ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

28 августа 2012г.

Комментарий по рынку акций

В понедельник инвесторы на американских биржах заняли выжидательную позицию, оставив по итогам торгов свои фондовые индексы возле нулевых отметок. Общий торговый оборот на ASE, Nasdaq и NYSE вчера оказался на минимумах этого года (4,46 млрд. акций против среднего оборота в этом году 6,6 млрд. акций). Участники рынка не хотят активно двигать рынок в преддверии пятничного выступления главы ФРС Бена Бернанке на конференции в Джексон Хоуле. Плюс к этому, на пути роста индекса S&P-500 стоит близкое сопротивление на годовых максимумах (1425 п.). Из общей массы вчера выделились лишь акции Apple (достигшие нового исторического максимума

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 431,53	-0,37%	1,99%	3,52%	-14,16%
Индекс ММВБ	1 448,57	-0,38%	1,39%	3,01%	-4,22%
S&P 500	1 410,44	-0,05%	-0,54%	1,77%	16,56%

Главные новости

- ТГК 11 делистингуется с фондовой биржи

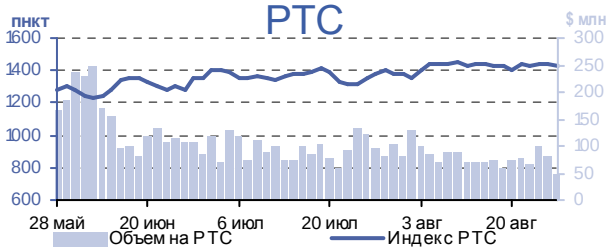
Лидеры роста

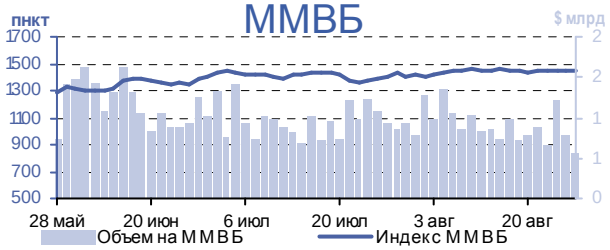
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Сбербанк	2,9180	0,27%	4,59%	9,49%

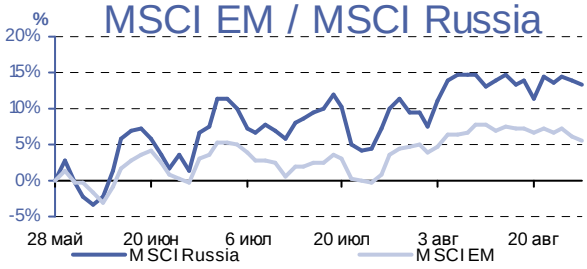
Индекс *MSCI*

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	960,86	-0,48%	2,03%	-4,35%
Индекс MSCI BRAZIL	2656,56	-0,65%	-0,26%	-14,64%
Индекс MSCI RUSSIA	771,67	-0,29%	3,09%	-10,98%
Индекс MSCI INDIA	380,20	-1,08%	4,69%	-10,66%
Индекс MSCI CHINA	53,65	-0,81%	1,40%	-5,59%

Основные индикаторы







Обзор рынка

В понедельник инвесторы на американских биржах заняли выжидательную позицию, оставив по итогам торгов свои фондовые индексы возле нулевых отметок. Общий торговый оборот на ASE, Nasdaq и NYSE вчера оказался на минимумах этого года (4,46 млрд. акций против среднего оборота в этом году 6,6 млрд. акций). Участники рынка не хотят активно двигать рынок в преддверии пятничного выступления главы ФРС Бена Бернанке на конференции в Джексон Хоуле. Плюс к этому, на пути роста индекса S&P-500 стоит близкое сопротивление на годовых максимумах (1425 п.). Из общей массы вчера выделились лишь акции Apple (достигшие нового исторического максимума $680,87), благодаря паразитическим судебным действиям против южнокорейской корпорации Samsung.

Во вторник мы ждем умеренно негативного открытия торгов на нашем рынке акций. Вчера внутридневная динамика российских индексов оказалась в рамках узкой консолидации. Тем не менее, неспособность местных игроков вернуть индекс ММВБ к отметке 1470 п. мы расцениваем как слабость. На ближайшие три дня в США запланированы долговые аукционы по размещению 2-, 5- и 7-летних бондов, в связи, с чем возрастают риски коррекционного снижения рынка к нижней границе зоны консолидации. В связи с тем, что ближайшие уровни в наших индексах хорошо проторгованы, мы ждем, что в ближайшее время индекс ММВБ отойдет к уровням поддержки на 1440-30-20 п. Утреннее снижение фьючерсов S&P на -0,2% также играет на стороне «медведей».

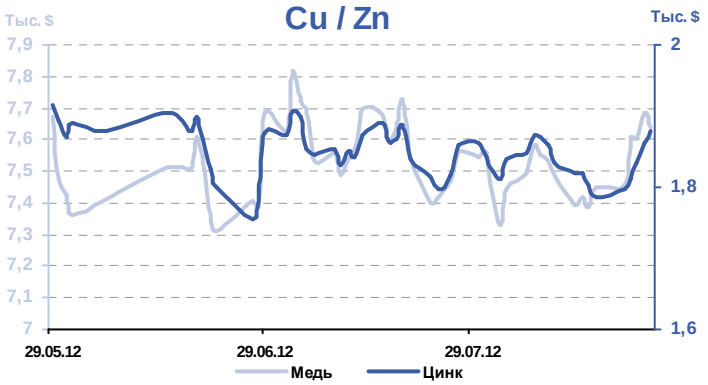
Поскольку собственных идей для роста пока нет, мы будем ориентироваться на внешний фон. Хотим обратить внимание, что котировки нефти Brent вчера довольно агрессивно снизилась со $115 до $112 за барр. даже на фоне урагана Isaac бушующего в районе Мексиканского залива. На наш взгляд это сигнал в пользу продолжения снижения цен на рынке «черного золота» вниз, на уровни 109-107 $/барр.

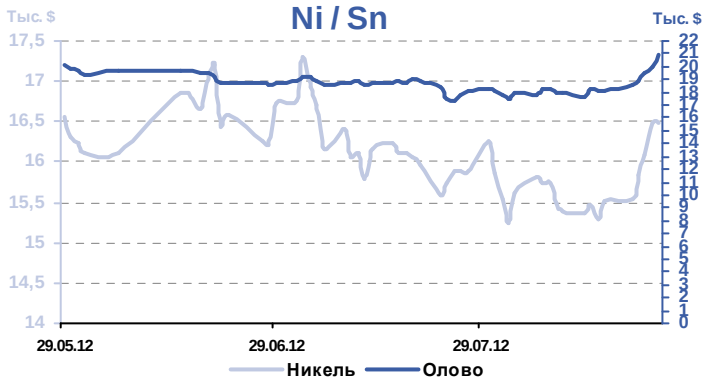
Сегодня по МСФО за I полугодие 2012 г. отчитается ММК. Компания МТС представит отчет за II квартал 2012 г. по US GAAP. Во вторник в 10-00 ждем данных из Германии по индексу доверия потребителей Gfk за сентябрь. В 11-00 Испания представит данные по ВВП за 2 квартал. В 12-30 Испания проводит аукцион по продаже 3 и 6-месячных бондов на сумму 2,5-3,5 млрд. евро. В 17-00 будет опубликован отчет по индексу цен на дома в крупнейших городах США за июнь и за II квартал от S&P/Case-Shiller. В 18-00 ждем данных компании Conference Board по индексу потребительского доверия в США за август. В это же время ФРБ Ричмонда выдаст индекс деловой активности в производственном секторе региона за август. В 21-00 Минфин США проведет аукцион по продаже 2-летних бондов на сумму $35 млрд

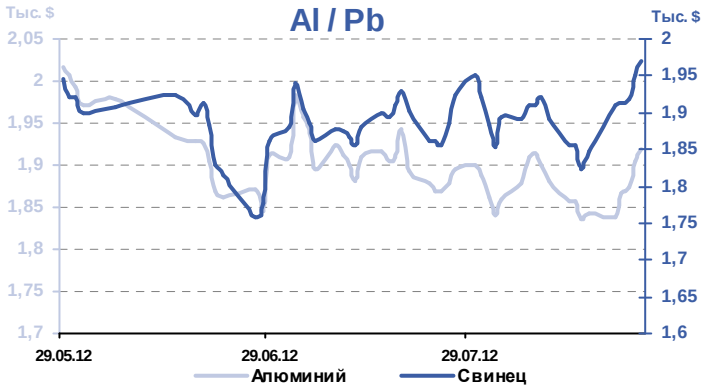
Электроэнергетика

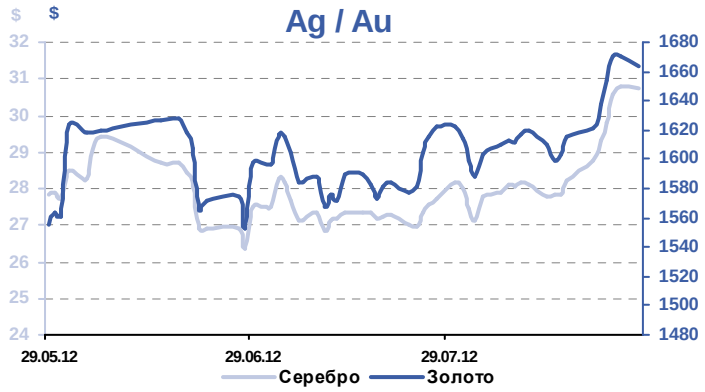
ТГК11 подало 24 августа на биржу заявление об исключении своих ценных бумаг из списка ценных бумаг, допущенных к торгам в ЗАО ФБ ММВБ. Эта новость была ожидаемой на фоне покупки компании ИнтерРао в первой половине года и выставлении оферты миноритариям на выкуп акций. Мы советуем акционерам компании воспользоваться этой возможностью и подать заявление о выкупе. Кроме того, ожидаем, что после окончания действия выкупа компания в сентябре-октябре делистингуется с рынка и проведет принудительный выкуп у остальных миноритариев, после чего консолидирует компанию в рамках ИнтерРао.

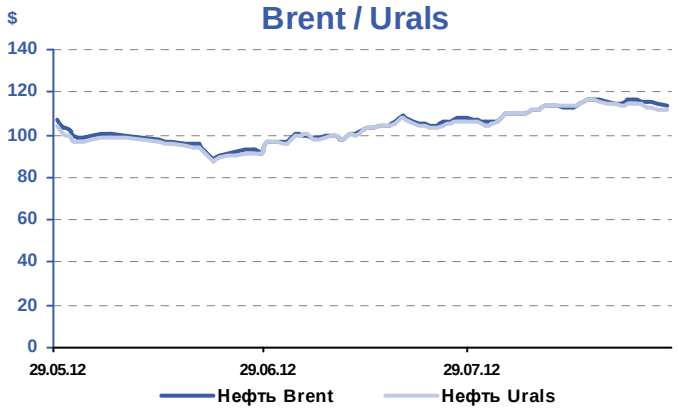
Commodities

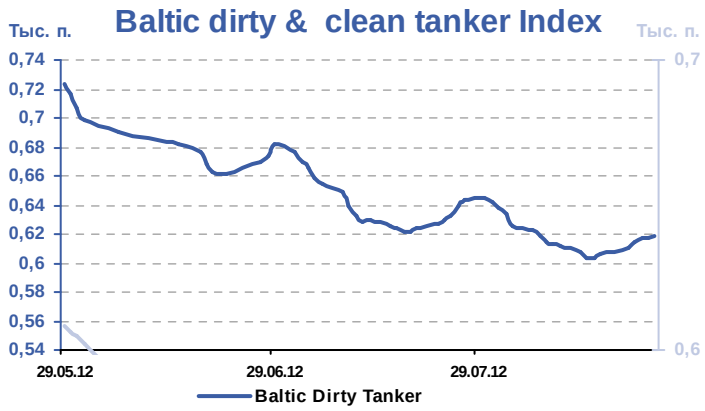












Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Серебро, $/oz	30,72	-0,19%	6,71%	10,73%	-24,83%
Золото, $/oz	1 664,10	-0,39%	2,69%	2,54%	-6,95%
Нефть Brent, $/	113,77	-1,19%	-1,09%	5,42%	0,61%
Нефть Urals, $/	111,74	-1,07%	-2,02%	4,97%	0,07%

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	51,000	0,00%	0,00%	5 100		8 679
Газпром	GAZP	4,820	0,00%	0,00%	241 000		114 106
Лукойл	LKOH	58,750	0,00%	0,00%	293 750		49 971
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,633	0,00%	0,00%	63 250		4 872
Татнефть	TATN	6,500	0,00%	0,00%	324 500		14 161
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	30,000	0,00%	0,00%	30 000		556
Северсталь-авто	SVAV	14,394	0,00%	0,00%	8 953		493
Металлургия							
ВСМПО	VSMO	164,000	0,00%	0,00%	16 400		1 891
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	12,492	0,00%	0,00%	12 492		12 588
СТЗ	SVTZ	3,000	0,00%	0,00%	6 000		144
Банки							
Сбербанк	SBER	2,918	0,27%	0,00%	2 637 740		62 991
Транспорт							
Дальневосточное МП	FESH	0,335	0,00%	0,00%	6 618		989
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	1,120	0,00%	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
Магнит	MGNT	130,000	0,00%	0,00%	13 000		12 293
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	0,125	0,00%	0,00%	12 500		223
Ярославнефтеоргсинтез	JNOS	0,525	0,00%	0,00%	26 250		490
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	106,369	-1,51%	
Башнефть	AK6		EUR	186,670	-2,95%	
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,920	0,16%	0,04
Газпром	GAZ		EUR	7,776	-1,22%	1 121,38
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,012	-4,00%	0,62
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,650	0,00%	
Лукойл	LUK		EUR	46,485	-0,69%	390,91
Лукойл	LUKOY	1	USD	58,760	-0,31%	4 156,62
МТС	MBT	5	USD	18,280	-0,05%	22 440,44
МТС	MKY	5	EUR	14,590	0,14%	0,79
ТГК-3	MRO		EUR	3,299	3,09%	0,55
Мечел	MTL	3	USD	6,040	-1,95%	9 101,97
НорНикель	NILSY	1	USD	15,700	-0,38%	104,75
НорНикель	NNIA		EUR	12,565	-0,12%	0,76
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,692	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	7,050	0,00%	
Ростелеком	RTL		EUR	19,020	0,77%	8,58
Газпромнефть	SCF		EUR	18,825	-0,26%	18,81
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,161	0,32%	5,35
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	5,300	0,38%	196,95
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	6,650	-0,60%	46,36
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,920	-1,33%	36,95
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	6,881	-5,74%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,096	-0,19%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	100,100	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,400	0,29%	6 517,35
Возрождение	VZY		EUR	14,500	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.