

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

Внешний фон на начало торгового дня нейтральный.

Фьючерс на баррель Brent снижается на 0.41% и торгуется по цене в \$107.97.

Итоги торгов понедельника на американских биржах нельзя назвать однозначными. С одной стороны DJI обновил свой исторический максимум в 16000 пт, что как никогда должно было приободрить игроков. С другой, выступление У. Дадли, президента ФРБ Нью-Йорка, касательно позитивной динамики экономики США вновь привнесло напряжение на рынок. Кроме того, S&P500 и NasdaqComp. закрылись и вовсе в минусе. Важно отметить, что инвесторы за океаном не ожидают сворачивания программы количественного смягчения уже в декабре.

Торги в Азиатско-Тихоокеанском регионе не имели единой динамики. Вчерашний рост акций банковского сектора Китая продолжился только на Гонконгской бирже, в то время как акции этих же банков теряли позиции в Шанхае. Ослабление йены традиционно сменилось ее возвращением к прежним позициям в отношении американского доллара. Пара торгуется по курсу в 99.8.

На первичном рынке размещений сегодня выступят эмитентами векселей Мальта и Испания. В календаре корпоративной отчетности на сегодня значатся следующие компании:

BestBuyCo., Inc, TheHomeDepot, Inc., Medtronic Inc., The TJX Companies, Inc., CampbellSoupCompany.

Первая половина торгового дня не сможет порадовать игроков интересной статистикой, однако стоит отметить следующие публикации данных: индексы текущих экономических условий и экономических ожиданий ZEW Германии, обзор Организации экономического сотрудничества и развития "EconomicOutlook", данные об оплате труда и затратах на рабочую силу в США. Более того, сегодня на конференции WSJ выступят с речью министр финансов США Джек Лью и президент США Барак Обама.

Сегодняшний день может оказаться весьма интересным для РФР. Учитывая фундаментальные факторы и обстановку на мировых площадках, можно сделать вывод о вероятном боковом движении рынка в начале сессии даже на фоне вчерашнего роста к закрытию сессии. В то же время, рассматривая техническую сторону вопроса, нельзя не отметить, что сильный уровень сопротивления в 1500 пт уже пройден и что впереди мы ожидаем ир-тренд до позиций нового уровня сопротивления, который находится около значений 1540-1550 пт. Среди российских игроков свои финансовые результаты представят Башнефть и МТС за 3К 2013 по МСФО и US GAAP, соответственно.

Динамика индекса ММВБ



Мировые индексы				
	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	15976	+0,09 %	+3,7 %	+21,9 %
S&P 500	1792	-0,37 %	+2,7 %	+25,6 %
NASDAQ	3949	-0,93 %	+0,9 %	+30,8 %
Mexico Bolsa	41034	+1,81 %	+1,5 %	-6,1 %
Brazilian Bovespa	54307	+1,60 %	-1,9 %	-10,9 %
Argentina Merval	5552	-0,36 %	+1,6 %	+94,5 %
FTSE	6723	+0,45 %	+1,5 %	+14,0 %
DAX	9225	+0,62 %	+4,1 %	+21,2 %
CAC	4321	+0,66 %	+0,8 %	+18,7 %
NIKKEI	15127	-0,25 %	+3,9 %	+45,5 %
Hang Seng	23707	+0,20 %	+1,6 %	+4,6 %
Korea Composite	2032	+1,04 %	-1,0 %	+1,7 %
MSCI EM	1025	+2,00 %	-1,6 %	-2,8 %
PTC	1465	+0,68 %	-3,4 %	-4,1 %
ММВБ	1516	+0,19 %	-1,2 %	+2,8 %

Валюты				
	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	32,55	0,10%	-2,3 %	-6,2 %
Евро/Рубль	43,96	-0,06%	-0,8 %	-8,5 %
Евро/Доллар	1,3503	0,05%	-1,3 %	+2,4 %
Евро/Фунт	0,83662	0,10%	+1,2 %	-3,0 %
Доллар/Йена	100,05	0,14%	-2,3 %	-13,3 %
Доллар/Франк	0,9137	0,12%	-1,3 %	+0,2 %
Доллар/Новозел.	1,1959	-0,24%	+1,6 %	-0,9 %

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	108,0	-0,5 %	-1,8 %	-2,8 %
WTI	92,8	-0,3 %	-8,0 %	+1,0 %
Urals	109,3	+0,2 %	+3,5 %	-0,8 %
Sib. Light	109,4	+0,1 %	+3,1 %	-2,8 %
Никель	13690	+0,0 %	-3,4 %	-19,9 %
Медь	7000	+0,5 %	-3,3 %	-11,6 %
Алюминий	1737,5	-0,0 %	-3,9 %	-14,8 %
Олово	23000	+0,1 %	+1,1 %	-2,1 %
Свинец	2072	-0,0 %	-4,0 %	-11,5 %
Цинк	1864	+0,2 %	-2,3 %	-8,4 %
Сталь	235	+0,0 %	+4,4 %	-16,1 %
Золото	1283,5	-0,3 %	-2,5 %	-22,6 %
Платина	1430	-0,6 %	-0,6 %	-6,4 %
Палладий	727	-0,3 %	-1,4 %	+3,3 %
Серебро	20,6	+0,0 %	-5,6 %	-31,1 %

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	0,94%	0,93
GAZPROM	29.11.2015	1,43%	1,89
SBERBANK	07.07.2015	1,63%	1,54
GAZPROM	23.05.2016	1,89%	2,31
NOVATEK OAO	03.02.2016	2,19%	2,05
VTB BANK	04.03.2015	1,87%	1,23
TNK-BP FINANCE	18.07.2016	2,57%	2,39
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	3,51%	2,43
VIMPELCOM	02.02.2016	3,16%	2,02
SBERBANK	24.03.2017	2,90%	3,04
SBERBANK	28.06.2019	4,16%	4,76
SEVERSTAL COLUMB	15.02.2018	8,49%	0,23
NOMOS BANK	21.10.2015	5,07%	1,75
RUSSIAN STAND BK	11.07.2017	7,59%	2,97
RUSSIAN STAND BK	17.01.2024	11,67%	3,67
ALLIANCE OIL CO	16.07.2014	-0,67%	0,64
MMC FINANCE	30.04.2018	4,35%	3,99
GAZPROMBANK	15.12.2014	1,54%	1,01
GAZPROMBANK	23.09.2015	2,29%	1,73
GAZPROMBANK	08.05.2016	3,73%	2,19
GAZPROMBANK	29.04.2049	8,12%	3,67

Суверенный спред

Russia30-UST10	131,00	-4,38 %	+4,8 %	+70,1 %
----------------	--------	---------	--------	---------

АДР/Локальные акции

ВТБ	+0,66 %
Газпром нефть	+0,48 %
ЛУКОЙЛ	+0,26 %
Роснефть	-0,50 %
Ростелеком	+0,74 %
Система	+16,97 %
Газпром	+0,16 %
Сбербанк	+0,70 %

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	2,81	-100,00 %	+2,78 %	-18,79 %
Газпром нефть	22,81	-100,00 %	-1,04 %	-1,60 %
ЛУКОЙЛ	64,45	-100,00 %	-3,08 %	-2,57 %
Роснефть	7,49	-100,00 %	-8,10 %	-15,99 %
Ростелеком	21,62	-100,00 %	+5,98 %	-9,46 %
Система	28,14	-100,00 %	+6,23 %	+39,31 %
Газпром	9,21	-100,00 %	-6,16 %	-2,64 %
Сбербанк	13,08	-100,00 %	-0,61 %	+6,34 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

14:00 - Индекс текущих экономических условий ZEW в Германии
14:00 - Индекс экономических ожиданий ZEW в Германии
14:00 - Публикация обзора ОЭСР "Economic Outlook"
17:30 - Уровень оплаты труда в США
17:30 - Затраты на рабочую силу в США

Локальные акции

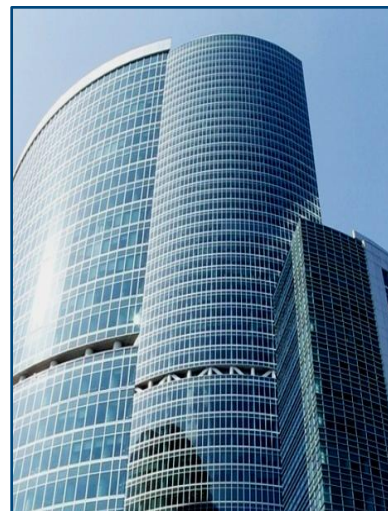
	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0455	+0,20 %	+5,13 %	-15,18 %
Газпром нефть	148,00	+0,00 %	+0,37 %	+3,85 %
ЛУКОЙЛ	2095,50	+0,17 %	-1,11 %	+4,30 %
Роснефть	245,23	+0,09 %	-6,19 %	-9,21 %
Ростелеком	116,60	-0,09 %	+7,17 %	-2,96 %
Система	39,21	+0,04 %	+10,12 %	+54,24 %
Газпром	149,88	+0,29 %	-4,52 %	+4,15 %
Сбербанк	105,86	+0,39 %	+0,48 %	+13,93 %

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

Отдел аналитических исследований

Chief Investment Officer

Александров Дмитрий, Ph.D
тел.: (495) 644-11-22 доб. 3336
e-mail: daleksandrov@univer.ru

Head of Research

Кондратьев Дмитрий, Ph.D
тел.: (495) 644-11-22 доб. 2264
e-mail: dkondratyev@univer.ru

Financial Analyst

Шульгина Ксения
e-mail: kshulgina@univer.ru

Junior Financial Analyst

Даровская Ксения
e-mail: kdarovskaya@univer.ru

Junior Financial Analyst

Неверова Дарья
e-mail: dneverova@univer.ru

Junior Financial Analyst

Мартыненко Валерий
e-mail: vmartynenko@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

Лицензия ФСФР № 077-12895-000100 профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности