ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

19 августа 2011г.

Комментарий по рынку акций

Вчера торги на фондовых биржах США завершились очередным обвалом индексов. Индекс волатильности американского фондового рынка (индекс страха) VIX взлетел вчера на 38% до 43,56 пункта на фоне опасений, что глобальная экономика замедляется, при том, что отдельные европейские банки могут испытывать недостатки в деньгах. По рынку циркулировали слухи о том, что ЕЦБ срочно выдал кредит на $500 млн. сроком на одну неделю одному из европейских банков. Быстрое сокращение резервов неамериканских банков на счетах в ФРС, также указывало на некоторые затруднения в денежных операциях на территории США. Вышедшая вчера статистика по

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 584,20	-4,79%	2,55%	-17,76%	8,63%
Индекс ММВБ	1 452,83	-3,73%	0,97%	-14,55%	4,76%
FTSE	5 092,23	-4,49%	-1,37%	-12,05%	-3,97%
S&P 500	1 140,65	-4,46%	-2,73%	-14,03%	4,25%
Dow Jones Avg.	10 990,58	-3,68%	-1,37%	-12,69%	5,52%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь	15,2503	2,11%	-16,58%	-1,68%
Дорогобуж	0,5600	1,82%	-8,20%	8,74%
ОАО Синергия	31,0000	1,47%	-25,12%	-14,48%
Башнефть	47,5000	1,06%	-16,67%	8,94%

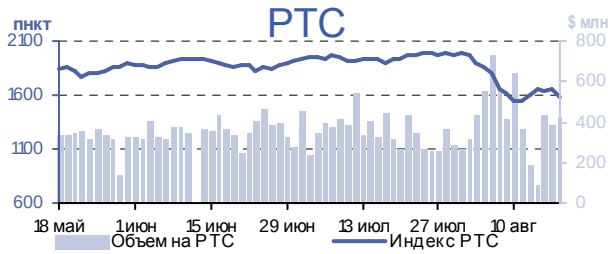
Лидеры снижения

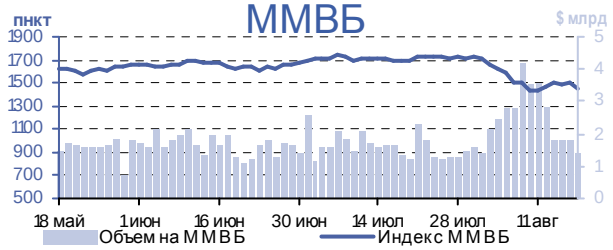
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Дальневосточное МП	0,4000	-17,53%	-19,19%	-5,88%
Ростелеком	5,1500	-6,36%	-21,13%	12,45%
ОАО Группа ЛСР	27,4300	-6,19%	-24,12%	-4,43%
Акрон	41,0000	-4,43%	-22,05%	35,09%

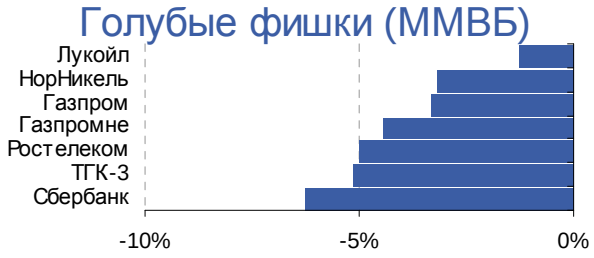
Индекс *MSCI*

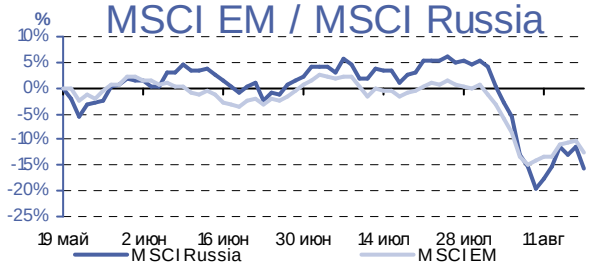
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	995,44	-2,83%	-11,83%	0,13%
Индекс MSCI BRAZIL	3015,88	-4,63%	-12,50%	-12,45%
Индекс MSCI RUSSIA	829,87	-4,77%	-17,77%	6,41%
Индекс MSCI INDIA	429,88	-3,03%	-15,26%	-11,63%
Индекс MSCI CHINA	57,82	-1,84%	-10,21%	-6,95%

Основные индикаторы









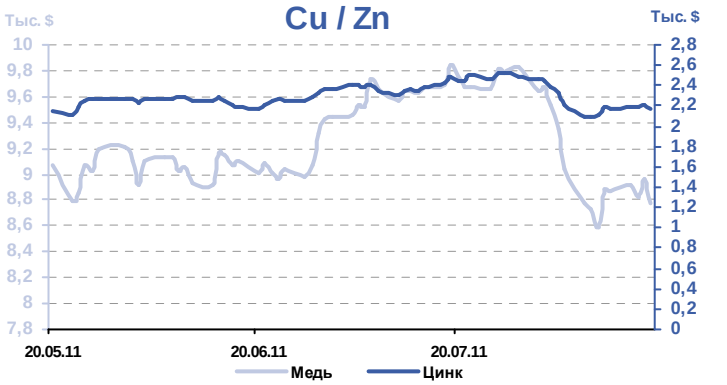
Обзор рынка

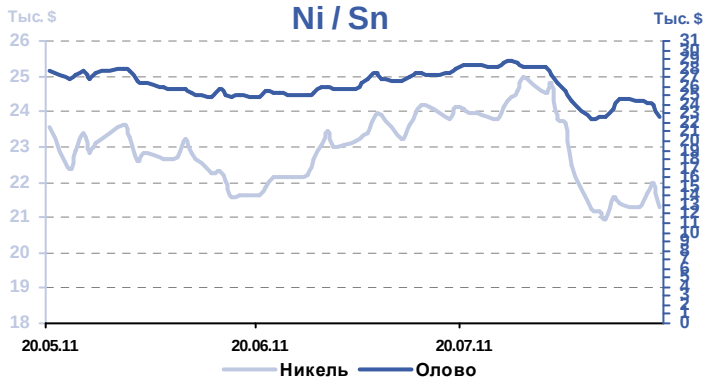
Вчера торги на фондовых биржах США завершились очередным обвалом индексов. Индекс волатильности американского фондового рынка (индекс страха) VIX взлетел вчера на 38% до 43,56 пункта на фоне опасений, что глобальная экономика замедляется, при том, что отдельные европейские банки могут испытывать недостатки в деньгах. По рынку циркулировали слухи о том, что ЕЦБ срочно выдал кредит на $500 млн. сроком на одну неделю одному из европейских банков. Быстрое сокращение резервов неамериканских банков на счетах в ФРС, также указывало на некоторые затруднения в денежных операциях на территории США. Вышедшая вчера статистика по производственному сектору в Филадельфии, безработице и инфляции, а также по продажам на вторичном рынке жилья также оказалась удручающе плохой. Усугубили общий негатив на рынке обзоры ряда крупнейших инвестиционных банков, в которых снижены прогнозы экономического роста на 2011 и 2012 годы для США и еврозоны.

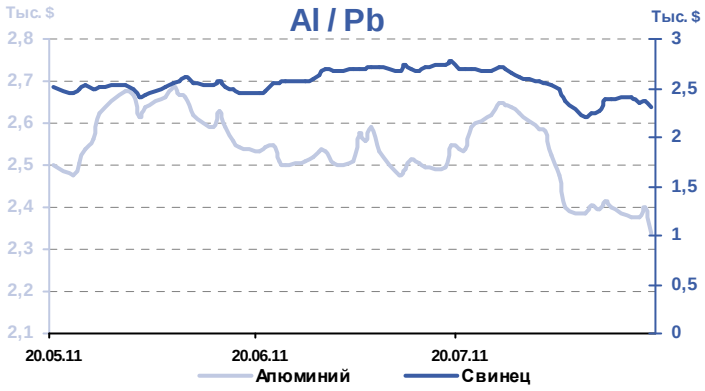
К утру пятницы цены на нефть марки Brent опустились до отметки $106/барр. Вчера фьючерсные контракты на нефть упали в цене более чем на 5% по, тем же причинам, что и фондовые индексы. Валютная пара EUR/USD сегодня может пойти на тестирование уровня поддержки на 1,4270. Сегодняшние торги на азиатских биржах проходят исключительно в красной зоне. В Китае предварительный индекс деловых условий в августе снизился до 55,38 п. против 57,19 п. в июле, а индекс производства упал до 58,33 от 59,35. На этом фоне фьючерсы на американские индексы сегодня опять теряют в цене (S&P -0,88%).

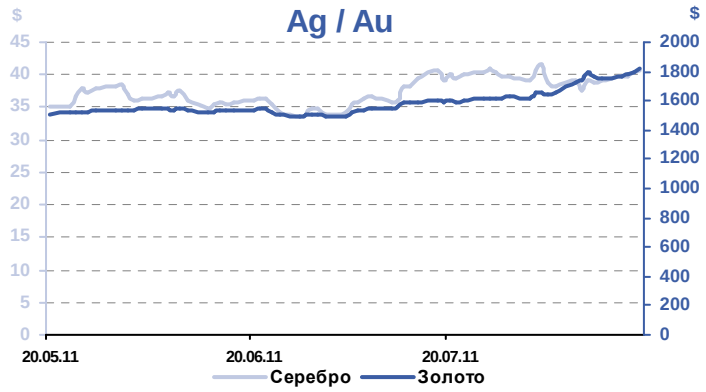
Открытие торгов на российских биржах в пятницу мы увидим опять с гэпом вниз. Утром потери индекса ММВБ могут составить чуть более 1%. Внешний фон сохраняет негативную окраску, однако сегодня мы рассчитываем увидеть, как наши биржевые индексы войдут в фазу стабилизации после вчерашнего обвала. Лишь завершив неделю выше уровня 1470 п. индексу ММВБ наш рынок имеет шансы на коррекцию на следующей. В противном случае наши индексы рискуют продолжить падение. В период нестабильности лучше рынка будут торговаться бумаги энергетических компаний, хуже – банки, металлурги и автопроизводители.

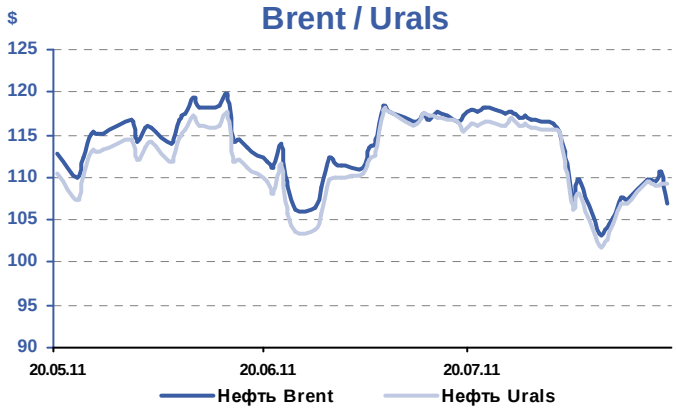
Commodities

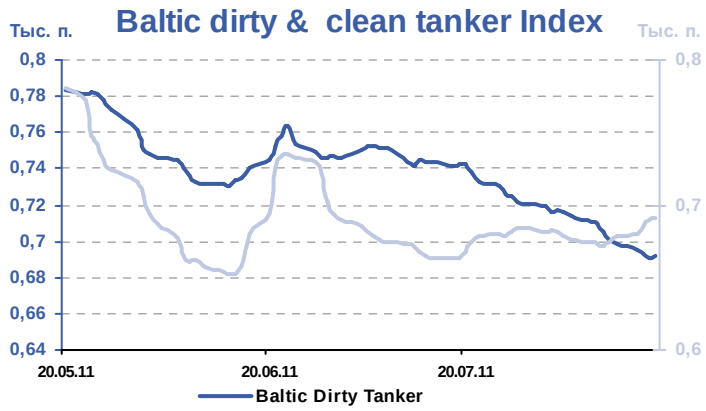












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 770,00	-2,18%	-1,25%	-10,87%	18,67%
Цинк, $/t	2 178,00	-1,67%	-0,37%	-12,53%	2,01%
Никель, $/t	21 300,00	-2,96%	-1,39%	-11,71%	-2,74%
Олово, $/t	22 750,00	-5,23%	-3,62%	-18,43%	8,33%
Алюминий, $/t	2 338,00	-2,50%	-3,11%	-8,31%	11,07%
Свинец, $/t	2 301,00	-2,75%	-3,52%	-16,93%	8,38%
Серебро, $/oz	40,61	0,68%	4,87%	3,96%	121,10%
Золото, $/oz	1 823,80	1,82%	3,38%	14,82%	48,34%
Нефть Brent, $/	106,93	-3,36%	-0,71%	-8,89%	41,59%
Нефть Urals, $/	109,22	0,04%	2,05%	-5,36%	46,68%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,351	0,00%	-7,07%		46 167	180
БашИнСв	BISV	0,375	0,00%	-0,91%		188	356
БашЭнрг	BEGY	1,330	0,00%	-5,61%		37 205	1 421
ВМЗ	VSMZ	1632,370	0,00%	-9,25%		155 084	2 561
ДВМП	FESH	0,386	0,00%	-6,06%		54 875	1 203
КазанскВЗ	KHEL	2,818	0,00%	-8,89%		24 032	453
Мечел	MTLR	18,530	0,00%	-5,83%		6 725 678	7 960
Мотовил	MOTZ	0,073	0,00%	-2,85%		958	73
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,700	-0,74%	0,00%	27 000		40 492
СилМашины	SILM	0,216	0,00%	-1,61%		81 215	1 881
СинТЗ-ао	SNTZ	48,315	0,00%	0,20%		48	304
Славн-ЯНОС	JNOS	0,324	0,00%	-0,73%		196	305
СТЗ-ао	SVTZ	4,689	0,00%	0,00%		47	226
ТАГМЕТ	TAMZ	0,591	0,00%	0,00%		575	293
ТНК-ВР	TNBP	2,715	0,00%	0,00%		4 356 788	41 349
У-УАЗ	UUAZ	1,650	0,00%	-7,35%		78 689	460
ЧМК	CHMK	189,424	0,00%	-6,39%		12 482	637
ЧТПЗ	CHEP	2,554	0,00%	-2,81%		192 952	1 238
ЮжКузб.	UKUZ	46,394	0,00%	-2,80%		21 578	1 676
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,500	1,06%	0,00%	95 000		8 083
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	-3,33%	292 200	442 923 804	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-4,43%	85 000	3 055 554	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	-1,26%	745 300	152 334 039	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%	-4,00%	131 000	99 646 194	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	-5,16%	347 000	26 479 866	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	-3,32%	145 000	13 610 556	3 119
Татнефть	TATN	5,600	10,24%	0,00%	12 320		12 092
Транснефть, п.	TRNFP	1250,000	0,00%	-5,44%	250 000	23 072 977	1 944
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,732	0,00%	-2,07%		149 852	3 538
Ленэнерго	LSNG	0,519	0,00%	-1,96%		29 135	490
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	1,91%	35 093	687 470	2 589
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,043	0,00%	0,00%	126 362		1 391
ОГК-3	OGKC	0,037	0,00%	-2,18%	5 025	620 330	1 743
ОГК-4	OGKD	0,081	0,00%	0,00%	40 500		5 107
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	-6,71%	38 000	376 130	2 688
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	-5,13%	163 350	2 933 929	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-3,86%	8 696	50 660	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-4,88%	6 121	67 524	466
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,150	-6,36%	-5,01%	51 500	46 057 363	15 158
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	-4,41%	48 000	5 471 103	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	-4,55%		3 851	151
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,784	0,00%	-7,65%		636 971	1 085
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,244	0,00%	-4,18%		12 041	242
КАМАЗ	KMAZ	1,464	0,00%	-8,13%		182 092	1 079
ОМЗ	OMZZ	1,780	0,00%	-6,99%		13 487	66
РКК Энергия	RKKE	230,284	0,00%	-6,67%		942	265
Северсталь-авто	SVAV	13,600	0,00%	-7,12%	9 030	727 095	466
Силовые машины	SILM	0,222	0,00%	0,00%	156 292		1 933

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	0,00%	-7,54%	7 150	874 760	1 649
Мечел	MTLR	19,400	-0,51%	0,00%	29 100		8 076
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-3,99%	52 000	5 125 203	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	-5,32%	39 750	11 897 855	15 882
НорНикель	GMKN	230,500	0,00%	-3,19%	1 313 850	94 314 138	43 940
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	-0,66%	62 400	1 885 413	8 307
Полюс Золото	PLZL	59,500	0,00%	0,54%	178 900	4 901 126	11 342
Северсталь	CHMF	15,250	2,11%	-6,05%	53 361	43 035 569	15 116
ТМК	TRMK	3,250	0,00%	-2,22%	32 500	5 710 033	3 047
ЧМЗ	CHMZ	5,860	-2,33%	0,00%	5 040		92
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346
Банки							
Банк Москвы	MMBM	30,414	0,00%	2,91%		22 351	5 371
Возрождение	VZRZ	32,150	0,00%	-0,40%	64 850	392 595	764
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-5,92%	15 097	68 775 746	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,351	0,00%	-1,49%		842	4 190
Сбербанк	SBER	3,033	0,00%	0,00%	3 018 500		65 473
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,000	0,00%	-3,84%	334 000	1 787 543	2 188
Дальневосточное МП	FESH	0,400	-17,53%	0,00%	40 000		1 181
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	0,38%	5 264	268 363	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	0,75%	15 500	4 249	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	-0,98%	41 000	207 466	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%	-0,99%	10 000	465 280	1 216
Концерн Калина	KLNA	44,000	0,00%	-2,49%	30 800	9 524	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-3,10%	10 100	8 638	93
Магнит	MGNT	108,000	0,00%	-6,84%	54 000	2 890 538	9 609
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,859	0,00%	-3,21%		4 378	14
Разгуляй	GRAZ	1,254	0,00%	-6,39%		298 517	202
Фармстандарт	PHST	68,000	-1,88%	-2,28%	81 260	77 534	2 570
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	-0,34%	24 000	27 508	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	0,00%	46 000	200 388	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,650	-0,88%	0,00%	113 500		1 556
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,930	0,00%	0,09%	5 003	6 564 508	1 939
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	41,000	-4,43%	-4,49%	20 500	1 505 471	1 955
Дорогобуж	DGBZ	0,560	1,82%	-2,90%	16 800	105 268	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	-0,99%	16 950	38 503 157	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,500	0,00%	-5,78%	122 026	5 816 919	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	123,100	-2,38%	
Башнефть	AK6		EUR	178,100	-0,56%	
ТГК-3	AOMD		USD	7,085	4,96%	4,04
Татнефть	ATAD		USD	32,500	-4,66%	16 576,91
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,885	-0,69%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,600	-1,06%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	23,960	-5,48%	28 685,87
X5	FIVE		USD	34,150	-3,80%	37 179,38
Газпром	GAZ		EUR	8,150	0,41%	1 592,61
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,039	12,51%	2,18
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,245	-1,00%	9,82
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,800	-3,45%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,850	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	55,750	-2,96%	358 215,70
Лукойл	LUK		EUR	39,000	-0,96%	1 125,59
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,220	-2,87%	4 659,02
МТС	MBT	5	USD	15,940	-4,38%	55 020,06
МТС	MKY	5	EUR	11,460	1,51%	
МГТС	MOW		EUR	9,100	-1,09%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,300	12,41%	34,72
Мечел	MTL	3	USD	18,090	-7,85%	51 831,48
НорНикель	NILSY	1	USD	22,090	-3,33%	3 002,55
НорНикель	NNIA		EUR	15,850	0,96%	198,70
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	128,600	-2,58%	55 983,20
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,900	-5,47%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,100	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	11,610	-4,84%	492 145,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,630	-7,96%	1 875,25
Ростелеком	RTL		EUR	22,895	1,69%	4,45
Газпромнефть	SCF		EUR	15,545	1,93%	91,10
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,524	3,27%	10,29
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,000	0,00%	12,64
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,510	-3,22%	331,42
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,750	-5,26%	228,17
АФКСистема	SSA	1	USD	18,500	-6,23%	23 287,76
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,600	-0,79%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	30,200	-0,66%	
СТЗ	SVY		EUR	31,180	-0,32%	
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	348,000	-5,56%	3,26
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,690	-3,69%	42 900,42
ВТБ	VTBR		USD	4,670	-6,97%	58 512,98
Возрождение	VZY		EUR	22,800	6,05%	

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.