

Комментарий по рынку акций

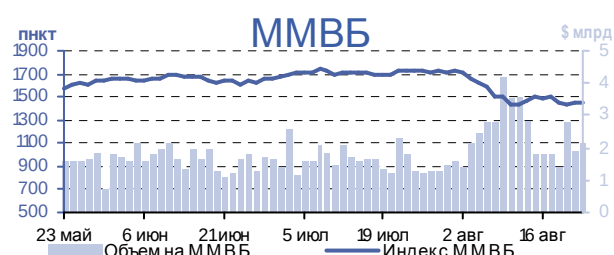
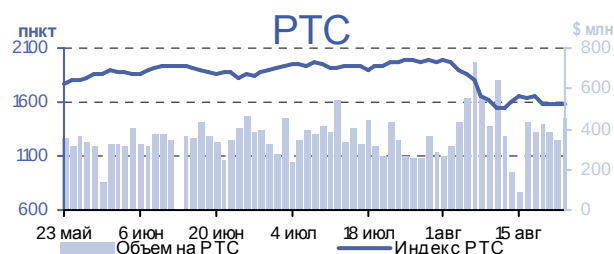
Несмотря на то, что вчера вечером в штате Виргиния США произошло довольно сильное для этих мест землетрясение магнитудой 5,8 баллов, американским фондовым индексам это не помешало показать очень хороший рост. Устав болтаться вблизи уровней поддержки заокеанские индексы полетели вверх, как за счет закрытия коротких позиций, так и на ожиданиях того, что в пятницу глава ФРС г-н Бернанке наметит о новых мерах по поддержке американской экономики, как это было год назад. Таким образом, эйфория на рынках может продлиться как раз до пятницы. Выходившая вчера статистика была удручающе слабой: индекс деловой активности в производственном секторе

Полный текст на 2 стр.

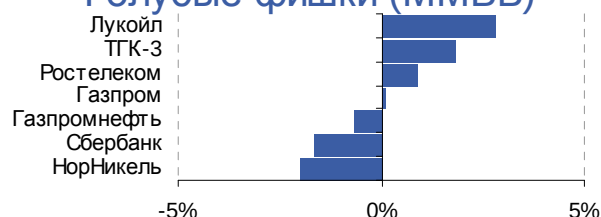
Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 578,91	0,03%	-3,27%	-20,13%	10,73%
Индекс ММВБ	1 444,11	0,01%	-2,50%	-16,47%	5,66%
FTSE	5 129,42	0,67%	-4,26%	-13,57%	-2,01%
S&P 500	1 162,35	3,43%	-2,55%	-13,58%	8,90%
Dow Jones Avg.	11 176,76	2,97%	-2,01%	-11,86%	9,85%

Основные индикаторы



Голубые фишки (ММВБ)

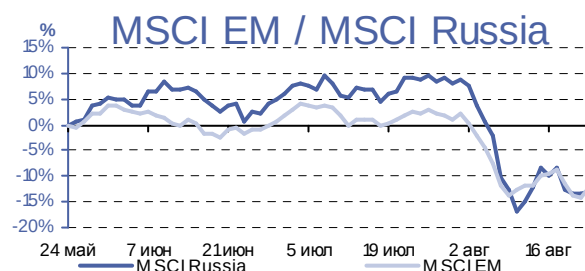


Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Аэрофлот	1,7500	-12,50%	-31,37%	-27,98%
Возрождение	29,9568	-6,82%	-9,22%	-28,25%
ОАО Группа ЛСР	25,3000	-1,56%	-29,72%	-9,35%
ОАО Компания М.видео	6,9000	-1,43%	-31,27%	-2,54%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	985,80	2,04%	-14,51%	-0,05%
Индекс MSCI BRAZIL	3024,89	2,12%	-14,26%	-9,41%
Индекс MSCI RUSSIA	827,06	0,45%	-20,23%	8,49%
Индекс MSCI INDIA	431,76	1,10%	-15,26%	-12,05%
Индекс MSCI CHINA	56,59	2,50%	-14,20%	-8,23%



Обзор рынка

Несмотря на то, что вчера вечером в штате Виргиния США произошло довольно сильное для этих мест землетрясение магнитудой 5,8 баллов, американским фондовым индексам это не помешало показать очень хороший рост. Устав болтаться вблизи уровней поддержки заокеанские индексы полетели вверх, как за счет закрытия коротких позиций, так и на ожиданиях того, что в пятницу глава ФРС г-н Бернанке наметит о новых мерах по поддержке американской экономики, как это было год назад. Таким образом, эйфория на рынках может продлиться как раз до пятницы. Выходившая вчера статистика была удручающе слабой: индекс деловой активности в производственном секторе Ричмонда снизился в августе до -10 п. (минимум с июня 2009 года) против -1 в июле; продажи новых домов в США в июле упали на 0,7% м/м, достигнув пятидесятилетнего минимума. Тем не менее, финансовый сектор акций на Уолл-стрит вчера выросли на 3,2%, отлично торговались и бумаги ведущих нефтяных компаний.

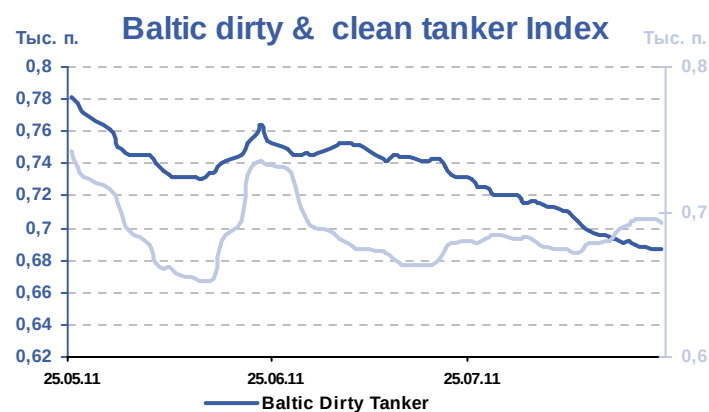
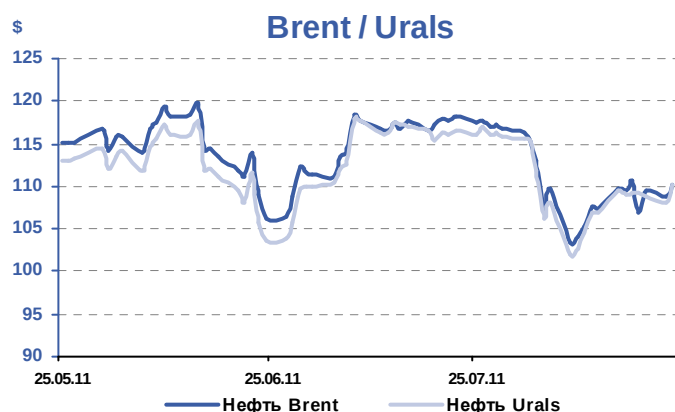
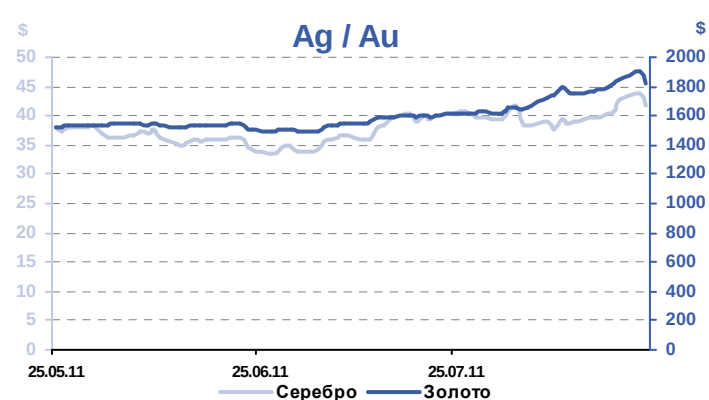
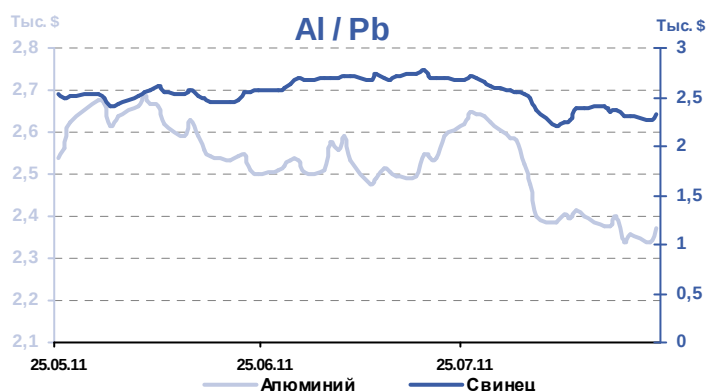
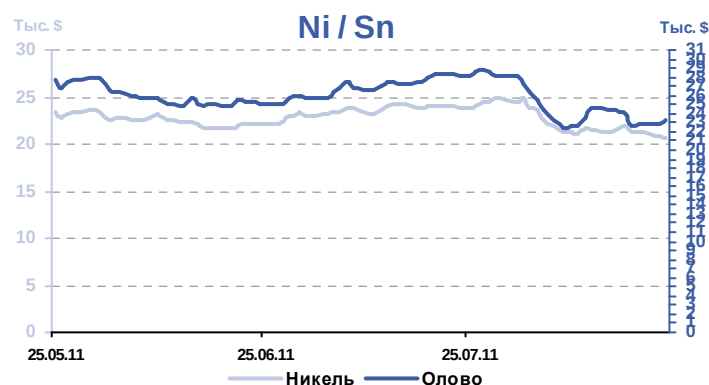
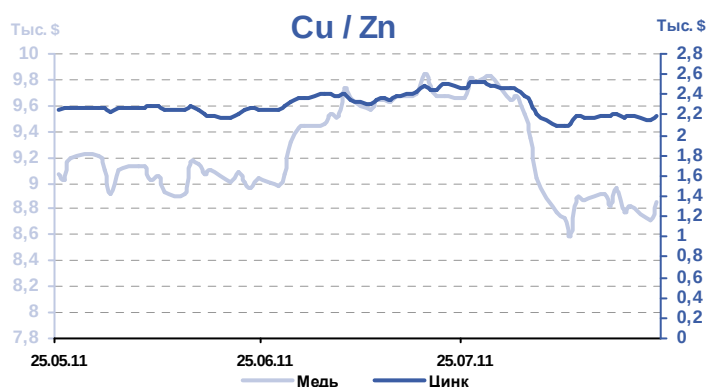
Агентство Moody's понизило рейтинг Японии до Аа3 в связи с продолжающимся ростом государственного долга страны и большим дефицитом бюджета. Рейтинговое агентство также собирается понизить рейтинг большинства японских банков. На этом фоне сегодня японский индекс Nikkei снижается на 0,2%. Интересно, что сегодня на торгах в Азии не видно большого оптимизма (MSCI Asia -0,7%) на фоне роста индексов в Штатах.

Цены на нефть марки Brent утром в среду (\$109,4/барр) торгуются примерно на полдоллара выше средних уровней вторника. Согласно данным API, запасы нефти в США сократились на 3,34 млн. барр, при этом, что запасы бензина выросли на 6,36 млн. барр.

В среду открытие торгов мы увидим с гэпом вверх около процента по ликвидным бумагам. Сильное закрытие торгов в Штатах накануне сегодня компенсируется неважной торговлей в Азии и падающими фьючерсами на американские индексы (S&P -0,98%). Поэтому сразу после открытия стоит ждать снижения в наших индексах, однако ближе к обеду мы рассчитываем увидеть разворот вверх. Точкой роста индекса ММВБ сегодня к вечеру может стать уровень 1470-75 п. Длинные позиции, открытие накануне, думаю, стоит поддержать, как минимум до закрытия рынка в четверг, а из ликвидных бумаг сильнее рынка могут быть акции Газпрома и Лукойла. Кстати, сегодня Газпром опубликует отчетность по МСФО за 1 квартал 2011 года и по факту выхода в акциях, возможно, возрастет волатильность. Магнит объявит финансовые результаты работы за первое полугодие 2011 года по МСФО.

Сегодня в 12-00 в Германии выходит индекс оптимизма в деловых кругах за август от института IFO (прогноз: 111 п.). В 13-00 ждем данных из еврозоны по объемам промышленных заказов в июне. В 16-30 в США будет опубликована статистика по объему заказов на товары длительного пользования за июль (прогноз: +2,1%). В 18-30 ждем данных по запасам нефти и нефтепродуктов в Америке

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	8 850,00	1,49%	0,23%	-8,53%	21,98%
Цинк, \$/t	2 190,00	1,72%	0,37%	-12,22%	7,14%
Никель, \$/t	20 660,00	-0,91%	-4,79%	-13,83%	-2,55%
Олово, \$/t	23 350,00	2,19%	-3,31%	-17,48%	14,13%
Алюминий, \$/t	2 371,00	1,45%	-0,17%	-8,46%	16,23%
Свинец, \$/t	2 335,00	3,27%	-0,89%	-13,20%	14,01%
Серебро, \$/oz	41,92	-4,21%	5,07%	4,57%	133,06%
Золото, \$/oz	1 828,35	-3,65%	2,39%	14,18%	49,11%
Нефть Brent, \$/	110,30	1,32%	0,69%	-6,75%	51,45%
Нефть Urals, \$/	110,16	1,85%	1,09%	-5,54%	51,99%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PTC	Δ ММВБ	Объем на PTC, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, т\$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,369	0,00%	1,78%		521 189	182
БашИнСв	BISV	0,395	0,00%	3,06%		4 210	367
БашЭнрг	BEGY	1,382	0,00%	-2,53%		846	1 470
ВМЗ	VSMZ	1780,848	0,00%	-0,27%		8 524	2 928
ДВМП	FESH	0,345	0,00%	-4,76%		103 310	1 041
КазанскВЗ	KHEL	2,913	0,00%	1,08%		1 708	432
Мечел	MTLR	17,743	0,00%	-2,39%		1 742 971	7 445
Мотовил	MOTZ	0,073	0,00%	0,00%		721	71
ОАО Выксунский металлур	VSMZ	1750,000	0,00%	0,00%	35 000		3 006
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,600	0,00%	0,00%	38 792		38 992
СилМашины	SILM	0,226	0,00%	0,54%		47 332	1 967
СинТЗ-ао	SNTZ	49,149	0,00%	1,64%		649	314
Славн-ЯНОС	JNOS	0,344	0,00%	2,57%		6 931	308
СТЗ-ао	SVTZ	4,663	0,00%	0,01%		140	224
ТАГМЕТ	TAMZ	0,593	0,00%	0,00%		59	302
ТНК-ВР	TNBP	2,554	0,00%	-1,19%		1 155 308	38 590
У-УАЗ	UUAZ	1,656	0,00%	-0,12%		127 365	444
ЧМК	CHMK	197,116	0,00%	0,11%		788	623
ЧТПЗ	CHEP	2,617	0,00%	1,70%		24 069	1 249
ЮжКузб.	UKUZ	45,602	0,00%	-0,72%		241 734	1 647

Нефть и газ

Башнефть	BANE	47,000	0,00%	0,00%	352 688		7 998
Газпром	GAZP	5,200	0,00%	0,10%	292 200	397 221 498	123 102
Газпромнефть	SIBN	4,250	0,00%	-0,66%	85 000	2 588 627	20 151
Лукойл	LKOH	52,800	0,00%	2,82%	745 300	144 854 803	44 910
Мегионнефтегаз	MFGS	15,500	0,00%	0,00%	7 750		1 542
НОВАТЭК	NVTK	12,810	0,00%	0,00%	441 745		38 895
Роснефть	ROSN	6,550	0,00%	-1,14%	131 000	100 289 343	69 418
Сургутнефтегаз	SNGS	0,750	0,00%	0,30%	347 000	28 424 919	26 794
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,400	0,00%	0,84%	145 000	6 365 311	3 119
Татнефть	TATN	5,600	0,00%	0,00%	12 320		12 092
Транснефть, п.	TRNFP	1285,000	0,00%	-1,44%	12 850	18 138 019	1 998

Электрэнергетика

Башкирэнерго	BEGY	1,350	0,00%	0,00%	13 500		1 408
Иркутскэнерго	IRGZ	0,769	0,00%	0,17%		30 668	3 637
Ленэнерго	LSNG	0,518	0,00%	-2,62%		11 973	480
МОЭСК	MSRS	0,053	0,00%	0,69%	35 093	262 346	2 589
Новосибирскэнерго	NVNG	22,145	0,00%	0,00%	3 012		299
ОГК-2	OGKB	0,043	0,00%	0,00%	126 362		1 391
ОГК-3	OGKC	0,037	0,00%	-0,71%	5 025	187 956	1 743
ОГК-4	OGKD	0,081	0,00%	0,00%	40 500		5 107
ОГК-5	OGKE	0,076	0,00%	4,22%	38 000	2 388 572	2 688
ТГК-3	MSGN	0,075	0,00%	1,83%	163 350	1 258 731	2 981
ТГК-5	TGKE	0,000	0,00%	-5,00%	8 696	24 452	357
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	0,09%	81 608	96 022	466

Телекоммуникации

МТС	MTSS	7,190	0,00%	0,00%	494 119		14 857
Ростелеком	RTKM	5,150	0,00%	0,89%	51 500	52 641 965	15 158
Ростелеком, п.	RTKMP	2,400	0,00%	-0,08%	48 000	5 880 365	583
Таттелеком	TTLK	0,007	0,00%	4,31%		1 401	154

Машиностроение

АвтоВАЗ	AVAZ	0,760	0,00%	-0,48%		328 047	1 074
ГАЗ	GAZA	34,550	0,00%	0,00%	54 275		640
ИРКУТ	IRKT	0,268	0,00%	-1,03%		26 926	265
КАМАЗ	KMAZ	1,441	0,00%	-1,60%		69 102	1 038
ОМЗ	OMZZ	1,806	0,00%	-0,21%		7 132	65
РКК Энергия	RKKE	240,374	0,00%	0,00%		2 698	253
Северсталь-авто	SVAV	13,600	0,00%	0,41%	9 030	133 425	466
Силовые машины	SILM	0,222	0,00%	0,00%	156 292		1 933

УМПО	UFMO	0,620	0,00%	0,00%	62 250		176
------	------	-------	-------	-------	--------	--	-----

Металлургия

АМЗ	AMEZ	0,443	0,00%	0,00%	22 125		221
Бурятзолото	BRZL	27,000	0,00%	0,00%	27 000		190
ВСМПО	VSMO	130,000	0,00%	0,59%	13 000	576 465	1 499
Мечел	MTLR	17,500	0,00%	0,00%	46 935		7 285
ММК	MAGN	0,800	0,00%	-1,52%	52 000	4 497 259	8 939
НЛМК	NLMK	2,650	0,00%	-1,85%	39 750	15 383 628	15 882
НорНикель	GMKN	230,500	0,00%	-2,01%	1 313 850	106 477 954	43 940
Полиметалл	PMTL	19,750	0,00%	2,55%	9 875	7 857 076	7 888
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	-0,08%	300 000	4 197 469	11 495
Северсталь	CHMF	15,250	0,00%	0,00%	53 361	61 008 619	15 116
ТМК	TRMK	3,150	0,00%	-3,93%	31 500	1 725 054	2 953
ЧМЗ	CHMZ	5,860	0,00%	0,00%	5 040		92
ЧТПЗ	CHEP	2,850	0,00%	0,00%	14 250		1 346

Банки

Банк Москвы	MMBM	29,186	0,00%	-1,52%		587	5 281
Возрождение	VZRZ	29,957	-6,82%	-0,57%	29 957	526 080	711
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	-0,56%	15 097	99 130 356	32 428
РОСБАНК	ROSB	3,454	0,00%	6,38%		11 205	4 173
Сбербанк	SBER	2,740	-0,83%	0,00%	374 268		59 148

Транспорт

Аэрофлот	AFLT	1,750	-12,50%	-1,70%	43 750	3 969 914	1 944
Дальневосточное МП	FESH	0,400	0,00%	0,00%	40 000		1 181
НМТП	NMTP	0,087	0,00%	-1,17%	5 264	68 254	1 676
Приморское МП	PRIM	0,155	0,00%	0,74%	15 500	282	123

Потребительский рынок

Аптечная сеть 36,6	APTK	2,600	0,00%	0,00%	26 000		273
Балтика	PKBA	41,000	0,00%	4,45%	41 000	132 947	6 220
Верофарм	VRPH	31,350	0,00%	0,00%	50 160		314
Вимм-Билль-Данн	WBDF	136,218	0,00%	0,00%		117 316	5 954
Дикси	DIXY	10,000	0,00%	-1,22%	10 000	163 051	1 216
Концерн Калина	KLNA	44,000	0,00%	-0,05%	30 800	23 830	283
Красный Октябрь	KROT	10,100	0,00%	2,86%	10 100	15 125	93
Магнит	MGNT	105,500	0,00%	0,20%	105 500	2 578 047	9 387
Нутринвестхолдинг	NTRI	0,854	0,00%	2,02%		12 323	14
Разгуляй	GRAZ	1,220	0,00%	-0,78%	12 200	131 178	193
Фармстандарт	PHST	68,000	0,00%	-0,24%	81 260	107 432	2 570
Черкизово	GCHE	24,000	0,00%	0,10%	24 000	14 786	1 034

Нефтехимия и нефтепереработка

Казаньоргсинтез	KZOS	0,175	0,00%	0,00%	26 500		312
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,920	0,00%	0,34%	46 000	655	1 482
Уфанефтехим	UFNC	5,510	0,00%	0,00%	387 900		1 528

Другие сектора

ПИК	pikk	3,930	0,00%	-1,65%	5 003	2 416 842	1 939
-----	------	-------	-------	--------	-------	-----------	-------

Химическая промышленность

Акрон	AKRN	41,000	0,00%	2,45%	20 500	924 734	1 955
Дорогобуж	DGBZ	0,560	0,00%	-0,02%	16 800	4 095	404
Уралкалий	URKA	8,475	0,00%	3,18%	16 950	31 074 641	26 227

Уголь

Распадская	rasp	4,500	0,00%	0,82%	122 026	6 545 133	3 514
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	125,900	-0,03%	5,09
Башнефть	AK6		EUR	154,280	-4,76%	
ТГК-3	AOMD		USD	7,330	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	31,150	-2,96%	30 254,04
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,510	-0,79%	
Бурятзолото	BYT		EUR	18,600	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,002	0,00%	
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	23,020	-2,54%	57 652,79
X5	FIVE		USD	34,420	1,24%	13 082,41
Газпром	GAZ		EUR	8,109	2,91%	1 474,07
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,031	4,60%	0,33
Иркутскэнерго	IRK		EUR	24,500	2,08%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	3,000	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,950	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,950	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	57,550	2,68%	328 201,40
Лукойл	LUK		EUR	38,350	0,99%	381,06
Лукойл	LUKOY	1	USD	58,850	6,71%	11 591,87
МТС	MBT	5	USD	15,850	2,32%	24 702,69
МТС	MKY	5	EUR	10,560	-0,28%	
МГТС	MOW		EUR	9,100	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	4,955	-1,12%	3,47
Мечел	MTL	3	USD	17,810	2,71%	41 554,40
НорНикель	NILSY	1	USD	22,050	0,68%	1 059,26
НорНикель	NNIA		EUR	15,250	-0,65%	115,84
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	122,800	-1,29%	43 211,54
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,910	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAQ		EUR	5,100	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	11,600	0,00%	417 703,60
ОМЗ	OMZD		USD	2,500	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,400	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	32,770	0,61%	7 148,66
Ростелеком	RTL		EUR	22,155	5,02%	5,67
Газпромнефть	SCF		EUR	14,350	1,06%	74,15
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,634	6,30%	1,81
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,200	6,31%	12,41
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,610	4,30%	125,78
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,060	1,64%	234,28
АФКСистема	SSA	1	USD	18,350	-0,54%	17 730,42
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	12,300	-0,81%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	29,600	-0,67%	
СТЗ	SVY		EUR	30,230	-2,42%	
ЦУМ	THT		EUR	14,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	31,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	286,530	0,00%	15,40
Вымпелком	VIP	1	EUR	10,910	3,02%	23 879,10
ВТБ	VTBR		USD	4,715	-0,13%	149 179,70
Возрождение	VZY		EUR	22,800	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.