

Комментарий по рынку акций

В США в среду к концу торгов индексы все же смогли выбраться из красной зоны (DJIA +0,25%, S&P +0,50%, NASDAQ +0,89%). Хуже рынка выглядели акции нефтегазового сектора (это снизившихся цен на нефть, нефть WTI потеряла около 2%), а лучше - телекоммуникационный и продовольственный сектора. Вчера несколько высокопоставленных чиновников ФРС заявили, что для поддержания восстановления экономики США необходим новый раунд количественного смягчения (QE3). Теперь инвесторы ждут 9 августа, когда состоится заседание ФРС, именно тогда стоит ждать официальных заявлений. Азиатские индексы растут умеренными темпами: Nikkei +0,57%

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 901,73	-3,37%	-3,77%	-2,40%	25,31%
Индекс ММВБ	1 655,36	-3,38%	-2,98%	-2,98%	17,21%
FTSE	5 584,51	-2,34%	-4,65%	-7,20%	3,48%
S&P 500	1 260,34	0,50%	-3,41%	-5,92%	12,48%
Dow Jones Avg.	11 896,44	0,25%	-3,30%	-5,45%	11,85%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Возрождение	34,2000	3,64%	6,88%	-6,04%
Казаньоргсинтез	0,2180	1,40%	-0,91%	19,37%
ОАО Группа ЛСР	36,3600	1,00%	1,71%	34,67%
Мечел	23,5000	0,64%	-9,79%	-3,89%

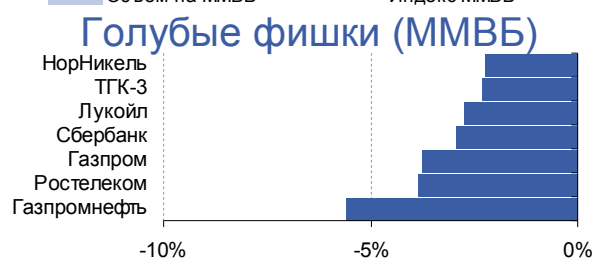
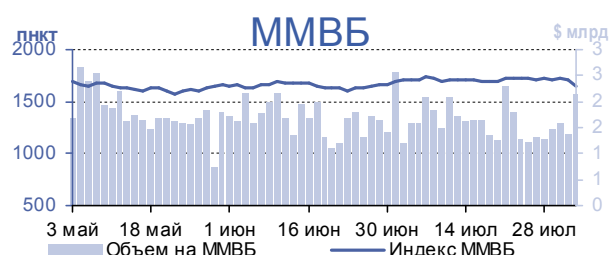
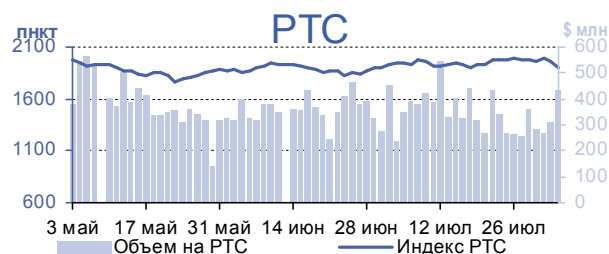
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
МОЭСК	0,0467	-16,54%	-15,02%	-1,85%
ОАО ОПИН	33,0000	-5,71%	-13,45%	0,92%
Дикси	13,0000	-4,41%	-5,80%	22,07%
Лукойл	63,7500	-3,99%	4,51%	13,23%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1102,59	-2,16%	-5,72%	9,20%
Индекс MSCI BRAZIL	3288,07	-2,32%	-11,37%	-5,17%
Индекс MSCI RUSSIA	986,60	-3,73%	-3,85%	21,75%
Индекс MSCI INDIA	487,38	-1,05%	-5,13%	-0,12%
Индекс MSCI CHINA	63,55	-1,99%	-5,56%	-0,13%

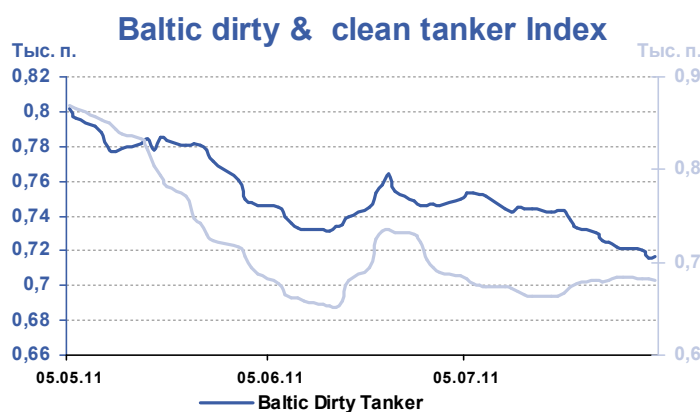
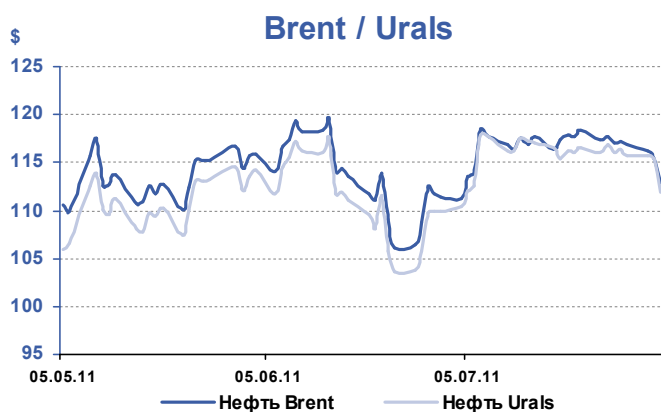
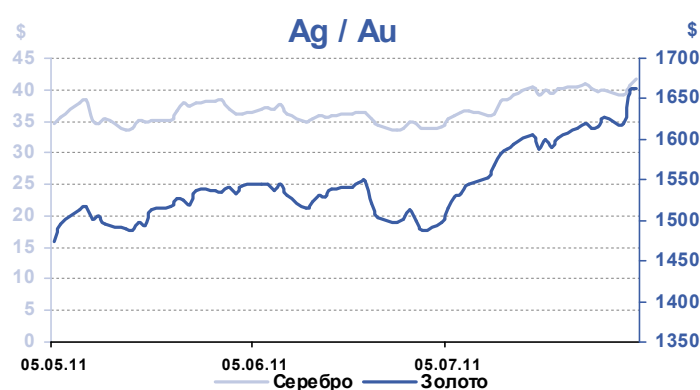
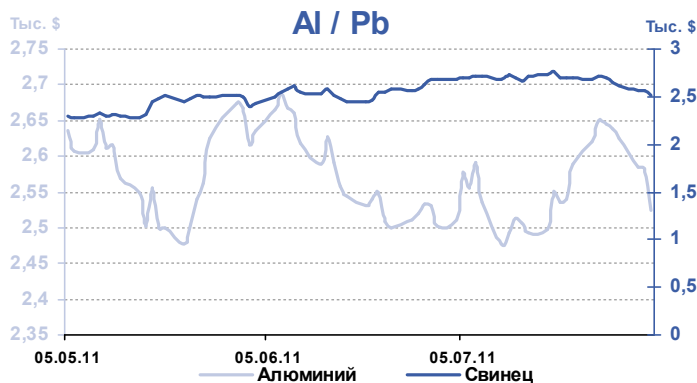
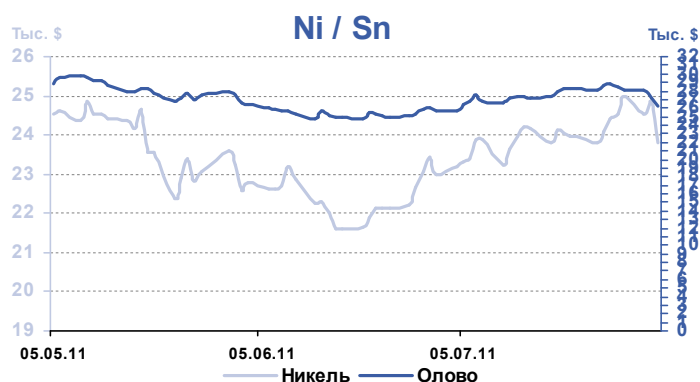
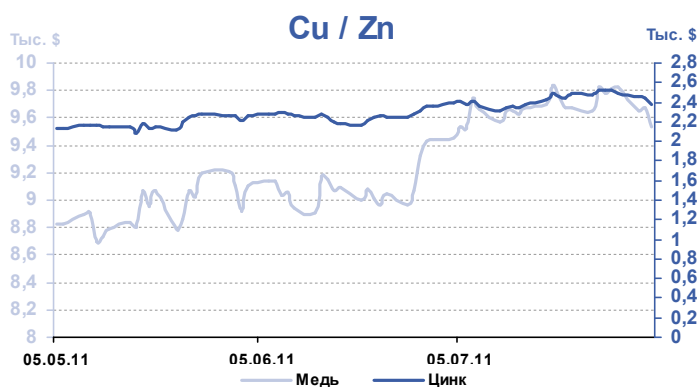
Основные индикаторы



Обзор рынка

В США в среду к концу торгов индексы все же смогли выбраться из красной зоны (DJIA +0,25%, S&P +0,50%, NASDAQ +0,89%). Хуже рынка выглядели акции нефтегазового сектора (это снизившихся цен на нефть, нефть WTI потеряла около 2%), а лучше - телекоммуникационный и продовольственный сектора. Вчера несколько высокопоставленных чиновников ФРС заявили, что для поддержания восстановления экономики США необходим новый раунд количественного смягчения (QE3). Теперь инвесторы ждут 9 августа, когда состоится заседание ФРС, именно тогда стоит ждать официальных заявлений. Азиатские индексы растут умеренными темпами: Nikkei +0,57% (ключевая ставка Банка Японии осталась на прежнем уровне 0%-0,1%), CSI 3000 +0,38%, лишь корейский KOSPI продолжил падение: -1,9%. Пара EUR/USD показывает уровень 1,428 пункта, перед объявлением процентной ставки ЕЦБ следует ожидать повышенной волатильности. Фьючерсы на американские фондовые индексы продолжили движение после закрытия основной торговой сессии. Котировки на нефть Brent уже несколько дней подряд дешевеют и этот день не исключение: -0,12% (113,11 долларов за баррель). Вчера под конец торговой сессии индекс ММВБ сильно просел и застыл возле важного уровня поддержки 1650 пунктов. Сегодня рынок будет пытаться отыграть вчерашнее падение, после открытия торгов, мы ожидаем гэп вверх на 1%. Важным уровнем сопротивления является отметка в 1685 пунктов. После вчерашнего снижения отыгрывать свои позиции будут акции нефтегазового и металлургического секторов. В Евросоюзе сегодня в 15-45 состоится публикация процентной ставки ЕЦБ (тут не ожидается никаких изменений). В США в 16-30 выходят данные по числу первичных заявок на получение пособий по безработице (прогноз 405K)

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	9 535,00	-1,50%	-2,50%	0,85%	28,42%
Цинк, \$/t	2 377,00	-2,58%	-5,75%	-0,88%	14,00%
Никель, \$/t	23 805,00	-4,01%	-2,42%	2,72%	9,88%
Олово, \$/t	26 300,00	-3,49%	-8,51%	2,53%	32,49%
Алюминий, \$/t	2 525,00	-2,25%	-4,50%	0,56%	14,56%
Свинец, \$/t	2 522,00	-1,52%	-6,25%	-6,04%	13,60%
Серебро, \$/oz	41,69	2,18%	3,50%	22,04%	126,76%
Золото, \$/oz	1 661,75	0,03%	2,98%	11,00%	40,10%
Нефть Brent, \$/	112,95	-2,06%	-3,55%	1,55%	36,74%
Нефть Urals, \$/	111,91	-2,96%	-3,54%	1,38%	38,18%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PТС	Δ ММВБ	Объем на PТС, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, m\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,459	0,00%	-3,50%		48 640	231
БашИнСв	BISV	0,459	0,00%	-1,12%		461	437
БашЭнрг	BEGY	1,668	0,00%	-3,13%		46 376	1 739
ВМЗ	VSMZ	1880,585	0,00%	-1,47%		39 688	3 246
ДВМП	FESH	0,460	0,00%	-0,26%		38 976	1 356
КазанскВЗ	KHEL	3,375	0,00%	-2,06%		8 535	526
Мечел	MTLR	22,709	0,00%	-8,39%		11 638 243	9 749
Мотовил	MOTZ	0,087	0,00%	-4,68%		87	86
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	2000,000	0,00%	0,00%	100 000		3 435
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,084	0,00%	0,00%	1 518		84
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,220	-2,42%	0,00%	32 200		47 990
СилМашины	SILM	0,291	0,00%	-2,75%		322 388	2 606
СинТЗ-ао	SNTZ	56,080	0,00%	-8,05%		972	360
Славн-ЯНОС	JNOS	0,368	0,00%	-2,38%		8 531	343
СТЗ-ао	SVTZ	5,385	0,00%	-11,43%		708	262
ТАГМЕТ	TAMZ	0,665	0,00%	-6,43%		612	346
ТНК-ВР	TNBP	3,155	0,00%	-2,28%		400 042	47 728
У-УАЗ	UUAZ	1,956	0,00%	-2,43%		124 066	527
ЧМК	CHMK	247,576	0,00%	-0,95%		28 146	788
ЧТПЗ	CHEP	2,996	0,00%	-0,60%		163 777	1 419
ЮжКузб.	UKUZ	61,386	0,00%	-6,44%		658 009	2 258

Нефть и газ

Башнефть	BANE	56,750	-2,16%	0,00%	227 100		9 657
Газпром	GAZP	7,280	0,00%	-3,75%	362 500	534 322 534	172 343
Газпромнефть	SIBN	5,000	0,00%	-5,62%	100 000	4 181 366	23 706
Лукойл	LKOH	63,750	-3,99%	-2,72%	159 375	163 438 209	54 223
Мегионнефтегаз	MFGS	16,000	0,00%	0,00%	528		1 592
НОВАТЭК	NVTK	14,300	-0,69%	0,00%	71 500		43 419
Роснефть	ROSN	8,269	0,00%	-2,50%		105 985 247	88 346
Сургутнефтегаз	SNGS	0,963	0,00%	-4,30%		33 404 835	35 083
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,520	0,00%	-2,65%	52 000	8 905 922	4 005
Татнефть	TATN	6,260	-3,69%	0,00%	630 500		13 639
Транснефть, п.	TRNFP	1575,000	-1,56%	-4,41%	15 750	19 086 094	2 449

Электрэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,700	-2,86%	0,00%	42 500		1 773
Иркутскэнерго	IRGZ	0,832	0,00%	0,21%		414 190	3 945
Ленэнерго	LSNG	0,640	0,00%	-0,84%		6 681	589
МОЭСК	MSRS	0,047	-16,54%	1,63%	1 295	3 072 490	2 665
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,049	0,00%	0,00%	38 310		1 601
ОГК-3	OGKC	0,047	0,00%	-0,22%	34 766	776 911	2 246
ОГК-4	OGKD	0,097	-0,82%	0,00%	5 348		6 097
ОГК-5	OGKE	0,090	0,00%	-1,74%	69 923	40 766	3 166
ТГК-3	MSNG	0,092	-3,56%	-2,31%	5 520	616 945	3 657
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-0,57%	251 264	5 606	517
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-1,86%	110 812	76 739	652

Телекоммуникации

МТС	MTSS	8,300	0,00%	0,00%	9 130		17 151
Ростелеком	RTKM	6,800	0,00%	-3,84%	68 000	11 012 405	20 014
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	0,00%	-5,02%	194 728	13 524 512	886
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	-3,00%		51 469	175

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	1,023	0,00%	-5,60%		185 273	1 453
ГАЗ	GAZA	48,200	0,00%	0,00%	48 200		893
ИРКУТ	IRKT	0,317	0,00%	-0,83%		23 734	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	2,081	0,00%	-3,49%		153 195	1 494
ОМЗ	OMZZ	2,427	0,00%	-3,65%		38 037	88
РКК Энергия	RKKE	287,039	0,00%	-6,97%		4 949	327

Северсталь-авто	SVAV	18,000	0,00%	-3,58%	27 000	509 135	617
Силовые машины	SILM	0,300	0,00%	0,00%	30 000		2 613

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,478	0,00%	0,00%	143 337		238
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	180,000	0,00%	-2,39%	36 000	1 002 619	2 075
Мечел	MTLR	23,500	0,64%	0,00%	23 500		9 782
ММК	MAGN	0,800	-9,60%	-5,00%	52 000	6 632 537	8 939
НЛМК	NLMK	3,616	0,00%	-4,77%		11 203 585	22 041
НорНикель	GMKN	270,750	0,00%	-2,24%	676 875	93 089 010	51 612
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	-4,49%	62 400	5 303 421	8 307
Полюс Золото	PLZL	58,500	0,00%	0,90%	58 500	23 916 166	11 152
Северсталь	CHMF	18,750	-3,85%	-3,21%	18 750	42 914 520	18 894
ТМК	TRMK	4,277	0,00%	-2,68%		862 332	4 069

Банки

Банк Москвы	MMBM	29,683	0,00%	-3,00%		32 457	5 450
Возрождение	VZRZ	34,200	3,64%	-3,49%	26 779	124 585	812
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-3,46%	15 097	102 953 340	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,533	0,00%	-0,64%		6 879	4 388
Сбербанк	SBER	3,565	-3,39%	0,00%	2 402 728		76 957

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,550	0,00%	-3,14%	22 160	1 084 303	2 832
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	9 600		1 417
НМТП	NMTP	0,111	-2,33%	-0,60%	65 266	842 830	2 135
Приморское МП	PRIM	0,166	0,00%	-3,49%		5 167	133

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,085	0,00%	0,00%	15 425		324
Балтика	PKBA	44,000	0,00%	-0,02%	96 800	15 652	6 675
Вимм-Билль-Данн	WBDF	138,493	0,00%	0,27%		277	6 096
Дикси	DIXY	13,000	-4,41%	-5,28%	26 000	117 848	1 622
Концерн Калина	KLNA	52,134	0,00%	-1,48%		21 757	342
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-1,07%	10 100	13 598	93
Магнит	MGNT	145,000	0,00%	-3,05%	145 000	4 065 109	12 901
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,130	0,00%	-2,66%		37 034	18
Разгуляй	GRAZ	1,668	0,00%	-4,14%		242 660	269
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	86,000	-2,71%	-3,77%	8 600	286 182	3 250
Черкизово	GCHE	29,131	0,00%	-0,09%		44 117	1 252

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,218	1,40%	0,00%	32 800		389
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,952	0,00%	-0,22%	14 280	41 310	1 534
Салаватнефтеоргсинтез	SNOZ	130,000	0,00%	0,00%	52 000		2 412
Уфанефтехим	UFNC	5,800	0,00%	0,00%	495 750		1 597

Другие сектора

ПИК	pikk	3,920	0,00%	-3,09%	10 002	2 684 844	1 934
-----	------	-------	-------	--------	--------	-----------	-------

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	56,000	0,00%	-4,41%	308 125	1 546 542	2 671
Дорогобуж	DGBZ	0,638	0,00%	-2,79%	51 260	49 116	460
Уралкалий	URKA	9,230	0,00%	-5,20%	215 246	40 274 700	28 565

Уголь

Распадская	gasp	6,210	0,00%	-4,68%	124 200	6 616 176	4 849
УК Южный Кузбасс	UKUZ	66,000	0,00%	0,00%	13 200		2 383

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в ADR	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	172,500	-1,71%	
Башнефть	AK6		EUR	182,000	-6,67%	0,76
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,040	-5,45%	9,52
ТГК-3	AOMD		USD	9,200	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	37,970	-5,55%	11 312,01
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,743	-0,03%	61,04
Бурятзолото	BYT		EUR	19,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	30,780	-6,27%	78 970,77
X5	FIVE		USD	38,620	-4,45%	15 157,78
Газпром	GAZ		EUR	9,920	-2,17%	5 393,00
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,060	0,42%	2,74
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,215	-1,00%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,500	-1,41%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,250	0,00%	62,50
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	63,850	-3,18%	301 165,60
Лукойл	LUK		EUR	45,900	-2,05%	1 901,29
Лукойл	LUKOY	1	USD	64,190	-1,62%	9 083,47
МТС	MBT	5	USD	18,060	-0,66%	37 712,18
МТС	MKY	5	EUR	12,660	-3,28%	3,41
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,175	0,41%	20,26
Мечел	MTL	3	USD	22,680	-3,08%	125 562,30
НорНикель	NILSY	1	USD	26,100	-0,27%	616,06
НорНикель	NNIA		EUR	18,150	-3,20%	392,97
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	152,400	-5,93%	75 982,50
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,273	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,450	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	13,730	-4,59%	599 305,10
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	42,140	-3,94%	2 186,51
Ростелеком	RTL		EUR	30,565	1,28%	10,37
Газпромнефть	SCF		EUR	17,000	-2,86%	137,29
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,023	-0,20%	11,77
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,410	0,00%	3,42
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,100	0,00%	10,49
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,720	-3,28%	56,63
АФКСистема	SSA	1	USD	24,250	-2,84%	17 741,34
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	13,390	-0,74%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	31,810	-0,62%	
СТЗ	SVY		EUR	38,675	-0,26%	
ЦУМ	THT		EUR	15,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	374,000	0,00%	0,40
Вымпелком	VIP	1	EUR	12,300	0,99%	45 485,15
ВТБ	VTBR		USD	5,775	-3,75%	91 513,53
Возрождение	VZY		EUR	21,500	-4,44%	

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

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hnp@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Синельщикова Екатерина
skat@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 ЗАО "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.