ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

6 сентября 2011г.

Комментарий по рынку акций

Американские фондовые площадки в понедельник были закрыты, поэтому для оценки динамики российского рынка акций обращаем внимание на утренние торги в Азии, цены на сырьевые товары и ситуацию на валютном рынке.

На биржах азиатско-тихоокеанского региона сегодня наблюдается снижение. Пока достаточно сдержанное: MCSI Asia -0,93%, даже, несмотря на обвал европейских фондовых индексов накануне. Инвесторы продают активы на фоне негатива связанного с банковским сектором Америки и Европы. Причем, если в США дело касается иска Федерального Агентства по финансированию

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 617,01	-2,43%	-3,04%	-10,10%	10,02%
Индекс ММВБ	1 492,83	-1,52%	-1,29%	-5,93%	5,98%
FTSE	5 102,58	-3,58%	-0,53%	-2,75%	-6,19%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ВСМПО	164,0000	26,15%	0,00%	71,73%
Силовые машины	0,2450	4,26%	-9,26%	-9,59%
Башнефть	51,5000	0,98%	0,00%	19,21%
Лукойл	58,3000	0,52%	-8,55%	1,92%

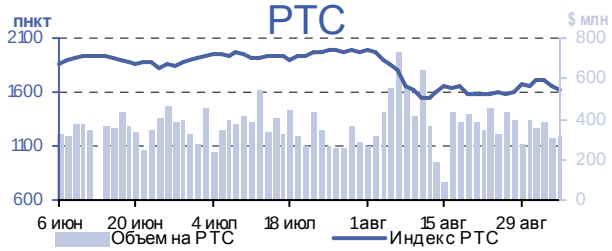
Лидеры снижения

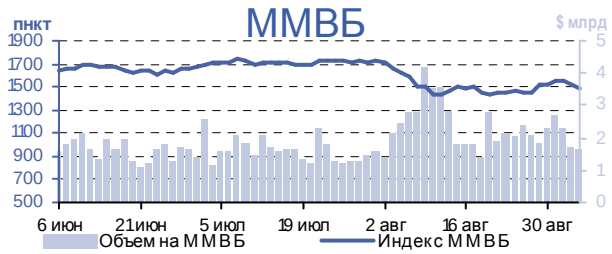
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-2	0,0390	-8,24%	-13,33%	-30,36%
ОГК-6	0,0320	-4,48%	-18,37%	-20,00%
ОАО АРМАДА	12,0000	-4,00%	-14,29%	42,86%
Сбербанк	2,7250	-3,54%	-19,50%	-18,66%

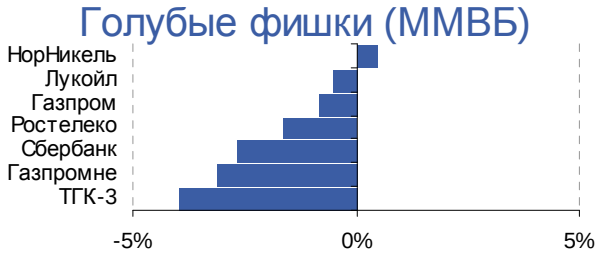
Индекс *MSCI*

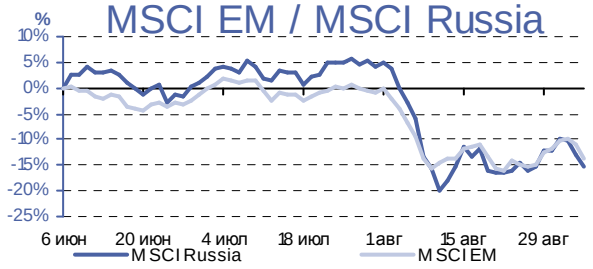
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	989,59	-3,16%	-4,94%	-2,19%
Индекс MSCI BRAZIL	3020,11	-3,73%	-1,79%	-12,74%
Индекс MSCI RUSSIA	836,66	-2,54%	-9,98%	6,93%
Индекс MSCI INDIA	436,18	-0,87%	-6,37%	-11,71%
Индекс MSCI CHINA	56,30	-3,53%	-7,04%	-11,32%

Основные индикаторы









Обзор рынка

Американские фондовые площадки в понедельник были закрыты, поэтому для оценки динамики российского рынка акций обращаем внимание на утренние торги в Азии, цены на сырьевые товары и ситуацию на валютном рынке.

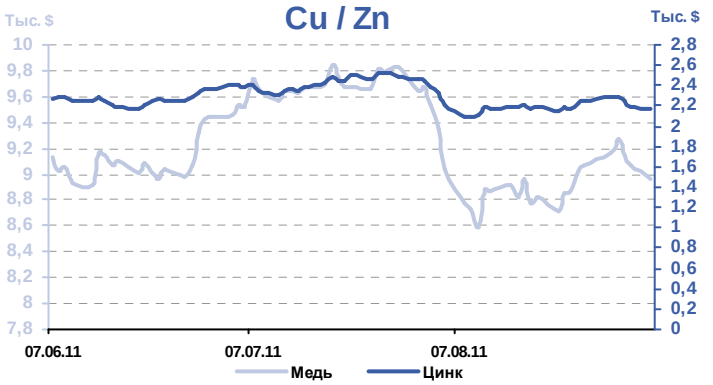
На биржах азиатско-тихоокеанского региона сегодня наблюдается снижение. Пока достаточно сдержанное: MCSI Asia -0,93%, даже, несмотря на обвал европейских фондовых индексов накануне. Инвесторы продают активы на фоне негатива связанного с банковским сектором Америки и Европы. Причем, если в США дело касается иска Федерального Агентства по финансированию жилья по поводу обвинений банков в продаже рискованных ипотечных ценных бумаг, то в Европе инвесторов очень беспокоят балансы банков с учетом продолжения падения цен на греческие гособлигации (доходность 2-летних бондов в понедельник поднялась - до 50,3% годовых). Не случайно Deutsche Bank сообщил, что может пойти на сокращения рабочих мест, если ситуация на рынках не улучшится.

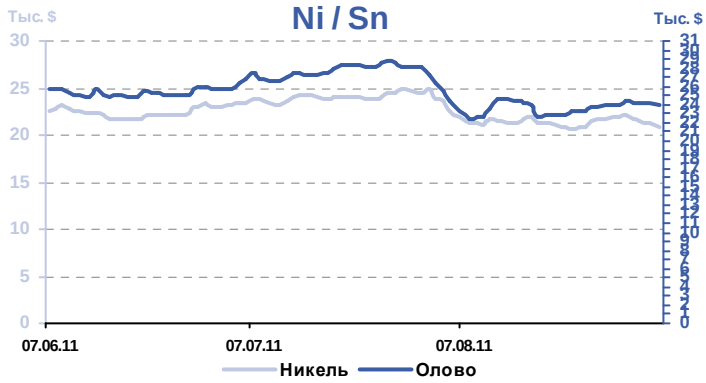
В случае шоковых последствий на долговом рынке Европы Банк России оценивает возможные месячные потери российских банков по ценным бумагам в 350 млрд. руб. Котировки акций Сбербанка вчера скатились к отметке 80 руб. и ближайший уровень поддержки находится совсем близко на 78 руб. Кстати, есть шанс, что в сегодня бумаги банковского сектора не прекратят снижение на фоне заявления China Construction Bank о продлении стратегического партнерства с Bank of America до 2016 года.

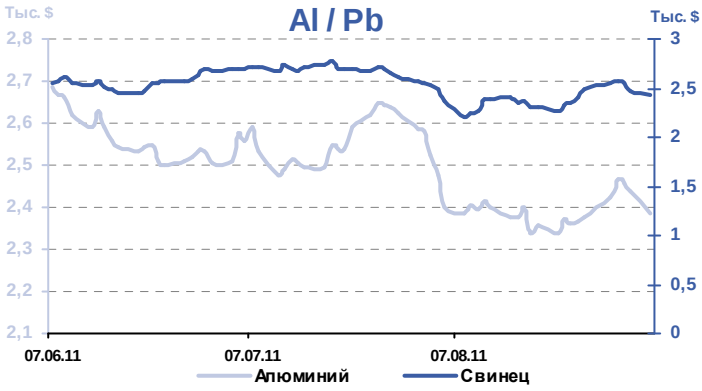
Цены на нефть марки Brent вчера вечером протестировали поддержку на уровне $110/барр и на утро вторника торгуются чуть выше. Бразильский индекс Bovespa без поддержки Штатов вчера с открытия опустился на -2,7%, где и провел всю торговую сессию. Таким образом, особого позитива на утро нет. Но чего нам ждать сегодня: нового обвала акций и фьючерсов или проторговки вокруг текущих уровней? Думаю, пока больше подходит второй сценарий торгов.

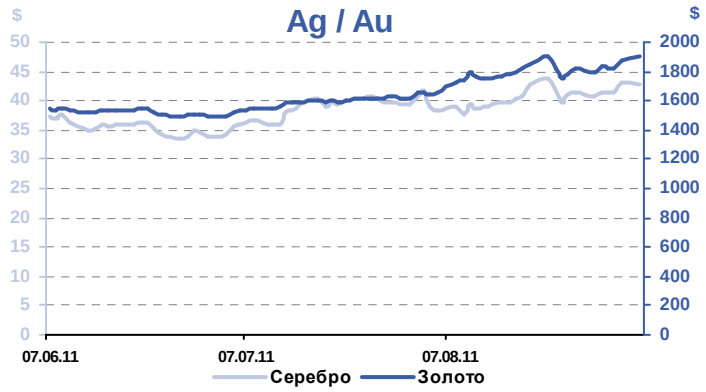
Индекс ММВБ начнет торги в красной зоне. Если фьючерс РТС уже пробил вниз свой растущий тренд, то индексу ММВБ еще есть шанс зацепиться за отметку 1485 п. Фьючерсы индекс S&P сегодня утром ушел к отметке 1136 п. – сильный уровень поддержки. Главный вопрос на сегодня: поддержат ли трейдеры на Уолл-стрит текущее снижение или попробуют его выкупить? Думаю, как минимум до четверга (8 сентября Б. Обама будет выступать перед Конгрессом) крупные игроки предпочтут оставаться вне рынка, но под занавес недели мы не исключаем позитивной динамики. Поэтому наша рекомендация на сегодня – активно не торговать, держа большую часть портфеля в кэше

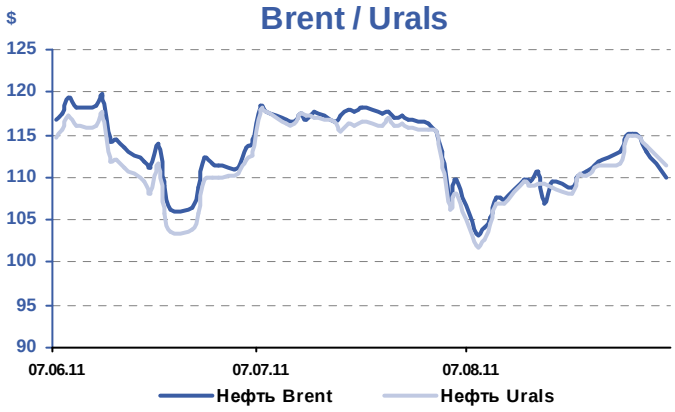
Commodities

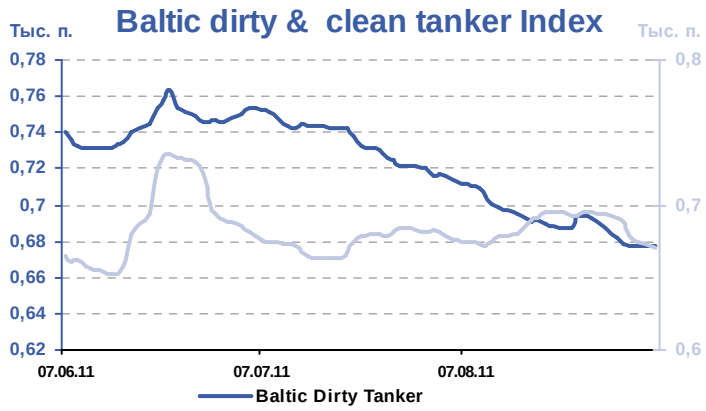












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	8 959,50	-1,28%	-1,27%	-0,90%	16,22%
Цинк, $/t	2 172,00	-1,05%	-3,34%	-1,27%	-1,09%
Никель, $/t	20 895,00	-2,81%	-2,59%	-7,15%	-5,67%
Олово, $/t	23 950,00	-1,24%	0,61%	-1,64%	14,87%
Алюминий, $/t	2 387,50	-1,99%	0,40%	-0,60%	8,87%
Свинец, $/t	2 435,00	-1,02%	-2,01%	3,13%	10,88%
Серебро, $/oz	42,93	-0,77%	5,03%	11,93%	116,33%
Золото, $/oz	1 900,23	0,92%	6,25%	14,21%	52,01%
Нефть Brent, $/	110,03	-2,59%	-2,70%	0,25%	44,55%
Нефть Urals, $/	111,38	-2,01%	-0,25%	3,14%	46,90%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,365	0,00%	-0,93%		11 294	182
БашИнСв	BISV	0,372	0,00%	3,30%		223	352
БашЭнрг	BEGY	1,469	0,00%	-0,60%		16 466	1 533
ВМЗ	VSMZ	1707,255	0,00%	-4,19%		6 879	2 954
ДВМП	FESH	0,341	0,00%	-4,19%		209 039	1 031
КазанскВЗ	KHEL	2,902	0,00%	-4,96%		1 828	454
Мечел	MTLR	17,045	0,00%	-2,11%		2 058 234	7 080
Мотовил	MOTZ	0,072	0,00%	0,00%		796	72
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,670	-1,47%	0,00%	26 700		40 042
СилМашины	SILM	0,248	0,00%	-2,68%		33 491	2 160
СинТЗ-ао	SNTZ	51,734	0,00%	1,61%		777	326
Славн-ЯНОС	JNOS	0,305	0,00%	-2,70%		2 752	285
СТЗ-ао	SVTZ	4,930	0,00%	0,00%		49	237
ТАГМЕТ	TAMZ	0,647	0,00%	11,06%		761	323
ТНК-ВР	TNBP	2,642	0,00%	-1,54%		44 299	39 780
У-УАЗ	UUAZ	1,673	0,00%	-2,80%		126 365	448
ЧМК	CHMK	186,678	0,00%	-3,51%		19 144	593
ЧТПЗ	CHEP	2,563	0,00%	-2,93%		28 957	1 200
ЮжКузб.	UKUZ	46,449	0,00%	-1,19%		17 994	1 666
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	51,500	0,98%	0,00%	51 500		8 764
Газпром	GAZP	5,980	0,00%	-0,81%	149 500	302 704 808	141 568
Газпромнефть	SIBN	4,185	0,00%	-3,13%		1 137 261	20 003
Лукойл	LKOH	58,300	0,52%	-0,51%	580 500	102 684 631	49 588
НОВАТЭК	NVTK	12,810	0,00%	0,00%	441 745		38 895
Роснефть	ROSN	6,550	0,00%	-2,54%	131 000	90 096 980	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	-3,37%	347 000	25 702 914	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	-1,13%	145 000	9 802 920	3 119
Татнефть	TATN	5,200	0,00%	0,00%	104 000		11 329
Транснефть, п.	TRNFP	1350,000	0,00%	-4,51%	135 000	24 824 357	2 099
Электроэнергетика							
Башкирэнерго	BEGY	1,500	0,00%	0,00%	15 000		1 564
Иркутскэнерго	IRGZ	0,709	0,00%	-2,89%		179 065	3 439
Ленэнерго	LSNG	0,523	0,00%	0,45%		71 719	487
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	1,81%	35 093	529 698	2 589
ОГК-2	OGKB	0,039	-8,24%	0,00%	19 500		1 277
ОГК-3	OGKC	0,037	0,00%	-2,60%	5 025	223 315	1 743
ОГК-4	OGKD	0,076	0,00%	0,00%	35 659		4 792
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	-1,58%	38 000	213 688	2 688
ТГК-3	MSNG	0,075	0,00%	-3,98%	163 350	678 425	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	0,27%	8 696	14 380	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-0,47%	52 674	9 289	484
Телекоммуникации							
МГТС, п.	MGTSP	14,625		0,00%	22 668		233
МТС	MTSS	8,360	0,00%	0,00%	25 064		17 275
Ростелеком	RTKM	6,250	0,00%	-1,64%	86 663	71 986 663	18 395
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	0,00%	-0,63%	36 500	3 668 463	886
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	0,06%		1 928	155
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	0,746	0,00%	-3,38%		182 928	1 040
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,245	0,00%	0,06%		18 966	240
КАМАЗ	KMAZ	1,512	0,00%	-4,44%		296 232	1 088
ОМЗ	OMZZ	1,935	0,00%	3,49%		50 360	70
РКК Энергия	RKKE	230,802	0,00%	-1,51%		11 823	251
Северсталь-авто	SVAV	12,857	0,00%	-1,38%	11 134	147 410	441
Силовые машины	SILM	0,245	4,26%	0,00%	12 250		2 134
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	164,000	26,15%	-2,33%	8 200	643 809	1 891
Мечел	MTLR	17,500	0,00%	0,00%	8 750		7 181
ММК	MAGN	0,582	0,00%	-2,53%		2 056 503	6 533
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	-4,24%	39 750	12 759 130	15 882
НорНикель	GMKN	244,000	0,00%	0,45%	244 000	136 112 462	46 513
Полиметалл	PMTL	19,750	0,00%	-1,82%	9 875	4 513 383	7 888
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	0,35%	300 000	4 805 766	11 495
Северсталь	CHMF	15,250	0,00%	-3,01%	53 361	27 909 526	15 116
ТМК	TRMK	2,880	0,00%	0,29%	28 800	1 354 077	2 700
ЧМЗ	CHMZ	5,860	0,00%	0,00%	5 040		92
Банки							
Банк Москвы	MMBM	28,545	0,00%	-0,65%		574	5 166
Возрождение	VZRZ	29,957	0,00%	-1,16%	29 957	711 716	711
ВТБ	VTBR	0,002	0,00%	-2,28%		82 280 964	25 854
РОСБАНК	ROSB	3,326	0,00%	3,58%		14 663	4 017
Сбербанк	SBER	2,725	-3,54%	0,00%	548 000		58 824
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,787	0,00%	-3,62%	44 675	2 250 071	1 985
Дальневосточное МП	FESH	0,370	0,00%	0,00%	18 500		1 092
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	1,64%	5 264	163 152	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	0,98%	15 500	5 600	123
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,350	0,00%	0,00%	10 050		315
Балтика	PKBA	38,432	0,00%	-2,39%		41 633	5 827
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%	1,58%	10 000	65 602	1 216
Концерн Калина	KLNA	50,050	0,00%	-0,19%	80 430	5 597	322
Красный Октябрь	KROT	7,840	0,00%	-8,88%		322	74
Магнит	MGNT	108,000	0,00%	0,94%	324 000	925 231	9 609
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,833	0,00%	-1,80%		3 201	13
Разгуляй	GRAZ	1,260	0,00%	-2,16%	31 500	120 464	199
Фармстандарт	PHST	74,550	0,00%	0,14%	7 455	86 092	2 817
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	-1,83%	24 000	86 966	1 034
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,918	0,00%	-1,67%	68 874	48 243	1 480
Уфанефтехим	UFNC	5,510	0,00%	0,00%	387 900		1 528
Другие сектора							
ПИК	pikk	3,750	0,00%	0,71%	5 003	2 623 609	1 850
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	45,250	0,00%	-2,09%	45 250	574 161	2 158
Дорогобуж	DGBZ	0,560	0,00%	2,80%	16 800	275 890	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	-3,36%	16 950	29 437 047	26 227
Уголь							
Распадская	rasp	4,700	0,00%	-1,06%	18 800	8 120 490	3 670

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	131,040	-3,36%	
Башнефть	AK6		EUR	176,000	3,53%	13,23
ТГК-3	AOMD		USD	7,795	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,510	-2,60%	29 738,15
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,597	-1,74%	14,57
Бурятзолото	BYT		EUR	18,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	22,680	-1,69%	36 510,41
X5	FIVE		USD	33,950	-1,59%	10 376,74
Газпром	GAZ		EUR	8,032	-0,93%	1 610,95
Иркутскэнерго	IRK		EUR	24,000	-4,38%	2,43
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,050	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,500	-1,79%	222 069,30
Лукойл	LUK		EUR	40,820	-0,95%	304,94
МТС	MKY	5	EUR	11,765	2,71%	
МГТС	MOW		EUR	9,100	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,305	0,09%	20,40
НорНикель	NNIA		EUR	16,900	-0,32%	649,99
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	127,000	-3,05%	39 240,44
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,910	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,200	3,33%	
Газпром	OGZD		USD	11,470	-1,97%	385 568,00
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,250	-3,41%	
Ростелеком	RKMD		USD	36,550	-2,82%	3 749,85
Ростелеком	RTL		EUR	25,600	-1,06%	16,52
Газпромнефть	SCF		EUR	14,750	-4,35%	130,01
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,571	-3,77%	13,01
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,324	-1,39%	
АФКСистема	SSA	1	USD	18,340	-2,13%	11 969,26
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	11,400	-0,87%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	27,800	-0,71%	
СТЗ	SVY		EUR	29,330	-0,34%	8,86
ЦУМ	THT		EUR	15,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	30,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	284,660	-0,12%	
ВТБ	VTBR		USD	4,905	-3,16%	128 302,80
Возрождение	VZY		EUR	20,000	-15,61%	2,00

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.