ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

23 августа 2011г.

Комментарий по рынку акций

В ходе торгов в понедельник фондовые индексы США нивелировали весь свой первоначальный рост. Рост акций компаний в сфере высоких технологий был противопоставлен снижению котировок банков. Июльские данные по индексу деловой активности Чикаго (-0,06 п. в июле, против -0,38 в июне) указал на то, что ситуация в американской экономике возможно не слишком плоха. Тем не менее, вот уже второй день подряд, индекс S&P-500 никак не может оторваться от поддержки на уровне 1120 п., что, однако не мешает сегодня фьючерсам на американские индексы показывать уверенный рост (S&P +0,95%).

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 578,45	0,20%	-4,63%	-20,15%	10,70%
Индекс ММВБ	1 443,93	0,36%	-4,42%	-16,48%	5,65%
FTSE	5 095,30	1,08%	-4,77%	-14,15%	-2,67%
S&P 500	1 123,82	0,03%	-6,70%	-16,45%	5,29%
Dow Jones Avg.	10 854,65	0,34%	-5,47%	-14,40%	6,69%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Полиметалл	19,7500	9,72%	-3,66%	19,70%
Сбербанк	2,7630	2,91%	-24,71%	-17,89%
ПИК	3,9300	0,77%	1,16%	4,24%
Полюс Золото	60,3000	0,58%	-3,52%	19,41%
ОАО Группа ЛСР	25,7000	0,39%	-28,61%	-7,92%

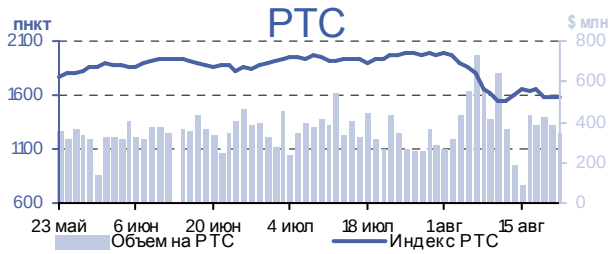
Лидеры снижения

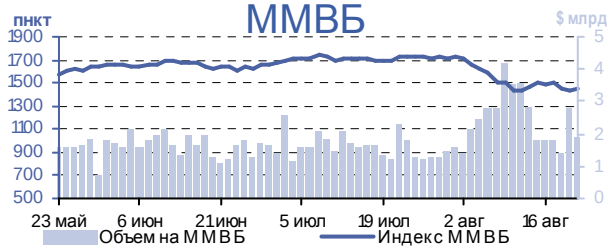
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Мечел	17,5000	-9,79%	-25,05%	-29,01%

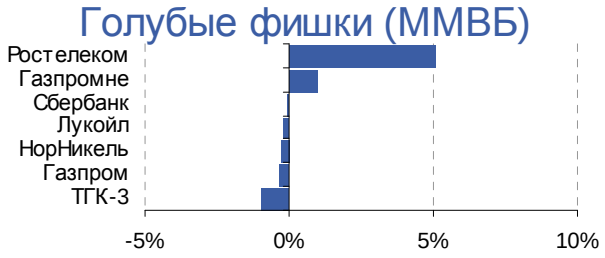
Индекс *MSCI*

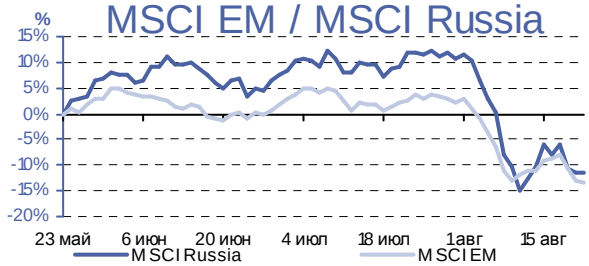
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	966,06	-0,42%	-16,23%	-2,05%
Индекс MSCI BRAZIL	2961,95	-0,83%	-16,04%	-11,29%
Индекс MSCI RUSSIA	823,34	0,00%	-20,59%	8,01%
Индекс MSCI INDIA	427,08	1,16%	-16,18%	-13,00%
Индекс MSCI CHINA	55,21	-1,09%	-16,29%	-10,47%

Основные индикаторы









Обзор рынка

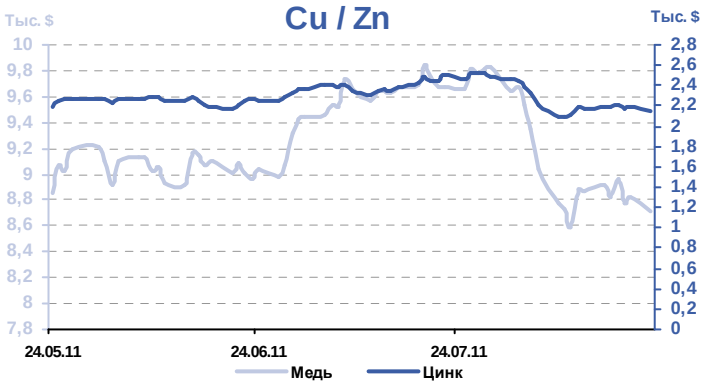
В ходе торгов в понедельник фондовые индексы США нивелировали весь свой первоначальный рост. Рост акций компаний в сфере высоких технологий был противопоставлен снижению котировок банков. Июльские данные по индексу деловой активности Чикаго (-0,06 п. в июле, против -0,38 в июне) указал на то, что ситуация в американской экономике возможно не слишком плоха. Тем не менее, вот уже второй день подряд, индекс S&P-500 никак не может оторваться от поддержки на уровне 1120 п., что, однако не мешает сегодня фьючерсам на американские индексы показывать уверенный рост (S&P +0,95%).

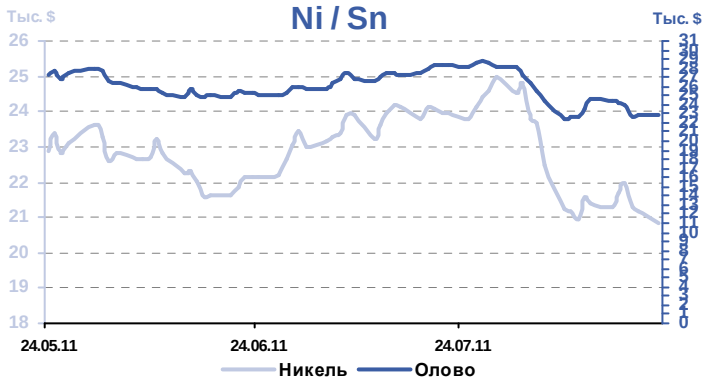
Валютная пара EUR/USD зажата в границах сужающегося треугольника с торговым диапазоном 1,4360 – 1,4405. Цены на нефть марки Brent сегодня утром опять коснулись сопротивления на уровне $109/барр., пробой которого, откроет дорогу на $111. Азиатские биржевые индексы сегодня в основном демонстрируют уверенный рост (MSCI Asia +2,2%), даже, несмотря на то, что предварительный индекс производственной активности PMI рассчитываемый банком HSBC в августе не показывает признаком существенного улучшения: 49,8 п. против 49,3 п. в июле.

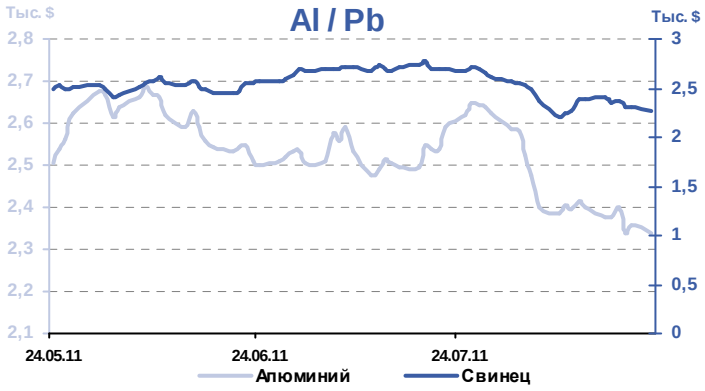
Вчерашнее неустойчивое закрытие наших биржевых индексов не отменяет того, что сейчас они находятся в рамках консолидации краткосрочной растущей формации. Акции американских банков (особенно Bank of America и Goldman Sachs) вчера торговались существенно хуже рынка. У каждого из них была своя история для падения, однако, сегодня на акции Сбербанка может оказать давление заявление первого заместителя председателя Банка России Алексея Улюкаева о том, что при неблагоприятной рыночной ситуации приватизация госпакета акций Сбера может быть перенесена с сентября на другой срок, но не позднее 2013 года. На фоне повышения стоимости сентябрьских нефтяных контрактов сегодня стоит ждать повышения спекулятивного спроса на акции нефтегазовых компаний (Газпром, Лукойл). Утром индекс ММВБ может опуститься до уровня 1435 п., но по итогам дня мы все же рассчитываем увидеть рост.

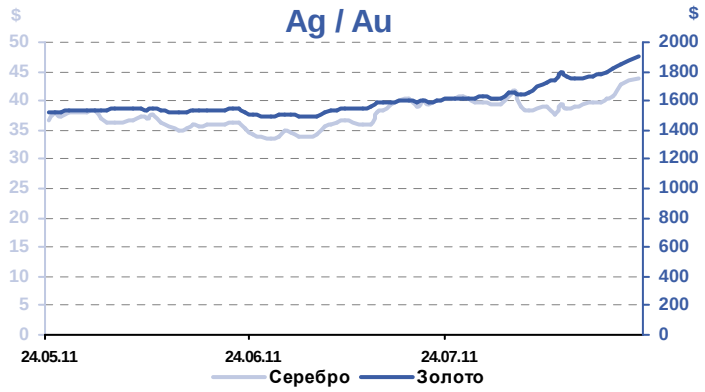
Сегодня в 11-30 мск выходит индекс деловой активности в производственном секторе и в сфере услуг Германии за август от ZEW. В 12-00 аналогичные показатели ждем по Еврозоне. В 18-00 выходит индекс потребительского доверия по Еврозоне за август. В это же время будет опубликована статистика из США по числу проданных домов в новостройках за июль, а также индекс деловой активности в производственном секторе ФРБ Ричмонда за август

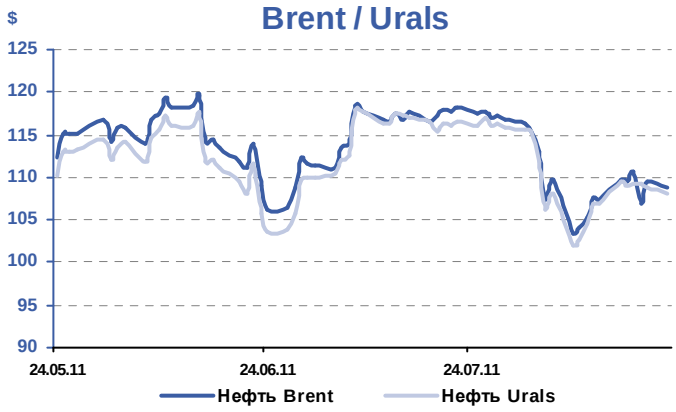
Commodities

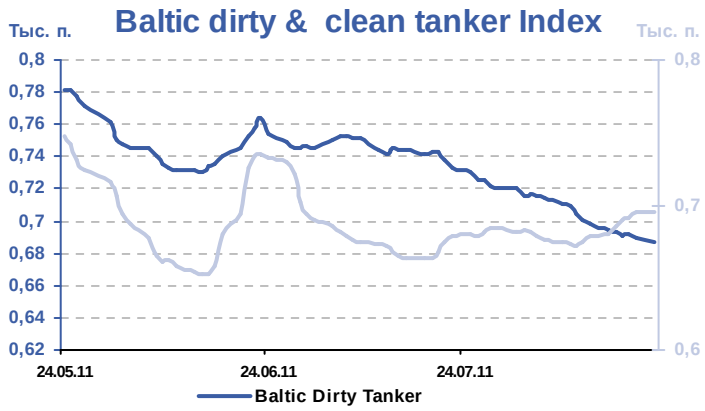












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 720,00	-1,19%	-2,11%	-9,87%	20,19%
Цинк, $/t	2 153,00	-1,82%	-1,37%	-13,71%	5,33%
Никель, $/t	20 850,00	-1,67%	-2,11%	-13,03%	-1,65%
Олово, $/t	22 850,00	0,22%	-6,54%	-19,24%	11,68%
Алюминий, $/t	2 337,00	-0,76%	-1,60%	-9,77%	14,56%
Свинец, $/t	2 261,00	-1,78%	-5,71%	-15,95%	10,40%
Серебро, $/oz	43,76	1,97%	9,74%	9,16%	143,29%
Золото, $/oz	1 897,60	2,46%	7,46%	18,51%	54,76%
Нефть Brent, $/	108,86	-0,61%	-0,83%	-7,97%	49,47%
Нефть Urals, $/	108,16	-0,61%	-1,12%	-7,25%	49,23%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,361	0,00%	0,49%		287 330	176
БашИнСв	BISV	0,381	0,00%	1,83%		267	362
БашЭнрг	BEGY	1,410	0,00%	0,34%		8 465	1 471
ВМЗ	VSMZ	1776,602	0,00%	0,00%		11 746	2 882
ДВМП	FESH	0,361	0,00%	-4,55%		845 639	1 065
КазанскВЗ	KHEL	2,867	0,00%	1,74%		471	427
Мечел	MTLR	18,086	0,00%	1,41%		1 574 025	7 440
Мотовил	MOTZ	0,073	0,00%	1,66%		721	71
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,600	0,00%	0,00%	38 792		38 992
СилМашины	SILM	0,223	0,00%	0,46%		24 657	1 949
СинТЗ-ао	SNTZ	48,268	0,00%	0,00%		48	304
Славн-ЯНОС	JNOS	0,333	0,00%	3,53%		167	311
СТЗ-ао	SVTZ	4,689	0,00%	0,00%		47	226
ТАГМЕТ	TAMZ	0,593	0,00%	0,00%		59	302
ТНК-ВР	TNBP	2,572	0,00%	-5,86%		1 814 669	38 620
У-УАЗ	UUAZ	1,649	0,00%	-2,95%		10 706	440
ЧМК	CHMK	195,907	0,00%	0,02%		4 627	636
ЧТПЗ	CHEP	2,560	0,00%	-0,68%		13 740	1 202
ЮжКузб.	UKUZ	45,700	0,00%	1,54%		53 022	1 609
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	47,000	0,00%	0,00%	352 688		7 998
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	-0,36%	292 200	433 655 633	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,97%	85 000	1 847 563	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	-0,23%	745 300	101 790 727	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%	0,14%	131 000	72 793 166	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	3,25%	347 000	33 342 294	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	1,15%	145 000	6 377 855	3 119
Татнефть	TATN	5,600	0,00%	0,00%	12 320		12 092
Транснефть, п.	TRNFP	1285,000	0,00%	-0,76%	12 850	15 097 146	1 998
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,763	0,00%	1,89%		7 939	3 639
Ленэнерго	LSNG	0,529	0,00%	4,56%		22 475	477
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	4,05%	35 093	249 396	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%	0,00%	5 025	197 505	1 743
ОГК-4	OGKD	0,081	0,00%	0,00%	40 500		5 107
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	-4,05%	38 000	929 379	2 688
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	-0,96%	163 350	1 048 768	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	6,55%	8 696	8 925	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,13%	81 608	93 276	466
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,150	0,00%	5,07%	51 500	94 402 127	15 158
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	2,50%	48 000	4 823 610	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	-0,91%		13 754	152
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,760	0,00%	-3,01%		637 785	1 060
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,269	0,00%	11,02%		215 645	277
КАМАЗ	KMAZ	1,457	0,00%	1,02%		233 060	1 033
ОМЗ	OMZZ	1,801	0,00%	1,55%		21 418	63
РКК Энергия	RKKE	240,374	0,00%	4,39%		2 698	253
Северсталь-авто	SVAV	13,600	0,00%	3,85%	9 030	387 309	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	0,00%	1,18%	13 000	269 138	1 499
Мечел	MTLR	17,500	-9,79%	0,00%	46 935		7 285
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-0,27%	52 000	3 663 047	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	1,24%	39 750	11 390 733	15 882
НорНикель	GMKN	230,500	0,00%	-0,31%	1 313 850	61 900 156	43 940
Полиметалл	PMTL	19,750	9,72%	6,37%	9 875	11 442 872	7 888
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,58%	1,32%	300 000	7 082 793	11 495
Северсталь	CHMF	15,250	0,00%	2,15%	53 361	43 609 218	15 116
ТМК	TRMK	3,150	0,00%	-0,36%	31 500	1 071 490	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	29,484	0,00%	0,20%		2 677	5 296
Возрождение	VZRZ	32,150	0,00%	-0,58%	64 850	92 234	764
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	1,78%	15 097	100 628 463	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,230	0,00%	0,00%		6 902	3 993
Сбербанк	SBER	2,763	2,91%	0,00%	4 089 116		59 645
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,000	0,00%	-2,65%	334 000	2 619 923	2 188
Дальневосточное МП	FESH	0,400	0,00%	0,00%	40 000		1 181
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	1,97%	5 264	33 806	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	5,12%	15 500	1 196	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	0,87%	41 000	24 998	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%	1,95%	10 000	41 050	1 216
Концерн Калина	KLNA	44,000	0,00%	2,17%	30 800	16 171	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	7,39%	10 100	1 132	93
Магнит	MGNT	105,500	0,00%	2,82%	105 500	1 622 806	9 387
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,833	0,00%	2,15%		3 584	14
Разгуляй	GRAZ	1,220	2,52%	0,62%	12 200	133 964	193
Фармстандарт	PHST	68,000	0,00%	-1,53%	81 260	43 919	2 570
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	-0,12%	24 000	2 840	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	-1,58%	46 000	1 282	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,510	0,00%	0,00%	387 900		1 528
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,930	0,77%	0,96%	5 003	5 502 471	1 939
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	41,000	0,00%	3,51%	20 500	1 331 982	1 955
Дорогобуж	DGBZ	0,560	0,00%	-0,46%	16 800	11 011	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	0,21%	16 950	26 941 855	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,500	0,00%	-3,29%	122 026	11 840 487	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	125,940	1,81%	
Башнефть	AK6		EUR	161,990	-4,77%	
ТГК-3	AOMD		USD	7,330	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	32,100	1,90%	10 600,67
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,530	-10,76%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,600	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	23,620	3,32%	39 692,92
X5	FIVE		USD	34,000	1,49%	7 349,77
Газпром	GAZ		EUR	7,880	0,77%	1 347,29
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,030	-19,74%	3,76
Иркутскэнерго	IRK		EUR	24,000	2,13%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	7,14%	3,00
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,950	11,76%	
Лукойл	LKOD		USD	56,050	0,09%	206 851,20
Лукойл	LUK		EUR	37,975	-1,76%	362,96
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,150	0,36%	5 510,07
МТС	MBT	5	USD	15,490	-0,51%	28 526,71
МТС	MKY	5	EUR	10,590	-2,75%	1,11
МГТС	MOW		EUR	9,100	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,011	2,27%	2,16
Мечел	MTL	3	USD	17,340	0,46%	47 697,03
НорНикель	NILSY	1	USD	21,900	-0,14%	918,30
НорНикель	NNIA		EUR	15,350	-0,68%	295,74
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	124,400	0,08%	32 996,19
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,910	0,53%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,100	-7,69%	
Газпром	OGZD		USD	11,600	0,00%	537 527,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,570	6,44%	563,90
Ростелеком	RTL		EUR	21,095	-0,64%	16,34
Газпромнефть	SCF		EUR	14,200	-2,07%	94,76
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,300	-2,75%	8,23
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,010	0,00%	1,62
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,420	0,23%	1 411,47
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,930	0,51%	920,53
АФКСистема	SSA	1	USD	18,450	2,84%	10 427,81
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,400	-0,80%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	29,800	-0,67%	
СТЗ	SVY		EUR	30,980	-0,32%	6,46
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	286,530	-17,66%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,590	1,05%	15 619,21
ВТБ	VTBR		USD	4,721	0,79%	176 462,20
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

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.