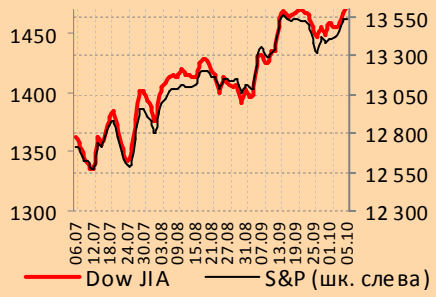
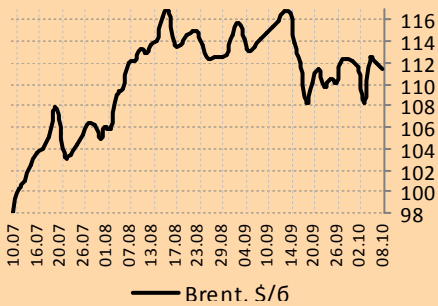
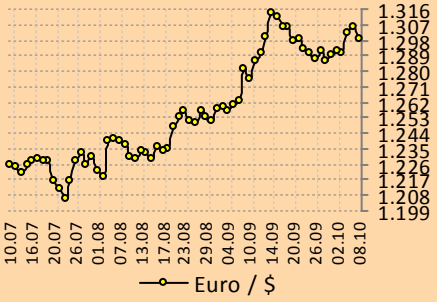
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

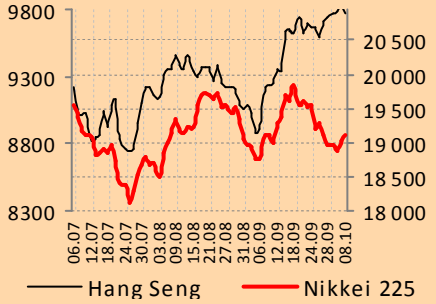
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

Ежедневный обзор

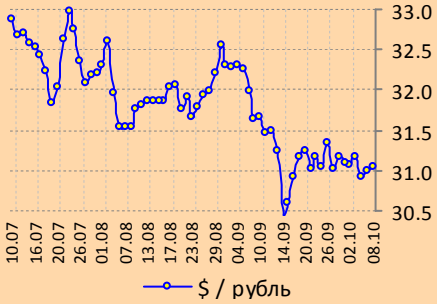






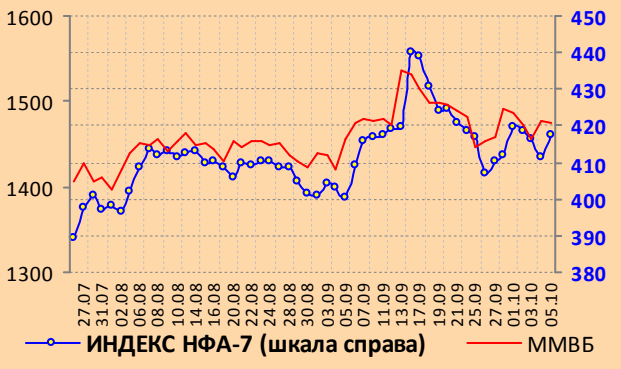






СОДЕРЖАНИЕ

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. Растет объем потребкредитования, за месяц на 18,12 млрд. долл., что превысило ожидания более чем в 2 раза. Последняя статистика по безработице тоже казалась самой что ни на есть благоприятной, а именно - ее уровень по сравнению с показателем предыдущего месяца снизился с 8,2 до 7,8% при том, что ожидания были в размере 8,2%. Но статистика безработицы вызвала недоверие, поскольку столь масштабный позитив не согласовывался с явно недостаточным ростом занятых в производстве (114 тыс.). Возможно, свою роль сыграло различие методик получения статданных, так, информация о количестве рабочих мест представляется предприятиями, тогда как уровень безработицы рассчитывается по результатам обследования домохозяйств и учитывает только лиц, желающих найти работу. Несмотря на позитивную тенденцию рынка занятости, инвесторы оценили уровень безработицы все еще достаточно высоким, а рост занятых в производстве (114 тыс.) недостаточным, к тому же, и объем промзаказов за месяц снизился на 5,2% по сравнению с предыдущим месяцем (хотя это и меньше, чем ожидалось, -5,9%). Динамика промзаказов действительно является одним из важных комплексных индикаторов перспектив экономики, учитывает заказы на товары и кратковременного (продукты питания, одежда, товары легкой промышленности), и длительного (автомобили, мебель и другие) пользования. В дополнение к неоднозначному восприятию статистики, инвесторы уже настраивались на начало очередного сезона корпоративной отчетности, который, как ожидается, может быть разочаровывающим. В условиях замедления глобальной экономики вполне ожидаемо не только ухудшение финансовых результатов корпораций, но и пересмотр ими прогнозов по прибыли в сторону понижения. Так что неудивительно, что в результате торгов Dow Jones =+0,26, S&P 500 =-0,03, Nasdaq Composite =-0,42%. Сегодня отмечается федеральный праздник, День Колумба, банки и долговые рынки будут закрыты, но торги акциями состоятся.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, по итогам торговой сессии в пятницу индексы выросли, ММВБ на 1,43, РТС на 1,73%. Из новостей отметим, что ЦБ сохранил ставку рефинансирования на прежнем уровне, 8,25%. Мы на это и надеялись, учитывая, что эффект повышения уже не успеет отразиться на инфляции текущего года, но может повлиять на снижение экономического роста. Инфляция с начала года составила 5,2%, в годовом выражении 6,6%. Средние потребительские цены на бензин в январе-августе по сравнению с аналогичным периодом прошлого года увеличились на 8,3%, как видим, более чем в полтора раза превысив инфляцию.

Европа. Биржевые торги последнего дня недели завершились ростом, FTSE=+0,0, DAX =+1,27, CAC=+1,64%. Позитив торгов в основном был вызван готовностью ЕЦБ, в случае необходимости, начать обещанную покупку гособлигаций при выполнении странами определенных условий. Между тем, объем промзаказов в Германии за месяц снизился на 1,3% при ожиданиях снижения в гораздо меньшем размере (на 0,5%). Появилась информация, что Кипр обратится за финансовой помощью к ЕС в размере 14 млрд. долл. Из позитива - профицит счета текущих операций платежного баланса Испании составил 0,5 млрд. евро по сравнению с дефицитом в 0,3 млрд. евро месяцем ранее.

Азия. На положительном завершении торгов США биржи пятницы также закрылись в плюсе, Nikkei увеличился на 0,44, Kospi на 0,12, Hang Seng на 0,50%. Торги в материковом Китае не проводились в связи с продолжением празднования Дня образования КНР. Банк Японии по итогам заседания, как и ожидалось, сохранил ключевую процентную ставку на прежнем уровне от 0 до 0,1% и отметил, что негативные процессы в мировой экономике могут стать основанием для смягчения монетарной политики уже на следующем заседании 30 октября. Повысился индекс делового доверия в малом бизнесе Японии (с 44,8 до 45,1 пунктов). Toyota Motor сообщил о значительном снижении продаж в Китае, причина обусловлена территориальными разногласиями между странами относительно 5 островов.

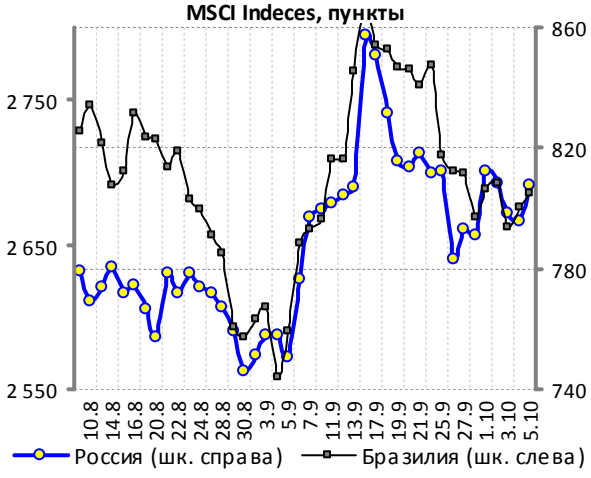
Золото. Утром пятницы фьючерсы на золото торговались по 1796, а дальше, под влиянием «минуток» ФРС о снижении рисков инфляционных ожиданий, к 13.30 по 1790,97, к закрытию по 1780,80 долл. за унцию.

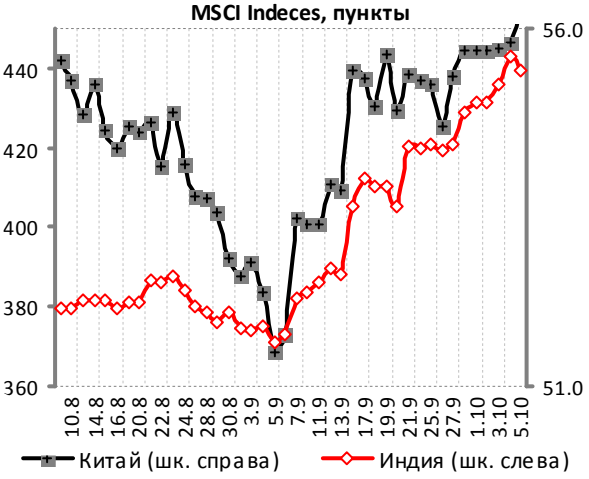
Нефть. Ряд текущих факторов пытался остановить рост цен. На фоне снижения опасений по поводу срыва поставок нефти из ближневосточного региона в связи с сирийско-турецким конфликтом, укрепления доллара и фиксации прибыли, образовавшейся днем ранее, Brent и Light утром пятницы шли по 112,02 и 91,4, к 13.30 по 110,80 и 91,27, к закрытию по 112,02 и 89,88 долл. за барр. (Brent все же реагирует на ближневосточный конфликт).

События, статистика, прогноз. Ожидается заседание министров финансов еврозоны (т.н. саммит Еврогруппы), в повестке дня Греция (но доклад кредиторов еще не готов) и бюджет Испании на 2013 г. (после его оценки международными кредиторами страна сможет обратиться за финансовой помощью при необходимости и стремлении к этому властей). На 21 октября в Испании назначены региональные выборы, а 29-31 октября наступает срок погашения госбумаг в сумме 21,3 млрд. евро (крупнейшее погашение в этом году).

Из наиболее важной статистики ждем данные по торговому балансу и объему промпроизводства Германии (соответственно в 10.00 и 14.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия тоже, нефть не растет. Российские биржи, скорее сего, будут следовать общему выжидательному тренду.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 08.10.2012

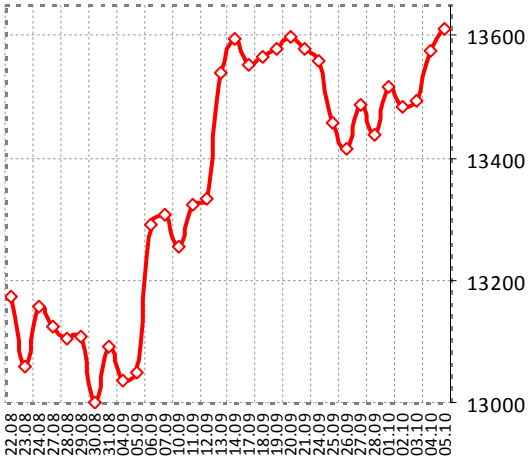




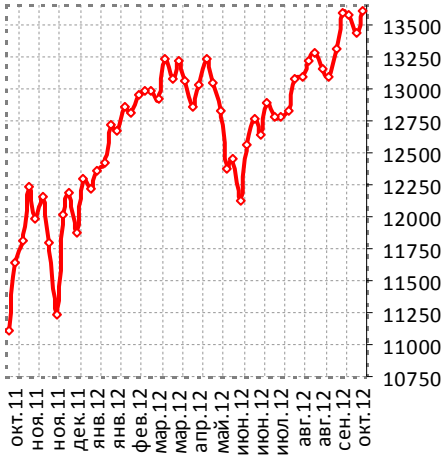
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

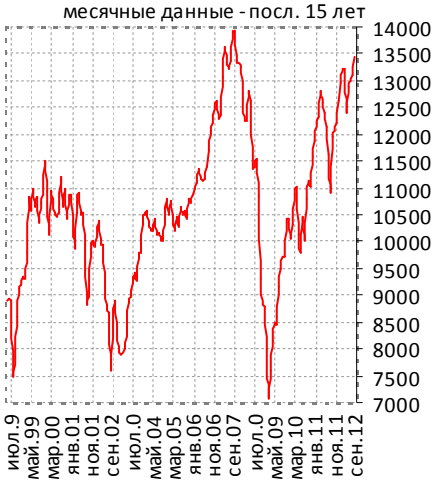
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



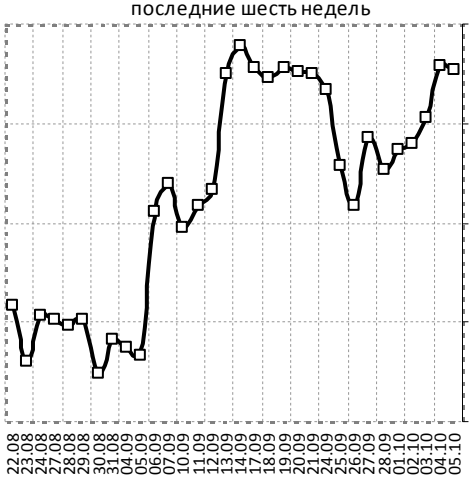
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



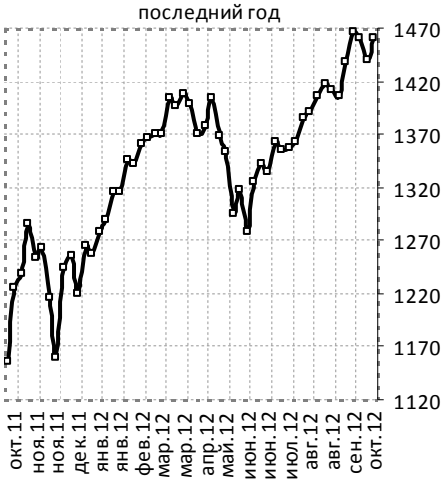
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



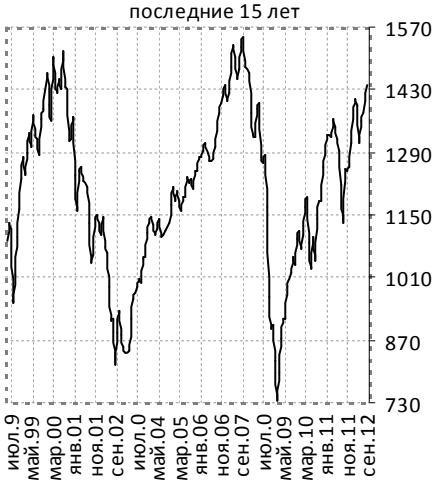
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



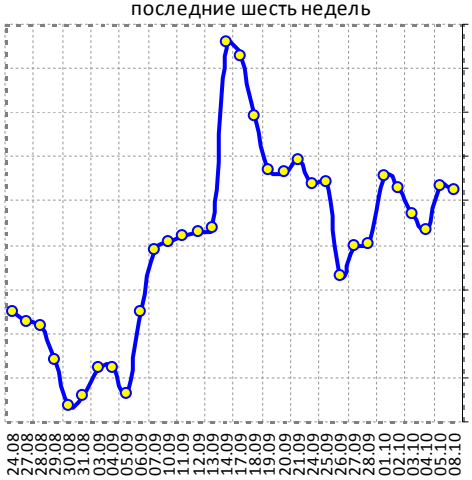
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



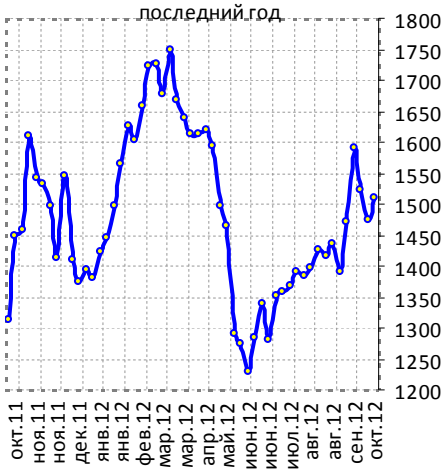
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



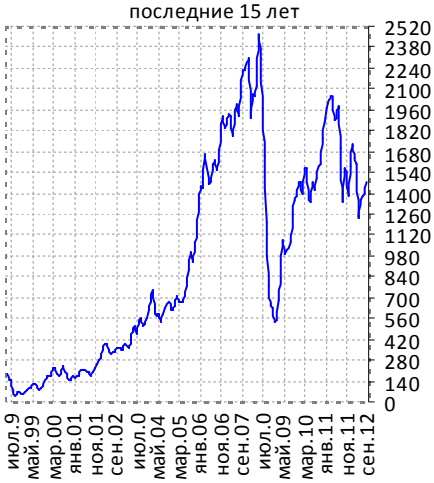
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



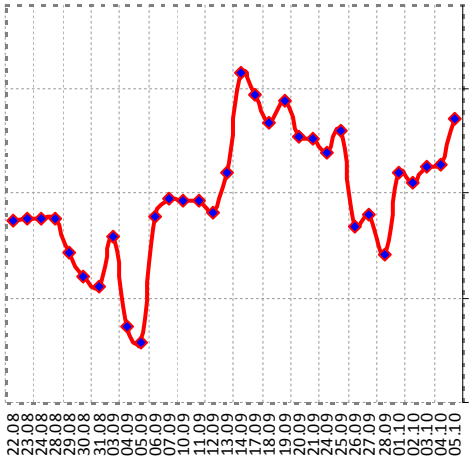
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



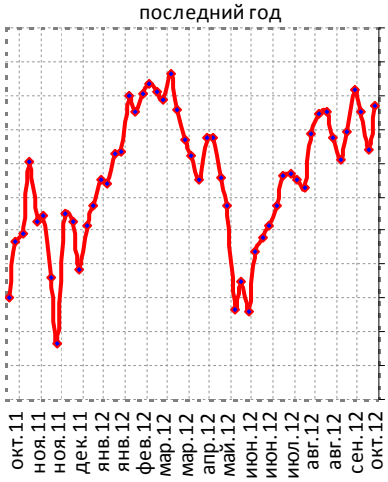
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

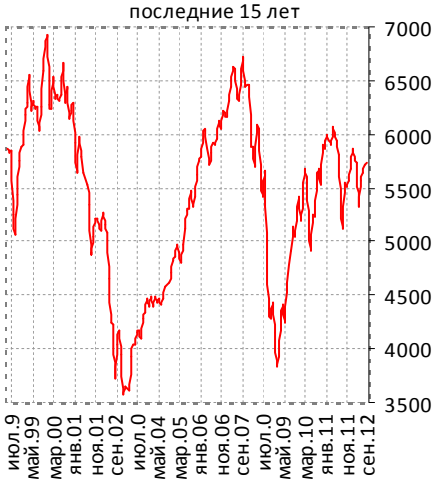
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



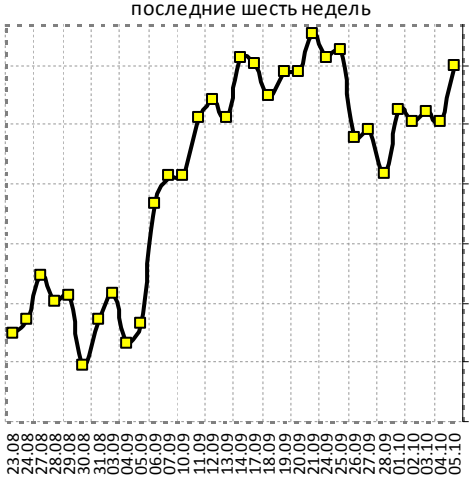
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



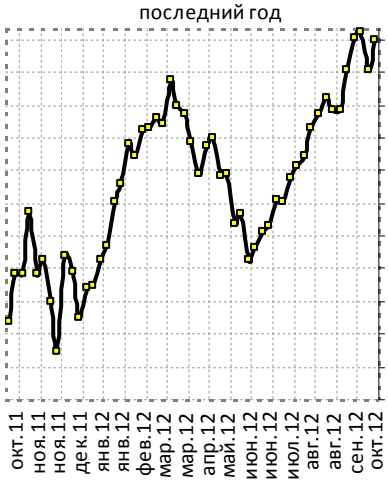
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



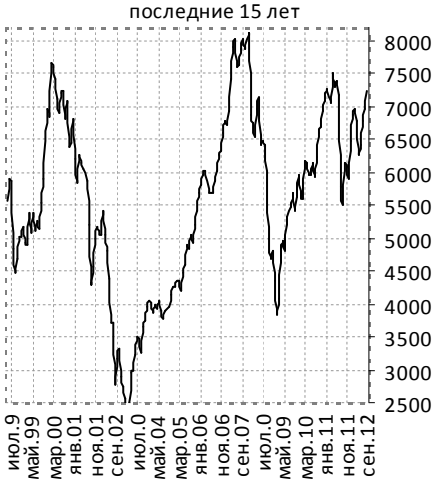
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



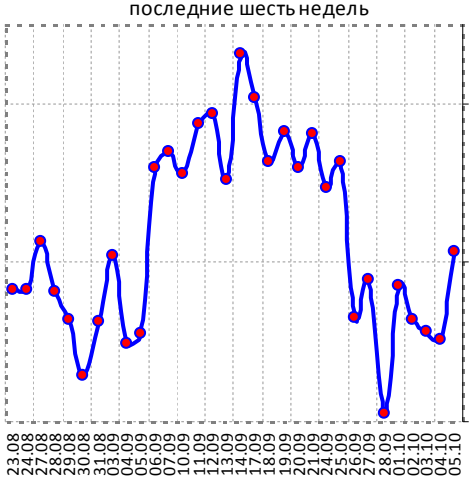
DAX Index: недельные данные - последний год



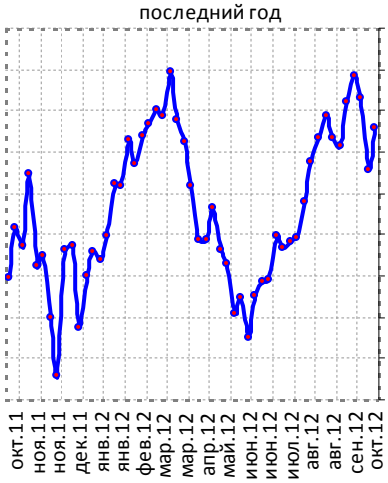
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



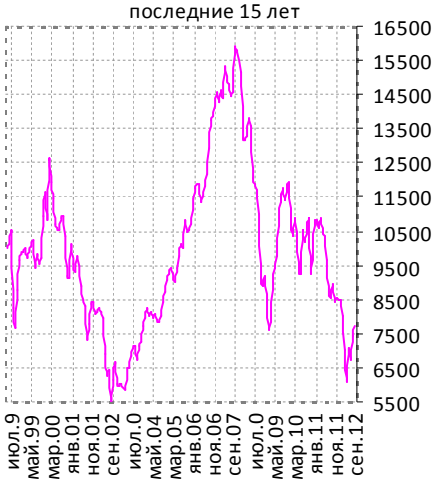
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

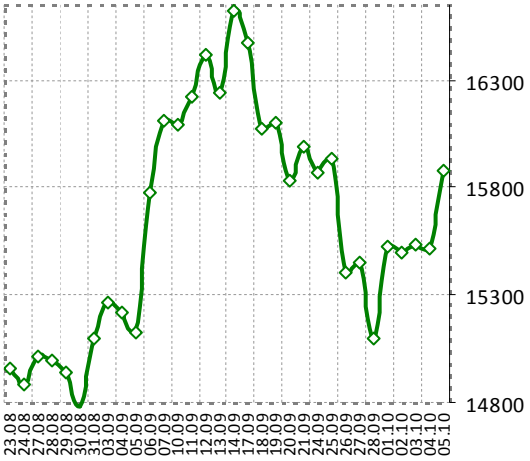


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

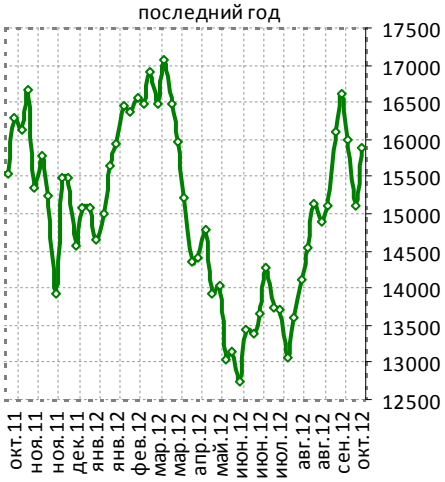


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



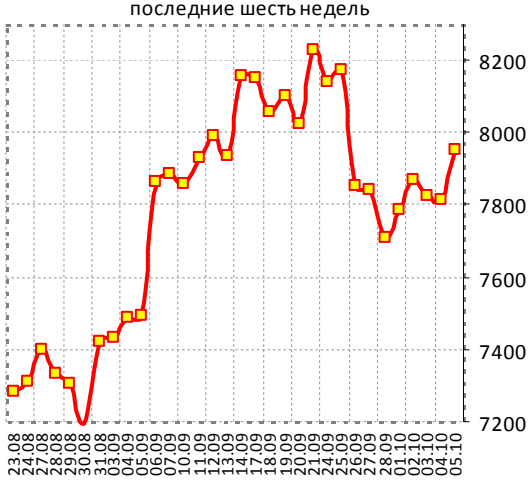
MIB Index: недельные данные - последний год



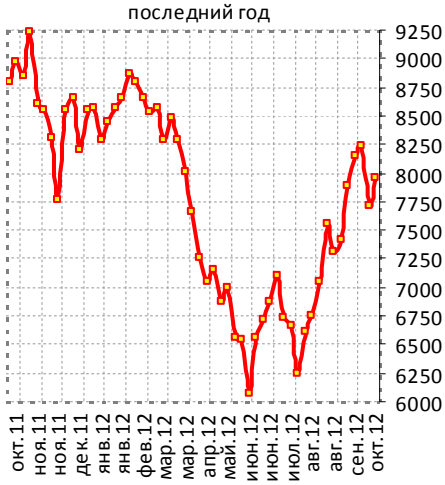
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



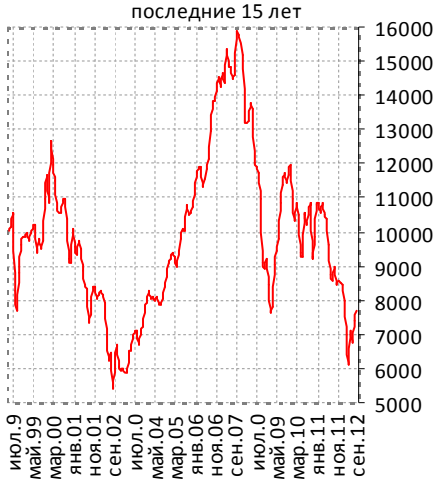
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



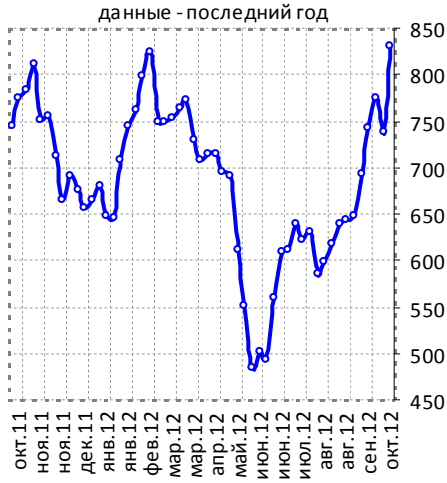
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



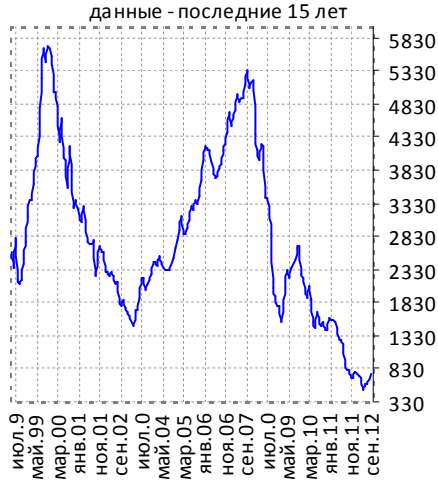
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



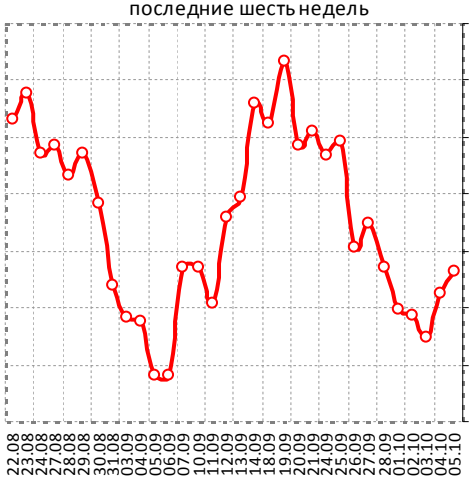
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



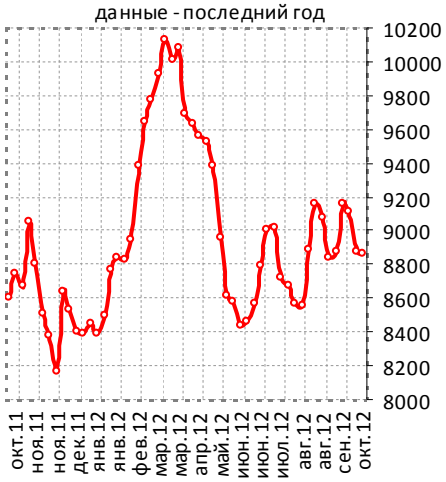
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

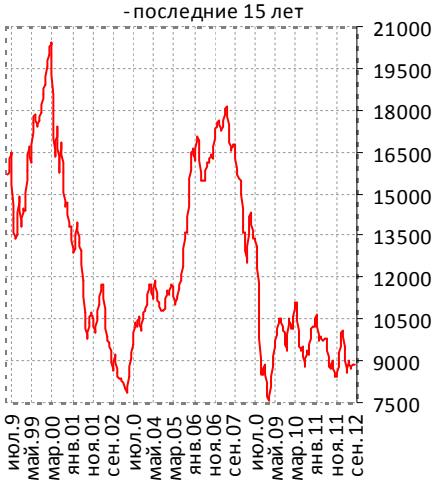
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



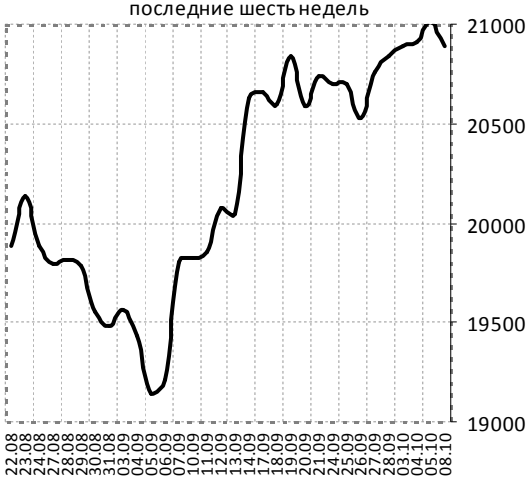
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



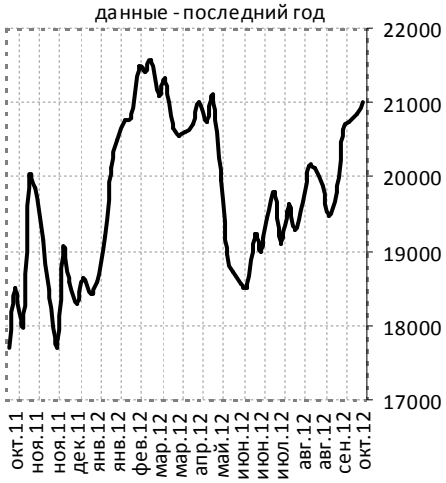
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



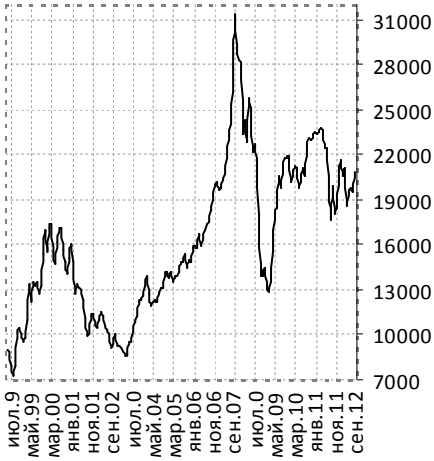
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



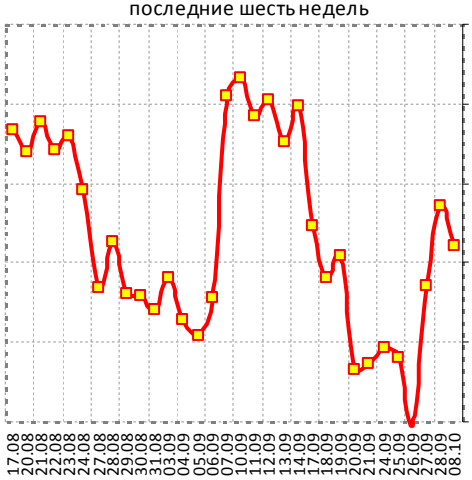
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



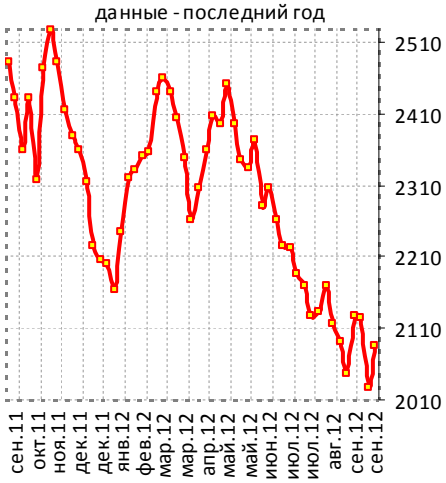
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



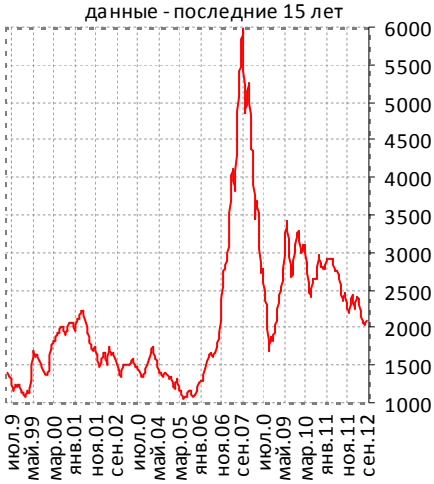
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



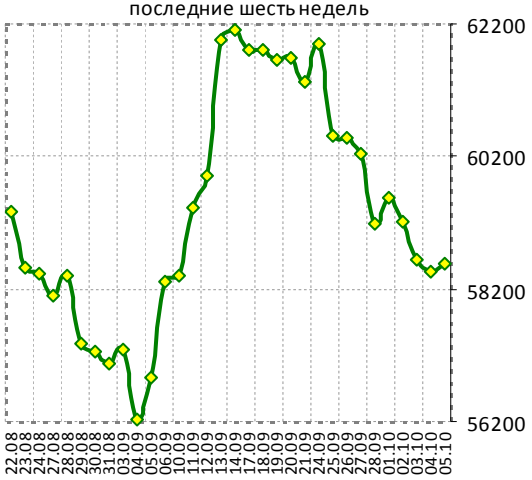
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



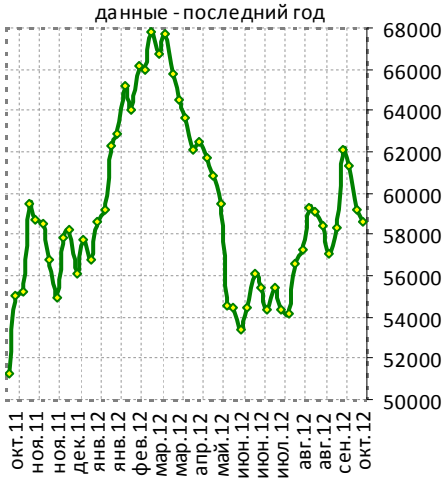
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

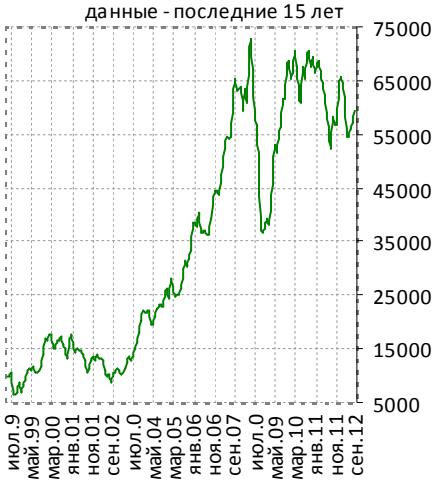
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



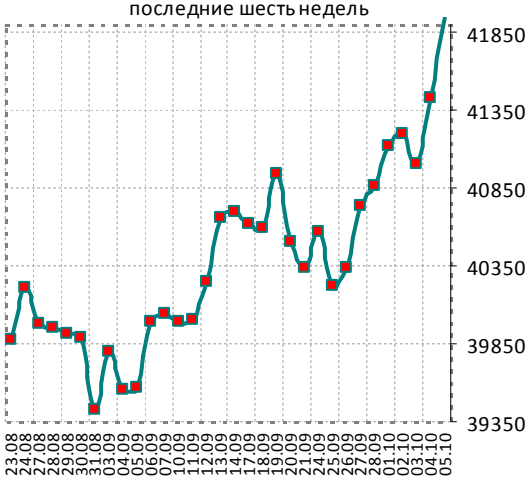
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



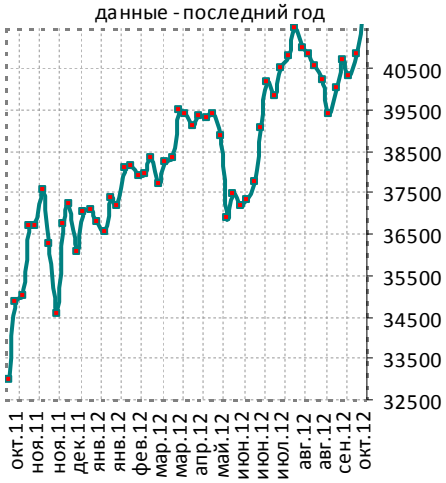
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



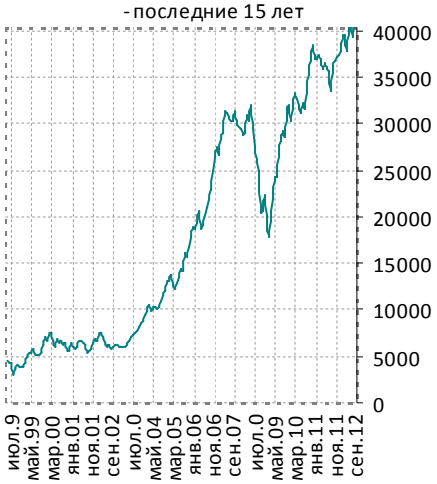
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



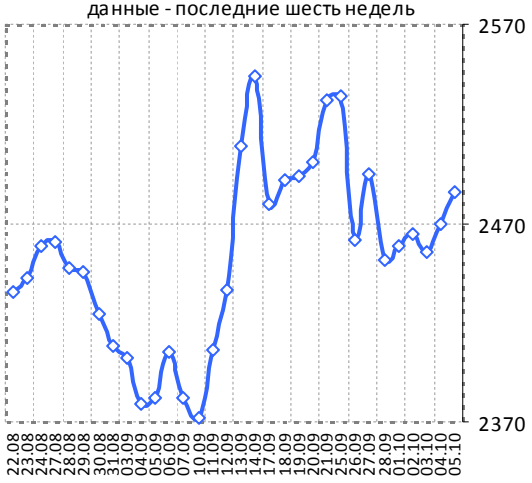
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



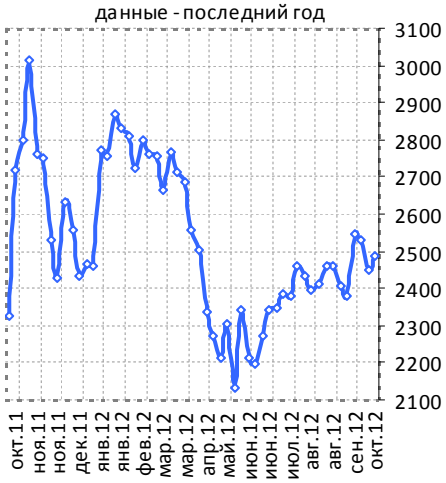
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



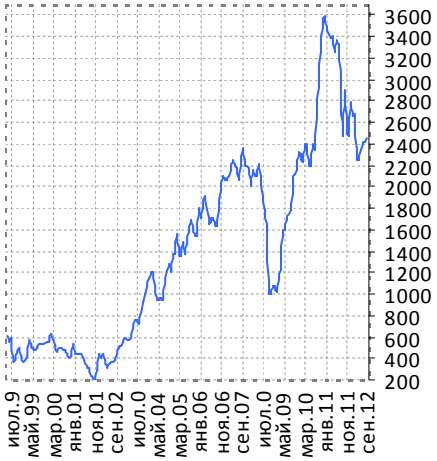
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

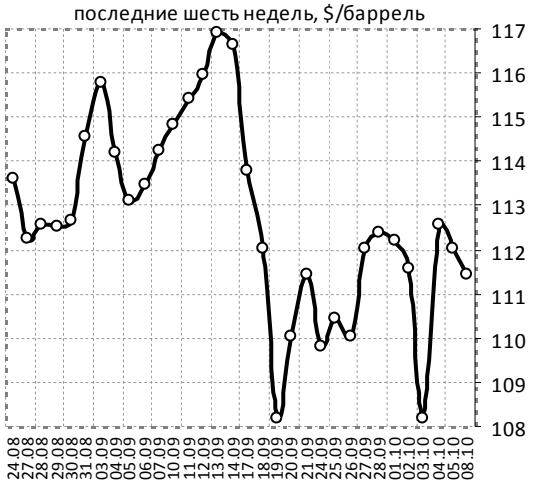


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

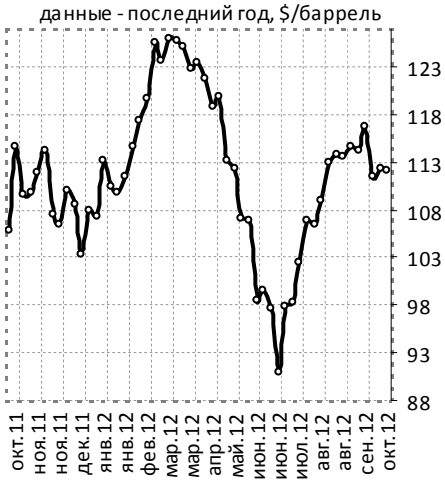
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

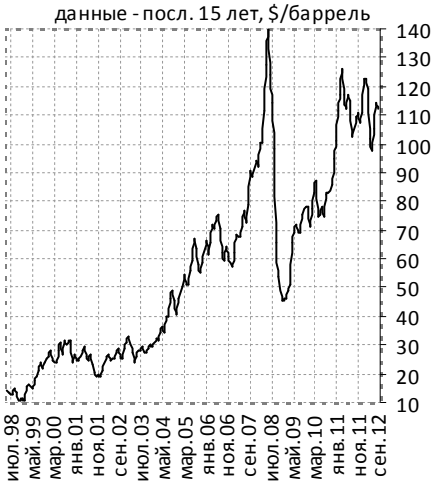
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



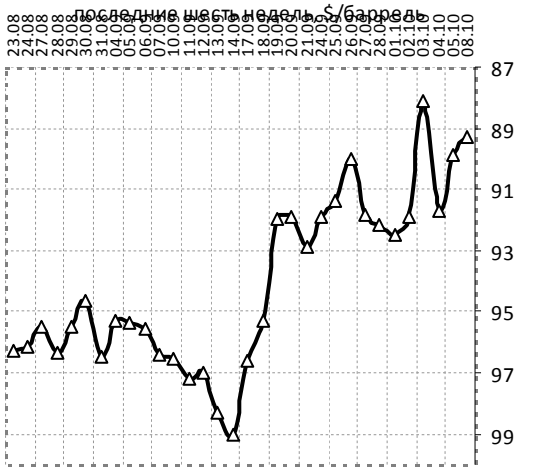
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



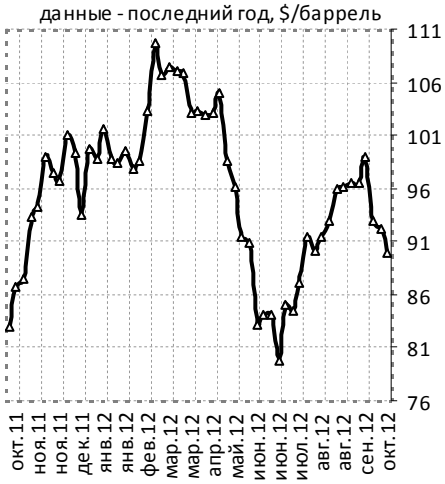
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



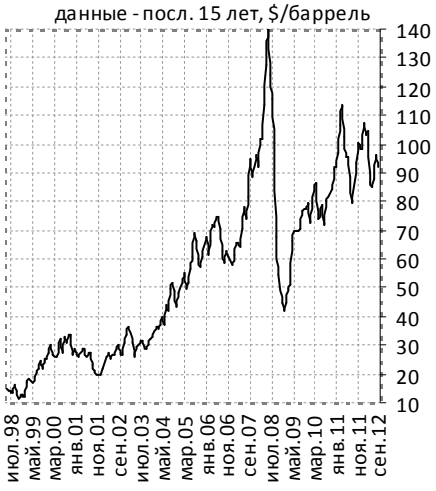
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



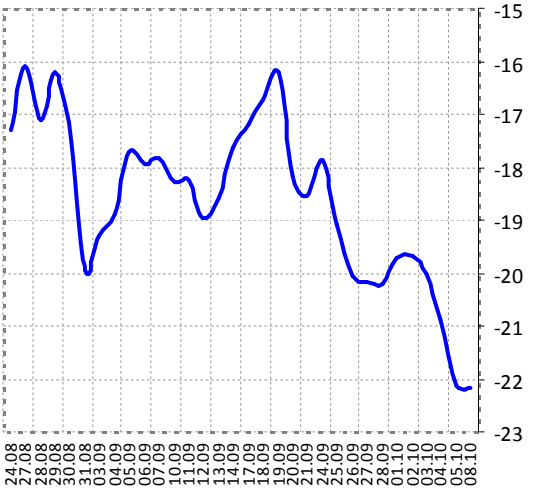
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



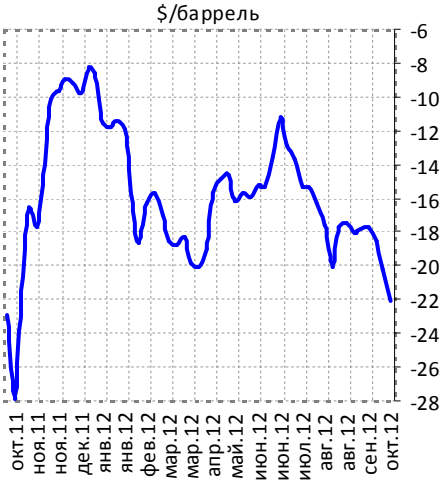
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



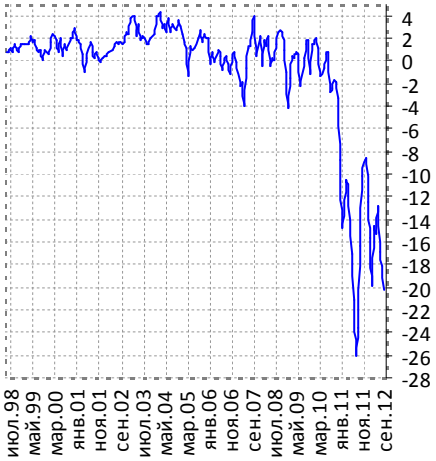
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



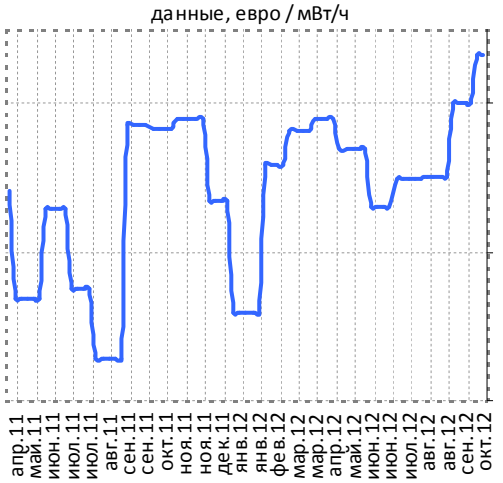
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



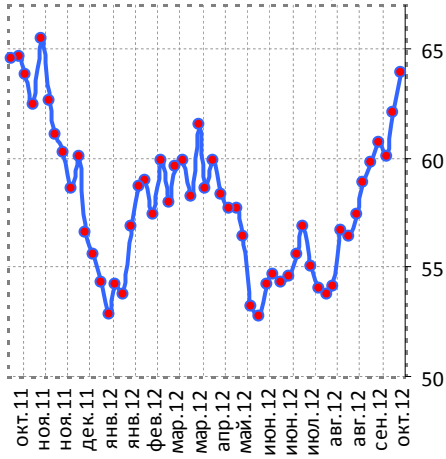
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

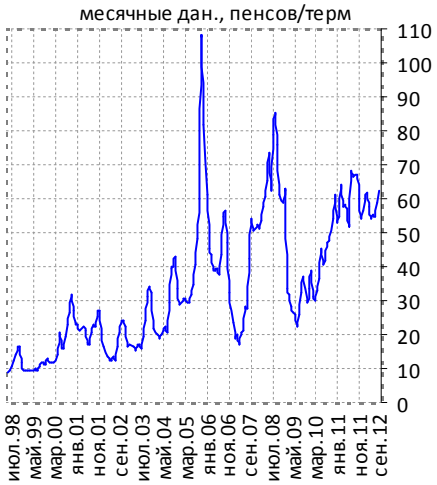
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



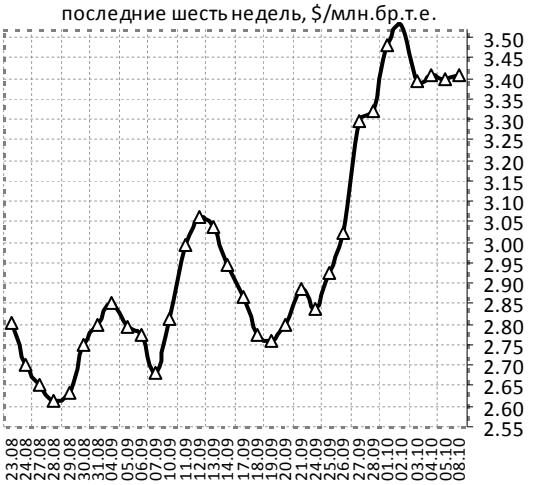
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



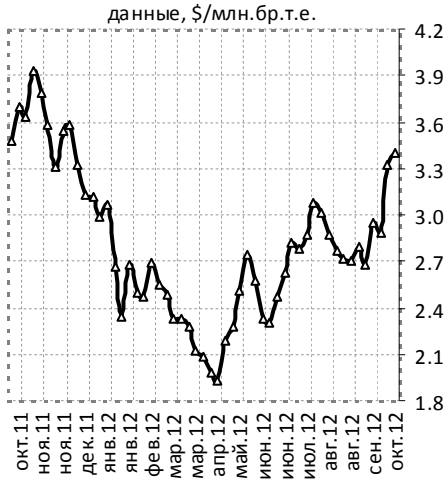
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



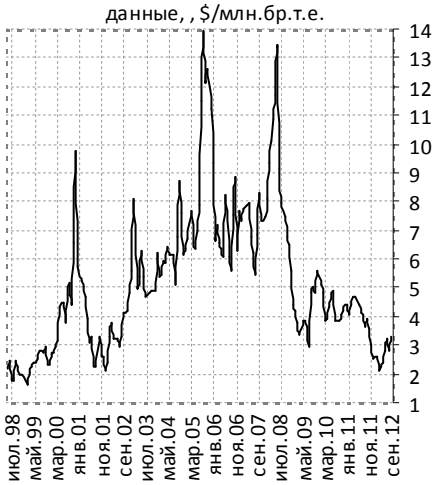
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



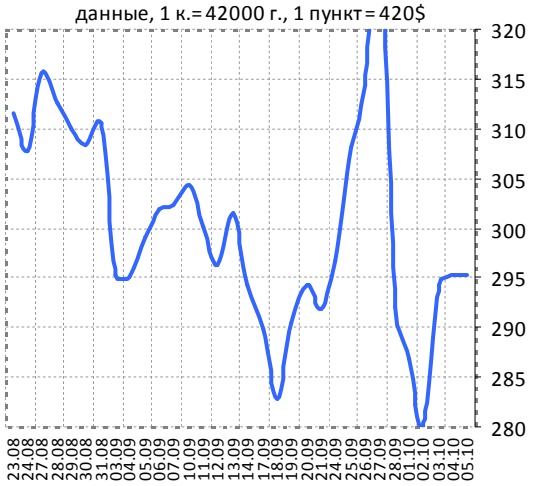
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



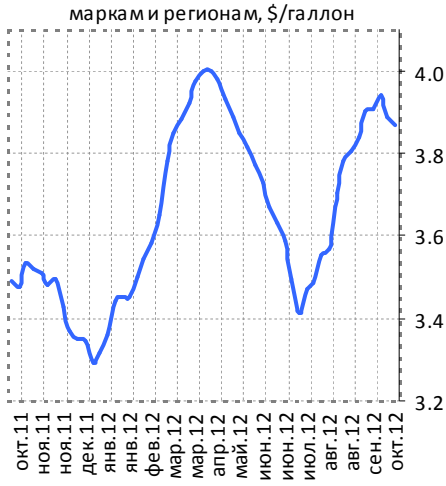
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



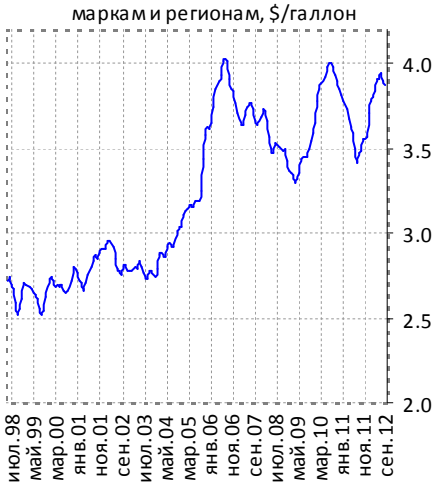
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



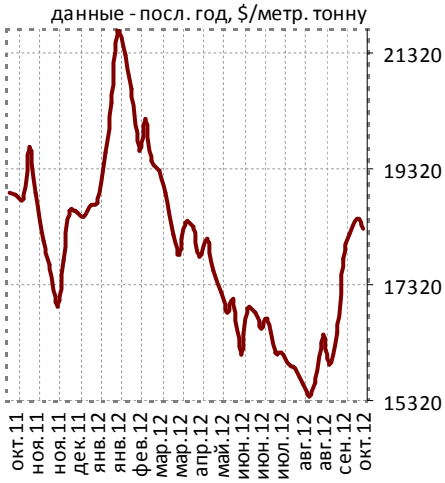
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

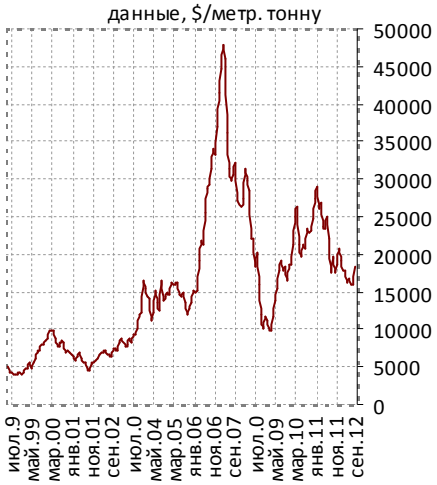
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



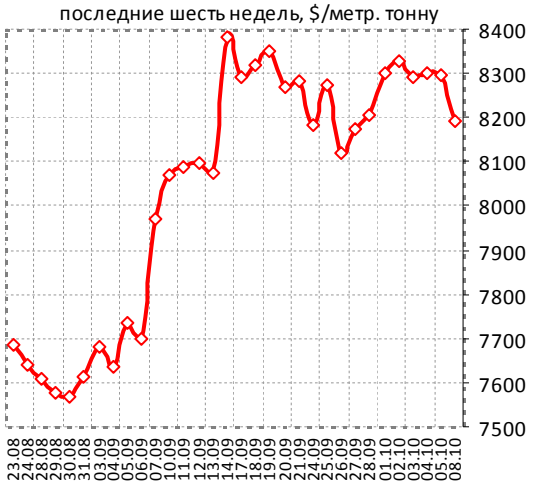
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



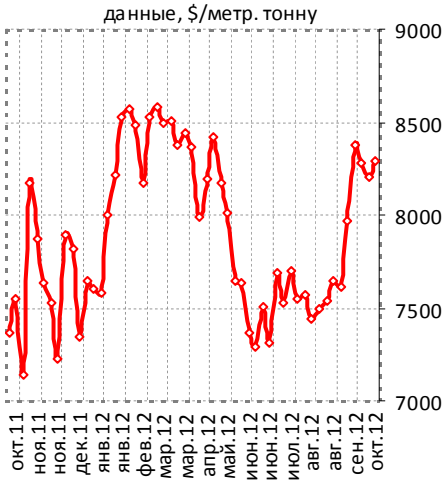
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



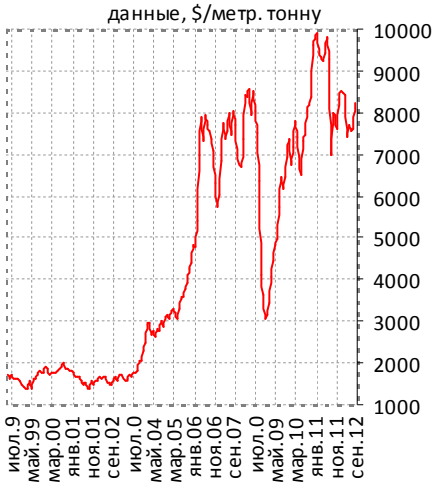
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



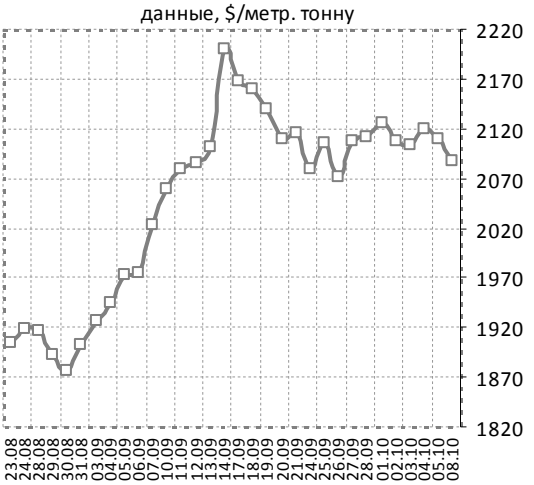
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



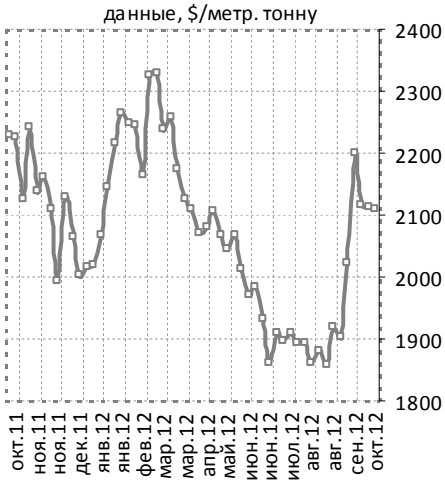
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



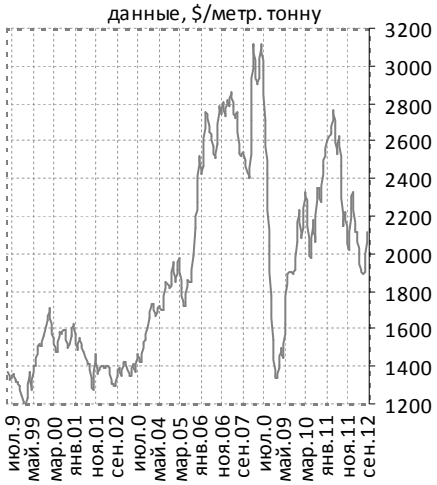
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.