УНИВЕР капитал

Daily

16 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 выше отметки $114 за баррель Brent, торги в Азии проходят в зелёной зоне. Фьючерсы на американские индексы растут на фоне небольшого контанго.

На рынке госдолга ситуация стабильна, суверенный спрэд на Россию сократился, спустившись вновь в районе 130 б.п.

Вчерашняя просадка вновь была активно выкуплена как на российском рынке, так и на внешних площадках, поэтому наше предостережение от открытия массированных долговременных шортов остаётся актуальным. Вместе с тем, та лёгкость, с какой вчера продавались наиболее ликвидные и капитализированные фишки, указывает на готовность продавать в случае поступления чёткого сигнала со стороны американских индексов или мировых регуляторов.

Сегодня мы сохраняем вчерашнюю рекомендацию по внутридневной торговле на основе сигналов индикаторов, причём возможность тестирования района 1480 п. по индексу ММВБ довольно высока.

В такой ситуации **банковские бумаги**, **Новатэк** и **Роснефть** могут стать лидерами движения.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13165	-0,06 %	+3,4 %	+7,8 %
S&P 500	1406	+0,11 %	+3,8 %	+11,8 %
NASDAQ	3031	+0,46 %	+4,6 %	+16,3 %
Mexico Bolsa	40793	+0,36 %	-0,3 %	+10,0 %
Brazilian Bovespa	58189	+0,18 %	+9,0 %	+2,5 %
Argentina Merval	2440	+0,83 %	+2,3 %	-0,9 %
FTSE	5833	-0,54 %	+3,0 %	+4,7 %
DAX	6947	-0,40 %	+5,8 %	+17,8 %
CAC	3449	-0,03 %	+8,5 %	+9,2 %
NIKKEI	9074	+1,67 %	+4,0 %	+7,3 %
Hang Seng	20081	+0,15 %	+5,0 %	+8,9 %
Korea Composite	1954	-0,13 %	+7,8 %	+7,0 %
MSCI EM	974	-0,31 %	+5,1 %	+6,3 %
РТС	1430	-1,22 %	+4,1 %	+3,5 %
ММВБ	1451	-0,97 %	+2,1 %	+3,5 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	31,84	+0,1 %	+2,2 %	+0,9 %
Евро/Рубль	39,18	-0,0 %	+1,9 %	+6,5 %
Евро/Доллар	1,2282	-0,1 %	+0,1 %	-5,2 %
Евро/Фунт	0,78385	-0,0 %	+0,1 %	+6,3 %
Доллар/Йена	79,33	-0,4 %	-0,6 %	-3,1 %
Доллар/Франк	0,9779	-0,1 %	+0,1 %	-4,1 %
Доллар/Новозел.	1,24	+0,1 %	-1,1 %	-3,6 %
Евро/Австрал.	0,9538	+0,2 %	-2,2 %	-2,6 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

16 августа 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	116,3	+0,0 %	+12,3 %	+8,3 %
WTI	94,4	+0,0 %	+6,7 %	-4,5 %
Urals	116,8	+1,8 %	+13,8 %	+10,4 %
Sib. Light	117,0	+1,8 %	+13,8 %	+7,4 %
REBCO	112,61	+1,0 %	+11,8 %	+9,3 %
Никель	15230	-2,1 %	-5,7 %	-16,7 %
Медь	7386	-0,3 %	-3,9 %	-2,2 %
Алюминий	1803,5	-0,5 %	-3,1 %	-8,5 %
Олово	18205	+0,4 %	-3,2 %	-3,9 %
Свинец	1835	-1,5 %	-2,1 %	-7,3 %
Цинк	1782	-0,6 %	-4,7 %	-2,5 %
Сталь	360,5	-1,2 %	-10,1 %	-35,6 %
Золото	1601,75	+0,3 %	+0,4 %	+4,6 %
Платина	1400	*+0,0 %*	-1,7 %	+3,4 %
Палладий	576	-0,2 %	-0,9 %	-8,6 %
Серебро	27,6	-0,7 %	+0,6 %	-1,9 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	139,00	-3,47 %	-30,15 %	-48,52 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,66 %
Газпром нефть	+0,02 %
ЛУКОЙЛ	-0,24 %
Роснефть	-0,66 %
Ростелеком	+0,23 %
Система	+24,18 %
Газпром	-0,43 %
Сбербанк	-0,13 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

13:00 – Инфляция в Еврозоне в июле.
16:30 – Первичные заявки на пособие по безработице в США за неделю. Разрешения на строительство и начатые строительства за июль.

Еврооблигации

	Погашение	Доходность	Дюрация
RENAISSANCE CAP	15.02.2013	25,1%	0,4
VTB BANK	31.10.2012	0,4%	0,2
SBERBANK	15.05.2013	1,0%	0,7
TRANSNEFT	07.08.2013	1,2%	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	1,3%	0,7
LUKOIL INTL FIN	05.11.2014	2,1%	2,0
EVRAZ GROUP SA	24.04.2013	3,1%	0,6
VIMPELCOM	30.04.2013	2,0%	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%	3,1
VTB BANK	04.03.2015	3,5%	2,3
TNK-BP FINANCE	18.07.2016	3,7%	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	3,51	+0,14 %	+3,66 %	-2,77 %
Газпром нефть	23,88	-0,12 %	+1,66 %	+1,62 %
ЛУКОЙЛ	58,50	+0,34 %	+4,09 %	+10,48 %
Роснефть	6,25	+0,47 %	-0,79 %	-5,30 %
Ростелеком	23,69	+0,47 %	+8,12 %	-16,02 %
Система	20,50	+1,12 %	+4,33 %	+21,95 %
Газпром	9,67	+1,08 %	+3,26 %	-9,29 %
Сбербанк	11,66	+0,17 %	+3,83 %	+17,54 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0562	-1,32 %	+1,17 %	-4,42 %
Газпром нефть	152,01	-2,06 %	-0,24 %	+2,59 %
ЛУКОЙЛ	1866,80	-1,15 %	+1,58 %	+9,60 %
Роснефть	200,30	-1,89 %	-3,05 %	-6,39 %
Ростелеком	125,41	-0,24 %	+5,25 %	-17,69 %
Система	26,28	-2,03 %	+5,50 %	+12,23 %
Газпром	154,59	-1,48 %	+0,56 %	-9,79 %
Сбербанк	92,92	-0,76 %	+2,21 %	+17,10 %

©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