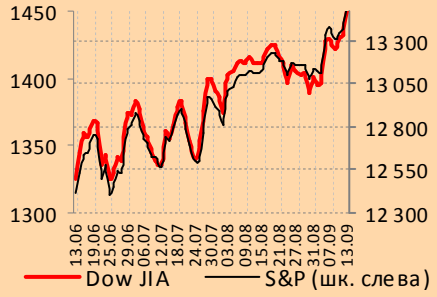
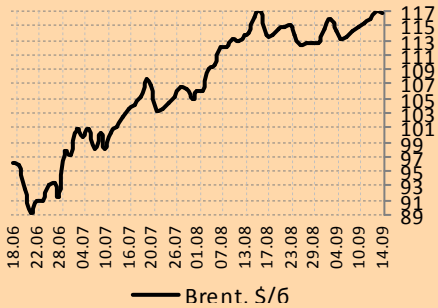
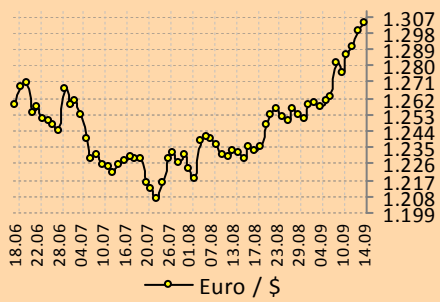
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

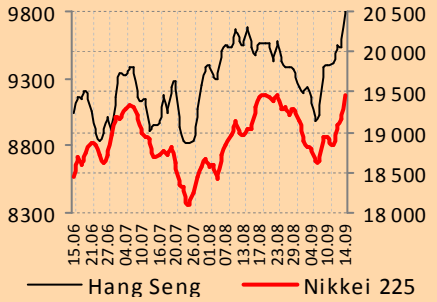
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

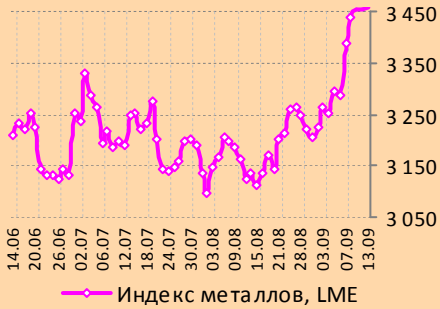
Ежедневный обзор

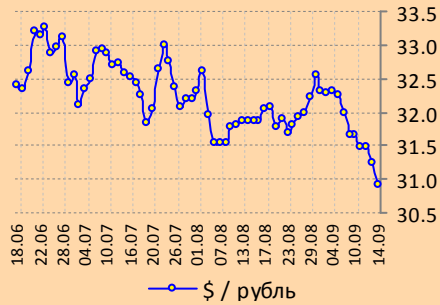






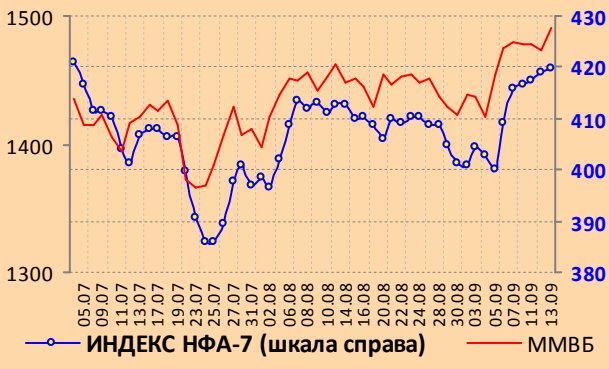






СОДЕРЖАНИЕ

I. Ежедневный комментарий 2
II. Фондовые рынки 3
2.1. Америка & Россия 3
2.2. Европа 4
2.3. Азия 6
2.4. Латинская Америка 7
III. Сырьевые рынки 8
3.1. Нефть 8
3.2. Металлы 10



Версия 2012-09-14

США. Долгожданное QE3 привело индексы к значительному росту, Dow =+1,55, S&P 500 =+1,63, NASDAQ =+1,33%. Итак, ФРС, в целях стимулирования экономического роста и снижения безработицы, решила: 1) сохранить ставку на уровне 0-0,25% до средины 2015г.; 2) начать покупку ипотечных бумаг на сумму 40 млрд. долл. ежемесячно, с сегодняшнего дня до конца месяца будет куплено бумаг на 23 млрд. (сразу в рост пошли на бирже акции компаний, наиболее связанных с ипотекой, строительных, потребсектора и т.д.); 3) продлить операцию «Твист» (продажа из портфеля ФРС по мере погашения краткосрочных госбумаг и приобретение за эти деньги долгосрочных) до конца года, объем 667 млрд. долл.; 4) понизить свой июньский прогноз на текущий год по ВВП с 1,9-2,4 до 1,7-2,0%, повысить по инфляции с 1,2-1,7 до 1,7-1,8%, оставить без изменения прогноз по безработице в 8-8,2%. Учитывая, что сейчас оба кандидата в президенты практически имеют равные шансы на победу, а г-н Ромни выражал недовольство политикой ФРС именно с точки зрения QE, можно сказать, что этим шагом г-н Бернанке поставил на г-на Обаму.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, при общем внешнем негативе, даже при высоких ценах нефти, биржи вчера пытались расти, но это удалось наполовину, индекс ММВБ -0,4%, РТС =+0,24%. ЦБ повысил ставку рефинансирования с 8,0 до 8,25%.

Европа. Рост показал только FTSE 100 +0,65%, DAX =-0,45, CAC 40 =-1,18. Из статистики отметим снижение доходности итальянских госбумаг, как по вновь размещенным вчера 3-летним, так и по ранее размещенным 15-летним гособлигациям (с 4,65 до 2,75% и с 5,9 до 5,32% соответственно). Снижение доходности говорит о повышенном интересе инвесторов к итальянским госбумагам после того, как ЕЦБ объявил о новой программе скупки гособлигаций проблемных стран еврозоны на вторичном рынке.

В Греции растет безработица, во втором квартале равна 23,6% (в первом 22,6%). Греческий Фонд развития активов определил 40 необитаемых островов, которые могут быть сданы в аренду на срок от 30 до 50 лет (если это не отразится на национальной безопасности) с целью привлечения средств для сокращения госдолга. Острова имеют хороший рельеф, развитую инфраструктуру и расположены недалеко от материка.

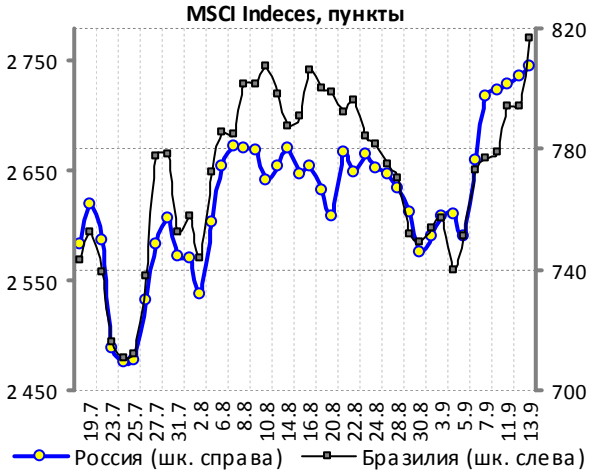
Азия. Торги четверга завершились полной неопределенностью, Nikkei и Kospi в плюсе (0,39 и 0,03), SSE и Hang Seng в минусе (0,76 и 0,14%). Рынки ждали новых стимулирующих мер со стороны ФРС, но не были в этом уверены.

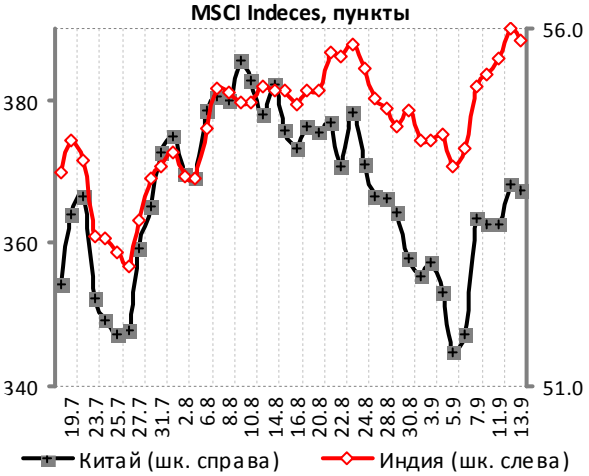
Золото. Утром четверга золото торговалось по 1733,79, к 15.00 по 1733,38, сегодня утром, по факту решений ФРС и ослабления доллара, декабрьские фьючерсы на золото = 1775,36, серебро = 33,77, платина = 1713 долл. за унцию.

Нефть. Запасы нефти в США, вопреки прогнозам, выросли, что, однако, практически не вызвало снижения цен, сильное повышающее влияние оказывает ожидание QE от ФРС и соответствующее ослабление доллара. Так, Brent и Light утром четверга шли по 115,42 и 97,41, к 15.00 по 115,60 и 97,48, сегодня с утра, уже по решениям ФРС, 116,53 и 99,49 долл. за барр.

События, прогноз. Министры финансов и руководители центральных банков еврозоны (Еврогруппа) соберутся, как ожидается, на Кипре в Никозии и обсудят состояние экономики Испании, а также сокращение бюджетных расходов Греции на сумму 11,5 млрд. евро в течение 2013-2014гг. Минфин Греции планировал к 14 сентября согласовать все вопросы с тройкой с тем, чтобы доклад тройки кредиторов о состоянии Греции мог быть представлен на рассмотрение Еврогруппы. А в Москве в субботу пройдет митинг оппозиции. Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас в преобладающем плюсе, Азия в абсолютном плюсе, нефть растет. Мировые площадки сегодня будут отыгрывать решение ФРС, наши – вместе со всеми и, вероятно, больше всех.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 14.09.2012.

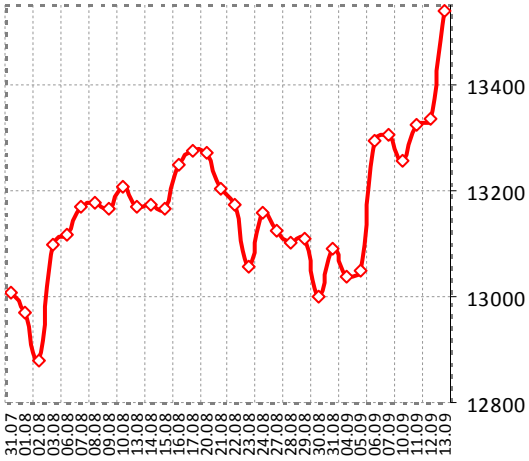




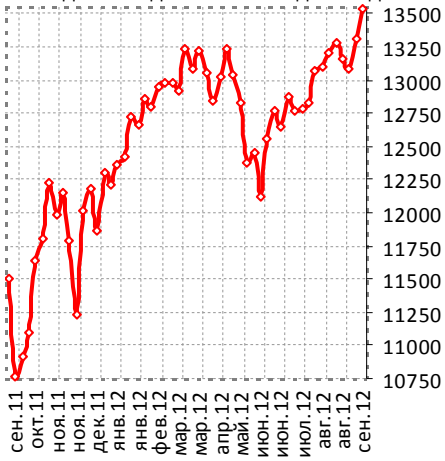
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

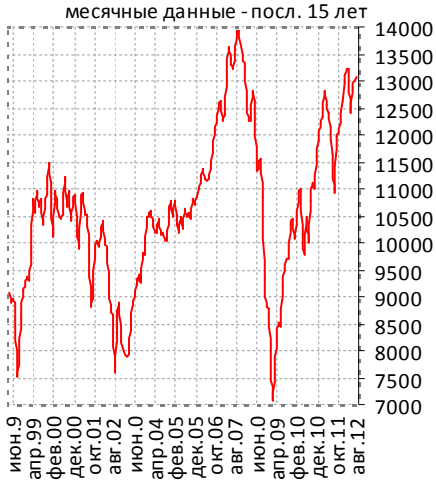
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



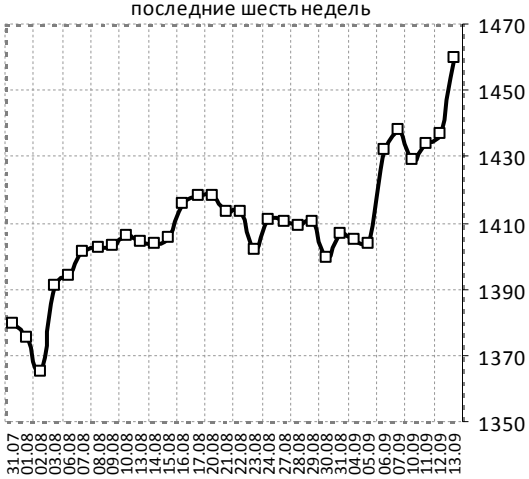
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



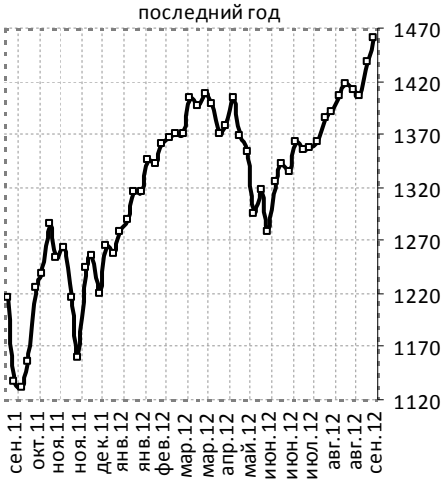
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



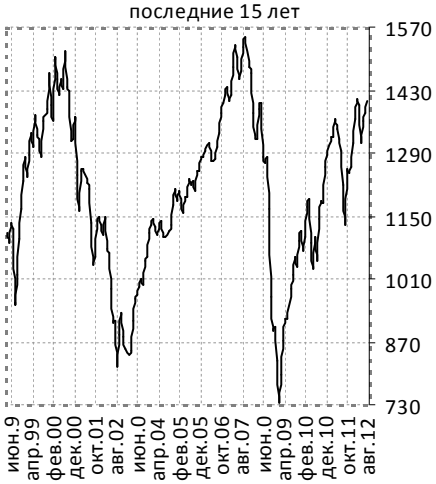
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



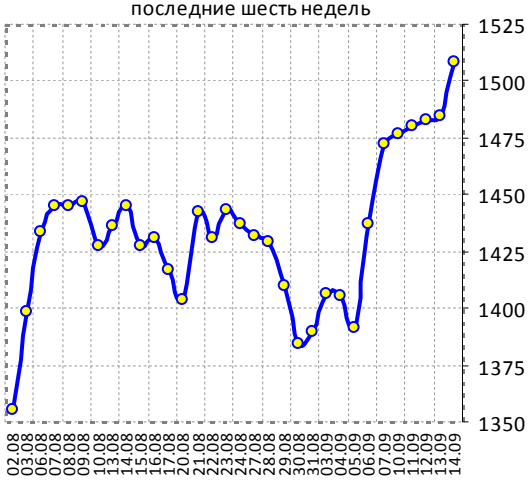
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



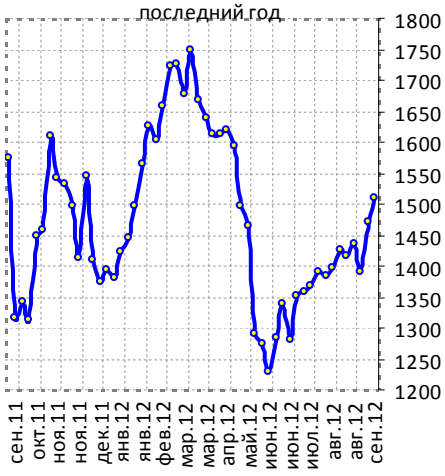
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



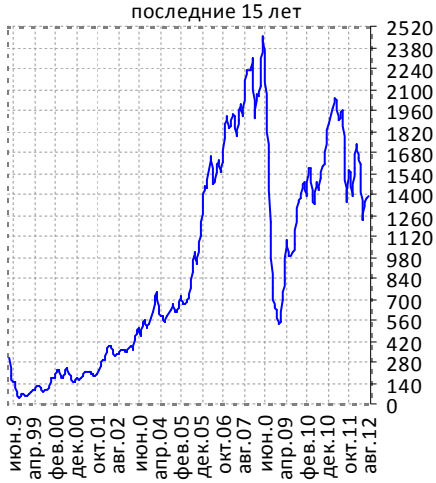
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



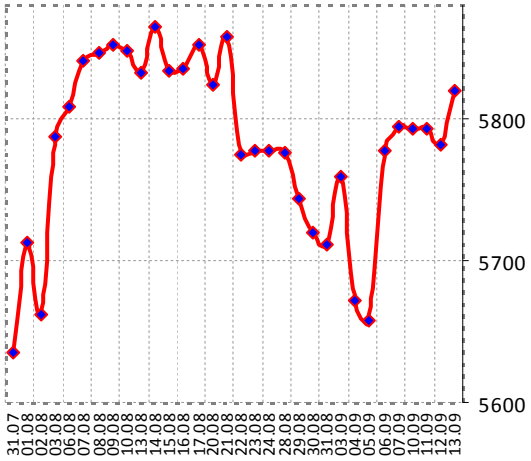
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



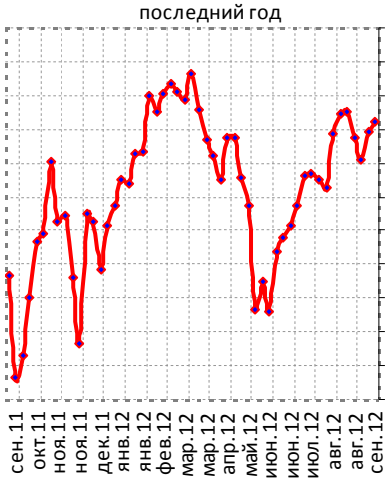
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

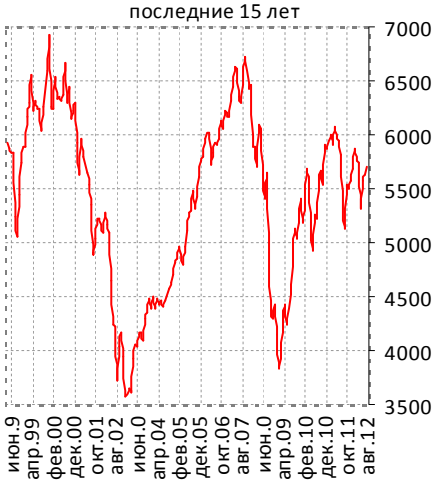
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



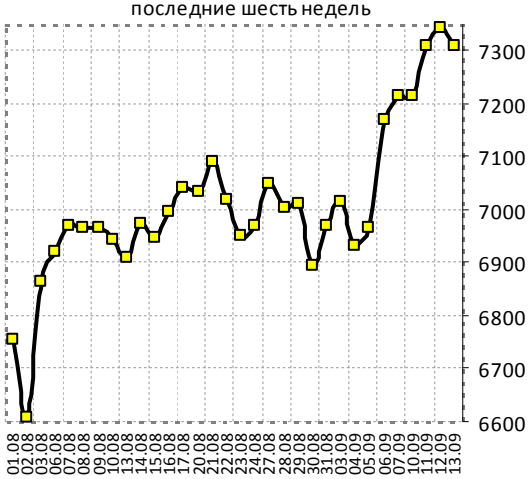
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



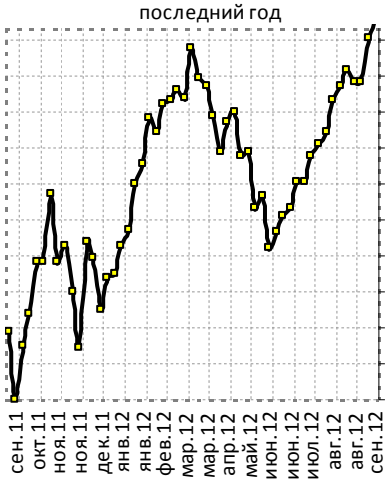
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



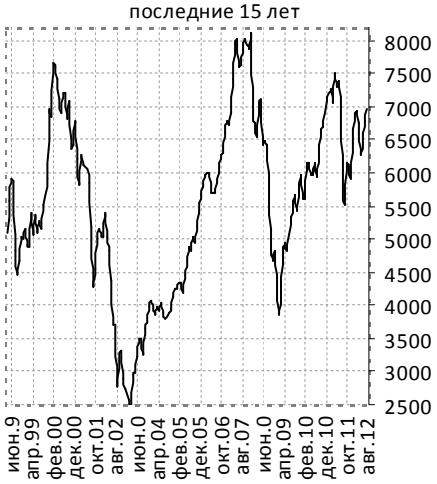
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



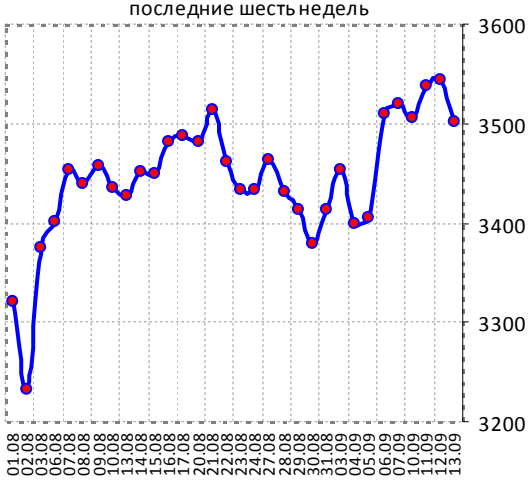
DAX Index: недельные данные - последний год



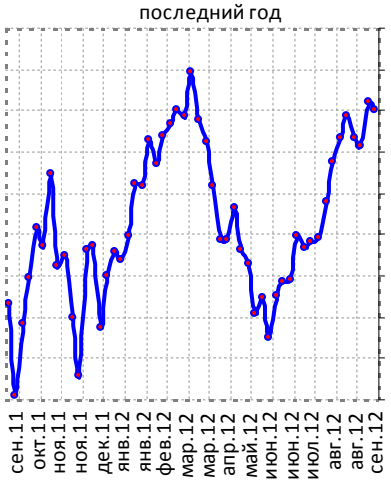
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



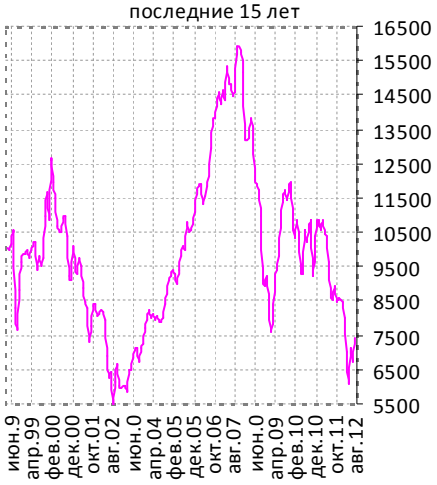
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

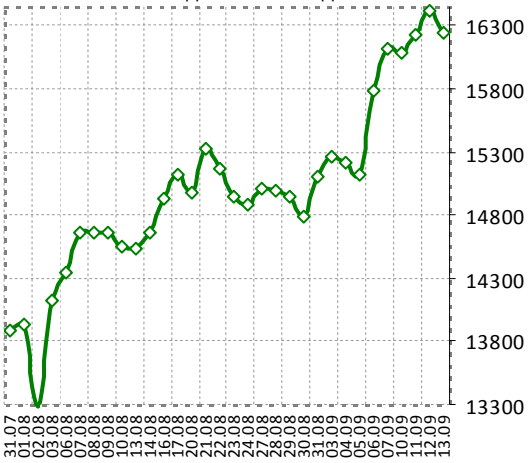


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

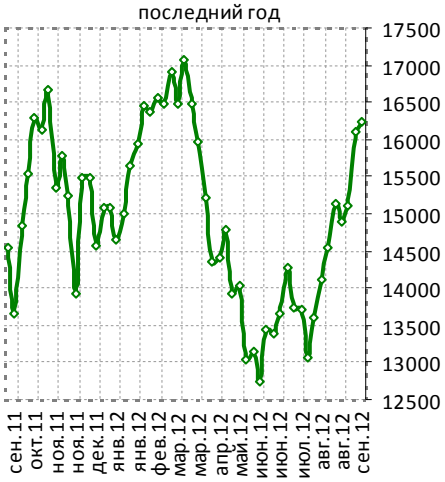


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

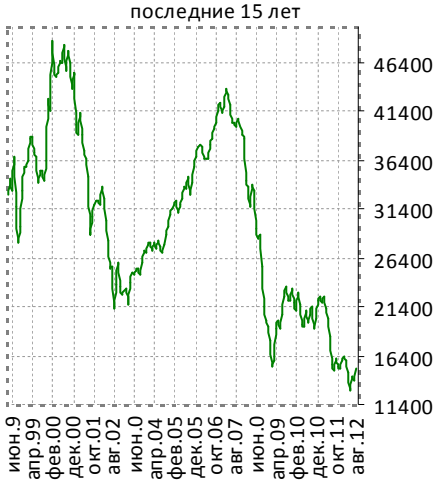
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



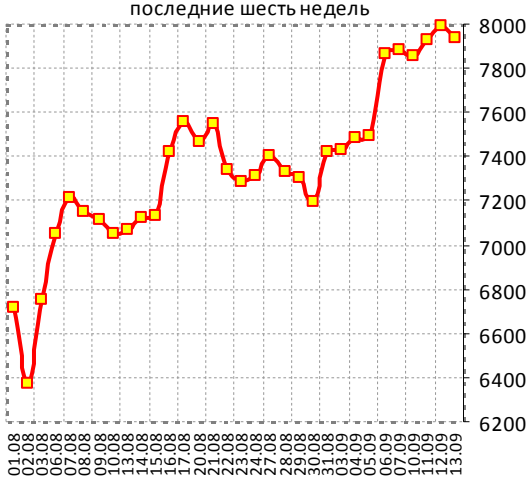
MIB Index: недельные данные - последний год



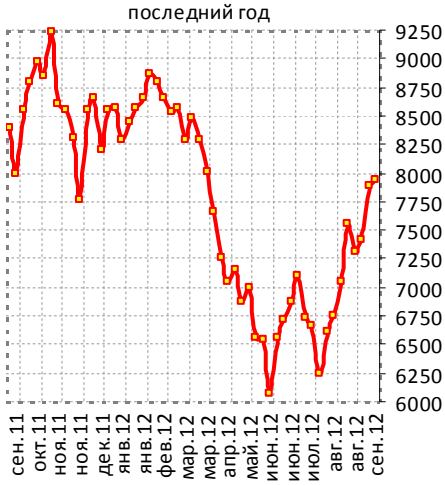
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



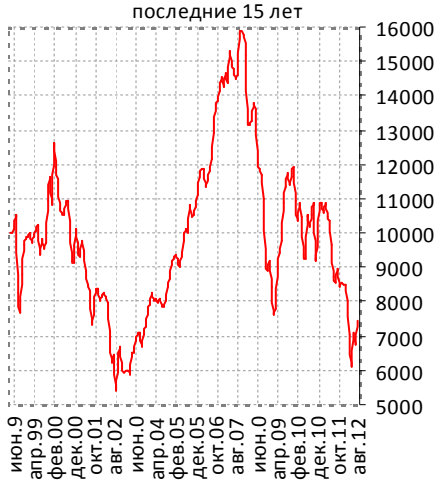
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



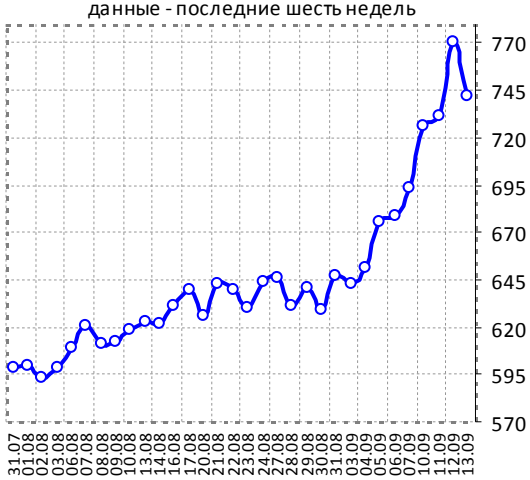
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



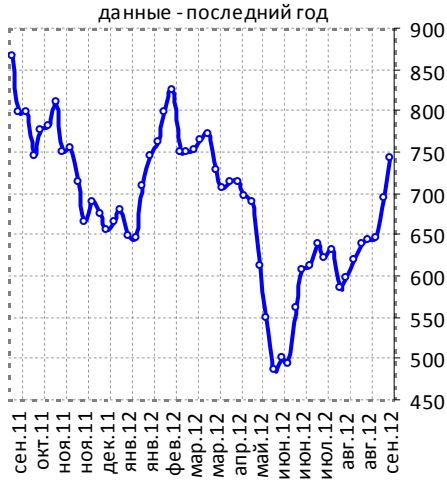
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



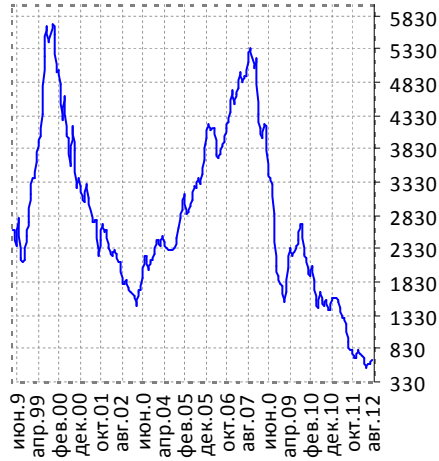
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



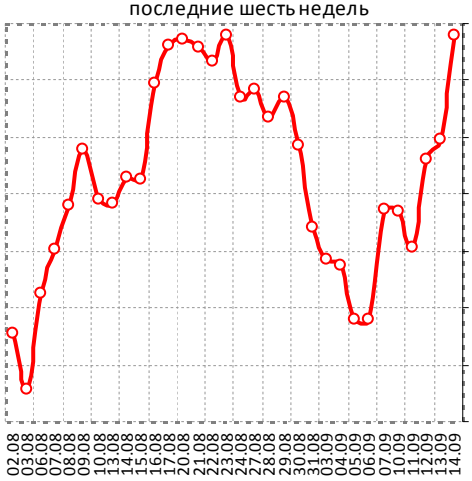
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



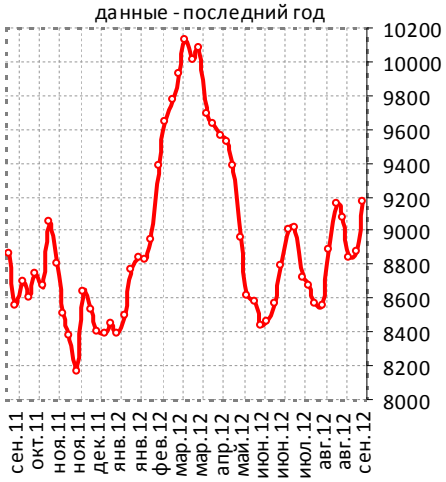
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

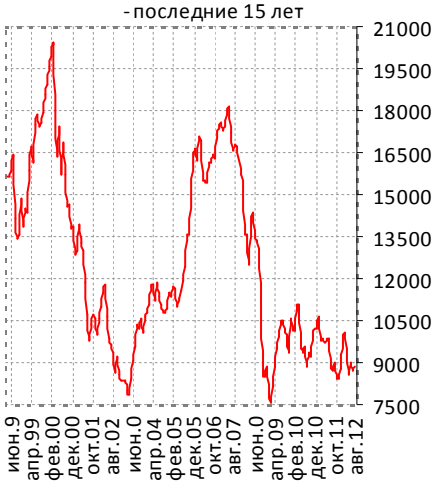
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



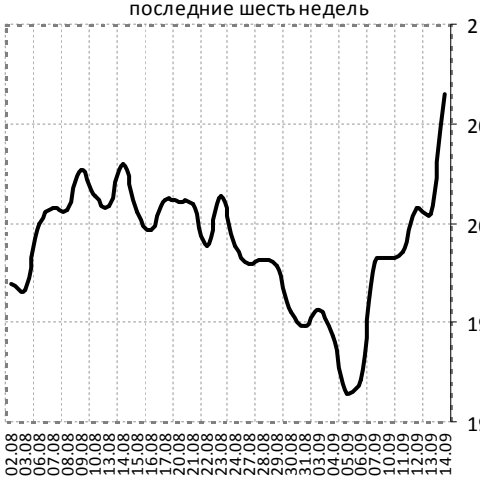
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



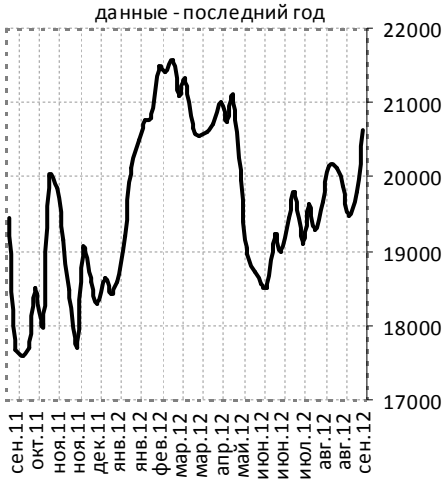
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



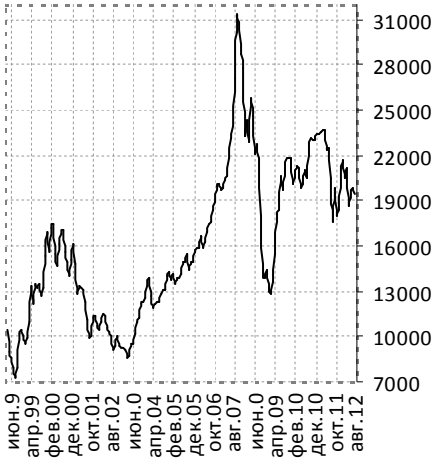
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



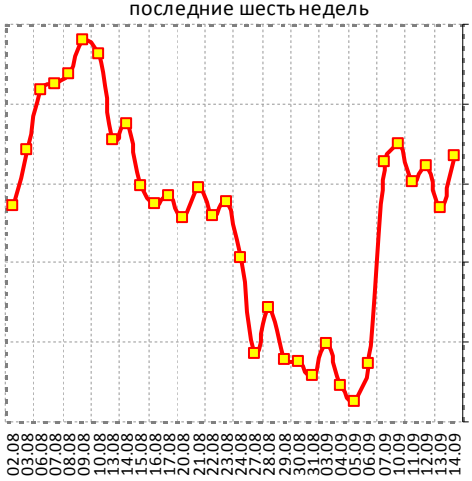
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



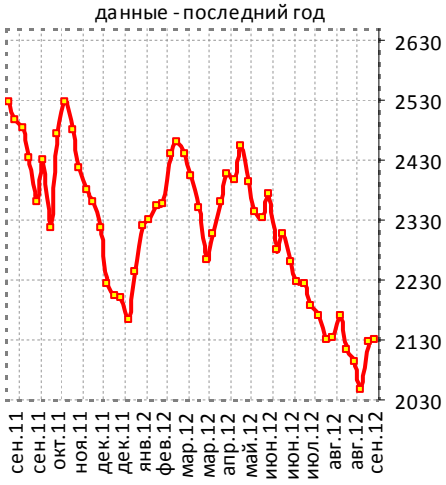
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



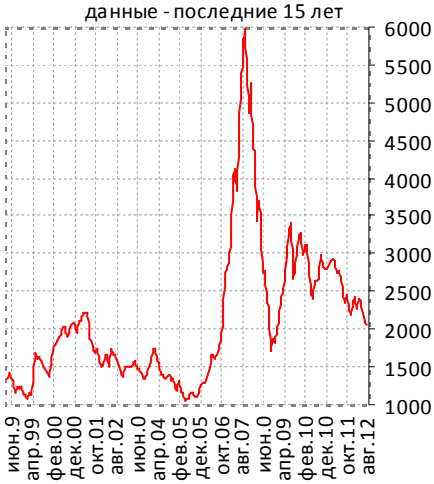
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



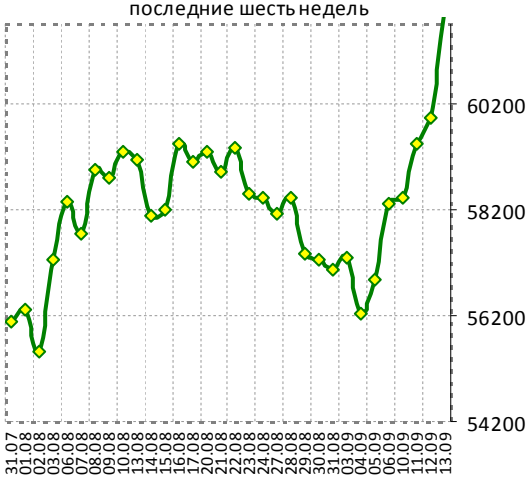
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



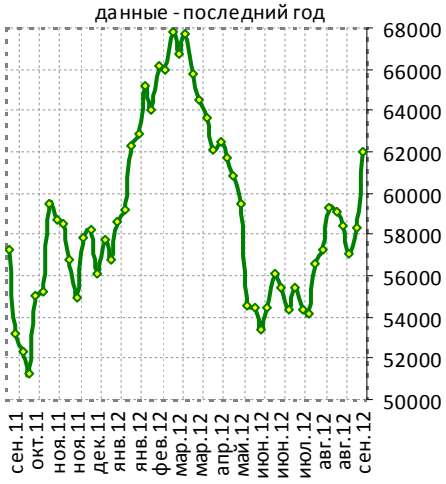
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

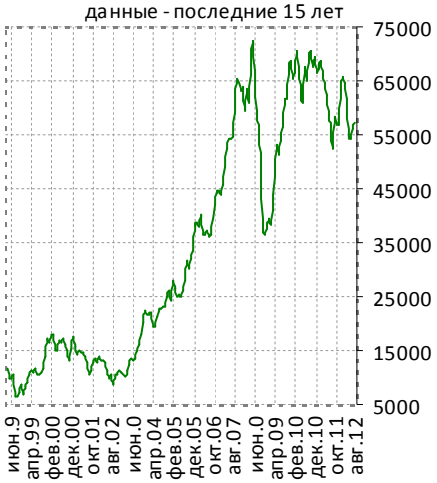
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



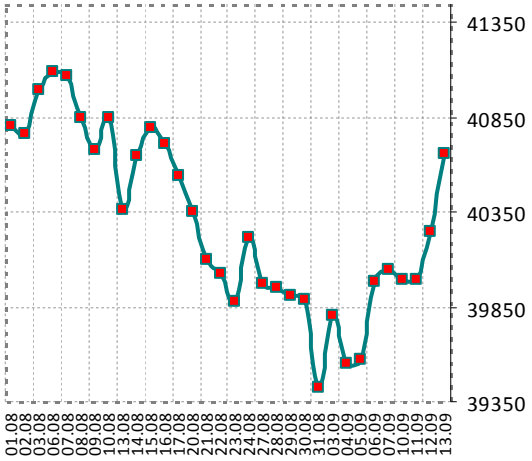
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



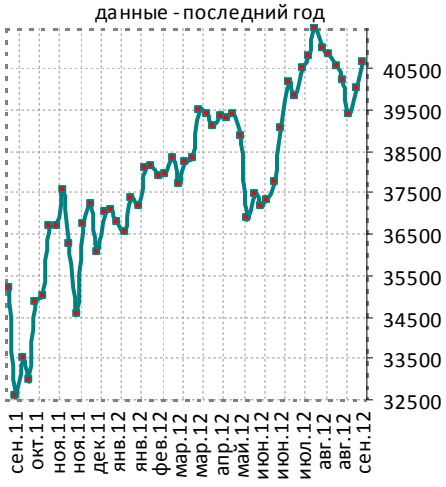
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



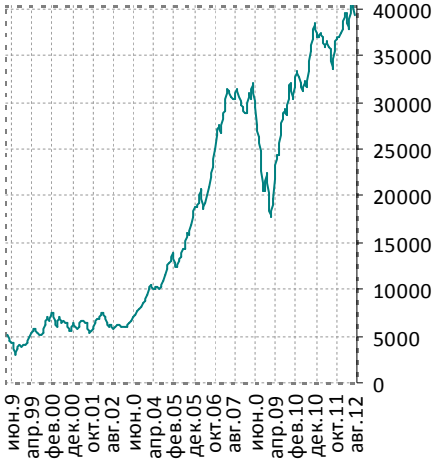
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



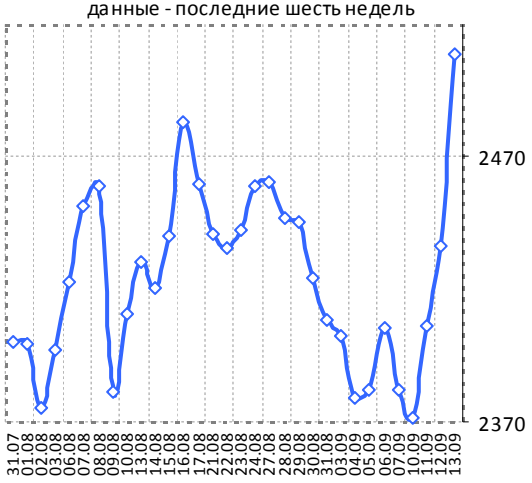
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



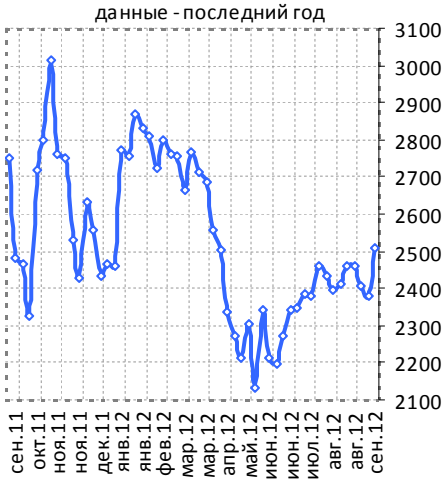
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



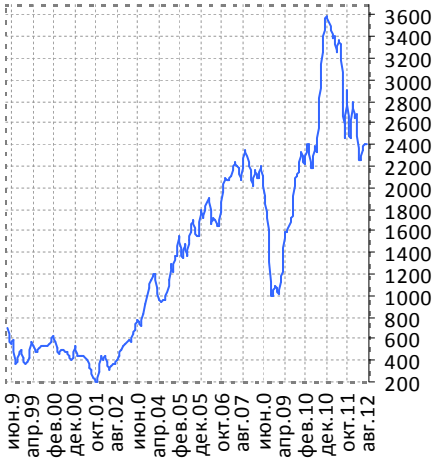
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

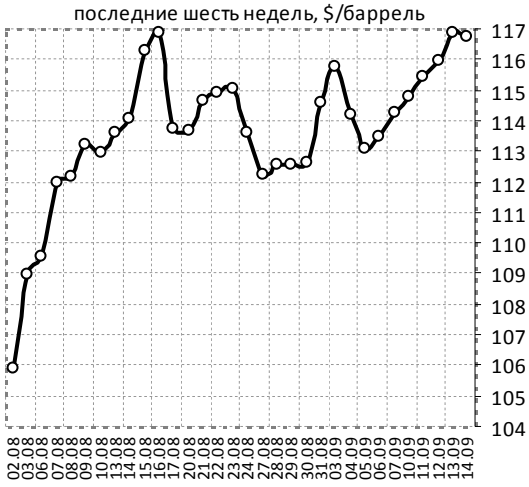


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

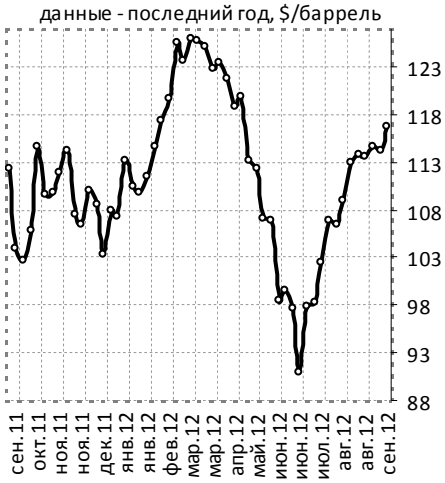
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

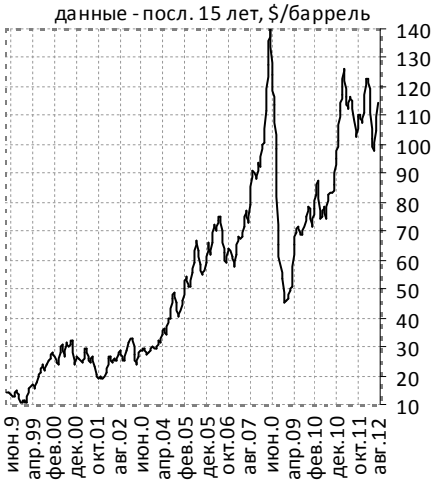
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



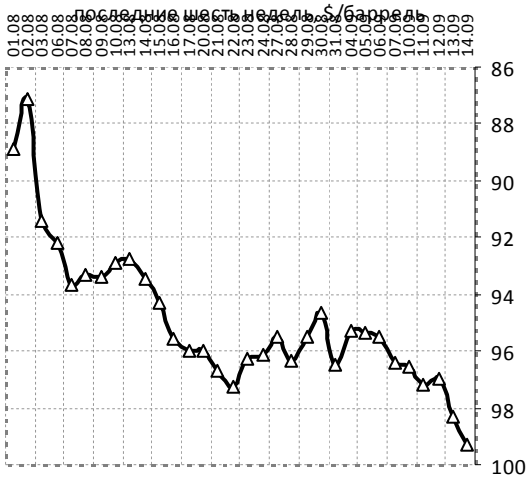
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



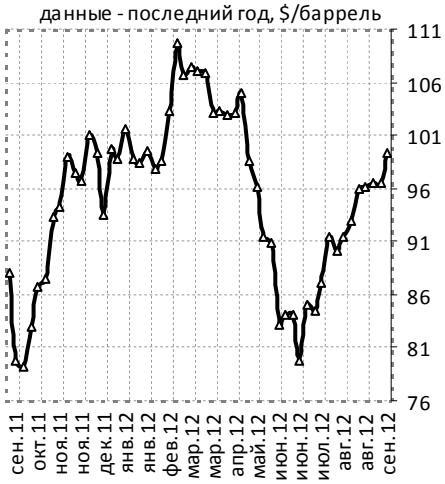
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



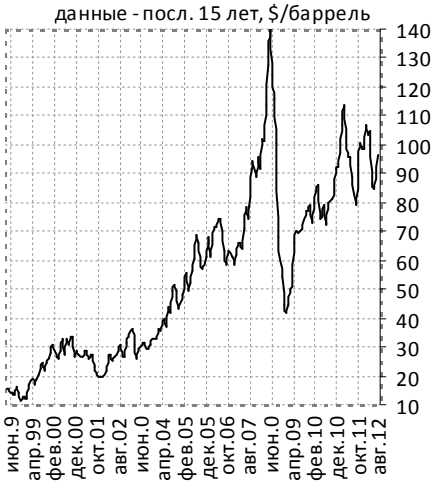
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



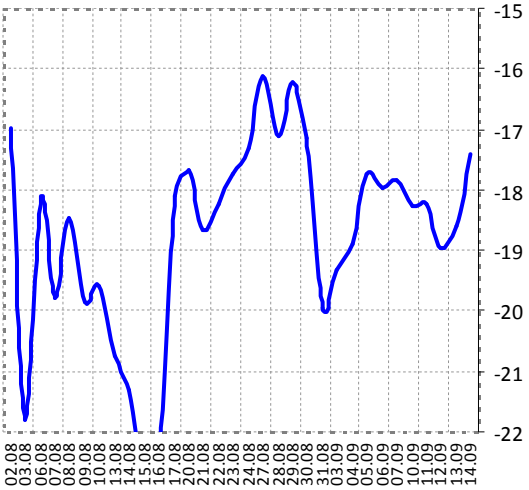
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



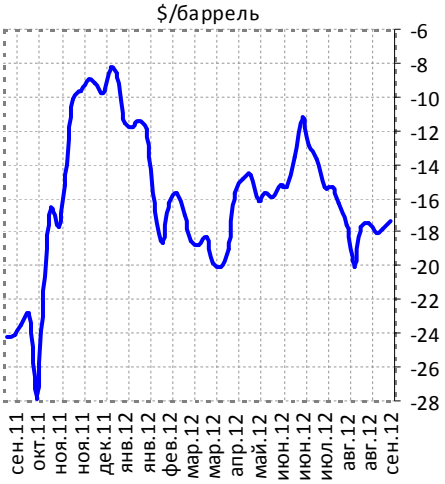
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



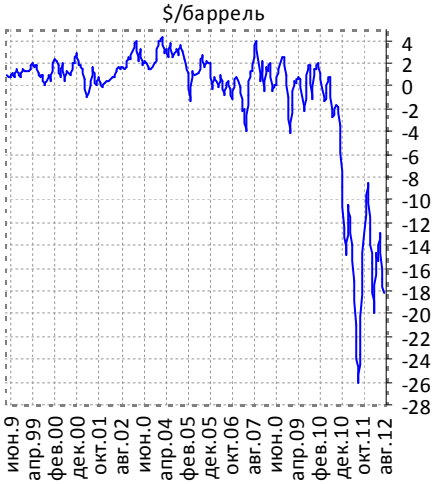
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



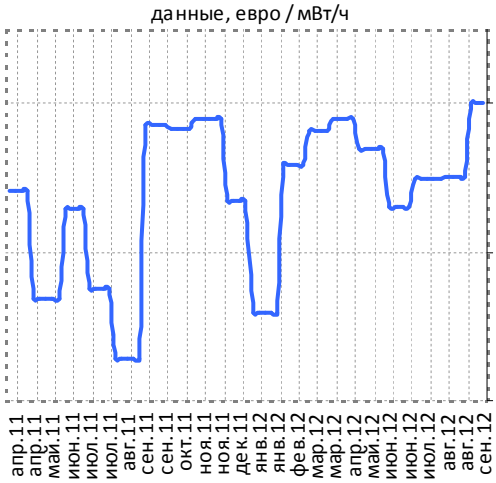
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



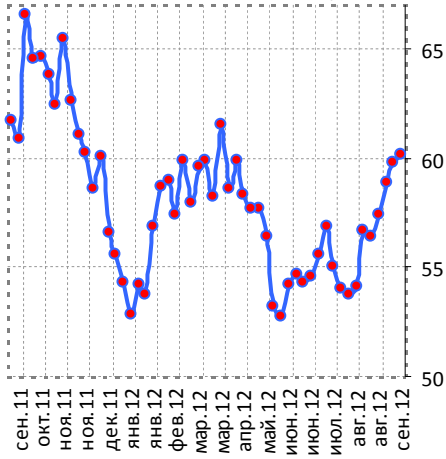
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

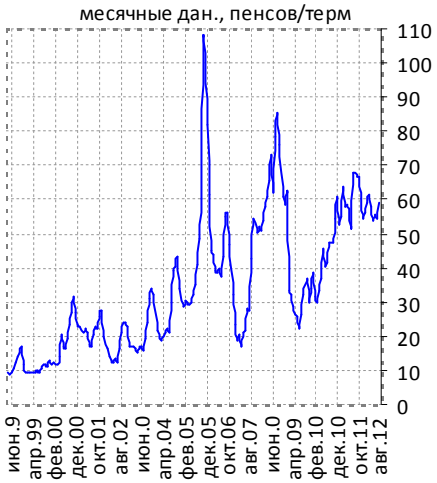
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



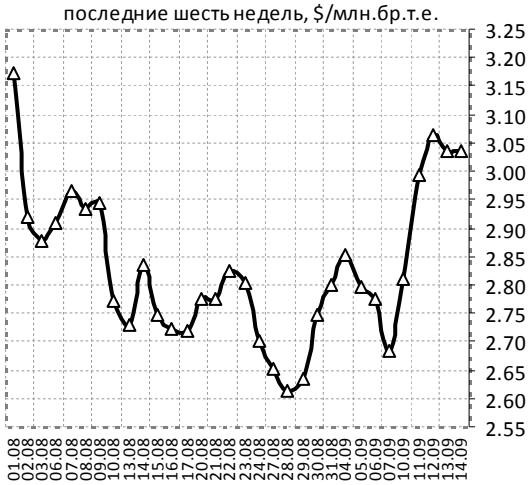
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



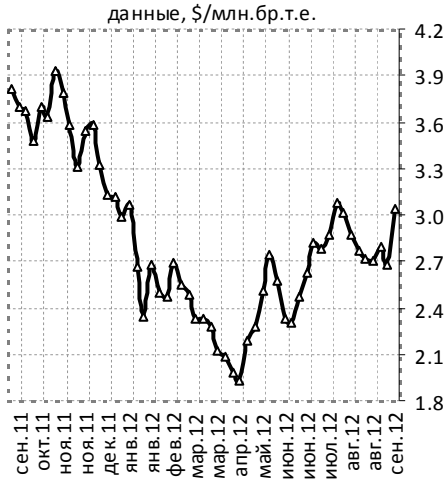
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



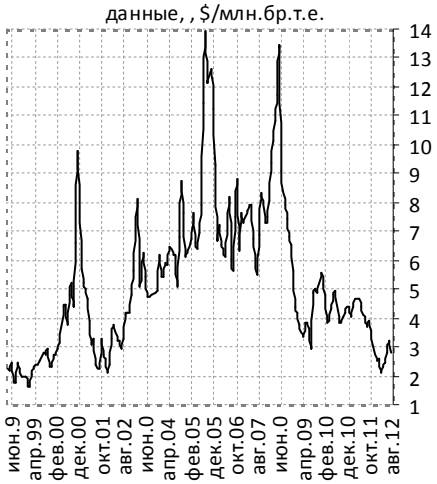
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



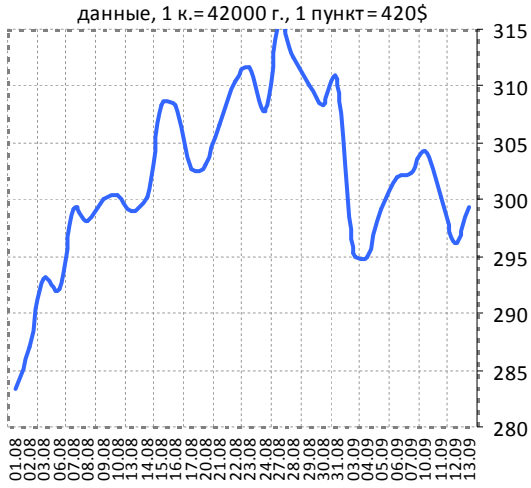
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



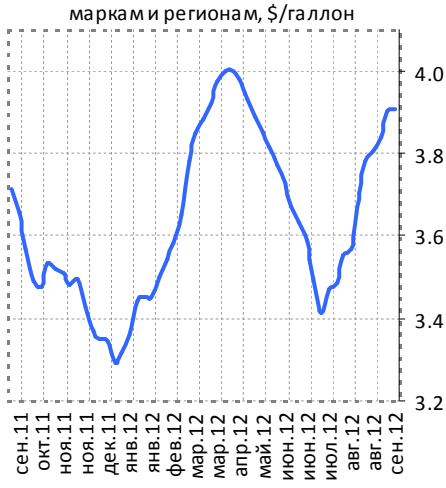
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



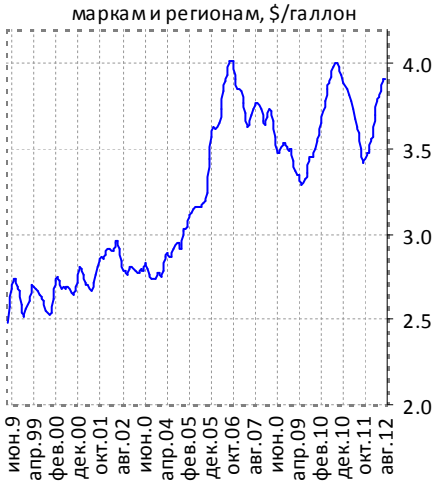
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



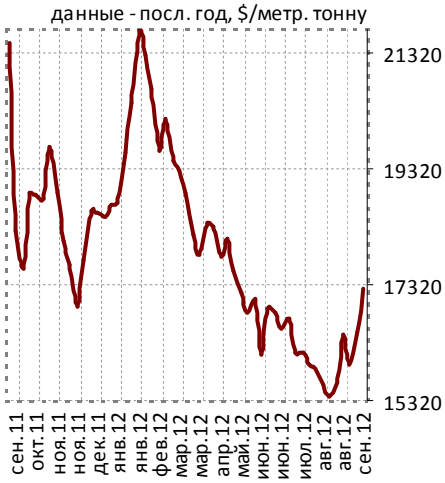
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

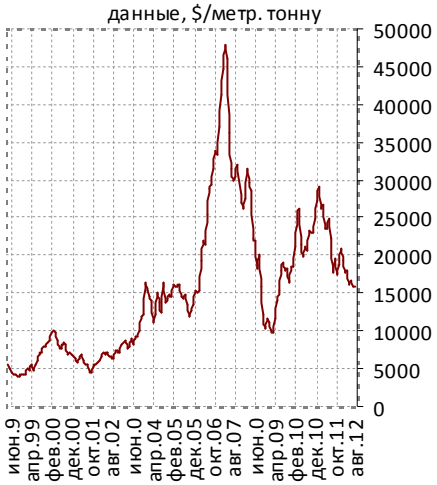
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



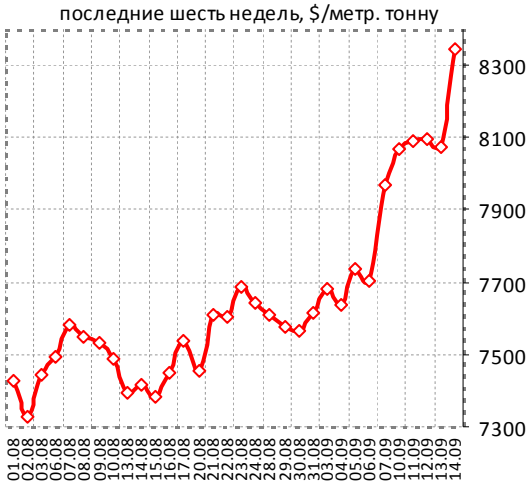
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



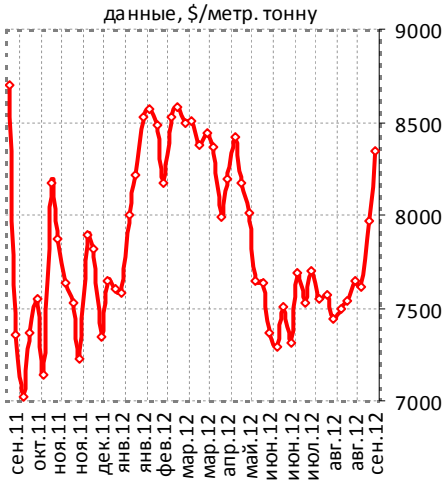
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



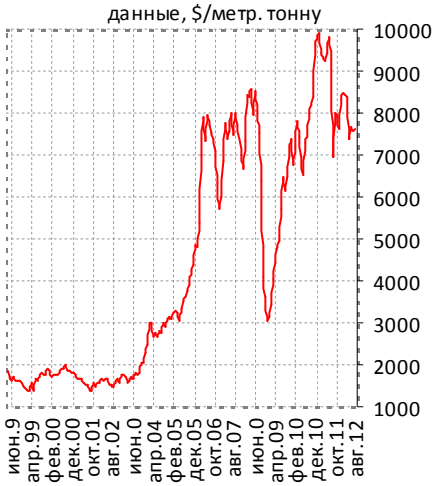
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



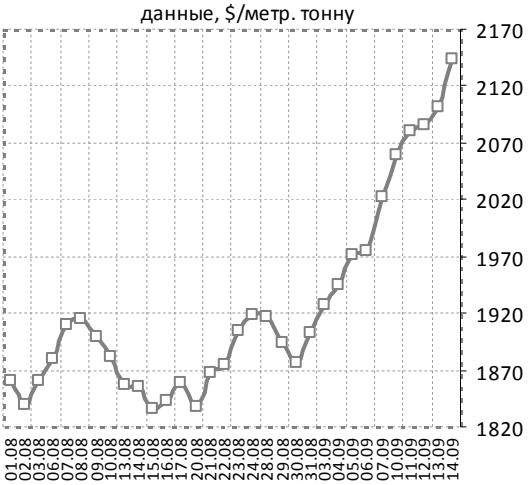
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



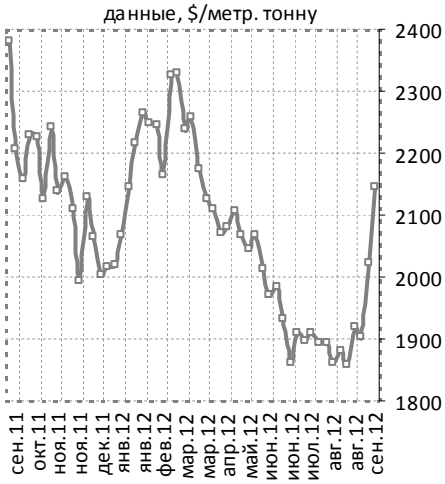
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



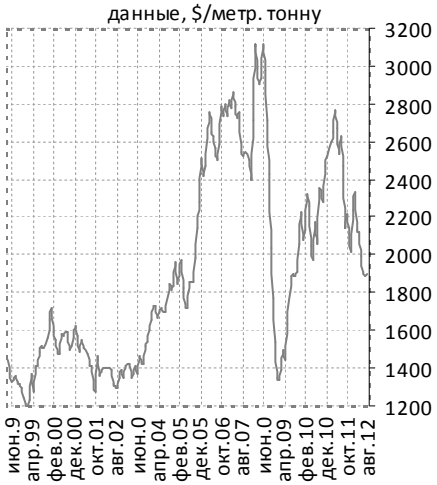
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



Фьючерс на алюминий: недельные данные, $/метр. тонну



Фьючерс на алюминий: месячные данные, $/метр. тонну



Источники данных: Bloomberg (LME).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

Фотографии на титульной странице обзора:
http://www.cbsnews.com
(официальный сайт CBSNews).

Содержание

I. Ежедневный комментарий 2
II. Фондовые рынки 3
2.1. Америка & Россия 3
2.2. Европа 4
2.3. Азия 6
2.4. Латинская Америка 7
III. Сырьевые рынки 8
3.1. Нефтяной рынок 8
3.2. Природный газ и бензин 9
3.3. Рынок металлов 10
5.1. Америка & Европа
5.2. Азия
VI. Социально-экономическая динамика
VI. Прочее

Аналитический отдел

Берсенев Евгений Павлович, директор департамента аналитики
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 158), e-mail: ebersenev@eufn.ru

Моисеева Людмила Филипповна, заместитель директора департамента аналитики
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 131), e-mail: l.moiseeva@eufn.ru

Белкина Анастасия Александровна, ведущий аналитик
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 151), e-mail: belkina@eufn.ru

Андрющенко Антон Олегович, аналитик
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 150), e-mail: a.anton@eufn.ru

Контакты

Открытое Акционерное Общество «ИК «ЕВРОФИНАНСЫ»
Аналитический отдел: (495) 545-35-35, доб. 158, 131, 150, 151
Отдел активных операций: (495) 545-35-35, доб. 120, 103, 113

119049 г. Москва,
Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35
(многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru, e-mail: analytics@eufn.ru

Настоящий отчет и содержащаяся в нем информация является исключительной собственностью ИК «Еврофинансы». Несанкционированное копирование, воспроизведение и распространение данной информации без письменного разрешения ИК «Еврофинансы» запрещено.

ИК «Еврофинансы» не несет какой-либо ответственности относительно любых последствий в результате использования информации, содержащейся в данном аналитическом отчете. ИК «Еврофинансы» не дает гарантий относительно полноты и достоверности приведенной в настоящем отчете информации. Настоящий отчет составлен на основе информации, полученной из официальных источников, надежность и достоверность которых общепризнанны. Вся информация, содержащаяся в данном отчете, ни при каких условиях не может рассматриваться как предложение или рекомендация к покупке или продаже ценных бумаг, предоставление гарантий или обещаний относительно будущих изменений на рынке ценных бумаг и действий эмитентов данных ценных бумаг. За последствия любых решений, принятых на основе настоящего отчета, ИК «Еврофинансы» ответственности не несет.