УНИВЕР капитал

Daily

29 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 нейтральный.

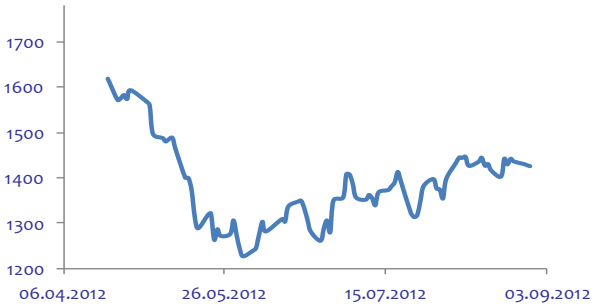
Нефть продолжает сползание и находится возле $112,5 за баррель Brent, торги в Азии проходят разнонаправленно, также как завершилась американская сессия. Фьючерсы на американские индексы слегка поднимаются.

На рынке госдолга ситуация в целом стабильна, суверенный спрэд на Россию устойчиво держится в районе 145 б.п.

Размещения итальянских облигаций прошли чрезвычайно успешно, показав значительное падение доходности, что, впрочем, говорит скорее о готовности игроков к спекулятивным покупкам в ожидании выкупа проблемных облигаций со стороны ЕЦБ на вторичном рынке. Основной болевой точной теперь может стать необходимость дополнительных займов со стороны Испании для наполнения региональных бюджетов – в ближайшее время Каталония может обратиться за помощью, а это означает неизбежные просьбы о поддержке со стороны и нескольких других областей.

Отчётность **Сбербанка** сегодня может стать поводом для продаж бумаги в случае негативной динамики на американских площадках. Можно рекомендовать переход к коротким продажам в середине дня. Для частичного хеджирования позиции будет разумно использовать длинные позиции в **ВТБ** (бумага очень устойчива последнее время и активно выкупается на просадках), а также привилегированных акциях **Сбербанка**, поскольку возможность приватизации будет служить им дополнительной поддержкой.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13103	-0,17 %	+0,2 %	+7,2 %
S&P 500	1409	-0,08 %	+1,7 %	+12,1 %
NASDAQ	3077	+0,13 %	+4,0 %	+18,1 %
Mexico Bolsa	39951	-0,06 %	-3,7 %	+7,8 %
Brazilian Bovespa	58406	+0,51 %	+3,3 %	+2,9 %
Argentina Merval	2447	-0,55 %	+0,5 %	-0,6 %
FTSE	5776	-0,02 %	+2,6 %	+3,7 %
DAX	7003	-0,64 %	+4,7 %	+18,7 %
CAC	3432	-0,90 %	+4,6 %	+8,6 %
NIKKEI	9070	+0,40 %	+5,9 %	+7,3 %
Hang Seng	19809	-0,01 %	+2,8 %	+7,5 %
Korea Composite	1929	+0,64 %	+5,4 %	+5,6 %
MSCI EM	957	-0,43 %	+1,6 %	+4,4 %
РТС	1427	-0,19 %	+3,2 %	+3,2 %
ММВБ	1455	+0,15 %	+3,5 %	+3,8 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	32,03	-0,2 %	+0,5 %	+0,3 %
Евро/Рубль	40,24	-0,0 %	-2,0 %	+3,7 %
Евро/Доллар	1,2561	-0,0 %	+2,5 %	-3,1 %
Евро/Фунт	0,79406	+0,0 %	-1,7 %	+5,0 %
Доллар/Йена	78,53	-0,0 %	-0,4 %	-2,1 %
Доллар/Франк	0,9561	-0,0 %	+2,5 %	-1,9 %
Доллар/Новозел.	1,2412	-0,1 %	+0,4 %	-3,5 %
Евро/Австрал.	0,9633	-0,0 %	+1,2 %	-1,7 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

29 августа 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	112,3	-0,3 %	+5,5 %	+4,6 %
WTI	95,9	-0,5 %	+6,3 %	-3,0 %
Urals	112,5	+0,1 %	+5,2 %	+6,4 %
Sib. Light	114,1	+0,1 %	+5,7 %	+4,8 %
REBCO	109,95	-2,3 %	+4,8 %	+6,7 %
Никель	16210	-1,3 %	+2,2 %	-11,3 %
Медь	7606	+0,1 %	+0,7 %	+0,7 %
Алюминий	1883	+0,6 %	+1,2 %	-4,4 %
Олово	20675	+1,7 %	+13,4 %	+9,1 %
Свинец	1954,5	+0,6 %	+2,5 %	-1,3 %
Цинк	1848	+0,6 %	+0,7 %	+1,1 %
Сталь	355	+1,3 %	-7,8 %	-36,6 %
Золото	1668	+0,1 %	+3,1 %	+9,0 %
Платина	1521	-1,0 %	+7,9 %	+12,3 %
Палладий	640	-0,5 %	+11,5 %	+1,6 %
Серебро	30,8	+1,5 %	+11,1 %	+9,3 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	146,00	-0,68 %	-12,05 %	-45,93 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,44 %
Газпром нефть	+0,35 %
ЛУКОЙЛ	-0,13 %
Роснефть	-0,87 %
Ростелеком	+0,04 %
Система	+22,61 %
Газпром	-0,41 %
Сбербанк	+0,52 %

Важнейшая макроэкономическая статистика

16:30 – Прирост ВВП США во 2К 2012 г.
16:30 – Базовый индекс цен расходов на личное потребление в США во 2К 2012 г.
18:00 – Индекс подписанных договоров о продаже недвижимости в США в июле.

Еврооблигации

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

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,46	-0,57 %	+6,53 %	-4,16 %
Газпром нефть	23,27	-0,98 %	-3,60 %	-0,98 %
ЛУКОЙЛ	58,60	-0,68 %	+3,53 %	+10,67 %
Роснефть	6,15	-1,13 %	+0,66 %	-6,82 %
Ростелеком	23,50	-0,68 %	+9,30 %	-16,70 %
Система	19,63	-2,09 %	-5,90 %	+16,78 %
Газпром	9,75	-0,51 %	+3,01 %	-8,54 %
Сбербанк	11,85	+1,11 %	+4,87 %	+19,46 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0557	-0,22 %	+6,20 %	-5,40 %
Газпром нефть	148,56	-0,32 %	-3,89 %	+0,26 %
ЛУКОЙЛ	1879,40	-0,12 %	+3,43 %	+10,34 %
Роснефть	198,73	+0,07 %	+0,55 %	-7,13 %
Ростелеком	125,40	+0,14 %	+9,46 %	-17,70 %
Система	25,64	*+0,00 %*	-0,59 %	+9,51 %
Газпром	156,80	-0,10 %	+2,93 %	-8,50 %
Сбербанк	94,40	-0,13 %	+4,52 %	+18,97 %

©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

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