ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

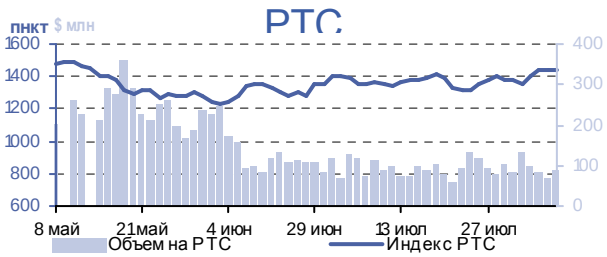
9 августа 2012г.

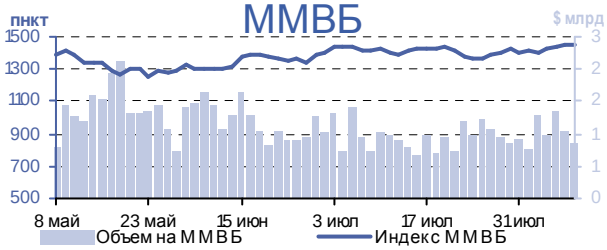
Комментарий по рынку акций

Ждем открытия российского фондового рынка опять в нулях. Как и мы, американцы вчера закрылись в нулях, так и не решившись отойти от психологической отметки 1400 пунктов по S&P500. Статистика из Китая, которую ждали всю неделю, показала ускорение замедления темпов роста, причем по всем фронтам: по промпроизводству, по розничным продажам и инвестициям. Вышедшие данные из Японии также показали ухудшение ситуации с инвестициями в Китае через усиление уменьшения заказов в машиностроении. Более того, в КНР замедлился темп роста потребительских цен (до 1,8% годовых), а индекс цен производителей углубился в негативную область (-2,9%). Все это

Полный текст на 2 стр.

Основные индикаторы



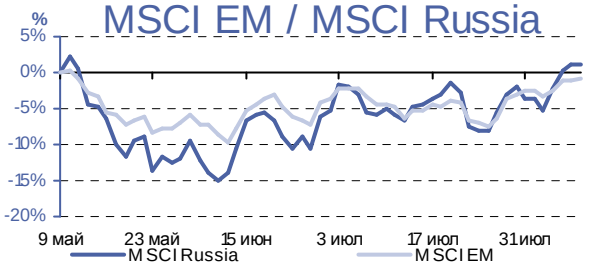


Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 444,79	-0,04%	5,08%	6,82%	-10,27%
Индекс ММВБ	1 449,49	-0,09%	2,67%	2,46%	-3,23%
FTSE	5 845,92	0,08%	2,33%	3,88%	13,19%
S&P 500	1 402,22	0,06%	1,96%	3,68%	19,59%
Dow Jones Avg.	13 175,64	0,05%	1,58%	3,45%	17,22%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Башнефть, п.	35,7000	2,00%	-1,11%	9,85%



Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	2,4500	-3,54%	-2,39%	2,08%

Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	970,60	0,28%	3,73%	0,22%
Индекс MSCI BRAZIL	2728,27	1,69%	5,01%	-4,40%
Индекс MSCI RUSSIA	780,27	-0,11%	7,42%	-6,23%
Индекс MSCI INDIA	381,01	-0,19%	2,12%	-14,58%
Индекс MSCI CHINA	55,01	-0,10%	3,07%	-1,33%

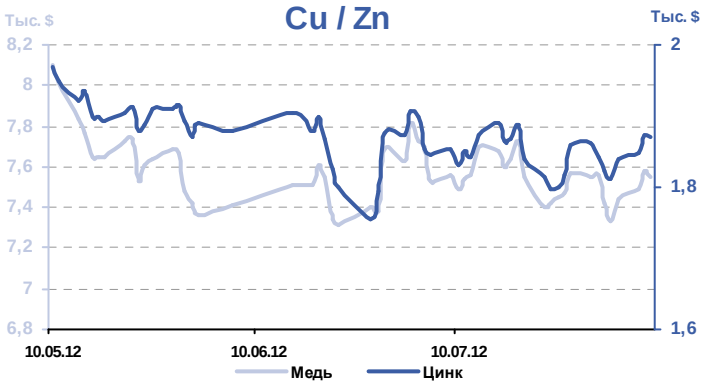
Обзор рынка

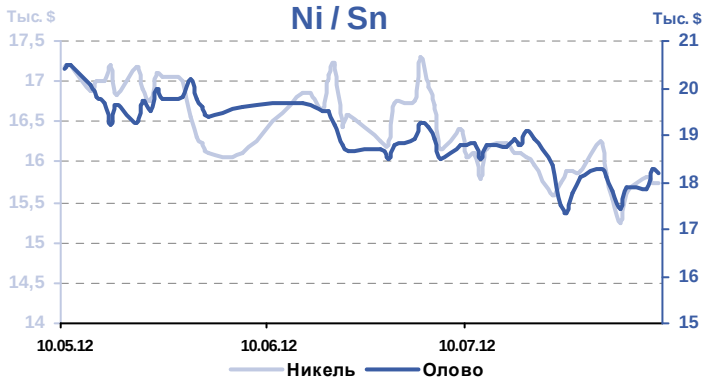
Ждем открытия российского фондового рынка опять в нулях. Как и мы, американцы вчера закрылись в нулях, так и не решившись отойти от психологической отметки 1400 пунктов по S&P500. Статистика из Китая, которую ждали всю неделю, показала ускорение замедления темпов роста, причем по всем фронтам: по промпроизводству, по розничным продажам и инвестициям. Вышедшие данные из Японии также показали ухудшение ситуации с инвестициями в Китае через усиление уменьшения заказов в машиностроении. Более того, в КНР замедлился темп роста потребительских цен (до 1,8% годовых), а индекс цен производителей углубился в негативную область (-2,9%). Все это дает серьезную надежду на череду мер по ослаблению кредитно-денежной политики КНР уже в ближайшее время. А через какое-то время, уже после съезда партии осенью, можно рассчитывать и на новый пакет фискальных стимулирующих мер, похожий на принятый в 2008 году.

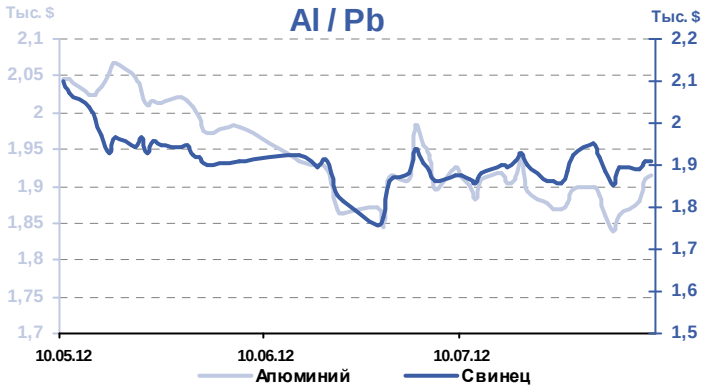
В целом, на этой неделе продолжилась июльская консолидация под 200-дневной скользящей средней. Тем не менее, до конца недели возможен, если не ухудшится внешний фон, short squeeze на котором индекс ММВБ может войти в диапазон 1460-1480 пунктов, где мы бы советовали разгрузить свой портфель, так как на графиках многих эмитентов уже сформировались медвежьи дивергенции, что грозит движением к нижней границе диапазона колебаний в районе 1380 пунктов в ближайшие недели. Что касается вероятности short squeeze, то она высока, так как вероятно еще не все зафиксировали свои шорты от 1430 пунктов, а кроме того, в последние дни наверняка были открыты шорты от 1450 пунктов. Также техническая картинка по нефти марки Brent дает возможность движения в район 114$, после пробития вчера вверх дипазона сопротивлнеия 110-112$.

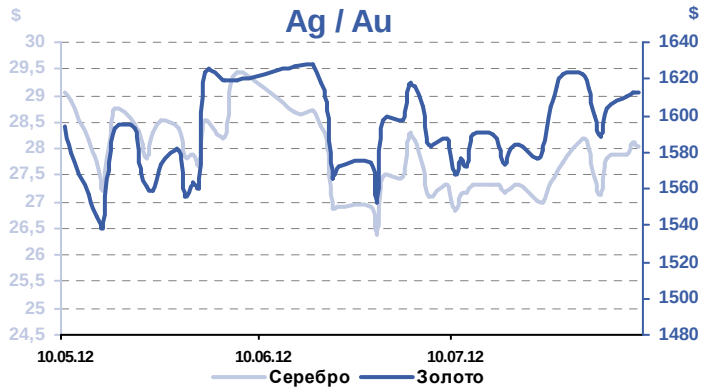
Ждем сегодня традиционной статистики по недельной безработице из США (16-30) и по запасам (18-00.

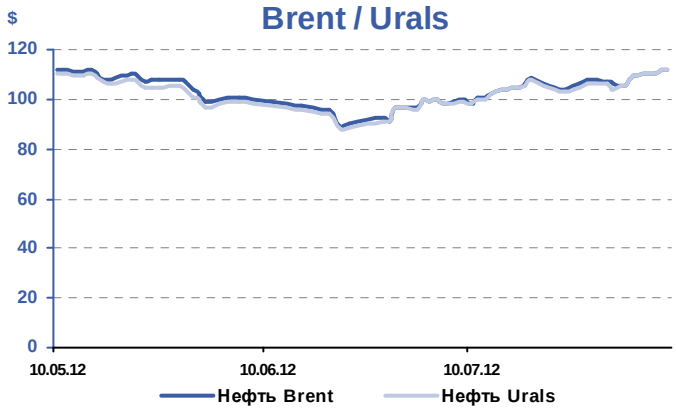
Commodities

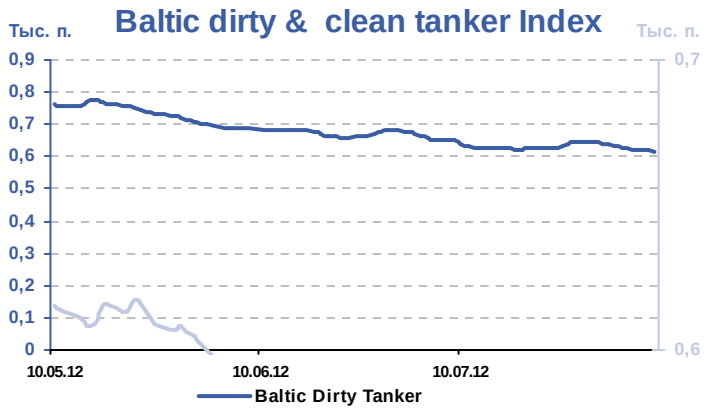












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 550,00	-0,40%	1,68%	-0,13%	-13,53%
Цинк, $/t	1 869,50	-0,19%	2,61%	0,84%	-10,98%
Никель, $/t	15 740,00	-0,06%	1,22%	-4,02%	-25,77%
Олово, $/t	18 200,00	-0,38%	2,25%	-3,19%	-20,00%
Алюминий, $/t	1 915,00	0,29%	2,90%	-0,52%	-20,44%
Свинец, $/t	1 911,00	0,10%	1,43%	1,81%	-15,22%
Серебро, $/oz	28,05	-0,31%	2,23%	2,59%	-25,35%
Золото, $/oz	1 612,13	0,00%	0,79%	1,54%	-7,37%
Нефть Brent, $/	112,20	0,45%	6,02%	12,17%	7,78%
Нефть Urals, $/	112,19	0,20%	6,14%	12,95%	9,27%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,390	3,46%	0,00%	155 350		35 843
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	52,500	0,00%	0,00%	52 500		8 934
Газпром	GAZP	4,820	0,00%	0,00%	241 000		114 106
Лукойл	LKOH	56,800	0,00%	0,00%	284 000		48 312
Мегионнефтегаз	MFGS	13,024	0,00%	0,00%	14 443		1 296
Татнефть	TATN	6,450	0,00%	0,00%	161 250		14 053
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
ТГК-3	MSNG	0,040	0,00%	0,00%	5 452		1 590
Машиностроение							
ГАЗ	GAZA	25,100	0,00%	0,00%	5 020		465
Северсталь-авто	SVAV	13,150	0,00%	0,00%	78 900		451
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	12,352	0,00%	0,00%	15 933		12 447
СТЗ	SVTZ	3,000		0,00%	6 000		144
Банки							
Сбербанк	SBER	2,845	0,00%	0,00%	1 398 500		61 415
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,320	0,00%	0,00%	13 200		1 466
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	0,990	0,00%	0,00%	49 500		104
Балтика	PKBA	46,000	0,00%	0,00%	17 250		7 180
Верофарм	VRPH	25,400	0,00%	0,00%	25 400		254
Дикси	DIXY	10,650	0,00%	0,00%	5 325		1 329
Магнит	MGNT	129,200	0,00%	0,00%	103 360		12 217
Разгуляй	GRAZ	0,579	0,00%	0,00%	144 780		92
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	2,450	-3,54%	0,00%	24 500		1 913

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	105,462	0,11%	0,53
Башнефть	AK6		EUR	201,910	0,44%	
ТГК-3	AOMD		USD	4,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	40,020	-0,47%	22 695,34
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,982	2,01%	
X5	FIVE		USD	19,800	-0,50%	3 342,20
Газпром	GAZ		EUR	7,955	-0,64%	897,30
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	-9,09%	
Лукойл	LKOD		USD	59,300	0,25%	102 147,00
Лукойл	LUK		EUR	47,999	0,91%	321,73
Лукойл	LUKOY	1	USD	59,350	0,15%	1 149,27
МТС	MBT	5	USD	19,140	1,00%	39 551,01
МТС	MKY	5	EUR	14,949	-1,07%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,299	5,57%	6,64
Мечел	MTL	3	USD	7,040	-0,56%	15 570,83
НорНикель	NILSY	1	USD	16,130	-0,74%	245,06
НорНикель	NNIA		EUR	13,040	-0,57%	11,14
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	120,300	0,67%	41 491,88
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,850	0,74%	0,68
Газпром	OGZD		USD	9,810	-0,71%	149 223,90
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	22,420	0,54%	1 249,47
Ростелеком	RTL		EUR	18,250	1,84%	1,03
Газпромнефть	SCF		EUR	19,850	1,33%	95,21
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,295	1,05%	11,79
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,940	3,52%	0,12
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,190	0,32%	206,60
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,950	0,56%	2 913,00
АФКСистема	SSA	1	USD	20,700	0,73%	4 479,68
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,831	-5,62%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,172	-0,37%	
СТЗ	SVY		EUR	26,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	100,000	-2,91%	2,30
Вымпелком	VIP	1	EUR	9,130	1,78%	6 580,11
ВТБ	VTBR		USD	3,640	-0,87%	25 050,85
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.