ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

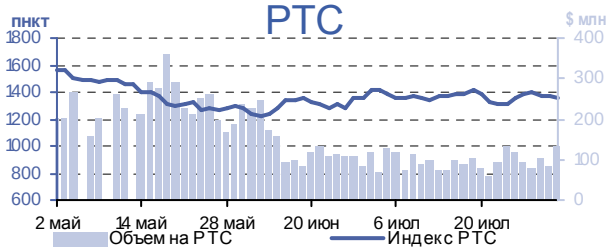
3 августа 2012г.

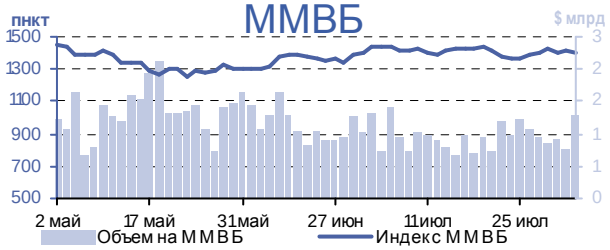
Комментарий по рынку акций

Ожидаем открытия в пятницу российских биржевых индикаторов в районе нуля. Как мы и предполагали во вчерашнем дневном комментарии, несмотря эмоциональное разочарование от итогов заседания ЕЦБ вчера, американский индекс S&P500 закрылся вчера всего лишь на три четверти процента ниже. Более того, с утра фьючерс на индекс умеренно прибавляет, благодаря позитивной статистике из Китая по PMI в сфере услуг, который по версии HSBC умудрился вырасти с 52,3 до 53,1 пункта. По этой же причине, провалившись вчера, сегодня фьючерсы на нефть марки Brent прибавляют с утра порядка полупроцента, и по сути выйдя на уровни до речи Драги. Из критического, сегодня стоит

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы





Значение основных индексов

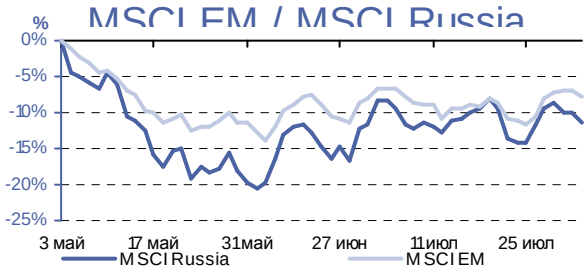
	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 355,32	-1,43%	0,40%	-3,77%	-28,73%
Индекс ММВБ	1 397,05	-1,05%	0,94%	-2,81%	-15,60%
FTSE	5 662,30	-0,88%	1,60%	-0,45%	1,39%

Главные новости

- Ожидаемое снижение прибыли у Русгидро

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь	11,6149	2,77%	-4,78%	5,59%
Лукойл	56,8000	0,18%	5,87%	17,11%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,7100	-3,42%	-3,56%	23,74%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	944,94	-0,97%	-1,24%	-14,30%
Индекс MSCI BRAZIL	2570,87	-1,42%	-2,45%	-21,81%
Индекс MSCI RUSSIA	732,10	-1,54%	-3,48%	-25,80%
Индекс MSCI INDIA	369,30	-0,88%	-3,56%	-24,23%
Индекс MSCI CHINA	53,95	-0,99%	-0,83%	-15,11%

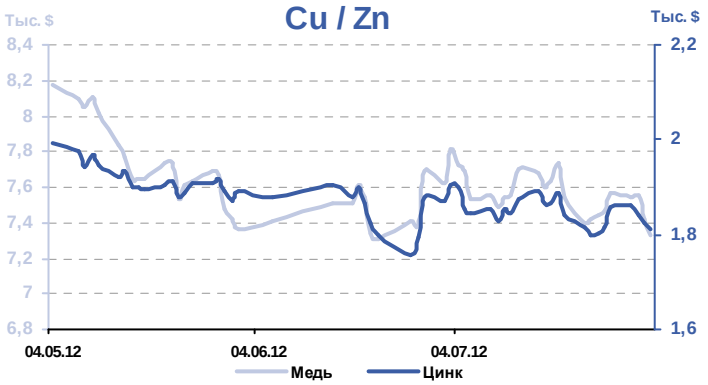
Обзор рынка

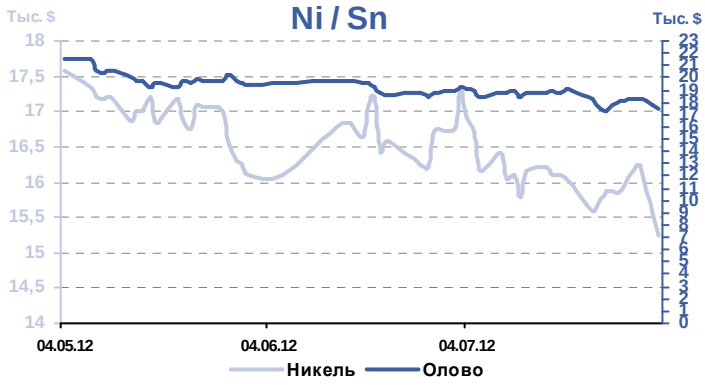
Ожидаем открытия в пятницу российских биржевых индикаторов в районе нуля. Как мы и предполагали во вчерашнем дневном комментарии, несмотря эмоциональное разочарование от итогов заседания ЕЦБ вчера, американский индекс S&P500 закрылся вчера всего лишь на три четверти процента ниже. Более того, с утра фьючерс на индекс умеренно прибавляет, благодаря позитивной статистике из Китая по PMI в сфере услуг, который по версии HSBC умудрился вырасти с 52,3 до 53,1 пункта. По этой же причине, провалившись вчера, сегодня фьючерсы на нефть марки Brent прибавляют с утра порядка полупроцента, и по сути выйдя на уровни до речи Драги. Из критического, сегодня стоит смотреть на данные по безработице от министерства труда. Консенсусные ожидания кажутся несколько заниженными на фоне данных от ADP, поэтому здесь можно ждать позитивного сюрприза. В целом, ждем сегодня волатильной сессии, так как еще не все эмоции уляглись после вчерашнего разочарования. На следующей неделе, скорее всего в первой её половине, ждем формирования среднесрочного импуса в ту или иную сторону.

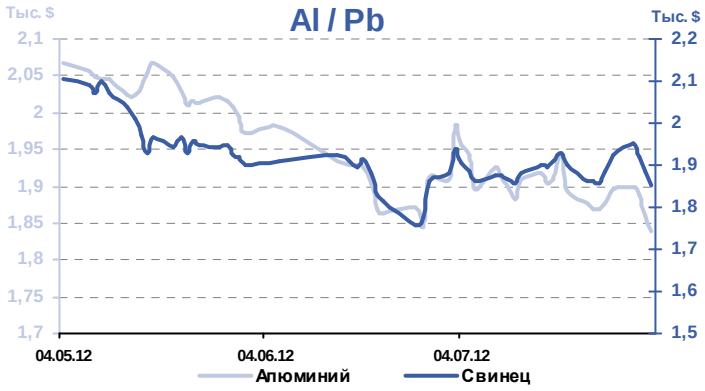
Электроэнергетика

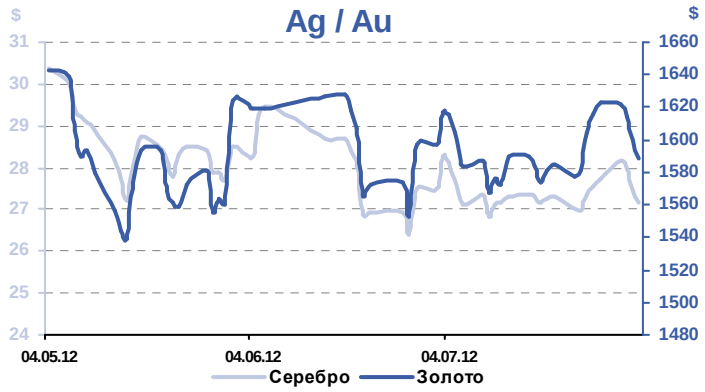
Сегодня вышла отчетность Русгидро. Чистая прибыль и EBITDA компании за 1 квартал 2012 года по МСФО упала на 59% и 37% относительно 2011 года. Снижение показателей обусловлено как изменением структуры группы, так и отменой инвестиционной составляющей в тарифах гидроэлектростанций в 2012 году. В целом, данные оказались несколько лучше ожиданий, что позволило акциям удержаться в процентном плюсе на фоне 1,5% падения индекса ММВБ. Отчетность подтвердила общий тренд на ухудшение финансовых показателей компаний сектора из-за ужесточения госрегулирования. В целом, мы считаем, что акции компании серьезно недооценены, но при этом необходимо помнить, что до окончания переформатирования отрасли как в генерацию, так и в электроэнергетику в целом инвестиции остаются высокорискованными.

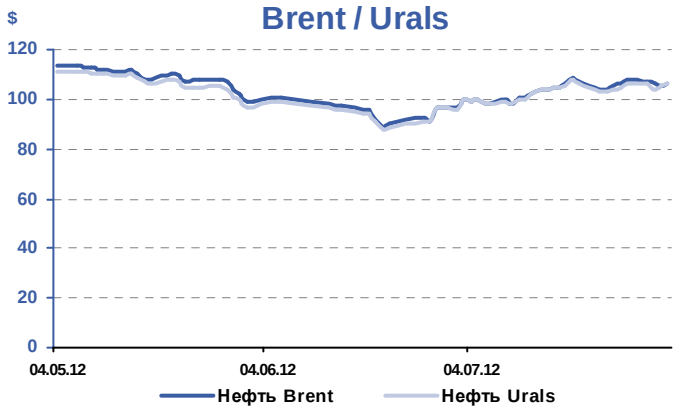
Commodities

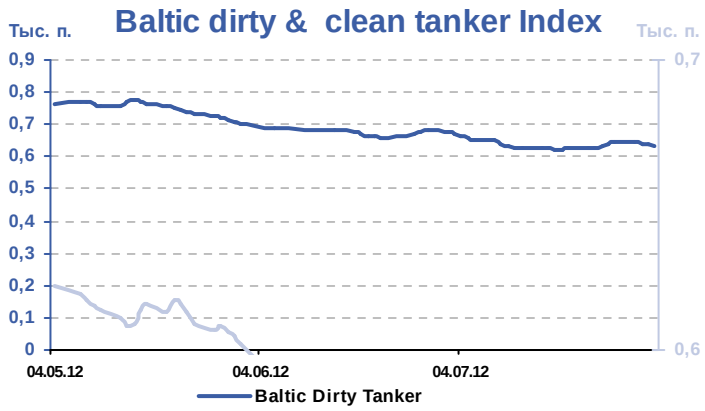












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 330,00	-1,28%	-1,87%	-6,25%	-23,13%
Цинк, $/t	1 812,00	-0,55%	-0,22%	-4,93%	-23,77%
Никель, $/t	15 250,00	-1,93%	-3,94%	-11,80%	-35,94%
Олово, $/t	17 425,00	-2,11%	-1,83%	-9,48%	-33,75%
Алюминий, $/t	1 840,00	-1,13%	-2,02%	-7,16%	-27,13%
Свинец, $/t	1 854,00	-1,59%	-1,64%	-4,38%	-26,49%
Серебро, $/oz	27,14	-1,07%	-1,45%	-4,00%	-34,89%
Золото, $/oz	1 588,63	-0,68%	-1,68%	-1,78%	-4,40%
Нефть Brent, $/	106,39	0,53%	0,06%	6,24%	-5,81%
Нефть Urals, $/	106,57	0,82%	1,57%	6,59%	-4,77%

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	56,800	0,18%	0,00%	284 000		48 312
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%	0,00%	48 180		1 425
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	25,100	0,00%	0,00%	5 020		465
Северсталь-авто	SVAV	13,366	0,00%	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	11,615	2,77%	0,00%	58 847		11 704
Банки							
Сбербанк	SBER	2,710	-3,42%	0,00%	2 571 783		58 501
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	0,00%	0,00%	42 675		1 647
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,095	0,00%	0,00%	16 725		170
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	101,695	-0,45%	
Башнефть	AK6		EUR	199,000	-1,00%	22,33
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,319	-8,86%	1,28
ТГК-3	AOMD		USD	3,760	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	37,440	-0,98%	8 384,22
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,919	0,16%	
X5	FIVE		USD	19,120	-1,75%	9 027,85
Газпром	GAZ		EUR	7,365	-1,62%	609,72
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	56,100	-1,23%	121 780,70
Лукойл	LUK		EUR	46,200	0,72%	188,74
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,670	-1,49%	7 338,78
МТС	MBT	5	USD	18,800	-2,39%	41 001,32
МТС	MKY	5	EUR	15,275	-2,05%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,249	-1,55%	
Мечел	MTL	3	USD	6,200	-6,20%	24 902,52
НорНикель	NILSY	1	USD	15,333	-0,76%	249,28
НорНикель	NNIA		EUR	12,555	-1,30%	14,88
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	114,000	-0,44%	43 338,69
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,850	-0,36%	34,25
Газпром	OGZD		USD	9,110	-1,30%	167 979,10
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	21,050	0,53%	1 085,04
Ростелеком	RTL		EUR	17,205	2,72%	
Газпромнефть	SCF		EUR	18,835	-2,81%	8,70
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,991	1,10%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,570	-1,23%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,700	-2,56%	599,02
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,360	-0,12%	106,71
АФКСистема	SSA	1	USD	20,420	-1,11%	27 483,23
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,206	-0,45%	
СТЗ	SVY		EUR	24,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	107,000	15,68%	2,04
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,700	0,00%	16 491,64
ВТБ	VTBR		USD	3,280	-0,91%	43 010,82
Возрождение	VZY		EUR	14,750	13,46%	29,50

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.