ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

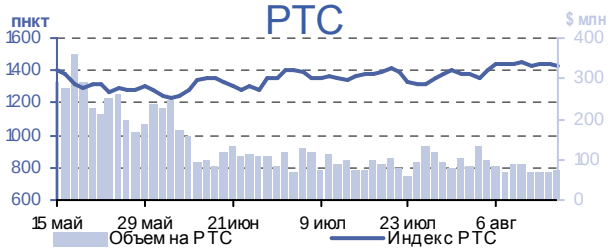
16 августа 2012г.

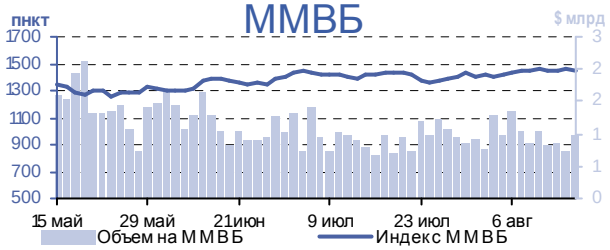
Комментарий по рынку акций

Летнее затишье царит на мировых фондовых биржах. На Уолл-стрит торговые обороты находятся на минимальных уровнях с 2008 года. Уже больше недели индексы Европы и США стоят на месте. Вероятно, эта затянувшаяся консолидация продлится до конца недели, когда состоится экспирация опционов на западных площадках. В середине августа мы имеем рынок, который в краткосрочной перспективе локально перекуплен. Однако это не означает, что он не сможет пойти еще выше к концу месяца. Думаю, инвесторы займут выжидательную позицию до 31 августа, когда откроется ежегодная конференция управляющих ФРС в Джексон Хоуле. Обычно глава ФРС на этом форуме дает посылы

Полный текст на 2 стр.

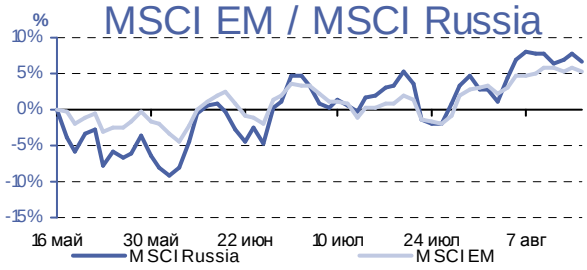
Основные индикаторы





Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 427,67	-1,22%	-1,18%	3,90%	-12,54%
Индекс ММВБ	1 448,32	-0,97%	-0,08%	1,85%	-2,22%
FTSE	5 833,04	-0,54%	-0,22%	3,01%	8,87%
S&P 500	1 405,53	0,11%	0,24%	3,83%	17,84%
Dow Jones Avg.	13 164,78	-0,06%	-0,08%	3,44%	15,42%



Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	974,23	-0,31%	5,13%	-4,36%
Индекс MSCI BRAZIL	2700,29	0,33%	7,14%	-13,33%
Индекс MSCI RUSSIA	771,59	-1,14%	4,54%	-9,85%
Индекс MSCI INDIA	381,44	0,00%	2,97%	-13,66%
Индекс MSCI CHINA	54,59	-1,16%	4,27%	-7,36%

Обзор рынка

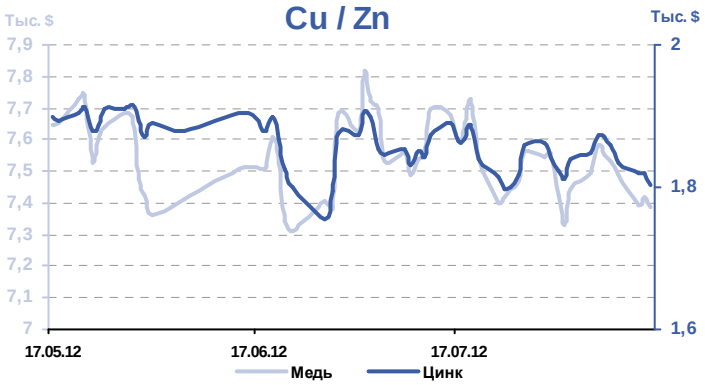
Летнее затишье царит на мировых фондовых биржах. На Уолл-стрит торговые обороты находятся на минимальных уровнях с 2008 года. Уже больше недели индексы Европы и США стоят на месте. Вероятно, эта затянувшаяся консолидация продлится до конца недели, когда состоится экспирация опционов на западных площадках. В середине августа мы имеем рынок, который в краткосрочной перспективе локально перекуплен. Однако это не означает, что он не сможет пойти еще выше к концу месяца. Думаю, инвесторы займут выжидательную позицию до 31 августа, когда откроется ежегодная конференция управляющих ФРС в Джексон Хоуле. Обычно глава ФРС на этом форуме дает посылы в плане будущих решений по монетарной политике.

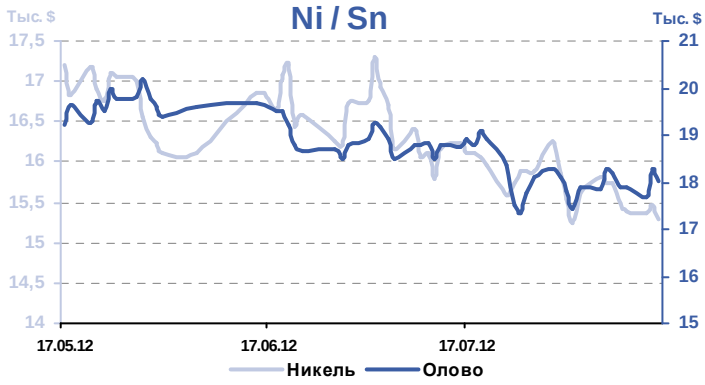
Вчера на нашем рынке акций мы увидели попытки раскачать заснувший рынок. Однако направленного дневного движения так и не получилось. Пока довольно нелепо спекулятивно играть на понижение в то время, как Европа и Америка торгуются нейтрально, а цен на нефть обновляют свои 3-месячные максимумы (октябрьский фьючерс на нефть марки Brent подскочил до $114,5/барр.). В итоге в среду днем индекс ММВБ опустился на уровень локальной наклонной поддержки (1435 п.), сохранив движение в рамках бокового тренда с границами: 1430-65 п. Утренний позитив, идущий с азиатских бирж (Nikkei +1,63%), американских фьючерсов (S&P +0,22%) и выросших цен на нефть (WTI +94,7/барр). Но главный момент, который сейчас явно играет на стороне биржевых «быков» – вывод средств из US Treasuries (доходности по 10-леткам поднялись до 1,8% - максимум пойти за 3 месяца) и возможное перераспределение их в более рискованные активы.

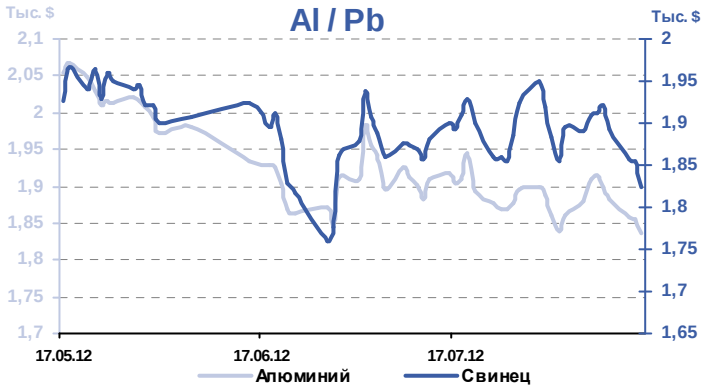
На этом фоне индекс ММВБ сегодня попробует еще раз вернуться на ретест своего недельного максимума (1465 п.) за счет акций банковского сектора (Сбербанк и ВТБ). Уровень поддержки по фьючерсу РТС сместился к отметке 142 тыс. п., соответственно сильное сопротивление проходит через уровень 146 тыс.п.

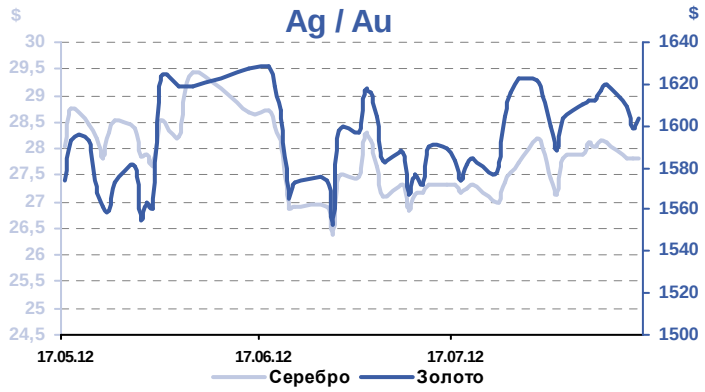
Сегодня в 12-30 в Великобритании выходят данные по розничным продажам за июль. В 13-00 по еврозоне будет опубликованы данные по индексу потребительских цен за июль. В 16-30 ждем статистики из США по числу обращений за пособием по безработице и объемам закладки новых домов, а также выданных разрешений на строительство жилья за июль. В 18-00 ФРБ Филадельфии опубликует индекс деловой активности в производственном секторе региона за август.

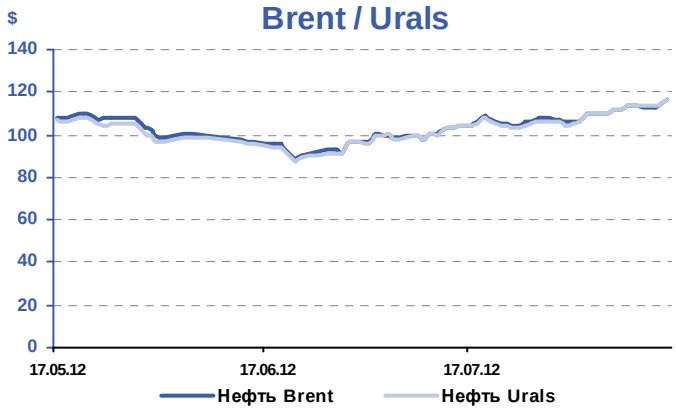
Commodities

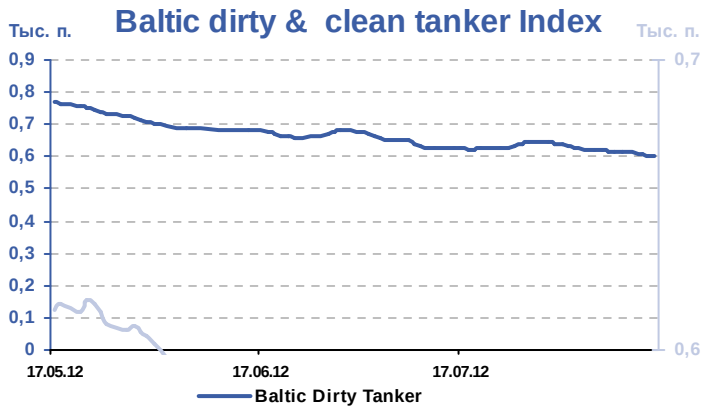












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	7 385,50	-0,41%	-2,18%	-3,85%	-16,36%
Цинк, $/t	1 802,00	-0,93%	-3,61%	-4,66%	-17,42%
Никель, $/t	15 300,00	-1,10%	-2,80%	-5,70%	-29,49%
Олово, $/t	18 025,00	-1,37%	-0,96%	-3,87%	-25,36%
Алюминий, $/t	1 836,00	-1,08%	-4,13%	-4,25%	-22,69%
Свинец, $/t	1 823,00	-1,73%	-4,60%	-4,05%	-22,62%
Серебро, $/oz	27,83	0,04%	-0,78%	1,81%	-30,24%
Золото, $/oz	1 603,10	0,25%	-0,56%	0,86%	-10,23%
Нефть Brent, $/	116,43	1,95%	3,77%	11,52%	6,29%
Нефть Urals, $/	116,59	1,77%	3,92%	11,73%	6,99%

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%	73 160		35 393
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	52,000	0,00%	0,00%	156 000		8 849
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
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,633	0,00%	0,00%	63 250		4 872
Татнефть	TATN	6,450	0,00%	0,00%	161 250		14 053
Транснефть, п.	TRNFP	1725,000	0,00%	0,00%	17 250		2 682
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	29,269		0,00%	1 463		542
Северсталь-авто	SVAV	15,000	0,00%	0,00%	5 250		514
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	158,000	0,00%	0,00%	15 800		1 822
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%	0,00%	6 000		144
Банки							
Сбербанк	SBER	2,896	0,00%	0,00%	289 600		62 516
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	1,120	13,13%	0,00%	15 120		118
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	41,700	0,00%	0,00%	166 800		1 576
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,095	0,00%	0,00%	16 725		170
Химическая промышленность							
Дорогобуж	DGBZ	0,510	0,00%	0,00%	51 000		368
Уголь							
Распадская	rasp	2,435	0,00%	0,00%	97 400		1 901

Источник: РТС, Bloomberg

Российские *ADR/GDR*

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	105,500	0,00%	
Башнефть	AK6		EUR	203,330	0,23%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,350	-19,11%	0,25
ТГК-3	AOMD		USD	4,000	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	39,500	-0,80%	12 783,42
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,040	3,76%	0,20
X5	FIVE		USD	19,490	-1,17%	13 385,87
Газпром	GAZ		EUR	7,888	-0,82%	255,01
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	58,500	-1,27%	213 459,40
Лукойл	LUK		EUR	47,522	-0,40%	576,22
Лукойл	LUKOY	1	USD	58,840	0,24%	1 565,30
МТС	MBT	5	USD	19,200	-0,88%	38 895,63
МТС	MKY	5	EUR	15,510	-1,15%	4,65
ТГК-3	MRO		EUR	3,425	0,00%	13,78
Мечел	MTL	3	USD	6,800	-1,73%	13 792,63
НорНикель	NILSY	1	USD	15,800	-0,33%	231,82
НорНикель	NNIA		EUR	12,800	-0,47%	7,25
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	122,200	0,33%	21 948,45
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,592	4,74%	2,01
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,900	1,47%	
Газпром	OGZD		USD	9,670	-1,38%	133 486,10
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	23,690	0,38%	371,07
Ростелеком	RTL		EUR	19,285	0,76%	
Газпромнефть	SCF		EUR	19,480	-1,84%	0,52
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,319	0,01%	8,58
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,087	-0,25%	0,76
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,470	2,21%	73,00
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,130	-0,11%	78,20
АФКСистема	SSA	1	USD	20,500	-1,11%	2 873,87
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	7,358	2,66%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,137	-0,28%	
СТЗ	SVY		EUR	25,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	98,750	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,200	8,74%	56 143,68
ВТБ	VTBR		USD	3,510	-1,38%	13 290,10
Возрождение	VZY		EUR	15,500	-3,13%	

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.