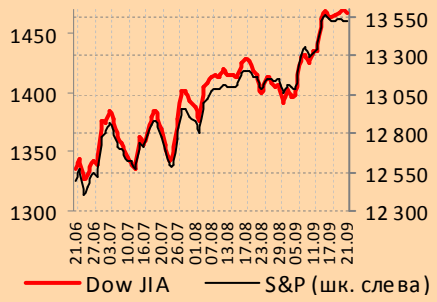
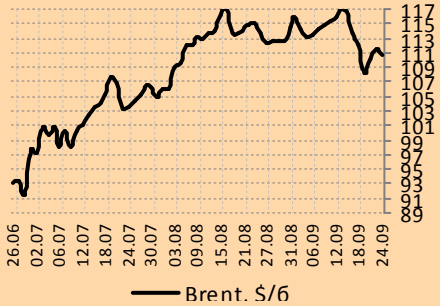
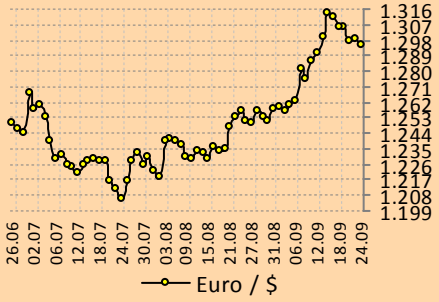
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

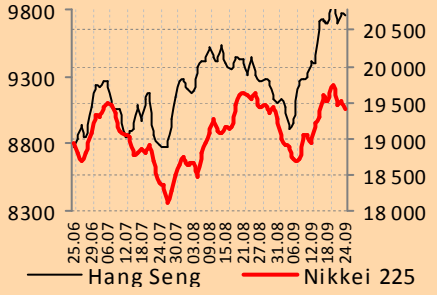
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

Ежедневный обзор

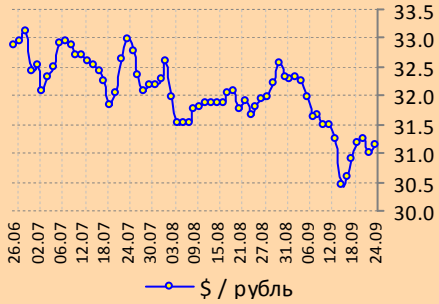






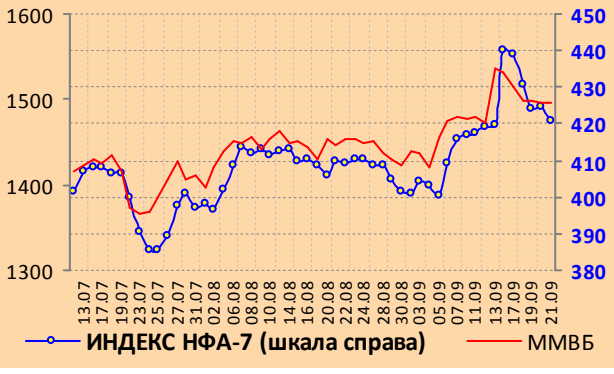






СОДЕРЖАНИЕ

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



США. В конце недели новости были противоречивыми. Так, Bank of America Merrill Lynch потерял 10 млн. долл. из-за операционной ошибки. Это второй в стране (после J.P.Morgan Chase) банк по размеру активов (2,14 трлн. долл.), на его долю приходится около 10% всех депозитов в США. Потери получены на торговле опционами, клиенты банка не пострадали. Безработица в Нью-Йорке, традиционно более высокая, чем в среднем по стране, снизилась с двузначных значений до 9,9%. Началась продажа iPhone 5, раньше всех смартфон появился в Австралии, Гонконге и Сингапуре, в пятницу продажа прошла в Германии, Франции, Великобритании, США и Канаде. До конца года новый iPhone будет продаваться в более чем 100 странах. Ожидается, что продажи iPhone 5 смогут обеспечить дополнительный прирост ВВП в размере от 0,25 до 0,5% в годовом исчислении, рыночная стоимость Apple превышает 700 млрд. долл. (крупнейшая по капитализации среди американских компаний), положительная динамика акций компании влияет на динамику рынка в целом. Итоги торгов последнего дня недели: Dow Jones= -0,13, S&P 500 = -0,01, Nasdaq =+0,13%.

По последнему опросу в США, действующий президент набирает 48, а его противник 43% голосов избирателей.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, подрастающая нефть поддерживала биржи от значительного снижения, индекс ММВБ =-0,18, РТС =+ 0,45%. Правительство обсудило проект федерального бюджета на трехлетний период (с 2013 по 15 гг.), было решено отправить документ на доработку. Из других новостей отметим, что максимальная ставка по вкладам в рублях 10 банков, привлекающим наибольший объем депозитов физических лиц, составила 10,53%, в начале года была 9,467%. Начался период выплаты дивидендов за 9 месяцев, что может способствовать приливу новых средств на рынки. В Госдуму поступил на рассмотрение проект закона о переходе на зимнее время (на 1 час назад) с 28 октября 2012 года. В этой связи РЖД остановил продажу билетов на поезда отправлением с 26 октября. В России официальные продажи iPhone 5 начнутся в декабре, наша страна попала во вторую волну поставок.

Европа. Появилась информация, что Испания все же обратится к европейским властям за помощью до октября, когда ей необходимо будет рефинансировать крупный пакет госдолга. В этой связи страна разрабатывает план структурных реформ, который будет опубликован уже на следующей неделе, а именно в четверг (27 сентября). Возможно, ситуация с Испанией ускорит меры ЕЦБ по активизации программы покупки гособлигаций проблемных стран. Новость снизила напряженность вокруг Испании, биржи отреагировали практически повсеместным ростом, CAC 40 =+0,6, DAX =+0,8, FTSE 100 =- 0,03%.

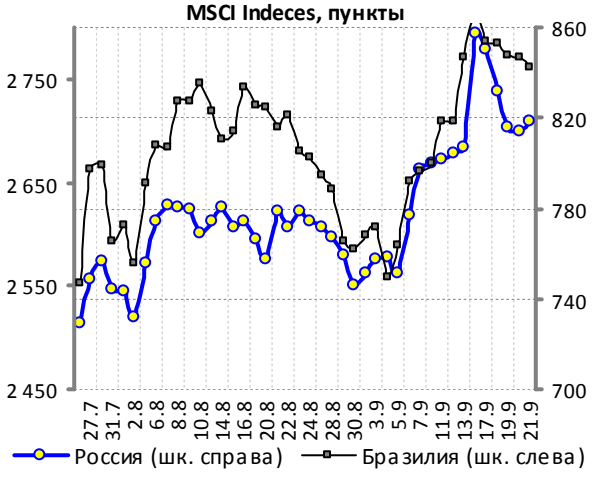
Из менее оптимистичных новостей отметим, что Италия ухудшила прогноз ВВП на 2012 год, с -1,2 до -2,4%, прогноз дефицита бюджета с 1,7 до 2,6% ВВП. В Греции полным ходом идет обсуждение мер экономии правительства с представителями кредиторов. Завершить переговоры предполагалось к воскресенью, затем меры оптимизации бюджета должны быть одобрены парламентом, после этого рассмотрены Еврогруппой и утверждены саммитом еврозоны. Ожидаемый Грецией транш помощи равен примерно 31 млрд. евро, экономию расходов бюджета планируется достичь за счет сокращения зарплат и бонусов, повышения пенсионного возраста с 65 до 67 лет, снижения расходов на здравоохранение, оборону и дотации регионам. Пока премьера не поддерживают даже лидеры партий, вошедших в правительственную коалицию. Между тем, во-первых, появилось предположение, что рассмотрение отчета о финансовой ситуации в Греции будет отложено до 6 ноября, когда наступит определенность с выборами президента США, с тем, чтобы не создавать излишней нервозности на рынках в преддверии выборов. Во-вторых, инвесторы, уже наученные горьким опытом, опасаются новой реструктуризации греческого долга.

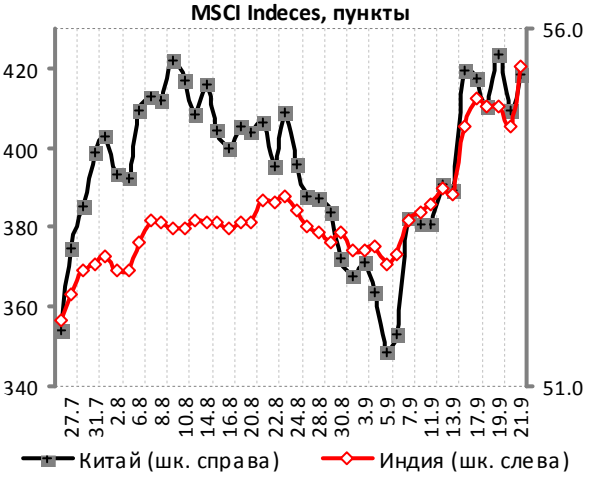
Азия. Итоги азиатских торгов пятницы в плюсе, Nikkei +0,25, SSE +0,09, Kospi +0,60, Hang Seng +0,70%. Основным драйвером стал старт продаж смартфона iPhone 5 компании Apple, прогнозируется высокий спрос, и это стало хорошей новостью для акций азиатских технологических и телекоммуникационных компаний - поставщиков Apple. Сохраняется обострение отношений между Китаем и Японией вокруг трех необитаемых островов Сенкаку в Восточно-Китайском море. Так, Japan Airlines планирует сократить количество полетов в Китай, в частности, компания отменит некоторые рейсы в Пекин и Шанхай, запланированные на 10 - 27 октября. Китай, со своей стороны, решил отменить торжественную церемонию, посвященную 40-летию восстановления дипломатических отношений с Японией.

Золото. На надеждах подвижек в решении европейских проблем укрепился евро и ослабел доллар, цены драгметаллов обозначили рост, утром пятницы фьючерсы на золото торговались по 1774,35, к 14.00 по 1776,14, на закрытии по 1778,0 долл. за унцию. Венесуэла и Китай заключили соглашение о совместной разработке одного из крупнейших месторождений золота в мире Лас-Кристинас.

Нефть. Значительное снижение цен накануне, а также ослабление доллара вновь к концу недели вызвали интерес покупателей к нефти. Кроме того, позитивное влияние на динамику цен оказало решение ОПЕК (а это около 40% мировых поставок нефти) сократить экспорт сырья в связи с техническим обслуживанием нефтеперерабатывающих заводов (рост экспорта ожидается к декабрю). Brent и Light к 14.00 пятницы шли по 110,43 и 92,98, на закрытии по 111,42 и 92,89 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной информации отметим публикацию в США индексов деловой активности в обрабатывающей промышленности округа ФРБ Чикаго (16.30), а также в промышленном секторе по данным ФРБ Далласа (18.30). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия преимущественно в минусе, нефть с утра не растет. Для позитивной динамики российских бирж этих факторов явно недостаточно.

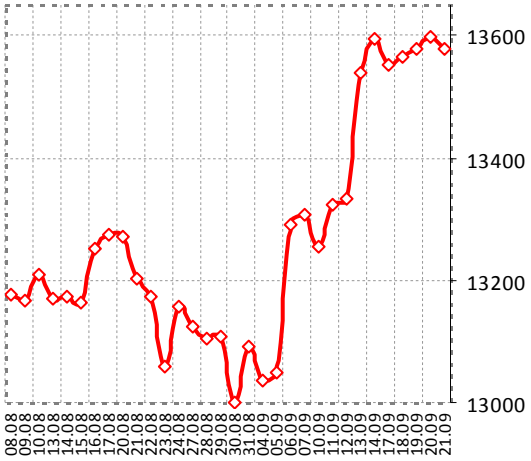




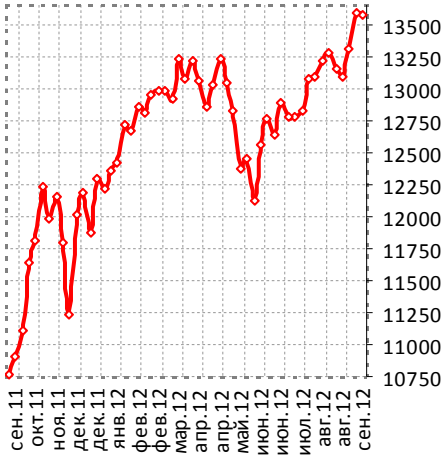
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

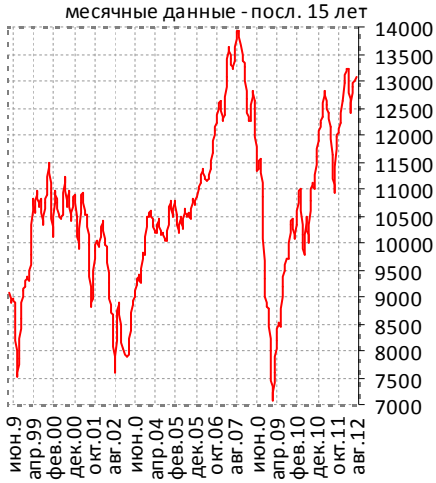
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



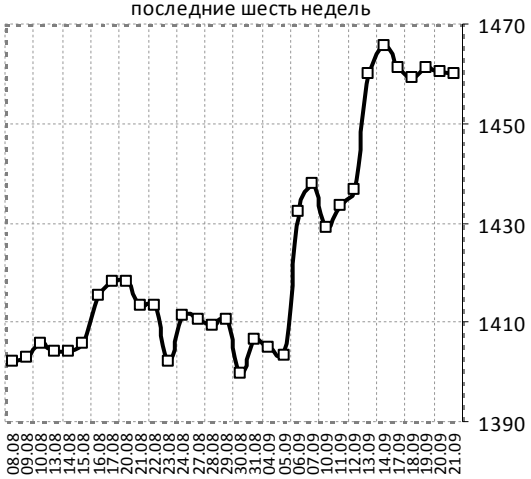
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



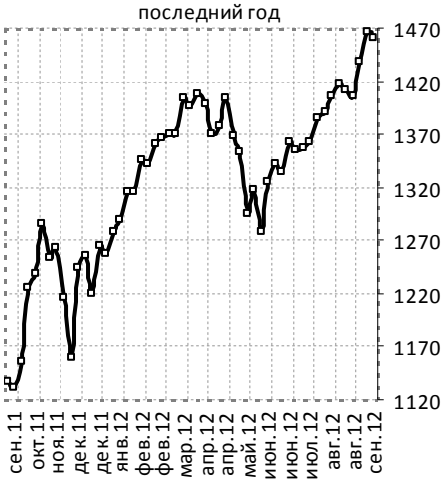
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



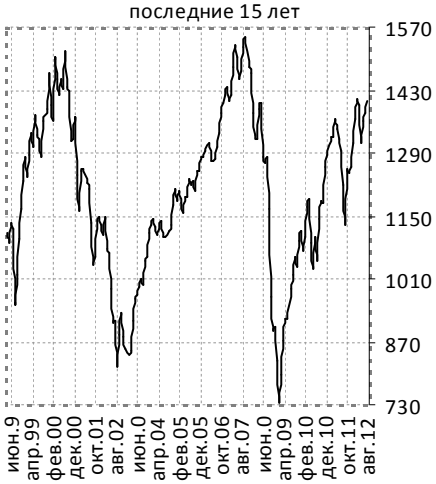
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



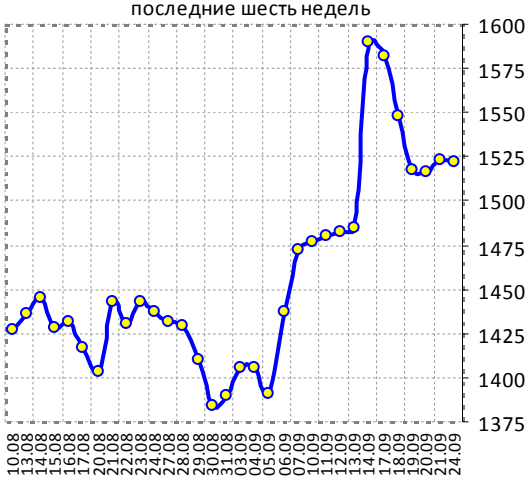
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



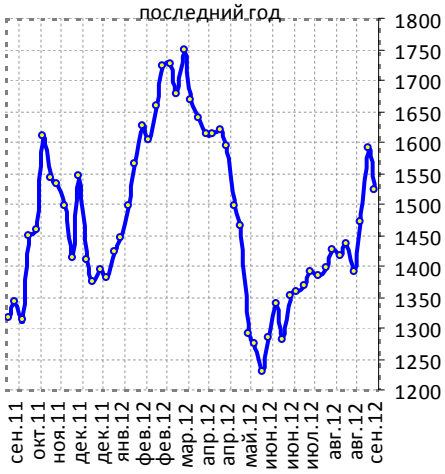
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



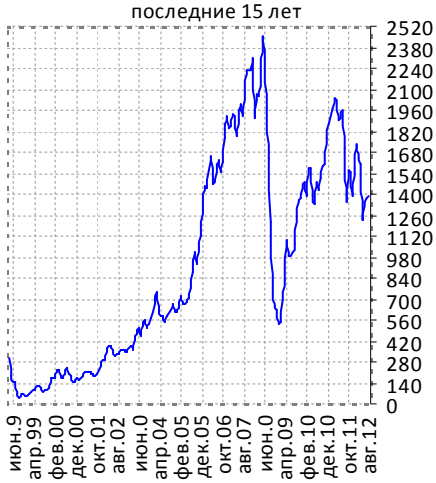
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



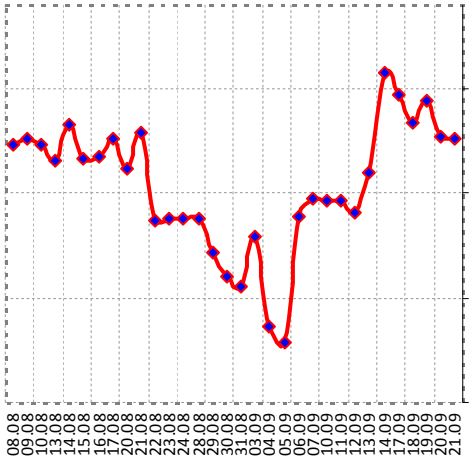
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



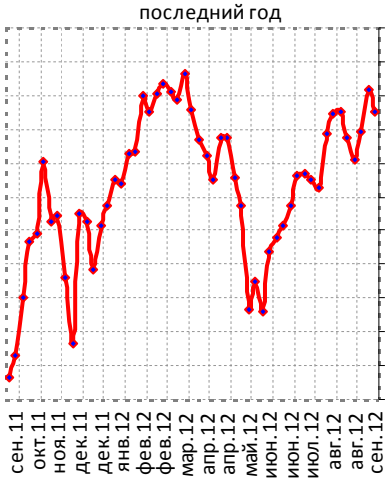
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

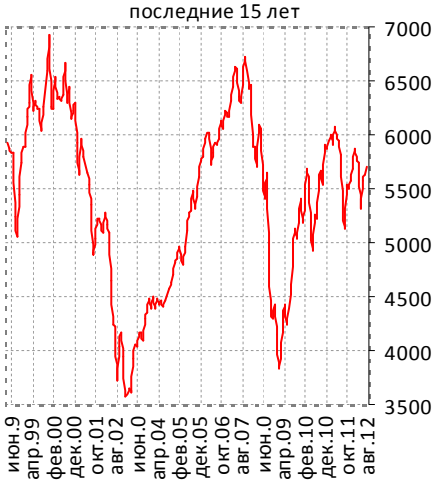
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



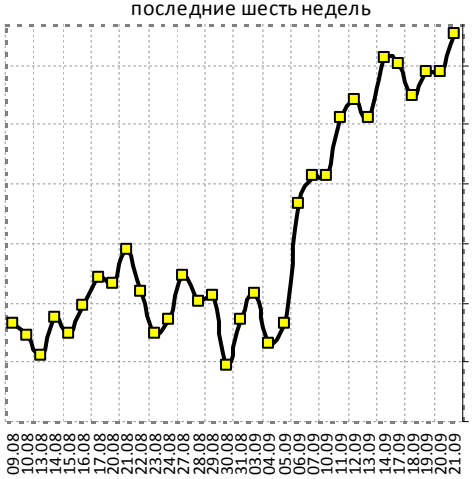
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



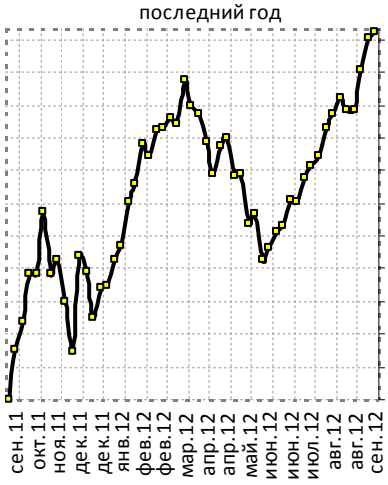
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



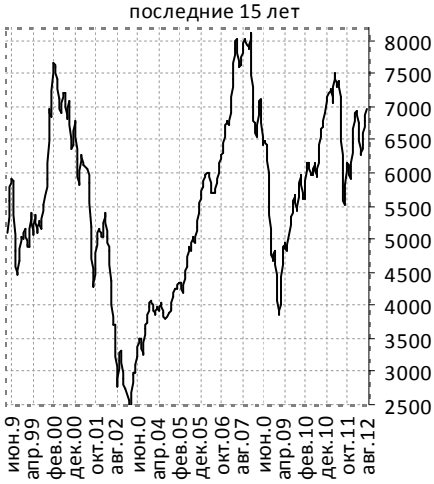
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



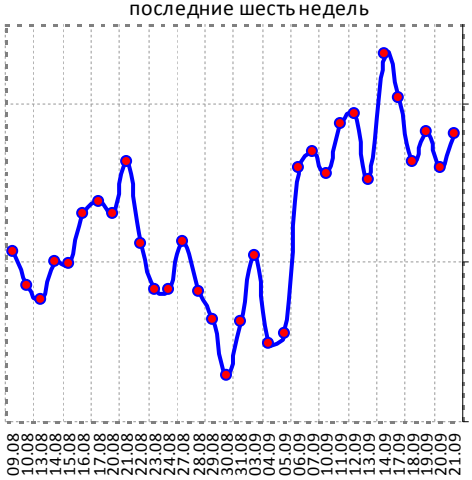
DAX Index: недельные данные - последний год



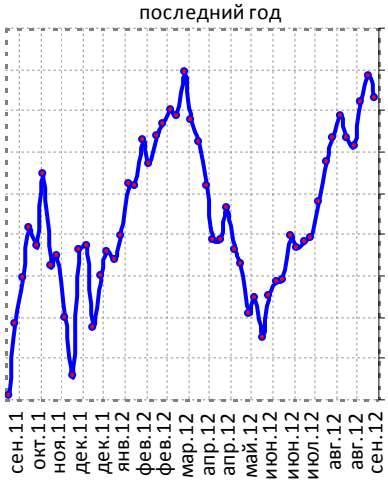
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



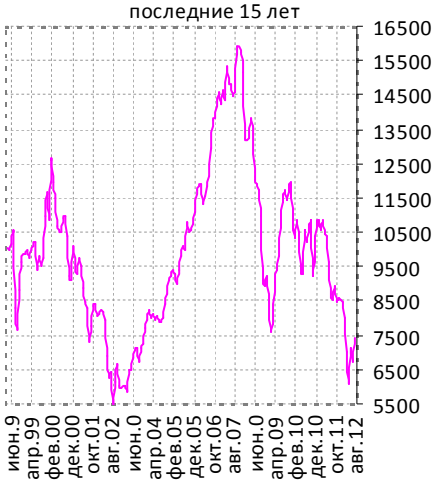
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

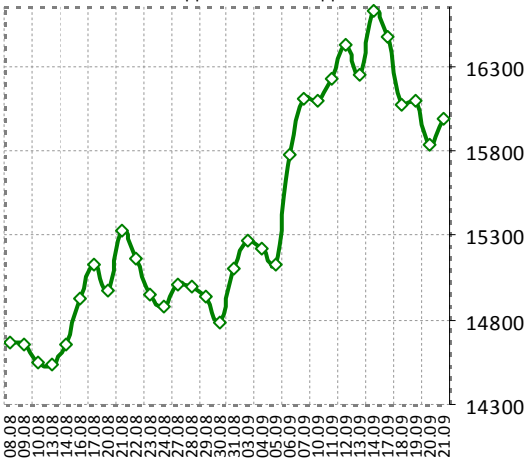


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

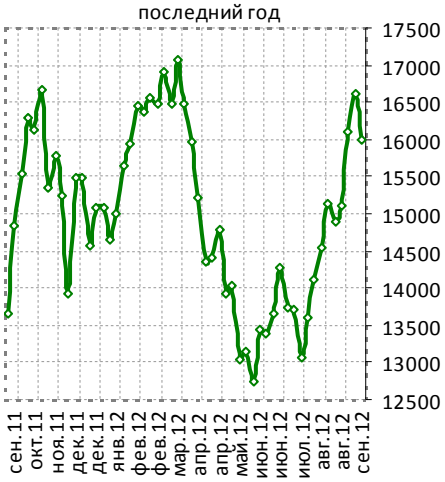


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



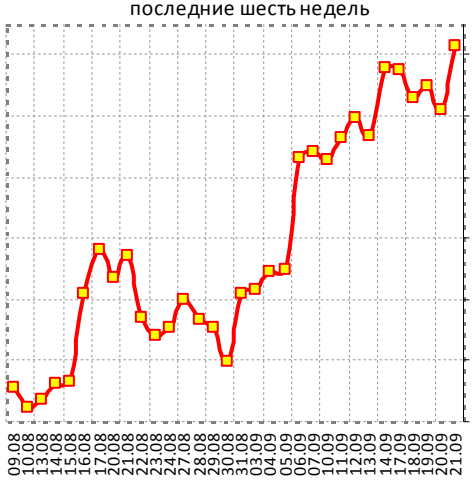
MIB Index: недельные данные - последний год



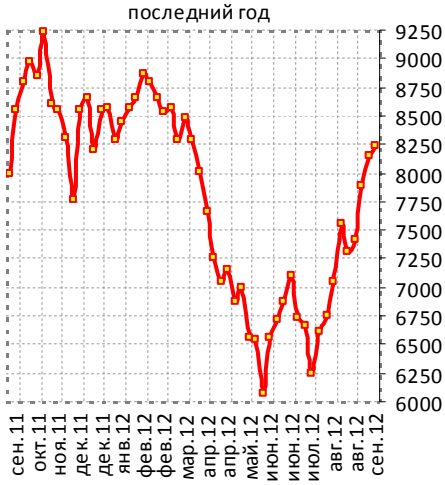
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



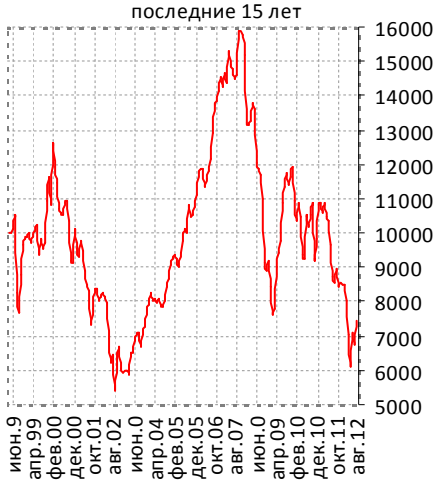
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



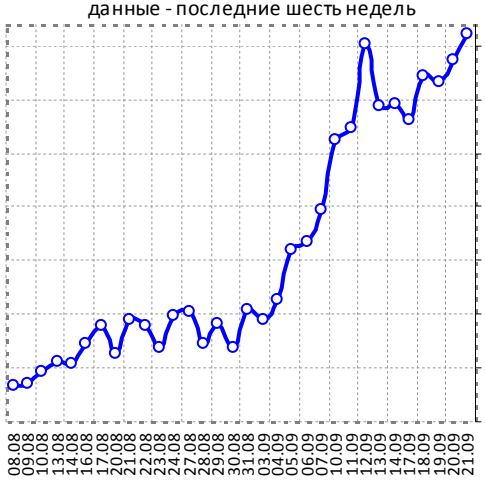
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



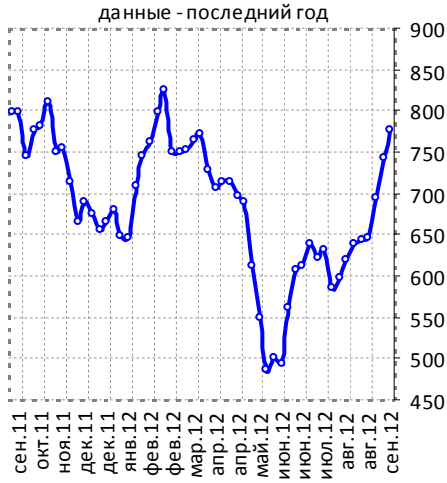
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



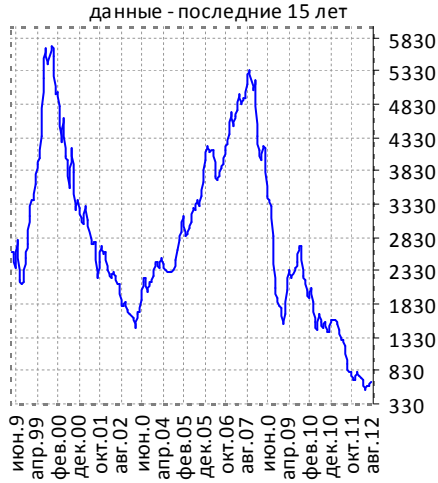
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



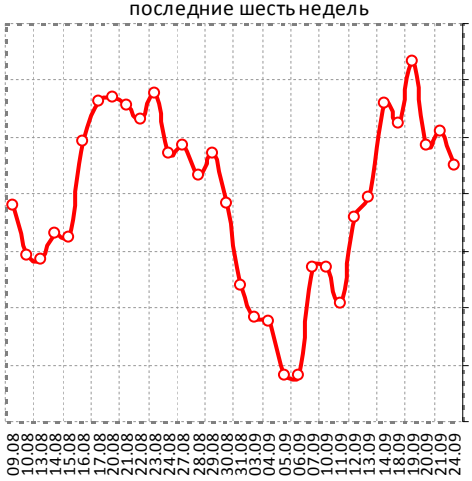
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



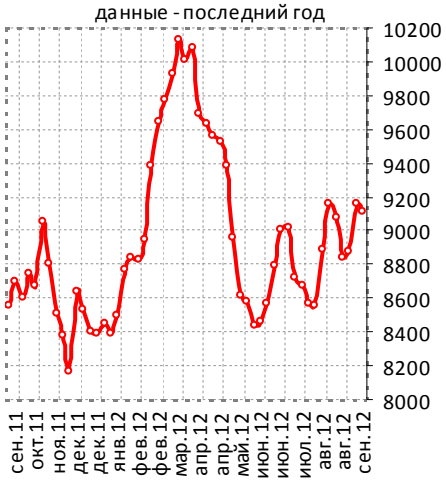
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

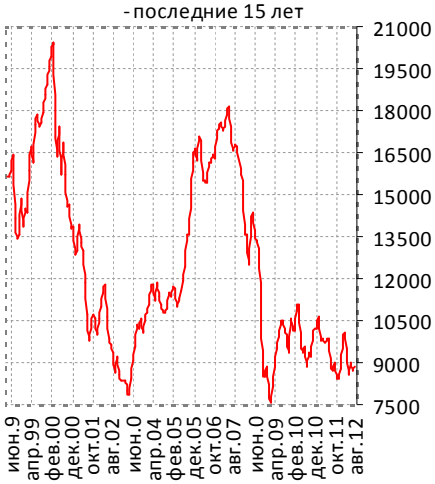
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



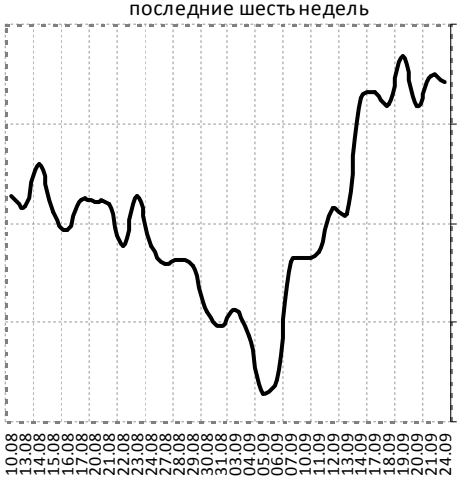
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



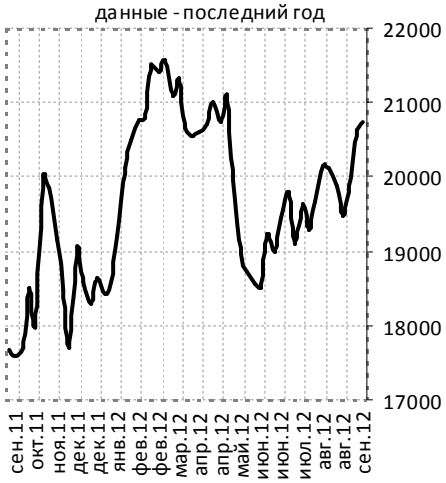
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



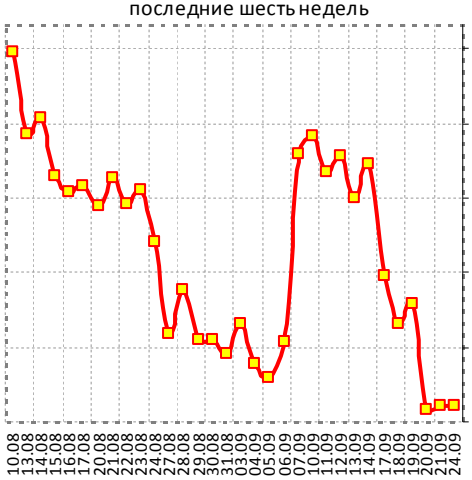
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



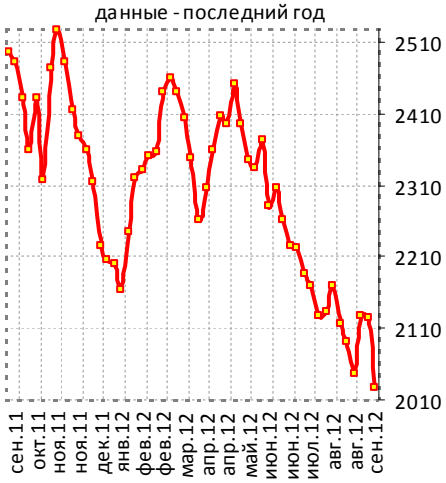
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



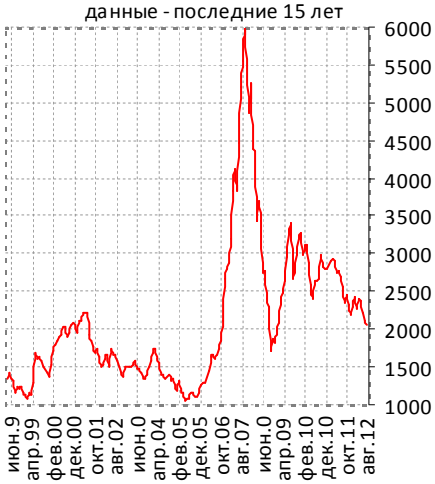
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



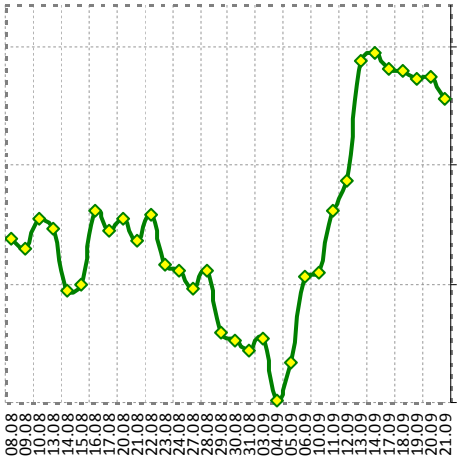
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



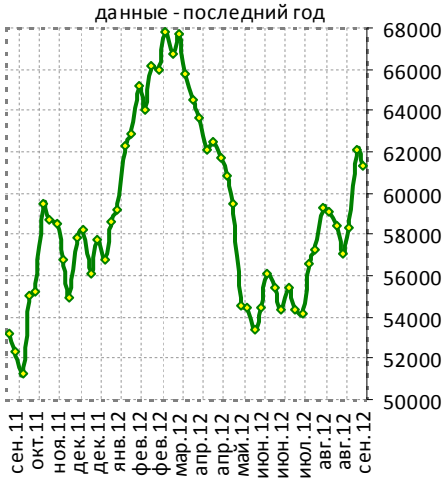
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

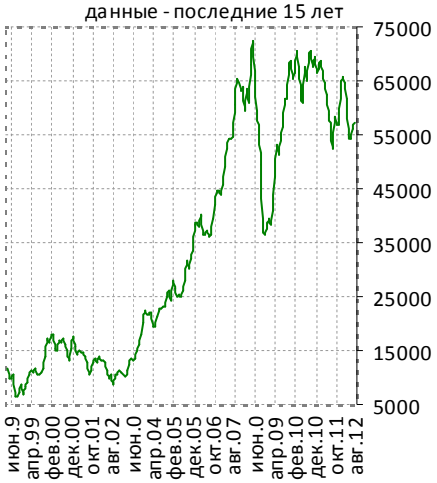
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



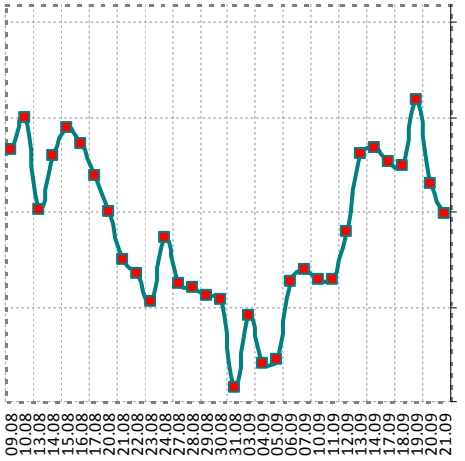
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



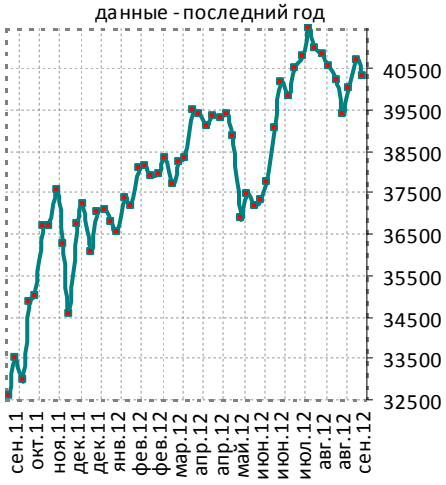
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



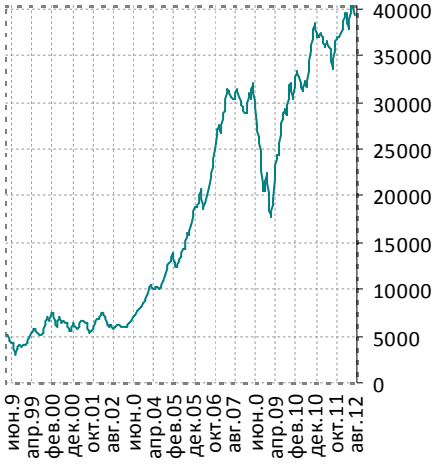
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



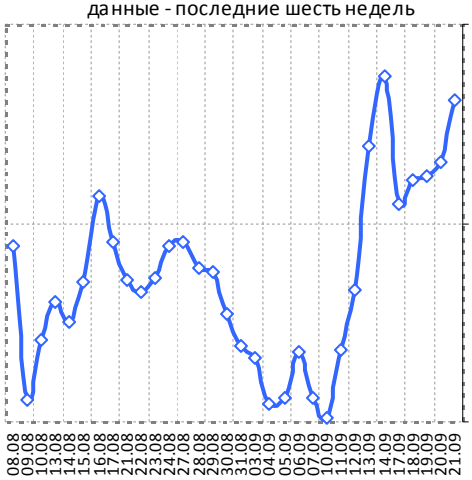
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



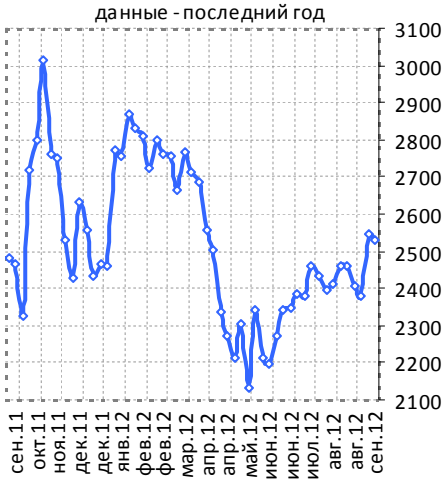
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



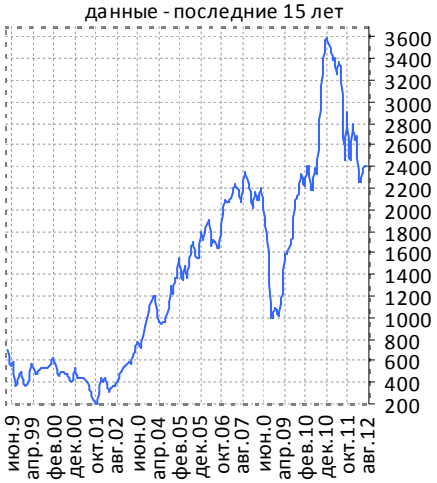
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

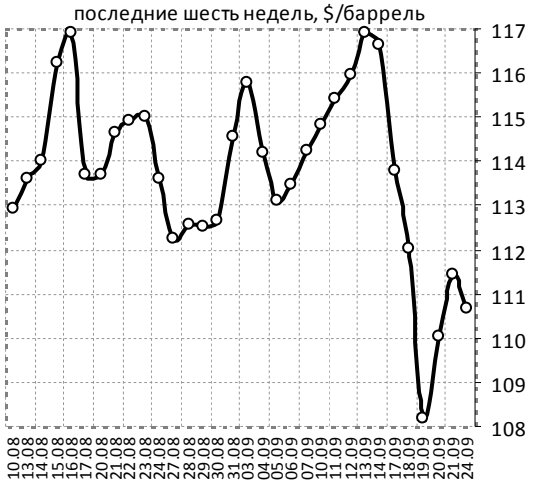


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

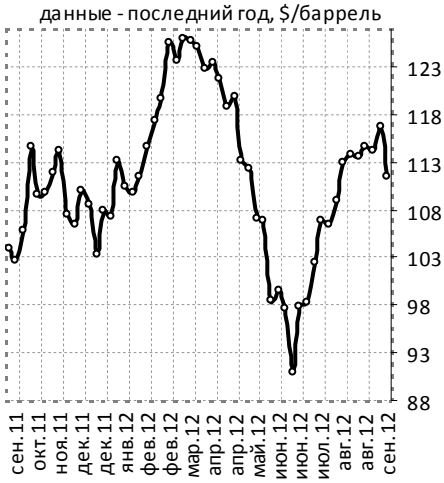
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

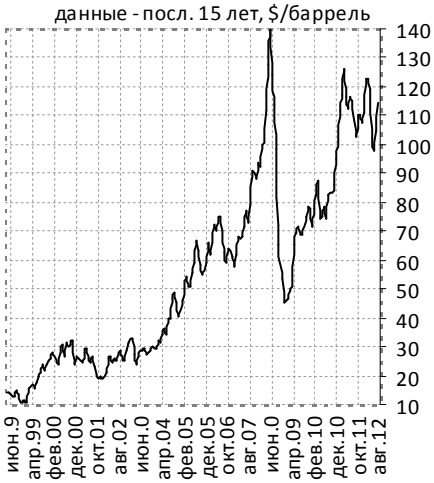
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



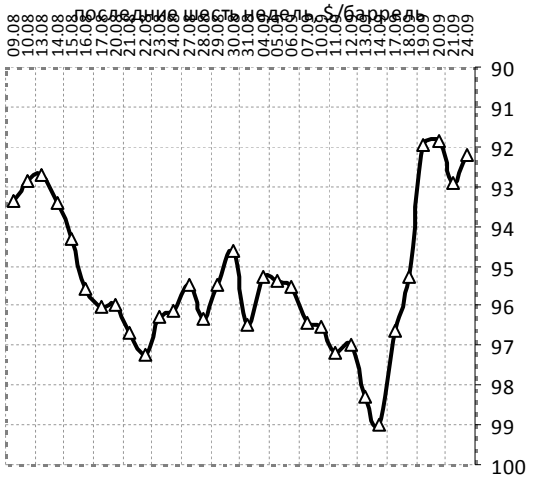
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



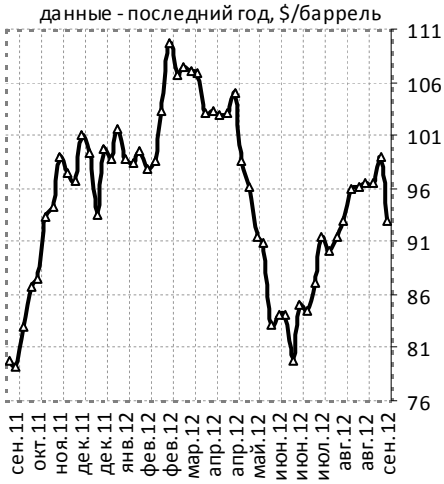
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



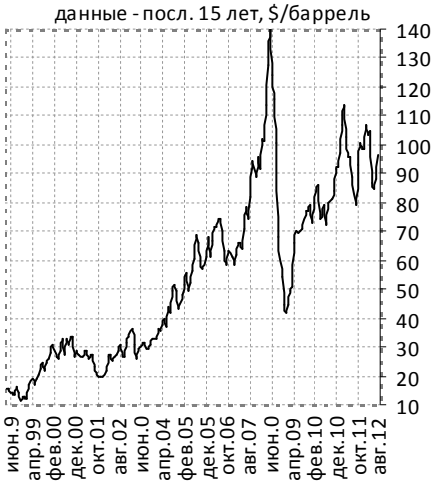
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



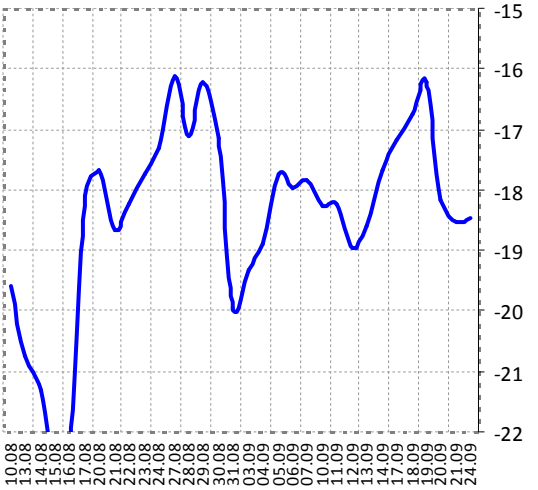
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



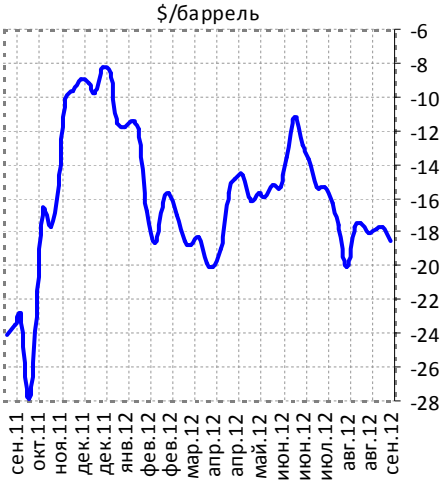
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



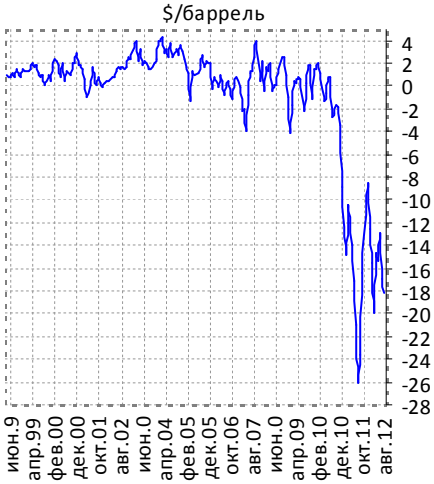
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



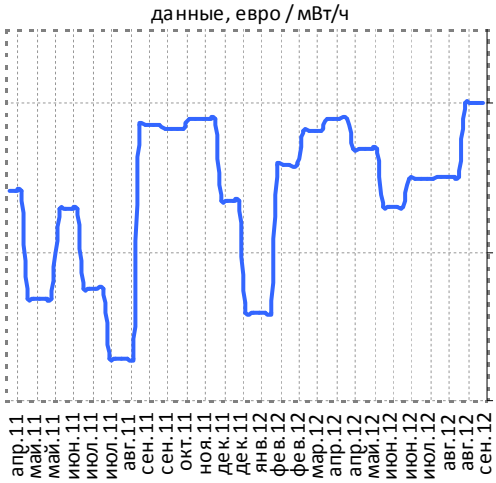
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



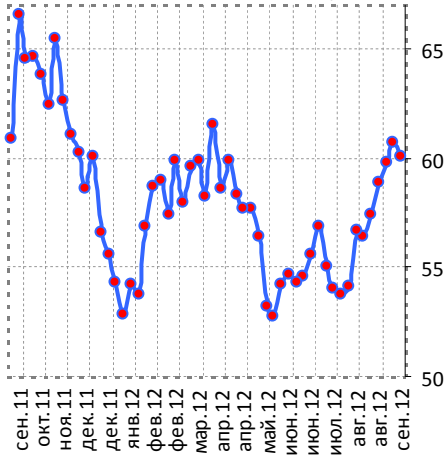
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

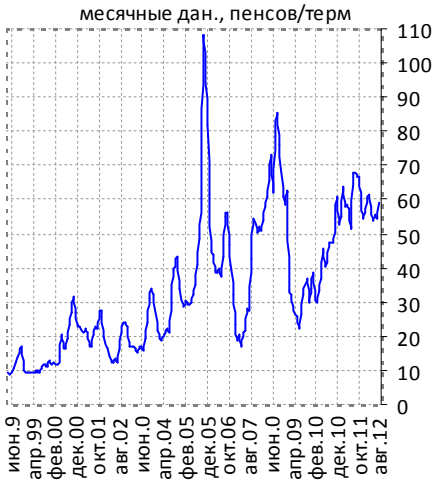
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



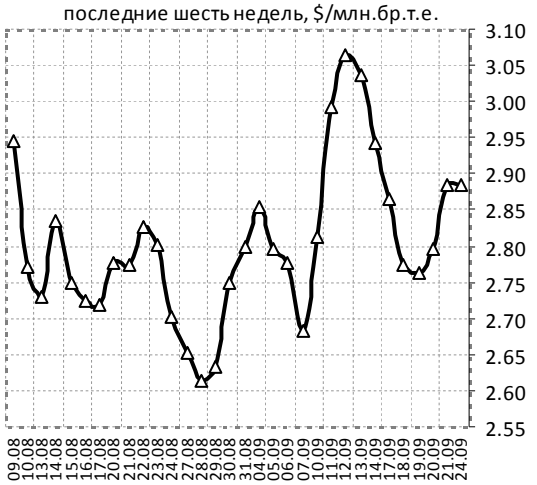
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



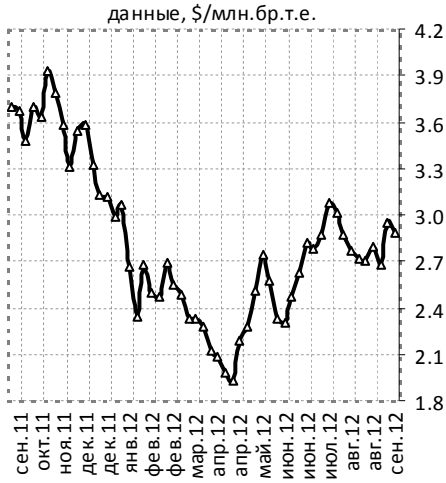
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



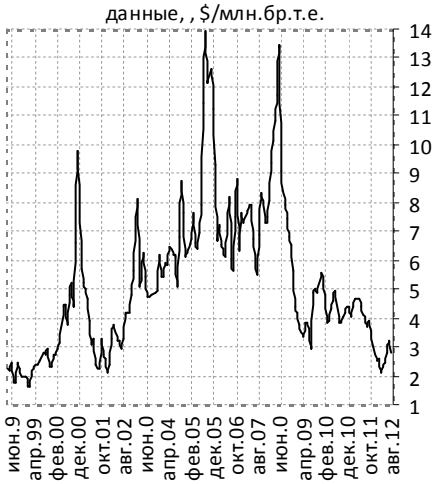
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



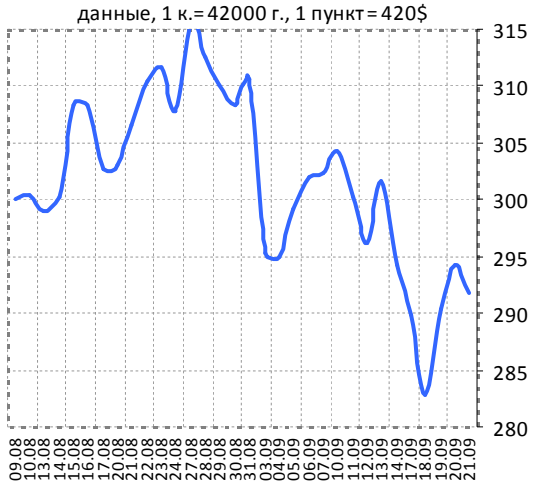
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



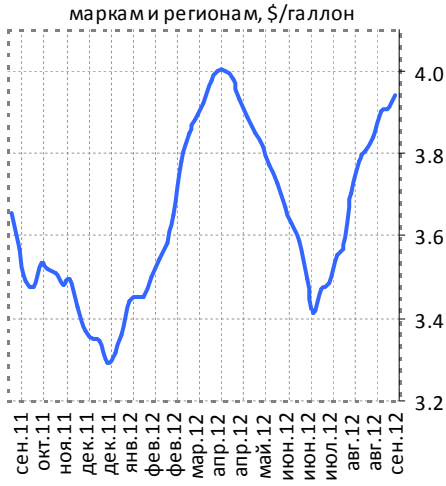
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



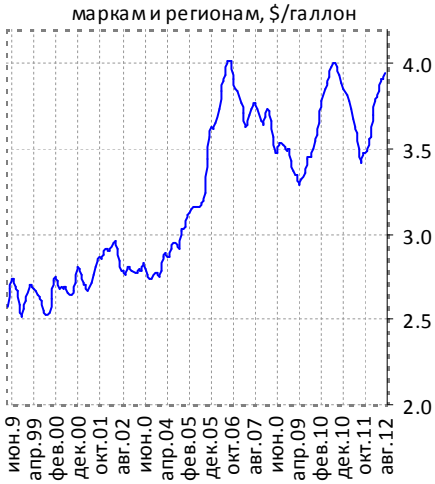
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.= 42000 г., 1 пункт = 420$



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



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



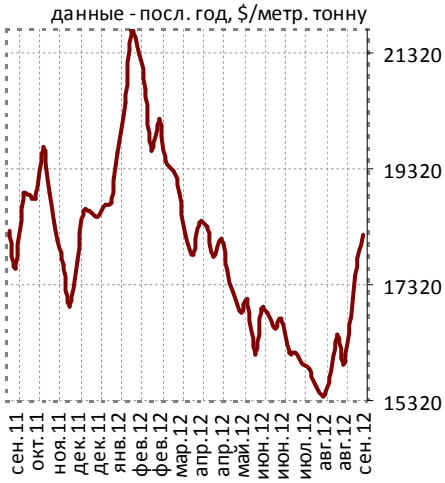
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

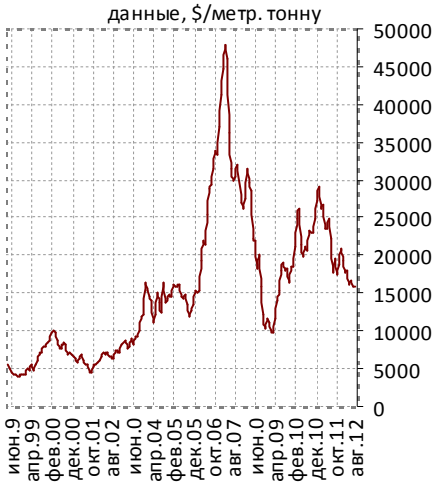
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



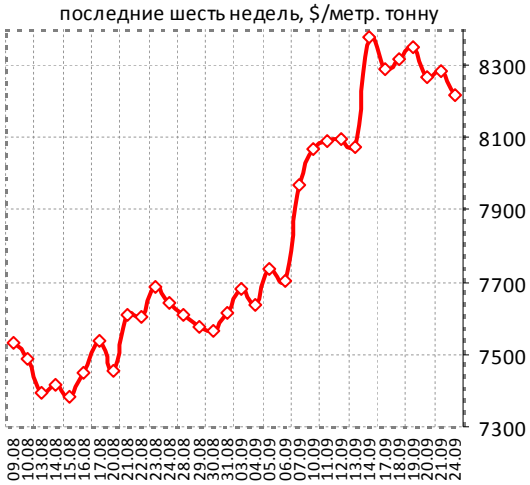
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



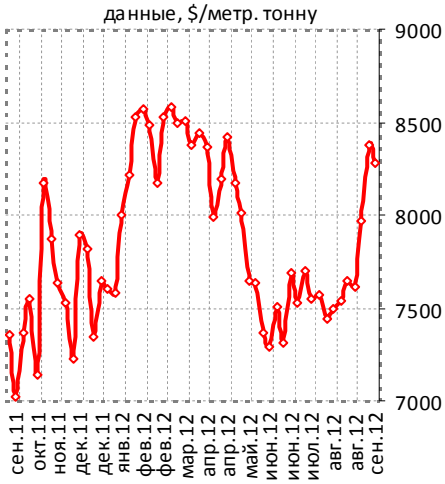
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



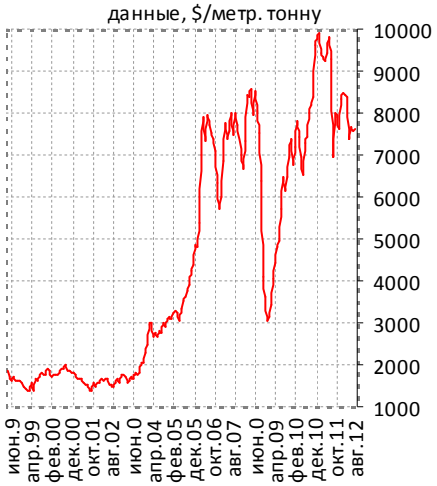
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



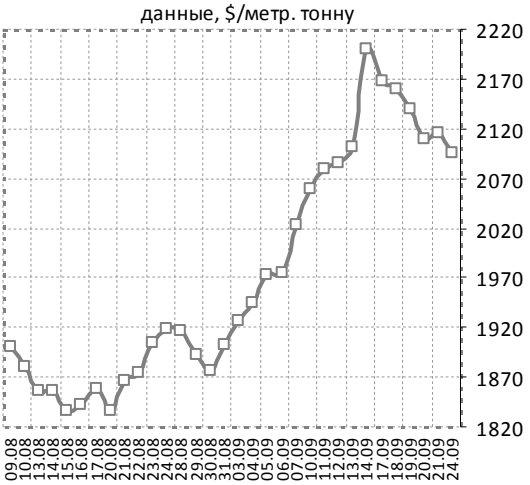
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



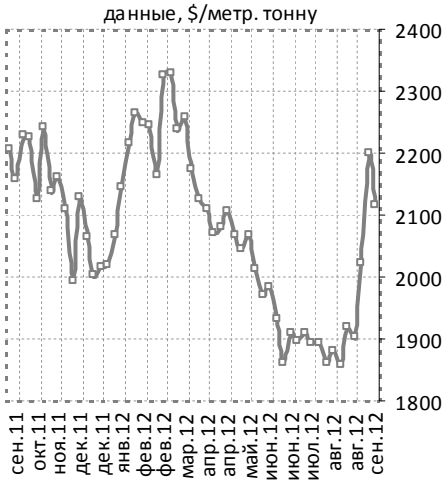
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



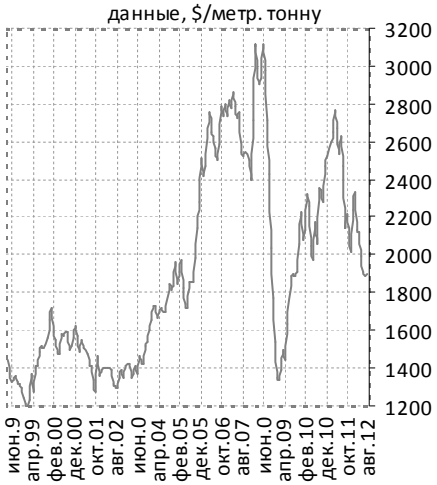
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.