

Комментарий по рынку акций

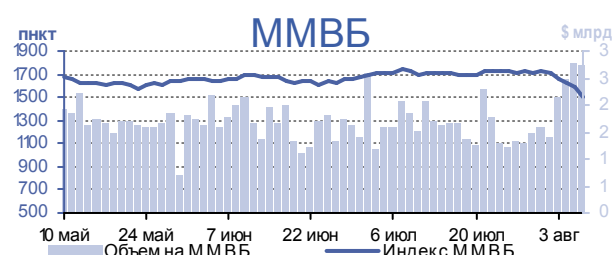
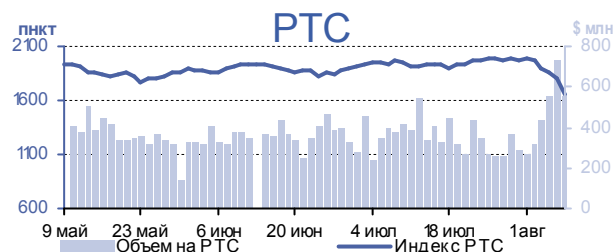
Понижение рейтинга США агентством S&P, спровоцировало падение фондовых индексов, такого мы не видели со времен кризиса 2008 года: DJIA -5,55%, S&P -6,66%, NASDAQ -6,9%. Банковский сектор был лидером снижения: так за вчерашнюю сессию «Bank of America» потерял 19,8%, «Citigroup Inc» показывал -15,8%. Нефть WTI за вчерашнюю сессию стала дешевле на 6,4% (81,31%), что оказывало сильнейшее давление на нефтегазовый сектор. Акции потребительского сектора смотрелись лучше остальных. Никакие заявления политиков не сумели вытянуть индексы из «красной зоны».

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 657,77	-7,84%	-16,52%	-15,35%	9,02%
Индекс ММВБ	1 499,79	-5,50%	-13,06%	-13,03%	5,68%
FTSE	5 068,95	-3,39%	-12,22%	-15,38%	-6,31%
S&P 500	1 119,46	-6,66%	-13,01%	-16,69%	-0,74%
Dow Jones Avg.	10 809,85	-5,55%	-10,90%	-14,60%	1,04%

Основные индикаторы



Голубые фишки (ММВБ)

Лидеры роста

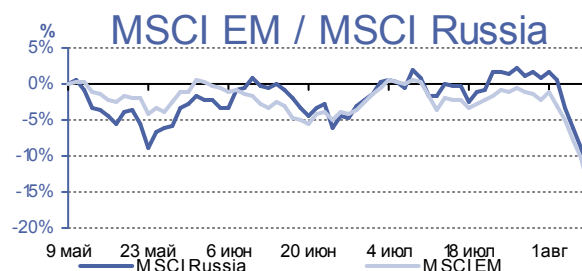
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
МОЭСК	0,0528	12,97%	-9,65%	10,88%

Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Распадская	4,7500	-23,51%	-28,03%	-15,18%
ОАО Банк Санкт-	4,2000	-17,32%	-19,23%	1,20%
Башкирэнерго	1,4500	-14,71%	-14,71%	-34,39%
Северсталь-авто	12,6000	-14,58%	-33,68%	-20,25%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	990,18	-4,89%	-14,93%	-2,54%
Индекс MSCI BRAZIL	2797,18	-9,04%	-21,73%	-19,38%
Индекс MSCI RUSSIA	854,90	-8,01%	-16,84%	5,26%
Индекс MSCI INDIA	454,08	-2,53%	-11,61%	-7,88%
Индекс MSCI CHINA	58,91	-2,72%	-12,30%	-8,14%



Обзор рынка

Понижение рейтинга США агентством S&P, спровоцировало падение фондовых индексов, такого мы не видели со времен кризиса 2008 года: DJIA -5,55%, S&P -6,66%, NASDAQ -6,9%. Банковский сектор был лидером снижения: так за вчерашнюю сессию «Bank of America» потерял 19,8%, «Citigroup Inc» показывал -15,8%. Нефть WTI за вчерашнюю сессию стала дешевле на 6,4% (81,31%), что оказывало сильнейшее давление на нефтегазовый сектор. Акции потребительского сектора смотрелись лучше остальных. Никакие заявления политиков не сумели вытянуть индексы из «красной зоны».

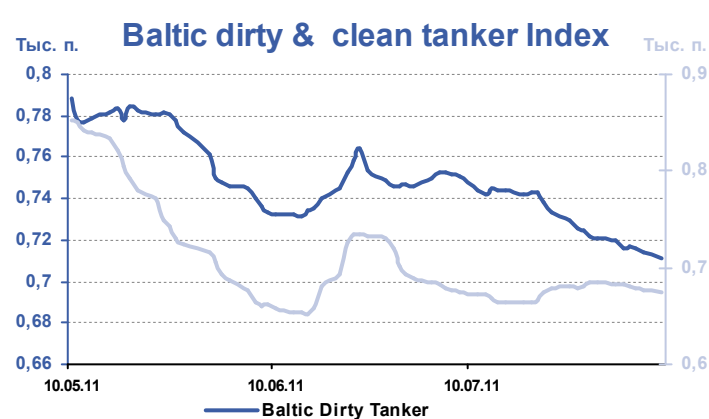
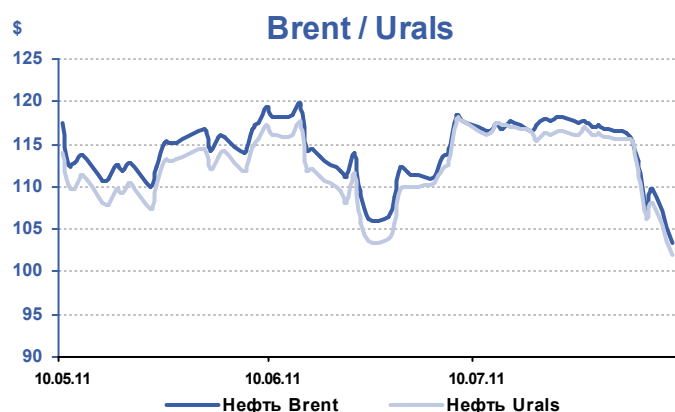
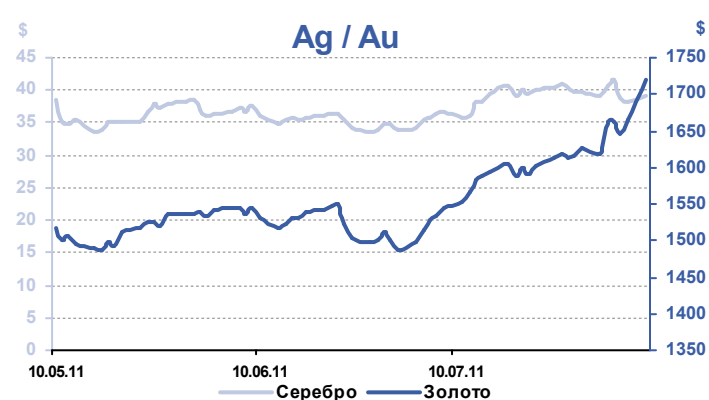
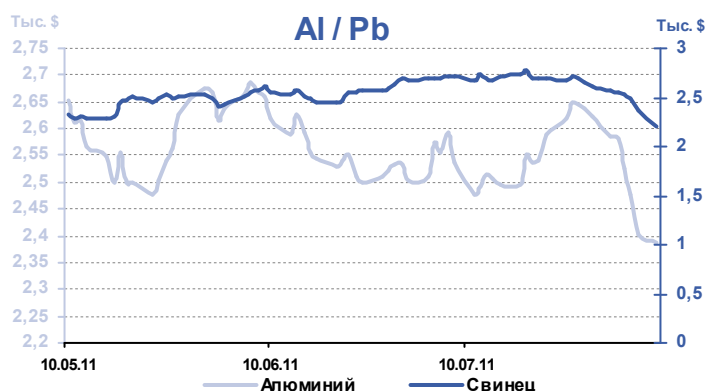
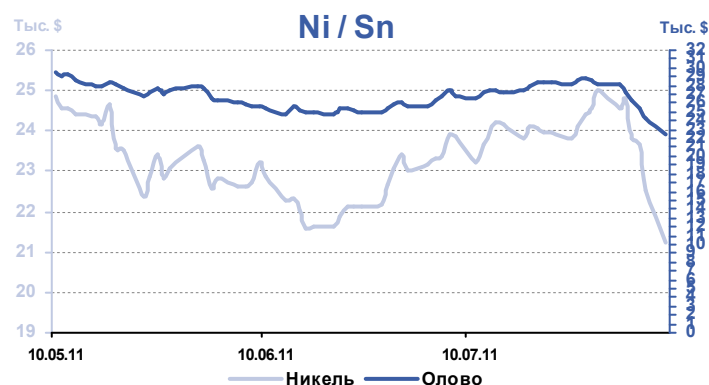
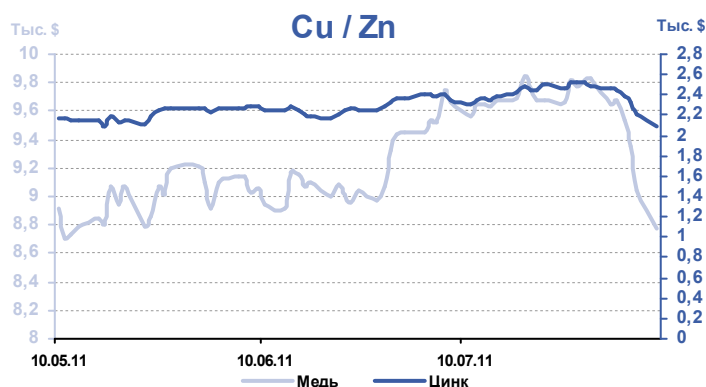
Сегодня мы узнаем, как собрание ФРС попытается успокоить рынки, и увенчаются ли их попытки успехом.

В Азии продолжается резкое снижение котировок: Nikkei -2,7%, Shanghai Composite -0,7%, KOSPI -4,8%. Тем не менее, курс EUR/USD выглядит достаточно стабильно 1,425 пункта. Это обусловлено тем, что ЕЦБ продолжает скупать государственные облигации Италии и Испании. На Pre-Market фьючерсы на фондовые индексы продолжают терять в цене. Цены на нефть Brent сегодня продолжают жестко проседать -2% (101,7 долларов за баррель).

Негативный внешний фон может обеспечить открытие индекса ММВБ с гэпом вниз на 5%. Мы сегодня вновь увидим новый годовой минимум. Уже несколько дней назад начала свою реализацию техническая фигура «Бриллиант», а это значит, что цель снижения находится возле 1400 пунктов по индексу ММВБ. Цены на золото вновь показывает исторические максимумы, а это означает, что акции «Полюс Золота» вновь будут покупать. Хуже рынка будут выглядеть акции финансового сектора («Сбербанк», ВТБ). Вполне вероятно, что из-за сильнейшего падения торги на бирже ММВБ будут приостановлены.

Сегодня в США в 15-30 публикуется индикатор оптимизма в сфере малого предпринимательства от NFIB за июль (прогноз 89.9), а в 16-30 публикуются данные по изменению уровня производительности рабочей силы в непроизводственном секторе за второй квартал (прогноз -0.6%кв/кв). В 22-15 произойдет публикация решения FOMC по основной процентной ставке

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	8 781,00	-2,88%	-9,01%	-9,11%	18,26%
Цинк, \$/t	2 091,00	-4,95%	-15,03%	-11,25%	-2,74%
Никель, \$/t	21 250,00	-5,58%	-13,44%	-11,05%	-6,80%
Олово, \$/t	22 505,00	-7,58%	-19,91%	-16,03%	5,66%
Алюминий, \$/t	2 385,50	-0,69%	-7,72%	-5,90%	9,33%
Свинец, \$/t	2 205,00	-6,61%	-14,04%	-18,90%	0,23%
Серебро, \$/oz	39,02	1,75%	-0,69%	6,30%	112,83%
Золото, \$/oz	1 719,53	3,35%	6,21%	11,36%	43,13%
Нефть Brent, \$/	103,46	-5,74%	-11,00%	-12,16%	28,09%
Нефть Urals, \$/	101,91	-5,63%	-11,87%	-13,39%	29,26%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PTC	Δ ММВБ	Объем на PTC, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, т\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,380	0,00%	-12,39%		29 406	193
БашИнСв	BISV	0,380	0,00%	-11,30%		14 774	350
БашЭнрг	BEGY	1,381	0,00%	-14,58%		14 191	1 451
ВМЗ	VSMZ	1623,119	0,00%	11,61%		83 250	2 859
ДВМП	FESH	0,384	0,00%	-10,96%		105 260	1 170
КазанскВЗ	KHEL	2,866	0,00%	-9,82%		12 072	459
Мечел	MTLR	19,616	0,00%	-5,32%		6 292 275	8 115
Мотовил	MOTZ	0,076	0,00%	-8,80%		8 899	74
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,730	-7,30%	0,00%	196 100		40 942
СилМашины	SILM	0,245	0,00%	-9,81%		34 124	2 174
СинТЗ-ао	SNTZ	48,006	0,00%	-11,08%		144	302
Славн-ЯНОС	JNOS	0,318	0,00%	-10,05%		7 610	301
СТЗ-ао	SVTZ	4,869	0,00%	-4,08%		487	234
ТАГМЕТ	TAMZ	0,658	0,00%	0,00%		66	335
ТНК-ВР	TNBP	2,732	0,00%	-9,18%		1 741 525	42 003
У-УАЗ	UUAZ	1,588	0,00%	-11,22%		72 099	439
ЧМК	CHMK	194,774	0,00%	-16,06%		23 103	635
ЧТПЗ	CHEP	2,694	0,00%	-5,89%		64 982	1 279
ЮжКузб.	UKUZ	47,008	0,00%	-17,77%		216 721	1 766

Нефть и газ

Башнефть	BANE	46,750	-9,22%	0,00%	1 115 250		7 955
Газпром	GAZP	6,040	-4,13%	-9,14%	272 000	662 429 370	142 988
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-6,98%	85 000	3 393 377	20 151
Лукойл	LKOH	63,750	0,00%	-4,08%	159 375	207 223 073	54 223
Мегионнефтегаз	MFGS	15,500	0,00%	0,00%	7 750		1 542
НОВАТЭК	NVTK	13,050	-8,74%	0,00%	196 250		39 624
Роснефть	ROSN	7,150	-6,54%	-7,73%	143 000	130 910 192	75 777
Сургутнефтегаз	SNGS	0,870	0,00%	-6,60%	87 000	39 198 900	31 082
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,520	0,00%	-6,91%	52 000	14 377 082	4 005
Татнефть	TATN	5,630	-7,70%	0,00%	1 428 000		12 266
Транснефть, п.	TRNFP	1575,000	0,00%	-11,29%	15 750	34 733 666	2 449

Электрэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,450	-14,71%	0,00%	14 500		1 512
Иркутскэнерго	IRGZ	0,725	0,00%	-9,52%		290 007	3 497
Ленэнерго	LSNG	0,515	0,00%	-16,36%		97 900	525
МОЭСК	MSRS	0,053	12,97%	-1,27%	35 093	2 671 863	2 589
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,045	0,00%	0,00%	22 500		1 473
ОГК-3	OGKC	0,047	0,00%	-16,39%	34 766	249 375	2 246
ОГК-4	OGKD	0,079	-12,00%	0,00%	90 937		4 993
ОГК-5	OGKE	0,080	-13,98%	-10,25%	40 000	840 629	2 759
ТГК-3	MSNG	0,075	-6,25%	-13,43%	18 750	1 104 221	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	-21,43%	-13,50%	6 996	36 752	406
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-13,80%	110 812	68 033	652

Телекоммуникации

МТС	MTSS	8,050	0,00%	0,00%	241 500		16 635
Ростелеком	RTKM	6,700	0,00%	-13,04%	67 000	12 734 867	19 720
Ростелеком, п.	RTKMP	3,050	0,00%	-12,62%	124 200	22 689 679	741
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	-10,78%		65 242	151

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,863	0,00%	-10,62%		350 819	1 207
ГАЗ	GAZA	45,000	0,00%	0,00%	45 000		833
ИРКУТ	IRKT	0,252	0,00%	-13,61%		50 023	256
Казанский ВЗ	KHEL	3,446	0,00%	0,00%	37 628		531
КАМАЗ	KMAZ	1,697	0,00%	-12,68%		285 283	1 238
ОМЗ	OMZZ	2,003	0,00%	-13,46%		75 714	73
РКК Энергия	RKKE	238,288	0,00%	-15,84%		103 369	271
Северсталь-авто	SVAV	12,600	-14,58%	-21,14%	12 600	1 077 165	432

Силовые машины	SILM	0,250	-7,41%	0,00%	6 250		2 177
УМПО	UFMO	0,630	-2,33%	0,00%	56 700		179

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,443	-3,80%	0,00%	22 125		221
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	145,000	-11,59%	-17,49%	108 750	1 864 600	1 672
Мечел	MTLR	20,500	0,00%	0,00%	9 307		8 534
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-9,72%	52 000	8 980 177	8 939
НЛМК	NLMK	2,980	0,00%	-10,53%		18 443 476	18 696
НорНикель	GMKN	236,200	-12,76%	-5,79%	1 354 978	207 705 253	45 026
Полиметалл	PMTL	20,800	0,00%	-6,37%	62 400	6 691 272	8 307
Полюс Золото	PLZL	57,800	0,00%	0,44%	259 850	20 660 990	11 018
Северсталь	CHMF	17,000	0,00%	-14,37%	17 000	78 486 020	17 131
ТМК	TRMK	3,712	0,00%	-7,70%		1 949 453	3 509
ЧМЗ	CHMZ	6,100	0,00%	0,00%	5 002		96
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346

Банки

Банк Москвы	MMBM	25,728	0,00%	-7,42%		118 199	4 578
Возрождение	VZRZ	34,000	0,00%	-7,69%	34 000	253 226	807
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-3,85%	15 097	139 578 122	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,086	0,00%	-7,96%		5 570	3 828
Сбербанк	SBER	3,080	-9,01%	0,00%	3 604 550		66 488

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	2,190	-3,95%	-9,53%	65 700	2 237 118	2 432
Дальневосточное МП	FESH	0,430	0,00%	0,00%	44 000		1 269
НМТП	NMTP	0,110	0,00%	-7,99%	109 820	206 379	2 115
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	-5,56%	15 500	32 306	123

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	-3,62%	41 000	25 018	6 220
Вимм-Билль-Данн	WBDF	133,303	0,00%	0,00%		11 731	5 865
Дикси	DIXY	12,000	-7,69%	-16,85%	12 000	551 833	1 497
Концерн Калина	KLNA	46,756	0,00%	-5,80%		64 370	300
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	-17,98%	10 100	5 233	93
Магнит	MGNT	120,000	-10,45%	-7,25%	151 250	8 543 829	10 677
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,867	0,00%	-17,70%		24 245	14
Разгуляй	GRAZ	1,371	0,00%	-13,68%		630 565	222
Седьмой континент	SCON	7,500	0,00%	0,00%	7 500		563
Фармстандарт	PHST	75,000	-9,64%	-8,13%	7 500	177 936	2 834
Черкизово	GCHE	24,174	0,00%	-12,51%		70 362	1 091

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,218	0,00%	0,00%	6 540		389
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	-11,64%	46 000	91 064	1 482
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	3,200	-5,88%	-8,49%	15 007	10 902 761	1 578
-----	------	-------	--------	--------	--------	------------	-------

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	45,000	0,00%	-10,32%	45 000	1 443 191	2 146
Дорогобуж	DGBZ	0,550	0,00%	-7,18%	27 500	158 652	397
Уралкалий	URKA	8,475	-8,18%	-6,23%	16 950	52 371 319	26 227

Уголь

Распадская	rasp	4,750	-23,51%	-17,48%	190 000	23 275 452	3 709
УК Южный Кузбасс	UKUZ	60,000	0,00%	0,00%	60 000		2 167

Источник: PTC, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	157,150	-5,62%	1,10
Башнефть	AK6		EUR	183,340	-2,99%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,880	-12,87%	46,14
ТГК-3	AOMD		USD	7,760	-4,14%	7,79
Татнефть	ATAD		USD	32,960	-8,70%	78 360,58
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,168	-9,46%	6,27
Бурятзолото	BYT		EUR	19,000	-1,04%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	25,990	-8,36%	94 078,80
X5	FIVE		USD	34,500	-5,48%	39 042,42
Газпром	GAZ		EUR	7,941	-12,25%	8 843,13
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,060	-1,64%	7,43
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	-2,60%	28,73
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,100	-1,59%	1,62
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,000	0,00%	31,20
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,900	0,00%	3,15
Лукойл	LKOD		USD	57,250	-5,53%	590 998,70
Лукойл	LUK		EUR	39,845	-4,64%	3 273,47
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,300	-8,90%	63 699,87
МТС	MBT	5	USD	16,150	-7,87%	139 060,70
МТС	MKY	5	EUR	11,805	-3,20%	0,89
МГТС	MOW		EUR	9,400	-1,05%	
ТГК-3	MRO		EUR	5,500	1,03%	41,01
Мечел	MTL	3	USD	19,110	-8,87%	165 118,50
НорНикель	NILSY	1	USD	21,990	-11,65%	3 190,40
НорНикель	NNIA		EUR	15,870	0,38%	802,14
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	129,800	-8,91%	112 475,20
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	2,280	0,31%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,300	-2,33%	
Газпром	OGZD		USD	11,700	-8,74%	887 351,40
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	-3,23%	
Ростелеком	RKMD		USD	31,990	-11,14%	1 188,93
Ростелеком	RTL		EUR	25,050	-9,32%	23,05
Газпромнефть	SCF		EUR	14,200	-5,99%	434,83
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,916	-7,53%	30,61
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,107	-5,30%	21,00
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,230	-11,88%	132,64
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,270	-9,62%	370,18
АФКСистема	SSA	1	USD	19,680	-11,71%	12 869,60
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,495	-5,27%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	29,820	-5,06%	
СТЗ	SVY		EUR	36,645	-4,76%	
ЦУМ	THT		EUR	14,200	-2,07%	
Ютэйр	TYV		EUR	33,500	-1,47%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	375,000	0,00%	132,94
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,940	-6,97%	85 520,17
ВТБ	VTBR		USD	5,295	-6,61%	210 975,60
Возрождение	VZY		EUR	22,800	-4,00%	

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.