ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

22 августа 2011г.

Комментарий по рынку акций

В пятницу американским биржевым индексам не удалось закрепиться на положительной территории, и они завершили торги очередным существенным снижением. В выходящей статистике инвесторы все яснее видят растущие риски очередной рецессии, что в первую очередь негативно сказывается на акциях компаний, которые зависят экономических циклов. В пятницу компания Hewlett-Packard понизила прогноз по доходам до конца года, что негативно сказалось на всем секторе акций высокотехнологических компаний. В конце прошлой недели, индекс широкого спектра акций S&P-500 пошел на тестирование минимумов года (1130 - 1110 п.), и если они устоят, то инвесторы

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 575,33	-0,56%	-1,21%	-20,31%	8,97%
Индекс ММВБ	1 438,74	-0,97%	-2,16%	-16,78%	4,63%
FTSE	5 040,76	-1,01%	-5,25%	-15,07%	-3,27%
S&P 500	1 123,53	-1,50%	-4,69%	-16,47%	4,45%
Dow Jones Avg.	10 817,65	-1,57%	-4,01%	-14,70%	5,32%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскнефтехим, п.	0,5500	3,77%	3,77%	83,33%
Транснефть, п.	1285,0000	2,80%	-14,33%	1,18%
Полюс Золото	59,9500	0,76%	-4,08%	18,71%

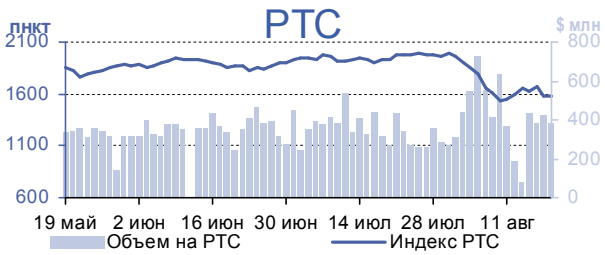
Лидеры снижения

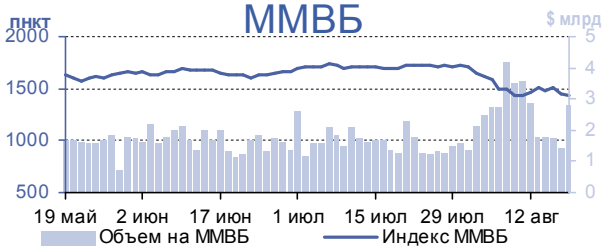
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Полиметалл	18,0000	-13,46%	-12,20%	0,00%
Сбербанк	2,6850	-11,47%	-26,84%	-14,49%
ВСМПО	130,0000	-9,09%	-27,78%	34,72%
Башнефть, п.	38,0000	-7,88%	-24,00%	18,75%

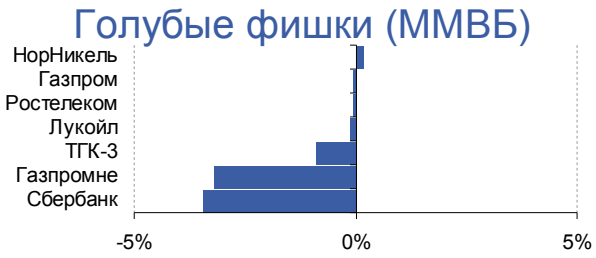
Индекс MSCI

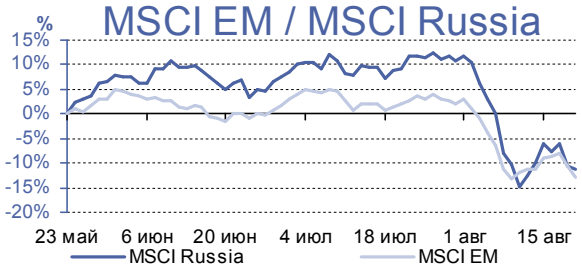
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	970,16	-2,54%	-15,87%	-2,42%
Индекс MSCI BRAZIL	2986,77	-0,97%	-15,34%	-11,68%
Индекс MSCI RUSSIA	823,32	-0,79%	-20,59%	6,51%
Индекс MSCI INDIA	422,17	-1,79%	-17,15%	-14,19%
Индекс MSCI CHINA	55,82	-3,47%	-15,38%	-10,52%

Основные индикаторы









Обзор рынка

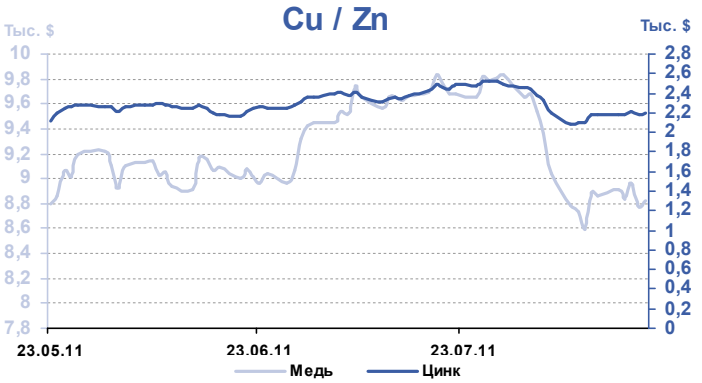
В пятницу американским биржевым индексам не удалось закрепиться на положительной территории, и они завершили торги очередным существенным снижением. В выходящей статистике инвесторы все яснее видят растущие риски очередной рецессии, что в первую очередь негативно сказывается на акциях компаний, которые зависят экономических циклов. В пятницу компания Hewlett-Packard понизила прогноз по доходам до конца года, что негативно сказалось на всем секторе акций высокотехнологических компаний. В конце прошлой недели, индекс широкого спектра акций S&P-500 пошел на тестирование минимумов года (1130 - 1110 п.), и если они устоят, то инвесторы вполне могут рассчитывать на коррекцию опять в район 1200 п. Дабы успокоить инвесторов, в воскресенье Президент США Б. Обама заявил, что не видит угрозы повторной рецессии, однако темпов восстановления американской экономики, сейчас явно недостаточно для борьбы с безработицей.

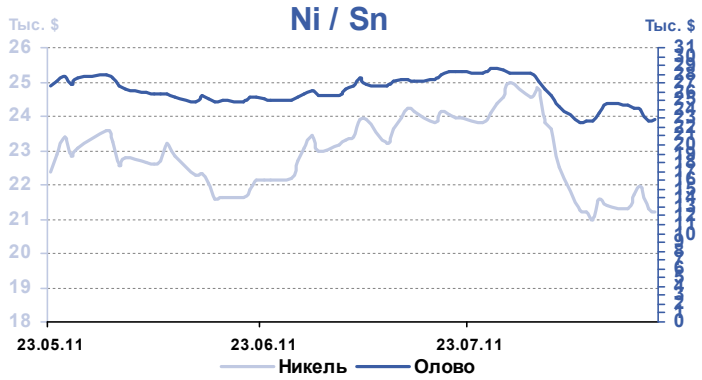
Котировки смеси Brent в понедельник снижаются более, чем на 2% ($106/барр), на сообщениях о том, что ливийские повстанцы вошли в Триполи и контролируют большую часть города. Если события в Ливии продолжат развиваться не в пользу сторонников Муаммара Каддафи, то думаю, в ближайшее время стоит ждать существенного сокращения спрэда между Brent и WTI с пятничных $26 хотя бы до $12-15. Поэтому ключевая отметка $100 может оказаться под угрозой на этой неделе.

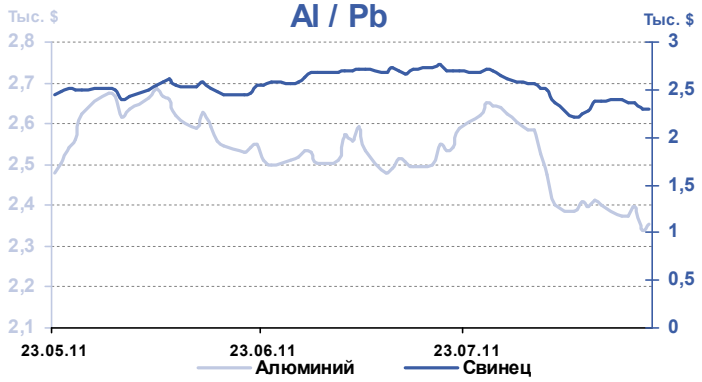
Открытие торгов на российском рынке акций в понедельник мы ожидаем увидеть с гэпом вниз немногим более 1%. К сожалению, ставка на то, что американские инвесторы смогут вытащить свои индексы в пятницу в плюс, заодно и поднимут стоимость нефти, не оправдалась. Вся надежда теперь на то, что вслед за азиатскими биржевыми индексами, наши также не пойдут агрессивно вниз. Хотя нефтяной сектор может быть под давлением продаж из-за снижающихся котировок «черного золота». На дневном графике индекса ММВБ четко виден ближайший уровень поддержки на 1390 п., на котором покупатели показывают силу. Думаю, в начале этой недели мы все же увидим возврат индекса к уровням 1410-15 п., тем более, что падающие котировки нефти будут давить на позиции рубля.

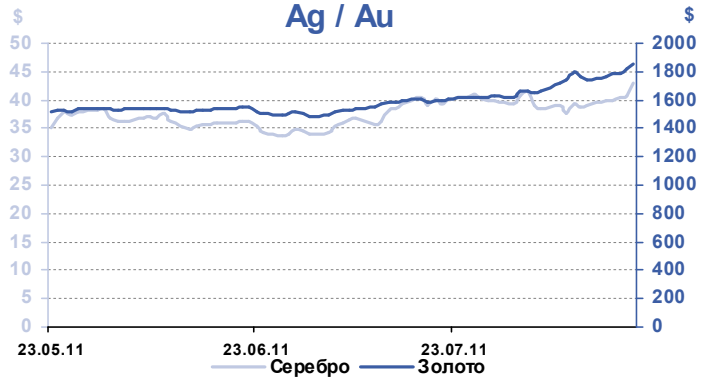
Сегодня в 16-30 ФРБ Чикаго опубликует данные индекса национальной деловой активности в США за июль. В целом наступающая неделя будет скупа на статистику, лишь в пятницу инвесторы будут следить за выступлением главы ФРС Бена Бернанке в Джексон Хоул. Если в прошлом году Бернанке поведал о старте QE-2, то на этот раз подобных заявлений от него не ждут.

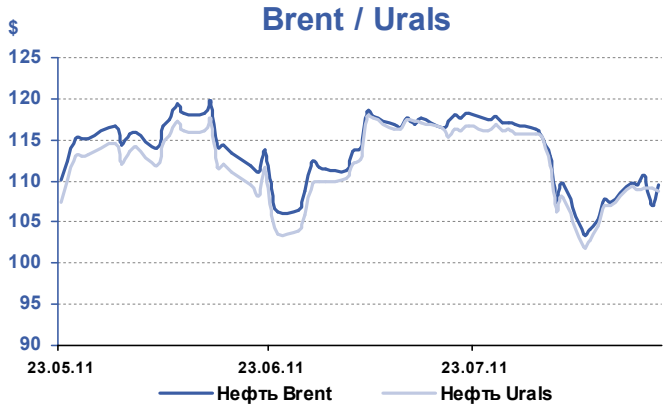
Commodities

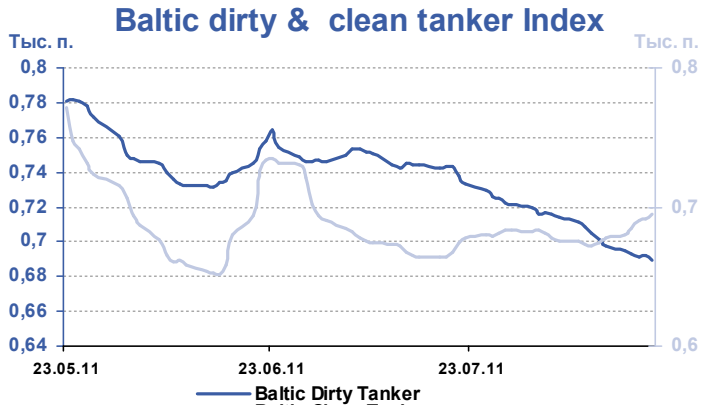












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 825,00	0,63%	-0,45%	-8,79%	20,81%
Цинк, $/t	2 193,00	0,69%	0,73%	-12,10%	4,93%
Никель, $/t	21 205,00	-0,45%	-0,91%	-11,55%	-2,71%
Олово, $/t	22 800,00	0,22%	-7,69%	-19,42%	8,06%
Алюминий, $/t	2 355,00	0,73%	-1,88%	-9,07%	13,99%
Свинец, $/t	2 302,00	0,04%	-3,28%	-14,42%	9,36%
Серебро, $/oz	42,91	5,67%	9,75%	7,04%	134,54%
Золото, $/oz	1 852,10	1,55%	6,02%	15,66%	50,31%
Нефть Brent, $/	109,53	2,43%	2,04%	-7,41%	46,76%
Нефть Urals, $/	108,82	-0,37%	1,71%	-6,69%	47,21%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,360	0,00%	2,25%		229 580	172
БашИнСв	BISV	0,375	0,00%	0,00%		188	356
БашЭнрг	BEGY	1,410	0,00%	5,68%		91 364	1 422
ВМЗ	VSMZ	1782,464	0,00%	8,84%		69 389	2 837
ДВМП	FESH	0,379	0,00%	-2,01%		58 540	1 141
КазанскВЗ	KHEL	2,827	0,00%	0,00%		13 047	424
Мечел	MTLR	17,894	0,00%	-3,75%		1 702 451	7 484
Мотовил	MOTZ	0,072	0,00%	-0,88%		2 269	70
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,600	-3,70%	0,00%	38 792		38 992
СилМашины	SILM	0,223	0,00%	2,85%		145 895	1 894
СинТЗ-ао	SNTZ	48,268	0,00%	-0,42%		48	304
Славн-ЯНОС	JNOS	0,323	0,00%	-0,66%		9 187	290
СТЗ-ао	SVTZ	4,689	0,00%	0,00%		47	226
ТАГМЕТ	TAMZ	0,593	0,00%	1,07%		59	302
ТНК-ВР	TNBP	2,741	0,00%	0,63%		2 956 559	40 852
У-УАЗ	UUAZ	1,705	0,00%	3,04%		303 395	434
ЧМК	CHMK	196,519	0,00%	3,41%		17 658	614
ЧТПЗ	CHEP	2,586	0,00%	0,90%		20 784	1 227
ЮжКузб.	UKUZ	45,155	0,00%	-2,99%		57 281	1 615
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,000	-1,05%	0,00%	352 688		7 998
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	-0,05%	292 200	614 742 359	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-3,21%	85 000	4 350 027	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	-0,12%	745 300	198 164 911	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%	-1,43%	131 000	124 042 192	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	-0,56%	347 000	32 467 142	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	-0,02%	145 000	17 368 291	3 119
Татнефть	TATN	5,600	0,00%	0,00%	12 320		12 092
Транснефть, п.	TRNFP	1285,000	2,80%	-1,54%	12 850	22 530 793	1 998
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,752	0,00%	2,35%		111 421	3 453
Ленэнерго	LSNG	0,508	0,00%	-2,49%		21 808	474
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	-2,00%	35 093	1 878 529	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%	-3,35%	5 025	243 469	1 743
ОГК-4	OGKD	0,081	0,00%	0,00%	40 500		5 107
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	1,40%	38 000	1 061 134	2 688
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	-0,89%	163 350	1 178 601	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-1,87%	8 696	44 253	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,24%	6 121	89 557	466
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,150	0,00%	-0,05%	51 500	73 844 732	15 158
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	1,20%	48 000	6 279 813	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	0,42%		27 081	144
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,786	0,00%	-0,04%		403 273	1 046
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,243	0,00%	-0,52%		21 835	233
КАМАЗ	KMAZ	1,447	0,00%	-1,50%		175 456	1 010
ОМЗ	OMZZ	1,779	0,00%	-0,39%		47 632	62
РКК Энергия	RKKE	230,284	0,00%	0,00%		942	265
Северсталь-авто	SVAV	13,600	0,00%	-2,45%	9 030	976 952	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	130,000	-9,09%	1,32%	13 000	574 282	1 499
Мечел	MTLR	19,400	0,00%	0,00%	29 100		8 076
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-2,48%	52 000	4 567 034	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	-3,86%	39 750	21 617 088	15 882
НорНикель	GMKN	230,500	0,00%	0,22%	1 313 850	139 936 265	43 940
Полиметалл	PMTL	18,000	-13,46%	3,57%	9 000	8 256 866	7 189
Полюс Золото	PLZL	59,950	0,76%	0,24%	3 277 300	12 563 281	11 419
Северсталь	CHMF	15,250	0,00%	-1,35%	53 361	63 039 057	15 116
ТМК	TRMK	3,150	-3,08%	-2,92%	31 500	3 992 437	2 953
ЧМЗ	CHMZ	5,860	0,00%	0,00%	5 040		92
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346
Банки							
Банк Москвы	MMBM	29,523	0,00%	-3,24%		40 216	5 269
Возрождение	VZRZ	32,150	0,00%	-3,43%	64 850	153 268	764
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,47%	15 097	114 872 487	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,241	0,00%	-3,61%		8 924	3 993
Сбербанк	SBER	2,685	-11,47%	0,00%	67 125		57 961
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,000	0,00%	-4,07%	334 000	2 224 483	2 188
Дальневосточное МП	FESH	0,400	0,00%	0,00%	40 000		1 181
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	-3,44%	5 264	336 286	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	-9,96%	15 500	817	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	0,90%	41 000	44 655	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%	-2,43%	10 000	45 976	1 216
Концерн Калина	KLNA	44,000	0,00%	-2,89%	30 800	8 454	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-4,86%	10 100	7 124	93
Магнит	MGNT	105,500	-2,31%	1,31%	105 500	3 243 840	9 387
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,818	0,00%	-5,08%		53 102	13
Разгуляй	GRAZ	1,190	0,00%	-2,03%	5 950	250 837	188
Фармстандарт	PHST	68,000	0,00%	1,30%	81 260	149 701	2 570
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	0,21%	24 000	19 302	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	98 959	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,510	-2,48%	0,00%	387 900		1 528
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,900	-0,76%	0,89%	5 004	10 980 405	1 924
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	41,000	0,00%	-2,26%	20 500	2 560 894	1 955
Дорогобуж	DGBZ	0,560	0,00%	-1,97%	16 800	42 546	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	-0,19%	16 950	46 242 506	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,500	0,00%	-1,95%	122 026	9 221 874	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	123,700	0,49%	15,82
Башнефть	AK6		EUR	170,100	-4,49%	0,68
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,920	-1,08%	0,19
ТГК-3	AOMD		USD	7,330	3,46%	1,10
Татнефть	ATAD		USD	31,500	-3,08%	17 958,89
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,835	-1,73%	2,25
Бурятзолото	BYT		EUR	18,600	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	22,860	-4,59%	43 867,90
X5	FIVE		USD	33,500	-1,90%	22 181,73
Газпром	GAZ		EUR	7,820	-4,05%	3 161,13
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,037	-5,08%	0,81
Иркутскэнерго	IRK		EUR	23,500	-6,91%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	2,800	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,850	0,00%	1,27
Лукойл	LKOD		USD	56,000	0,45%	421 139,40
Лукойл	LUK		EUR	38,655	-0,88%	650,81
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,950	-0,49%	10 789,54
МТС	MBT	5	USD	15,570	-2,32%	40 111,34
МТС	MKY	5	EUR	10,890	-4,97%	
МГТС	MOW		EUR	9,100	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,900	-7,55%	9,08
Мечел	MTL	3	USD	17,260	-4,59%	56 528,46
НорНикель	NILSY	1	USD	21,930	-0,72%	1 468,49
НорНикель	NNIA		EUR	15,455	-2,49%	344,31
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,300	-3,34%	89 608,50
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,900	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,525	8,33%	
Газпром	OGZD		USD	11,600	-0,09%	566 364,90
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	30,600	-0,10%	2 430,27
Ростелеком	RTL		EUR	21,230	-7,27%	13,63
Газпромнефть	SCF		EUR	14,500	-6,72%	154,58
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,450	-1,34%	11,98
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,010	0,33%	15,97
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,410	-2,22%	470,99
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,890	1,81%	83,83
АФКСистема	SSA	1	USD	17,940	-3,03%	24 374,05
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,500	-0,79%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	30,000	-0,66%	
СТЗ	SVY		EUR	31,080	-0,32%	
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	348,000	0,00%	9,30
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,480	-1,96%	30 143,00
ВТБ	VTBR		USD	4,684	0,30%	127 981,20
Возрождение	VZY		EUR	22,800	0,00%	

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

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.