ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

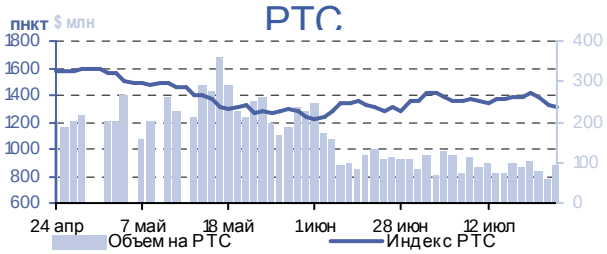
25 июля 2012г.

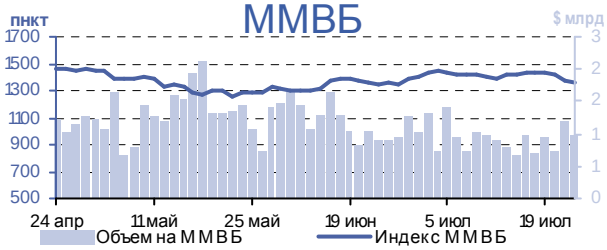
Комментарий по рынку акций

В ходе вечерней сессии фьючерс РТС показал снижение на 1,2%, опустился до минимальных отметок с начала месяца (128 тыс. п.). Это движение вниз проходило под аккомпанемент очередного закрытия торгов на Уолл-стрит в красной зоне (S&P-500 -0,9%). Заокеанских инвесторов опять не смогла утешить ситуация на долговом рынке Европы (доходности по итальянским и испанским облигациям достигли новых максимумов). Макроэкономические данные по США также оказались негативными (в июле в регионе, контролируемым ФБР Ричмонда, который формирует около 9% ВВП США, индекс производственной активности упал до -17 п.). Наконец, слабая

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



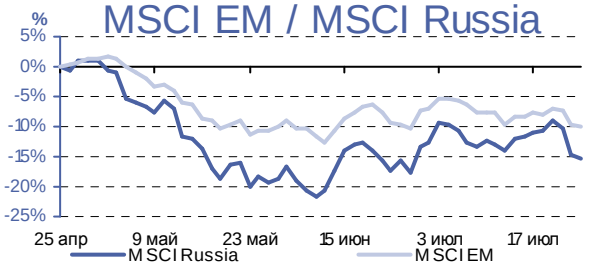


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 314,27	-0,73%	-4,90%	2,53%	-33,61%
Индекс ММВБ	1 365,75	-0,53%	-4,50%	1,38%	-20,91%
FTSE	5 499,23	-0,63%	-2,31%	-0,26%	-7,19%
S&P 500	1 338,31	-0,90%	-1,86%	0,25%	0,07%
Dow Jones Avg.	12 617,32	-0,82%	-1,47%	-0,19%	0,19%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Магнит	121,4500	10,41%	19,07%	18,49%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Газпром	4,4900	-2,39%	0,22%	-7,23%
Дикси	9,8600	-1,40%	6,94%	-1,40%
Сбербанк	2,6070	-1,25%	11,89%	9,54%
Лукойл	55,0000	-0,27%	2,52%	8,91%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	909,43	-0,33%	-0,84%	-20,79%
Индекс MSCI BRAZIL	2478,90	-0,62%	-1,68%	-30,16%
Индекс MSCI RUSSIA	709,43	-0,59%	2,63%	-31,43%
Индекс MSCI INDIA	360,55	-0,13%	1,45%	-29,66%
Индекс MSCI CHINA	51,94	-0,54%	-1,49%	-20,27%

Обзор рынка

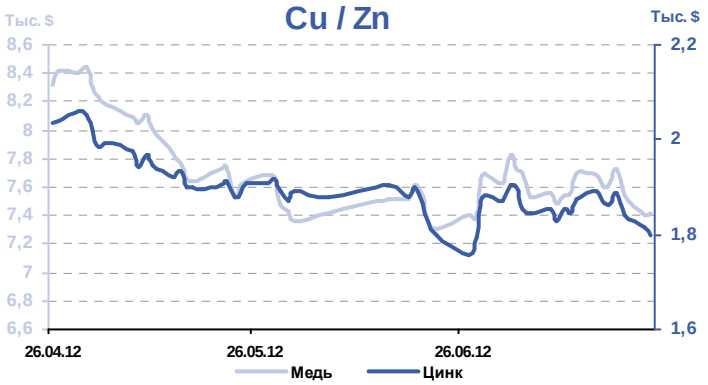
В ходе вечерней сессии фьючерс РТС показал снижение на 1,2%, опустился до минимальных отметок с начала месяца (128 тыс. п.). Это движение вниз проходило под аккомпанемент очередного закрытия торгов на Уолл-стрит в красной зоне (S&P-500 -0,9%). За океанских инвесторов опять не смогла утешить ситуация на долговом рынке Европы (доходности по итальянским и испанским облигациям достигли новых максимумов). Макроэкономические данные по США также оказались негативными (в июле в регионе, контролируемым ФБР Ричмонда, который формирует около 9% ВВП США, индекс производственной активности упал до -17 п.). Наконец, слабая отчетность и прогнозы компаний (AT&T, DuPont, UPS) довершили «медвежьи» тенденции на рынке акций. Пережевывание в СМИ старой жвачки на счет возможных мер монетарного стимулирования со стороны ФРС смогло остановить американские индексы возле минимальных отметок двухнедельной давности.

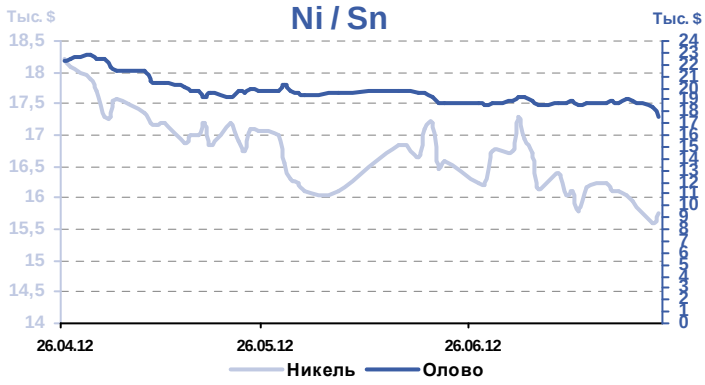
После завершения торгов квартальную отчетность представила корпорация Apple, прибыль ($8,82 млрд.) и объемы продаж ($35 млрд.) которой не оправдали ожиданий рынка. Общие продажи смартфонов iPhone упали почти на четверть по сравнению с предыдущим кварталом. В результате акции Apple на постмаркете падают на -6,5%. Это создает негативный настрой по индексам Nasdaq и S&P-500 на предстоящие торги, в связи с высокой долей веса акций Apple в их структурах.

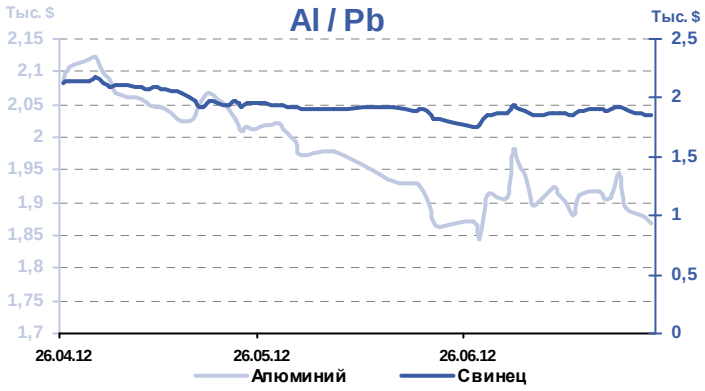
Таким образом, в среду торги на наших биржах начнутся с продаж. Еще накануне наши индексы под занавес сессии нарисовали неприятное движение вниз, завершив сессию возле минимальных дневных отметок. Отсутствие позитивных сдвигов на долговом рынке еврозоне, снижение темпов экономической активности в Штатах и Китае не создает спрос на рисковые активы. Это оказывает негативное влияние на сырьевые цены, на рынки акций развивающихся стран и их валюты. Кстати, накануне ЦБ РФ объявил о расширении коридора бивалютной корзины до 7 руб. и теперь его границы находятся на 31,65 руб. и 38,65 руб. Вчера на нашем рынке был день консолидации, однако объем открытого интереса по фьючерсу РТС рос (+40 тыс. контрактов). Не хотелось бы, чтобы этот набор позиций был предвестником нового обвала рынка. Слабое закрытие акций Газпрома подразумевает их дальнейшее сползание к рубежу 143-144 руб. Аналогично бумаги Роснефти могут вернуться на 196 руб., а Сбербанк на 83,5 руб.

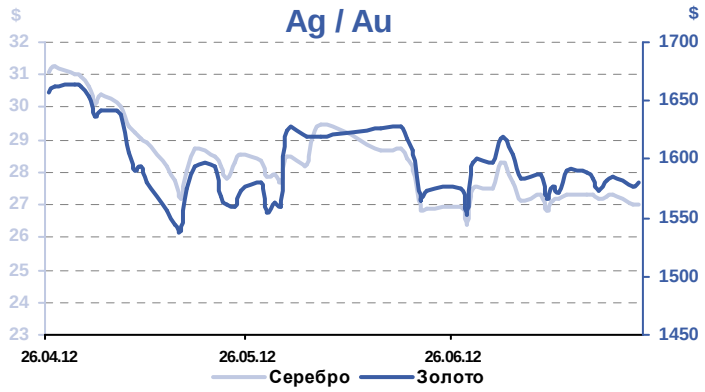
Сегодня в 12-00 в Германии выходит индекс делового оптимизма IFO за июль. Возможно, сегодня мы получим свидетельство того, что экономические проблемы периферийных стран Европе постепенно распространяются и на Германию. В 12-30 Великобритания опубликует предварительные данные по ВВП за II квартал. В 18-00 в США выходят данные по продажам новых домов за июнь. В 18-30 выходит недельная статистика по запасам нефти от Минэнерго США.

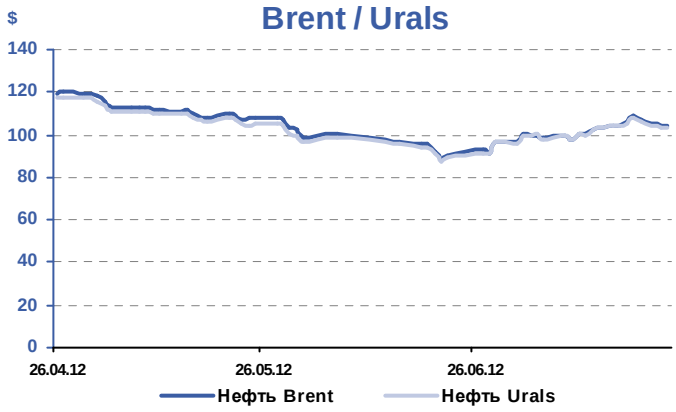
Commodities

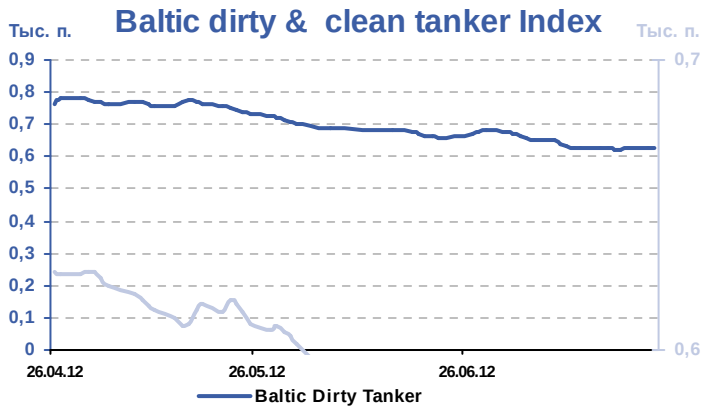












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 417,00	0,22%	-2,34%	1,46%	-23,18%
Цинк, $/t	1 797,00	-0,94%	-3,65%	-0,17%	-27,25%
Никель, $/t	15 750,00	0,96%	-2,17%	-4,98%	-33,82%
Олово, $/t	17 530,00	-4,47%	-7,22%	-6,13%	-37,73%
Алюминий, $/t	1 869,00	-0,48%	-1,84%	0,38%	-28,66%
Свинец, $/t	1 860,00	0,00%	-1,80%	2,42%	-30,47%
Серебро, $/oz	26,99	-0,19%	-1,22%	0,27%	-33,12%
Золото, $/oz	1 580,95	0,25%	-0,15%	0,54%	-2,06%
Нефть Brent, $/	104,11	-0,12%	-0,53%	15,20%	-11,36%
Нефть Urals, $/	103,29	0,17%	-1,06%	16,12%	-11,03%

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	4,490	-2,39%	0,00%	451 000		106 294
Лукойл	LKOH	55,000	-0,27%	0,00%	275 000		46 781
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	0,00%	0,00%	12 500		428
Металлургия							
Мечел	MTLR	5,500	0,00%	0,00%	19 250		2 289
Северсталь	CHMF	11,978	0,00%	0,00%	20 710		12 070
Банки							
Сбербанк	SBER	2,607	-1,25%	0,00%	3 220 025		56 277
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	9,860	-1,40%	0,00%	29 284		1 230
Магнит	MGNT	121,450	10,41%	0,00%	121 450		11 484
Фармстандарт	PHST	40,000		0,00%	20 000		1 512
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,095	0,00%	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	105,880	-0,17%	
Башнефть	AK6		EUR	187,000	0,98%	
ТГК-3	AOMD		USD	4,100	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	34,420	-0,41%	8 169,40
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,950	-0,10%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	100,00%	
X5	FIVE		USD	20,520	2,29%	11 793,87
Газпром	GAZ		EUR	7,307	-2,61%	994,60
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	-3,23%	
Лукойл	LKOD		USD	54,950	-0,45%	142 975,70
Лукойл	LUK		EUR	45,320	0,13%	118,22
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,330	-1,31%	3 289,60
МТС	MBT	5	USD	17,700	-0,06%	26 325,15
МТС	MKY	5	EUR	14,550	0,17%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,200	-4,48%	6,88
Мечел	MTL	3	USD	5,350	-7,12%	13 896,56
НорНикель	NILSY	1	USD	15,000	-1,52%	635,39
НорНикель	NNIA		EUR	12,410	-0,88%	
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	113,200	0,44%	37 980,26
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,750	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	8,900	-1,87%	265 355,40
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	20,820	0,43%	41,45
Ростелеком	RTL		EUR	17,250	1,47%	2,51
Газпромнефть	SCF		EUR	18,595	-0,40%	29,10
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,322	-3,50%	47,68
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,481	3,63%	3,63
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,550	1,83%	16,65
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,860	-1,75%	74,67
АФКСистема	SSA	1	USD	19,730	-0,25%	4 626,58
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,286	-0,61%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	92,000	-3,62%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	7,830	-1,26%	26 554,29
ВТБ	VTBR		USD	3,120	-0,41%	40 122,62
Возрождение	VZY		EUR	16,000	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

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.