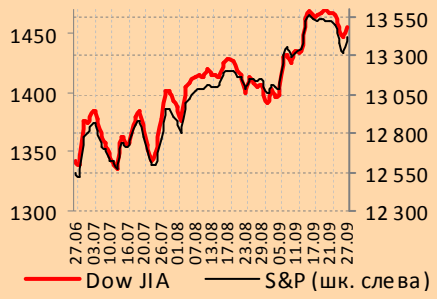
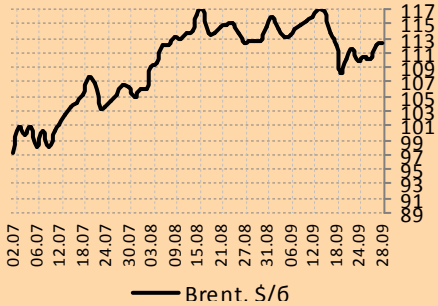
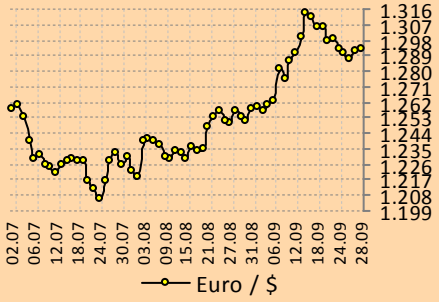
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

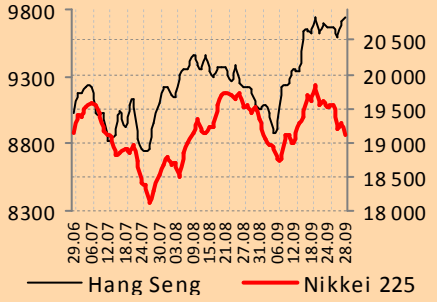
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

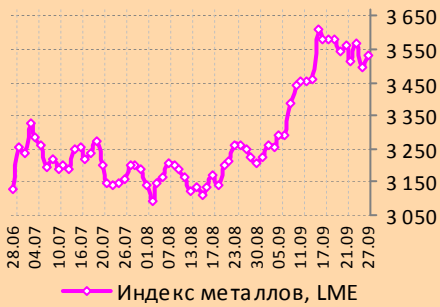
Ежедневный обзор

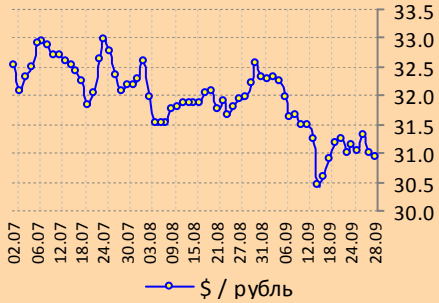






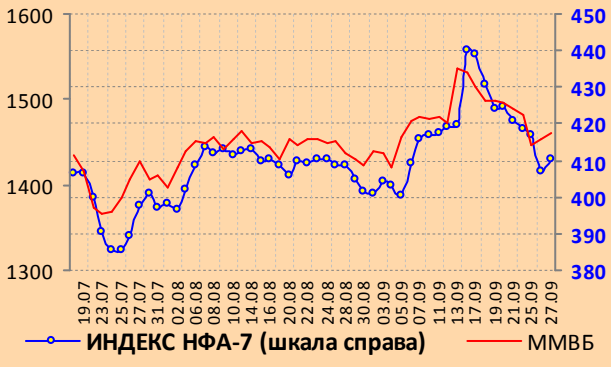






СОДЕРЖАНИЕ

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 2012-09-28

МОСКВА

США. Фьючерсы на биржевые индексы в течение дня находились в зеленой зоне, инвесторы рассчитывали на позитив статистики и европейских новостей. Волна предыдущих продаж на фондовых биржах пришлась кстати для успешного размещения гособлигаций США (в целом на 99 млрд. долл.), так, вчера пятилетние бумаги шли с доходностью 0,647% по сравнению с 0,708% месяцем ранее. Что касается статистики, то она по факту в основном имела негативный характер. Так, ВВП во втором квартале относительно первого квартала, согласно окончательным данным, вырос на 1,3% при ожиданиях повышения на 1,7% (что вряд ли будет отыграно рынками, поскольку именно на ухудшении роста введена в действие QE3). Индекс деловой активности в промышленности ФРБ Чикаго снизился за месяц с 95,3 до 94,1 пункта, заказы на товары длительного пользования на 13,2% (и это больше, чем ожидалось -5,0%), месяцем ранее был рост на 3,3%. А вот позитив: количество первичных обращений за пособиями по безработице уменьшилось с 385 до 359 тыс., больше, чем ожидалось (378 тыс.). В результате итоги торговой сессии четверга в плюсе, Dow Jones =+0,54, S&P 500 =+0,96, NASDAQ =+1,39%.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, индексы росли, ММВБ повысился на 0,53, РТС на 1,22%. Инфляция с начала года составила 5,1%, ЦБ предложил вчера банкам на 1 день прямое РЕПО в сумме 370 млрд. руб., спрос составил 258 млрд., ставка 5,58% (ставка рынка выше и равна 6,42%).

Европа. Удивительно, но на ожиданиях позитива по Испании котировки выросли, FTSE 100 =+0,2, DAX =+0,19, CAC 40 =+0,72%. Главное событие вчерашнего дня - правительство Испании представило проект бюджета на 2013г., который основывается на сокращении расходов, а не на повышении налогов, планируется принять в общей сложности 43 новых закона, которые помогут реформировать экономику. Кроме того, правительство создаст независимый финансовый орган для надзора за соблюдением обязательств по сокращению дефицита. Сегодня будет опубликовано изменение рейтинга Испании агентством Moody's, а независимые аудиторы представят данные стресс-теста, который покажет, какой объем средств необходим испанским банкам для докапитализации. Возможно даже, что неблагоприятная информация в данном случае будет отыгрываться рынками как фактор, указывающий на готовность испанского руководства снизить национальные риски путем обращения за финансовой помощью к ЕС.

Статистика имела разнонаправленный характер, так, индекс делового климата еврозоны, оставаясь негативным, ухудшился с -1,18 до -1,34 пункта (ожидалось -1,19 пункта). Доходность 10-летних испанских бумаг превысила 6%, Германия не смогла вчера полностью разместить свои 10-летние гособлигации даже повысив по ним доходность. Безработица в Германии, как и ожидалось, составила 6,8%. Но улучшился индекс делового доверия в Италии, его уровень достиг 88,3 пункта при ожиданиях в 87,5 пункта.

В Греции правительство подготовило пакет мер по экономии бюджетных средств, в понедельник предложения поступят на рассмотрение представителей кредиторов. Оппозиция, между тем, призывает парламент потребовать от Германии репарации за ущерб, нанесенный стране во время Второй мировой войны (в размере 54 млрд. евро, не считая процентов).

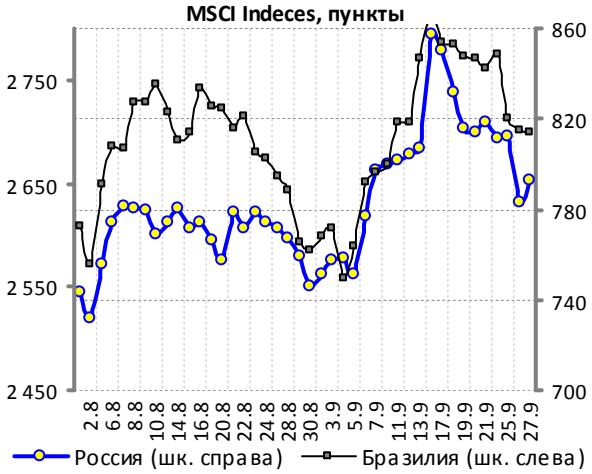
По уточненным данным, ВВП Великобритании за второй квартал относительно первого снизился на 0,4% к/к, ожидалось сокращение на 0,5%.

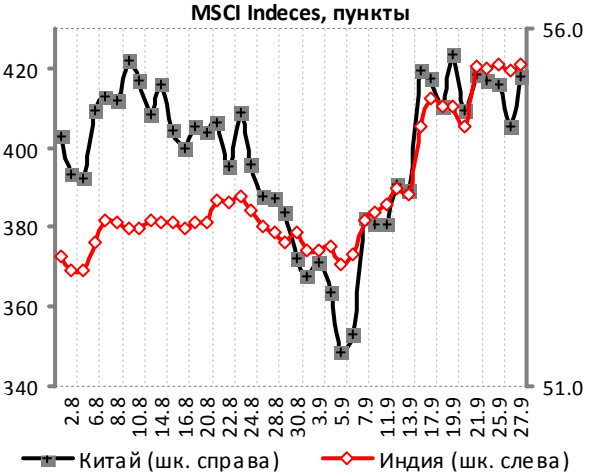
Азия. Данные по прибыли промышленных компаний Китая показали снижение (за полгода на 6,2% в годовом исчислении, что дает надежду на введение новых мер поддержки со стороны правительства и Народного банка. Пополнение ликвидности со стороны Народного банка Китая в виде обратного РЕПО накануне следующей, праздничной недели в стране в связи с национальным праздником, инвесторы рассматривают тоже как начало новой программы поддержки экономики. В Южной Корее опережающий индекс доверия промышленных производителей снизился с 75 до 72 пунктов (минимум с 2009г.), также усиливая надежды на стимулирующие меры. В этой связи рынки завершили сессию четверга ростом, Nikkei +0,48, Hang Seng +1,14, SSE +2,60, Kospi +0,42%. Относительно конфликта между Японией и Китаем по спорным островам, инвесторы начинают опасаться, что Китай может начать продажу японских облигаций (их у него на 230 млрд. долл.), а это непременно отразиться на рынках.

Золото. Цены драгметаллов пошли в рост, если вчера к 14.00 фьючерсы на золото торговались по 1759,08, то сегодня утром золото 1782,59, серебро = 34,81, платина = 1656, палладий = 627,25 долл. за унцию.

Нефть. Напряженность на Ближнем Востоке удерживает цены на высоком уровне. Снижение запасов нефти в США также стало текущим фактором роста цен, в результате Brent и Light к 14.00 вчера шли по 110,22 и 90,34, сегодня утром по 112,34 и 92,31 долл. за барр. Но в целом конъюнктура нефтяного рынка в свете предстоящих выборов в США (среднесрочный фактор) и на фоне замедления темпов роста мировой экономики (долгосрочный фактор) остается под влиянием понижательного тренда.

События, статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем инфляцию в зоне евро (13.00), по США динамику потребительских доходов и расходов, индекс деловой активности Чикагской ассоциации менеджеров по закупкам, индекс потребительских настроений Мичиганского университета (16.30 – 17.55). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются преимущественно в плюсе, Азия тоже, нефть растет. У нас завершаются налоговые платежи, к тому же – последний день месяца и квартала (в США – финансового года), так что биржи попытаются завершить день достойно.

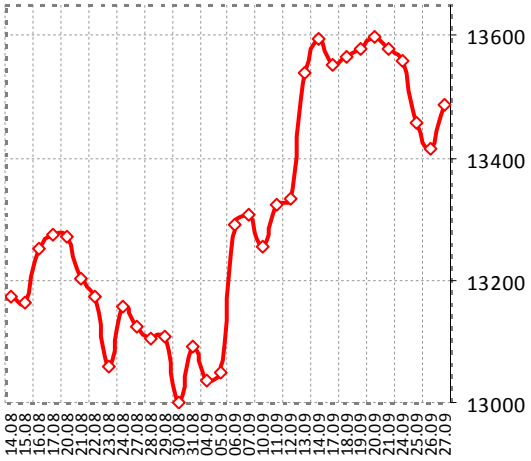




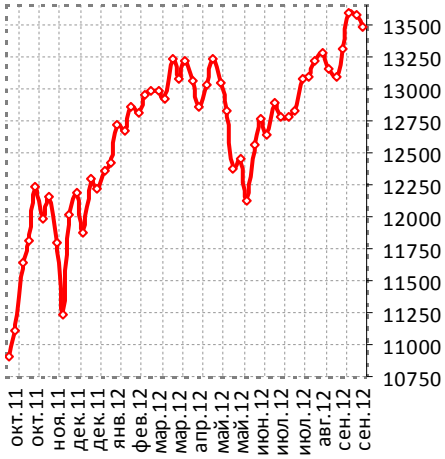
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

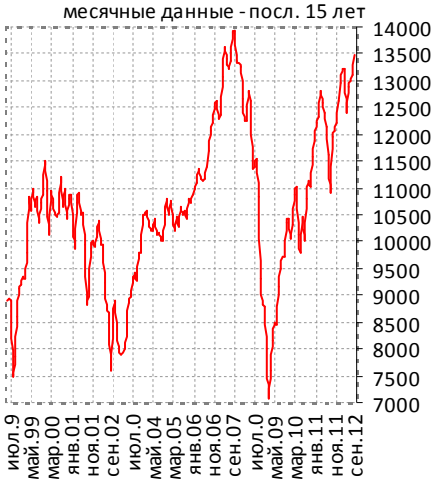
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



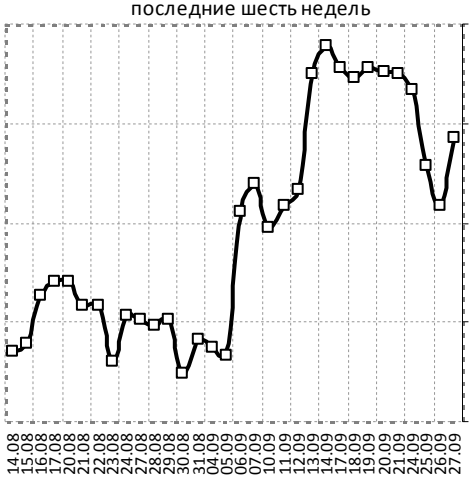
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



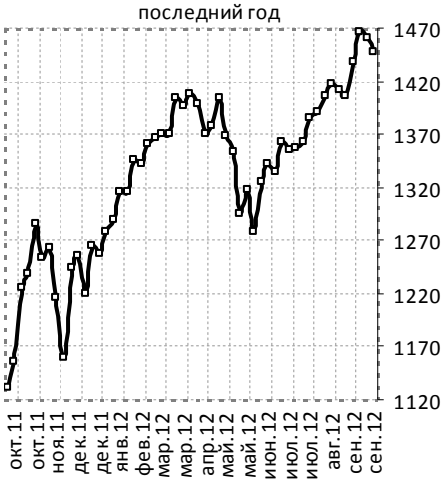
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



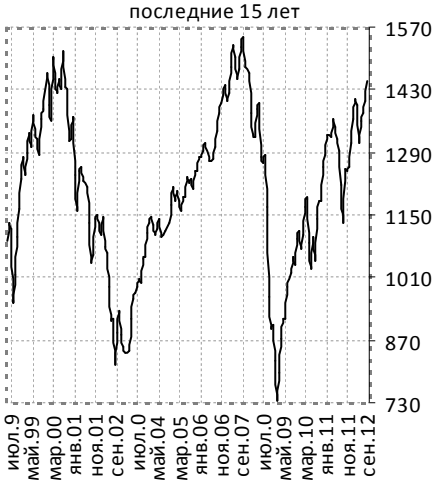
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



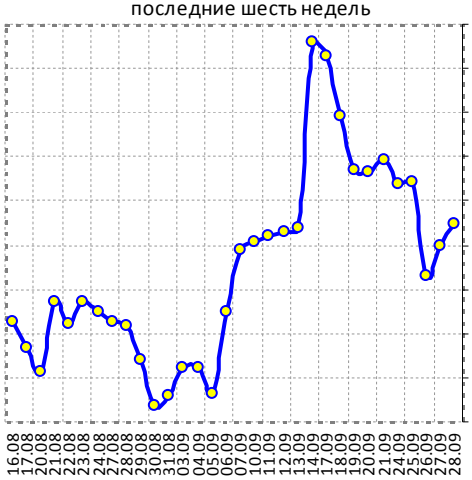
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



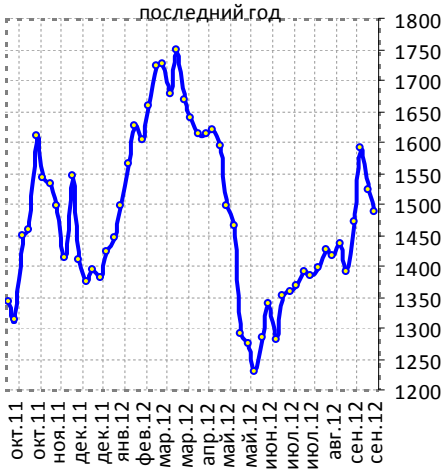
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



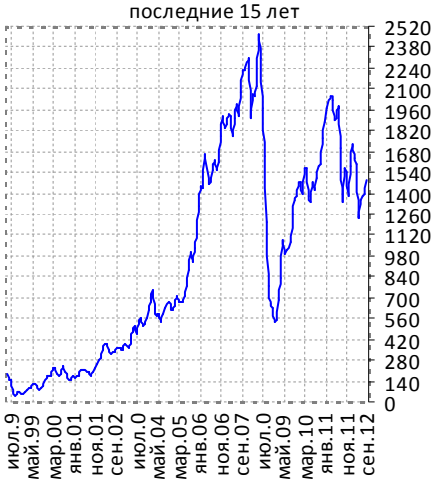
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



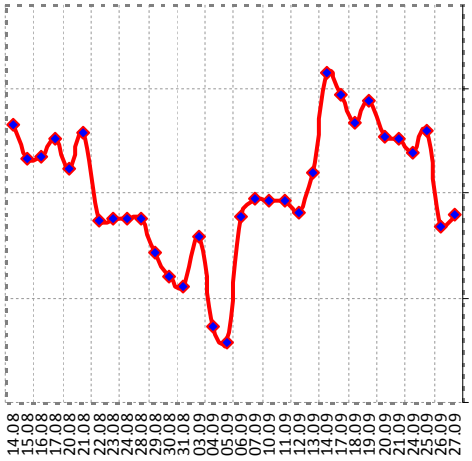
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



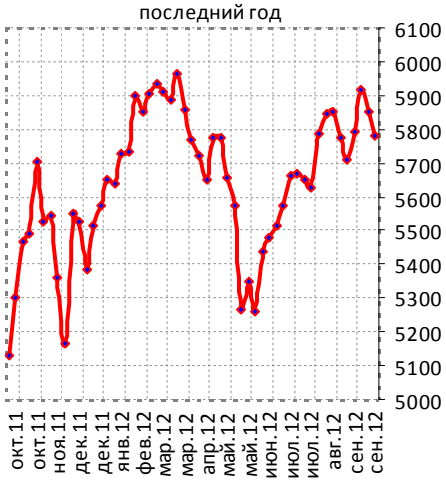
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

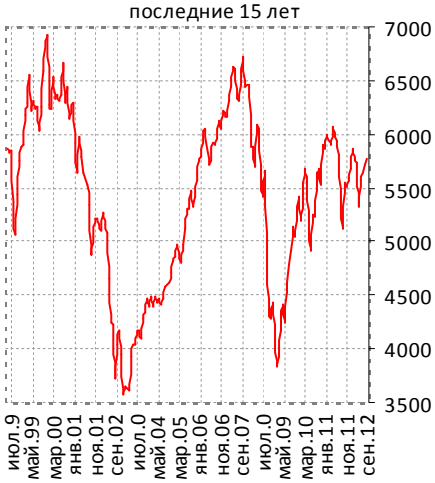
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



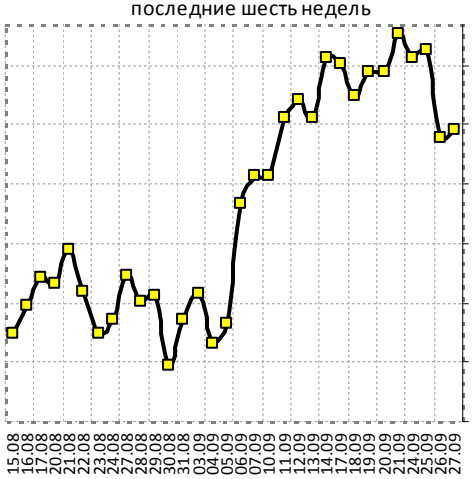
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



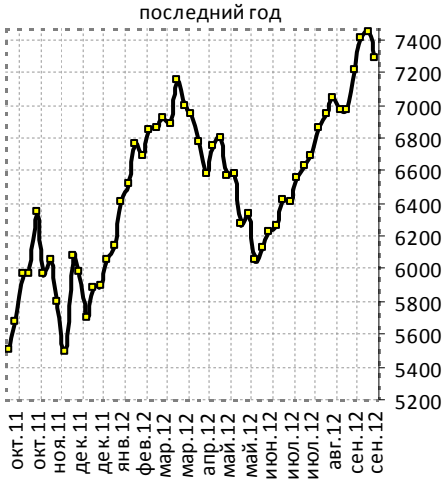
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



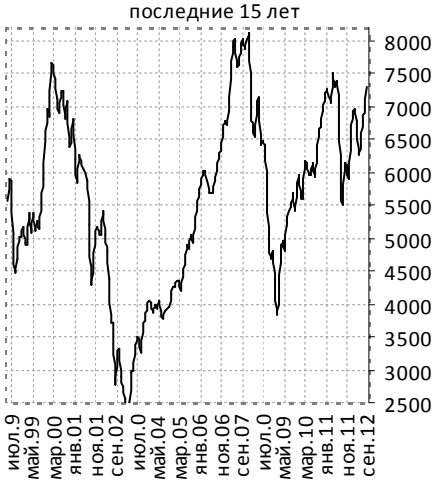
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



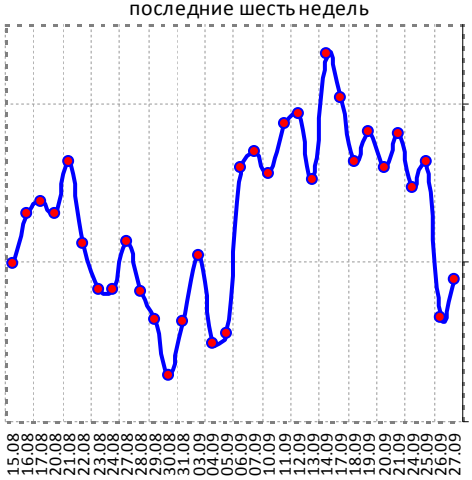
DAX Index: недельные данные - последний год



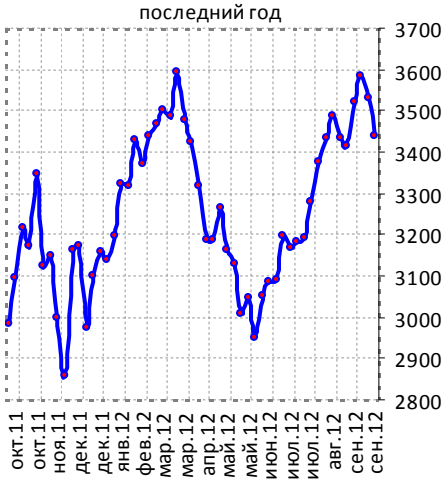
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



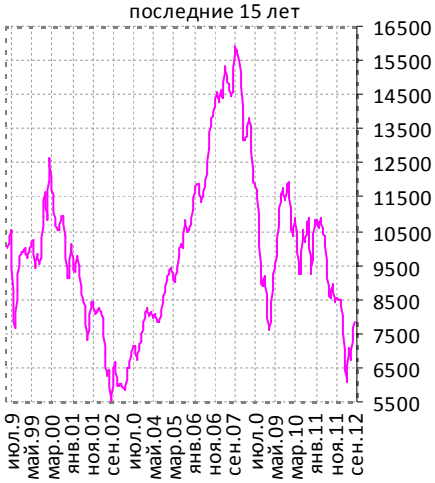
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

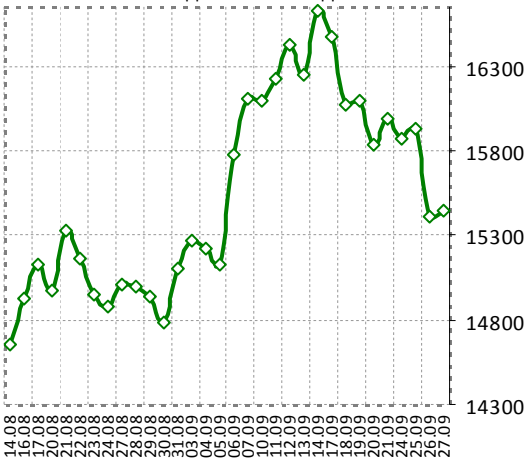


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

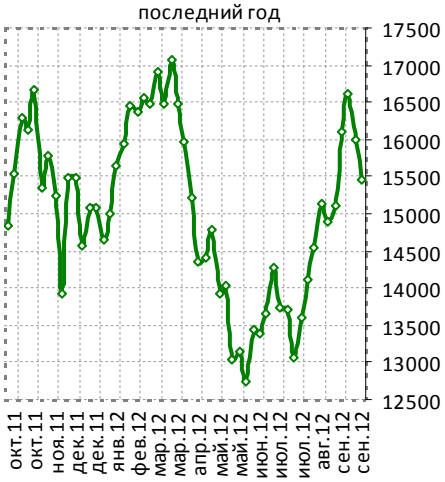


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

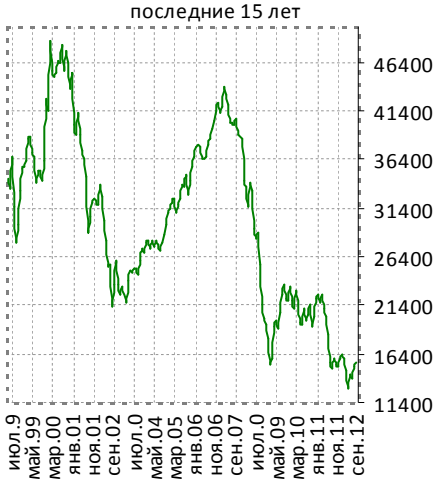
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



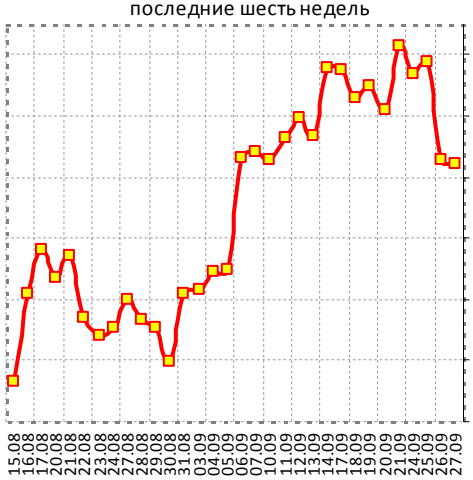
MIB Index: недельные данные - последний год



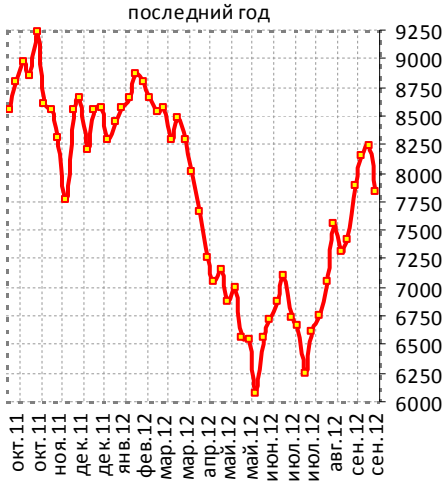
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



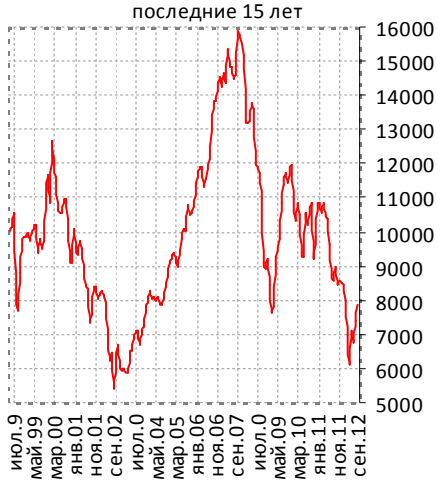
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



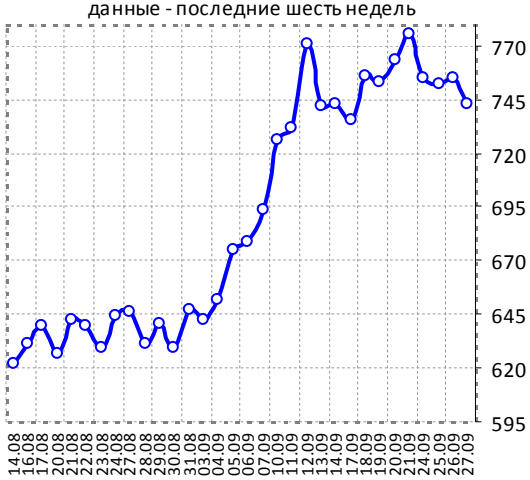
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



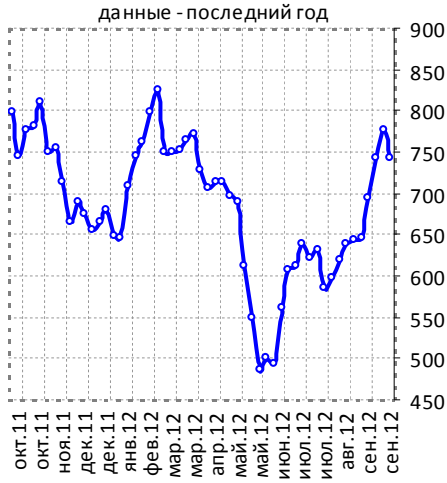
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



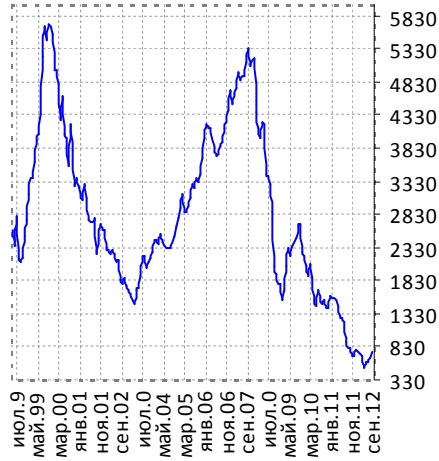
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



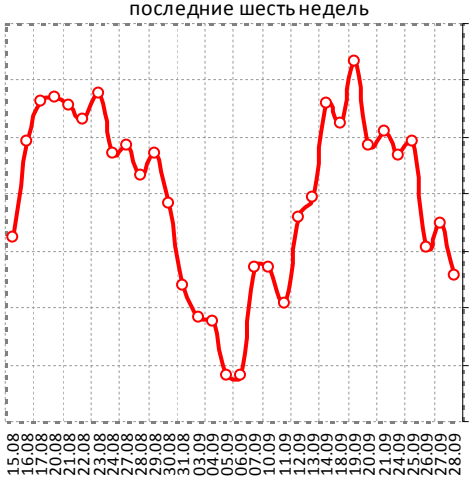
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



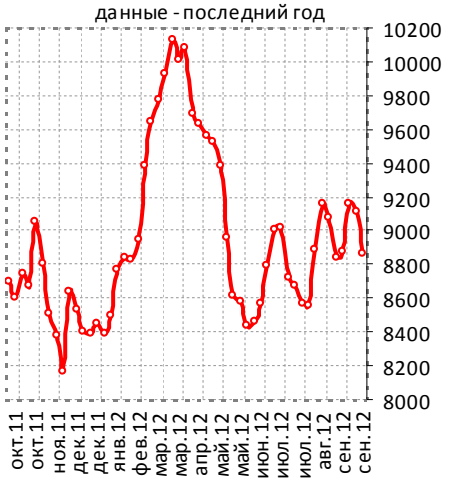
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

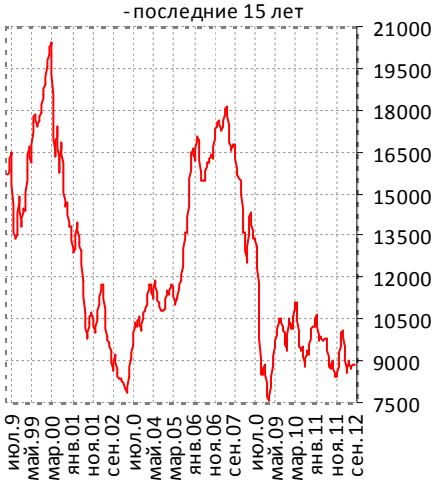
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



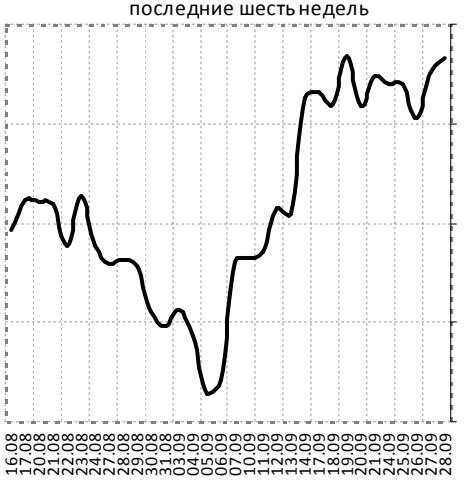
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



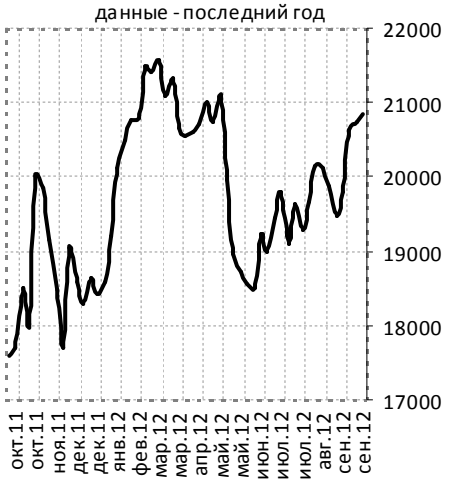
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



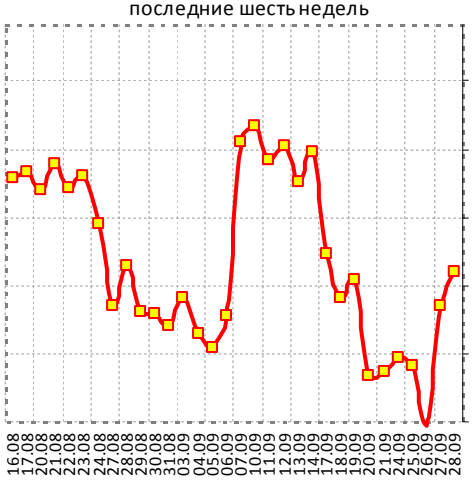
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



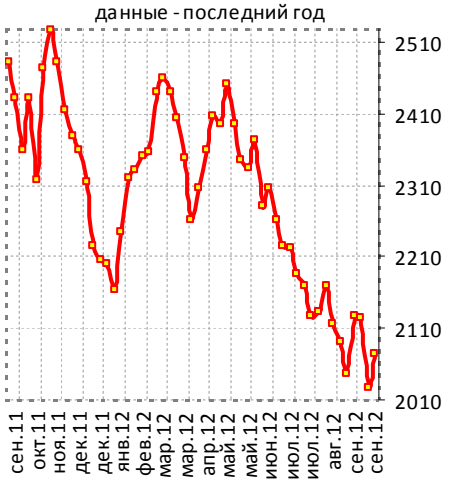
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



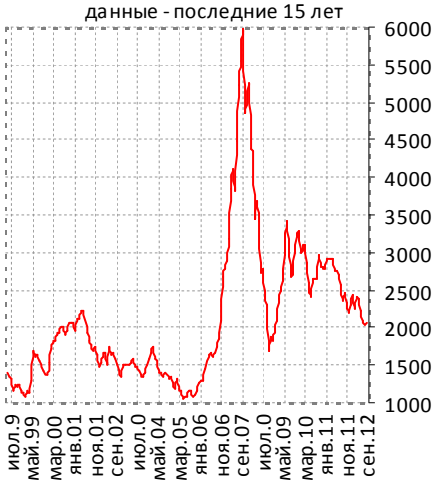
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



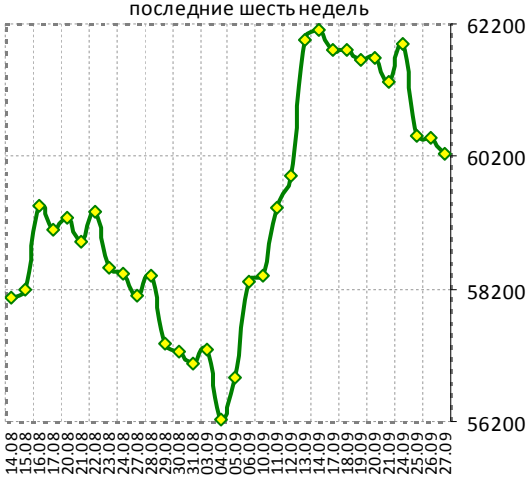
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



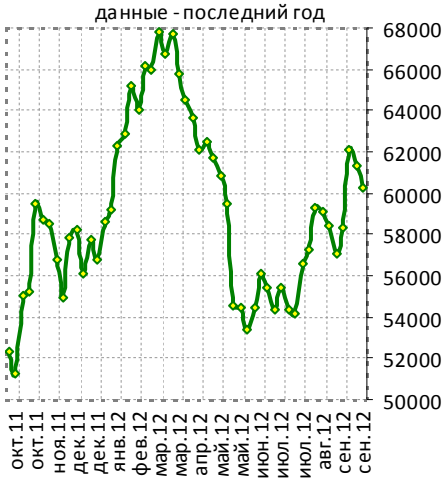
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

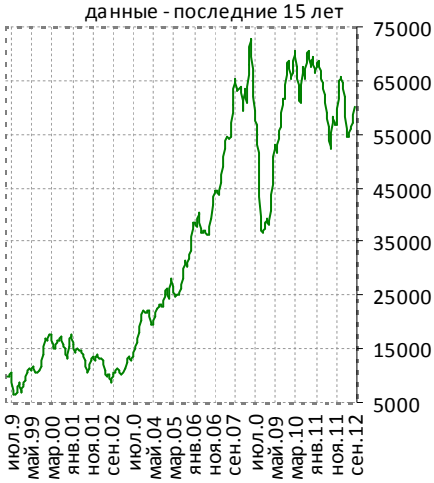
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



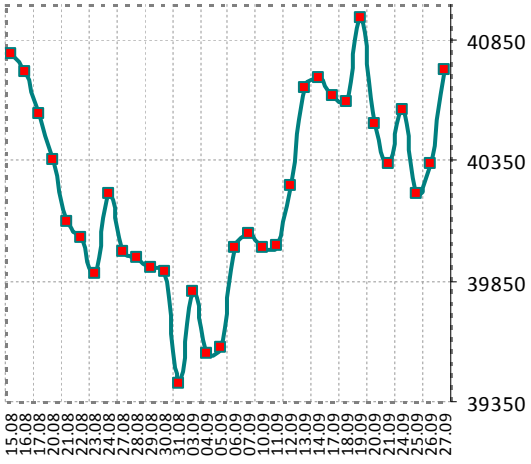
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



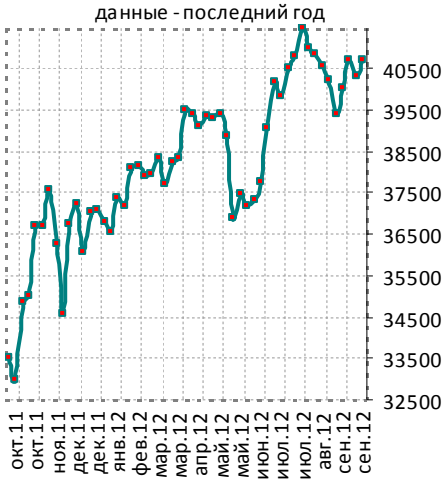
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



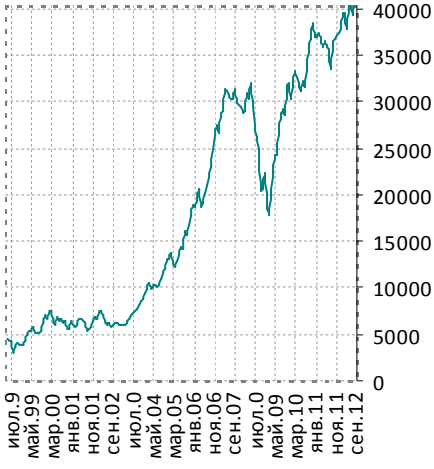
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



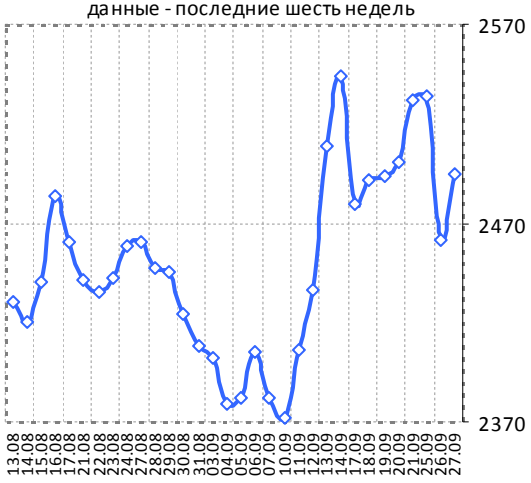
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



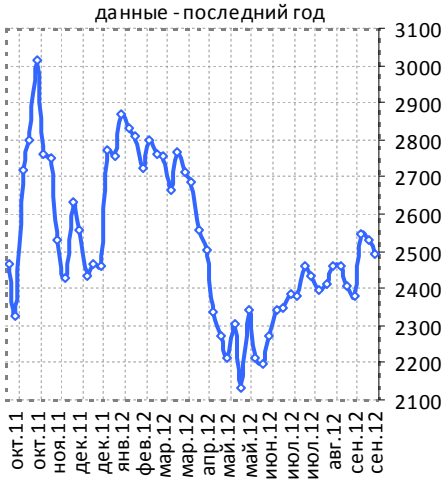
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



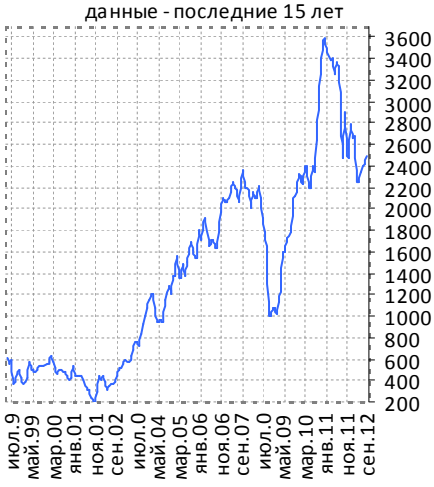
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

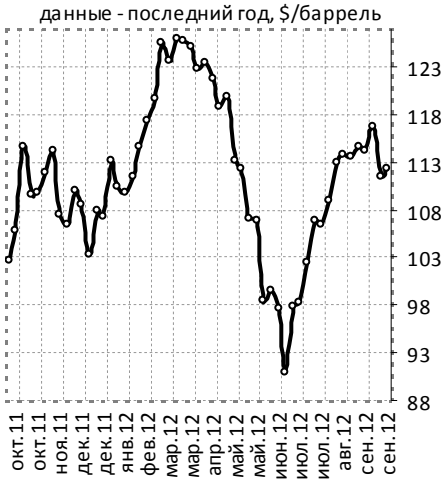
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

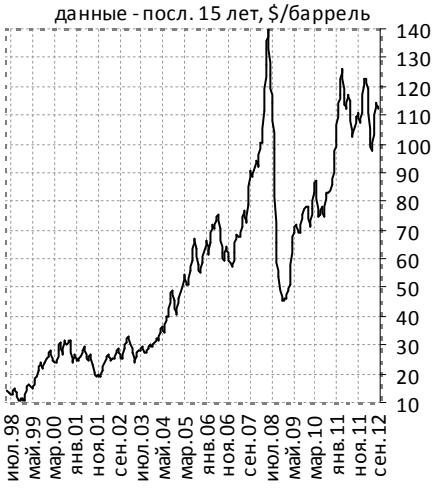
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



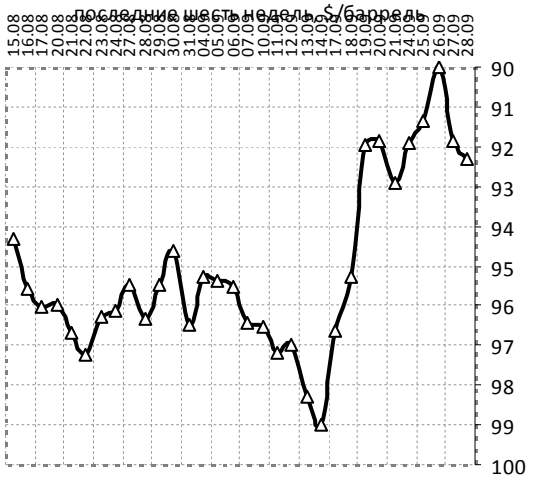
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



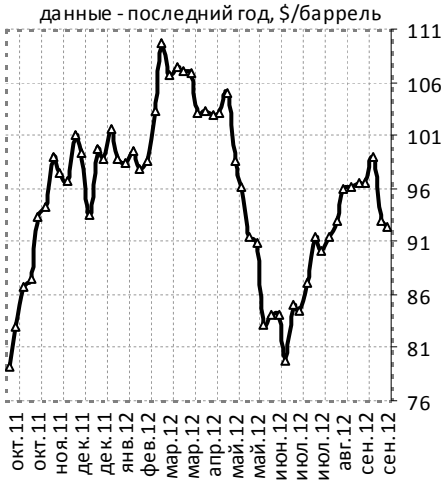
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



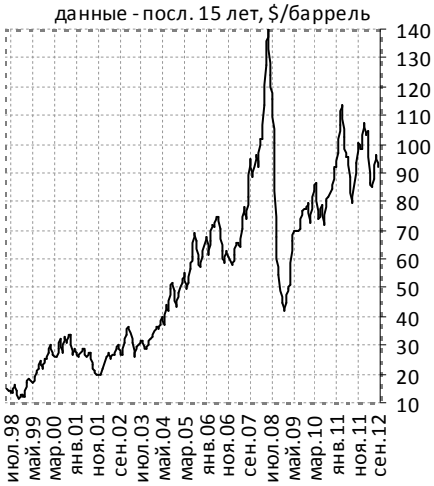
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



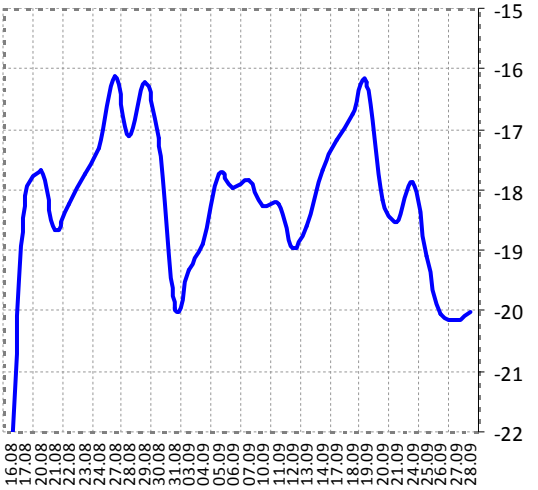
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



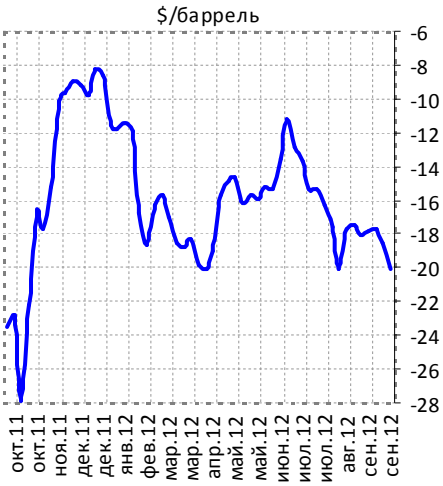
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



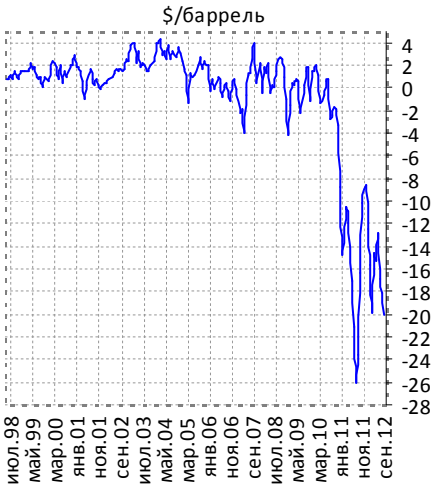
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



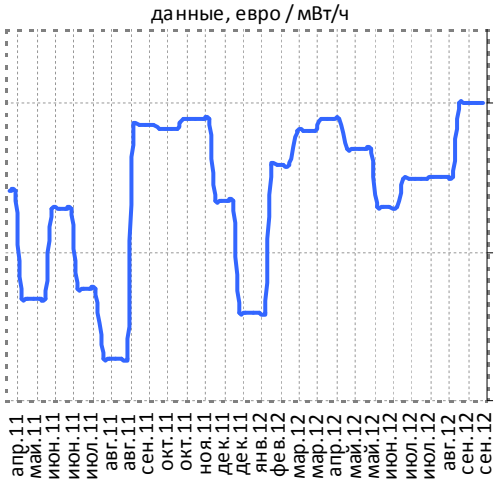
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



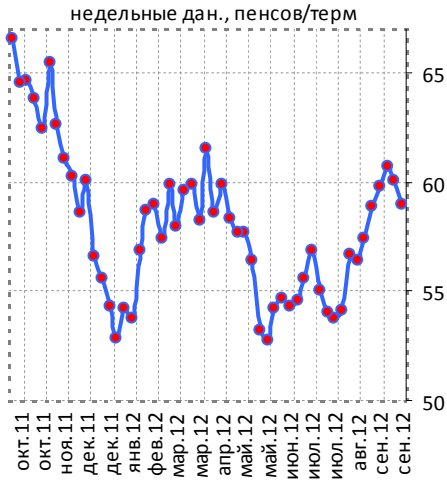
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

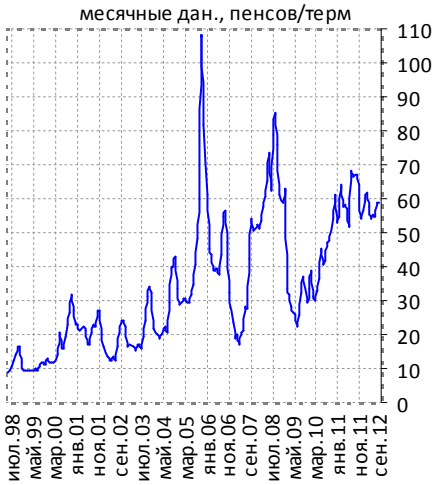
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



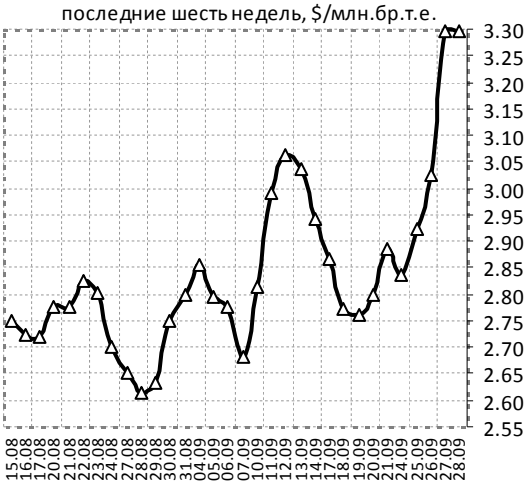
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



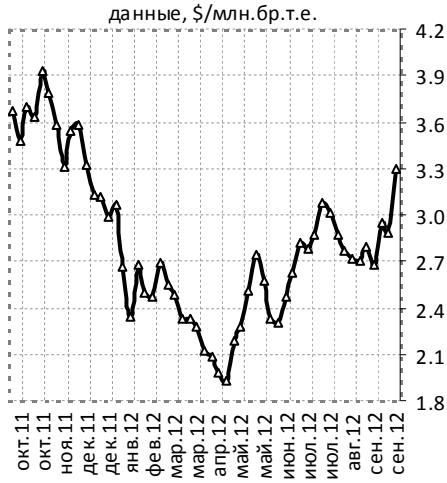
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



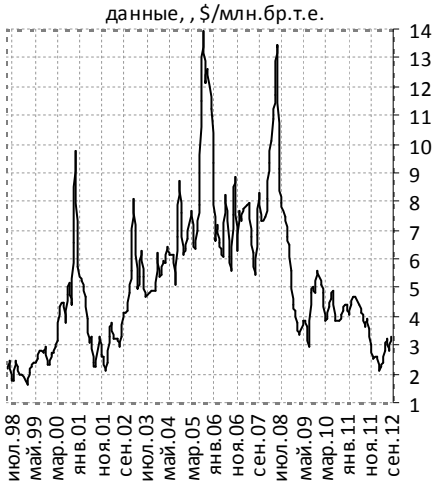
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



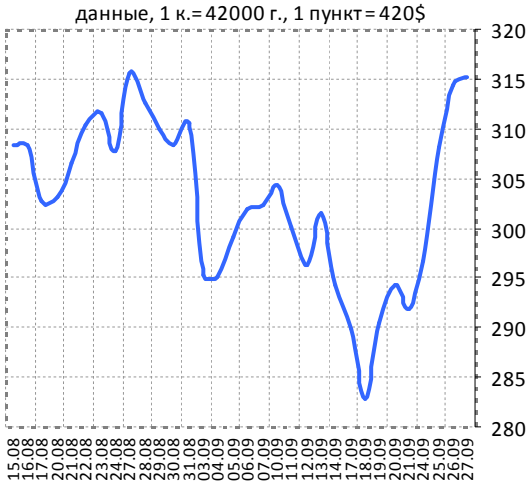
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



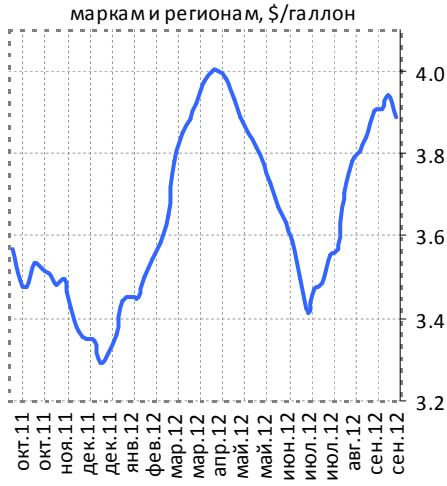
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



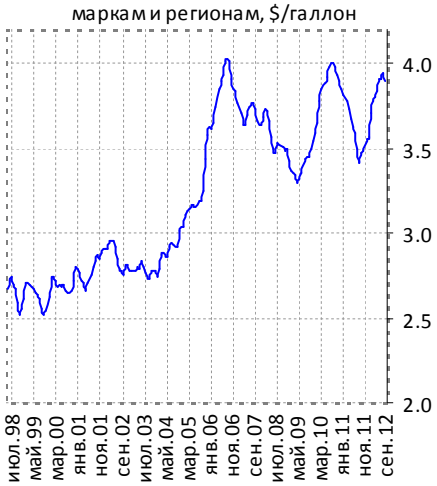
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



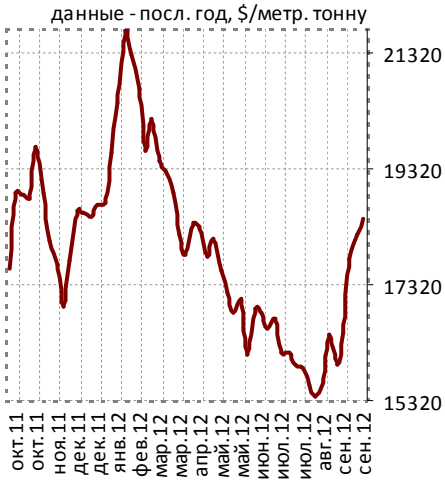
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

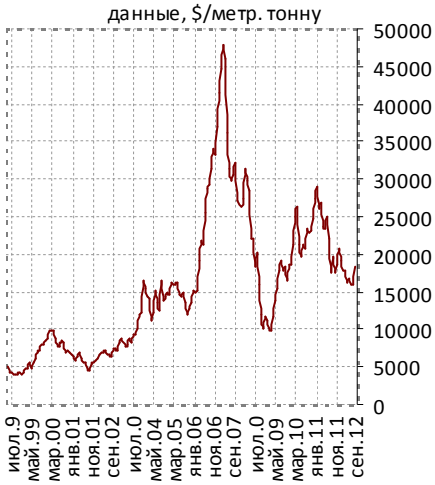
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



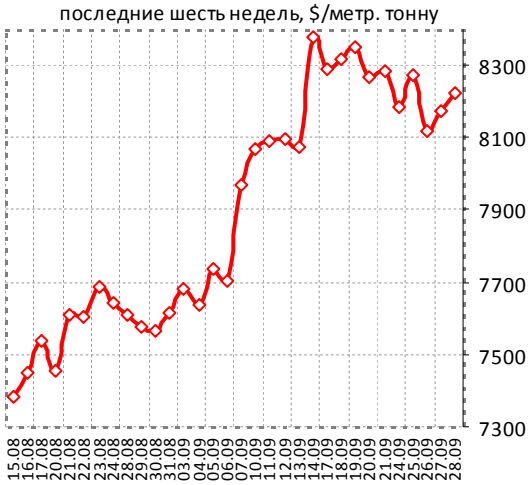
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



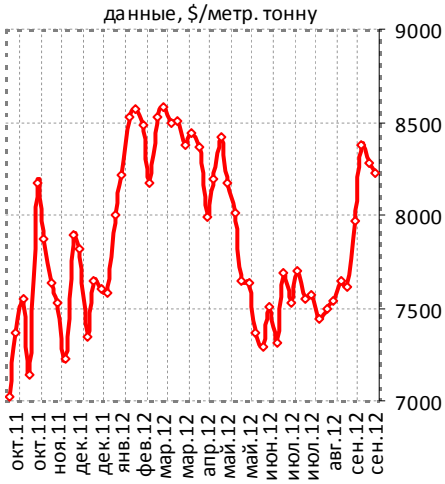
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



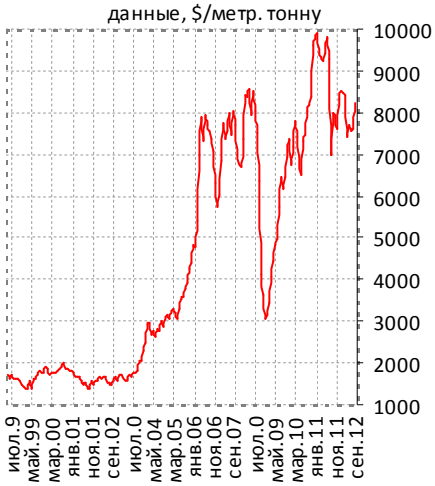
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



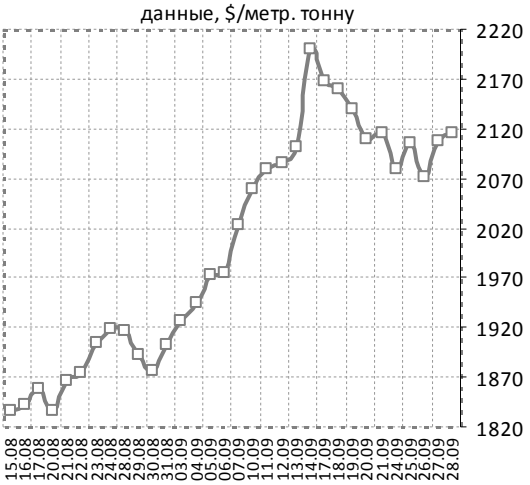
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



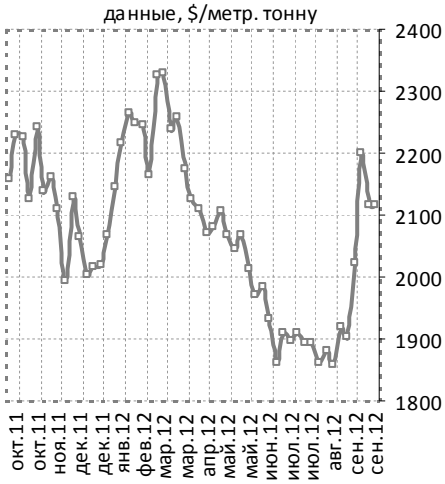
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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.