ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

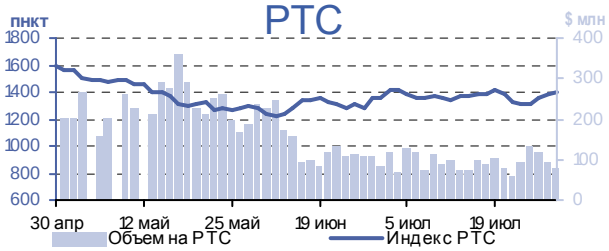
31 июля 2012г.

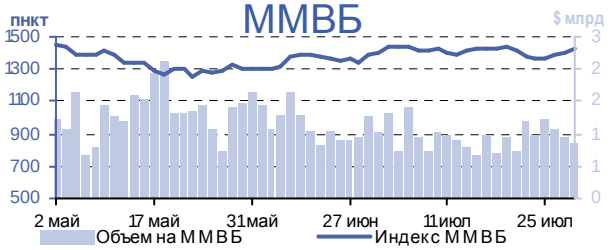
Комментарий по рынку акций

Ожидаем открытия открытия российских фондовых индикаторов сегодня немного выше нуля. Вчерашняя торговая сессия в Америке прошла в рамках проторговки новых уровней вблизи диагонального сопротивления, находящегося, например, на индексе S&P 500 на уровне 1395 пунктов. В результате, закрытие американских бирж оказалось поблизости от нуля. Мировым фондовым индексам, несмотря на негативную статистику из Японии. которая показала серьезное углубление спада в июне, удается успешно держаться либо в нулях, либо в плюсе в последнюю неделю. Причиной этого конечно служит ожидание объявления нового QE на заседании ФРС, которое начнется

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





Значение основных индексов

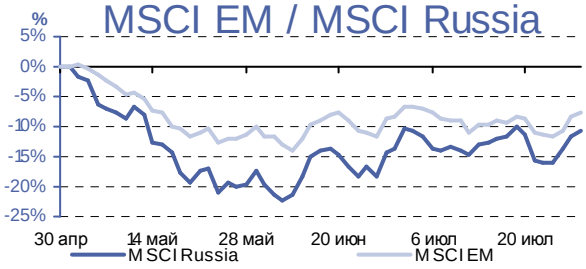
	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 398,07	1,10%	5,60%	3,52%	-29,60%
Индекс ММВБ	1 428,62	1,59%	4,05%	2,96%	-17,19%
FTSE	5 693,63	1,18%	2,89%	2,20%	-1,40%
S&P 500	1 385,30	-0,05%	2,58%	1,70%	7,64%
Dow Jones Avg.	13 073,01	-0,02%	2,76%	1,50%	7,75%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Фармстандарт	45,0000	10,57%	0,60%	-33,33%
Газпром	4,8200	7,35%	7,59%	3,66%
Лукойл	57,0000	2,33%	6,24%	17,53%
Сбербанк	2,8500	2,15%	22,32%	27,52%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	13,0638	-6,69%	16,64%	1,61%



Индекс *MSCI*

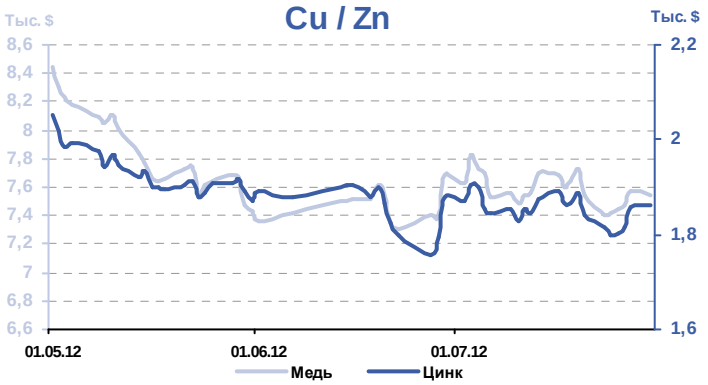
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	948,97	0,77%	1,24%	-17,31%
Индекс MSCI BRAZIL	2665,94	0,10%	4,24%	-23,07%
Индекс MSCI RUSSIA	756,75	1,10%	4,27%	-26,97%
Индекс MSCI INDIA	369,19	1,66%	-1,06%	-26,10%
Индекс MSCI CHINA	53,51	1,12%	-0,12%	-18,88%

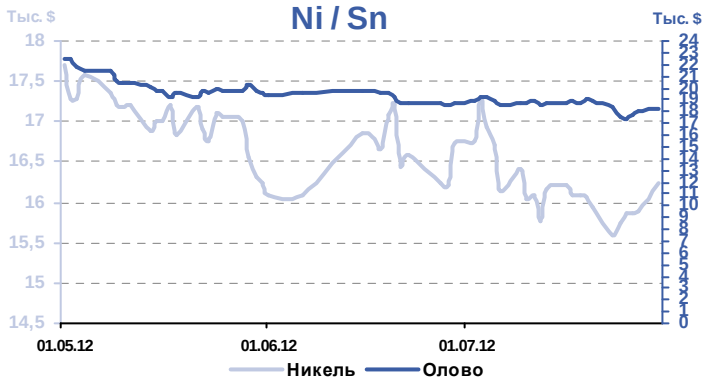
Обзор рынка

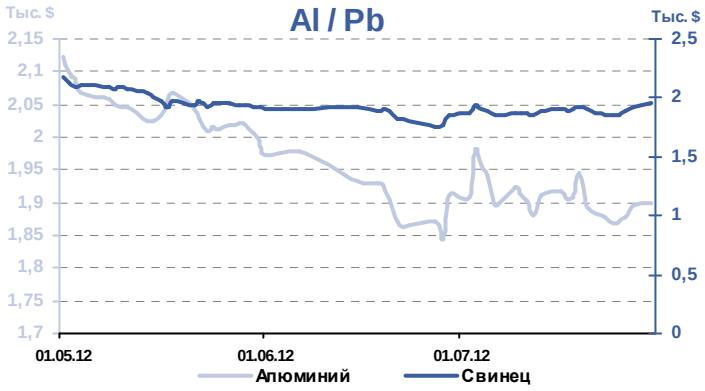
Ожидаем открытия открытия российских фондовых индикаторов сегодня немного выше нуля. Вчерашняя торговая сессия в Америке прошла в рамках проторговки новых уровней вблизи диагонального сопротивления, находящегося, например, на индексе S&P 500 на уровне 1395 пунктов. В результате, закрытие американских бирж оказалось поблизости от нуля. Мировым фондовым индексам, несмотря на негативную статистику из Японии. которая показала серьезное углубление спада в июне, удается успешно держаться либо в нулях, либо в плюсе в последнюю неделю. Причиной этого конечно служит ожидание объявления нового QE на заседании ФРС, которое начнется сегодня. Рыночные консенсусные ожидания уже велики: так уже ожидается, что либо завтра будет принято решение о новом QE величиной 600 млрд. $, либо будет дан прозрачный намек на его объявление на следующем заседании в середине сентября. Мы считаем, что ожидания завышены, ведь Фед уже заявил об операции Twist продолжительностью до конца года. В результате, если QE и будет, то, скорее всего, уже после ноябрьских выборов в США, что конечно сильно разочарует рынки. Вероятность щедрости со стороны ЕЦБ в четверг, с нашей точки зрения, выше, так как ситуация на межбанковском рынке в Европе остается шаткой, а экономика при этом уже свалилась в рецессию, которая при этом еще и углубляется. В целом, мы советуем перед такими судьбоносными для будущего движения на рынках решениями либо быть вне позиций, либо с их минимальным количеством. До итогов заседания ФРС, вероятнее всего, рынки останутся в текущем боковике с возможными небольшими задергами в обе стороны.

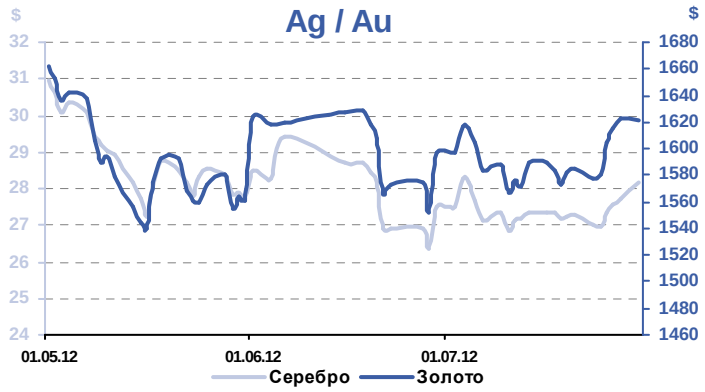
Из статистики мы советуем сосредоточить внимание сегодня на ИПЦ в еврозоне, выходящим в 13-00, так как этот фактор будет важен для принятия решения ЕЦБ и по данным Chicago PMI (17-45), базовый индекс потребительских расходов (16-30), индекс цен на недвижимость Case&Schiller (17-00) и данные по потребительскому доверию (18-00).

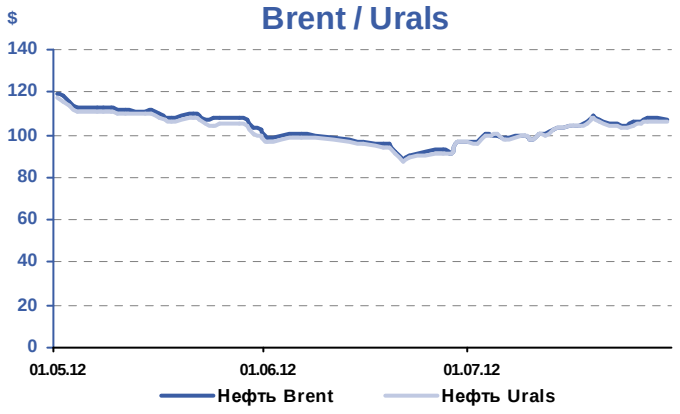
Commodities

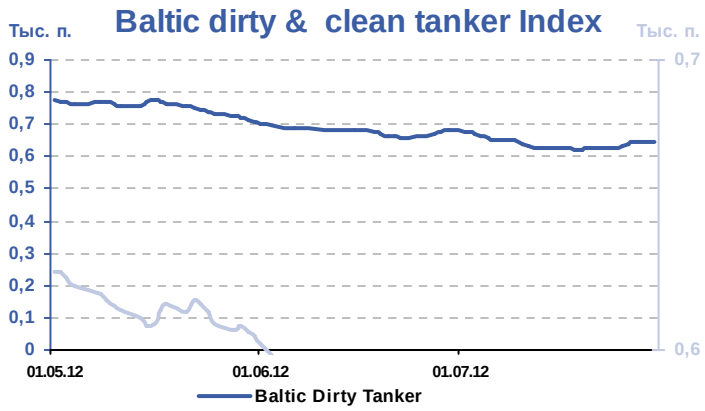












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 545,00	-0,26%	1,95%	-1,82%	-21,81%
Цинк, $/t	1 862,50	0,19%	2,67%	-0,77%	-24,32%
Никель, $/t	16 250,00	2,33%	4,17%	-2,87%	-33,81%
Олово, $/t	18 270,00	0,86%	-0,44%	-2,69%	-34,98%
Алюминий, $/t	1 900,00	0,26%	1,17%	-0,58%	-26,50%
Свинец, $/t	1 951,00	1,40%	4,89%	4,84%	-23,94%
Серебро, $/oz	28,18	1,59%	4,23%	2,55%	-28,28%
Золото, $/oz	1 621,97	-0,06%	2,85%	1,54%	0,18%
Нефть Brent, $/	107,33	-0,55%	2,96%	10,65%	-7,67%
Нефть Urals, $/	106,14	-0,29%	2,94%	9,77%	-8,22%

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%	58 050		8 508
Газпром	GAZP	4,820	7,35%	0,00%	241 000		114 106
Лукойл	LKOH	57,000	2,33%	0,00%	57 000		48 482
Мегионнефтегаз	MFGS	13,024	0,00%	0,00%	14 443		1 296
Татнефть	TATN	6,200	0,00%	0,00%	930 000		13 508
Татнефть, п.	TATNP	2,695	0,00%	0,00%	212 873		397
Транснефть, п.	TRNFP	1538,000	0,00%	0,00%	115 350		2 391
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	25,100	0,00%	0,00%	5 020		465
Северсталь-авто	SVAV	13,064	-6,69%	0,00%	7 577		448
Металлургия							
Мечел	MTLR	5,500	0,00%	0,00%	19 250		2 289
НорНикель	GMKN	158,786		0,00%	38 268		30 269
Полюс Золото	PLZL	29,646		0,00%	7 145		5 651
Северсталь	CHMF	11,978	0,00%	0,00%	20 710		12 070
Банки							
Сбербанк	SBER	2,850	2,15%	0,00%	285 000		61 523
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,320	0,00%	0,00%	13 200		1 466
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	46,000	1,10%	0,00%	17 250		7 180
Верофарм	VRPH	26,190	0,00%	0,00%	52 380		262
Дикси	DIXY	10,650	0,00%	0,00%	5 325		1 329
Магнит	MGNT	129,200	0,00%	0,00%	103 360		12 217
Фармстандарт	PHST	45,000	10,57%	0,00%	22 500		1 701
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%	138 000		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	104,153	0,99%	
Башнефть	AK6		EUR	202,000	1,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,432	20,74%	2,59
ТГК-3	AOMD		USD	3,750	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	38,790	-0,41%	13 053,04
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,956	-0,10%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,001	0,00%	
X5	FIVE		USD	19,550	1,40%	9 419,69
Газпром	GAZ		EUR	7,769	0,41%	1 182,94
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,014	0,00%	0,12
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,950	0,62%	110 357,00
Лукойл	LUK		EUR	46,155	-0,24%	346,79
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,660	-1,38%	1 421,52
МТС	MBT	5	USD	19,140	-0,05%	57 914,92
МТС	MKY	5	EUR	15,525	1,04%	12,08
ТГК-3	MRO		EUR	3,100	3,37%	5,48
Мечел	MTL	3	USD	6,120	0,33%	14 569,47
НорНикель	NILSY	1	USD	15,870	-1,00%	195,79
НорНикель	NNIA		EUR	12,925	0,74%	38,40
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	117,000	3,54%	27 788,95
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,850	0,74%	
Газпром	OGZD		USD	9,585	1,27%	149 559,50
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	21,420	-0,37%	332,31
Ростелеком	RTL		EUR	17,540	0,92%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,700	2,10%	104,28
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,886	3,70%	16,07
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,695	2,49%	27,34
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,850	-3,31%	1 794,81
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,550	-0,12%	33,63
АФКСистема	SSA	1	USD	21,350	2,35%	5 177,34
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,237	-0,49%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	92,000	-4,36%	2,50
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,490	0,12%	7 497,26
ВТБ	VTBR		USD	3,326	2,40%	30 436,56
Возрождение	VZY		EUR	13,000	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.