ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

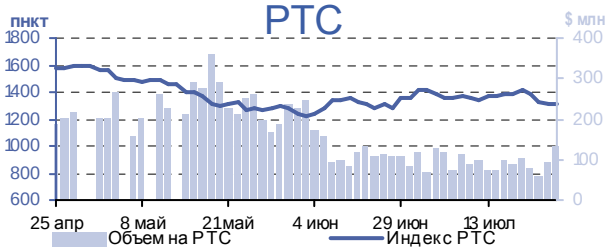
26 июля 2012г.

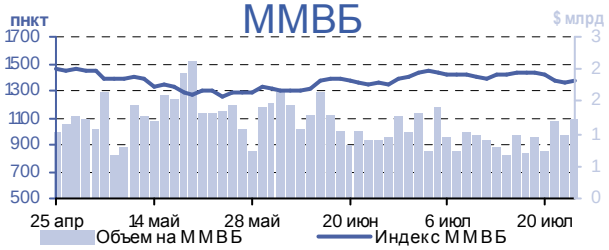
Комментарий по рынку акций

Уже два дня российский рынок акций стоит на месте. В биржевых индикаторах наблюдается высокая волатильность в узком торговом диапазоне: вчера индекс ММВБ обновил как минимум (1355 п.), так и максимум (1385 п.) вторника, но так и не сумел сформировать отчетливое движение по тренду. Закрытие наших торгов в среду проходило на минорной ноте, когда рынки на Уолл-стрит и цены на нефть были на своих внутридневных минимумах. С учетом того, что котировки Brent к утру четверга восстановились до $104/барр, азиатские биржи сегодня преимущественно смотрят наверх (MSCI Asia +0,7%), а индекс S&P-500 вчера не стал обновлять минимум недели, у нас сегодня

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



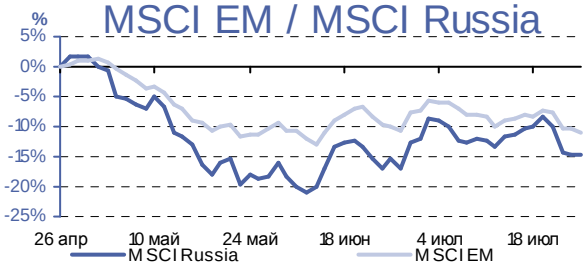


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 318,31	0,31%	-5,20%	2,84%	-33,68%
Индекс ММВБ	1 367,67	0,14%	-4,11%	1,52%	-20,58%
FTSE	5 498,32	-0,02%	-3,30%	-0,28%	-7,28%
S&P 500	1 337,89	-0,03%	-2,54%	0,21%	0,45%
Dow Jones Avg.	12 676,05	0,47%	-1,80%	0,28%	1,40%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	14,0000	12,00%	25,00%	8,89%
Магнит	129,2000	6,38%	26,67%	44,36%
Сбербанк	2,6230	0,61%	12,58%	24,90%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	905,65	-0,42%	-1,26%	-21,69%
Индекс MSCI BRAZIL	2482,56	0,15%	-1,53%	-30,10%
Индекс MSCI RUSSIA	710,15	0,10%	2,74%	-31,87%
Индекс MSCI INDIA	358,84	-0,47%	0,97%	-29,22%
Индекс MSCI CHINA	51,74	-0,38%	-1,86%	-21,70%

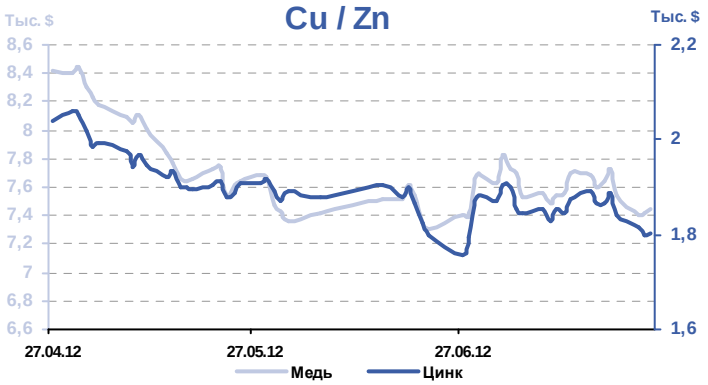
Обзор рынка

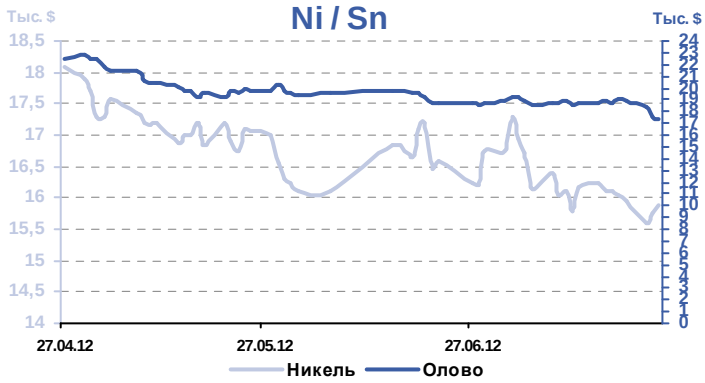
Уже два дня российский рынок акций стоит на месте. В биржевых индикаторах наблюдается высокая волатильность в узком торговом диапазоне: вчера индекс ММВБ обновил как минимум (1355 п.), так и максимум (1385 п.) вторника, но так и не сумел сформировать отчетливое движение по тренду. Закрытие наших торгов в среду проходило на минорной ноте, когда рынки на Уолл-стрит и цены на нефть были на своих внутридневных минимумах. С учетом того, что котировки Brent к утру четверга восстановились до $104/барр, азиатские биржи сегодня преимущественно смотрят наверх (MSCI Asia +0,7%), а индекс S&P-500 вчера не стал обновлять минимум недели, у нас сегодня больше шансов увидеть движение вверх. Снижение доходностей по облигациям периферийных стран Европы не дает поводов к давлению на акции европейского банковского сектора.

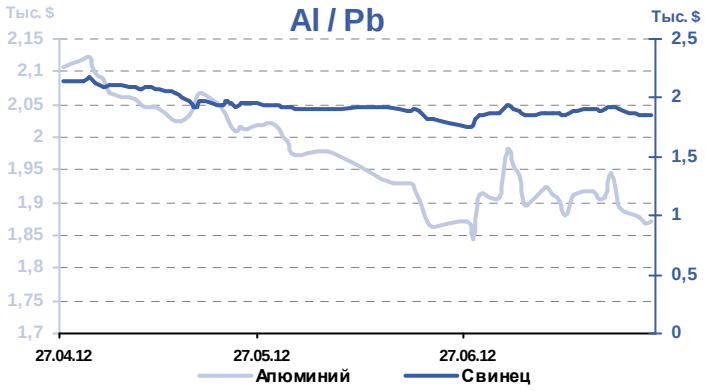
Возможно та волатильность и «утаптывание» минимумов, которое мы видели в последние два дня, являются сигналом к окончанию недельной волны снижения. Если по итогам четверга индексу ММВБ удастся закрепиться выше уровня 1385 п. (фьючерсу РТС выше 133 тыс. п.), то думаю, рынок сформирует движение вверх, которое может продлиться до конца месяца. Не думаю, что сегодня западные инвесторы начнут избавляться от рискованных активов, не увидев пятничных данных по ВВП США за II квартал. Поведение AUD/USD (1,0335) также указывает в пользу сценария коррекционного роста в четверг. Поведение цен на золото ($1605/барр) также указывает на «бычьи» ожидания игроков. Закрепившись выше рубежа 1385 п. индекс ММВБ получит шанс вернуться к отметке 1415 п. Стабилизация цен на рынке энергоносителей снизит давление на акции наших нефтяных компаний, а через укрепление курса рубля будут неплохо себя чувствовать акции банков.

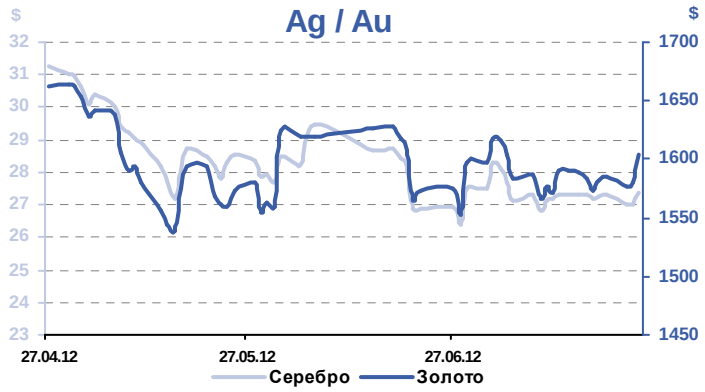
Сегодня в 12-00 в еврозоне выходят данные по объемам потребительского кредитования за июнь. В 13-10 Минфин Италии проводит аукцион по продаже 2-летних облигаций на сумму 1,5-2,5 млрд евро. Очень интересно, повлияет ли на него понижение рейтинга Италии агентством Egan Jones до «мусорного» уровня CCC+. В четверг в Ланкастер-хаусе пройдет глобальная инвестиционная конференция, на которой выступят глава МВФ Кристин Лагард, руководитель Банка Англии Мервин Кинг, а также глава ЕЦБ Марио Драги. До начала торгов на Уолл-стрит квартальные отчеты представят компании 3M, Dow Chemical, Exxon Mobil. В 16-30 из США ждем еженедельных данных по числу обращений за пособием по безработице, а также данных по объемам заказов на товары длительного пользования за июнь. В 18-00 выходят данные по незавершенным продажам домов на вторичном рынке недвижимости США. В 19-00 ФРБ Канзас-Сити опубликует данные индекса деловой активности в производственном секторе своего региона.

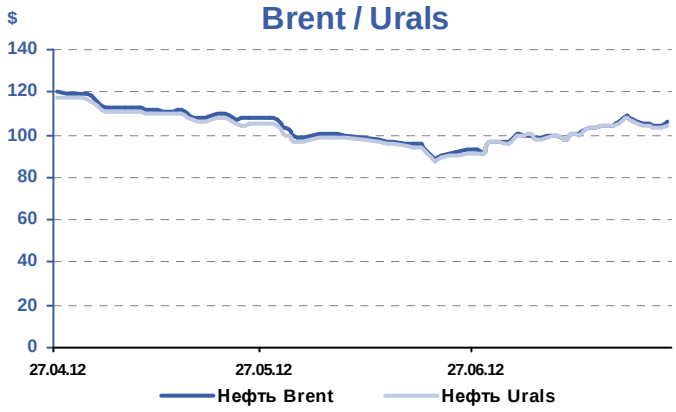
Commodities

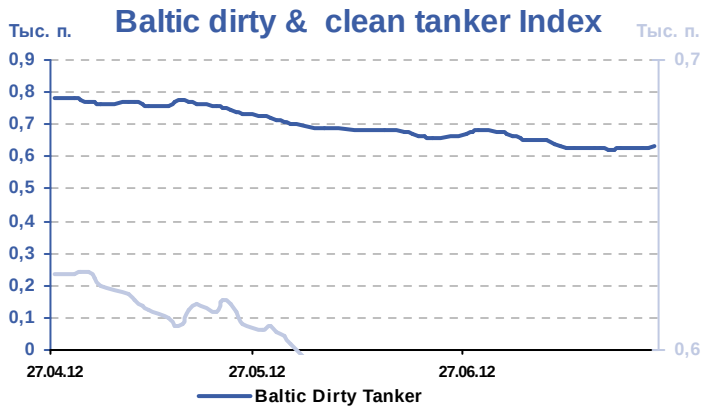












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 446,00	0,39%	-2,50%	1,86%	-24,18%
Цинк, $/t	1 801,00	0,22%	-3,59%	0,06%	-28,84%
Никель, $/t	15 875,00	0,79%	-1,40%	-4,22%	-34,13%
Олово, $/t	17 345,00	-1,06%	-7,74%	-7,12%	-39,35%
Алюминий, $/t	1 870,00	0,05%	-2,04%	0,43%	-29,43%
Свинец, $/t	1 855,00	-0,27%	-2,88%	2,15%	-31,80%
Серебро, $/oz	27,36	1,39%	0,63%	1,66%	-33,06%
Золото, $/oz	1 604,45	1,49%	1,97%	2,04%	-0,92%
Нефть Brent, $/	105,84	1,66%	-0,68%	17,12%	-10,11%
Нефть Urals, $/	104,28	0,96%	-1,33%	17,23%	-10,80%

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	0,00%	0,00%	451 000		106 294
Лукойл	LKOH	55,000	0,00%	0,00%	275 000		46 781
Мегионнефтегаз	MFGS	13,024		0,00%	14 443		1 296
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	12,00%	0,00%	5 040		480
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	2,623	0,61%	0,00%	901 512		56 623
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	0,00%	0,00%	29 284		1 230
Магнит	MGNT	129,200	6,38%	0,00%	103 360		12 217
Фармстандарт	PHST	40,000	0,00%	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	0,00%	
Башнефть	AK6		EUR	187,000	0,00%	
ТГК-3	AOMD		USD	3,750	-8,54%	33,34
Татнефть	ATAD		USD	35,320	2,61%	11 648,61
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,990	2,05%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	19,850	-3,27%	33 056,36
Газпром	GAZ		EUR	7,364	0,78%	659,90
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,018	20,00%	0,27
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,300	-13,33%	
Лукойл	LKOD		USD	54,200	-1,36%	130 403,30
Лукойл	LUK		EUR	44,792	-1,17%	229,00
Лукойл	LUKOY	1	USD	54,500	0,31%	4 123,30
МТС	MBT	5	USD	17,540	-0,90%	23 516,06
МТС	MKY	5	EUR	14,165	-2,65%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,100	-3,13%	27,20
Мечел	MTL	3	USD	5,400	0,93%	12 817,24
НорНикель	NILSY	1	USD	15,180	1,20%	202,59
НорНикель	NNIA		EUR	12,390	-0,16%	44,07
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	111,600	-1,41%	16 167,78
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,750	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	8,850	-0,56%	328 280,70
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	20,840	0,10%	565,81
Ростелеком	RTL		EUR	17,300	0,29%	
Газпромнефть	SCF		EUR	18,255	-1,83%	47,93
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,465	2,26%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,494	0,29%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,640	1,62%	749,00
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,850	-0,13%	341,30
АФКСистема	SSA	1	USD	19,850	0,61%	13 160,91
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,273	-0,57%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	101,000	9,78%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	7,880	0,64%	12 508,94
ВТБ	VTBR		USD	3,093	-0,87%	27 791,99
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.