УНИВЕР капитал

Daily

15 августа 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 торгуется в районе $114 за баррель Brent, торги в Азии проходят в целом в красной зоне. Фьючерсы на американские индексы снижаются на фоне небольшой бэквордации. Тем не менее, попытка коррекции вновь была выкуплена на американской сессии и узкий боковой тренд на рынках США продолжается.

На рынке госдолга ситуация стабильна, суверенный спрэд на Россию находится на уровне 140 б.п.

Вышедшая макроэкономическая статистика показала разнонаправленную динамику в экономиках еврозоны: локомотивные страны демонстрируют рост и опережение ожиданий рынка, периферийные – ухудшение ситуации. Тем не менее, в целом такую картину можно считать скорее позитивной, с учётом размера экономик и довольно уверенного поведения игроков на государственном долговом рынке. Вчерашнее успешное размещение греческих квартальных векселей в целом подтверждает такие выводы.

Как результат – имеющаяся на рынке картина может сохраниться в течение ближайших недель и мы не увидим ни серьёзного роста, ни значительных продаж. В этой связи стоит ориентироваться на сигналы технических индикаторов, делая упор на внутридневной диапазонной торговле. До достижения индексом ММВБ отметки 1480 п. или до формирования сильных медвежьих сигналов активное открытие шортовых позиций было бы на таком фоне преждевременным.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13172	+0,02 %	+3,1 %	+7,8 %
S&P 500	1404	-0,01 %	+3,5 %	+11,6 %
NASDAQ	3017	-0,18 %	+3,7 %	+15,8 %
Mexico Bolsa	40645	+0,69 %	+0,4 %	+9,6 %
Brazilian Bovespa	58083	-1,76 %	+6,9 %	+2,3 %
Argentina Merval	2420	-0,42 %	+1,6 %	-1,7 %
FTSE	5865	+0,56 %	+3,5 %	+5,2 %
DAX	6974	+0,94 %	+6,4 %	+18,2 %
CAC	3450	+0,70 %	+8,5 %	+9,2 %
NIKKEI	8917	-0,14 %	+2,2 %	+5,5 %
Hang Seng	20059	-1,15 %	+5,1 %	+8,8 %
Korea Composite	1957	+1,27 %	+7,9 %	+7,2 %
MSCI EM	977	+0,48 %	+5,5 %	+6,6 %
РТС	1442	+0,64 %	+5,3 %	+4,3 %
ММВБ	1456	+0,70 %	+2,8 %	+3,8 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,87	-0,1 %	+2,0 %	+0,8 %
Евро/Рубль	39,30	-0,1 %	+1,6 %	+6,2 %
Евро/Доллар	1,233	+0,1 %	+0,5 %	-4,9 %
Евро/Фунт	0,78656	-0,1 %	-0,2 %	+6,0 %
Доллар/Йена	78,79	-0,1 %	+0,1 %	-2,4 %
Доллар/Франк	0,9742	+0,1 %	+0,5 %	-3,7 %
Доллар/Новозел.	1,2419	+0,0 %	-0,9 %	-3,5 %
Евро/Австрал.	0,9546	+0,1 %	-2,2 %	-2,6 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

15 августа 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	113,9	-0,2 %	+11,2 %	+6,0 %
WTI	93,2	-0,2 %	+7,0 %	-5,7 %
Urals	114,7	+1,2 %	+11,7 %	+8,5 %
Sib. Light	115,0	+1,1 %	+11,9 %	+5,6 %
REBCO	111,54	+1,5 %	+10,8 %	+8,3 %
Никель	15555	+1,5 %	-3,7 %	-14,9 %
Медь	7407	-0,3 %	-3,7 %	-1,9 %
Алюминий	1813	-0,6 %	-2,6 %	-8,0 %
Олово	18125	+1,7 %	-3,6 %	-4,4 %
Свинец	1862,5	-0,2 %	-0,6 %	-5,9 %
Цинк	1793	-1,5 %	-4,1 %	-1,9 %
Сталь	365	-1,5 %	-9,0 %	-34,8 %
Золото	1597,75	-1,5 %	+0,1 %	+4,4 %
Платина	1400	-0,1 %	-1,7 %	+3,4 %
Палладий	577	-0,7 %	-0,7 %	-8,4 %
Серебро	27,8	-0,8 %	+1,3 %	-1,2 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	144,00	*+0,00 %*	-27,64 %	-46,67 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,48 %
Газпром нефть	+0,50 %
ЛУКОЙЛ	-0,00 %
Роснефть	-0,55 %
Ростелеком	-0,27 %
Система	+23,17 %
Газпром	-0,41 %
Сбербанк	+0,17 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

16:30 – Инфляция в США в июле.
17:00 – Приток капитала в США в июне.
17:15 – Промышленное производство в США в июле.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	25,0%	0,4
VTB BANK	31.10.2012	0,5%	0,2
SBERBANK	15.05.2013	1,1%	0,7
TRANSNEFT	07.08.2013	1,3%	0,9
TNK-BP FINANCE	13.03.2013	0,5%	0,5
GAZPROM	31.07.2013	1,1%	0,9
RSHB CAPITAL SA	16.05.2013	1,4%	0,7
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	2,0%	2,0
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	3,1%	0,6
VIMPELCOM	30.04.2013	2,1%	0,7
SEVERSTAL OAO	29.07.2013	2,1%	0,9
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,1%	0,8
GAZPROMBANK	15.12.2014	4,0%	2,1
PROMSVYAZBK	15.07.2013	4,4%	0,9
GAZPROM	29.11.2015	2,9%	3,0
SBERBANK	07.07.2015	2,8%	2,7
GAZPROM	23.05.2016	3,2%	3,4
NOVATEK OAO	03.02.2016	3,1%	3,2
VTB BANK	04.03.2015	3,5%	2,3
TNK-BP FINANCE	18.07.2016	3,6%	3,4
GAZPROMBANK	08.05.2016	4,9%	3,2
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	5,8%	3,4
VIMPELCOM	02.02.2016	5,6%	3,1

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,56	+0,11 %	+4,99 %	-1,41 %
Газпром нефть	24,47	-0,53 %	+4,57 %	+4,13 %
ЛУКОЙЛ	59,25	+0,94 %	+6,47 %	+11,90 %
Роснефть	6,37	+0,71 %	+0,79 %	-3,49 %
Ростелеком	23,60	+2,26 %	+7,08 %	-16,34 %
Система	20,73	-1,58 %	+4,96 %	+23,32 %
Газпром	9,81	+0,78 %	+4,70 %	-8,02 %
Сбербанк	11,77	+0,69 %	+5,18 %	+18,65 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0570	*+0,00 %*	+2,35 %	-3,14 %
Газпром нефть	155,21	*+0,00 %*	+2,09 %	+4,74 %
ЛУКОЙЛ	1888,60	*+0,00 %*	+3,92 %	+10,88 %
Роснефть	204,16	*+0,00 %*	-0,97 %	-4,59 %
Ростелеком	125,71	*+0,00 %*	+5,39 %	-17,49 %
Система	26,82	*+0,00 %*	+7,38 %	+14,56 %
Газпром	156,91	*+0,00 %*	+2,33 %	-8,44 %
Сбербанк	93,63	*+0,00 %*	+2,96 %	+18,00 %

©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

Домнин Виктор
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 2256
E-mail: vdomnin@univer.ru

Душек Александр
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 2282
E-mail: adushek@univer.ru

Виценовский Вениамин
Телефон: (495) 792-555-0 , доб. 3338
E-mail: vvitsenovskiy@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