УНИВЕР капитал

Daily

1 октября 2012 г.

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

Внешний фон на начало торгового дня нейтральный.

Нефть по-прежнему стабильна в районе $111-112 за баррель Brent, фьючерсы на американские индексы снижаются на фоне бэквордации.

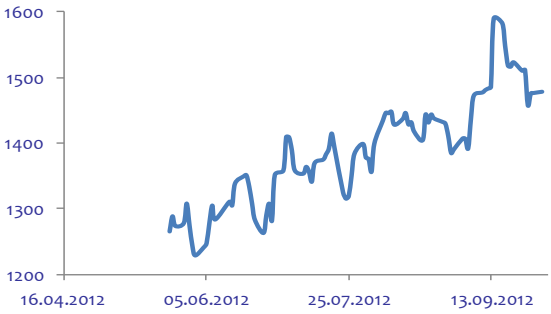
В Азии динамика торгов с утра смешанная.

На долговом рынке Европы ситуация остаётся устойчивой, несмотря на растущие спекуляции вокруг испанских проблем и заявлений агентства Moody's о готовности снизить суверенный рейтинг страны, значительных изменений доходностей нет. Суверенный спрэд на Россию немного сузился и находится в районе 130 б.п.

Наступающий день принесёт данные о безработице в еврозоне и выступление Б. Бернанке, которое несомненно должно оказать влияние на рынок. Сильная просадка по американским фьючерсам является, на наш взгляд, предвестником как минимум сильного движения вверх во второй половине дня. Председатель ФРС также постарается построить своё выступление в позитивной риторике. Кроме того, прошло уже 2 недели с момента объявления о запуске третьего раунда QE, что является достаточным для сокращения резервов по соответствующим ипотечным активам и увеличения лимитов на покупки активов, в том числе рисковых. В такой ситуации покупки становятся предпочтительными.

Финансовый сектор будет одним из лучших кандидатов на подъём. В Мечеле ожидание отчётности за 2К 2012 г. будет способствовать росту ликвидности и спекулятивная покупка на просадке бумаги оправдана, поскольку негативные ожидания по отчётности, вплоть до получения квартального убытка, уже заложены в рынок.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13437	-0,36 %	+2,6 %	+10,0 %
S&P 500	1441	-0,45 %	+2,4 %	+14,6 %
NASDAQ	3116	-0,65 %	+1,6 %	+19,6 %
Mexico Bolsa	40867	+0,34 %	+3,7 %	+10,2 %
Brazilian Bovespa	59176	-1,77 %	+3,7 %	+4,3 %
Argentina Merval	2452	-1,70 %	+1,8 %	-0,4 %
FTSE	5742	-0,65 %	+0,5 %	+3,0 %
DAX	7216	-1,01 %	+3,5 %	+22,3 %
CAC	3355	-2,46 %	-1,7 %	+6,2 %
NIKKEI	8788	-0,92 %	-0,6 %	+3,9 %
Hang Seng	20840	+0,38 %	+7,0 %	+13,1 %
Korea Composite	1996	+0,38 %	+4,8 %	+9,3 %
MSCI EM	1003	+0,43 %	+5,8 %	+9,4 %
РТС	1478	+0,06 %	+6,3 %	+6,9 %
ММВБ	1459	+0,36 %	+2,5 %	+4,0 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,29	-0,4 %	+3,2 %	+2,7 %
Евро/Рубль	40,13	+0,1 %	+1,3 %	+4,0 %
Евро/Доллар	1,2824	-0,3 %	+1,8 %	-1,1 %
Евро/Фунт	0,79503	+0,1 %	-0,3 %	+4,8 %
Доллар/Йена	77,88	+0,1 %	+0,5 %	-1,2 %
Доллар/Франк	0,9424	-0,3 %	+1,2 %	-0,5 %
Доллар/Новозел.	1,2088	+0,3 %	-3,6 %	-6,0 %
Евро/Австрал.	0,9672	+0,4 %	-0,9 %	-1,3 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

1 октября 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	111,6	-0,7 %	-2,6 %	+3,9 %
WTI	91,6	-0,7 %	-5,1 %	-7,3 %
Urals	111,0	-0,1 %	-1,3 %	+5,0 %
Sib. Light	112,2	-0,1 %	-1,7 %	+3,0 %
REBCO	108,77	-0,2 %	-1,1 %	+5,6 %
Никель	18520	+2,0 %	+14,3 %	+1,3 %
Медь	8268	+1,1 %	+8,7 %	+9,4 %
Алюминий	2094	+1,3 %	+11,2 %	+6,3 %
Олово	21655	+3,4 %	+4,7 %	+14,3 %
Свинец	2300	+1,5 %	+17,7 %	+16,2 %
Цинк	2088	+1,8 %	+13,0 %	+14,2 %
Сталь	360	+4,3 %	+1,4 %	-35,7 %
Золото	1776	+0,7 %	+6,5 %	+16,0 %
Платина	1668	+1,0 %	+9,7 %	+23,2 %
Палладий	642	+1,3 %	+0,3 %	+1,9 %
Серебро	34,7	+2,1 %	+12,5 %	+23,0 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	132,00	*+0,00 %*	-13,73 %	-51,11 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-1,46 %
Газпром нефть	+0,77 %
ЛУКОЙЛ	-0,16 %
Роснефть	-0,21 %
Ростелеком	-1,78 %
Система	+30,92 %
Газпром	-0,57 %
Сбербанк	+0,75 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

13:00 – Инфляция в Еврозоне в сентябре.
16:30 – Индекс цен расходов на личное потребление в августе в США.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	29,5%	0,3
VTB BANK	31.10.2012	-0,4%	0,1
SBERBANK	15.05.2013	1,0%	0,6
TRANSNEFT	07.08.2013	0,8%	0,8
TNK-BP FINANCE	13.03.2013	0,7%	0,4
GAZPROM	31.07.2013	1,0%	0,8
RSHB CAPITAL SA	16.05.2013	1,5%	0,6
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	1,9%	1,9
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	2,1%	0,5
VIMPELCOM	30.04.2013	2,2%	0,5
SEVERSTAL OAO	29.07.2013	1,2%	0,8
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,5%	0,7
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,2%	2,0
PROMSVYAZBK	15.07.2013	3,8%	0,7
GAZPROM	29.11.2015	2,7%	2,9
SBERBANK	07.07.2015	2,4%	2,5
GAZPROM	23.05.2016	3,1%	3,3
NOVATEK OAO	03.02.2016	3,0%	3,0
VTB BANK	04.03.2015	3,3%	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	3,33	-100,00 %	+1,84 %	-7,76 %
Газпром нефть	24,57	-100,00 %	+4,11 %	+4,55 %
ЛУКОЙЛ	61,60	-100,00 %	+8,45 %	+16,34 %
Роснефть	6,72	-100,00 %	+13,71 %	+1,82 %
Ростелеком	25,30	-100,00 %	+10,48 %	-10,32 %
Система	20,36	-100,00 %	+3,30 %	+21,12 %
Газпром	10,03	-100,00 %	+3,78 %	-5,91 %
Сбербанк	11,73	-100,00 %	+1,91 %	+18,25 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0529	-1,91 %	-1,01 %	-10,15 %
Газпром нефть	152,59	+0,91 %	+0,73 %	+2,98 %
ЛУКОЙЛ	1930,60	+0,71 %	+5,15 %	+13,35 %
Роснефть	210,72	+1,43 %	+9,13 %	-1,52 %
Ростелеком	134,34	+0,58 %	+8,77 %	-11,83 %
Система	24,33	-3,45 %	-6,96 %	+3,92 %
Газпром	157,82	+0,10 %	+0,39 %	-7,91 %
Сбербанк	91,08	+1,18 %	-2,32 %	+14,78 %

©2012, Универ Капитал

Контакты:

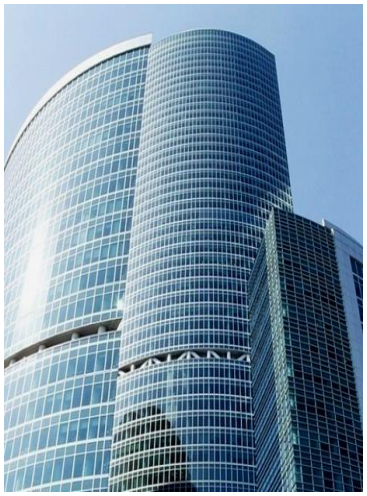
Центральный офис:

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