ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

2 сентября 2011г.

Комментарий по рынку акций

В четверг американские фондовые индексы завершили сессию в красной зоне. И в среду, и в четверг внутридневная динамика торгов проходит по схожему сценарию: высокое открытие и плавное движение вниз. Несмотря на ожидания новых стимулов со стороны ФРС инвесторы пока предпочитают выходить из рискованных активов накануне публикации отчета по рынку труда в США за август. Выходившая вчера в США статистика показала сокращение числа первичных обращений за пособием по безработице на 12 тыс. до 409 тыс. При этом во II квартале отмечено снижение производительности труда на 0,7%, с одновременным ростом затрат на рабочую силу на +3,3%. В

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 703,86	0,09%	7,57%	-13,43%	17,51%
Индекс ММВБ	1 551,58	0,36%	7,56%	-9,44%	11,26%
FTSE	5 418,65	0,45%	5,60%	-5,24%	0,97%
S&P 500	1 204,42	-1,19%	3,89%	-3,96%	11,49%
Dow Jones Avg.	11 493,57	-1,03%	3,08%	-3,14%	11,92%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Транснефть, п.	1350,0000	5,06%	-15,63%	11,57%
Магнит	108,0000	3,85%	-25,52%	-6,09%
ОАО Группа ЛСР	25,4100	2,87%	-29,42%	-8,96%
Сбербанк	2,8600	2,23%	-22,49%	-13,70%
Дальневосточное МП	0,3700	0,14%	-22,92%	-17,78%

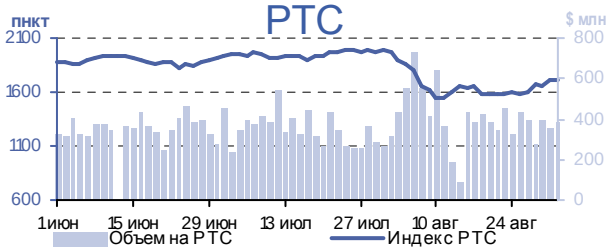
Лидеры снижения

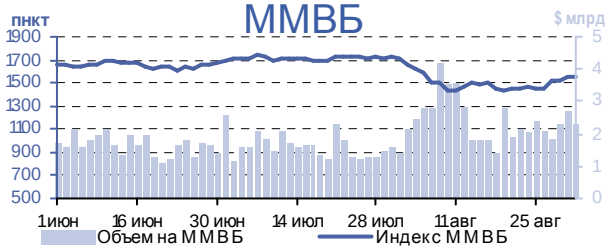
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Фармстандарт	74,5500	-21,53%	-15,67%	-15,38%
ОАО АРМАДА	12,5000	-10,71%	-15,25%	48,81%
ОГК-4	0,0797	-1,60%	-18,26%	-10,45%

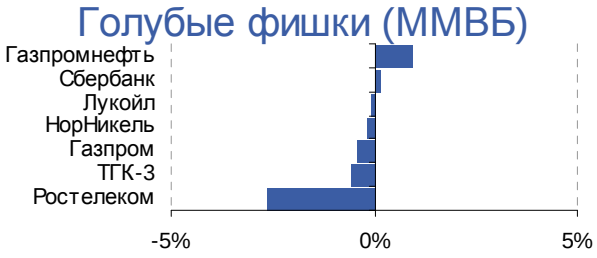
Индекс *MSCI*

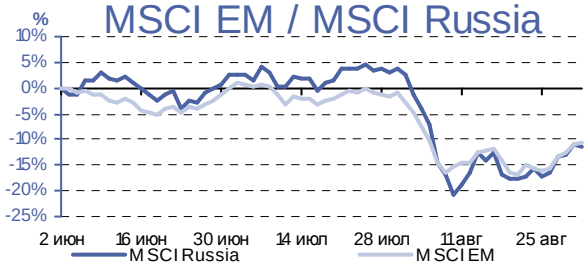
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1038,00	0,47%	-7,89%	4,87%
Индекс MSCI BRAZIL	3265,31	1,38%	-2,99%	-5,20%
Индекс MSCI RUSSIA	885,54	-0,40%	-13,59%	14,64%
Индекс MSCI INDIA	433,69	0,00%	-11,95%	-9,91%
Индекс MSCI CHINA	59,48	0,60%	-8,27%	-2,67%

Основные индикаторы









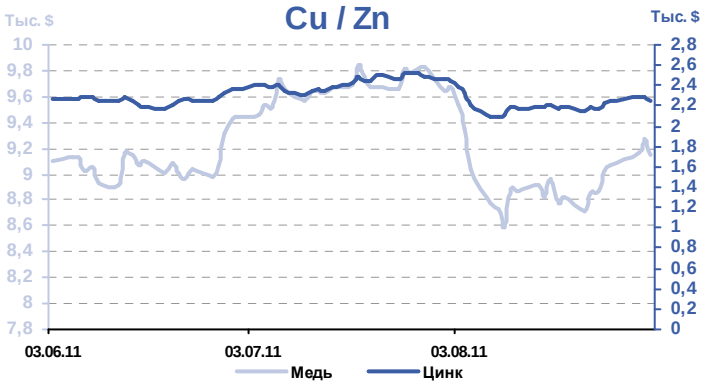
Обзор рынка

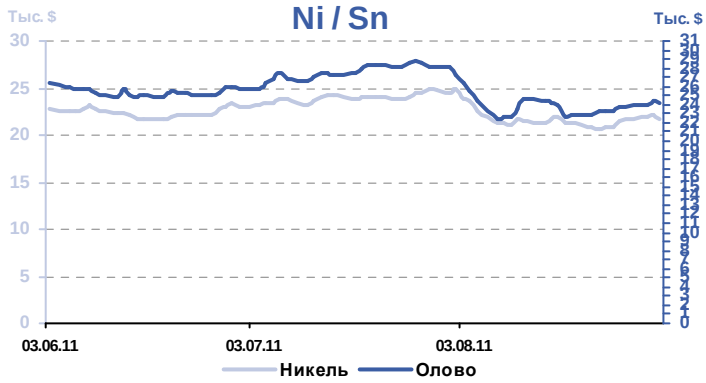
В четверг американские фондовые индексы завершили сессию в красной зоне. И в среду, и в четверг внутридневная динамика торгов проходит по схожему сценарию: высокое открытие и плавное движение вниз. Несмотря на ожидания новых стимулов со стороны ФРС инвесторы пока предпочитают выходить из рискованных активов накануне публикации отчета по рынку труда в США за август. Выходившая вчера в США статистика показала сокращение числа первичных обращений за пособием по безработице на 12 тыс. до 409 тыс. При этом во II квартале отмечено снижение производительности труда на 0,7%, с одновременным ростом затрат на рабочую силу на +3,3%. В августе индекс деловой активности в производственном секторе (ISM manufacturing) хоть и снизился до 50,6 п. против 50,9 п. в июле, но все же оказался лучше прогноза 48,5 п. В целом напрашивается вывод, что крупнейшая мировая экономика этим летом просто топчется на месте из-за высокой безработицы и растущих издержек бизнеса.

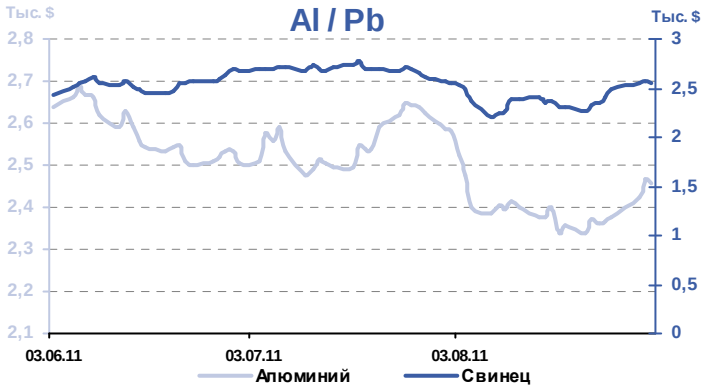
Уход от риска накануне выхода важной статистики из США привело к укреплению позиций доллара (EUR/USD 1,4265). С другой стороны вчерашние слабые статданные из Европы оказывают давление на позиции евро, поскольку участники рынка уже не ожидают повышения ставок ЕЦБ в ближайшей перспективе. Цены на нефть марки Brent в пятницу стабильно торгуются возле отметки $114,3/барр, при этом сохраняется тенденция, когда каждый следующий дневной минимум цены, выше, чем минимум предыдущего дня. Сегодняшние торги в Азии в основном проходят в красной зоне (MSCI Asia -1,15%), что оказывает давление на американские фьючерсы: S&P -0,32%.

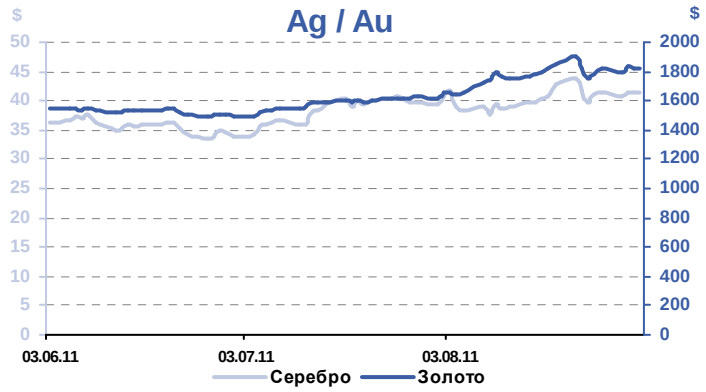
В пятницу мы ждем открытия торгов на нашем рынке акций с гэпом вниз около одного процента. Ситуация складывается довольно неоднозначная: вчерашняя существенная просадка котировок (даже несмотря на то, что она была потом выкуплена) говорит о том, что «медведи» уже пробуют силы в расчете на новое падение. И, наверное, не беспочвенно, поскольку ведущие мировые банки снижают свои прогнозы по цифрам сегодняшней статистики из США по безработице. С другой стороны в пятницу днем не выходит никакой важной макроэкономической статистики, а значит при подходе к вчерашним минимумам (1520 п. по ММВБ и 164500 по fRTS) у спекулянтов появится соблазн повторить вчерашний трюк с выкупом снижения на ожиданиях того, что статистика из США все же не разочарует рынок. Думаю, показательными для нас будут уровни и направление движения индексов под самое закрытие сессии. Если индекс ММВБ удерживает планку 1510 п. сегодня, то для «быков» ситуация остается довольно благоприятной и на следующей неделе. Не стоит забывать, что в понедельник, 5 сентября, биржи США будут закрыты в связи с празднованием Дня Труда

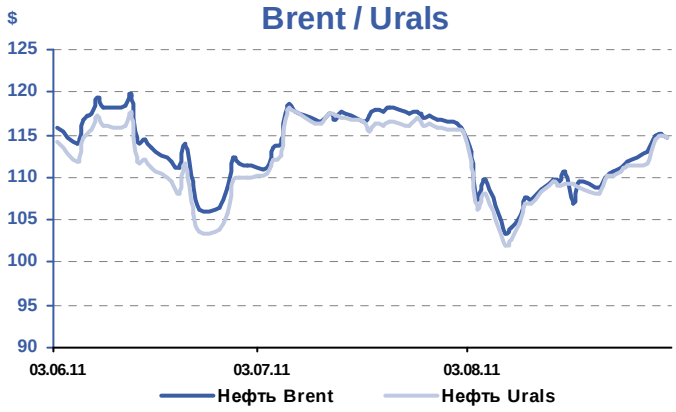
Commodities

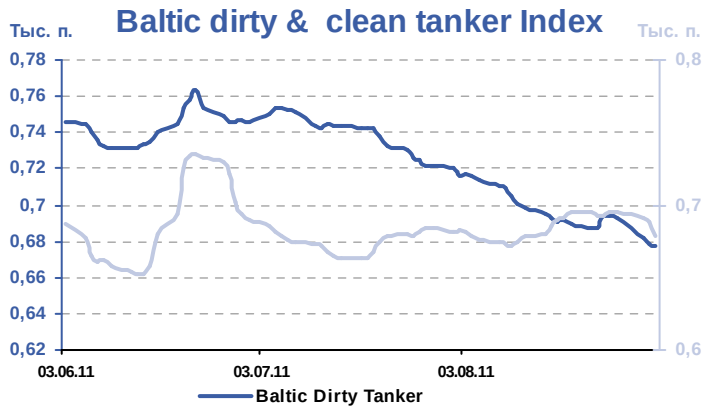












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 145,00	-1,40%	1,27%	-5,53%	20,23%
Цинк, $/t	2 239,00	-2,31%	0,49%	-8,24%	4,97%
Никель, $/t	21 750,00	-2,03%	4,32%	-12,30%	3,33%
Олово, $/t	24 245,00	-0,64%	3,83%	-11,03%	13,03%
Алюминий, $/t	2 455,00	-0,57%	3,76%	-4,96%	16,46%
Свинец, $/t	2 550,00	-1,16%	6,18%	-0,43%	20,57%
Серебро, $/oz	41,57	0,02%	1,16%	1,88%	114,73%
Золото, $/oz	1 826,15	0,02%	2,93%	9,93%	46,76%
Нефть Brent, $/	114,67	-0,47%	3,19%	-0,56%	51,18%
Нефть Urals, $/	114,74	-0,08%	3,70%	-0,50%	51,55%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,385	0,00%	1,34%		144 854	189
БашИнСв	BISV	0,367	0,00%	0,00%		147	348
БашЭнрг	BEGY	1,511	0,00%	-1,64%		1 390	1 611
ВМЗ	VSMZ	1849,442	0,00%	4,79%		5 509	3 154
ДВМП	FESH	0,366	0,00%	-0,77%		235 750	1 081
КазанскВЗ	KHEL	3,072	0,00%	-0,02%		4 595	466
Мечел	MTLR	18,712	0,00%	2,05%		5 497 186	7 753
Мотовил	MOTZ	0,072	0,00%	-2,40%		796	72
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,710	0,00%	0,00%	162 587		40 638
СилМашины	SILM	0,264	0,00%	-0,66%		75 680	2 241
СинТЗ-ао	SNTZ	54,474	0,00%	0,00%		5 499	343
Славн-ЯНОС	JNOS	0,330	0,00%	0,00%		3 329	293
СТЗ-ао	SVTZ	5,534	0,00%	0,00%		5 517	266
ТАГМЕТ	TAMZ	0,639	0,00%	2,83%		192	325
ТНК-ВР	TNBP	2,779	0,00%	0,62%		1 081 920	41 296
У-УАЗ	UUAZ	1,760	0,00%	3,39%		232 032	469
ЧМК	CHMK	203,829	0,00%	0,43%		3 441	640
ЧТПЗ	CHEP	2,727	0,00%	-0,74%		11 728	1 288
ЮжКузб.	UKUZ	48,489	0,00%	-0,05%		47 945	1 736
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,000	0,00%	0,00%	51 000		8 679
Газпром	GAZP	6,130	0,00%	-0,41%	153 250	401 921 822	145 119
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	0,98%	85 000	1 685 802	20 151
Лукойл	LKOH	58,000	0,00%	-0,07%	58 000	126 209 263	49 333
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%	1,75%	131 000	150 242 587	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	1,73%	347 000	41 642 826	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	1,94%	145 000	7 812 208	3 119
Татнефть	TATN	5,200	0,00%	0,00%	104 000		11 329
Транснефть, п.	TRNFP	1350,000	5,06%	-0,19%	135 000	19 554 547	2 099
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,500	0,00%	0,00%	37 500		1 564
Иркутскэнерго	IRGZ	0,751	0,00%	-0,39%		11 485	3 578
Ленэнерго	LSNG	0,535	0,00%	-0,20%		28 623	498
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	-1,15%	35 093	888 534	2 589
ОГК-2	OGKB	0,043	0,00%	0,00%	126 362		1 391
ОГК-3	OGKC	0,037	0,00%	-2,63%	5 025	432 181	1 743
ОГК-4	OGKD	0,080	-1,60%	0,00%	6 551		5 025
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	-1,62%	38 000	126 908	2 688
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	-0,57%	163 350	629 467	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-0,76%	8 696	32 826	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,14%	52 674	34 479	484
Телекоммуникации							
МТС	MTSS	8,360	0,00%	0,00%	25 064		17 275
Ростелеком	RTKM	6,380	0,00%	-2,64%	50 581	117 620 852	18 778
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	0,00%	-0,38%	36 500	14 898 177	886
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	0,33%		450	157
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,804	0,00%	0,65%		329 620	1 106
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,259	0,00%	-0,12%		17 457	251
КАМАЗ	KMAZ	1,660	0,00%	0,35%		637 276	1 192
ОМЗ	OMZZ	1,850	0,00%	-1,65%		55 328	69
РКК Энергия	RKKE	242,814	0,00%	0,00%		22 339	273
Северсталь-авто	SVAV	12,857	0,00%	1,24%	11 134	733 452	441
Силовые машины	SILM	0,235	0,00%	0,00%	36 922		2 047
УМПО	UFMO	0,620	0,00%	0,00%	62 250		176

Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,443	0,00%	0,00%	22 125		221
ВСМПО	VSMO	130,000	0,00%	-2,21%	13 000	249 480	1 499
Мечел	MTLR	17,500	0,00%	0,00%	46 935		7 285
ММК	MAGN	0,620	0,00%	0,48%		3 603 253	6 871
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	0,63%	39 750	12 139 003	15 882
НорНикель	GMKN	244,000	0,00%	-0,17%	244 000	129 244 896	46 513
Полиметалл	PMTL	19,750	0,00%	-1,24%	9 875	4 087 307	7 888
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	-0,01%	300 000	12 136 070	11 495
Северсталь	CHMF	15,250	0,00%	-0,92%	53 361	44 988 607	15 116
ТМК	TRMK	2,880	0,00%	3,51%	28 800	8 309 324	2 700
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	30,381	0,00%	-1,12%		20 016	5 534
Возрождение	VZRZ	29,957	0,00%	-0,03%	29 957	60 840	711
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	1,72%		132 596 300	26 825
РОСБАНК	ROSB	3,314	0,00%	-0,35%		570	4 171
Сбербанк	SBER	2,860	2,23%	0,00%	286 000		61 739
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,787	0,00%	2,00%	44 675	3 528 143	1 985
Дальневосточное МП	FESH	0,370	0,14%	0,00%	18 500		1 092
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	0,17%	5 264	22 288	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	3,50%	15 500	1 008	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,350	0,00%	0,00%	10 050		315
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	0,09%	41 000	68 871	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%	1,03%	10 000	187 397	1 216
Концерн Калина	KLNA	50,050	13,75%	8,28%	80 430	720 895	322
Красный Октябрь	KROT	8,630	0,00%	-2,34%		3 115	78
Магнит	MGNT	108,000	3,85%	-2,15%	324 000	1 662 609	9 609
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,900	0,00%	1,72%		3 183	14
Разгуляй	GRAZ	1,260	0,00%	-1,22%	31 500	199 068	199
Фармстандарт	PHST	74,550	-21,53%	8,85%	7 455	1 566 631	2 817
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	1,26%	24 000	18 000	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,918	0,00%	-1,52%	68 874	142 269	1 480
Уфанефтехим	UFNC	5,510	0,00%	0,00%	387 900		1 528
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,700	0,00%	-0,88%	5 002	2 779 953	1 825
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,250	0,00%	0,29%	45 250	1 624 736	2 158
Дорогобуж	DGBZ	0,560	0,00%	-0,60%	16 800	15 985	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	1,36%	16 950	36 904 335	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,280	0,00%	-0,74%	42 800	7 954 124	3 342
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	138,160	2,34%	
Башнефть	AK6		EUR	170,000	5,59%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,890	4,71%	9,05
ТГК-3	AOMD		USD	7,500	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	33,760	-0,79%	33 856,70
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,737	0,66%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	24,200	0,88%	83 300,90
X5	FIVE		USD	36,950	2,18%	32 550,37
Газпром	GAZ		EUR	8,521	-0,92%	1 010,51
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,025	0,00%	0,10
Иркутскэнерго	IRK		EUR	25,000	0,00%	10,00
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,100	16,98%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,050	10,53%	
Лукойл	LKOD		USD	59,650	-0,91%	264 800,00
Лукойл	LUK		EUR	41,650	0,02%	335,40
Лукойл	LUKOY	1	USD	59,450	-0,42%	3 052,39
МТС	MBT	5	USD	16,750	-1,06%	39 234,16
МТС	MKY	5	EUR	11,610	-0,17%	
МГТС	MOW		EUR	9,100	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,285	-0,19%	2,73
Мечел	MTL	3	USD	18,580	-1,48%	51 033,31
НорНикель	NILSY	1	USD	24,800	-0,20%	752,31
НорНикель	NNIA		EUR	17,400	0,87%	196,97
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	137,600	0,95%	81 267,09
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,910	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,350	24,51%	37,80
Газпром	OGZD		USD	12,180	-2,17%	490 358,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,250	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	38,090	-3,57%	3 583,98
Ростелеком	RTL		EUR	26,500	0,00%	5,49
Газпромнефть	SCF		EUR	15,355	1,69%	55,11
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,005	1,23%	18,65
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,448	2,38%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,840	-0,21%	119,97
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,490	0,47%	158,44
АФКСистема	SSA	1	USD	19,110	2,91%	10 018,44
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	11,600	-0,85%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	28,200	-0,70%	
СТЗ	SVY		EUR	29,530	-0,34%	8,92
ЦУМ	THT		EUR	15,000	7,14%	0,60
Ютэйр	TYV		EUR	30,000	-3,23%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	305,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,450	0,17%	36 344,00
ВТБ	VTBR		USD	5,200	0,00%	106 320,10
Возрождение	VZY		EUR	23,700	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

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@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.