

Комментарий по рынку акций

В четверг торги на нашем рынке акций откроются в нейтральной зоне. Небольшой позитив от нейтрального закрытия торгов в Штатах и от подъема цен на нефть (Brent \$100,2/барр) сегодня утром нивелируется снижением фондовых индексов в Азии (MSCI Asia -1,8%), что утянуло вниз американские фьючерсы (S&P -0,3%). Несмотря на то, что вчера вечером пара EUR/USD опустилась до нового двухлетнего минимума, цены на нефть марки Brent поднялись на фоне неожиданного снижения коммерческих запасов нефти в США (-4,7 млн. барр.). Все эти факторы не дают однозначного ответа на вопрос по поводу динамики нашего рынка сегодня днем.

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 355,86	-0,52%	-3,72%	6,13%	-29,26%
Индекс ММВБ	1 405,15	-1,23%	-2,71%	7,00%	-17,63%
FTSE	5 664,48	0,01%	-0,35%	5,21%	-3,48%
S&P 500	1 341,45	0,00%	-2,37%	2,00%	2,12%
Dow Jones Avg.	12 604,53	-0,38%	-2,62%	1,53%	1,27%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Северсталь-авто	14,0000	7,95%	25,00%	8,89%

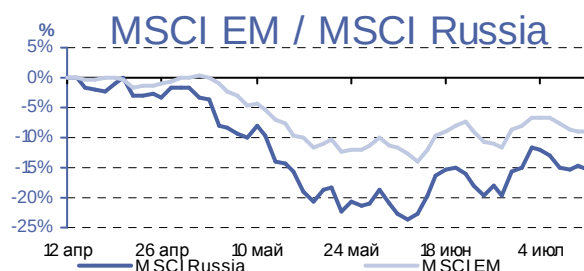
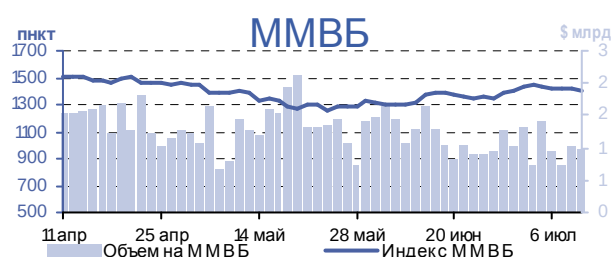
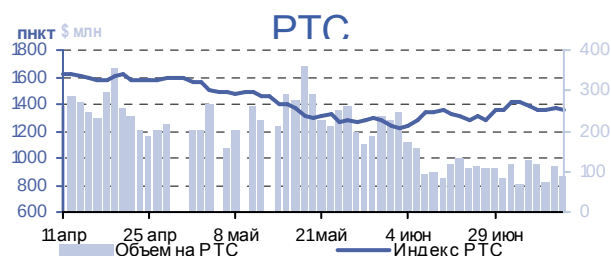
Лидеры снижения

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Башнефть	46,2500	-1,60%	0,54%	-10,19%
Сбербанк	2,7650	-1,07%	18,67%	-0,90%

Индекс MSCI

	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	932,38	-0,20%	3,30%	-16,85%
Индекс MSCI BRAZIL	2517,69	-0,01%	-0,88%	-27,23%
Индекс MSCI RUSSIA	728,15	-0,62%	5,47%	-27,30%
Индекс MSCI INDIA	378,31	-0,75%	5,81%	-23,86%
Индекс MSCI CHINA	53,21	-0,18%	1,87%	-16,27%

Основные индикаторы



Обзор рынка

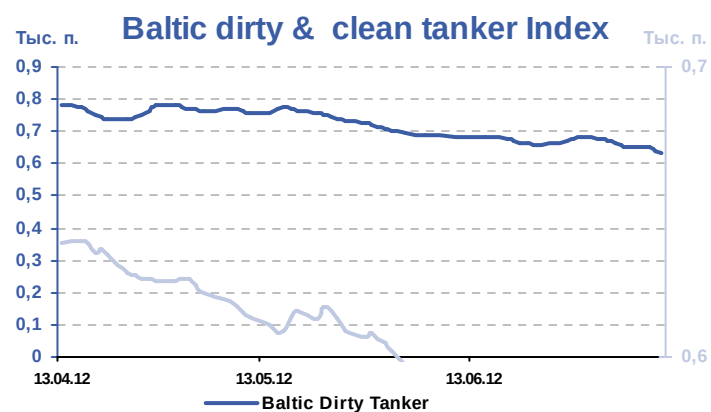
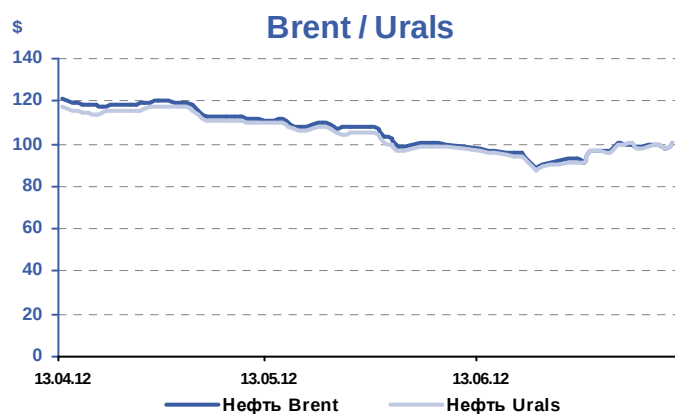
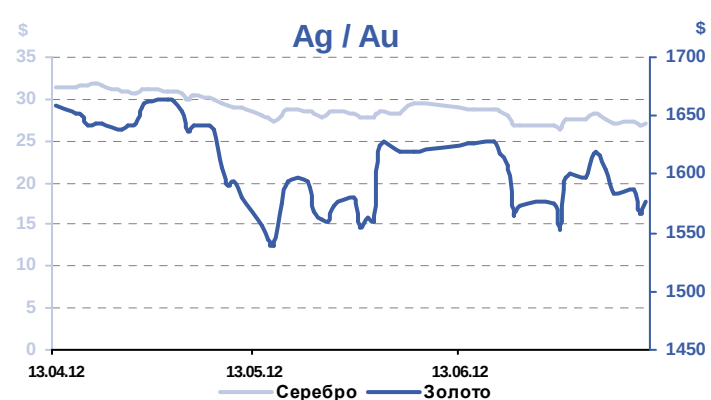
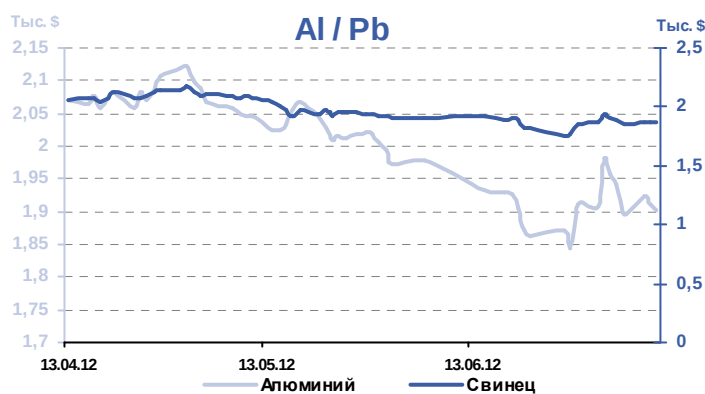
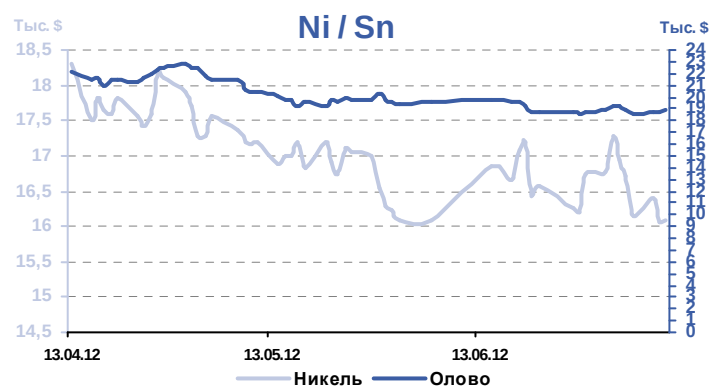
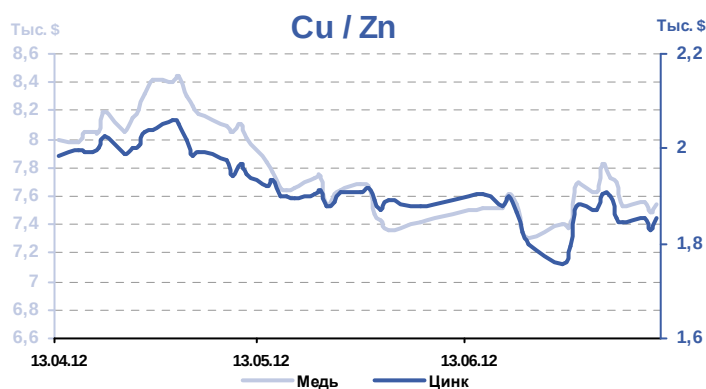
В четверг торги на нашем рынке акций откроются в нейтральной зоне. Небольшой позитив от нейтрального закрытия торгов в Штатах и от подъема цен на нефть (Brent \$100,2/барр) сегодня утром нивелируется снижением фондовых индексов в Азии (MSCI Asia -1,8%), что утянуло вниз американские фьючерсы (S&P -0,3%). Несмотря на то, что вчера вечером пара EUR/USD опустилась до нового двухлетнего минимума, цены на нефть марки Brent подняться на фоне неожиданного снижения коммерческих запасов нефти в США (-4,7 млн. барр.). Все эти факторы не дают однозначного ответа на вопрос по поводу динамики нашего рынка сегодня днем.

Вчера индекс ММВБ получил поддержку на уровне 1395 п. и формально он пока остается в растущем тренде, но с учетом того, что последние два дня мы торговались слабее наших европейских коллег по цеху, наша дальнейшая устойчивость – под большим вопросом. Фьючерс РТС сейчас застрял в сужающемся треугольнике с границами 135500 сверху и 133500 п. снизу. Уход ниже означает продолжение снижения до 131000 п.

В попытке раскатать экономическую активность в стране Центральный Банк Бразилии вчера сократил процентную ставку с 8,5% до нового минимума 8,0%. Сегодня Банк Кореи также понизил ставку с 3,25% до 3,00%, поскольку рост экономики Южной Кореи не оправдывает ожиданий. Это первое понижение ставки за 3 с лишним года. В связи с тем, что недавно аналогичные меры мы видели со стороны Китая, инвесторы сейчас с тревогой ждут завтрашней макроэкономической статистики из Поднебесной по росту ВВП за 2 квартал, объемам промышленного производства в июне, а также данных по розничным продажам. Не осознав реальный масштаб и темпы охлаждения одной из крупнейших экономик мира, крупные инвесторы предпочтут занять на фондовых рынках выжидательную позицию.

Сегодня в 13-00 в еврозоне выходят данные по объемам промышленного производства за май. В это же время итальянский Минфин проведет аукцион по продаже 12-месячных облигаций на сумму 7,5 млрд евро. В 16-30 в США будут опубликованы данные по числу обращений за пособием по безработице, а также данные по ценам на экспорт и импорт за июнь

Commodities



Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, \$	Δ PTC	Δ ММВБ	Объем на PTC, \$	Объем на ММВБ, \$	Капитализация, m\$
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,360	0,00%	0,00%	236 023		35 396
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	46,250	-1,60%	0,00%	23 125		7 870
Газпром	GAZP	4,750	0,00%	0,00%	474 000		112 449
Лукойл	LKOH	55,600	0,00%	0,00%	222 400		47 291
Транснефть, п.	TRNFP	1470,770	0,00%	0,00%	16 178		2 287
Машиностроение							
Северсталь-авто	SVAV	14,000	7,95%	0,00%	14 000		480
Металлургия							
Северсталь	CHMF	11,978	0,00%	0,00%	20 710		12 070
Банки							
Сбербанк	SBER	2,765	-1,07%	0,00%	276 500		59 688
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	1,320		0,00%	13 200		1 466
Потребительский рынок							
Балтика	PKBA	45,250	0,00%	0,00%	94 799		7 063
Дикси	DIXY	10,000	0,00%	0,00%	100 000		1 248
Магнит	MGNT	110,000	0,00%	0,00%	55 000		10 402
Нефтехимия и нефтепереработка							
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,900	0,00%	0,00%	45 000		1 450
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	39,200	0,00%	0,00%	52 920		1 589
Уголь							
Распадская	rasp	2,510	0,00%	0,00%	71 215		1 960

Источник: PTC, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акции в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, к\$
Аэрофлот	AETG		EUR	108,000	0,00%	
Башнефть	AK6		EUR	180,480	-1,91%	
ТГК-3	AOMD		USD	4,100	0,00%	
Татнефть	ATAD		USD	34,680	-1,64%	5 586,62
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	2,016	7,81%	53,98
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,003	0,00%	
X5	FIVE		USD	22,500	0,90%	22 909,51
Газпром	GAZ		EUR	7,606	-0,51%	557,96
ГолденТелеком	GLDN	1	USD	0,014	-12,50%	0,49
Кузбассэнерго	KUW		EUR	1,320	-12,00%	
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	4,600	31,05%	45,95
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	0,501	0,00%	
Лукойл	LKOD		USD	55,150	-0,45%	106 589,40
Лукойл	LUK		EUR	44,785	0,06%	143,41
Лукойл	LUKOY	1	USD	55,380	0,93%	1 863,03
МТС	MBT	5	USD	17,080	-0,87%	28 251,60
МТС	MKY	5	EUR	13,925	-0,78%	
ТГК-3	MRO		EUR	3,340	0,00%	2,87
Мечел	MTL	3	USD	6,080	1,84%	13 236,59
НорНикель	NILSY	1	USD	16,050	0,88%	234,08
НорНикель	NNIA		EUR	13,035	-0,50%	32,09
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	106,500	0,57%	28 176,29
Nizhnednepr.tubeRoll.Plant	NYZ		EUR	1,520	0,00%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	6,800	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	9,350	-0,53%	284 186,80
ОМЗ	OMZD		USD	1,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	21,720	-0,37%	1 094,99
Ростелеком	RTL		EUR	17,415	-1,89%	
Газпромнефть	SCF		EUR	18,620	-0,03%	14,04
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	6,691	-1,63%	
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	4,666	-2,28%	0,09
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,910	1,55%	76,61
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	8,410	0,60%	73,44
АФКСистема	SSA	1	USD	19,100	1,60%	8 265,39
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	8,881	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	2,440	-0,89%	
СТЗ	SVY		EUR	26,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	109,520	4,75%	
Вымпелком	VIP	1	EUR	8,030	3,61%	9 774,84
ВТБ	VTBR		USD	3,361	-2,47%	36 581,67
Возрождение	VZY		EUR	11,250	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.