УНИВЕР капитал

Daily

30 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 оттолкнулась после вчерашнего спуска к $111,5 и находится возле $112,5 за баррель Brent, торги в Азии проходят в красной зоне, несмотря на позитивные итоги торгов в США. Фьючерсы на американские индексы снижаются на фоне бэквордации.

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

День сравнительно небогат на статистику – только в 16:30 по Москве поступят данные по индексу расходов на личное потребление в США, причём снижение может быть истолковано в пользу запуска QE3, однако после вчерашних хороших данных по ВВП США за 2К 2012 года вероятность его всё же существенно понизилась.

Сегодня стоит сохранять открытые вчера короткие позиции. Стоит рассмотреть спекулятивную покупку **Роснефти** от 196-196,5 руб. и готовиться к активной покупке акций компании в случае просадки в район 193,5 в течение ближайших сессий.

Технически картина как по российским, так и по мировым индексам выглядит слабой и это заставляет рекомендовать частичное прикрытие длинных позиций во второй половине дня.

График индекса РТС



Мировые индексы

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Dow Jones	13107	+0,03 %	+0,3 %	+7,3 %
S&P 500	1410	+0,08 %	+1,8 %	+12,2 %
NASDAQ	3081	+0,13 %	+4,6 %	+18,3 %
Mexico Bolsa	39909	-0,11 %	-3,4 %	+7,6 %
Brazilian Bovespa	57369	-1,78 %	+0,2 %	+1,1 %
Argentina Merval	2445	-0,07 %	+1,0 %	-0,7 %
FTSE	5744	-0,56 %	+0,9 %	+3,1 %
DAX	7011	+0,11 %	+3,5 %	+18,9 %
CAC	3414	-0,52 %	+2,8 %	+8,0 %
NIKKEI	8993	-0,85 %	+4,1 %	+6,4 %
Hang Seng	19568	-1,12 %	-0,1 %	+6,1 %
Korea Composite	1909	-1,01 %	+3,5 %	+4,6 %
MSCI EM	953	-0,40 %	+0,4 %	+4,0 %
РТС	1410	-1,31 %	+0,8 %	+2,0 %
ММВБ	1437	-0,94 %	+0,6 %	+2,5 %

Валюты

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Доллар/Рубль	32,24	-0,1 %	-0,2 %	-0,3 %
Евро/Рубль	40,48	-0,4 %	-2,6 %	+3,1 %
Евро/Доллар	1,2554	+0,2 %	+2,4 %	-3,1 %
Евро/Фунт	0,79263	-0,2 %	-1,5 %	+5,1 %
Доллар/Йена	78,63	+0,1 %	-0,6 %	-2,2 %
Доллар/Франк	0,9568	+0,2 %	+2,4 %	-2,0 %
Доллар/Новозел.	1,2458	-0,3 %	+0,8 %	-3,2 %
Евро/Австрал.	0,9673	+0,1 %	+1,6 %	-1,3 %

©2012, Универ Капитал

УНИВЕР капитал

Daily

30 августа 2012 г.

Товарные рынки

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
Brent	112,9	+0,3 %	+6,3 %	+5,1 %
WTI	95,2	-0,3 %	+6,0 %	-3,7 %
Urals	112,0	-0,4 %	+4,8 %	+6,0 %
Sib. Light	113,7	-0,4 %	+5,3 %	+4,4 %
REBCO	110,49	+0,5 %	+5,3 %	+7,3 %
Никель	16235	+0,2 %	+2,4 %	-11,2 %
Медь	7525	-1,1 %	-0,4 %	-0,4 %
Алюминий	1873	-0,5 %	+0,7 %	-4,9 %
Олово	20300	-1,8 %	+11,4 %	+7,1 %
Свинец	1959	+0,2 %	+2,7 %	-1,1 %
Цинк	1835	-0,7 %	*+0,0 %*	+0,4 %
Сталь	350	-1,4 %	-9,1 %	-37,5 %
Золото	1660	-0,5 %	+2,6 %	+8,4 %
Платина	1518	-0,2 %	+7,7 %	+12,1 %
Палладий	634	-0,9 %	+10,5 %	+0,6 %
Серебро	30,7	-0,3 %	+10,8 %	+9,1 %

Суверенный спрэд

Russia30-UST10	143,00	*+0,00 %*	-12,80 %	-47,04 %

ADR/Локальные акции

ВТБ	-0,02 %
Газпром нефть	+0,82 %
ЛУКОЙЛ	+0,45 %
Роснефть	-0,20 %
Ростелеком	+0,60 %
Система	+22,12 %
Газпром	-0,10 %
Сбербанк	+0,57 %

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	26,3%	0,4
VTB BANK	31.10.2012	0,2%	0,2
SBERBANK	15.05.2013	0,8%	0,7
TRANSNEFT	07.08.2013	0,9%	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	1,2%	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	1,8%	0,9
ALFA MTN INVEST	24.06.2013	2,4%	0,8
GAZPROMBANK	15.12.2014	3,5%	2,1
PROMSVYAZBK	15.07.2013	4,2%	0,8
GAZPROM	29.11.2015	2,7%	3,0
SBERBANK	07.07.2015	2,4%	2,6
GAZPROM	23.05.2016	3,0%	3,4
NOVATEK OAO	03.02.2016	3,1%	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	4,8%	3,1
JSC SEVERSTAL	26.07.2016	5,5%	3,4
VIMPELCOM	02.02.2016	5,0%	3,0

АДР

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	3,38	-2,46 %	+1,47 %	-6,51 %
Газпром нефть	23,20	-0,30 %	-4,96 %	-1,28 %
ЛУКОЙЛ	58,40	-0,34 %	+2,55 %	+10,29 %
Роснефть	6,11	-0,65 %	-2,63 %	-7,42 %
Ростелеком	23,49	-0,04 %	+9,66 %	-16,73 %
Система	19,30	-1,68 %	-9,60 %	+14,81 %
Газпром	9,67	-0,82 %	+0,89 %	-9,29 %
Сбербанк	11,79	-0,51 %	+3,42 %	+18,85 %

Локальные акции

	Закрытие	1D, %	1M, %	Y-t-D, %
ВТБ	0,0544	*+0,00 %*	+1,42 %	-7,51 %
Газпром нефть	148,39	*+0,00 %*	-5,63 %	+0,14 %
ЛУКОЙЛ	1874,60	*+0,00 %*	+2,08 %	+10,06 %
Роснефть	197,41	*+0,00 %*	-2,46 %	-7,74 %
Ростелеком	125,48	*+0,00 %*	+9,65 %	-17,64 %
Система	25,48	*+0,00 %*	-2,75 %	+8,82 %
Газпром	156,05	*+0,00 %*	+0,96 %	-8,94 %
Сбербанк	94,50	*+0,00 %*	+3,53 %	+19,09 %

©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