УНИВЕР капитал

Daily

3 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 немного скорректировалась и торгуется в районе $111 за баррель Brent, фьючерсы на американские индексы снижаются на фоне бэквордации.

В Азии динамика торгов с утра вновь смешанная – ставшее уже традиционным снижение наблюдается в Японии, остальные площадки демонстрируют более позитивные настроения.

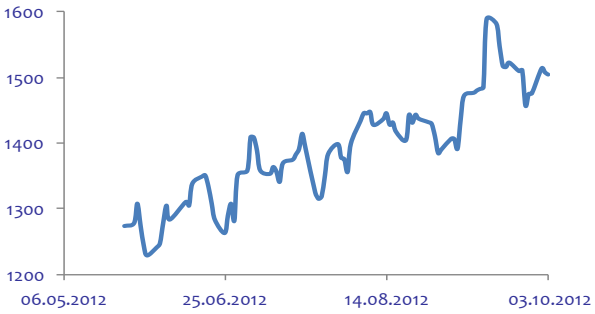
На долговом рынке Европы ситуация остаётся устойчивой, более того, 10-летние облигации Италии вплотную подошли по доходности к отметке 5%. Суверенный спрэд на Россию также сузился и находится в районе 125 б.п.

Сегодня будет поступать важная статистика из Европы и США, причём последние данные, указывающие на создание новых рабочих мест в экономике, дадут самую свежую, сентябрьскую информацию и формально уже могут содержать определённую реакцию работодателей на новость о запуске QE3. В этой связи, рынок однозначно позитивно отнесётся к данным о вновь созданных рабочих местах, в том случае, если цифра превысит 160 тыс.

Американские индексы очень хорошо отрабатывают поддержку и пока не готовы идти вниз, поэтому мы рекомендуем переходить к активным покупкам в случае выхода благоприятной статистики по розничным продажам в Еврозоне и рынку труда в США. Кандидаты на покупку – ВТБ, ФСК ЕЭС, Холдинг МРСК.

Спекулятивные игроки могут увеличивать позиции в Мечеле, поскольку негативная отчётность не смогла значительно продавить бумагу, а периодические покупки на объёме говорят о поддержке.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13482	-0,24 %	+3,0 %	+10,4 %
S&P 500	1446	+0,09 %	+2,8 %	+15,0 %
NASDAQ	3120	+0,21 %	+1,7 %	+19,8 %
Mexico Bolsa	41199	+0,18 %	+3,5 %	+11,1 %
Brazilian Bovespa	59222	-0,59 %	+3,4 %	+4,3 %
Argentina Merval	2465	+0,26 %	+2,6 %	+0,1 %
FTSE	5809	-0,19 %	+0,9 %	+4,3 %
DAX	7306	-0,29 %	+4,1 %	+23,9 %
CAC	3414	-0,60 %	-1,1 %	+8,1 %
NIKKEI	8745	-0,46 %	-0,4 %	+3,4 %
Hang Seng	20867	+0,13 %	+7,1 %	+13,2 %
Korea Composite	1996	-0,01 %	+4,4 %	+9,3 %
MSCI EM	1006	+0,11 %	+5,6 %	+9,8 %
РТС	1504	-0,40 %	+7,0 %	+8,9 %
ММВБ	1479	-0,31 %	+2,8 %	+5,5 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,21	-0,4 %	+3,4 %	+3,0 %
Евро/Рубль	40,23	-0,0 %	+1,1 %	+3,7 %
Евро/Доллар	1,2892	-0,2 %	+2,4 %	-0,5 %
Евро/Фунт	0,7998	+0,1 %	-0,9 %	+4,2 %
Доллар/Йена	78,23	-0,1 %	+0,0 %	-1,7 %
Доллар/Франк	0,9385	-0,2 %	+1,6 %	-0,0 %
Доллар/Новозел.	1,2163	+0,7 %	-3,0 %	-5,5 %
Евро/Австрал.	0,9793	+0,5 %	+0,3 %	-0,0 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

3 октября 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	111,1	-0,4 %	-4,0 %	+3,5 %
WTI	91,7	-0,2 %	-4,9 %	-7,2 %
Urals	109,9	-0,4 %	-3,7 %	+3,9 %
Sib. Light	111,1	-0,5 %	-4,0 %	+2,0 %
REBCO	108,99	+0,1 %	-2,4 %	+5,8 %
Никель	18840	+1,9 %	+18,7 %	+3,1 %
Медь	8340	+1,8 %	+10,1 %	+10,4 %
Алюминий	2104	+1,7 %	+13,8 %	+6,8 %
Олово	22110	+1,0 %	+12,5 %	+16,7 %
Свинец	2315	+3,4 %	+17,9 %	+16,9 %
Цинк	2098	+2,9 %	+16,1 %	+14,7 %
Сталь	335,5	-2,8 %	-1,9 %	-40,1 %
Золото	1775,5	-0,6 %	+7,7 %	+16,0 %
Платина	1678	*+0,0 %*	+10,6 %	+23,9 %
Палладий	1298,25	+99,7 %	+108,4 %	+106,1 %
Серебро	34,9	+1,5 %	+14,2 %	+23,7 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	124,00	+0,81 %	-18,95 %	-54,07 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,41 %
Газпром нефть	+0,56 %
ЛУКОЙЛ	+0,23 %
Роснефть	-0,22 %
Ростелеком	+0,60 %
Система	+34,43 %
Газпром	-0,19 %
Сбербанк	+0,96 %

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	30,2%	0,3
VTB BANK	31.10.2012	-1,5%	0,1
SBERBANK	15.05.2013	1,1%	0,6
TRANSNEFT	07.08.2013	0,7%	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	1,4%	0,6
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	1,9%	1,9
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	1,9%	0,5
VIMPELCOM	30.04.2013	2,1%	0,5
SEVERSTAL OAO	29.07.2013	1,0%	0,8
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,3%	0,7
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,2%	2,0
PROMSVYAZBK	15.07.2013	3,7%	0,7
GAZPROM	29.11.2015	2,7%	2,9
SBERBANK	07.07.2015	2,3%	2,5
GAZPROM	23.05.2016	3,0%	3,3
NOVATEK OAO	03.02.2016	2,9%	3,0
VTB BANK	04.03.2015	3,2%	2,2
TNK-BP FINANCE	18.07.2016	2,9%	3,3
GAZPROMBANK	08.05.2016	4,7%	3,1
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	4,8%	3,3
VIMPELCOM	02.02.2016	4,5%	2,9

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,48	+2,97 %	+5,17 %	-3,71 %
Газпром нефть	24,95	+1,99 %	+5,86 %	+6,17 %
ЛУКОЙЛ	63,05	+2,11 %	+9,84 %	+19,08 %
Роснефть	6,74	+1,71 %	+11,59 %	+2,12 %
Ростелеком	26,66	+6,32 %	+14,57 %	-5,50 %
Система	21,00	+2,90 %	+1,84 %	+24,93 %
Газпром	10,19	+2,79 %	+4,57 %	-4,41 %
Сбербанк	11,90	+1,88 %	+1,88 %	+19,96 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0545	*+0,00 %*	+1,25 %	-7,44 %
Газпром нефть	154,85	*+0,00 %*	+1,73 %	+4,50 %
ЛУКОЙЛ	1962,90	*+0,00 %*	+5,57 %	+15,24 %
Роснефть	210,79	*+0,00 %*	+6,99 %	-1,49 %
Ростелеком	137,83	*+0,00 %*	+9,99 %	-9,54 %
Система	24,37	*+0,00 %*	-9,39 %	+4,10 %
Газпром	159,29	*+0,00 %*	+0,73 %	-7,05 %
Сбербанк	91,95	*+0,00 %*	-2,32 %	+15,88 %

©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