ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

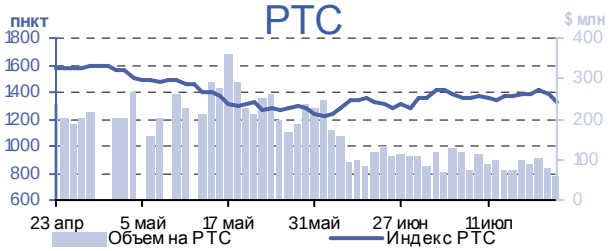
24 июля 2012г.

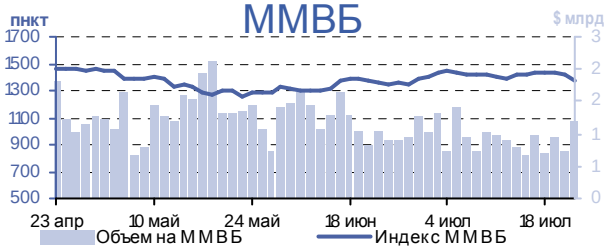
Комментарий по рынку акций

В понедельник все европейские биржи провели в зоне агрессивного падения (EURO STOXX -2,6%). Фондовые индексы США также понесли потери, однако заокеанские инвесторы сумели выкупить почти половину первоначальной просадки в своих индексах. Просадка фондовых бирж началась после шумихи в СМИ о том, что Испании может потребоваться дополнительный пакет финансовой помощи, а МВФ может отказаться от дальнейшего финансирования программы спасения Греции. На этом фоне стоимость страховки от дефолта (CDS) по ряду европейских стран выросла, в то время, как доходность по испанским 10-летним гособлигациям в понедельник взлетела

Полный текст на 2 стр.

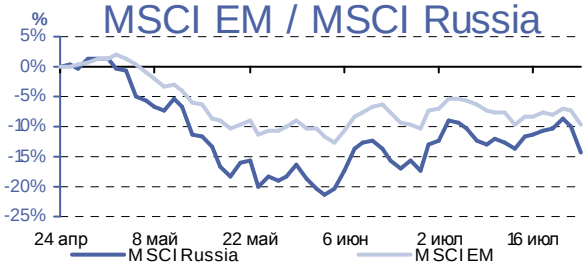
Основные индикаторы





Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 323,96	-4,86%	-3,64%	3,28%	-33,12%
Индекс ММВБ	1 372,97	-3,00%	-3,45%	1,92%	-20,50%
FTSE	5 533,87	-2,09%	-2,27%	0,37%	-6,61%
S&P 500	1 350,52	-0,89%	-0,23%	1,16%	0,98%
Dow Jones Avg.	12 721,46	-0,79%	-0,05%	0,64%	1,02%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	12,5000	-10,71%	11,61%	-2,77%
Сбербанк	2,6400	-8,81%	13,30%	2,33%
Газпром	4,6000	-5,74%	2,68%	-12,71%
Лукойл	55,1500	-4,00%	2,80%	-3,08%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	912,47	-2,60%	-0,51%	-20,53%
Индекс MSCI BRAZIL	2494,34	-2,47%	-1,06%	-29,73%
Индекс MSCI RUSSIA	713,63	-4,82%	3,24%	-31,02%
Индекс MSCI INDIA	361,03	-2,87%	1,59%	-29,57%
Индекс MSCI CHINA	52,22	-2,66%	-0,95%	-19,83%

Обзор рынка

В понедельник все европейские биржи провели в зоне агрессивного падения (EURO STOXX -2,6%). Фондовые индексы США также понесли потери, однако заокеанские инвесторы сумели выкупить почти половину первоначальной просадки в своих индексах. Просадка фондовых бирж началась после шумихи в СМИ о том, что Испании может потребоваться дополнительный пакет финансовой помощи, а МВФ может отказаться от дальнейшего финансирования программы спасения Греции. На этом фоне стоимость страховки от дефолта (CDS) по ряду европейских стран выросла, в то время, как доходность по испанским 10-летним гособлигациям в понедельник взлетела почти до 7,5% - максимум с момента образования зоны евро.

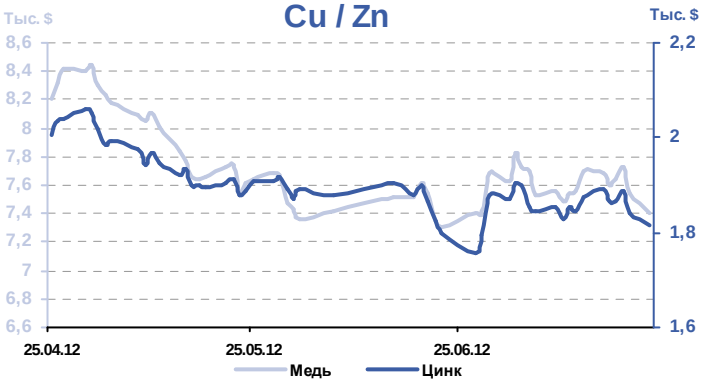
В итоге страхов на рынке оказалось больше, чем реальной опасности, а рост стоимости госдолга стал результатом биржевых спекуляций. Поскольку вчера не выходило никакой новой макроэкономической статистики, а часть публикаций в СМИ уже дезавуирована (МВФ подтвердил свою поддержку Греции в процессе выхода из экономического кризиса), следовательно, в ближайшие дни фондовые рынки Европы должны успокоиться и компенсировать понесенные потери.

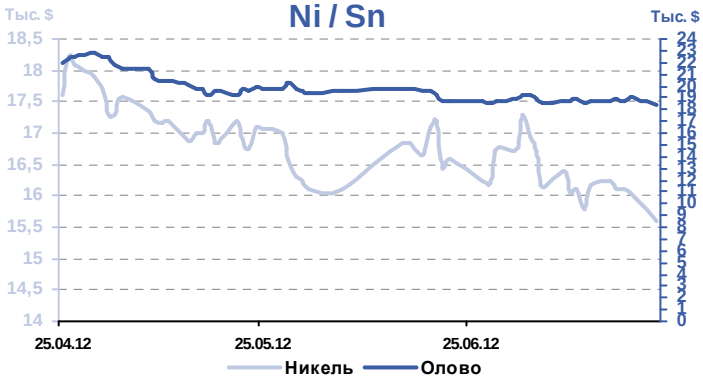
Индекс ММВБ завершил торговую сессию в понедельник сильным движением вниз. Обычно такие падения одномоментно не останавливаются, и сегодня мы продолжим «утаптывать» уровни поддержки. Думаю, сегодня днем индекс ММВБ сумеет обновить вчерашний минимум, но, похоже, что это снижение будет не долгим и после вчерашнего ударного дня вниз, сегодня рынок войдет в фазу консолидации. На сегодня движения индекса ММВБ мы видим с границами: 1365 п. - снизу и 1390 п. - сверху. Вчерашнее падение индекса РТС и фьючерса (RIU) было обусловлено ростом стоимости контракта на доллар/рубль (Si). На фоне консолидации EUR/USD возле 1,2120 и цен на нефть Brent выше $103,5/барр движение Si существенно выше 33 тыс. п. будет затруднено. Соответственно по фьючерсу РТС ближайшая сильная поддержка находится на 130500 п., сопротивление – на 134200 п.

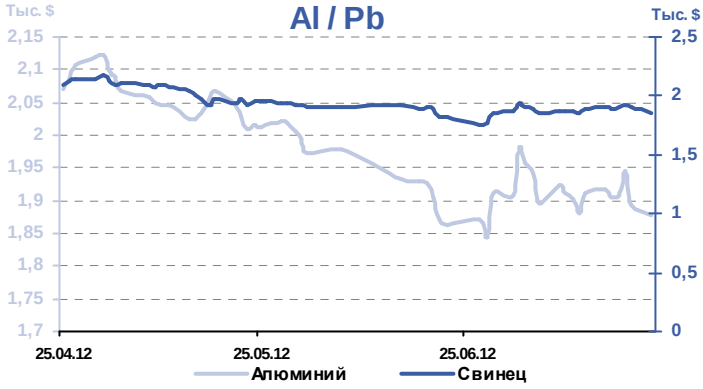
Новости, которые сегодня будут влиять на рыночные настроения. Китайский индекс PMI от банка HSBC в июле вырос до 49,5 п. против 48,2 п. в июне; индекс потребительского доверия Conference Board в июне поднялся на +0,1% до 234,9 п. Из негатива: агентство Moody's понизило прогноз по рейтингам Германии, Нидерландов и Люксембурга со Стабильного до Негативного.

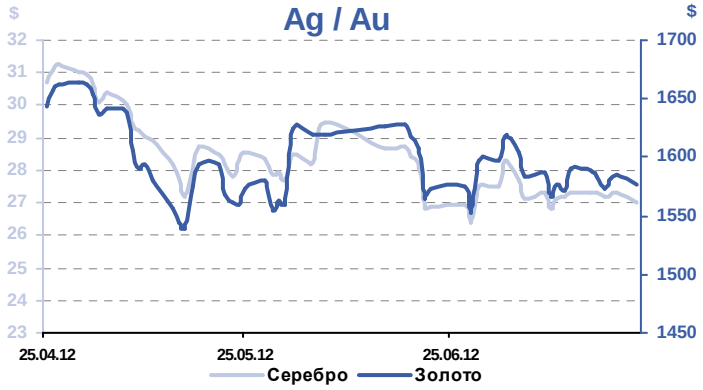
Компания Магнит сегодня опубликует финансовые результаты по МСФО за II квартал и I полугодие 2012 года. Днем внимание обращаем на индексы деловой активности в промышленности и сфере услуг Франции, Германии и еврозоны. В 18-00 ждем данных из США по индексу деловой активности ФРБ Ричмонда за июль.

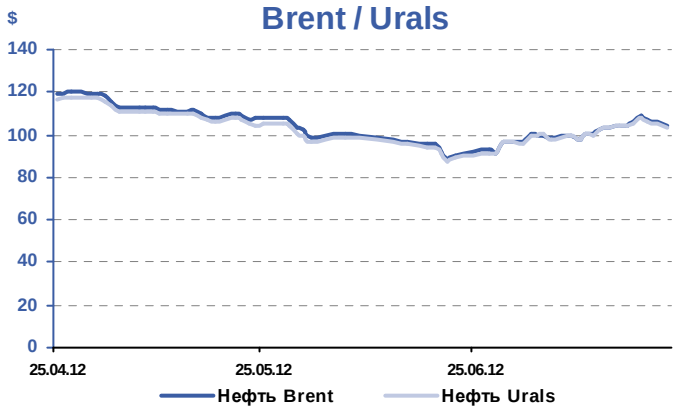
Commodities

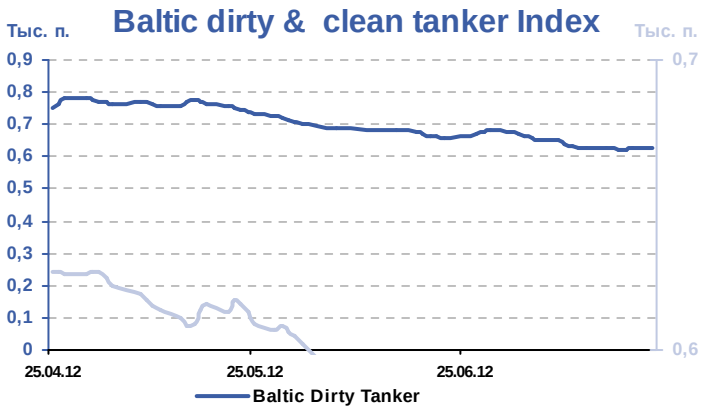












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 401,00	-1,91%	-3,65%	1,24%	-23,35%
Цинк, $/t	1 814,00	-1,39%	-4,02%	0,78%	-26,56%
Никель, $/t	15 600,00	-2,19%	-3,85%	-5,88%	-34,45%
Олово, $/t	18 350,00	-3,06%	-2,13%	-1,74%	-34,81%
Алюминий, $/t	1 878,00	-0,74%	-2,06%	0,86%	-28,32%
Свинец, $/t	1 860,00	-2,16%	-2,11%	2,42%	-30,47%
Серебро, $/oz	27,04	-1,01%	-1,09%	0,46%	-32,99%
Золото, $/oz	1 576,95	-0,48%	-0,78%	0,29%	-2,30%
Нефть Brent, $/	104,24	-2,88%	-0,15%	15,35%	-11,25%
Нефть Urals, $/	103,11	-3,16%	-1,19%	15,92%	-11,19%

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	4,600	-5,74%	0,00%	461 500		108 898
Лукойл	LKOH	55,150	-4,00%	0,00%	275 750		46 909
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	12,500	-10,71%	0,00%	12 500		428
Металлургия							
Мечел	MTLR	5,500	-7,81%	0,00%	19 250		2 289
Северсталь	CHMF	11,978	0,00%	0,00%	20 710		12 070
Банки							
Сбербанк	SBER	2,640	-8,81%	0,00%	3 018 987		56 990
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							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,095		0,00%	16 725		170
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	106,055	-2,26%	
Башнефть	AK6		EUR	185,190	-6,47%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,370	0,00%	2,17
ТГК-3	AOMD		USD	4,100	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	34,560	-6,59%	15 668,46
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,952	-3,46%	4,69
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,001	-66,67%	
X5	FIVE		USD	20,060	-3,09%	39 911,53
Газпром	GAZ		EUR	7,503	-3,70%	1 857,59
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,015	-16,67%	1,26
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,550	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	55,200	-1,95%	203 650,40
Лукойл	LUK		EUR	45,260	-1,61%	589,69
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,051	-1,90%	1 718,20
МТС	MBT	5	USD	17,710	-2,75%	34 217,78
МТС	MKY	5	EUR	14,525	-3,04%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,350	-1,47%	78,90
Мечел	MTL	3	USD	5,760	-0,69%	18 408,97
НорНикель	NILSY	1	USD	15,231	-3,97%	913,03
НорНикель	NNIA		EUR	12,520	-4,02%	19,14
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	112,700	-5,05%	47 932,66
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,750	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	9,070	-4,93%	212 794,00
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	20,730	-6,11%	1 849,73
Ростелеком	RTL		EUR	17,000	-6,21%	3,00
Газпромнефть	SCF		EUR	18,670	-3,79%	155,07
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,551	-2,36%	18,16
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,324	-8,00%	2,50
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,450	-3,20%	13,06
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,000	-5,33%	31,99
АФКСистема	SSA	1	USD	19,780	-2,08%	10 847,20
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	-1,07%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,300	-0,65%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	95,460	-5,49%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	7,930	-6,82%	41 111,73
ВТБ	VTBR		USD	3,133	-6,00%	57 892,44
Возрождение	VZY		EUR	16,000	0,00%	0,16

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.