ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

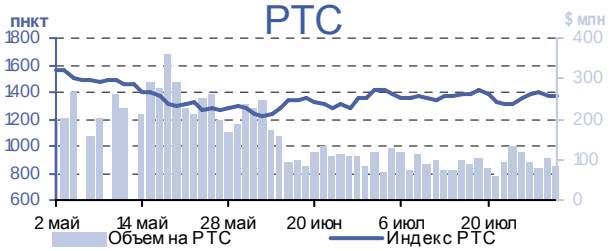
2 августа 2012г.

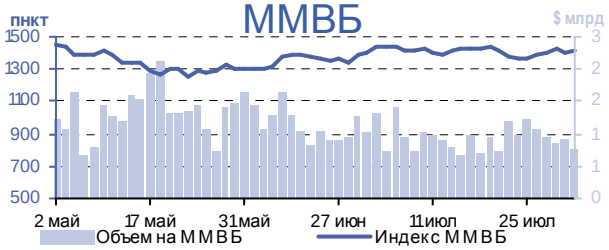
Комментарий по рынку акций

И все-таки QE 3 в августе не быть. Именно таков был итог вчерашнего решения федрезерва. Казалось бы все, продаем все по стопу и начинаем шортить, ведь разорачаровнию рынка не будет предела. Но динамика американского рынка акций говорит об обратном. По сути отсутствие негативной реакции на такой итог может говорить в пользу того, что в общем-то продавцы закончились. Так это или нет, вероятно, станет понятно по итогам сегодняшних-завтрашних торгов после итогов заседания ЕЦБ сегодня. Если в итоге, так и не будут пробиты уровни поддержки, о которых мы писали ранее, есть хороший шанс увидеть растущий август. Если все-таки, реализуется позитивный

Полный текст на 2 стр.

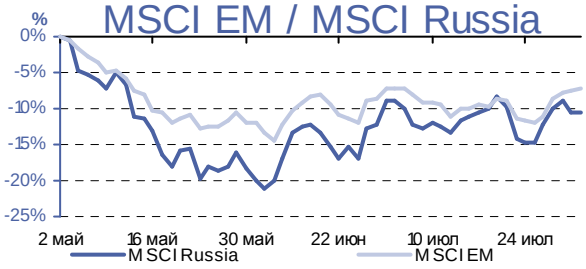
Основные индикаторы





Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 374,98	-0,17%	4,30%	1,30%	-30,14%
Индекс ММВБ	1 411,85	0,34%	3,23%	0,65%	-17,59%
FTSE	5 712,82	1,38%	3,90%	1,28%	-0,10%
S&P 500	1 375,32	-0,29%	2,80%	0,72%	9,67%
Dow Jones Avg.	12 971,06	-0,29%	2,33%	0,77%	9,31%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	13,3663	-10,89%	19,34%	3,97%
Северсталь	11,3018	-5,64%	-2,94%	2,74%
Фармстандарт	43,5900	-3,13%	-2,55%	-54,12%
Лукойл	56,7000	-0,53%	5,68%	16,91%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	954,22	0,18%	1,36%	-15,33%
Индекс MSCI BRAZIL	2607,89	0,54%	0,16%	-22,52%
Индекс MSCI RUSSIA	743,55	-0,14%	1,72%	-27,45%
Индекс MSCI INDIA	372,56	0,51%	-0,75%	-24,36%
Индекс MSCI CHINA	54,49	0,41%	1,72%	-15,96%

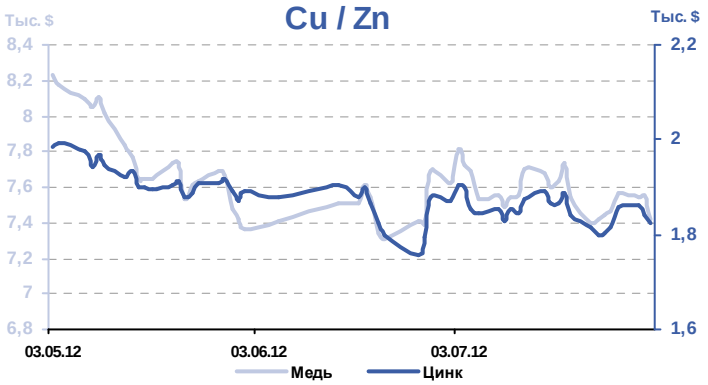
Обзор рынка

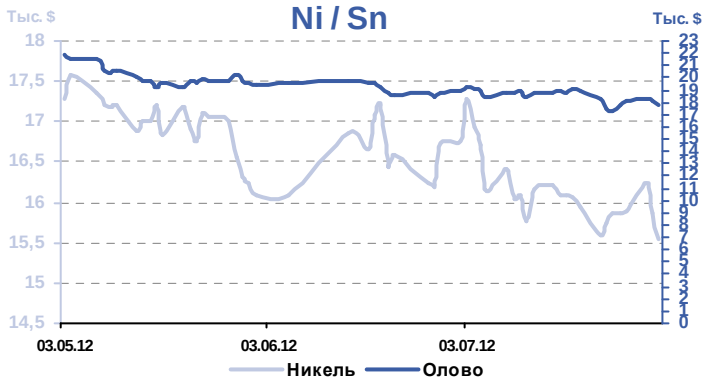
И все-таки QE 3 в августе не быть. Именно таков был итог вчерашнего решения федрезерва. Казалось бы все, продаем все по стопу и начинаем шортить, ведь разорачаровнию рынка не будет предела. Но динамика американского рынка акций говорит об обратном. По сути отсутствие негативной реакции на такой итог может говорить в пользу того, что в общем-то продавцы закончились. Так это или нет, вероятно, станет понятно по итогам сегодняшних-завтрашних торгов после итогов заседания ЕЦБ сегодня. Если в итоге, так и не будут пробиты уровни поддержки, о которых мы писали ранее, есть хороший шанс увидеть растущий август. Если все-таки, реализуется позитивный сценарий, то первые цели роста уже можно будет поставить на 1450-1480 пунктов по ММВБ, чему будет способствовать постепенное оживление рынка после летней спячки.

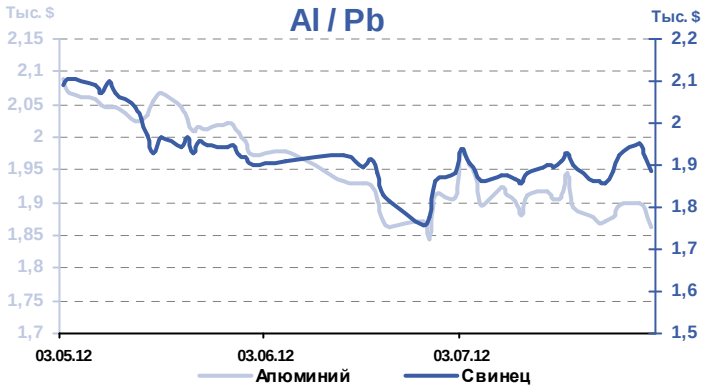
Кроме того, вышедшие позитивные данные относительно сохранения кредитных рейтингов Германии и Испании со стороны S&P способны дать хотя бы временную передышку для развития более серьезного движения вверх, чем мы видели в июне-июлею

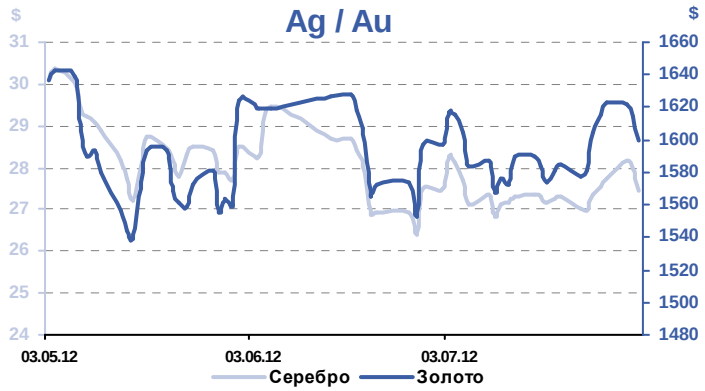
Сегодня, кроме естественно итогов заседания ЕЦБ и банка Англии ждем традиционно статистику по еженедельным пособиям по безработице (16-30), а также данные ISM Нью-Йорка и данные по промзаказам (18-00).

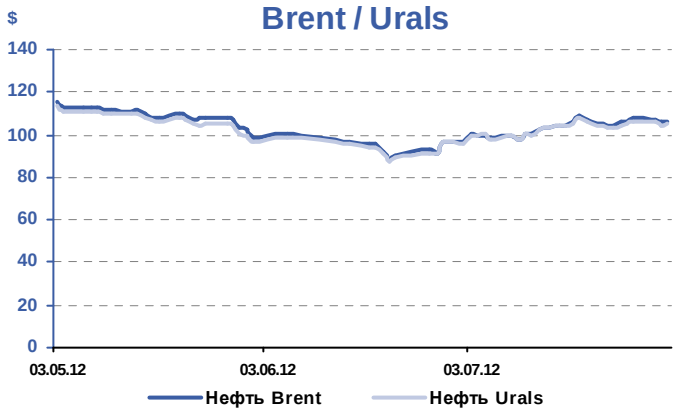
Commodities

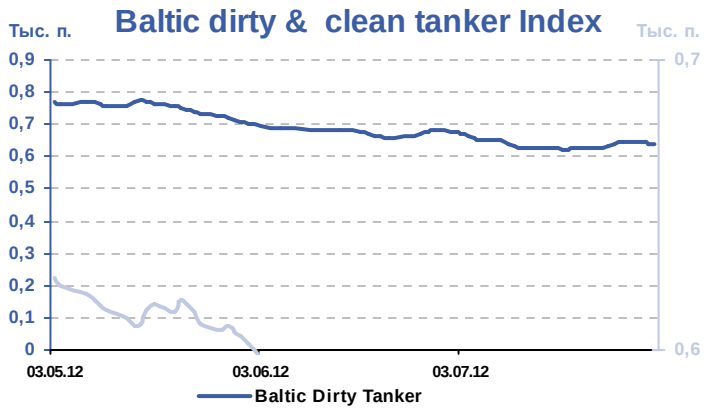












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 425,00	-1,79%	-0,28%	-2,62%	-23,30%
Цинк, $/t	1 822,00	-1,09%	1,17%	-2,67%	-25,33%
Никель, $/t	15 550,00	-1,99%	-2,05%	-7,22%	-37,30%
Олово, $/t	17 800,00	-1,66%	2,62%	-5,82%	-34,68%
Алюминий, $/t	1 861,00	-1,48%	-0,48%	-2,51%	-27,95%
Свинец, $/t	1 884,00	-1,88%	1,56%	0,27%	-26,43%
Серебро, $/oz	27,44	-1,97%	0,27%	-0,21%	-32,76%
Золото, $/oz	1 599,48	-0,92%	-0,31%	0,15%	-3,71%
Нефть Brent, $/	105,83	-0,10%	-0,01%	9,57%	-8,23%
Нефть Urals, $/	105,70	1,43%	1,36%	10,31%	-8,34%

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	0,00%	0,00%	241 000		114 106
Лукойл	LKOH	56,700	-0,53%	0,00%	283 500		48 227
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
Электроэнергетика							
ОГК-3	OGKC	0,030		0,00%	48 180		1 425
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	25,100	0,00%	0,00%	5 020		465
Северсталь-авто	SVAV	13,366	-10,89%	0,00%	3 809		458
Металлургия							
Мечел	MTLR	5,500	0,00%	0,00%	19 250		2 289
НорНикель	GMKN	158,786	0,00%	0,00%	38 268		30 269
Полюс Золото	PLZL	29,646	0,00%	0,00%	7 145		5 651
Северсталь	CHMF	11,302	-5,64%	0,00%	16 953		11 389
Банки							
Сбербанк	SBER	2,806	-0,14%	0,00%	2 260 859		60 573
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,320	0,00%	0,00%	13 200		1 466
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	46,000	0,00%	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	43,590	-3,13%	0,00%	42 675		1 647
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	102,152	-1,84%	
Башнефть	AK6		EUR	201,000	0,00%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,350	-18,60%	292,92
ТГК-3	AOMD		USD	3,760	0,27%	1,88
Татнефть	ATAD		USD	37,810	0,45%	3 707,35
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,916	-0,93%	0,20
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,001	0,00%	
X5	FIVE		USD	19,460	-0,82%	8 961,90
Газпром	GAZ		EUR	7,486	-1,08%	628,17
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,014	3,85%	0,09
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,800	0,53%	94 005,38
Лукойл	LUK		EUR	45,870	0,48%	708,89
Лукойл	LUKOY	1	USD	56,510	0,55%	4 459,07
МТС	MBT	5	USD	19,260	1,64%	51 712,84
МТС	MKY	5	EUR	15,595	2,43%	3,88
ТГК-3	MRO		EUR	3,300	3,12%	2,63
Мечел	MTL	3	USD	6,610	2,01%	28 489,22
НорНикель	NILSY	1	USD	15,450	0,32%	223,96
НорНикель	NNIA		EUR	12,720	1,07%	1,91
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	114,500	1,24%	19 203,04
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,875	0,36%	
Газпром	OGZD		USD	9,230	-0,27%	127 193,30
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	20,940	-0,05%	1 504,07
Ростелеком	RTL		EUR	16,750	-1,47%	4,95
Газпромнефть	SCF		EUR	19,380	1,41%	14,27
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,915	1,38%	14,38
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,627	2,89%	5,60
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,850	4,46%	528,42
АФКСистема	SSA	1	USD	20,650	-0,43%	11 096,02
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,216	-0,45%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	92,500	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,700	3,69%	36 514,61
ВТБ	VTBR		USD	3,310	1,22%	21 111,40
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.