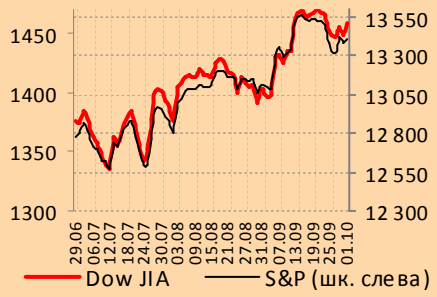
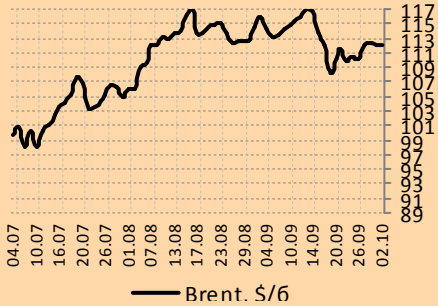
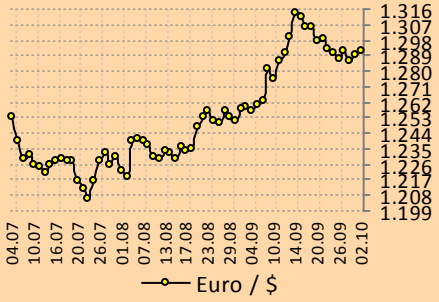
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

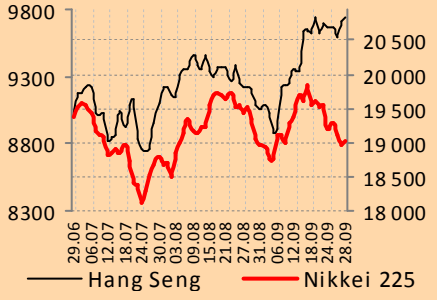
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

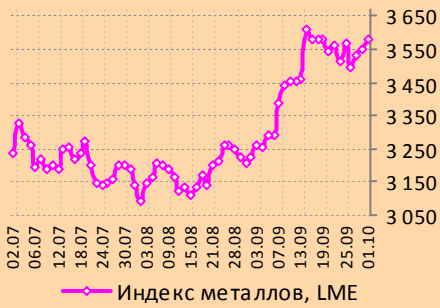
Ежедневный обзор

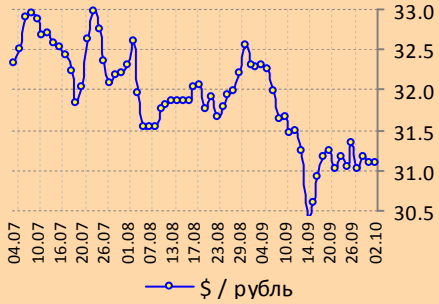






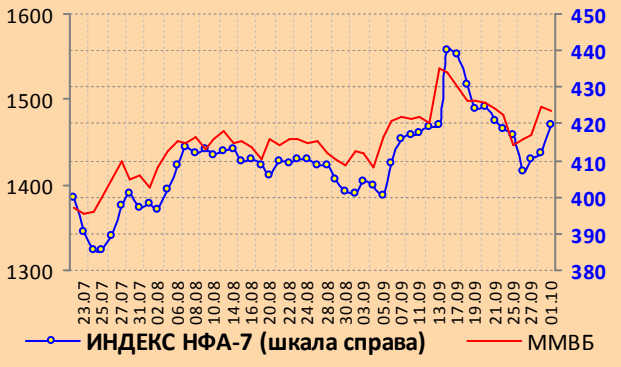






СОДЕРЖАНИЕ

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. Начало нового финансового года характеризовалось практически ростом индексов, Dow Jones =+0,58, S&P 500 =+0,27, NASDAQ =-0,09%. Глава ФРС, выступая в Конгрессе, отметил недостаточные темпы восстановления экономики, что привнесло легкий пессимизм в ход биржевых торгов.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, даже при снижении цены нефти внешняя поддержка оказала решающее воздействие на динамику котировок, индекс ММВБ =+2,19, РТС =+2,58%.

ЦБ вчера предложил банкам на 1 день прямое РЕПО в сумме 220 млрд. руб., спрос на утреннем аукционе составил 97 млрд. под 5,61% (ставка рынка выше и равна 6,22%). Меняется в сторону удлинения срока структура задолженности по обеспеченным кредитам ЦБ. В основном растет доля задолженности на сроки до полугода и года. Так, за последние 5 месяцев доля кредитов на срок от 91 до 180 дней возросла с 51 до 86%, от 180 до 365 дней - от 3,7 до 37,9%.

Казначейство сегодня размещает средства федерального бюджета на банковских депозитах в сумме 25 млрд. руб., минимальная ставка размещения 6,2%, срок 28 дней.

Европа. Итоги торгов понедельника впечатлили положительной динамикой, FTSE 100 =+1,37, DAX =+1,53, CAC 40 =+2,39%. Биржи росли на новостях по Испании, стало известно, что финансовая помощь испанскому банковскому сектору может быть предоставлена уже в ноябре. Статистика показала небольшой рост, хотя показатели деловой активности оставались ниже 50 пунктов (т.е. в целом наблюдается замедление деятельности). Так, по еврозоне индекс деловой активности в промышленности за месяц возрос с 46,0 до 46,1 пункта (ожидалось 46,0 пункта), в Германии с 47,3 до 47,4 пункта (ожидалось 47,3 пункта), во Франции с 42,6 до 42,7 пункта (ожидалось 42,6 пункта). В Великобритании индекс деловой активности в промышленности снизился с 49,5 до 48,4, ожидалось 49,0 пункта. Уровень безработицы еврозоны не изменился (11,4 %), как и ожидалось, в Италии также сохранился прежний уровень 10,7%, ожидалось 10,8%. В Греции правительство в основном завершило работу по пакету мер экономии бюджетных средств, предложения поступили на рассмотрение представителей кредиторов. Но самым опасным может стать этап рассмотрения этих мер в парламенте, когда оппозиция сделает все возможно, чтобы они не были приняты.

Азия. Из основных бирж вчера работали только биржи Японии, индекс Nikkei закрылся в минусе (-0,83%). Последние данные HSBC по PMI Китая показали рост за месяц на 0,3%, но индекс при этом остался ниже 50 (47,9) пунктов (значение ниже 50 является индикатором сокращения производственной активности), что и понятно при значительном уменьшении экспортных заказов. Данные PMI Китая стали причиной отрицательной динамики биржевых котировок в Японии. Укрепление иены дополнительно ухудшило ситуацию с акциями экспортеров, в наибольшей степени снизились котировки машиностроительных компаний и производителей сырья. С 1 по 7 октября в Китае отмечается образование КНР, это второй по важности праздник после китайского нового года.

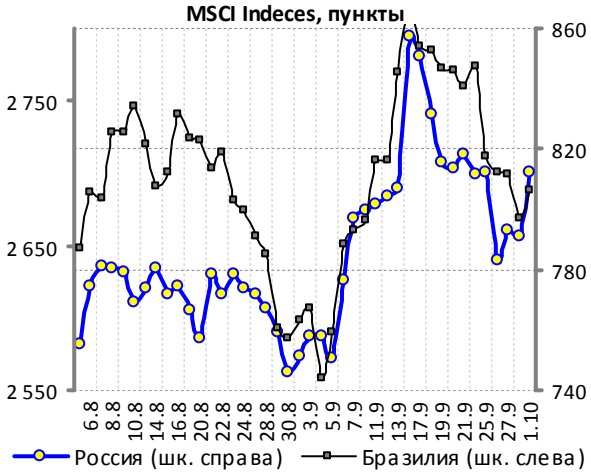
Золото. На фоне позитива мировых фондовых площадок цены драгметаллов также обозначили рост, если вчера к 14.00 золото торговалось по 1773,33, то сегодня утром фьючерсы на золото = 1780,3, серебро = 34,85, платину = 1677,7, палладий = 644,5 долл. за унцию.

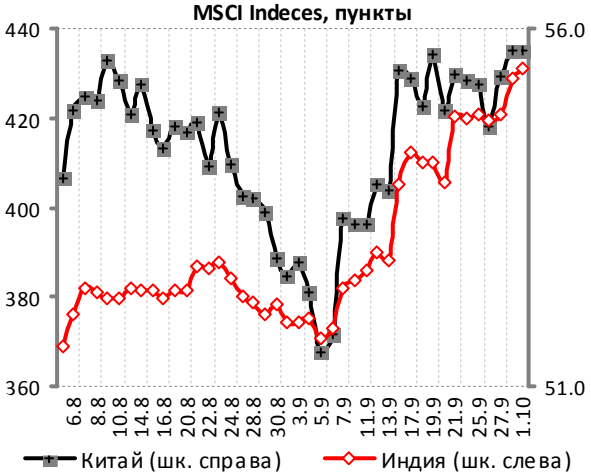
Нефть. Что касается цены нефти, то она находится под влиянием противоречивых факторов текущего характера. Стало известно, что США и Израиль согласовали позицию в отношении Ирана. Новость усилила ожидания роста напряженности на Ближнем Востоке. Кроме того, наблюдаются задержки поставок с Северного моря, снижена добыча в Иране до минимального уровня за последние 20 лет. Если бы ни укрепление доллара, цены могли бы расти, но под влиянием этого последнего фактора Brent и Light к 14.00 понедельника шли по 112,11 и 91,01, сегодня утром по 112,1 и 92,4 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем индекс производственных цен в зоне евро (13.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются в плюсе, Азия тоже, нефть не растет. Российские биржи, не имея сильного драйвера по нефти, могут попытаться развить продажи, используя подросшие цены. При внешней поддержке, однако, возможен и умеренный рост.

Исправления. В обзоре от 01.10. 2012 г. относительно результатов стресс-теста испанских банков их потребность в докапитализации составляет до 60 млрд. евро. Приносим наши извинения.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 02.10.2012

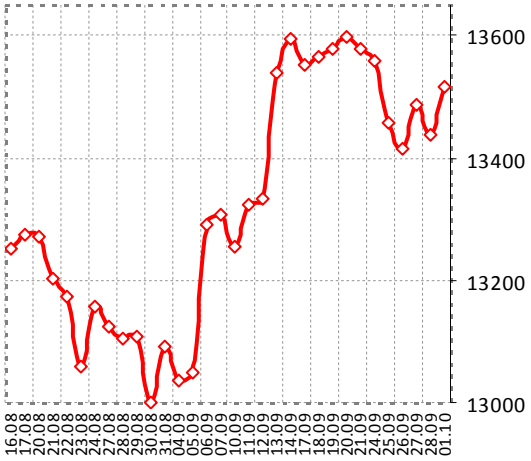




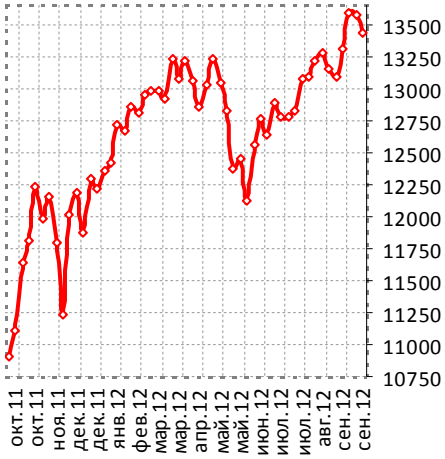
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

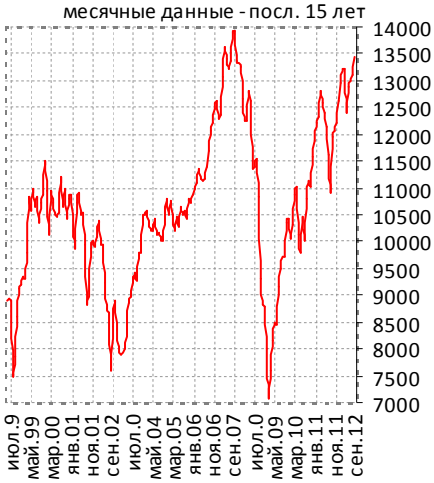
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



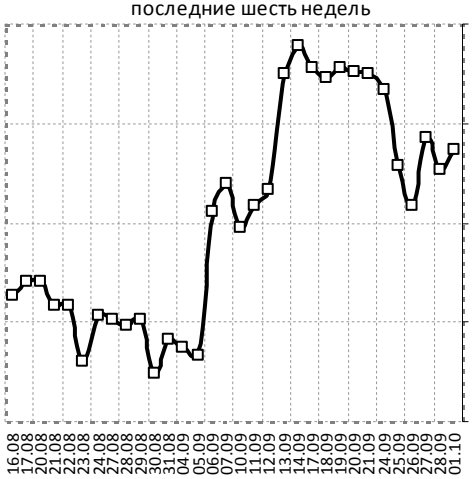
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



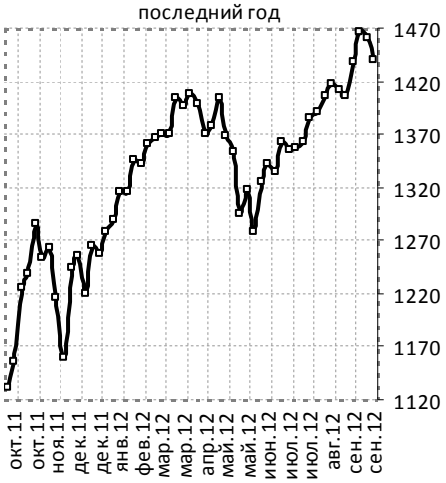
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



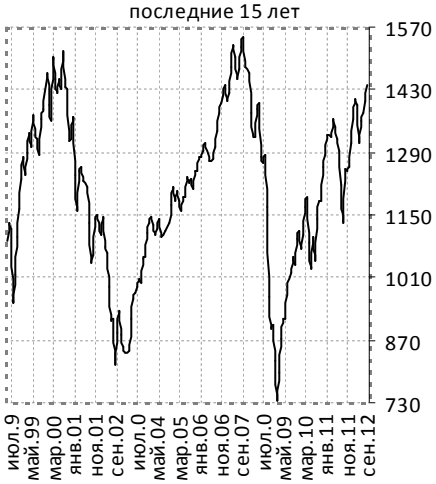
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



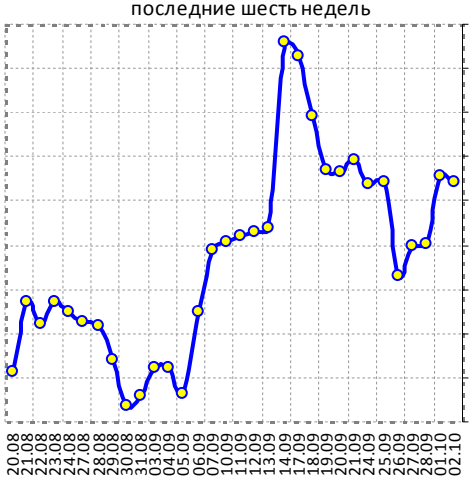
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



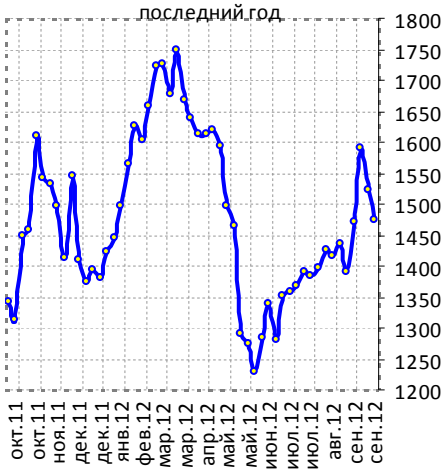
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



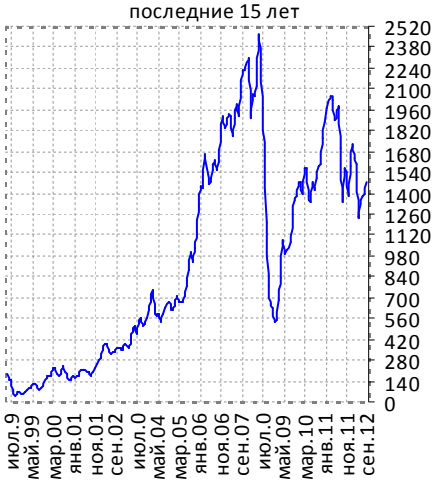
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



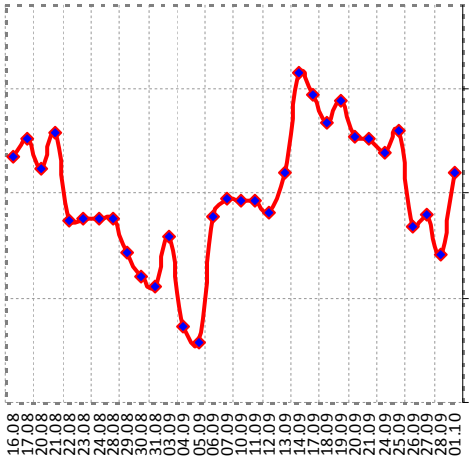
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



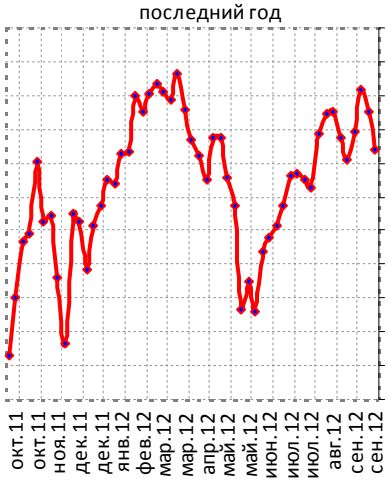
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

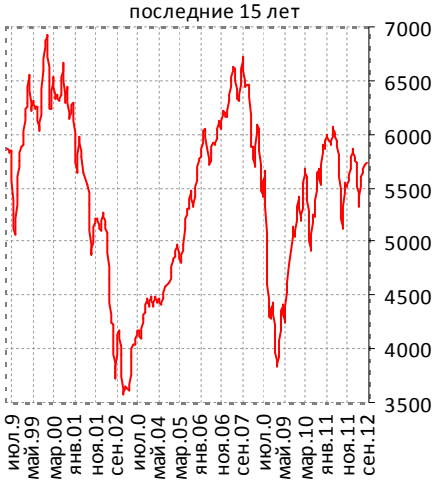
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



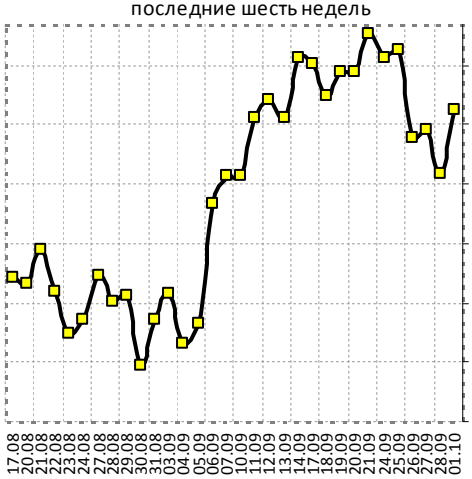
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



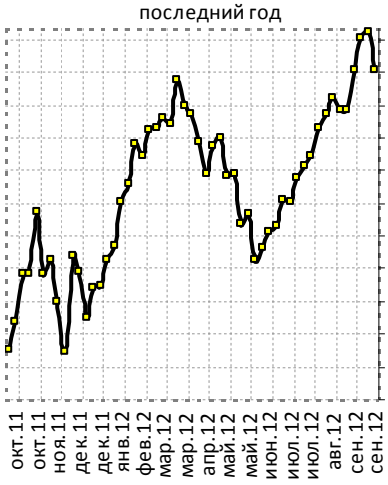
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



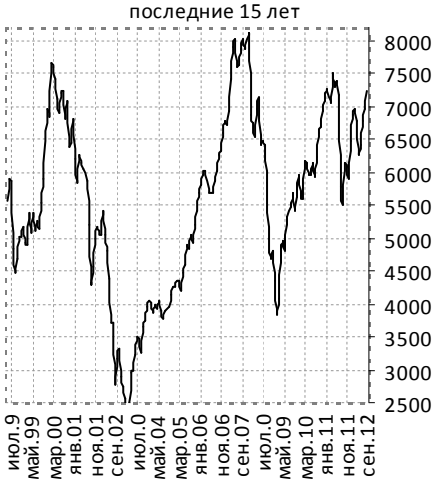
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



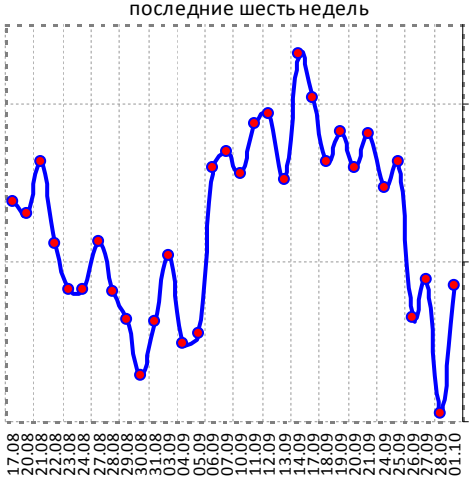
DAX Index: недельные данные - последний год



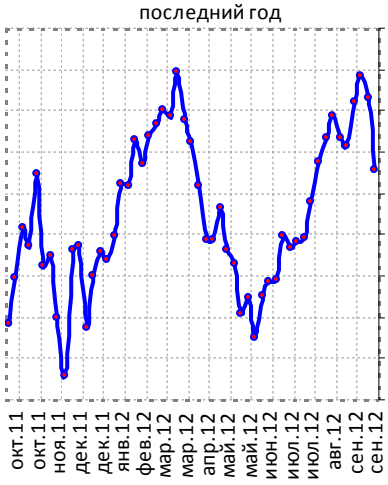
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



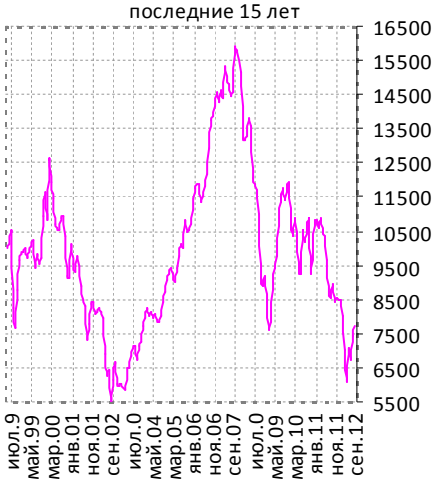
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

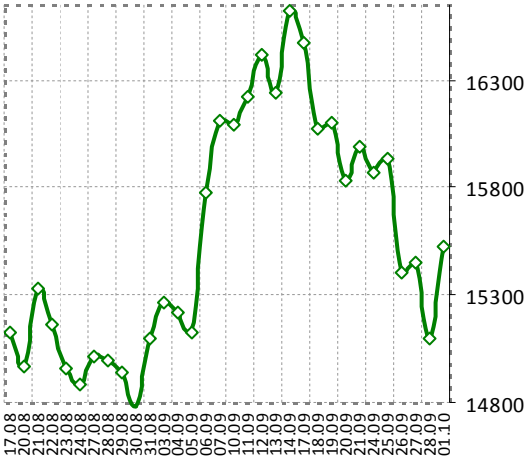


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

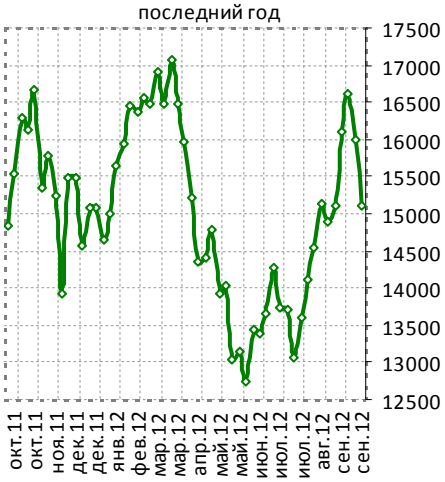


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



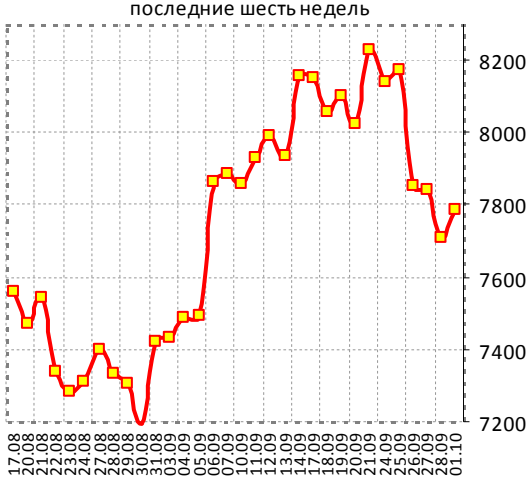
MIB Index: недельные данные - последний год



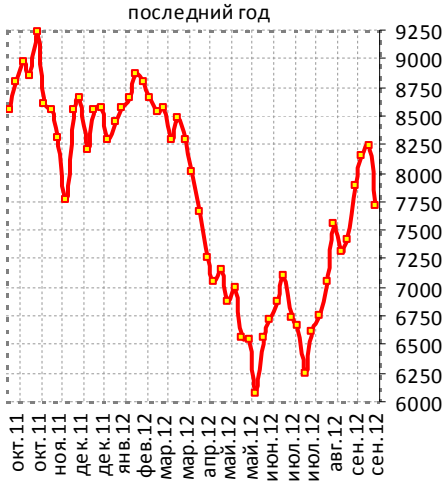
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



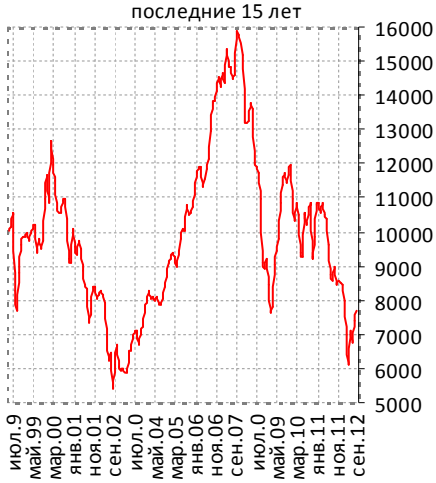
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



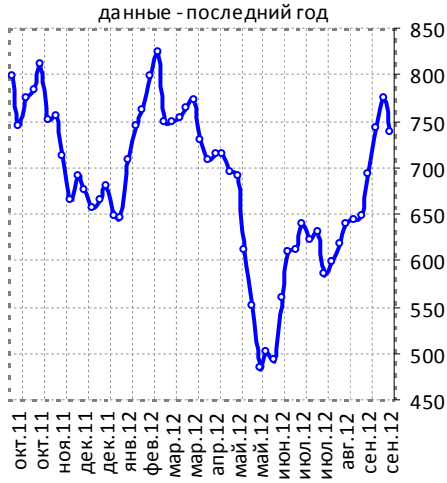
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



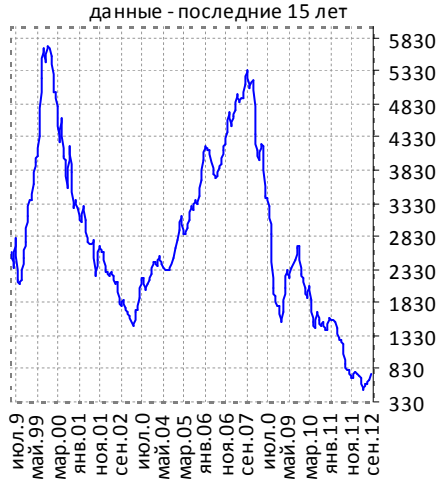
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



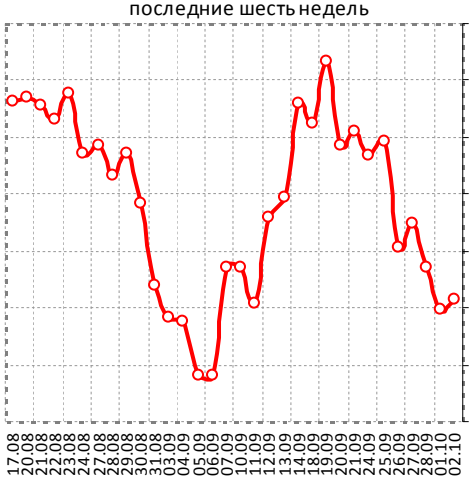
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



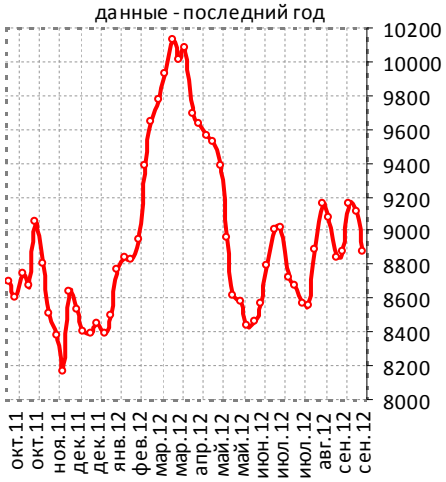
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

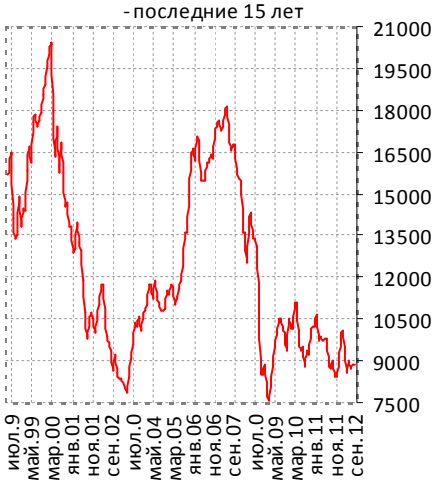
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



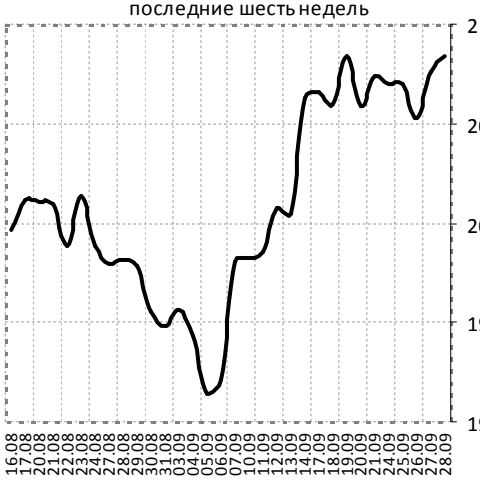
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



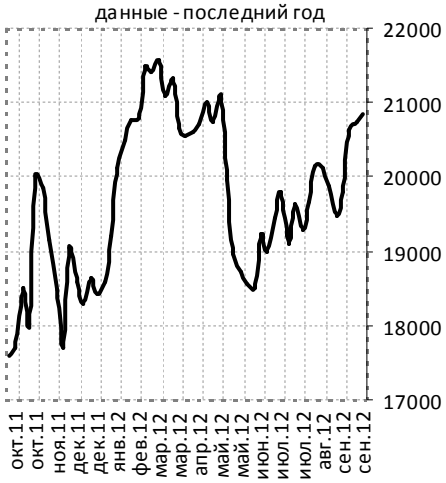
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



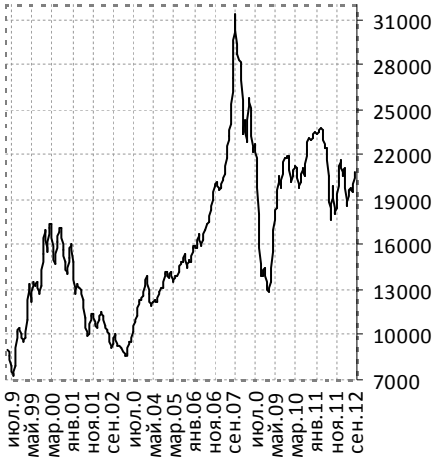
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



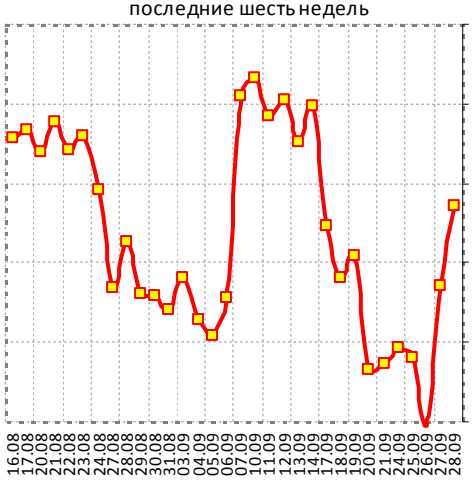
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



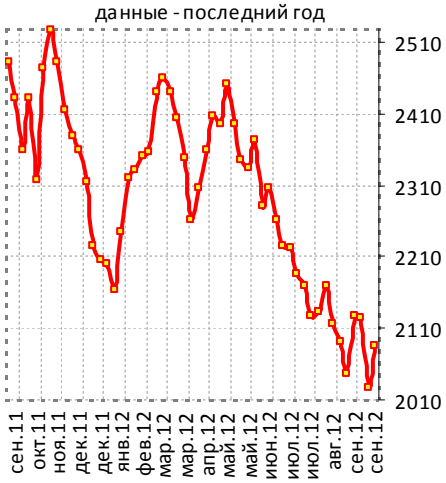
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



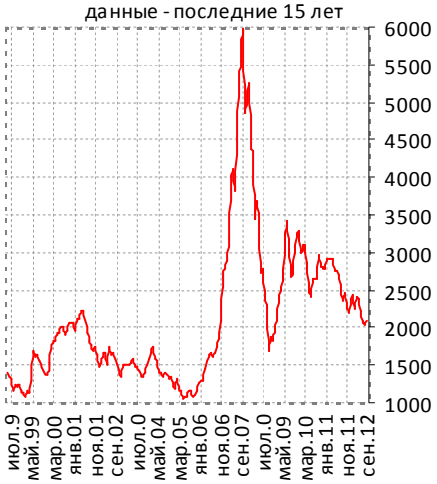
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



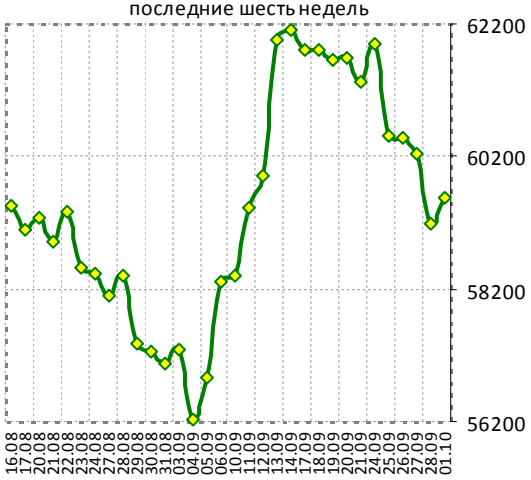
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



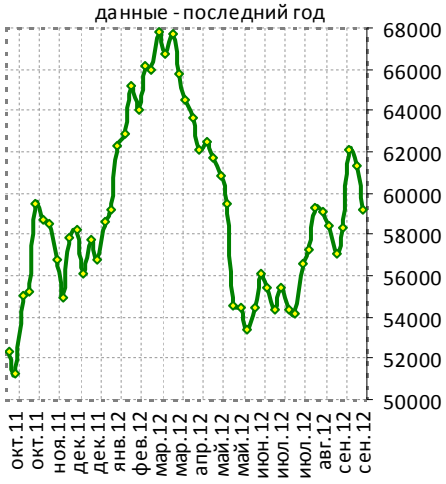
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

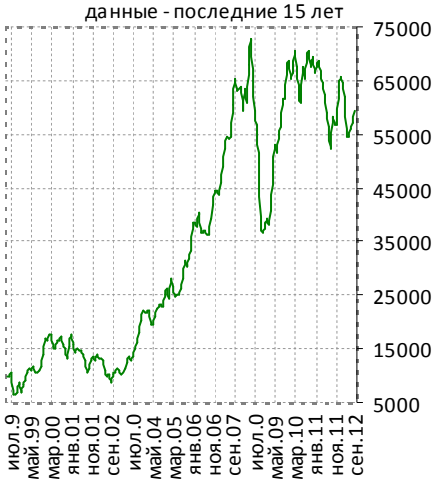
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



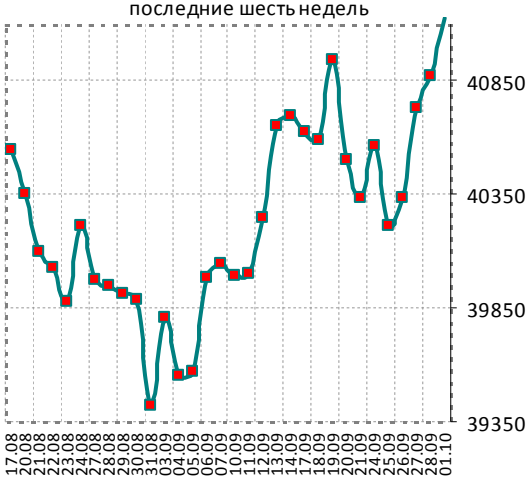
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



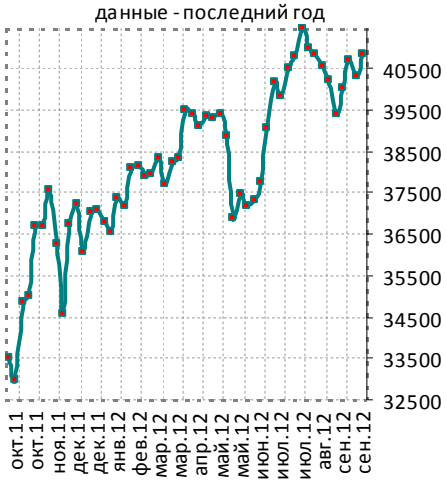
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



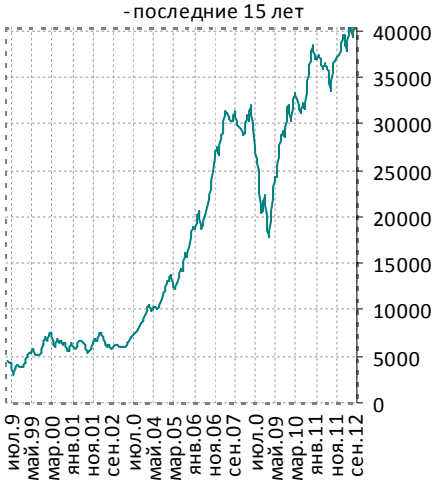
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



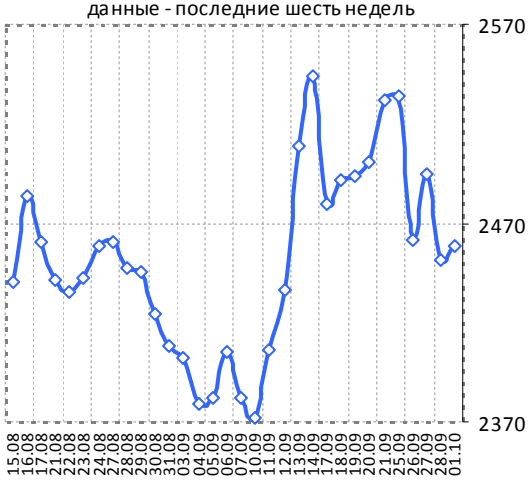
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



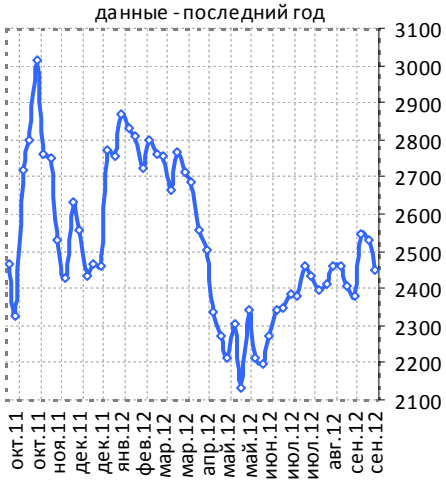
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



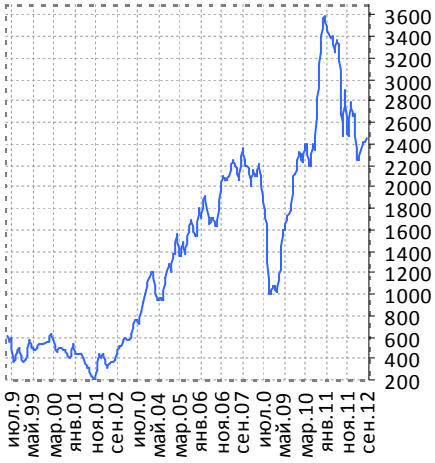
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

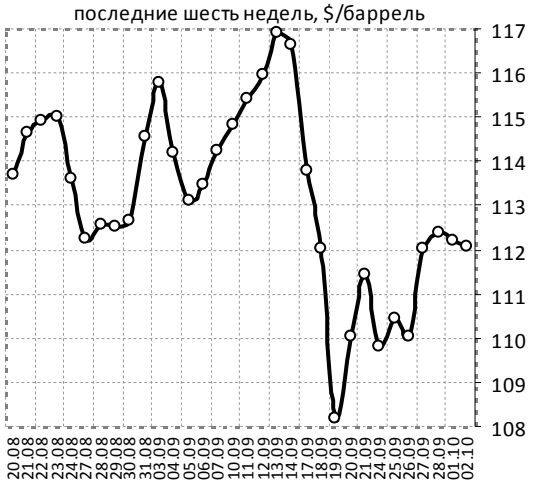


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

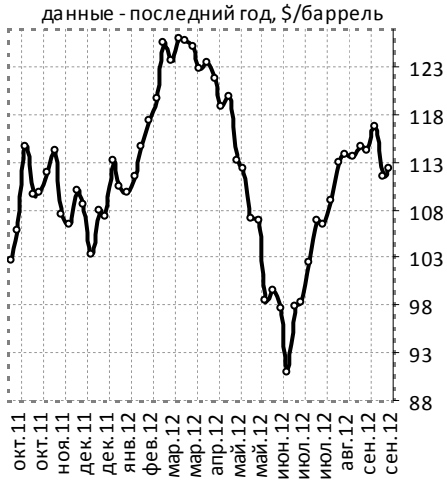
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

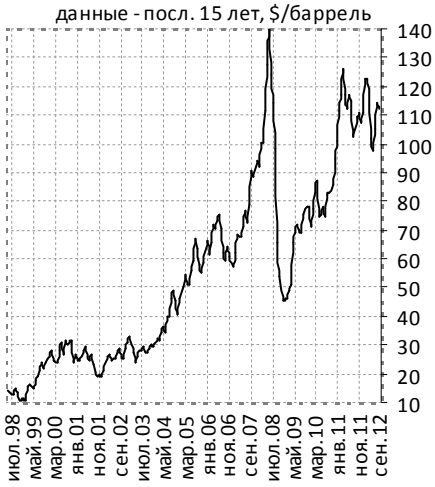
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



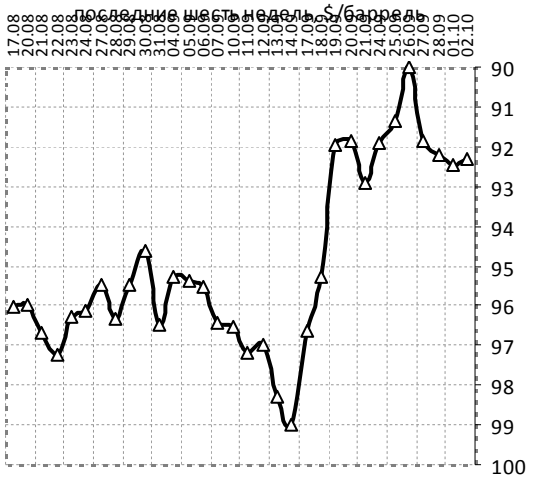
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



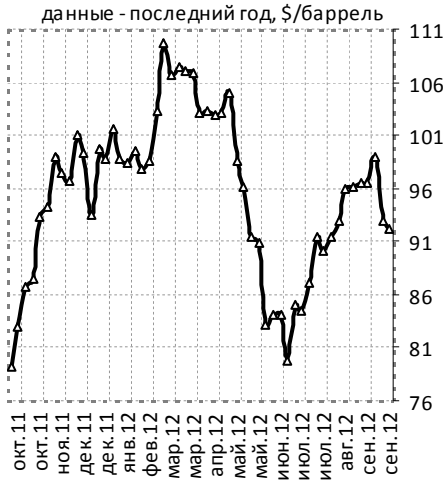
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



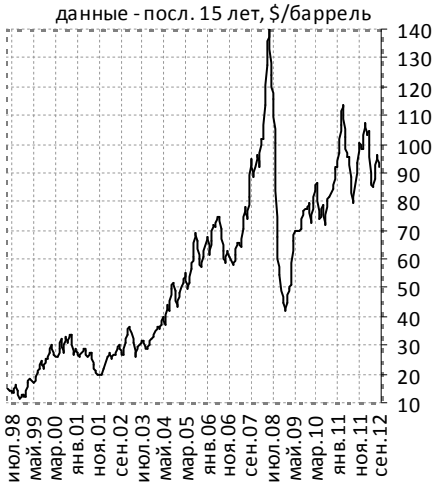
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



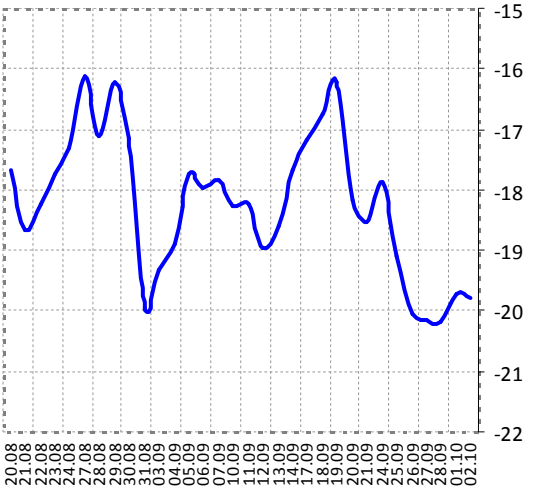
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



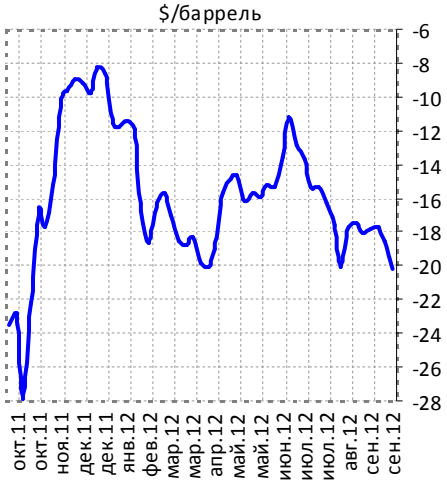
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



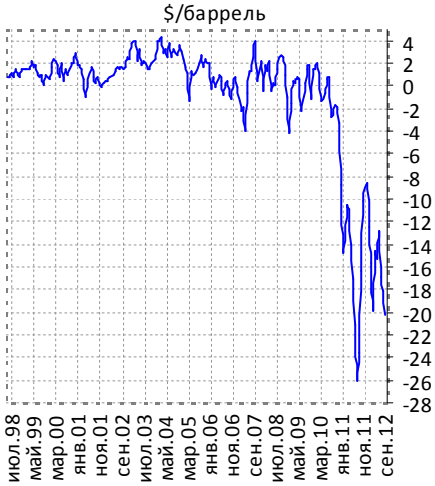
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



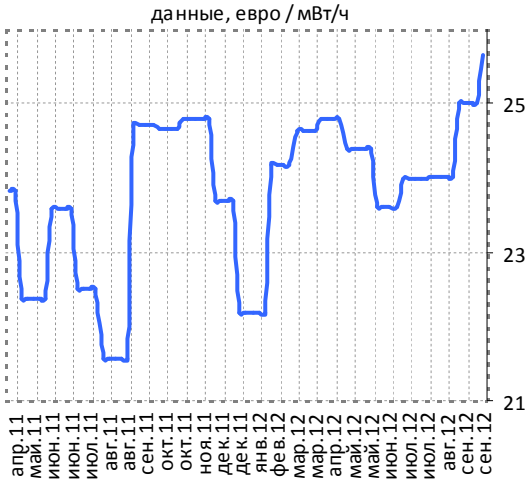
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



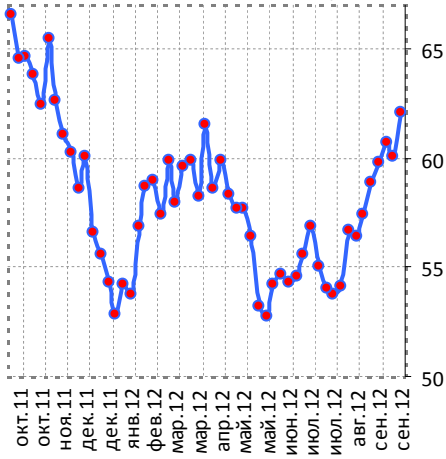
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

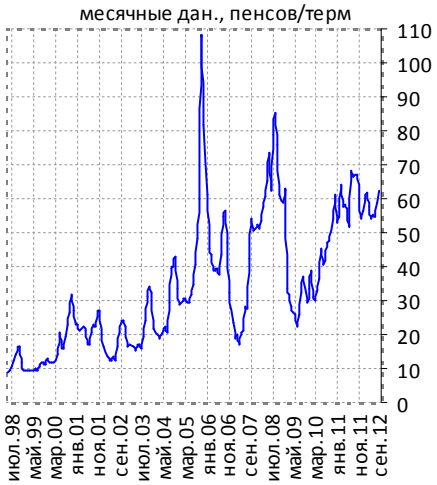
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



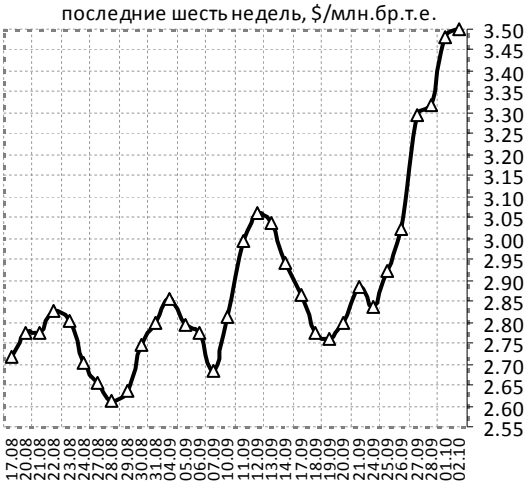
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



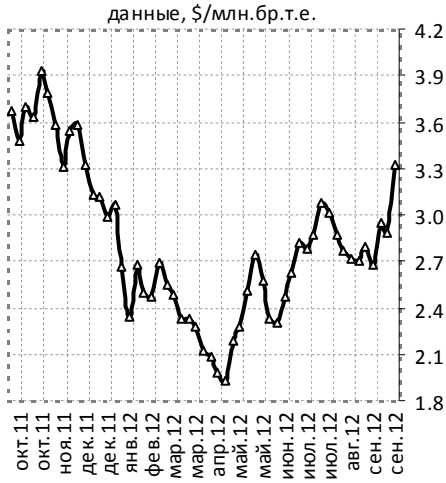
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



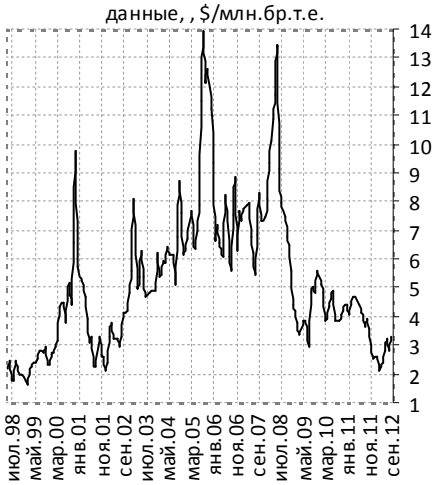
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



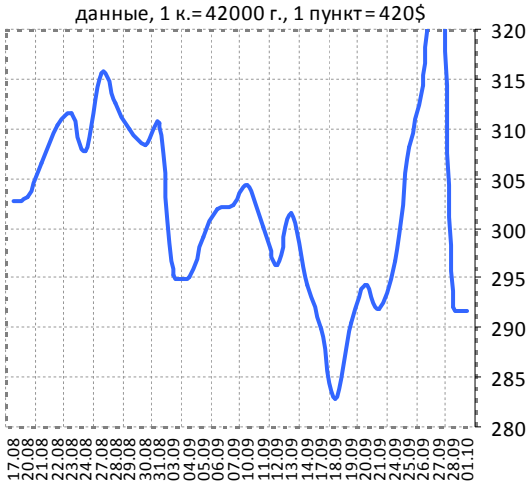
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



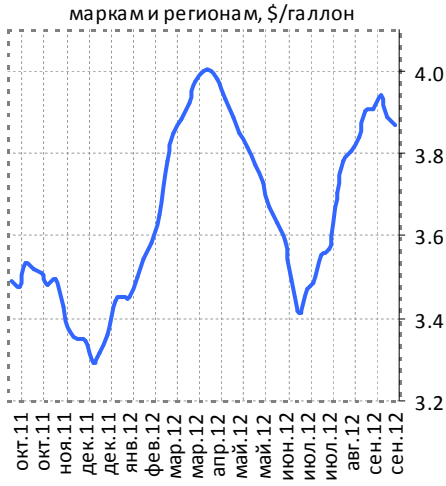
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



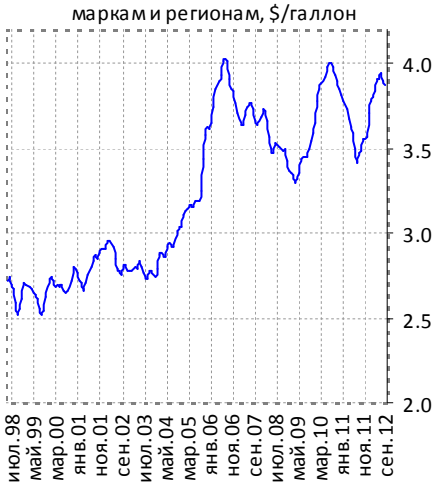
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



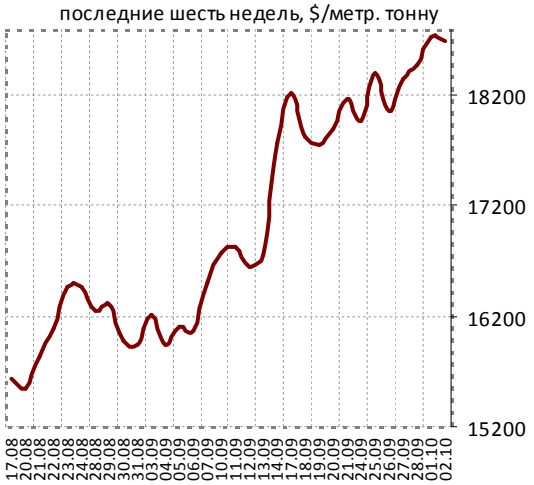
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



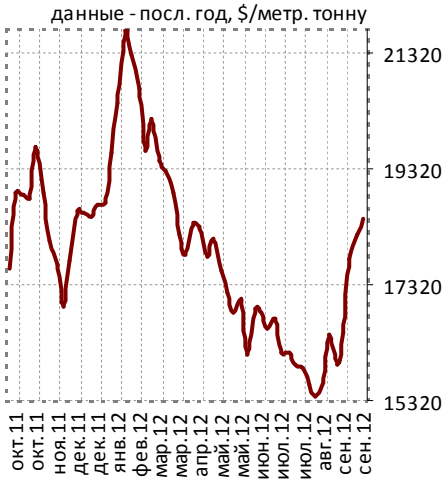
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

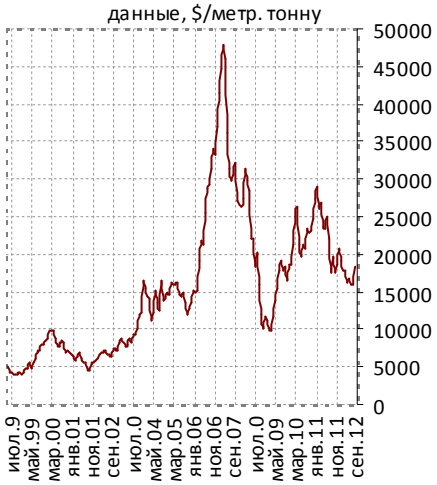
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



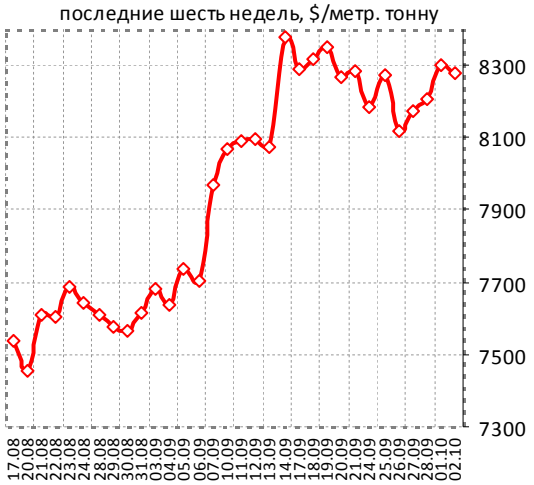
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



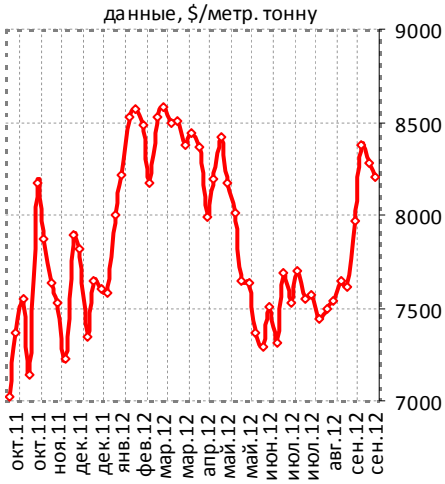
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



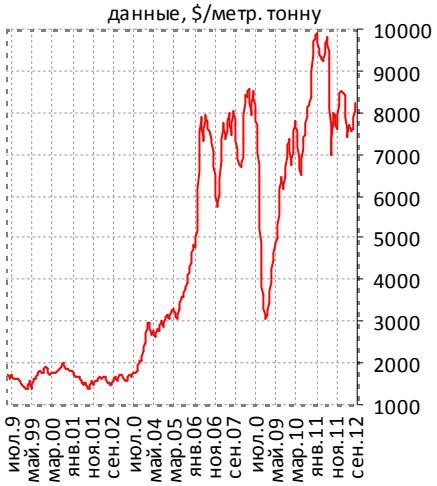
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



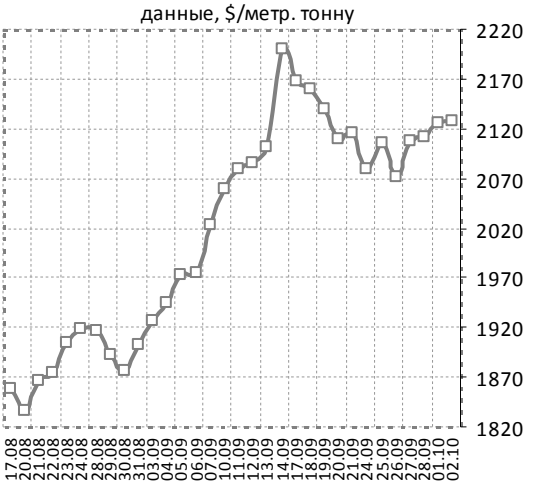
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



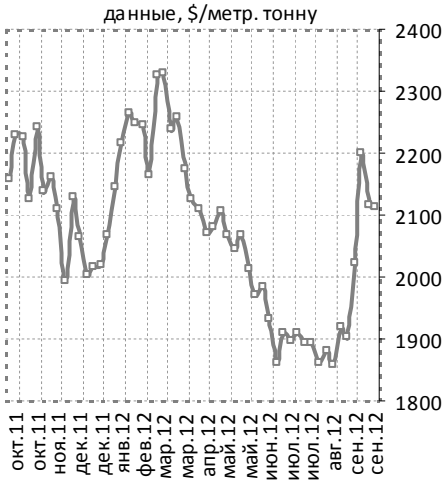
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



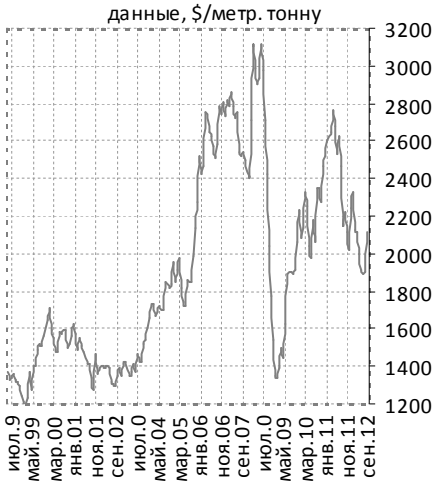
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.