УНИВЕР капитал

Daily

11 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 умеренно негативный.

Нефть стабильна в районе $114,5 за баррель Brent, фьючерсы на американские индексы падают на фоне бэквордации.

В Азии динамика торгов с утра в также негативная.

Тем не менее, на долговом рынке Европы ситуация остаётся устойчивой, в том числе испанские бумаги демонстрируют устойчивую динамику, несмотря на снижение рейтинга от S&P на две ступени.

Сегодняшнее размещение итальянских облигаций покажет, насколько высока чувствительность первичного рынка к динамике рейтингов. Та кили иначе, мы не ожидаем падения спроса.

Суверенный спрэд на Россию находится на уровне 123 б.п.

Корпоративная отчётность сегодня бедна, впрочем, как и макроэкономическая статистика, поэтому резкие движения маловероятны. Скорее всего, состоится попытка тестирования 1148-1452 по ММВБ, откуда возможны спекулятивные покупки на отскок.

С технической точки зрения превлекательная ситуация сформирована в бумагах Мечела, ФСК ЕЭС, Холдинга МРСК, Роснефти, Новатэка и Сбербанка-п.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13345	-0,95 %	+0,2 %	+9,2 %
S&P 500	1433	-0,62 %	-0,1 %	+13,9 %
NASDAQ	3052	-0,43 %	-1,7 %	+17,1 %
Mexico Bolsa	41470	-0,68 %	+3,7 %	+11,8 %
Brazilian Bovespa	58456	-0,82 %	-1,6 %	+3,0 %
Argentina Merval	2388	-1,94 %	-0,8 %	-3,0 %
FTSE	5777	-0,58 %	-0,3 %	+3,7 %
DAX	7205	-0,41 %	-1,4 %	+22,2 %
CAC	3366	-0,50 %	-4,8 %	+6,5 %
NIKKEI	8523	-0,85 %	-3,2 %	+0,8 %
Hang Seng	20902	-0,08 %	+5,3 %	+13,4 %
Korea Composite	1922	-1,37 %	+0,1 %	+5,3 %
MSCI EM	992	-0,45 %	+2,0 %	+8,3 %
РТС	1481	-0,69 %	+0,1 %	+7,2 %
ММВБ	1458	-0,82 %	-1,4 %	+4,0 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,16	-0,0 %	+1,0 %	+3,2 %
Евро/Рубль	40,12	+0,1 %	+1,1 %	+4,0 %
Евро/Доллар	1,2874	-0,0 %	+0,1 %	-0,7 %
Евро/Фунт	0,80357	+0,1 %	-0,5 %	+3,7 %
Доллар/Йена	78,03	+0,2 %	-0,3 %	-1,4 %
Доллар/Франк	0,9389	+0,0 %	*+0,0 %*	-0,1 %
Доллар/Новозел.	1,223	-0,2 %	-0,0 %	-4,9 %
Евро/Австрал.	0,9728	-0,5 %	+1,5 %	-0,7 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

11 октября 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	114,8	+0,4 %	-0,6 %	+6,9 %
WTI	91,3	+0,1 %	-6,0 %	-7,6 %
Urals	113,1	+0,0 %	-0,4 %	+6,9 %
Sib. Light	113,9	+0,1 %	-0,8 %	+4,6 %
REBCO	112,95	+1,2 %	+2,3 %	+9,7 %
Никель	17735	-1,1 %	+7,3 %	-3,0 %
Медь	8125	-0,7 %	+1,2 %	+7,6 %
Алюминий	1992	-2,4 %	-2,0 %	+1,1 %
Олово	21685	-1,9 %	+7,0 %	+14,4 %
Свинец	2215	-1,6 %	+4,6 %	+11,9 %
Цинк	1952	-2,4 %	-0,6 %	+6,8 %
Сталь	335,5	-1,6 %	+3,2 %	-40,1 %
Золото	1761,25	-0,7 %	+1,7 %	+15,0 %
Платина	1671	-1,4 %	+4,9 %	+23,4 %
Палладий	650	-1,5 %	-1,7 %	+3,2 %
Серебро	33,8	-0,2 %	+0,6 %	+19,9 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	123,00	-1,60 %	+0,82 %	-54,44 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-1,31 %
Газпром нефть	+0,44 %
ЛУКОЙЛ	+0,37 %
Роснефть	-0,23 %
Ростелеком	+0,35 %
Система	+30,50 %
Газпром	-0,25 %
Сбербанк	+0,72 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

16:30 – Первичные заявки на пособие по безработице за неделю, цены на импорт/экспорт в сентябре, торговый баланс в августе в США.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	30,0%	0,3
VTB BANK	31.10.2012	-2,4%	0,0
SBERBANK	15.05.2013	0,9%	0,6
TRANSNEFT	07.08.2013	0,7%	0,8
TNK-BP FINANCE	13.03.2013	0,2%	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	1,8%	1,9
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	1,7%	0,5
VIMPELCOM	30.04.2013	2,3%	0,5
SEVERSTAL OAO	29.07.2013	0,9%	0,8
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,1%	0,7
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,2%	2,0
PROMSVYAZBK	15.07.2013	3,5%	0,7
GAZPROM	29.11.2015	2,6%	2,8
SBERBANK	07.07.2015	2,3%	2,5
GAZPROM	23.05.2016	2,9%	3,2
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	4,7%	3,0
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	4,4%	3,3
VIMPELCOM	02.02.2016	4,3%	2,9

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,42	-0,63 %	-5,58 %	-5,32 %
Газпром нефть	24,92	+0,32 %	+1,88 %	+6,04 %
ЛУКОЙЛ	62,50	+0,72 %	+2,54 %	+18,04 %
Роснефть	6,74	+0,44 %	+5,56 %	+2,05 %
Ростелеком	26,17	+2,87 %	+6,17 %	-7,23 %
Система	20,09	-2,06 %	-12,16 %	+19,51 %
Газпром	9,95	-1,08 %	-3,30 %	-6,66 %
Сбербанк	11,93	-0,17 %	-0,08 %	+20,26 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0540	-0,52 %	-5,99 %	-8,31 %
Газпром нефть	154,60	+0,07 %	+0,42 %	+4,33 %
ЛУКОЙЛ	1940,10	-0,52 %	+0,64 %	+13,90 %
Роснефть	210,31	-0,91 %	+3,64 %	-1,72 %
Ростелеком	135,42	-1,08 %	+5,36 %	-11,12 %
Система	23,98	-0,79 %	-13,78 %	+2,43 %
Газпром	155,38	-1,19 %	-4,82 %	-9,33 %
Сбербанк	92,26	-0,39 %	-1,88 %	+16,27 %

©2012, Универ Капитал

Контакты:

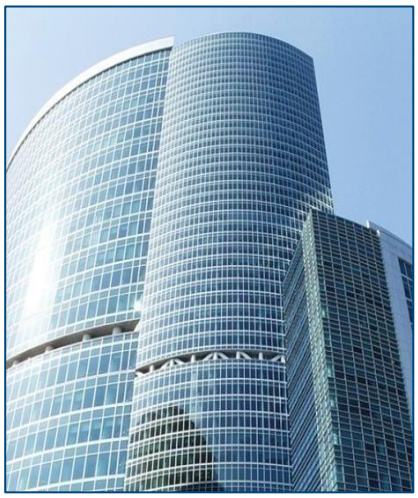
Центральный офис:

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