

Комментарий по рынку акций

В США в четверг торги закончились в глубоком минусе (DJIA - 4,31%, S&P -4,28%, NASDAQ -5,09%). Хуже рынка выглядели нефтегазовый, металлургический и химический сектора (из-за резкого падения цен на сырье), а лучше защитный продовольственный сектор. Не очень позитивные статистические данные, усугубление долгового кризиса в зоне Евросоюза, а также снижающиеся цены на металлы и нефть (инвесторы опасаются, что спрос на сырье может упасть), все это продолжает негативно сказываться на фондовых рынках.

Азиатские рынки рухнули вслед за США: Nikkei -3,0%, Shanghai

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 855,69	-2,42%	-6,52%	-4,99%	21,78%
Индекс ММВБ	1 620,68	-2,10%	-5,80%	-5,22%	14,29%
FTSE	5 393,14	-3,43%	-8,17%	-10,47%	0,13%
S&P 500	1 200,07	-4,78%	-7,73%	-10,30%	6,46%
Dow Jones Avg.	11 383,68	-4,31%	-7,00%	-9,44%	6,58%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОГК-5	0,0930	3,91%	12,05%	5,80%

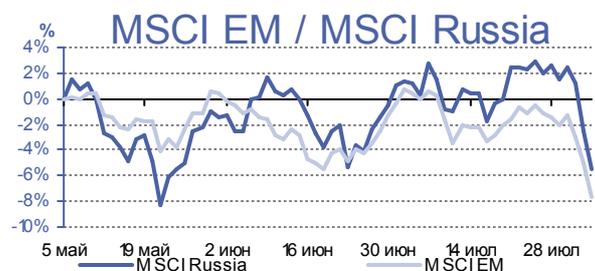
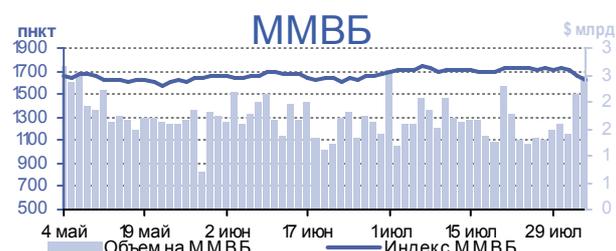
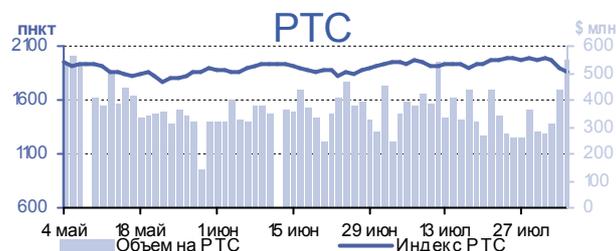
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Акрон	49,8000	-11,07%	2,89%	64,90%
Магнит	132,0000	-8,97%	-7,50%	13,79%
Газпром	6,7000	-7,97%	-4,96%	29,34%
ОАО Синергия	40,0000	-6,98%	16,79%	0,00%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1073,02	-2,68%	-7,99%	6,08%
Индекс MSCI BRAZIL	3098,34	-5,77%	-15,35%	-10,96%
Индекс MSCI RUSSIA	956,75	-3,03%	-6,56%	17,75%
Индекс MSCI INDIA	478,93	-1,73%	-6,51%	-2,49%
Индекс MSCI CHINA	63,22	-0,52%	-6,01%	-0,89%

Основные индикаторы



Обзор рынка

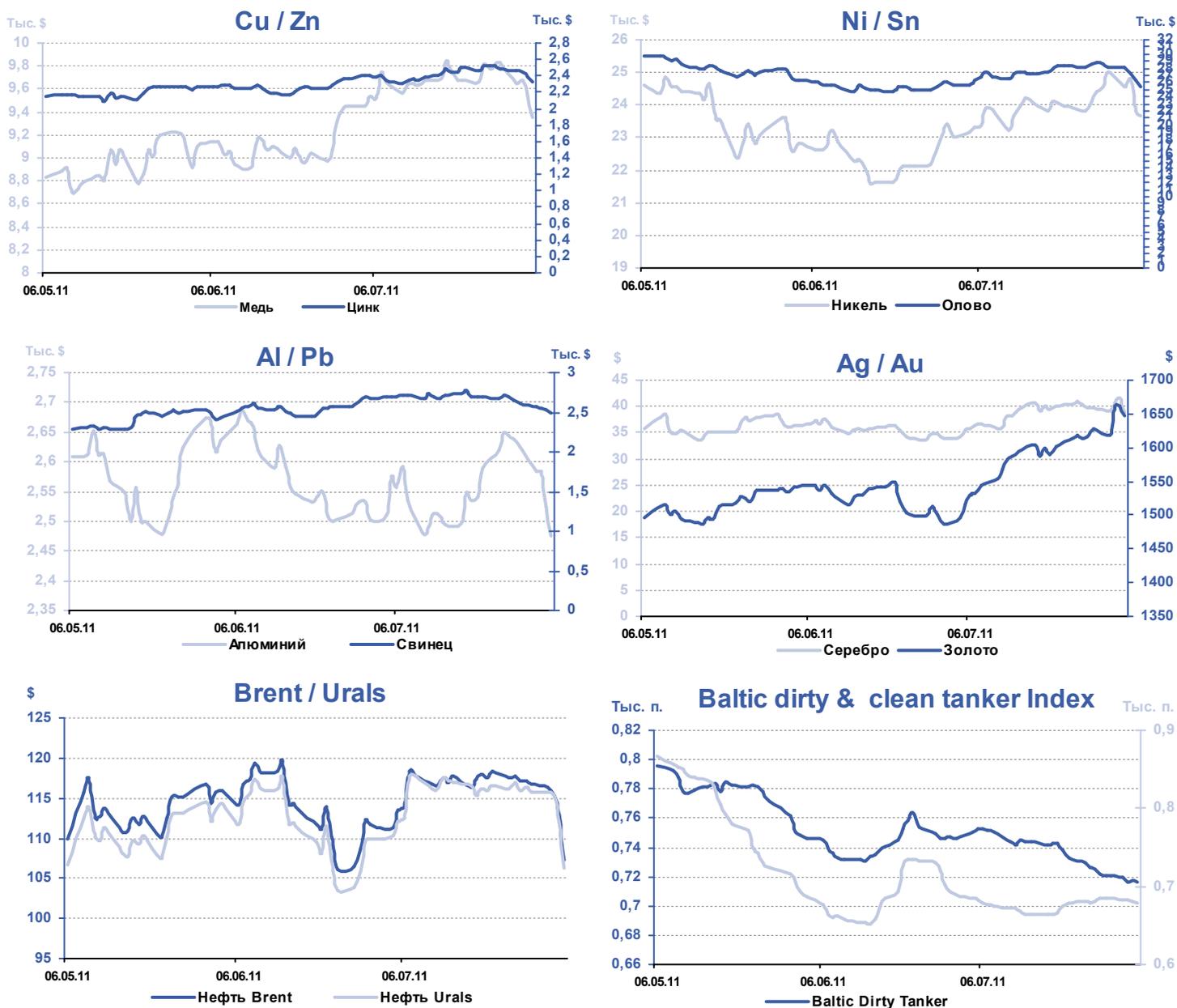
В США в четверг торги закончились в глубоком минусе (DJIA -4,31%, S&P -4,28%, NASDAQ -5,09%). Хуже рынка выглядели нефтегазовый, металлургический и химический сектора (из-за резкого падения цен на сырье), а лучше защитный продовольственный сектор. Не очень позитивные статистические данные, усугубление долгового кризиса в зоне Евросоюза, а также снижающиеся цены на металлы и нефть (инвесторы опасаются, что спрос на сырье может упасть), все это продолжает негативно сказываться на фондовых рынках.

Азиатские рынки рухнули вслед за США: Nikkei -3,9%, Shanghai Composite -1,9%, KOSPI -4,3%. Не смотря на то, что Жан-Клод Трише заявил, что будет продолжена скупка облигаций проблемных стран зоны Евро, доходности бондов Испании и Италии продолжили свой рост, а курс EUR/USD скатился вплоть до отметки 1,411 пункта. Фьючерсы на главные американские индексы торгуются ниже уровней открытия дня. Цены на нефть Brent за неделю потеряли 10%, сегодня опять наблюдается снижение на 0,12% (107,27 долларов за баррель).

Сегодня индекс ММВБ откроется резким снижением на 1,5%-2%, это значит, что важный уровень поддержки 1600 пунктов будет пробит, будем надеяться, падение прекратиться около отметки 1570 пунктов. Акции нефтегазовых, металлургических и машиностроительных компаний будут смотреться хуже рынка, в то время как дорожающие золото и серебро толкнут вверх котировки «Полюс Золота» и «Полиметалла». Лучше рынка также может выглядеть потребительский сектор.

В США в 16-30 выходят данные по изменению числа занятых в несельскохозяйственном секторе (прогноз 89К) и данные по уровню безработицы за июль (прогноз 9,2%)

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	9 355,00	-1,89%	-4,68%	-1,94%	24,65%
Цинк, \$/t	2 330,00	-1,98%	-7,54%	-3,36%	9,91%
Никель, \$/t	23 650,00	-0,65%	-3,69%	1,50%	7,74%
Олово, \$/t	25 505,00	-3,02%	-10,51%	-3,21%	25,70%
Алюминий, \$/t	2 476,00	-1,94%	-6,14%	-3,84%	11,13%
Свинец, \$/t	2 490,00	-1,27%	-6,23%	-7,78%	11,01%
Серебро, \$/oz	38,91	-6,68%	-2,17%	9,64%	112,60%
Золото, \$/oz	1 646,53	-0,92%	1,89%	8,64%	37,79%
Нефть Brent, \$/	107,36	-4,95%	-8,35%	-5,43%	30,40%
Нефть Urals, \$/	106,32	-5,00%	-8,60%	-5,16%	31,42%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PTC	Δ ММВБ	Объем на PTC, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, т\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,446	0,00%	-1,78%		45 553	227
БашИнСв	BISV	0,441	0,00%	-3,09%		2 569	420
БашЭнрг	BEGY	1,664	0,00%	0,71%		16 408	1 711
ВМЗ	VSMZ	1496,627	0,00%	-19,67%		89 457	3 073
ДВМП	FESH	0,444	0,00%	-2,56%		664 811	1 357
КазанскВЗ	KHEL	3,271	0,00%	-2,16%		1 923	511
Мечел	MTLR	21,321	0,00%	-5,23%		4 363 810	9 202
Мотовил	MOTZ	0,086	0,00%	0,00%		1 017	84
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	2000,000	0,00%	0,00%	100 000		3 435
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	3,220	0,00%	0,00%	32 200		47 990
СилМашины	SILM	0,280	0,00%	-2,83%		171 382	2 461
СинТЗ-ао	SNTZ	55,565	0,00%	0,01%		167	351
Славн-ЯНОС	JNOS	0,368	0,00%	0,00%		8 531	343
СТЗ-ао	SVTZ	5,225	0,00%	-2,06%		5 694	249
ТАГМЕТ	TAMZ	0,658	0,00%	-0,08%		66	335
ТНК-ВР	TNBP	3,096	0,00%	-0,96%		231 538	46 670
У-УАЗ	UUAZ	1,841	0,00%	-4,97%		334 560	498
ЧМК	CHMK	238,799	0,00%	-2,64%		15 204	763
ЧТПЗ	CHEP	2,946	0,00%	-0,74%		75 172	1 409
ЮжКузб.	UKUZ	58,831	0,00%	-3,26%		299 058	2 160

Нефть и газ

Башнефть	BANE	56,750	0,00%	0,00%	43 925		9 657
Газпром	GAZP	6,700	-7,97%	-3,11%	335 250	606 360 800	158 613
Газпромнефть	SIBN	5,000	0,00%	-3,12%	100 000	4 656 171	23 706
Лукойл	LKOH	63,750	0,00%	-2,52%	159 375	168 538 534	54 223
Мегионнефтегаз	MFGS	16,000	0,00%	0,00%	528		1 592
НОВАТЭК	NVTK	14,300	0,00%	0,00%	71 500		43 419
Роснефть	ROSN	8,000	0,00%	-2,43%	16 000	122 700 351	84 785
Сургутнефтегаз	SNGS	0,944	0,00%	-1,11%		32 590 224	33 827
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,520	0,00%	-1,36%	52 000	10 022 315	4 005
Татнефть	TATN	6,050	-3,35%	0,00%	1 533 000		13 181
Транснефть, п.	TRNFP	1575,000	0,00%	-2,34%	15 750	49 392 547	2 449

Электрэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,700	0,00%	0,00%	42 500		1 773
Иркутскэнерго	IRGZ	0,825	0,00%	0,05%		1 589 982	3 904
Ленэнерго	LSNG	0,633	0,00%	-0,20%		2 463	585
МОЭСК	MSRS	0,047	0,00%	0,96%	1 295	2 498 983	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%	0,00%	34 766	820 054	2 246
ОГК-4	OGKD	0,094	-2,79%	0,00%	28 200		5 927
ОГК-5	OGKE	0,093	3,91%	-1,63%	9 300	196 819	3 290
ТГК-3	MSNG	0,089	-3,26%	-2,90%	89 000	2 052 527	3 538
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-5,95%	251 264	35 878	517
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-2,13%	110 812	160 167	652

Телекоммуникации

МТС	MTSS	8,300	0,00%	0,00%	9 130		17 151
Ростелеком	RTKM	6,700	-1,47%	-6,34%	67 000	12 070 029	19 720
Ростелеком, п.	RTKMP	3,650	0,00%	-0,72%	194 728	11 349 755	886
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	-0,34%		8 808	175

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,994	0,00%	-1,89%		178 709	1 402
ГАЗ	GAZA	45,000	-6,64%	0,00%	45 000		833
ИРКУТ	IRKT	0,300	0,00%	-4,26%		49 207	299
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	2,001	0,00%	-2,95%		176 997	1 444
ОМЗ	OMZZ	2,382	0,00%	-0,95%		57 106	85
РКК Энергия	RKKE	291,400	0,00%	2,47%		3 146	321
Северсталь-авто	SVAV	18,000	0,00%	-5,63%	27 000	845 211	617

Силовые машины	SILM	0,280	-6,67%	0,00%	14 000		2 439
----------------	------	-------	--------	-------	--------	--	-------

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,460	-3,72%	0,00%	23 000		229
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	180,000	0,00%	2,28%	36 000	1 143 968	2 075
Мечел	MTLR	23,500	0,00%	0,00%	23 500		9 782
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-5,00%	52 000	10 297 411	8 939
НЛМК	NLMK	3,428	0,00%	-4,32%		13 904 103	20 930
НорНикель	GMKN	270,750	0,00%	-1,78%	676 875	136 037 225	51 612
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	-4,09%	62 400	4 982 187	8 307
Полюс Золото	PLZL	58,500	0,00%	-0,31%	58 500	15 764 733	11 152
Северсталь	CHMF	18,750	0,00%	-4,96%	18 750	51 062 318	18 894
ТМК	TRMK	4,139	0,00%	-2,31%		10 096 430	3 894
ЧМЗ	CHMZ	6,100		0,00%	5 002		96

Банки

Банк Москвы	MMBM	28,600	0,00%	-2,74%		30 398	5 236
Возрождение	VZRZ	34,200	0,00%	10,64%	26 779	1 281 567	812
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,88%	15 097	98 221 843	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,451	0,00%	-1,41%		1 425	4 322
Сбербанк	SBER	3,530	-0,98%	0,00%	1 172 700		76 202

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,550	0,00%	-3,31%	22 160	3 528 152	2 832
Дальневосточное МП	FESH	0,480	0,00%	0,00%	9 600		1 417
НМТП	NMTP	0,109	-1,13%	-1,02%	109 820	291 320	2 094
Приморское МП	PRIM	0,160	0,00%	-2,60%		17 975	128

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	3,085	0,00%	0,00%	15 425		324
Балтика	PKBA	44,000	0,00%	-2,42%	44 000	17 030	6 675
Вимм-Билль-Данн	WBDF	137,188	0,00%	-0,01%		4 256	6 041
Дикси	DIXY	13,000	0,00%	0,84%	26 000	118 743	1 622
Концерн Калина	KLNA	51,079	0,00%	-1,10%		53 102	335
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-0,52%	10 100	17 407	93
Магнит	MGNT	132,000	-8,97%	-2,62%	118 800	5 103 424	11 745
Нутринвестхолдинг	NTRI	1,084	0,00%	-3,17%		13 789	18
Разгуляй	GRAZ	1,635	0,00%	-1,08%		410 158	259
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	83,000	-3,49%	-1,28%	8 300	239 678	3 137
Черкизово	GCHE	28,436	0,00%	-1,47%		131 139	1 246

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,218	0,00%	0,00%	6 540		389
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,952	0,00%	-0,77%	14 280	250 788	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	3,700	-5,61%	-1,95%	5 002	3 429 469	1 825
-----	------	-------	--------	--------	-------	-----------	-------

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	49,800	-11,07%	-5,89%	99 800	3 302 300	2 375
Дорогобуж	DGBZ	0,638	0,00%	-2,44%	51 260	14 657	460
Уралкалий	URKA	9,230	0,00%	-1,97%	215 246	53 374 008	28 565

Уголь

Распадская	gasp	6,210	0,00%	-2,60%	124 200	7 303 569	4 849
УК Южный Кузбасс	UKUZ	62,000	-6,06%	0,00%	12 400		2 239

Источник: PTC, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в ADR	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	169,500	-1,74%	
Башнефть	AK6		EUR	198,000	8,79%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,000	-3,85%	8,97
ТГК-3	AOMD		USD	8,615	-6,36%	57,06
Татнефть	ATAD		USD	37,530	-1,16%	16 278,25
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,682	-1,63%	7,25
Бурятзолото	BYT		EUR	19,500	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	29,080	-5,52%	74 625,12
X5	FIVE		USD	37,250	-3,55%	40 804,60
Газпром	GAZ		EUR	9,160	-7,66%	4 872,23
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,060	-0,12%	2,66
Иркутскэнерго	IRK		EUR	28,000	-0,76%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,500	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,250	0,00%	250,00
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	62,000	-2,90%	458 300,30
Лукойл	LUK		EUR	44,760	-2,48%	1 724,54
Лукойл	LUKOY	1	USD	60,600	-5,59%	12 502,27
МТС	MBT	5	USD	17,380	-3,77%	57 832,12
МТС	MKY	5	EUR	12,520	-1,11%	
МГТС	MOW		EUR	10,000	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,134	-0,66%	20,65
Мечел	MTL	3	USD	20,770	-8,42%	156 541,90
НорНикель	NILSY	1	USD	24,970	-4,33%	1 387,27
НорНикель	NNIA		EUR	18,260	0,61%	351,00
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	147,800	-3,02%	88 360,76
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,273	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,475	0,39%	1,94
Газпром	OGZD		USD	13,270	-3,35%	559 578,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	39,350	-6,62%	2 040,72
Ростелеком	RTL		EUR	29,655	-2,98%	39,94
Газпромнефть	SCF		EUR	15,815	-6,97%	128,29
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,764	-3,69%	46,38
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,322	-2,58%	6,76
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,900	-3,92%	79,01
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	9,480	-2,47%	142,22
АФКСистема	SSA	1	USD	23,360	-3,67%	13 992,04
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	13,290	-0,75%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	31,610	-0,63%	
СТЗ	SVY		EUR	38,575	-0,26%	
ЦУМ	THT		EUR	15,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	35,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	374,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	11,760	-4,39%	56 012,61
ВТБ	VTBR		USD	5,690	-1,47%	99 546,83
Возрождение	VZY		EUR	21,500	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

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.