ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

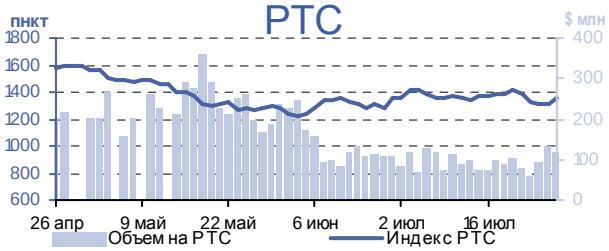
27 июля 2012г.

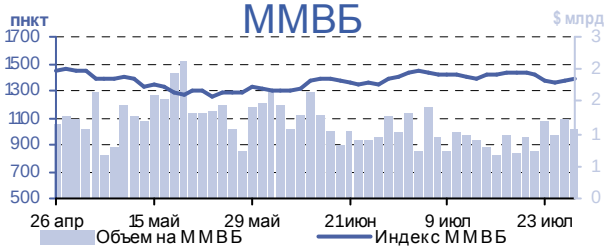
Комментарий по рынку акций

По мировым фондовым рынкам в последние сутки прокатилась волна оптимизма. Вызвали ее заявления главы ЕЦБ Марио Драги, который заверил, что сделает все возможное, чтобы не допустить краха евро. На фоне резкого усиления курса евро на валютном рынке, неоднозначные и откровенно слабые квартальные отчеты ряда крупных компаний и банков были проигнорированы. Не совсем ясно, какие именно шаги по стабилизации валютного и долгового рынков ЕЦБ готов предпринять. Однако, вчера доходность 10-летних испанских облигаций с уровня 7,43% упала до более комфортной отметки 6,93%. Еще во вторник евро был на двухгодовых минимумах по

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



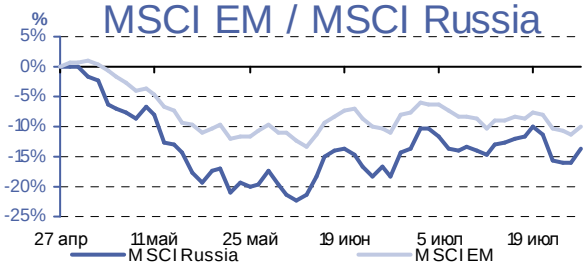


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 349,90	2,40%	-4,53%	3,30%	-31,69%
Индекс ММВБ	1 384,06	1,20%	-3,51%	1,33%	-18,88%
FTSE	5 573,16	1,36%	-2,47%	0,89%	-4,84%
S&P 500	1 360,02	1,65%	-1,20%	2,12%	4,22%
Dow Jones Avg.	12 887,93	1,67%	-0,43%	2,07%	4,76%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Дикси	10,6500	8,01%	15,51%	31,48%
Нижнекамскнефтехим, п.	0,6965	5,13%	20,09%	26,64%
Сбербанк	2,7330	4,19%	17,30%	30,14%
Фармстандарт	40,7000	1,75%	-9,01%	-39,70%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	916,44	1,19%	0,36%	-20,24%
Индекс MSCI BRAZIL	2553,30	2,85%	4,93%	-25,41%
Индекс MSCI RUSSIA	729,52	2,73%	3,53%	-29,33%
Индекс MSCI INDIA	356,65	-0,61%	0,29%	-29,54%
Индекс MSCI CHINA	51,79	0,09%	-2,18%	-21,63%

Обзор рынка

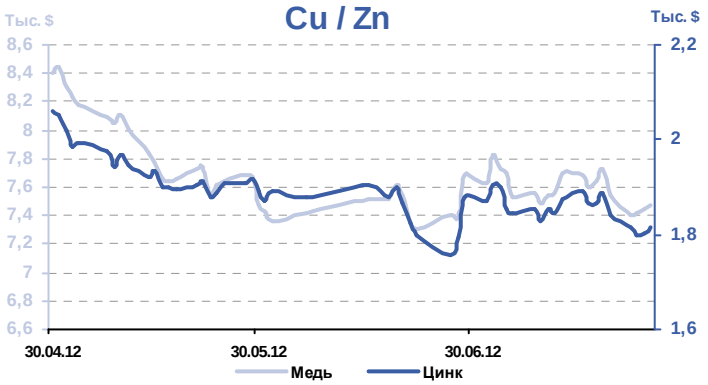
По мировым фондовым рынкам в последние сутки прокатилась волна оптимизма. Вызвали ее заявления главы ЕЦБ Марио Драги, который заверил, что сделает все возможное, чтобы не допустить краха евро. На фоне резкого усиления курса евро на валютном рынке, неоднозначные и откровенно слабые квартальные отчеты ряда крупных компаний и банков были проигнорированы. Не совсем ясно, какие именно шаги по стабилизации валютного и долгового рынков ЕЦБ готов предпринять. Однако, вчера доходность 10-летних испанских облигаций с уровня 7,43% упала до более комфортной отметки 6,93%. Еще во вторник евро был на двухгодовых минимумах по отношению к доллару (1,2042). Вчера по паре EUR/USD было отчетливо видно закрытие спекулятивных коротких позиций, которое вывело ее на максимумы прошлой недели (1,2315).

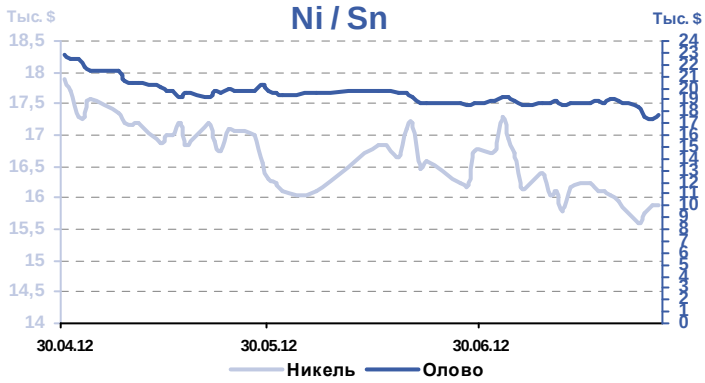
Чего ждать дальше? Обычно такие сильные движения вверх одним днем не заканчиваются, поэтому мы считаем, что EUR/USD к концу июля стоит ловить возле отметки 1,24. Однако, вчерашние заявления Драги существенно подняли ожидания мер стимулирования со стороны ЕЦБ, накануне заседания по монетарной политике, запланированного на следующую неделю. Если инвесторы не увидят подтверждений последним заявлениям, курс евро может опять сдать позиции, тем более, что фундаментальные факторы (отчетность компаний и макростатистика) явно не в пользу продолжения роста.

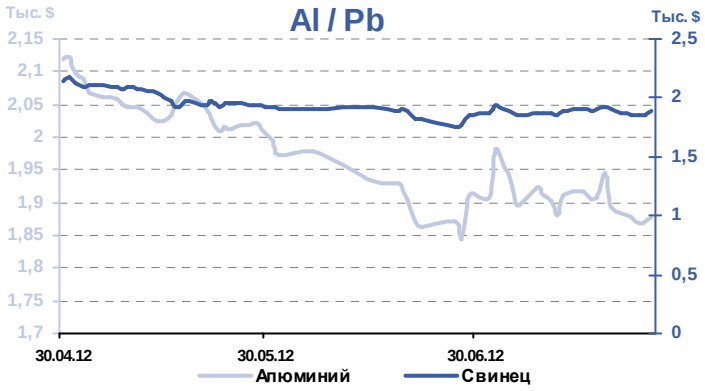
По итогам четверга фондовый индикатор Европы Euro STOXX взлетел на +4,26%, прервав 4-дневную серию снижения. Напротив, индекс ММВБ вчера с большой неохотой сумел достичь максимума среды (1385 п.; +1%). Даже рост цен на нефть Brent до отметки $106/барр не дал толчка к покупкам акций нефтяного сектора. Думаю, в пятницу утром мы увидим пассивный подъем наших индексов на чуть более высокие уровни (на фоне позитивных торгов в Азии и роста фьючерса S&P на 0,25%). Будет логичным увидеть сегодня небольшой отголосок вчерашнего роста, который вернет индекс ММВБ в диапазон 1395-1400 п., соответственно фьючерс РТС на 135-136 тыс. п. Не думаю, что инвесторы будут готовы двигать рынок выше, не увидев вечером первичной оценки по росту ВВП США за II квартал (16-30 мск). В это же время выходит индекс личных потребительских расходов.

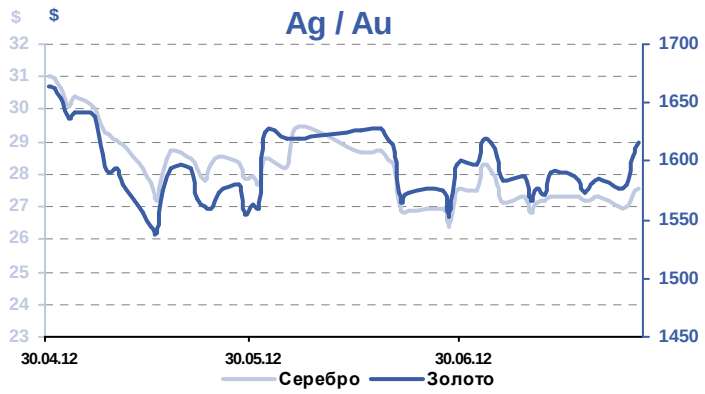
В 17-55 Мичиганский университет опубликуют финальные данные по индексу потребительского доверия США за июль. До открытия торгов на Уолл-стрит квартальную отчетность представят Chevron и Merck.

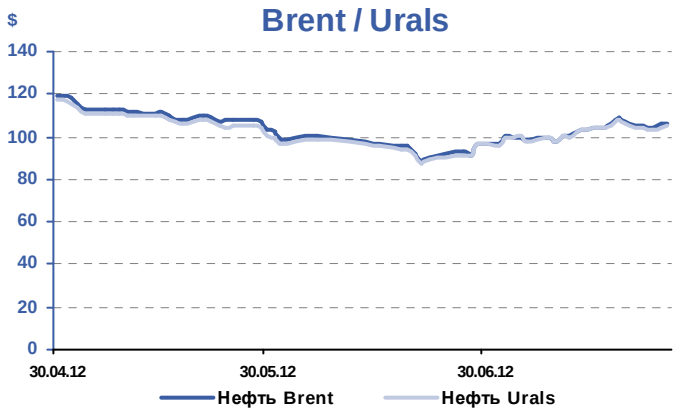
Commodities

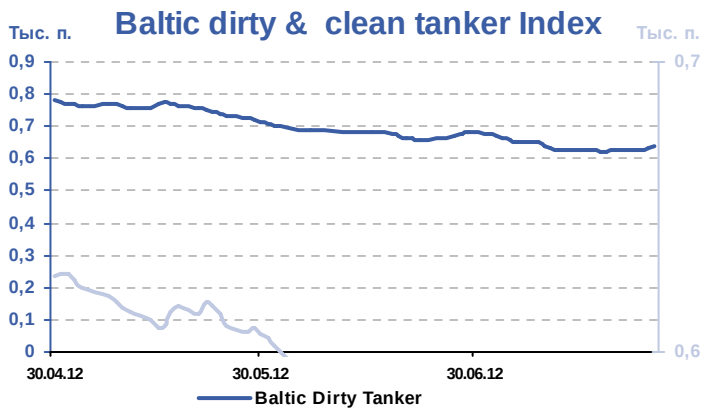












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 470,00	0,32%	-3,36%	0,88%	-23,61%
Цинк, $/t	1 816,00	0,83%	-3,74%	3,42%	-27,99%
Никель, $/t	15 875,00	0,00%	-1,12%	-2,31%	-34,93%
Олово, $/t	17 750,00	2,33%	-7,04%	-5,08%	-38,25%
Алюминий, $/t	1 878,00	0,43%	-3,40%	0,37%	-28,97%
Свинец, $/t	1 885,00	1,62%	-2,31%	7,16%	-29,93%
Серебро, $/oz	27,54	0,67%	1,08%	2,29%	-31,62%
Золото, $/oz	1 615,77	0,71%	2,17%	2,64%	0,13%
Нефть Brent, $/	106,33	0,46%	-2,31%	14,36%	-9,21%
Нефть Urals, $/	104,92	0,61%	-3,05%	15,31%	-9,57%

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%	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	0,00%	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	2,733	4,19%	0,00%	1 485 836		58 997
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	10,650	8,01%	0,00%	5 325		1 329
Магнит	MGNT	129,200	0,00%	0,00%	103 360		12 217
Фармстандарт	PHST	40,700	1,75%	0,00%	20 350		1 538
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%	3,18
Башнефть	AK6		EUR	195,000	4,28%	
ТГК-3	AOMD		USD	3,750	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	37,200	5,32%	20 952,80
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,957	-1,66%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
X5	FIVE		USD	19,350	-2,52%	51 255,28
Газпром	GAZ		EUR	7,402	0,52%	723,38
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,013	-27,78%	0,27
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	15,38%	7,44
Лукойл	LKOD		USD	55,250	1,94%	174 268,20
Лукойл	LUK		EUR	44,895	0,23%	228,58
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,650	2,11%	2 349,71
МТС	MBT	5	USD	18,360	4,68%	36 762,58
МТС	MKY	5	EUR	14,775	4,31%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,099	-0,03%	3,54
Мечел	MTL	3	USD	5,690	5,37%	12 929,39
НорНикель	NILSY	1	USD	15,450	1,78%	273,99
НорНикель	NNIA		EUR	12,595	1,65%	15,82
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	112,500	0,81%	48 036,98
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,800	0,74%	6,80
Газпром	OGZD		USD	9,160	3,50%	246 234,40
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	21,230	1,87%	230,30
Ростелеком	RTL		EUR	17,250	-0,29%	2,10
Газпромнефть	SCF		EUR	18,730	2,60%	11,49
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,455	-0,15%	6,79
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,534	0,89%	4,60
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,650	0,18%	184,54
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,080	2,93%	91,47
АФКСистема	SSA	1	USD	20,280	2,17%	7 537,11
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,260	-0,57%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	101,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,250	4,70%	8 423,34
ВТБ	VTBR		USD	3,175	2,65%	37 518,04
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.