ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

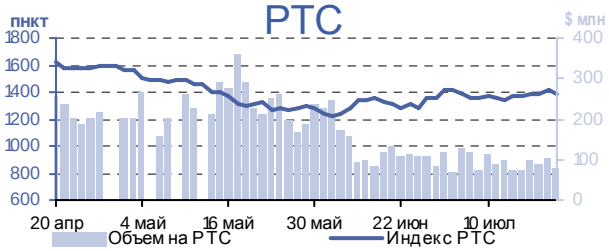
23 июля 2012г.

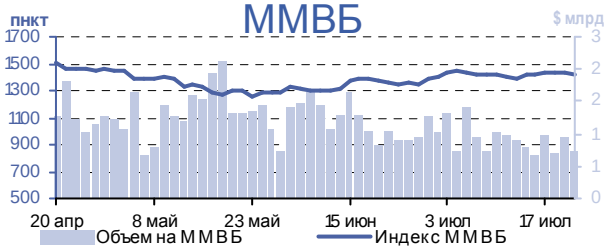
Комментарий по рынку акций

В пятницу мировые фондовые биржи накрыла волна продаж. Хуже остальных чувствовал себя рынок акций Испании, где индекс IBEX рухнул на -5,83% (с начала года -26,5%). Доходность по 10-летним гособлигациям Испании в пятницу взлетела до 7,27% (максимум с момента создания еврозоны) на фоне сообщений о том, что испанский регион Валенсия обратился за финансовой помощью к правительству. Эти факторы обвалили курс евро/доллар к отметке 1,21 – новый 25-месячный минимум. Через усиление позиций доллара и кризиса на фондовых биржах мы видели снижение цен на рынке сырья: Brent $105,5/барр; медь $7495/т; никель $15750/т – минимум более, чем за 2 года. Все

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



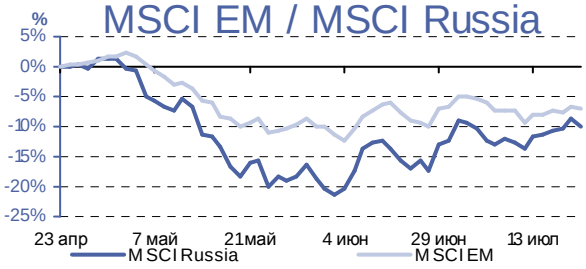


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 391,55	-1,59%	1,67%	8,56%	-29,45%
Индекс ММВБ	1 415,38	-1,33%	-0,08%	5,06%	-18,14%
FTSE	5 651,77	-1,09%	-0,25%	2,50%	-4,21%

Главные новости

- Поставит ли крест на секторе электроэнергетике экономический совет при президенте



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	936,87	-0,45%	2,15%	-18,05%
Индекс MSCI BRAZIL	2557,45	-1,41%	1,44%	-27,44%
Индекс MSCI RUSSIA	749,73	-1,55%	8,46%	-27,71%
Индекс MSCI INDIA	371,70	-0,71%	4,59%	-25,66%
Индекс MSCI CHINA	53,65	0,48%	1,76%	-16,91%

Обзор рынка

В пятницу мировые фондовые биржи накрыла волна продаж. Хуже остальных чувствовал себя рынок акций Испании, где индекс IBEX рухнул на -5,83% (с начала года -26,5%). Доходность по 10-летним гособлигациям Испании в пятницу взлетела до 7,27% (максимум с момента создания еврозоны) на фоне сообщений о том, что испанский регион Валенсия обратился за финансовой помощью к правительству. Эти факторы обвалили курс евро/доллар к отметке 1,21 – новый 25-месячный минимум. Через усиление позиций доллара и кризиса на фондовых биржах мы видели снижение цен на рынке сырья: Brent $105,5/барр; медь $7495/т; никель $15750/т – минимум более, чем за 2 года. Все эти факторы вызвали в понедельник утром продажи на азиатских биржах: MSCI Asia -2,5%.

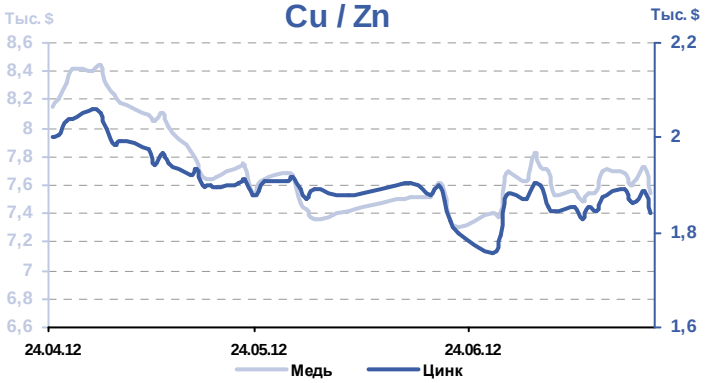
В четверг российские фондовые индексы нарисовали недельный максимум и развернулись вниз. В пятницу снижение было продолжено. В понедельник внешний фон опять сулит нам торговлю в красной зоне. Таким образом, в начале этой недели индекс ММВБ имеет все шансы, чтобы вернуться к нижней границе своего широкого бокового тренда: 1450 – 1390 п. Если неделей ранее мы открывали торги с позитивными настроениями и продолжали рост благодаря внешнему позитиву, то сейчас наш рынок акций переставят на более низкие уровни. После открытия индекс ММВБ придет на ретест уровня поддержки на 1400 п. Соответственно фьючерс РТС сегодня стоит ловить возле отметки 136500 п., где проходит наклонная поддержка растущего тренда. Сопротивление сместилось на уровень 138 тыс. п. С учетом того, что сегодня продажи на рынках будут преобладать, спешить с покупками не стоит. Сильных продаж в пятницу на ММВБ мы не видели, поэтому и сегодня агрессивного движения вниз мы не ждем. Но все же лучше повременить с покупками до вторника или среды.

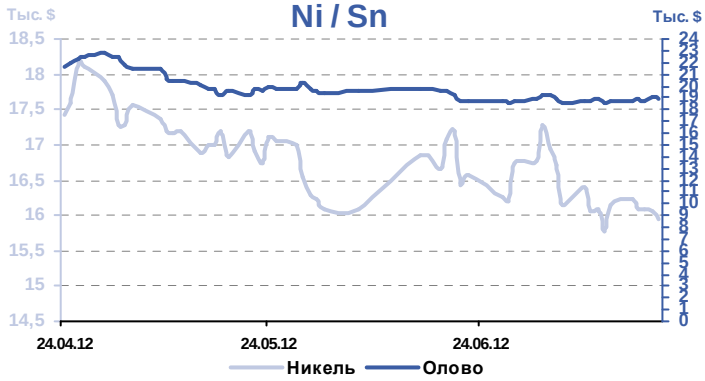
Сегодня в 16-30 ФРБ Чикаго опубликует индекс национальной экономической активности в США за июнь. В понедельник до открытия торгов NYSE квартальную отчетность представят: Coca-Cola, Halliburton, McDonald's; после торгов отчитывается - Texas Instruments.

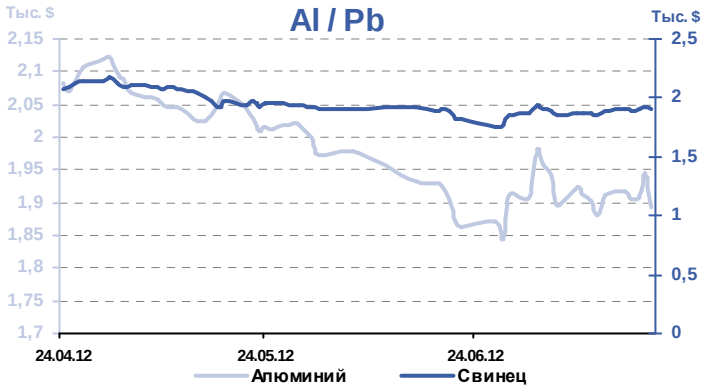
Электроэнергетика

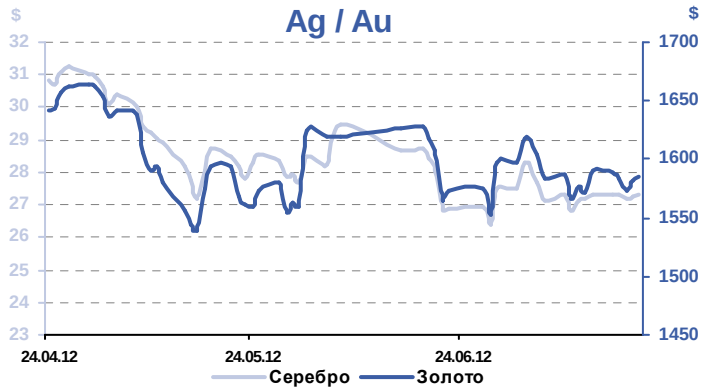
Как сообщает сегодня газета «Ведомости», сегодня состоится первое заседание экономического совета при президенте РФ, которое будет посвящено мерам, помогающим бизнесу противостоять кризису. Вероятно, одной из таких мер может стать установление максимального порога ежегодной индексации тарифов естественных монополий на уровне 4%. Никакие дополнительные подробности не приводятся, но известно, что упомянутая инициатива пока не согласована с правительством.
Мы считаем, что в случае принятия такого решения, которое, как мы считаем маловероятно, можно будет говорить о по сути смерти генераторов, так как сетевые тарифы уже приняты в основном. Так, на фоне роста тарифов на газ и соответственно электричество достигнуть таких показателей можно будет только за счет планомерного снижения тарифов на мощность и пересмотра ДПМ-соглашений.

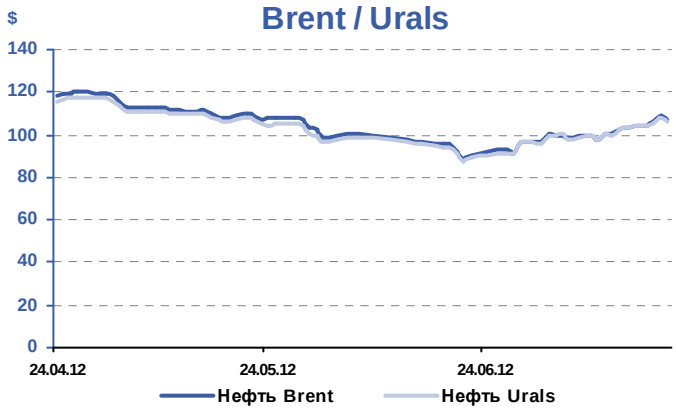
Commodities

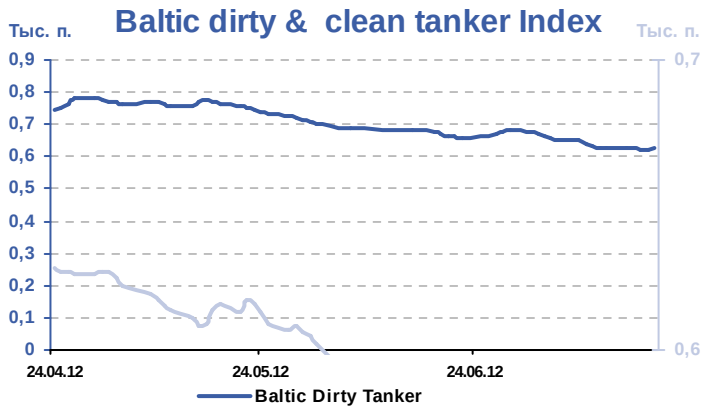












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 545,00	-2,39%	-2,01%	3,21%	-22,06%
Цинк, $/t	1 839,50	-2,49%	-1,84%	2,19%	-24,92%
Никель, $/t	15 950,00	-0,65%	-1,27%	-3,77%	-33,40%
Олово, $/t	18 930,00	-0,86%	0,80%	1,37%	-33,11%
Алюминий, $/t	1 892,00	-2,67%	-0,94%	1,61%	-25,51%
Свинец, $/t	1 901,00	-1,48%	1,12%	4,68%	-29,59%
Серебро, $/oz	27,31	0,24%	-0,05%	1,49%	-30,70%
Золото, $/oz	1 584,50	0,19%	-0,33%	0,77%	-0,39%
Нефть Brent, $/	107,33	-1,39%	4,59%	18,77%	-8,77%
Нефть Urals, $/	106,47	-1,62%	4,25%	19,70%	-8,24%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,360	0,00%	0,00%	236 023		35 396
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	50,000	0,00%	0,00%	45 000		8 508
Газпром	GAZP	4,880	0,00%	0,00%	244 000		115 527
Лукойл	LKOH	57,450	0,00%	0,00%	287 250		48 865
Татнефть	TATN	6,100	0,00%	0,00%	610 000		13 290
Татнефть, п.	TATNP	2,695	0,00%	0,00%	212 873		397
Транснефть, п.	TRNFP	1470,770	0,00%	0,00%	16 178		2 287
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	25,100	0,00%	0,00%	5 020		465
Северсталь-авто	SVAV	14,000	0,00%	0,00%	7 000		470
Металлургия							
Мечел	MTLR	5,966	0,00%	0,00%	20 881		2 483
Северсталь	CHMF	11,978	0,00%	0,00%	20 710		12 070
Банки							
Сбербанк	SBER	2,895	0,00%	0,00%	865 400		62 494
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,320	0,00%	0,00%	13 200		1 466
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	45,500	0,00%	0,00%	166 530		7 102
Верофарм	VRPH	26,190	0,00%	0,00%	52 380		262
Дикси	DIXY	10,000	0,00%	0,00%	100 000		1 248
Магнит	MGNT	110,000	0,00%	0,00%	55 000		10 402
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,900	0,00%	0,00%	45 000		1 450
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,350	0,00%	0,00%	211 428		1 595
Дорогобуж	DGBZ	0,460	0,00%	0,00%	46 000		332
Уголь							
Распадская	rasp	2,540	0,00%	0,00%	75 800		1 983

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	108,506	0,31%	
Башнефть	AK6		EUR	198,000	-1,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,370	-5,61%	0,05
ТГК-3	AOMD		USD	4,100	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	37,000	-2,37%	11 704,49
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,022	-0,98%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	20,700	-2,86%	45 985,10
Газпром	GAZ		EUR	7,791	-2,39%	967,74
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,018	0,00%	0,04
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,550	3,33%	4,55
Лукойл	LKOD		USD	56,300	-1,31%	98 018,30
Лукойл	LUK		EUR	46,000	-0,65%	480,28
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,120	-1,42%	1 388,79
МТС	MBT	5	USD	18,210	-0,22%	29 669,95
МТС	MKY	5	EUR	14,980	1,35%	43,82
ТГК-3	MRO		EUR	3,400	3,00%	
Мечел	MTL	3	USD	5,800	-4,45%	10 993,04
НорНикель	NILSY	1	USD	15,860	-1,06%	432,27
НорНикель	NNIA		EUR	13,045	-0,38%	13,92
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	118,700	0,25%	60 262,72
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,750	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	9,540	-1,90%	165 210,80
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	22,080	-1,65%	315,86
Ростелеком	RTL		EUR	18,125	-0,82%	9,96
Газпромнефть	SCF		EUR	19,405	-2,34%	10,73
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,709	-3,76%	40,07
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,700	-0,28%	16,63
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,630	-5,54%	1 042,36
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,450	-2,87%	15,91
АФКСистема	SSA	1	USD	20,200	-0,05%	4 999,08
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,881	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,315	-0,64%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	101,000	-5,61%	3,10
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,510	-2,41%	13 226,09
ВТБ	VTBR		USD	3,333	-2,69%	63 636,96
Возрождение	VZY		EUR	16,000	36,17%	8,13

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

Наумов Александр
электроэнергетика

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Бохин Александр
abokhin@prsp.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Сильвестров Кирилл
ksilvestrov@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 ОАО "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.