УНИВЕР капитал

Daily

27 сентября 2012 г.

Ежедневный утренний обзор итогов торгов на мировых фондовых, валютных и товарных биржах, анонс важнейших макроэкономических событий

Внешний фон на начало торгового дня **умеренно позитивный**.

Нефть дорожает и находится в районе $111 за баррель Brent, фьючерсы на американские индексы растут на фоне небольшого контанго.

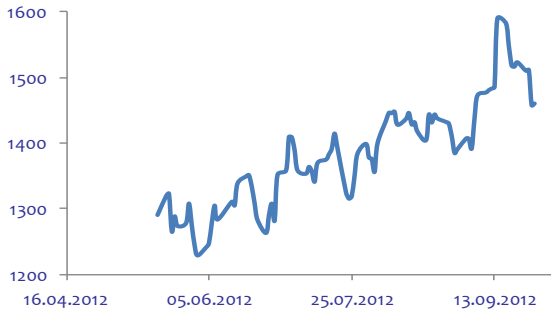
В Азии динамика торгов с утра также позитивная, хотя рост в среднем не превышает полпроцента.

На долговом рынке Европы после серии успешных размещений ситуация остаётся стабильной, суверенный спрэд на Россию немного сузился и находится в районе 145 б.п.

После того как американским индексам удалось удержаться на локальной поддержке, мы ожидаем развития восходящего движения после открытия гэпом вверх. Хорошо будут смотреться **металлурги, ФСК** и **Холдинг МРСК**, а также банки. Возможны спекулятивные покупки в **Новатэке**.

Сегодня довольно много статистики, но основное внимание будет обращено к данным по ВВП США, выходящим в 16:30 по Москве – если цифры окажутся меньше 1,7%, рынки могут вновь развернуться вниз и в этом случае короткие позиции по металлургическим и банковским бумагам могут стать хорошим решением. Тем не менее, наш базовый сценарий предполагает, что статданные сегодня будут способствовать подтверждению наметившегося разворота вверх.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13414	-0,33 %	+2,2 %	+9,8 %
S&P 500	1433	-0,57 %	+1,6 %	+14,0 %
NASDAQ	3094	-0,77 %	+0,7 %	+18,8 %
Mexico Bolsa	40333	+0,29 %	+0,9 %	+8,8 %
Brazilian Bovespa	60478	-0,04 %	+4,1 %	+6,6 %
Argentina Merval	2461	-2,86 %	+0,0 %	-0,1 %
FTSE	5768	-1,56 %	-0,1 %	+3,5 %
DAX	7277	-2,00 %	+3,3 %	+23,4 %
CAC	3415	-2,82 %	-1,4 %	+8,1 %
NIKKEI	8928	+0,24 %	-1,7 %	+5,6 %
Hang Seng	20742	+1,04 %	+4,8 %	+12,5 %
Korea Composite	1988	+0,37 %	+3,6 %	+8,9 %
MSCI EM	990	-1,15 %	+3,1 %	+8,1 %
РТС	1460	-3,57 %	+2,0 %	+5,6 %
ММВБ	1448	-2,51 %	-0,0 %	+3,3 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,17	+0,5 %	+2,4 %	+3,1 %
Евро/Рубль	40,22	+0,2 %	-0,8 %	+3,8 %
Евро/Доллар	1,2894	+0,2 %	+3,2 %	-0,5 %
Евро/Фунт	0,79627	+0,0 %	-0,6 %	+4,7 %
Доллар/Йена	77,76	-0,0 %	+1,3 %	-1,1 %
Доллар/Франк	0,938	+0,2 %	+2,4 %	+0,0 %
Доллар/Новозел.	1,2097	-0,3 %	-2,2 %	-6,0 %
Евро/Австрал.	0,9599	-0,5 %	-0,5 %	-2,0 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

27 сентября 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	110,2	+0,1 %	-1,9 %	+2,6 %
WTI	90,3	+0,3 %	-5,4 %	-8,7 %
Urals	108,5	-0,4 %	-4,5 %	+2,6 %
Sib. Light	109,8	-0,4 %	-4,7 %	+0,8 %
REBCO	106,42	-1,5 %	-5,4 %	+3,3 %
Никель	17930	-1,9 %	+9,1 %	-1,9 %
Медь	8131	-1,3 %	+7,0 %	+7,6 %
Алюминий	2049	-1,0 %	+9,5 %	+4,0 %
Олово	20995	-1,9 %	+3,3 %	+10,8 %
Свинец	2273	-0,5 %	+17,0 %	+14,8 %
Цинк	2068	-1,1 %	+12,6 %	+13,1 %
Сталь	346	-1,3 %	-1,3 %	-38,2 %
Золото	1744,75	-1,5 %	+4,7 %	+14,0 %
Платина	1621	-0,7 %	+5,5 %	+19,7 %
Палладий	624	-2,7 %	-3,0 %	-1,0 %
Серебро	33,9	-0,4 %	+11,6 %	+20,2 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	149,00	+7,97 %	+4,20 %	-44,81 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-1,45 %
Газпром нефть	-0,16 %
ЛУКОЙЛ	-0,54 %
Роснефть	-0,76 %
Ростелеком	-0,42 %
Система	+31,80 %
Газпром	-0,84 %
Сбербанк	+0,17 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

12:30 – ВВП Великобритании во 2К 2012 г.
13:00 – Индекс настроений в экономике Еврозоны в сентябре.
16:30 – ВВП США во 2К 2012 г; первичные заявки на пособие за неделю; реальные продажи во 2К 2012 г; прибыли компаний во 2К 2012 г; заказы на товары длительного пользования в августе.
18:00 – Индекс подписанных договоров на продажу жилья в августе.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	29,2%	0,3
VTB BANK	31.10.2012	-0,1%	0,1
SBERBANK	15.05.2013	0,9%	0,6
TRANSNEFT	07.08.2013	0,8%	0,8
TNK-BP FINANCE	13.03.2013	0,5%	0,4
GAZPROM	31.07.2013	0,9%	0,8
RSHB CAPITAL SA	16.05.2013	1,2%	0,6
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	1,9%	1,9
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	2,2%	0,5
VIMPELCOM	30.04.2013	2,1%	0,6
SEVERSTAL OAO	29.07.2013	1,2%	0,8
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,2%	0,7
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,2%	2,0
PROMSVYAZBK	15.07.2013	3,8%	0,7
GAZPROM	29.11.2015	2,8%	2,9
SBERBANK	07.07.2015	2,4%	2,5
GAZPROM	23.05.2016	3,1%	3,3
NOVATEK OAO	03.02.2016	3,1%	3,0
VTB BANK	04.03.2015	3,4%	2,2
TNK-BP FINANCE	18.07.2016	3,0%	3,3
GAZPROMBANK	08.05.2016	4,7%	3,1
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	5,3%	3,3
VIMPELCOM	02.02.2016	4,6%	3,0

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,38	-0,48 %	-2,96 %	-6,45 %
Газпром нефть	23,74	+0,54 %	+1,02 %	+1,02 %
ЛУКОЙЛ	60,90	+0,32 %	+3,22 %	+15,01 %
Роснефть	6,50	+0,30 %	+4,50 %	-1,52 %
Ростелеком	25,61	-0,67 %	+8,24 %	-9,22 %
Система	21,53	-0,81 %	+7,38 %	+28,08 %
Газпром	10,01	-0,10 %	+2,14 %	-6,10 %
Сбербанк	11,67	+0,25 %	-0,43 %	+17,64 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0534	-3,73 %	-4,04 %	-9,23 %
Газпром нефть	148,24	-1,28 %	-0,12 %	+0,04 %
ЛУКОЙЛ	1908,70	-1,73 %	+1,46 %	+12,06 %
Роснефть	204,18	-2,25 %	+2,00 %	-4,58 %
Ростелеком	133,62	-2,49 %	+6,62 %	-12,30 %
Система	25,46	-2,31 %	+0,63 %	+8,74 %
Газпром	157,34	-2,12 %	+0,65 %	-8,19 %
Сбербанк	90,79	-3,18 %	-2,25 %	+14,42 %

©2012, Универ Капитал

Контакты:

Центральный офис:

г. Москва

123317, г. Москва, Пресненская набережная, дом 10 («Башня на набережной» комплекса «Москва-Сити»), блок Б, 18 этаж

Телефон: (495) 792-55-54 (многоканальный)



www.univer.ru

Brokerage

Иконникова Юлия
тел.: (495) 792-555-0 доб. 2271
e-mail: Yikonnikova@univer.ru

Клюкин Артём
Телефон: (495) 792-555-0, доб. 2272
E-mail: aepishkin@univer.ru

Душек Александр
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 2282
E-mail: adushek@univer.ru

Домнин Виктор
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 2256
E-mail: vdomnin@univer.ru

Сапатова Мария
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 2257
E-mail: msapatova@univer.ru

Лицензия ФСФР №077-12601-100000 профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности от 09.10.2009 г.
Лицензия ФСФР № 1515 Биржевого посредника, совершающего товарные фьючерсные и опционные сделки в биржевой торговле от 01.07.2010 г.
Лицензия ФСФР №077-12604-010000 профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности от 09.10.2009 г.
Лицензия ФСФР №077-12895-000100 профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности от 02.02.2010 г.

©2012, Универ Капитал