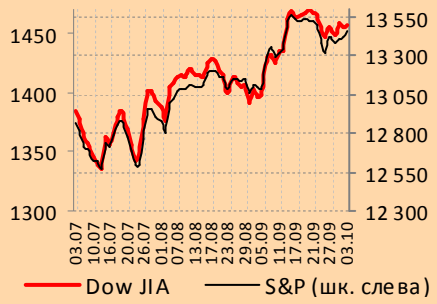
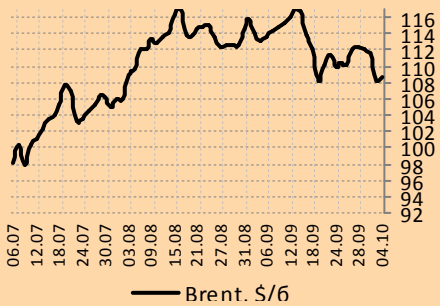
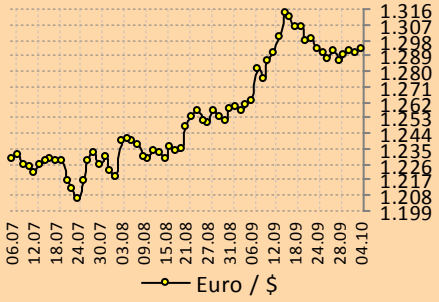
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

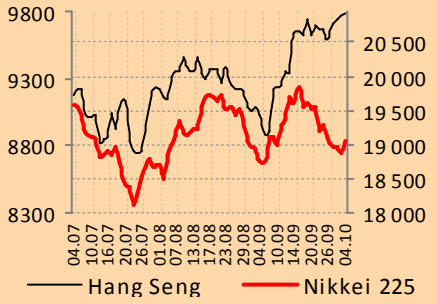
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

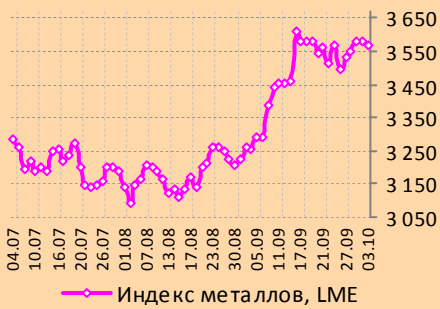
Ежедневный обзор

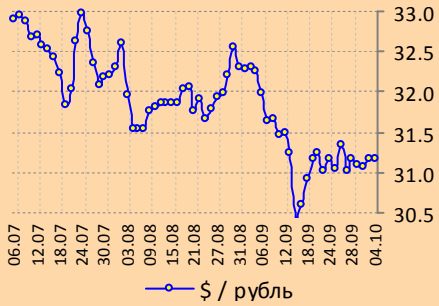






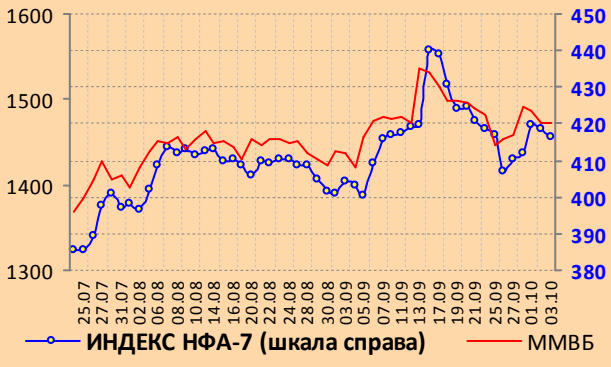






СОДЕРЖАНИЕ

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. С одной стороны, размещались пятилетние гособлигации, что традиционно вызывает прилив капитала на этот сегмент рынка. С другой - данные по рынку труда вселили оптимизм, индикатор занятости ADP хотя и снизился с 201 до 162 тыс., но меньше, чем ожидалось (143 тыс.). В результате котировки подросли, индекс Dow Jones =+0,09, S&P 500 =+0,36, NASDAQ = +0,49%.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, торги в результате завершились в минусе, ММВБ =-0,88, РТС =-1,03%.

ЦБ предложил вчера прямое РЕПО на 1 день в сумме 240 млрд. руб., банки на 2-х аукционах соответственно взяли 70 млрд. под 5,59% (ставка рынка равна 5,98%) и 33 млрд. под 5,51%, т.е. всего 43% от предложенной суммы кредита. Минфин изымал деньги, предложенные накануне, размещая ОФЗ-ПД в объеме 25 млрд. руб. в интервале доходности от 8,18 до 8,23%, погашение в феврале 2027 г. Спрос составил 18 млрд., доходность по факту 8,22% (практически на уровне верхней планки). МЭР повысил прогноз инфляции на текущий год с 5-6 до 7%, оттока капитала с 50-60 до 60-65 млрд. долл. Чистый отток частного капитала за январь-сентябрь уже составил 57,9 млрд. долл.

Европа. Биржи в основном показали рост, FTSE 100 =+0,28, DAX =+0,22, CAC 40 =-0,24%. Можно предположить, что опровержение премьер-министром Испании слухов о том, что страна собирается обратиться за финансовой помощью к ЕС, является чисто политическим ходом - отложить проблемные вопросы до прохождения в стране региональных выборов (21 октября). Теперь рынки ожидают решения рейтингового агентства Moodys относительно инвестиционного рейтинга Испании. В Греции продолжается работа представителей кредиторов (ЕЦБ, ЕС и МВФ) с правительством по согласованию мер по сокращению расходов бюджета на предстоящие 2 года на сумму 11,5 млрд. евро.

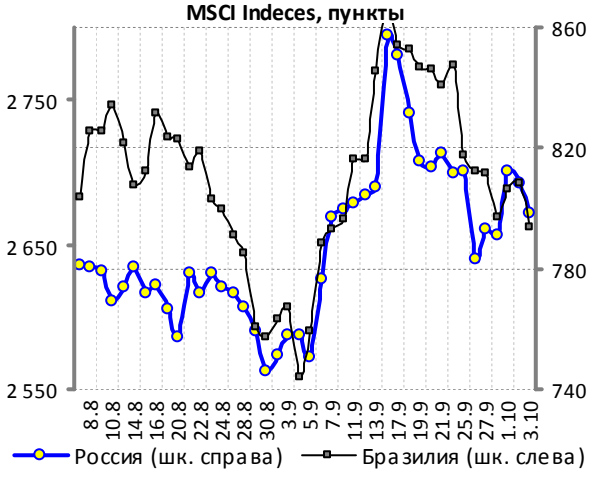
За месяц в еврозоне значительно увеличился рост цен производителей, на 0,9% в сравнении с июлем при ожидавшемся повышении на 0,5%. Известно, что с определенным лагом влияние производственной инфляции скажется на росте цен для населения, что находится под непосредственным контролем ЕЦБ и дает надежду на введение стимулирующих мер. Индекс деловой активности в секторе услуг еврозоны показал небольшой рост с 46,0 до 46,1 пункта, ожидалось 46,0 пункта. Розничные продажи в еврозоне снизились, но меньше ожиданий (соответственно 1,3 и 2,0%в годовом выражении). В Испании, между тем, индекс вырос на 2,1% относительно предыдущего месяца, и даже такая небольшая, но позитивная информация, при всех сложностях с Испанией, привнесла оптимизм на европейские площадки. С утра сегодня стало известно, что 17 испанских регионов поддерживают ориентиры бюджетного дефицита центрального правительства на 2013 год. Тем самым правительство как бы получило основание не обращаться пока за помощью к ЕС.

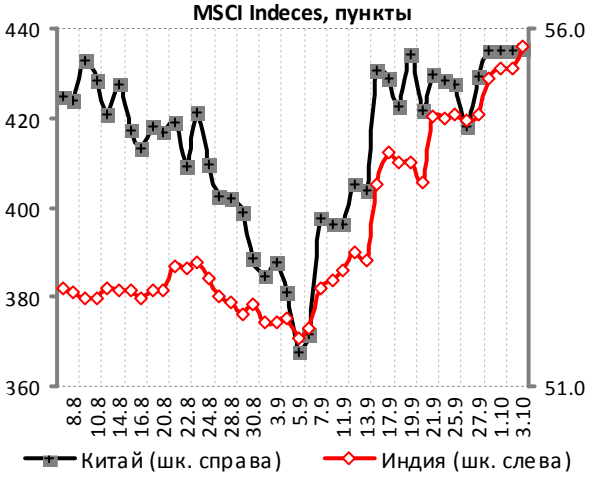
Азия. Торги в материковом Китае в среду не проводились в связи с продолжением празднования Дня образования КНР. Индекс Hang Seng повысился на 0,23%, Nikkei и Kospi умеренно снизились до -0,45 и -0,01% соответственно, чему способствовали данные из того же Китая, отразившие замедление роста сектора услуг. Индикатор снизился с 56,3 до 53,7 пункта, хотя и остается выше пороговой отметки в 50 пунктов. После длительной неопределенности на 8 ноября назначена дата очередного съезда компартии Китая, случайно или нет, но ровно после того, как в США появится определенность с выборами президента. **Золото.** Действия мировых центробанков по смягчению денежно-кредитной политики являются факторами долгосрочного повышательного характера для драгметаллов, как инструмента хеджирования от инфляционных рисков. Кроме того, цены поддерживаются текущими факторами, к примеру, сейчас это забастовка шахтеров рудников в ЮАР, требующих повышения заработной платы (добыча золота там практически приостановлена). Утром среды золото торговалось по 1775,4, к 14.00 по 1780,61, утром сегодня фьючерсы на золото = 1782,68, серебро = 34,78, платину = 1696,6, палладий = 657 долл. за унцию.

Нефть. Что касается цены, то она находилась под влиянием ожидания данных по запасам нефти в США, инвесторы были настроены на их рост, что и подтвердилось новой статистикой вчера вечером. Brent и Light утром среды шли по 111,06 и 91,65, к 14.00 по 110,00 и 91,74, утром сегодня по 108,47 и 88,26 долл. за барр.

События, статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем решение Банка Англии по ключевой процентной ставке (15.40), в зоне евро решение ЕЦБ по ключевой процентной ставке (15.45), пресс-конференцию главы ЕЦБ (16.30), в США данные по рынку труда (16.30) и объему промзаказов (18.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются в плюсе, Азия (кроме Кореи) тоже, нефть, правда, не растет, но российские биржи, следуя общему тренду на ожидание новых стимулов от ЕЦБ и Банка Англии, тоже попытаются расти, по крайней мере, до объявления решений банков.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 04.10.2012

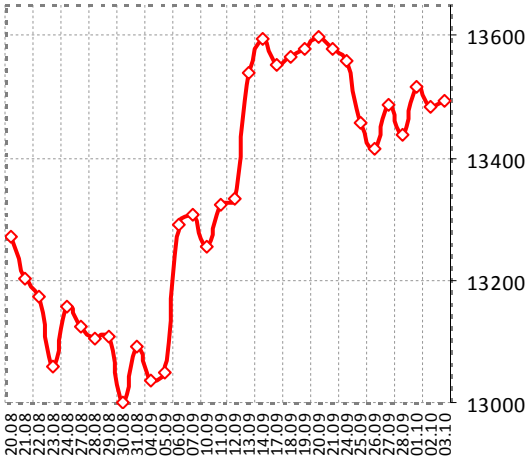




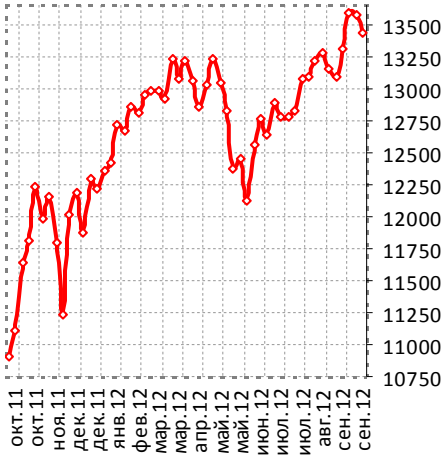
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

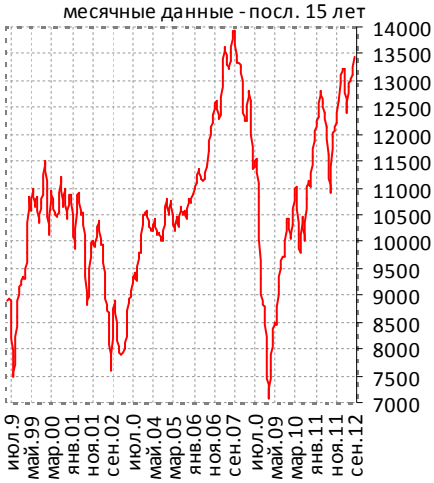
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



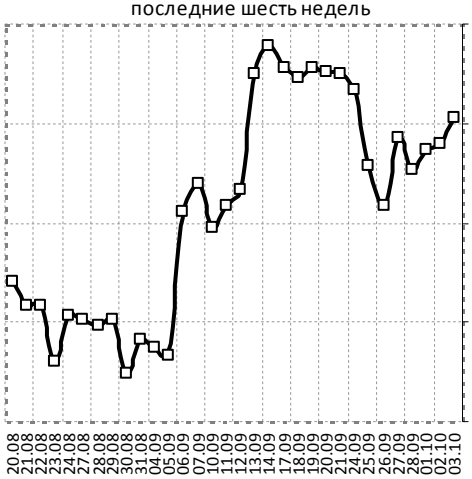
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



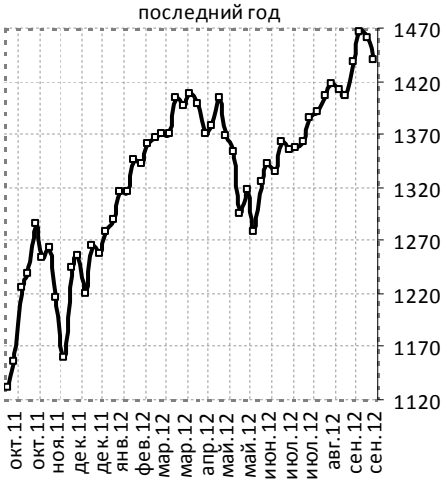
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



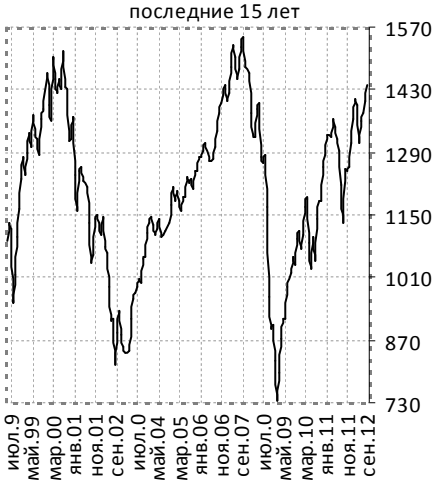
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



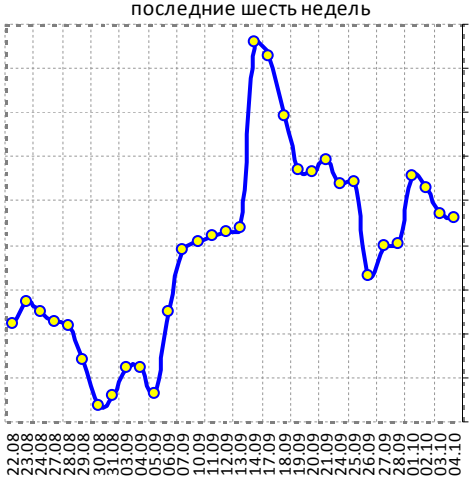
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



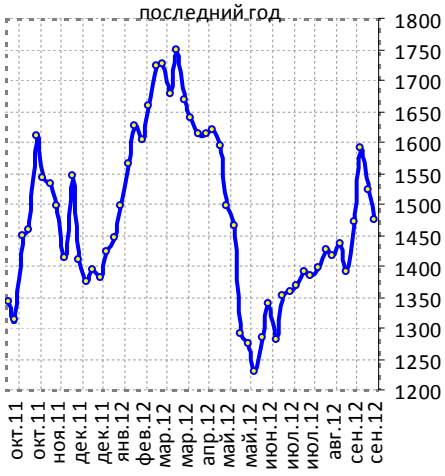
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



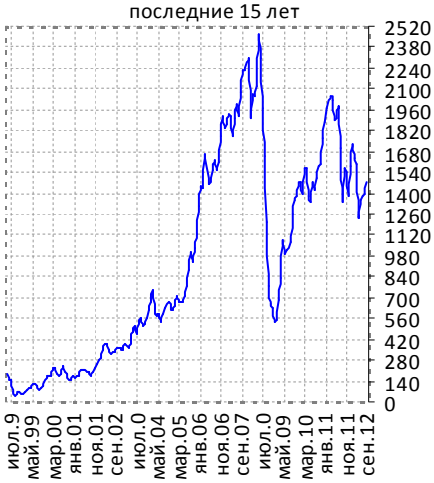
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



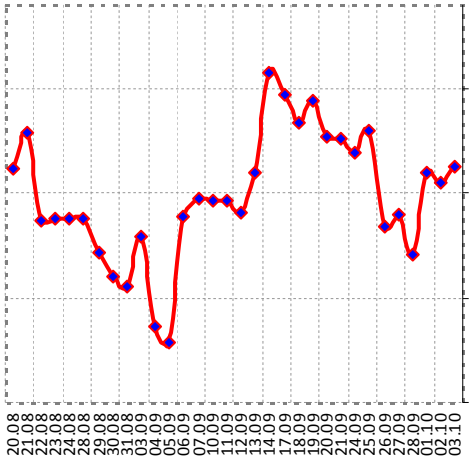
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



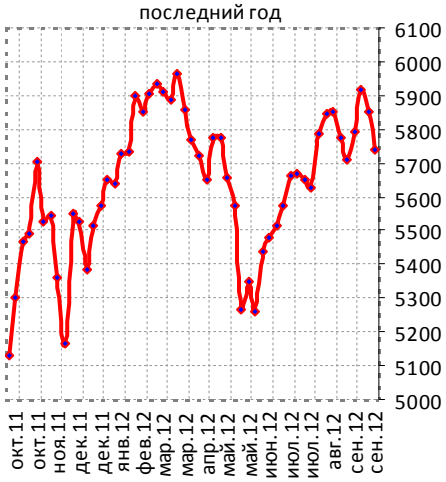
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

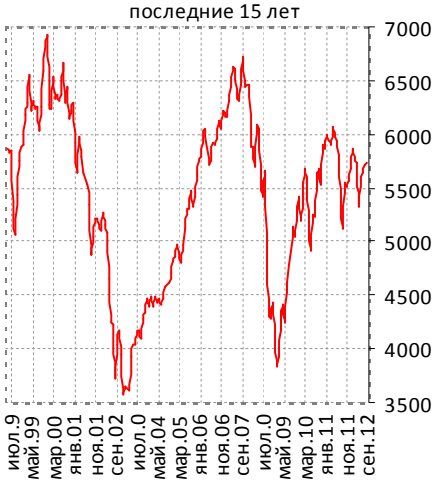
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



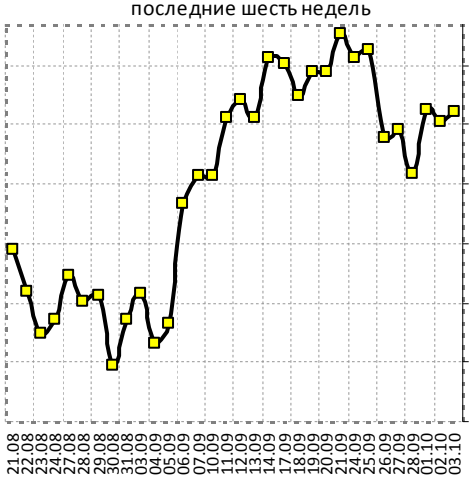
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



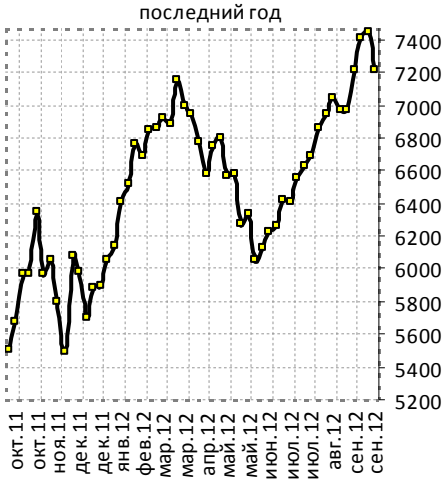
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



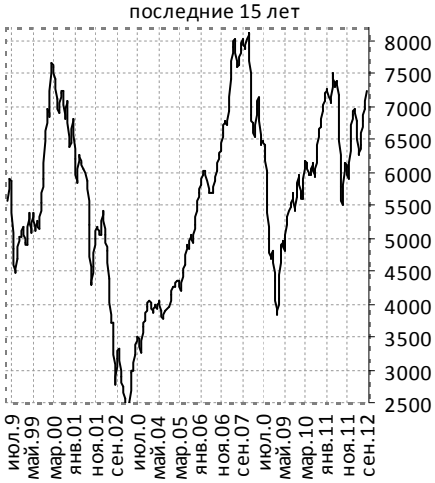
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



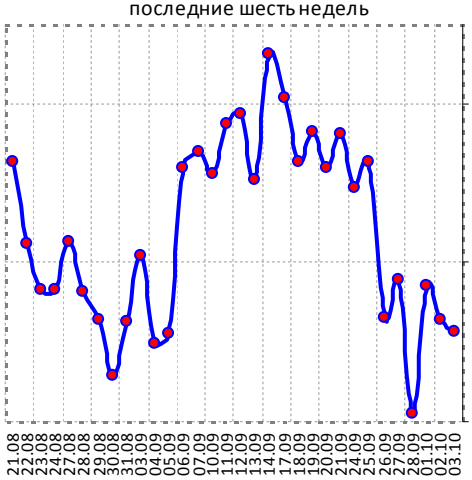
DAX Index: недельные данные - последний год



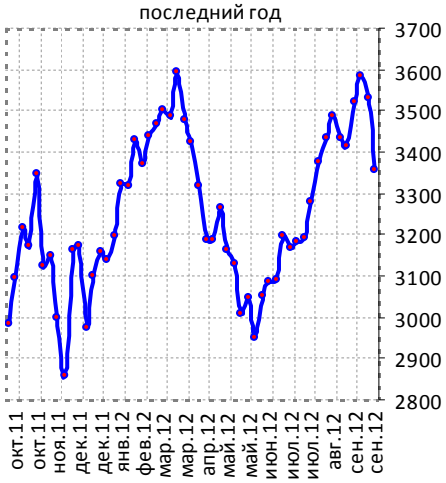
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



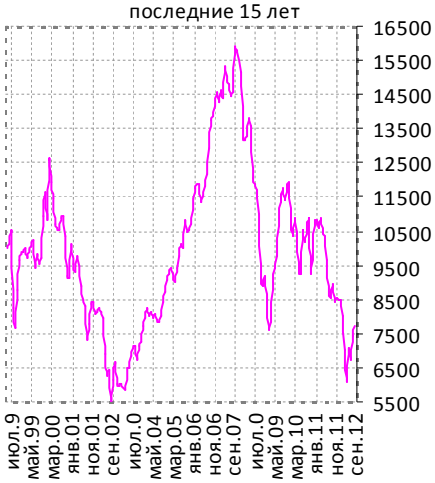
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

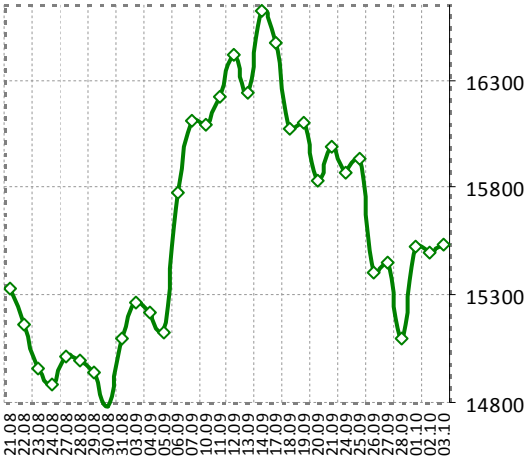


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

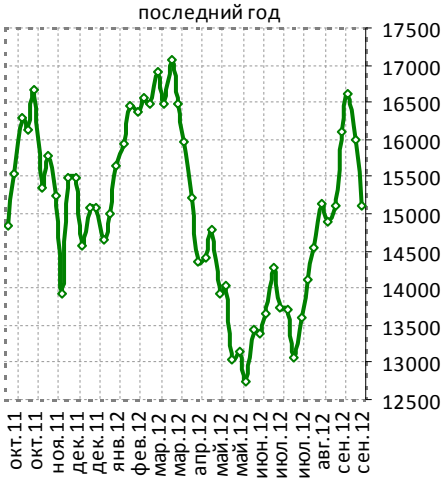


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



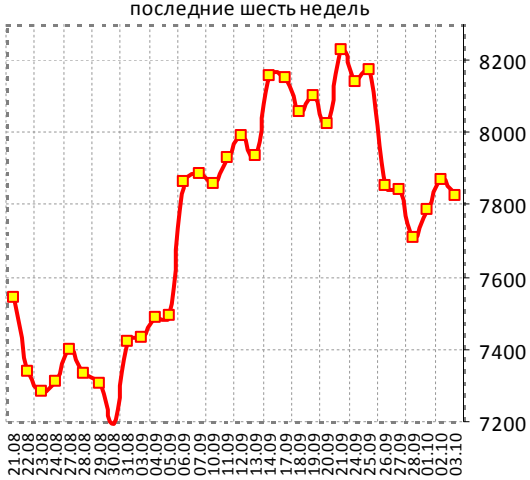
MIB Index: недельные данные - последний год



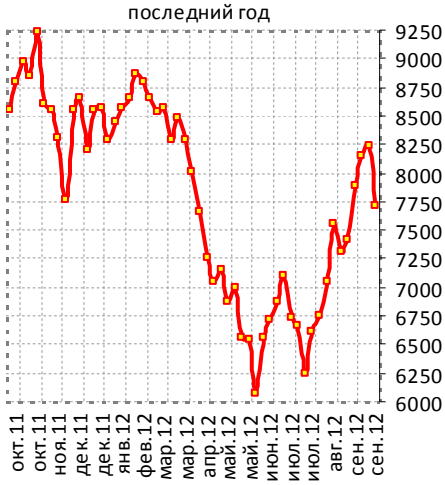
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



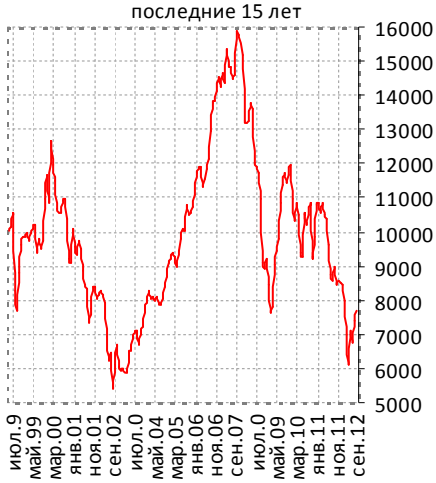
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



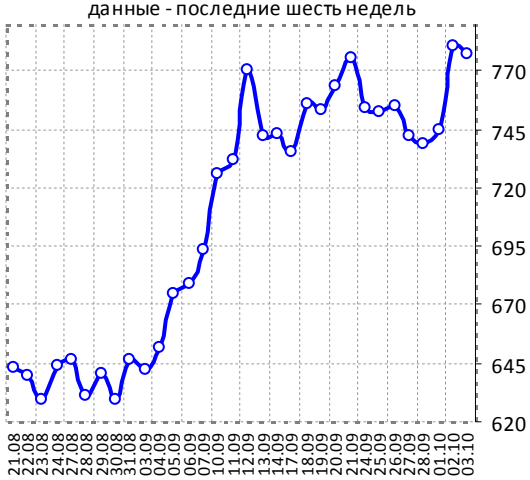
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



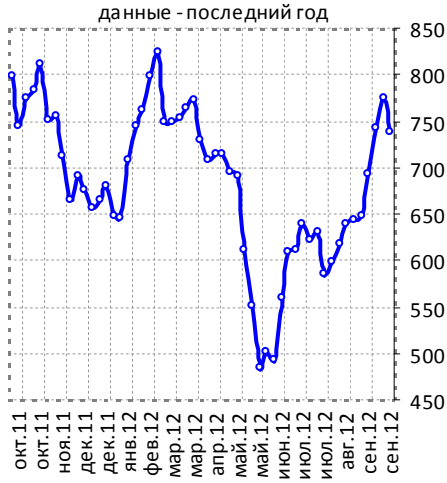
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



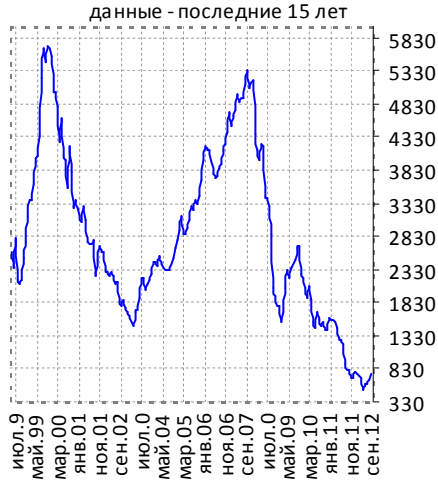
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



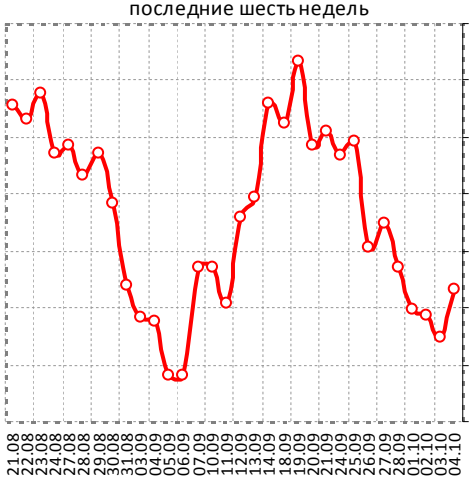
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



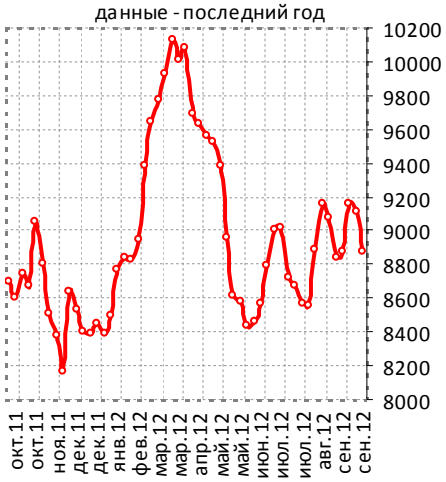
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

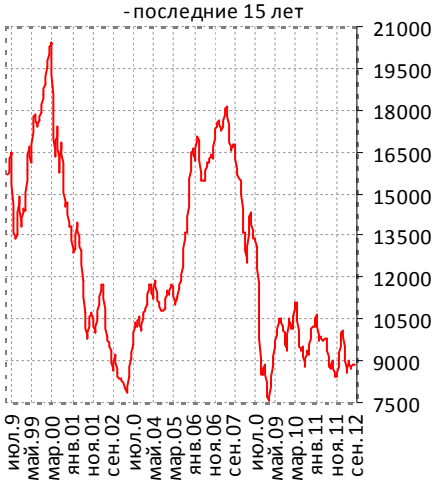
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



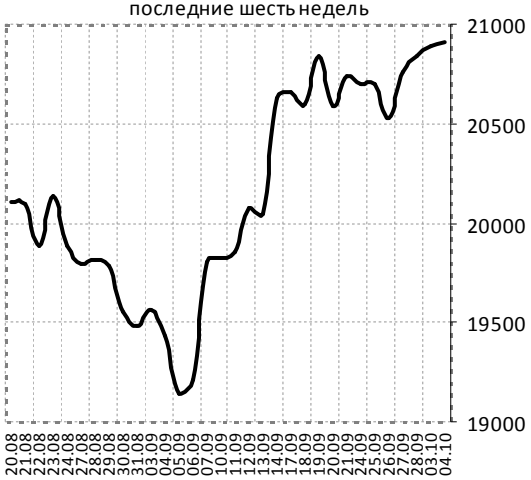
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



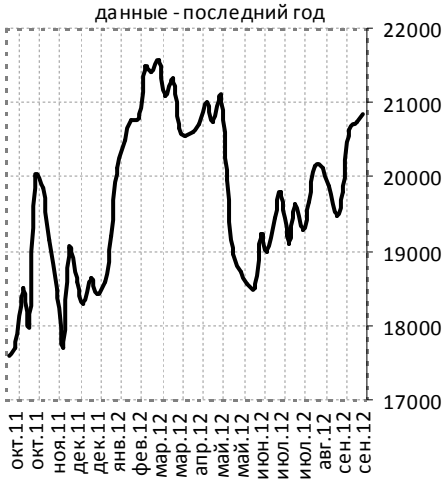
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



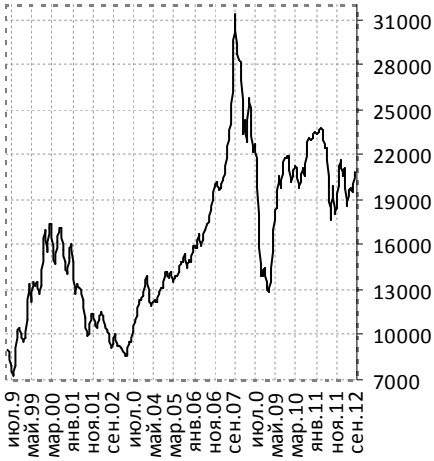
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



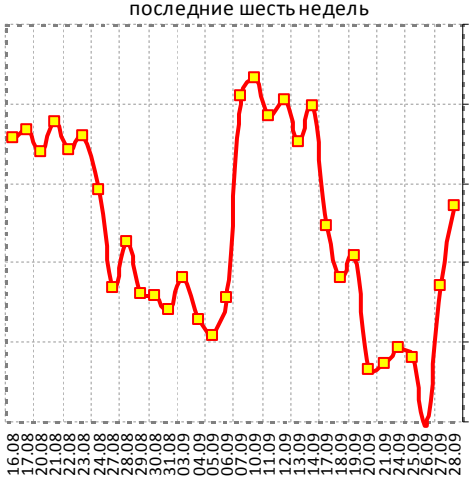
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



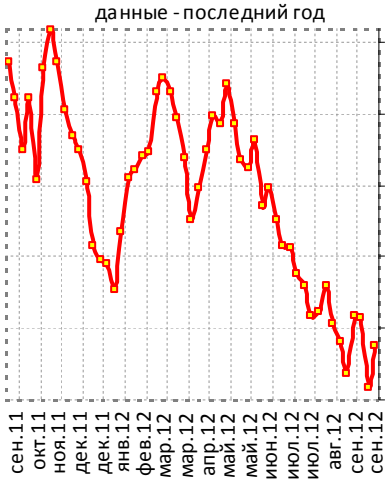
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



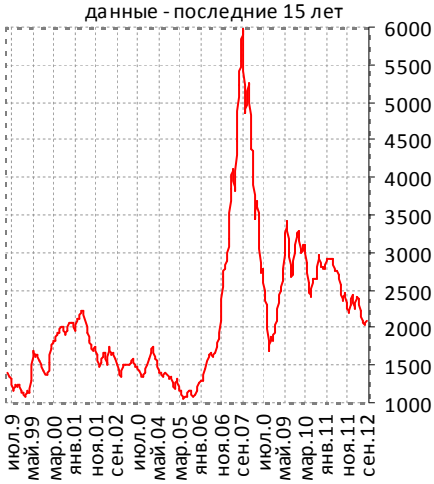
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



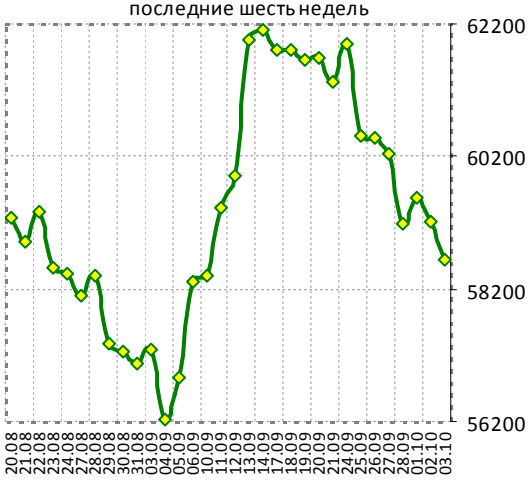
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



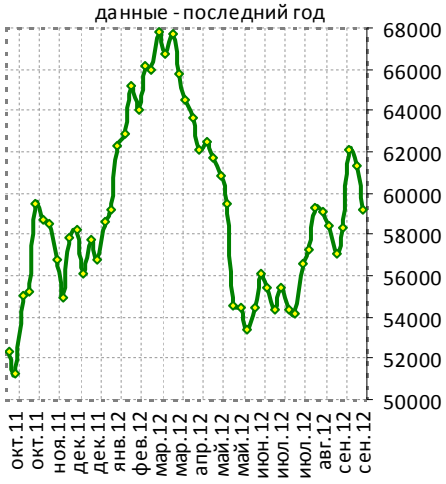
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

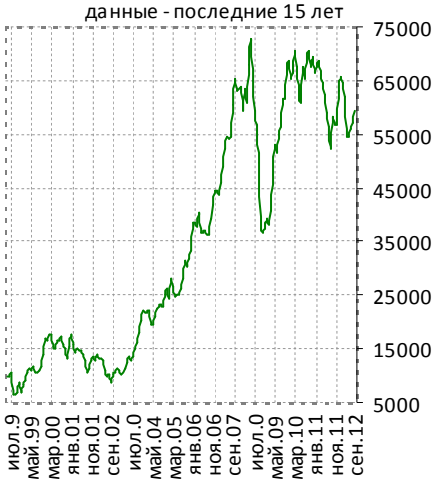
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



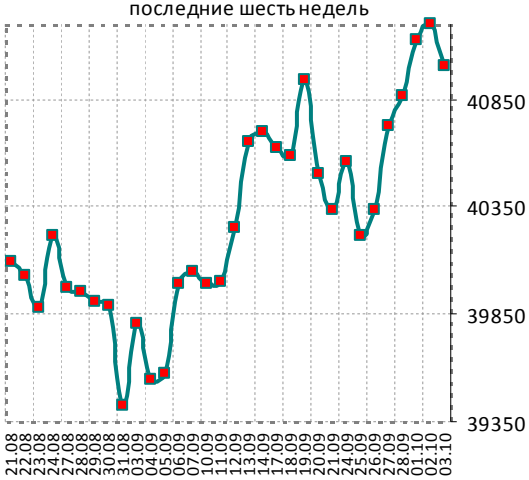
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



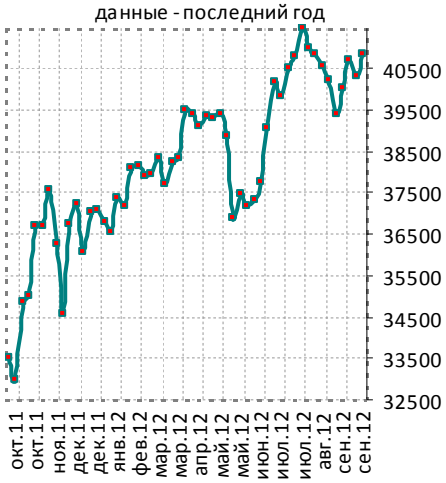
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



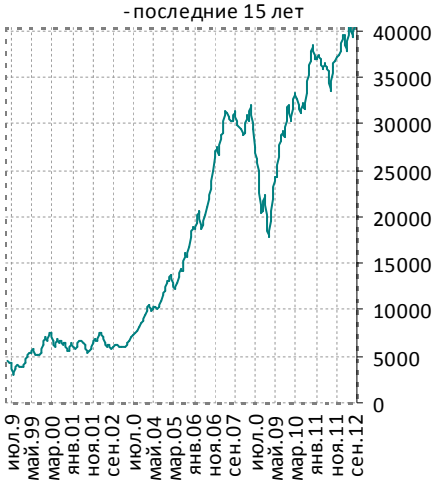
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



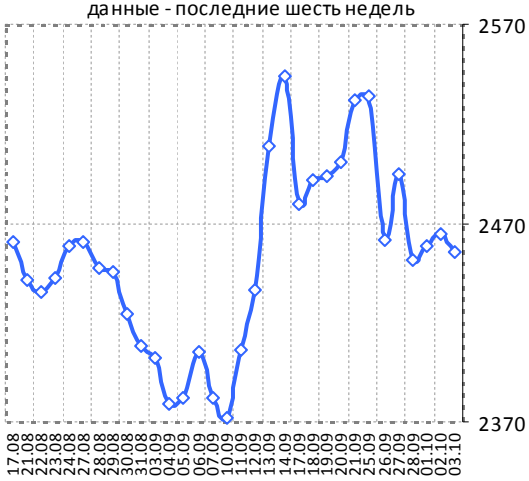
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



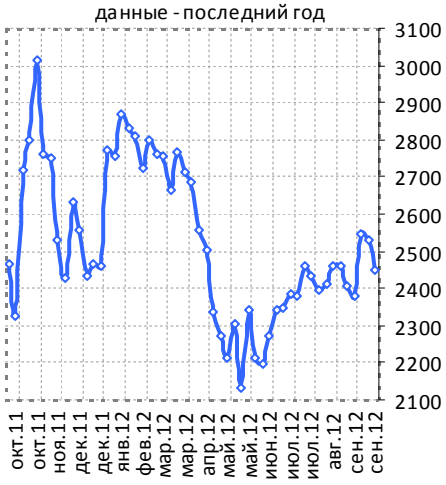
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



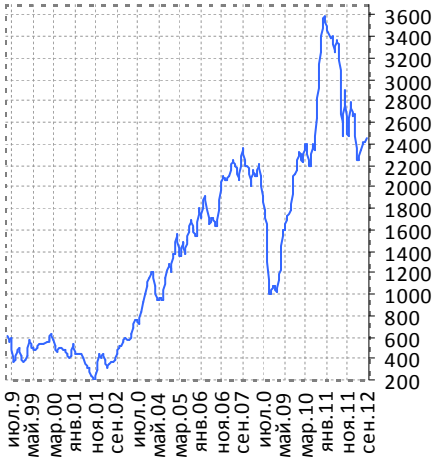
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

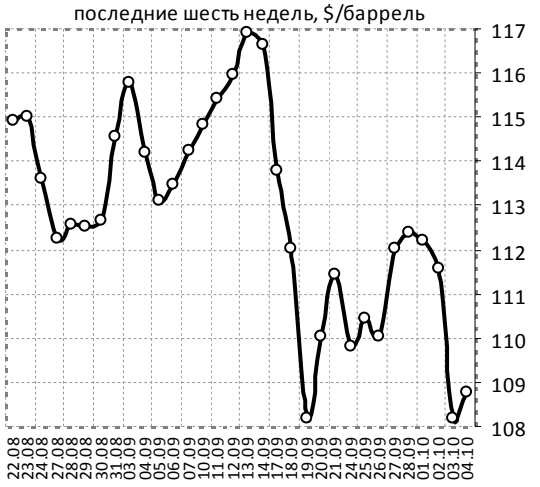


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

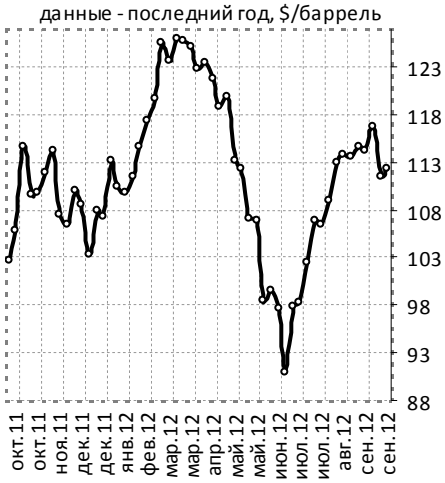
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

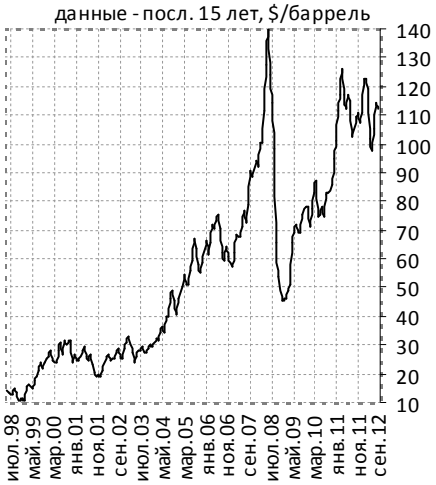
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



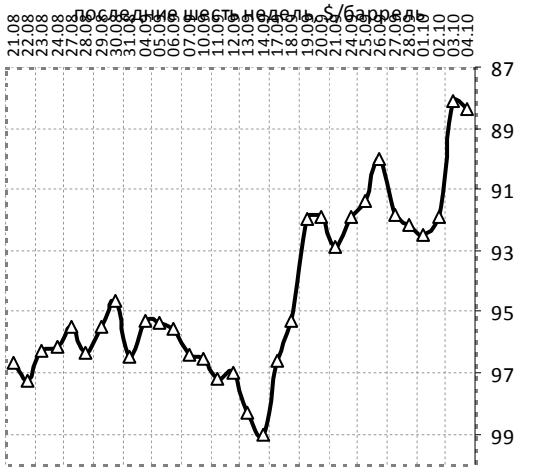
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



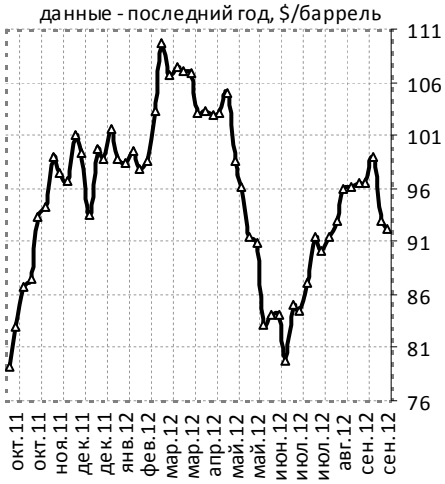
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



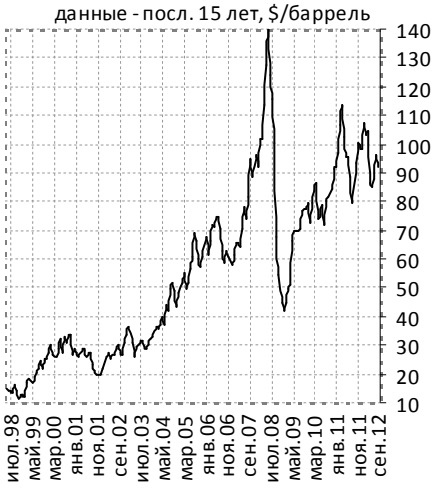
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



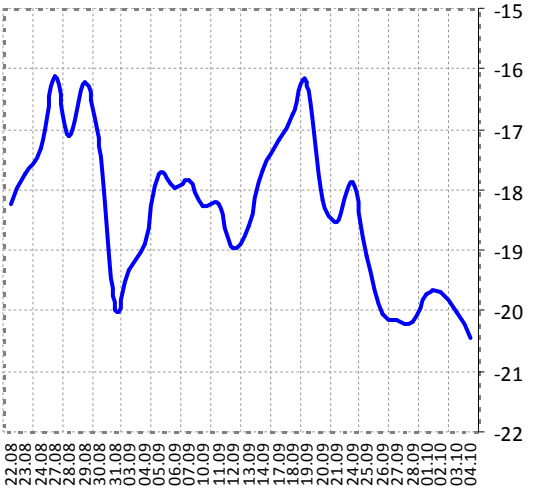
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



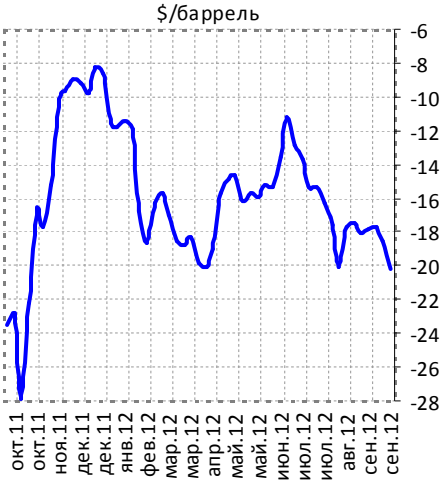
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



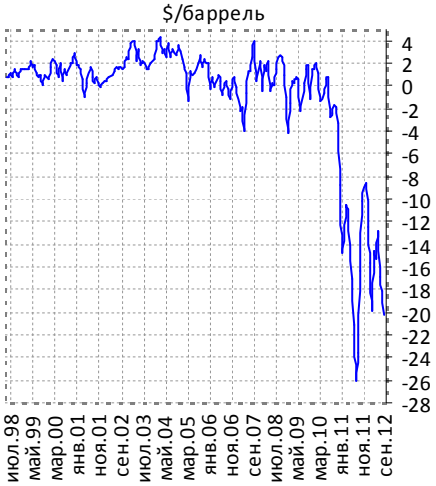
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



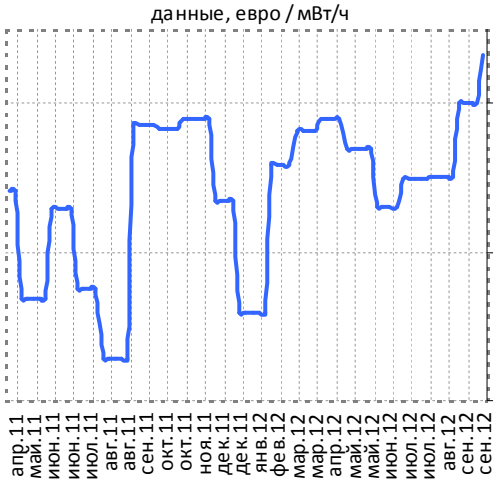
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



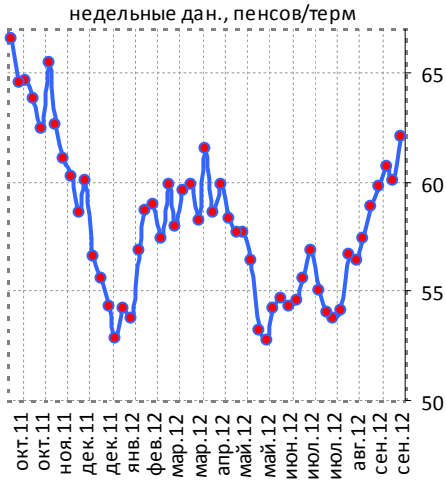
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

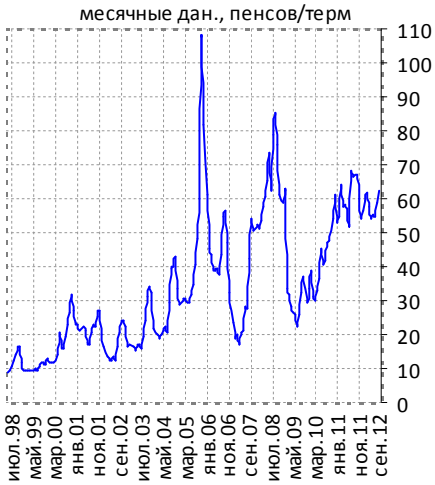
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



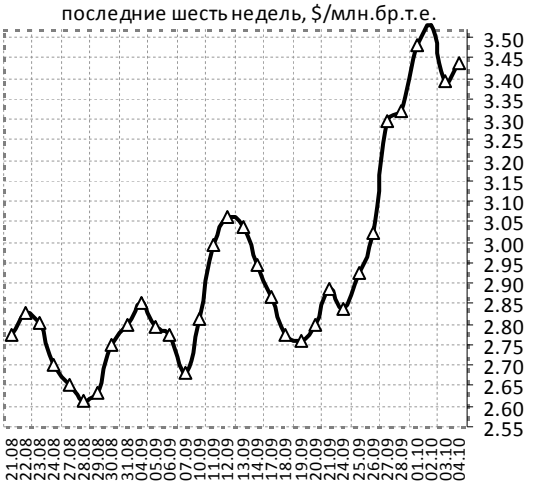
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



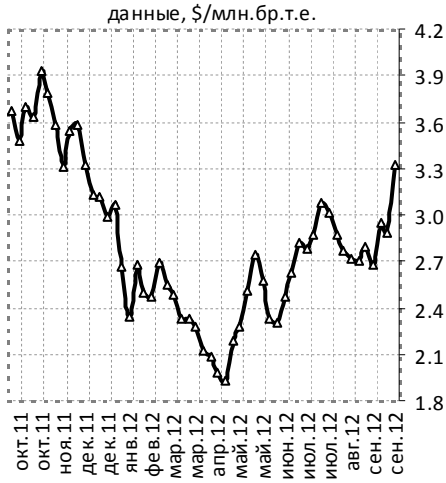
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



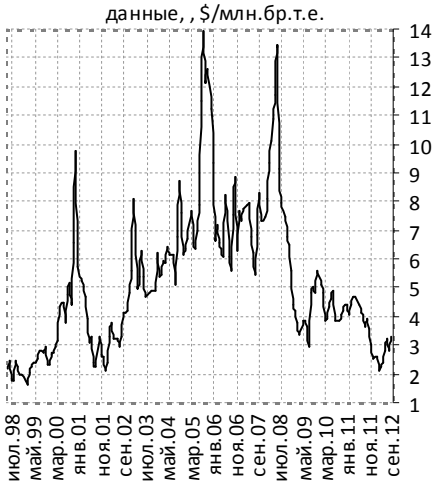
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



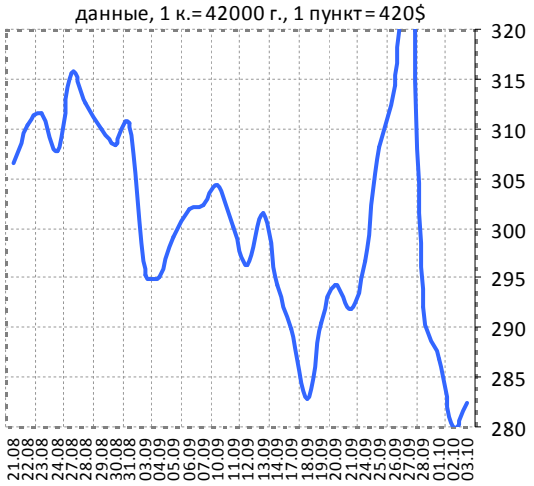
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



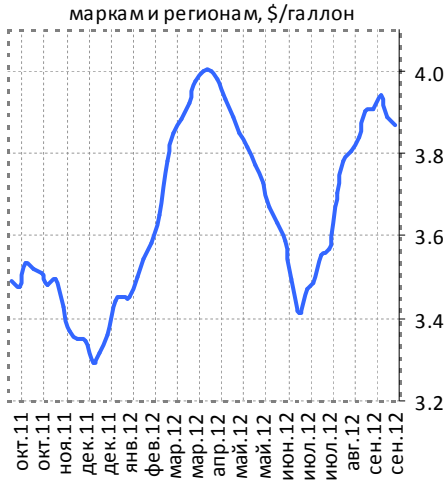
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



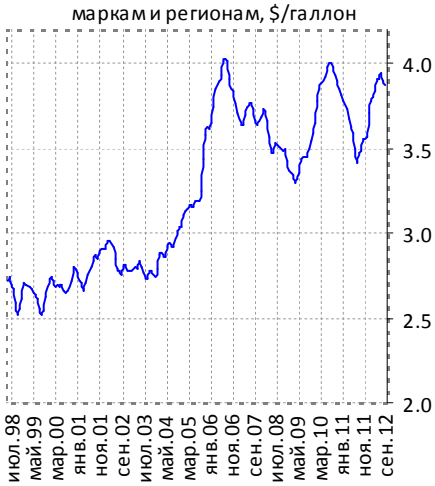
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



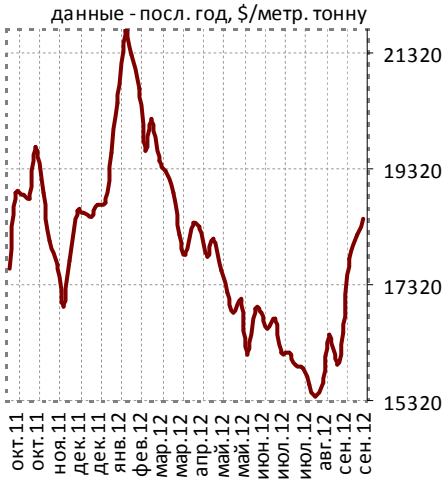
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

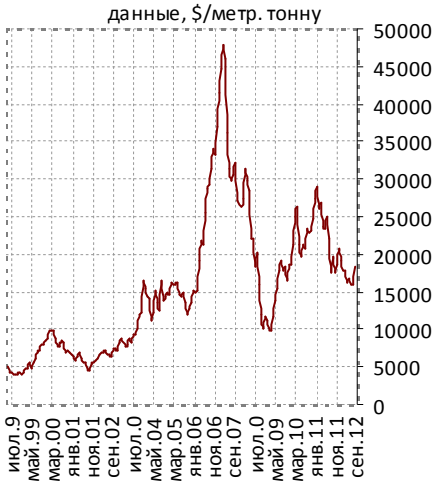
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



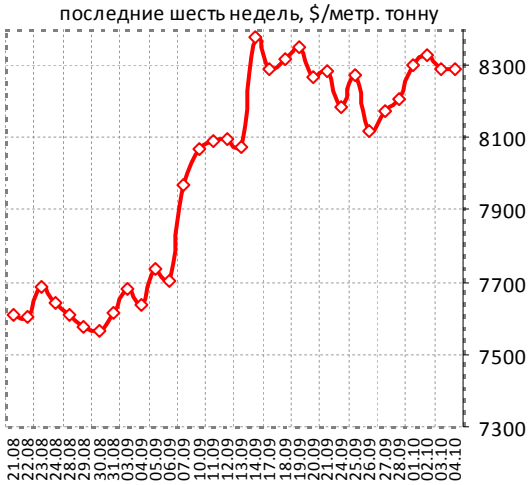
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



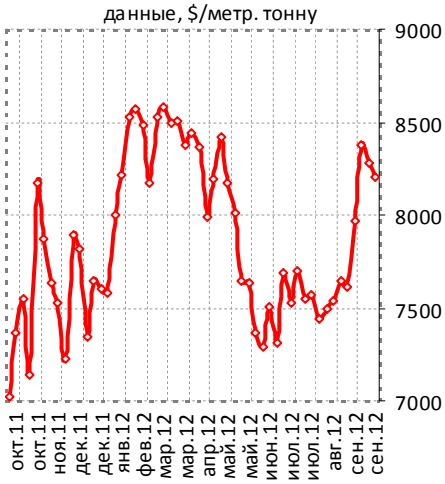
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



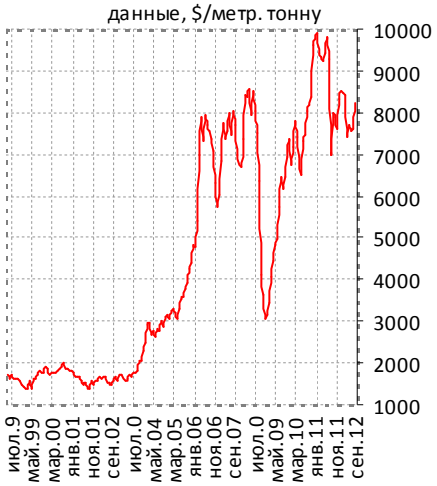
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



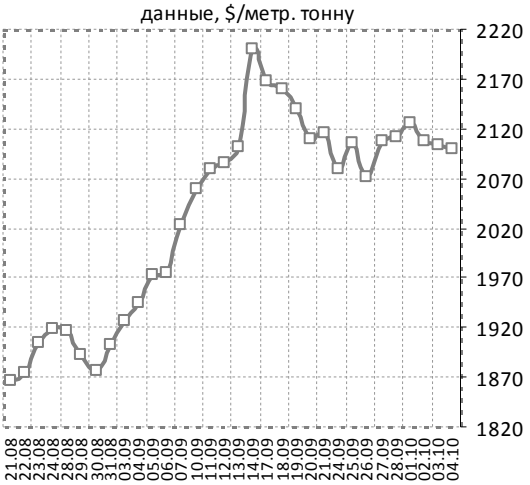
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



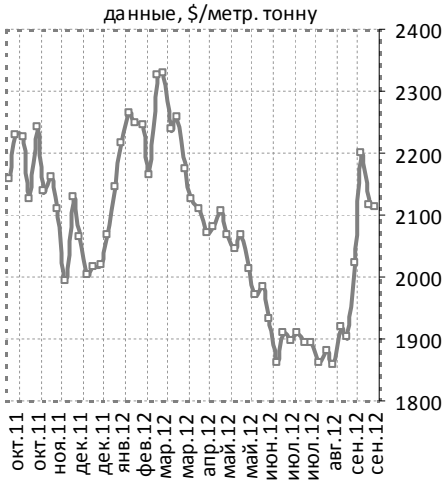
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



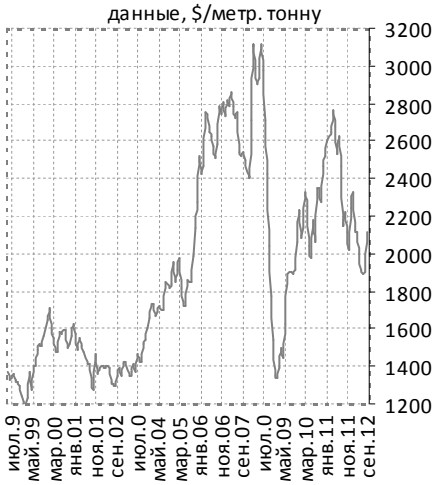
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.