ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

17 августа 2011г.

Комментарий по рынку акций

Вчера американские фондовые площадки закрылись в красной зоне. Биржевую публику не слишком воодушевил отчет ФРС из которого следует, что объем промышленного производства в США в июле вырос на 0,9% м/м. Не очень помогло «быкам» и заявление рейтингового агентства Fitch о подтверждении рейтинга США на уровне AAA со стабильным прогнозом. Под занавес торгов инвесторы негативно отреагировали на результаты встречи глав Германии и Франции в части борьбы с долговым кризисом в европейском регионе.

Курс евро не пошел на дальнейшее укрепление (EUR/USD 1,44)

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 632,31	-1,37%	1,37%	-15,80%	12,89%
Индекс ММВБ	1 481,18	-1,95%	-1,11%	-13,61%	7,86%
FTSE	5 357,63	0,13%	3,73%	-8,32%	1,55%
S&P 500	1 192,76	-0,97%	1,73%	-9,37%	10,50%
Dow Jones Avg.	11 405,93	-0,67%	1,48%	-8,60%	10,72%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Ростелеком	5,5000	14,58%	-3,54%	20,09%
Дальневосточное МП	0,4850	12,79%	-2,02%	14,12%
НорНикель	230,5000	10,76%	-11,96%	26,30%
ОАО Группа ЛСР	29,2400	6,72%	-19,11%	1,88%
ПИК	3,9300	4,86%	4,80%	4,24%
Полюс Золото	59,5000	2,94%	-5,56%	19,00%

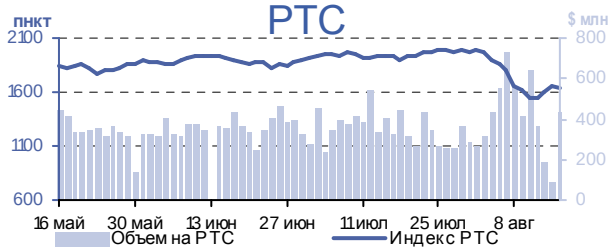
Лидеры снижения

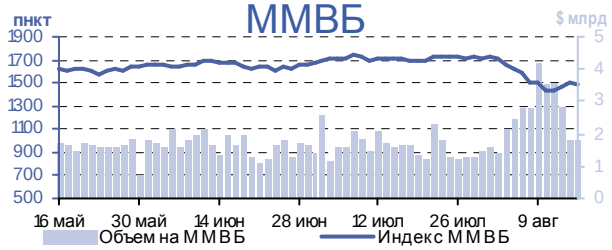
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ТГК-6	0,0003	-28,57%	-26,47%	-52,83%
ТГК-4	0,0003	-15,79%	18,52%	-37,25%
ТГК-5	0,0003	-12,12%	-29,27%	-47,27%
Нижнекамскшина	1,3800	-12,10%	-4,17%	45,26%

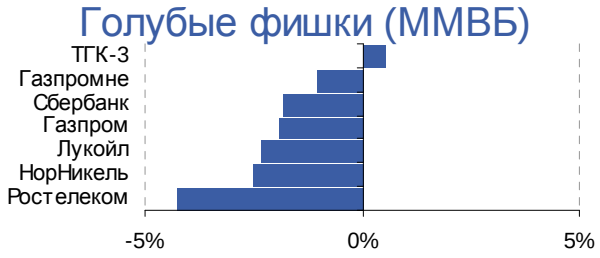
Индекс *MSCI*

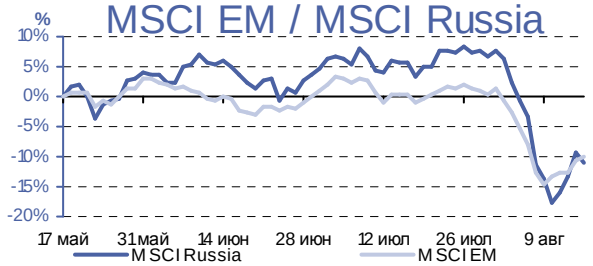
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1018,64	0,52%	-10,30%	3,39%
Индекс MSCI BRAZIL	3115,77	-0,16%	-9,54%	-8,02%
Индекс MSCI RUSSIA	855,86	-1,91%	-15,76%	10,52%
Индекс MSCI INDIA	441,79	-0,98%	-12,36%	-7,55%
Индекс MSCI CHINA	58,92	0,12%	-8,98%	-5,21%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Вчера американские фондовые площадки закрылись в красной зоне. Биржевую публику не слишком воодушевил отчет ФРС из которого следует, что объем промышленного производства в США в июле вырос на 0,9% м/м. Не очень помогло «быкам» и заявление рейтингового агентства Fitch о подтверждении рейтинга США на уровне AAA со стабильным прогнозом. Под занавес торгов инвесторы негативно отреагировали на результаты встречи глав Германии и Франции в части борьбы с долговым кризисом в европейском регионе.

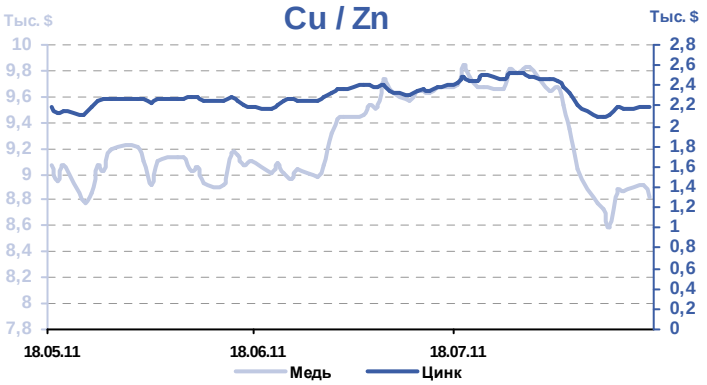
Курс евро не пошел на дальнейшее укрепление (EUR/USD 1,44), поскольку по итогам совместного заявления канцлера Германии Ангелы Меркель и президента Франции Николя Саркози была отвергнута идея выпуска общеевропейских бондов. Для спекулянтов негативным моментам стало также намерение ввести налог на финансовые операции (кстати, вчера из-за этого на 8,4% обвалились акции биржевого оператора NYSE Euronext), при этом ничего не было сказано про увеличение Европейского Фонда Финансовой Стабильности (EFSF). Вместо этого главы Германии и Франции озвучили план по созданию экономического правительства еврозоны, где должность председателя займет президент Европейского совета Херман ван Ромпей.

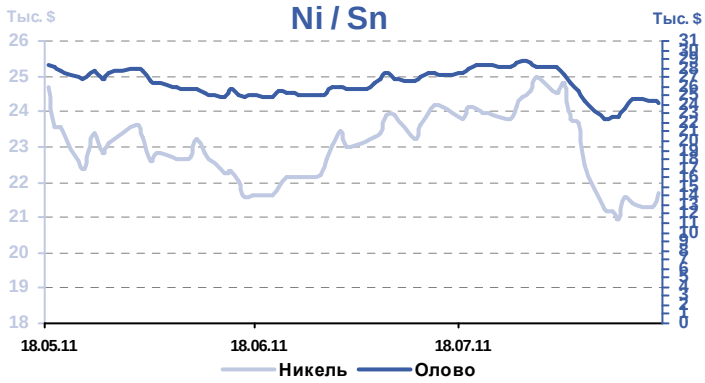
Торги в Лондоне нефтью Brent сегодня утром проходят возле отметки $109,4/барр. Согласно данным API запасы нефти в США на прошлой неделе выросли на 1,7 млн. барр., запасы бензина сократились на 5,4 млн. барр. Фьючерсы на американские индексы во вторник находятся в небольшом плюсе (S&P +0,2%) поддерживаемые позитивными торгами в Азии (MSCI Asia +0,77%).

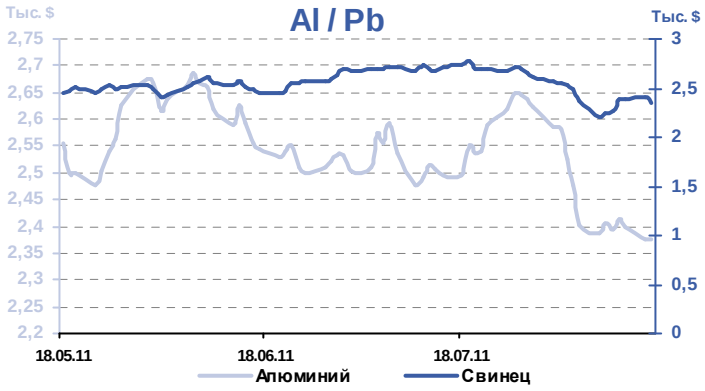
В среду российские биржевые индексы начнут торги с незначительными потерями. Поскольку на сырьевых и валютных рынках пока наблюдается относительное затишье, основные настроения к нам придут днем из Европы, где местные биржевики будут оценивать итоги вчерашней встречи Меркель и Саркози. Есть ощущение, что европейским инвесторам сегодня будет не до покупок, а значит, вниз могут быть утянуты и наши фондовые индикаторы. Вчера под вечер можно было наблюдать хороший спрос в бумагах ряда ОГК. Стоит последить за этим сегментом рынка, так как после непродолжительной консолидации покупки в этих интересных акциях 2-го эшелона могут возобновиться опять.

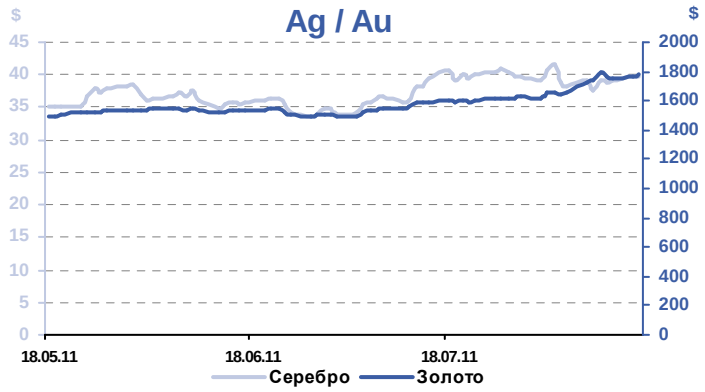
Сегодня в 16-30 ждем данных из США по индексу цен производителей США за июль. В 18-30 Минэнерго (EIA) представит отчет по запасам нефти и нефтепродуктов в США.

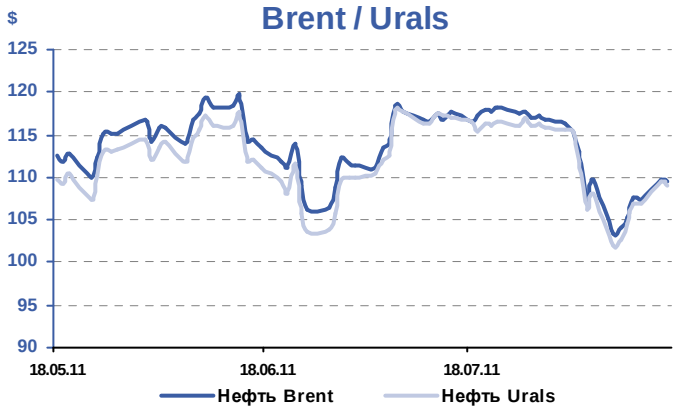
Commodities

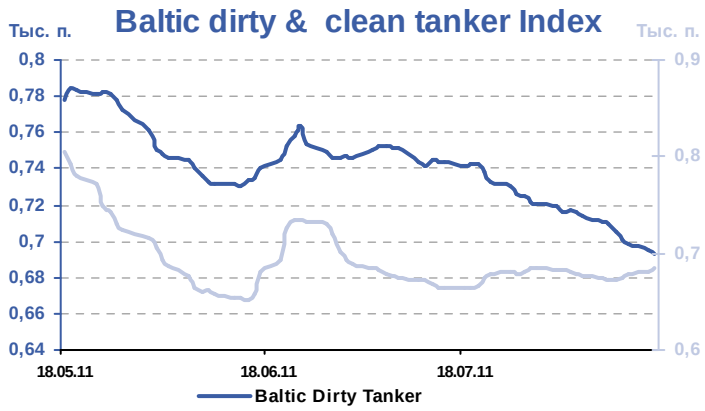












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 830,00	-0,88%	1,13%	-8,71%	21,79%
Цинк, $/t	2 182,00	-0,05%	3,90%	-8,22%	5,26%
Никель, $/t	21 700,00	1,88%	2,33%	-10,16%	0,70%
Олово, $/t	24 150,00	-1,23%	6,15%	-11,21%	14,45%
Алюминий, $/t	2 375,00	0,00%	-1,33%	-4,77%	12,13%
Свинец, $/t	2 356,00	-1,75%	4,53%	-13,00%	12,46%
Серебро, $/oz	39,89	0,05%	6,17%	1,49%	116,87%
Золото, $/oz	1 785,70	1,12%	2,60%	12,06%	45,75%
Нефть Brent, $/	109,54	-0,21%	5,23%	-6,95%	46,37%
Нефть Urals, $/	108,97	-0,38%	6,14%	-6,89%	48,91%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,382	0,00%	-2,71%		58 099	191
БашИнСв	BISV	0,390	0,00%	-0,26%		78	370
БашЭнрг	BEGY	1,378	0,00%	-1,20%		31 920	1 447
ВМЗ	VSMZ	1701,783	0,00%	-8,10%		16 869	2 897
ДВМП	FESH	0,473	0,00%	23,08%		65 350	1 290
КазанскВЗ	KHEL	2,987	0,00%	1,52%		34 742	453
Мечел	MTLR	19,511	0,00%	-0,36%		2 798 718	8 173
Мотовил	MOTZ	0,075	0,00%	-2,29%		1 410	74
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,700	0,00%	0,00%	54 000		40 492
СилМашины	SILM	0,213	0,00%	-4,69%		256 121	1 823
СинТЗ-ао	SNTZ	48,857	0,00%	0,00%		98	308
Славн-ЯНОС	JNOS	0,326	0,00%	-6,49%		4 821	310
СТЗ-ао	SVTZ	4,826	0,00%	0,00%		530	213
ТАГМЕТ	TAMZ	0,658	0,00%	0,00%		66	335
ТНК-ВР	TNBP	2,755	0,00%	1,48%		2 804 915	40 704
У-УАЗ	UUAZ	1,740	0,00%	1,32%		30 184	461
ЧМК	CHMK	208,538	0,00%	-2,21%		1 274	671
ЧТПЗ	CHEP	2,634	0,00%	2,05%		49 765	1 231
ЮжКузб.	UKUZ	47,775	0,00%	-4,27%		38 969	1 722
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,000	0,00%	0,00%	70 500		7 998
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	-1,90%	292 200	438 792 304	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-1,03%	85 000	1 365 061	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	-2,34%	745 300	117 748 226	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%	-0,92%	131 000	80 158 621	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	-1,84%	347 000	27 410 424	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	2,03%	145 000	10 043 539	3 119
Татнефть	TATN	5,080	0,00%	0,00%	1 315 000		11 068
Транснефть, п.	TRNFP	1250,000	0,00%	-0,91%	250 000	14 352 186	1 944
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,736	0,00%	0,60%		130 019	3 439
Ленэнерго	LSNG	0,519	0,00%	1,97%		22 829	469
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	-0,64%	35 093	27 467	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	0,037	0,00%	4,74%	5 025	370 373	1 743
ОГК-4	OGKD	0,074	0,00%	0,00%	152 035		4 666
ОГК-5	OGKE	0,080	0,00%	-0,92%	40 000	402 207	2 759
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	0,53%	18 750	685 888	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	-12,12%	1,53%	8 696	51 175	357
ТГК-6	TGKF	0,000	-28,57%	5,63%	6 121	19 845	466
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,500	14,58%	-4,26%	55 000	103 570 868	16 188
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	0,85%	48 000	7 559 153	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	-2,56%		1 835	153
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,840	0,00%	-1,62%		191 360	1 153
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,255	0,00%	-2,67%		12 849	248
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	1,587	0,00%	-1,77%		252 886	1 127
ОМЗ	OMZZ	1,780	0,00%	-4,62%		4 654	64
РКК Энергия	RKKE	247,596	0,00%	0,71%		495	278
Северсталь-авто	SVAV	13,600	0,00%	-4,01%	9 030	268 106	466

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	143,000	-0,69%	-1,85%	7 150	44 734	1 649
Мечел	MTLR	20,500	0,00%	0,00%	9 307		8 534
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-2,46%	52 000	4 780 785	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	-3,25%	39 750	10 302 727	15 882
НорНикель	GMKN	230,500	10,76%	-2,51%	1 313 850	85 626 320	43 940
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	-2,43%	62 400	2 678 354	8 307
Полюс Золото	PLZL	59,500	2,94%	-0,11%	297 500	11 817 399	11 342
Северсталь	CHMF	14,935	-0,15%	-2,30%	14 935	34 742 616	15 050
ТМК	TRMK	3,250	0,00%	-4,59%	32 500	3 789 670	3 047
ЧМЗ	CHMZ	6,000	0,00%	0,00%	5 400		94
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346
Банки							
Банк Москвы	MMBM	29,607	0,00%	3,02%		23 290	5 280
Возрождение	VZRZ	32,150	0,00%	-1,07%	64 850	28 872	764
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-2,40%	15 097	68 700 707	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,557	0,00%	2,21%		333 477	4 317
Сбербанк	SBER	3,000	-0,27%	0,00%	75 000		64 761
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,000	0,00%	-3,25%	334 000	1 262 632	2 188
Дальневосточное МП	FESH	0,485	12,79%	0,00%	24 250		1 431
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	-0,44%	5 264	64 817	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	-1,91%	15 500	4 647	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	-0,08%	41 000	1 340	6 220
Верофарм	VRPH	31,350	0,00%	0,00%	50 160		314
Вимм-Билль-Данн	WBDF	136,218	0,00%	0,00%		117 316	5 954
Дикси	DIXY	10,000	0,00%	-2,05%	10 000	286 808	1 216
Концерн Калина	KLNA	44,000	0,00%	4,31%	30 800	33 120	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-2,65%	10 100	21 916	93
Магнит	MGNT	108,000	0,00%	-2,79%	54 000	658 714	9 609
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,881	0,00%	2,06%		15 362	14
Разгуляй	GRAZ	1,314	0,00%	-0,82%		388 830	204
Фармстандарт	PHST	69,300	0,00%	-1,94%	13 755	65 790	2 619
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	-1,45%	24 000	84 385	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	-0,67%	46 000	54 628	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,700	0,00%	0,00%	57 000		1 569
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,930	4,86%	-2,33%	10 003	5 448 920	1 939
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,000	0,00%	-1,14%	299 119	581 689	1 860
Дорогобуж	DGBZ	0,550	0,00%	-2,67%	27 500	173 051	397
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	-0,13%	16 950	36 301 267	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,500	0,00%	-4,22%	122 026	9 064 713	3 514
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	129,100	0,00%	
Башнефть	AK6		EUR	173,100	3,59%	4,44
ТГК-3	AOMD		USD	6,750	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	33,170	-3,27%	12 004,88
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,925	6,56%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,800	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	23,980	-2,91%	16 785,98
X5	FIVE		USD	34,700	-0,14%	15 251,75
Газпром	GAZ		EUR	8,252	-0,91%	1 382,76
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,046	-3,42%	0,67
Иркутскэнерго	IRK		EUR	23,265	-1,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,900	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	15,83%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,850	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,500	-1,22%	163 392,90
Лукойл	LUK		EUR	39,750	1,49%	446,50
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,550	-1,65%	5 020,34
МТС	MBT	5	USD	16,650	-0,66%	43 837,50
МТС	MKY	5	EUR	11,525	2,86%	36,42
МГТС	MOW		EUR	9,200	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,700	0,00%	0,77
Мечел	MTL	3	USD	19,190	-2,74%	49 379,30
НорНикель	NILSY	1	USD	23,150	-2,32%	18 769,72
НорНикель	NNIA		EUR	16,500	0,30%	174,11
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	127,000	-3,64%	70 284,92
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,010	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,100	2,00%	
Газпром	OGZD		USD	11,900	-1,65%	281 562,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,750	-3,53%	720,39
Ростелеком	RTL		EUR	23,350	11,67%	10,50
Газпромнефть	SCF		EUR	15,260	1,73%	66,93
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,458	-1,09%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,000	2,92%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,590	0,66%	169,61
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,100	-0,25%	430,34
АФКСистема	SSA	1	USD	19,200	-2,93%	4 576,75
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,800	-0,78%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	30,600	-0,65%	
СТЗ	SVY		EUR	31,380	-0,32%	
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	374,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,920	0,00%	25 687,25
ВТБ	VTBR		USD	4,999	-1,59%	278 764,50
Возрождение	VZY		EUR	22,800	8,57%	

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.