УНИВЕР капитал

Daily

4 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.

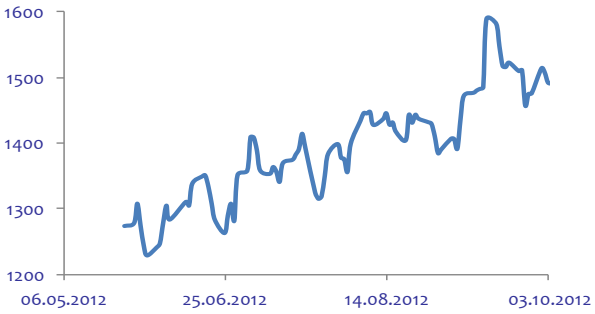
Нефть просела, но сумела оттолкнуться от района $107 и торгуется в районе $108 за баррель Brent, фьючерсы на американские индексы растут, пытаясь перейти в контанго.

В Азии динамика торгов с утра в целом позитивная. Наконец демонстрирует рост Япония.

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.

Сегодняшний день пройдёт под знаком заседаний ЕЦБ и Банка Англии, хотя главная помощь может придти, конечно, со стороны первого. Возможное снижение ставки, хотя вероятность его и оценивается рынком с вероятностью менее 50%, может придать тот недостающий импульс, который заставит игроков перейти от торговли в боковике к покупкам. Мы рекомендуем в случае снижения ставки приобретать на маржу банковские бумаги (**Сбербанк-п** и **ВТБ** в первую очередь), а также горно-металлургические компании (прежде всего **ММК**, **Мечел**). В случае же отсутсвия позитива со стороны центробанка, дополнительные покупки будут нецелесообразны, однако уже взятые длинные позиции по бумагам финансового сектора лучше сохранять, поскольку американские индексы демонстрируют силу и серьёзной просадки, судя по технической картине, пока не намечается.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13495	+0,09 %	+3,5 %	+10,5 %
S&P 500	1451	+0,36 %	+3,3 %	+15,4 %
NASDAQ	3135	+0,49 %	+2,0 %	+20,3 %
Mexico Bolsa	41005	-0,47 %	+3,7 %	+10,6 %
Brazilian Bovespa	58627	-1,00 %	+4,3 %	+3,3 %
Argentina Merval	2456	-0,36 %	+3,2 %	-0,3 %
FTSE	5826	+0,28 %	+2,7 %	+4,6 %
DAX	7322	+0,22 %	+5,6 %	+24,1 %
CAC	3406	-0,24 %	+0,2 %	+7,8 %
NIKKEI	8841	+1,07 %	+0,7 %	+4,6 %
Hang Seng	20909	+0,10 %	+7,6 %	+13,4 %
Korea Composite	1993	-0,17 %	+4,2 %	+9,1 %
MSCI EM	1003	-0,37 %	+5,8 %	+9,4 %
РТС	1490	-1,03 %	+6,0 %	+7,9 %
ММВБ	1472	-0,88 %	+2,4 %	+4,9 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,16	+0,0 %	+3,7 %	+3,1 %
Евро/Рубль	40,30	-0,2 %	+0,7 %	+3,5 %
Евро/Доллар	1,293	+0,2 %	+2,9 %	-0,2 %
Евро/Фунт	0,80316	-0,0 %	-1,4 %	+3,8 %
Доллар/Йена	78,62	-0,2 %	-0,2 %	-2,2 %
Доллар/Франк	0,9374	+0,1 %	+2,0 %	+0,1 %
Доллар/Новозел.	1,2182	-0,2 %	-3,2 %	-5,3 %
Евро/Австрал.	0,9777	-0,1 %	-0,0 %	-0,2 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

4 октября 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	108,7	+0,5 %	-4,8 %	+1,3 %
WTI	88,3	+0,2 %	-7,4 %	-10,7 %
Urals	106,2	-3,4 %	-6,3 %	+0,4 %
Sib. Light	107,6	-3,2 %	-6,5 %	-1,3 %
REBCO	105,73	-3,0 %	-5,3 %	+2,6 %
Никель	18620	-1,2 %	+15,6 %	+1,9 %
Медь	8276	-0,8 %	+8,2 %	+9,6 %
Алюминий	2070	-1,6 %	+10,1 %	+5,0 %
Олово	22100	-0,0 %	+12,3 %	+16,6 %
Свинец	2293,5	-0,9 %	+15,7 %	+15,8 %
Цинк	2056	-2,0 %	+12,0 %	+12,5 %
Сталь	345	+2,8 %	+1,5 %	-38,4 %
Золото	1775,25	-0,0 %	+5,0 %	+16,0 %
Платина	1685	+0,4 %	+9,2 %	+24,5 %
Палладий	652	+0,9 %	+3,7 %	+3,5 %
Серебро	34,7	-0,4 %	+9,4 %	+23,2 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	122,00	-0,81 %	-20,26 %	-54,81 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,53 %
Газпром нефть	-0,04 %
ЛУКОЙЛ	+0,04 %
Роснефть	-0,24 %
Ростелеком	+0,52 %
Система	+34,01 %
Газпром	-0,25 %
Сбербанк	+0,40 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

15:00 – Решение по процентной ставке Банка Англии.
15:45 – Решение по процентной ставке ЕЦБ.
16:30 – Выступление главы ЕЦБ.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	30,0%	0,3
VTB BANK	31.10.2012	-1,6%	0,1
SBERBANK	15.05.2013	1,0%	0,6
TRANSNEFT	07.08.2013	0,6%	0,8
TNK-BP FINANCE	13.03.2013	0,4%	0,4
GAZPROM	31.07.2013	0,9%	0,8
RSHB CAPITAL SA	16.05.2013	1,3%	0,6
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	1,8%	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	2,2%	0,7
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,2%	2,0
PROMSVYAZBK	15.07.2013	3,6%	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	2,8%	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	4,6%	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	+1,37 %	+6,40 %	-3,68 %
Газпром нефть	24,86	-0,44 %	+4,67 %	+5,79 %
ЛУКОЙЛ	62,80	+0,24 %	+8,18 %	+18,60 %
Роснефть	6,72	-1,39 %	+10,53 %	+1,82 %
Ростелеком	26,44	-0,89 %	+12,46 %	-6,27 %
Система	21,12	+0,24 %	+2,28 %	+25,64 %
Газпром	10,13	-1,16 %	+3,69 %	-4,97 %
Сбербанк	11,86	-0,42 %	+2,51 %	+19,56 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0545	*+0,00 %*	+2,22 %	-7,44 %
Газпром нефть	154,98	+0,08 %	+1,37 %	+4,59 %
ЛУКОЙЛ	1956,00	-0,35 %	+4,45 %	+14,84 %
Роснефть	209,89	-0,43 %	+6,34 %	-1,91 %
Ростелеком	136,59	-0,90 %	+8,53 %	-10,35 %
Система	24,55	+0,73 %	-8,39 %	+4,87 %
Газпром	158,22	-0,67 %	+0,10 %	-7,67 %
Сбербанк	92,02	+0,08 %	-1,19 %	+15,97 %

©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