 732	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,700	0,00%	0,00%	171 000		1 569
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,481	8,64%	0,00%	10 004	28 615 309	1 591
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	38,824	0,00%	0,00%	299 119	3 483 292	1 792
Дорогобуж	DGBZ	0,550	0,00%	0,00%	27 500	169 853	397
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	0,00%	16 950	73 213 187	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,271	18,42%	0,00%	122 026	22 767 731	3 218
УК Южный Кузбасс	UKUZ	60,000	0,00%	0,00%	60 000		2 167

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	133,340	3,32%	4,62
Башнефть	AK6		EUR	168,100	14,49%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,990	-20,80%	25,82
ТГК-3	AOMD		USD	6,750	1,28%	17,24
Татнефть	ATAD		USD	32,700	7,21%	17 085,27
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,900	4,05%	3,62
Бурятзолото	BYT		EUR	18,800	0,53%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	23,760	5,13%	31 450,60
X5	FIVE		USD	33,500	4,69%	23 071,26
Газпром	GAZ		EUR	8,200	7,65%	3 321,24
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,048	-20,62%	62,31
Иркутскэнерго	IRK		EUR	22,275	-15,83%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,900	-6,45%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,850	-5,56%	2,13
Лукойл	LKOD		USD	55,750	4,11%	265 418,00
Лукойл	LUK		EUR	39,080	-4,09%	1 273,67
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,000	6,14%	10 465,24
МТС	MBT	5	USD	16,180	5,27%	50 196,38
МТС	MKY	5	EUR	11,160	-2,11%	2,52
МГТС	MOW		EUR	9,200	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,500	0,00%	14,91
Мечел	MTL	3	USD	18,880	5,47%	41 441,38
НорНикель	NILSY	1	USD	23,350	6,14%	309,95
НорНикель	NNIA		EUR	15,500	4,03%	288,33
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	129,500	7,47%	94 223,61
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,010	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,000	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	11,650	9,91%	703 480,80
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,000	0,63%	3 695,95
Ростелеком	RTL		EUR	18,865	-16,60%	50,61
Газпромнефть	SCF		EUR	15,005	6,53%	87,60
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,330	-2,45%	77,02
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	2,860	-2,05%	6,98
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,388	7,80%	283,16
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,720	1,58%	472,12
АФКСистема	SSA	1	USD	18,710	5,41%	17 408,87
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,310	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	29,430	-0,64%	
СТЗ	SVY		EUR	31,580	-9,28%	
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	-6,06%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	374,000	1,08%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,420	2,86%	32 044,42
ВТБ	VTBR		USD	4,925	4,72%	437 791,00

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.