

Комментарий по рынку акций

Во вторник мы ожидаем увидеть нейтральное открытие торгов на нашем рынке акций. Никаких новых ухудшений на мировых биржах, того момента, как вчера закрылась сессия на ММВБ, не случилось. Из новостей можно выделить лишь решение Moody's понизило рейтинги 28 испанских банков на 1-4 позиции после закрытия торгов на Уолл-стрит. Ни во фьючерсах на S&P (+0,2%), ни в валютной паре EUR/USD (1,25) движений по факту выхода этого сообщения мы не увидели.

Вчера наши фондовые индикаторы стали заложниками продаж, которые мы видели в Европе. Биржевые индексы в Мадриде и

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 227,65	-1,19%	-3,54%	-3,54%	-34,81%
Индекс ММВБ	1 298,08	-0,59%	1,29%	1,29%	-21,73%
FTSE	5 260,19	-1,14%	-1,71%	-1,71%	-10,05%
S&P 500	1 278,04	-2,46%	-3,02%	-3,02%	-2,66%
Dow Jones Avg.	12 118,57	-2,22%	-2,70%	-2,70%	-1,06%

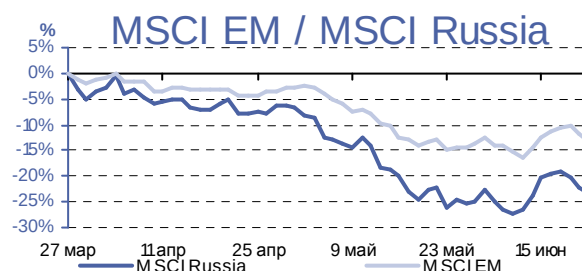
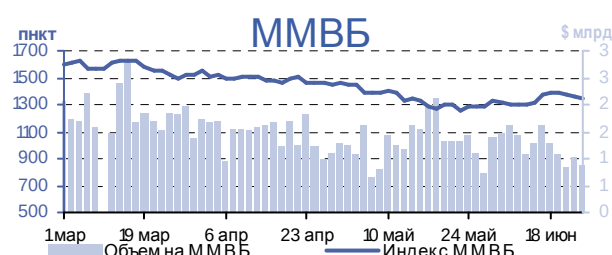
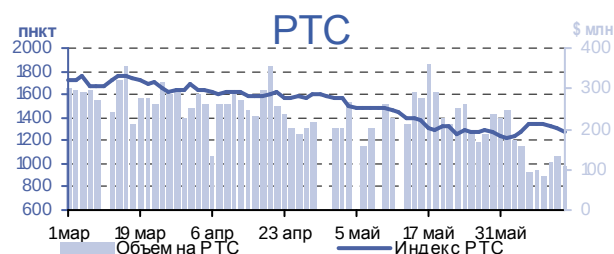
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	11,2000	-25,33%	-34,12%	-17,65%
Сбербанк	2,3300	-5,93%	-7,50%	-13,22%
Башнефть	46,0000	-5,15%	-9,80%	-2,13%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	893,86	-1,37%	-0,92%	-22,87%
Индекс MSCI BRAZIL	2477,57	-2,18%	-1,95%	-31,85%
Индекс MSCI RUSSIA	656,61	-1,22%	-2,87%	-34,25%
Индекс MSCI INDIA	344,35	-1,32%	-2,45%	-31,37%
Индекс MSCI CHINA	52,93	-0,69%	0,29%	-21,72%

Основные индикаторы



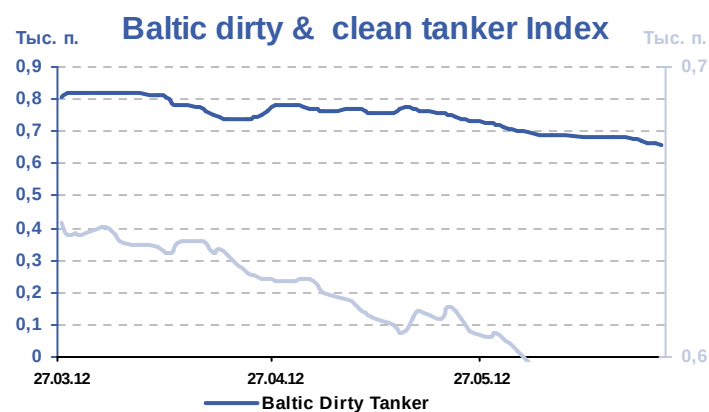
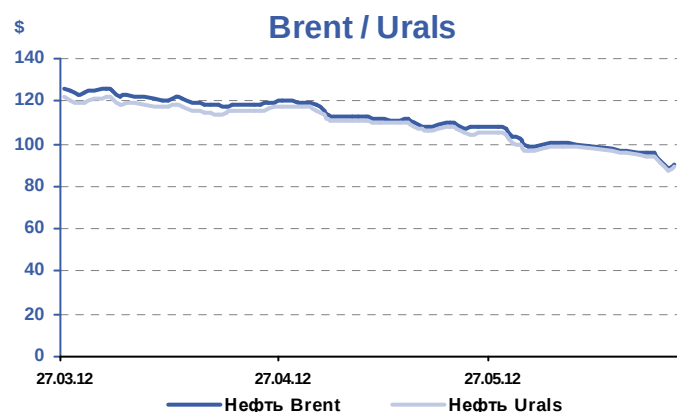
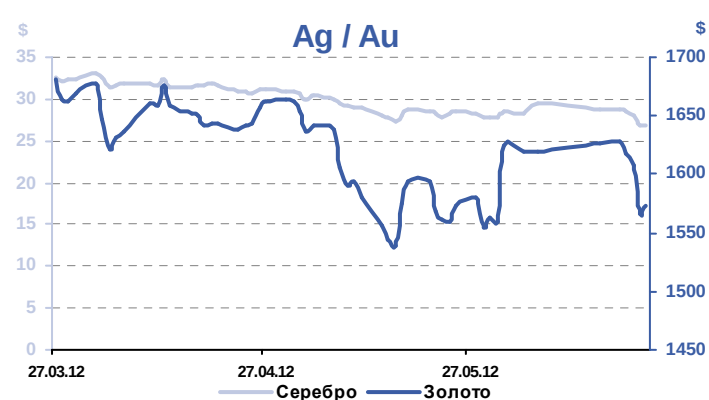
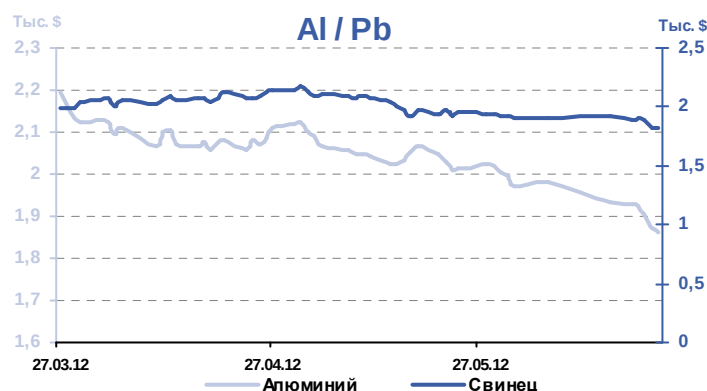
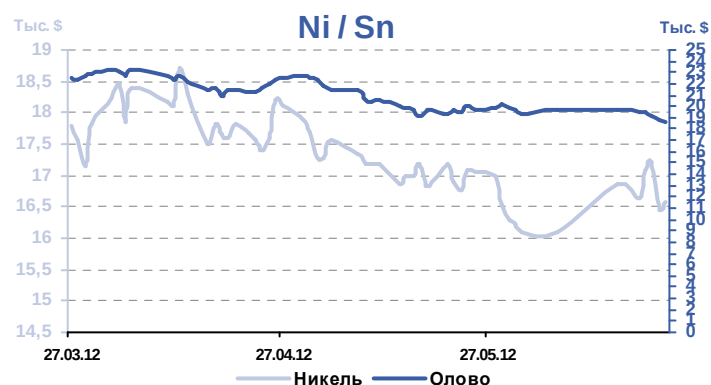
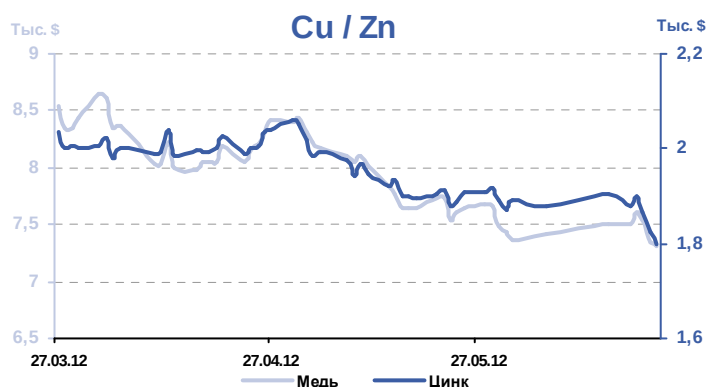
Обзор рынка

Во вторник мы ожидаем увидеть нейтральное открытие торгов на нашем рынке акций. Никаких новых ухудшений на мировых биржах, того момента, как вчера закрылась сессия на ММВБ, не случилось. Из новостей можно выделить лишь решение Moody's понизило рейтинги 28 испанских банков на 1-4 позиции после закрытия торгов на Уолл-стрит. Ни во фьючерсах на S&P (+0,2%), ни в валютной паре EUR/USD (1,25) движений по факту выхода этого сообщения мы не увидели.

Вчера наши фондовые индикаторы стали заложниками продаж, которые мы видели в Европе. Биржевые индексы в Мадриде и Милане рухнули в понедельник на 3,67 и 4,02 процентов соответственно. Формальным поводом для этого стал ряд новостей: Испания запросила ЕС предоставить финансовую помощь своим банкам (сумма составит немного больше прогноза); агентство Fitch снизило кредитный рейтинг Кипра (ожидаемое событие); пессимизм в части результатов предстоящего саммита лидеров стран ЕС (жесткая позиция Германии по вопросам евробондов не в новинку). Таким образом, новости понедельника просто способствовали отработке тех движений в фондовых индексах, которые они начали в конце прошлой недели.

Что касается российского рынка акций, то здесь можно выделить следующие основные моменты. В понедельник индекс ММВБ опустился ниже уровня поддержки (1350 п.) своего краткосрочного восходящего тренда начатого месяц назад, опять вступив на «медвежью» территорию. Стабилизация в ценах на нефть (Brent \$90,8/барр) привела не только к консервации курса рубля на внутреннем валютном рынке (USD/RUR 33,25), но и к очень сдержанной просадке наших фондовых индексов (вчера снижались без агрессии). Три раза за сессию индекс ММВБ пытался пробиться ниже отметки 1327 п. и пока это не удалось. Чуть более низкий диапазон поддержки проходит через отметки 1320-1315 п. С учетом того, что вчера европейские индексы показали хороший ход вниз, сегодня там стоит ждать волатильной сессии и остановки снижения, что может позитивно сказаться и на нашем рынке акций. Фьючерс на индекс РТС на сегодня имеет в качестве поддержки уровень 125 т.п., в то время как наклонное сопротивление нисходящего движения начатого в середине прошлой недели сместилось уже к отметке 127500 п. Консолидация сегодня – хороший признак того, чтобы ближе к концу недели пойти вверх.

Commodities



Основные товары, SPOT (LSE, NYSE)

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед, %	Δ за мес, %	Δ ytd, %
Медь, \$/t	7 361,00	-0,86%	-3,64%	-3,64%	-17,48%
Цинк, \$/t	1 890,00	1,04%	-0,97%	-0,97%	-14,86%
Никель, \$/t	16 100,00	-0,80%	-5,57%	-5,57%	-28,68%
Олово, \$/t	19 395,00	-1,05%	-1,85%	-1,85%	-27,09%
Алюминий, \$/t	1 972,50	-1,08%	-2,04%	-2,04%	-24,60%
Свинец, \$/t	1 900,00	-1,09%	-2,56%	-2,56%	-21,00%
Серебро, \$/oz	28,51	2,92%	-0,05%	-0,05%	-21,19%
Золото, \$/oz	1 624,10	4,08%	3,25%	3,25%	5,90%
Нефть Brent, \$/	98,81	-3,20%	-8,47%	-8,47%	-14,66%
Нефть Urals, \$/	96,86	-2,96%	-7,59%	-7,59%	-14,74%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PTC	Δ ММВБ	Объем на PTC, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, m\$
ОАО Мотовилихинские зав	MOTZ	0,135	0,00%	0,00%	6 750		134
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,060	-15,92%	0,00%	227 000		30 894
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	46,000	-5,15%	0,00%	92 000		7 828
Лукойл	LKOH	53,650	0,00%	0,00%	105 650		45 633
Транснефть, п.	TRNFP	1315,000	0,00%	0,00%	305 580		2 045
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,440	0,00%	0,00%	88 000		2 097
Машиностроение							
Северсталь-авто	SVAV	11,200	-25,33%	0,00%	33 074		384
Металлургия							
Бурятзолото	BRZL	18,500		0,00%	13 542		130
ВСМПО	VSMO	149,000	0,00%	0,00%	6 705		1 718
Северсталь	CHMF	11,644	0,00%	0,00%	46 390		11 733
Банки							
Сбербанк	SBER	2,330	-5,93%	0,00%	3 617 466		50 298
Транспорт							
Дальневосточное МП	FESH	0,292	0,00%	0,00%	43 845		863
Потребительский рынок							
Дикси	DIXY	9,220	0,00%	0,00%	31 697		1 150
Магнит	MGNT	102,000	0,00%	0,00%	102 000		9 645
Фармстандарт	PHST	44,730	0,00%	0,00%	10 064		1 690
Черкизово	GCHE	15,750	0,00%	0,00%	1 000 125		692
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,800		0,00%	8 000		1 289
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	33,700	0,00%	0,00%	203 885		1 607

Источник: PTC, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	103,195	3,73%	
Башнефть	AK6		EUR	182,910	-0,10%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	0,240	-29,41%	2,26
ТГК-3	AOMD		USD	4,450	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	29,290	-3,87%	16 287,10
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	1,939	0,31%	0,49
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	22,030	-0,27%	13 466,15
Газпром	GAZ		EUR	7,063	-0,42%	1 803,51
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,028	19,57%	1,56
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,500	0,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	3,500	-32,69%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,501	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	51,850	-0,10%	264 127,60
Лукойл	LUK		EUR	41,635	-0,55%	482,90
Лукойл	LUKOY	1	USD	51,800	-0,76%	7 245,66
МТС	MBT	5	USD	16,380	-1,56%	53 705,97
МТС	MKY	5	EUR	13,210	-0,94%	7,18
ТГК-3	MRO		EUR	3,400	0,00%	0,61
Мечел	MTL	3	USD	5,270	-0,75%	19 931,05
НорНикель	NILSY	1	USD	14,400	-3,49%	204,37
НорНикель	NNIA		EUR	11,600	-3,61%	161,79
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	94,300	-0,74%	81 035,48
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,600	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	8,730	-0,40%	371 962,70
ОМЗ	OMZD		USD	1,200	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	4,500	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	19,000	-1,04%	5 916,78
Ростелеком	RTL		EUR	15,350	-0,90%	0,46
Газпромнефть	SCF		EUR	15,300	-3,65%	17,32
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	5,873	-2,02%	48,31
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,754	-2,77%	7,44
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	4,750	-4,62%	2 363,44
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	7,430	-2,75%	41,53
АФКСистема	SSA	1	USD	16,270	-4,74%	20 750,63
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,786	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,973	-1,59%	
СТЗ	SVY		EUR	25,000	-3,85%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	121,000	0,00%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	7,230	-1,90%	22 123,43
ВТБ	VTBR		USD	3,055	-2,71%	30 198,87
Возрождение	VZY		EUR	11,800	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

Наумов Александр
электроэнергетика

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hnp@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@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.