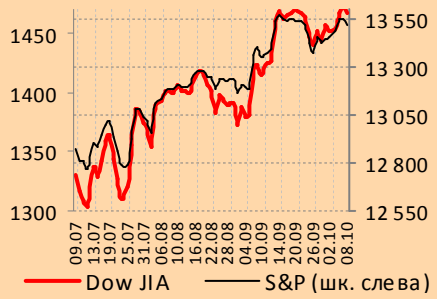
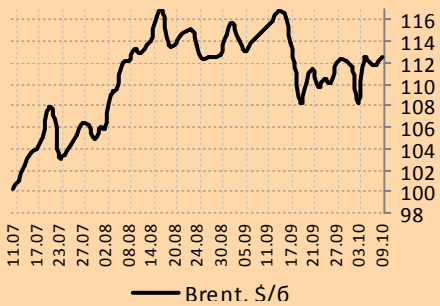
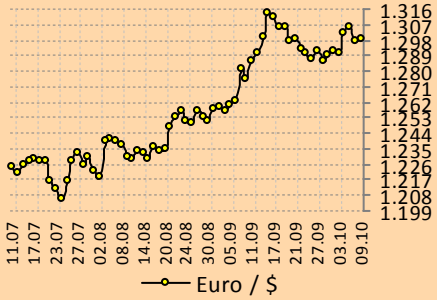
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

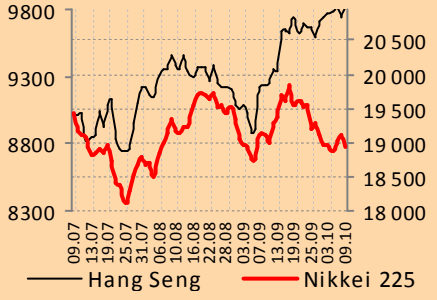
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

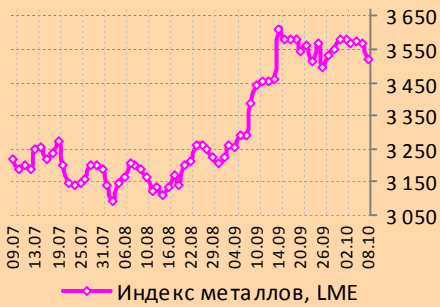
Ежедневный обзор

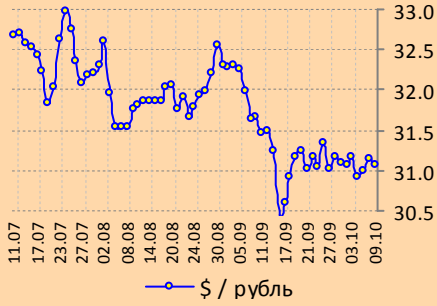






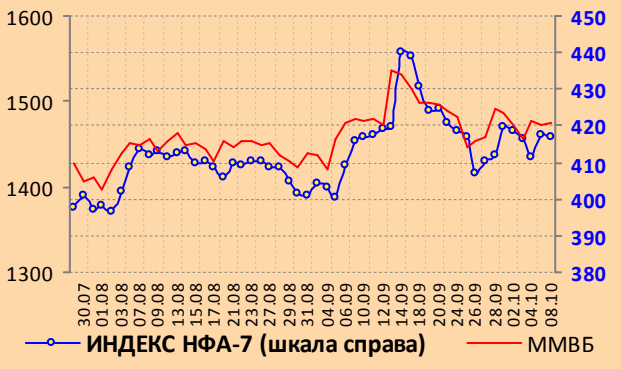






СОДЕРЖАНИЕ

I. Ежедневный комментарий 2
II. Фондовые рынки 3
2.1. Америка & Россия 3
2.2. Европа 4
2.3. Азия 6
2.4. Латинская Америка 7
III. Сырьевые рынки 8
3.1. Нефть 8
3.2. Металлы 10



США. В понедельник отмечался федеральный праздник, День Колумба, банки и долговые рынки не работали, но торги акциями проводились, индекс Dow Jones =-0,19, S&P =-0,35, NASDAQ =-0,76%. Сегодня, уже после закрытия наших бирж, состоится аукцион по размещению трехлетних гособлигаций на сумму 32 млрд. долл., что традиционно отвлечет часть капиталов с рынка акций. После нашего закрытия также будет опубликован финансовый отчет алюминиевой компании Alcoa.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, биржевые индексы по итогам торгов понедельника снизились, ММВБ =-0,27, РТС =-1,07%. Всемирный банк снизил прогноз роста ВВП на текущий год с 3,9 до 3,5%, на следующий с 4,1 до 3,6%. Понижение обосновывается тем, что в России наблюдается снижение темпов экономического роста на фоне ускорения инфляции, падения внутреннего спроса и пассивного внешнего спроса. Казначейство размещает сегодня средства федерального бюджета на банковских депозитах в сумме 38 млрд. руб., минимальная ставка размещения 7,1%, срок 98 дней (возврат 18 января следующего года). В комбанках под проценты уже размещено 557 млрд. руб. бюджетных денег.

Европа. Выжидательная позиция инвесторов привела к снижению биржевых индексов, FTSE 100 =-0,50, DAX =-1,44, CAC 40 =-1,46%. Вчера состоялось первое заседание Совета управляющих постоянного европейского стабмеханизма ESM, которое стало позитивным событием и было расценено инвесторами как продвижение в направлении урегулирования европейского долгового кризиса. Началось также заседание Еврогруппы, по итогам первого дня появилось мнение, что Испания не нуждается в полномасштабной финансовой помощи, предпринимает попытки оживить экономику и успешно привлекает финансирование на рынке. Бюджет Испании на 2013 г. предстоит рассмотреть на заседании группы сегодня.

Избыток наличности в банковской системе еврозоны достиг уровня в 711 млрд. евро. В еврозоне за месяц индекс доверия инвесторов, если можно так сказать, улучшился, повысившись с -23,2 до -22,2 пункта, ожидалось улучшение до -20,8 пункта. В Германии профицит торгового баланса превысил ожидания (соответственно 18,3 и 15,3 млрд. евро), а промпроизводство сократилось на 0,5%, но ожидаемо было еще большее снижение до 0,8%. Moody's понизило рейтинг четырех испанских банков, у которых на балансе есть гособлигации, мотивируя решение тем, что прогнозируемые убытки могут быть возложены на плечи вкладчиков. Агентство не исключило принятия подобных решений и в отношении других испанских банков.

Азия. Площадки Японии в понедельник были закрыты в связи с праздником. Всемирный банк понизил прогноз ВВП ряда стран (не включая Японию и Индию), обосновав свое решение зависимостью их экономик от Китая. На этом фоне биржевые индексы показали снижение, SSE -0,56, Kospi -0,67, Hang Seng -0,89%.

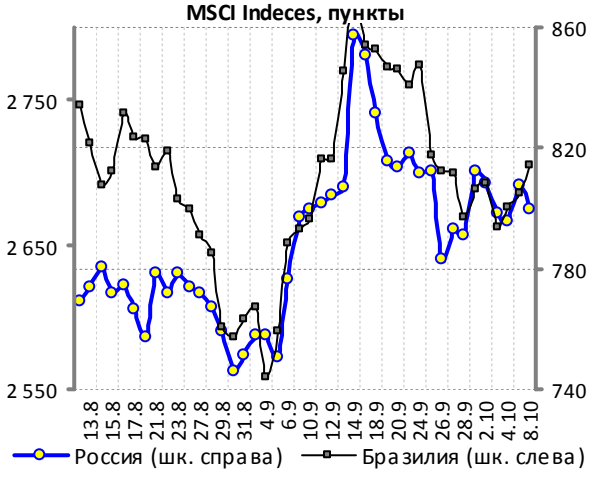
Золото. Возможность управлять параметрами QE для снижения инфляционных рисков, как это было отражено в последнем протоколе заседания ФРС, повысило интерес инвесторов к более рискованным вложениям и способствовала отливу капиталов из драгметаллов. К закрытию пятницы фьючерсы на золото торговались по 1780,80, вчера к 14.00 по 1771,66, сегодня с утра золото 1781,32, серебро = 34,25, платина = 1710, палладий = 665 долл. за унцию.

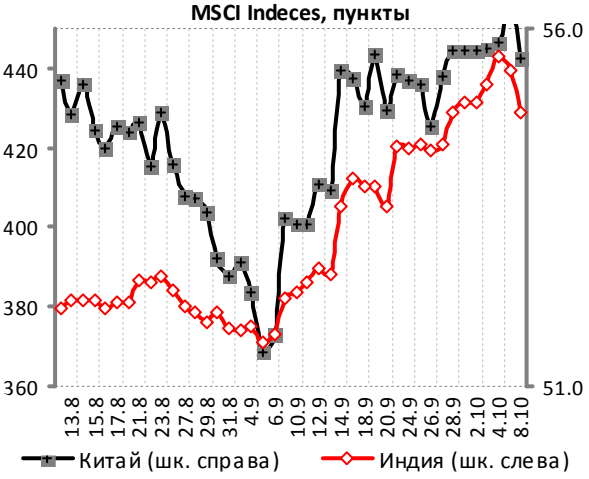
Нефть. Южная Корея восстановила поставки нефти из Ирана, которые были приостановлены из-за санкций (вступили в силу с 1 июля 2012г.). Наряду с запретом импорта нефти, санкции запрещают предоставлять услуги страхования танкеров. Поэтому иранское правительство начало самостоятельно предоставляет своим компания страховые услуги, способствуя тем самым и снижению стоимости поставок. До ввода санкций Южная Корея за счет поставок иранской нефти покрывала до 10% своих сырьевых потребностей. Турция, напротив, намерена заменить часть импортируемой иранской нефти на саудовскую. Укрепление доллара и фиксация прибыли, образовавшейся ранее, не давали ценам развернуться, Brent и Light вчера к 14.00 шли по 110,53 и 89,13, сегодня утром по 112,7 и 90,3 долл. за барр.

События, статистика, прогноз. Канцлер Германии посетит Афины с официальным визитом. Темой переговоров станет ситуация в Греции и перспективы стабилизации страны в рамках еврозоны. Ожидается совместная пресс-конференция по итогам переговоров. Вчера началось и сегодня продолжится заседание Еврогруппы, в состав которой входят министры финансов стран еврозоны, комиссар ЕС и президент ЕЦБ. В повестке дня заседания Греция (хотя готов только предварительный доклад кредиторов) и бюджет Испании на 2013г. 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).

Ожидается публикация очередного отчета ОПЕК, и если в нем будет содержаться информация о существенном увеличении объемов добычи нефти рядом стран (Ирак, США), цены нефти пойдут вниз. Из наиболее важной статистики ждем данные торговому балансу Франции (10.45), ВВП Италии за II квартал (12.30), промпроизводство Великобритании (12.30). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия тоже, нефть не растет. Российские биржи, скорее всего, будут следовать общему выжидательному тренду, но, учитывая комфортные цены акций после вчерашнего снижения, могут обозначить рост, по крайней мере, в начале торгов. Далее динамика зависит от характера поступающих внешних новостей.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 09.10.2012

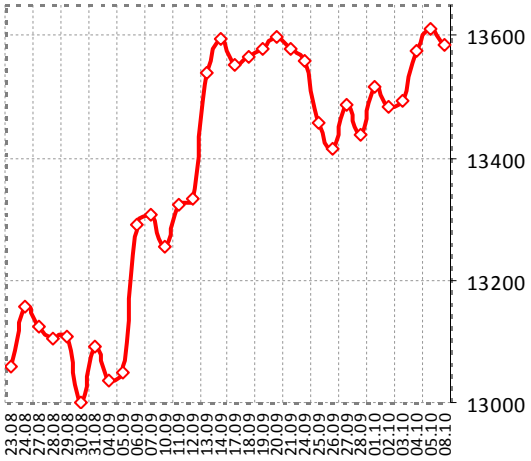




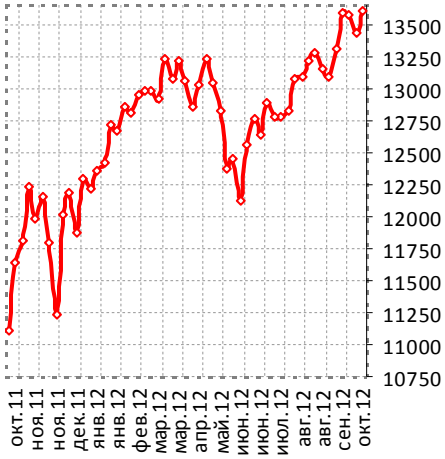
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

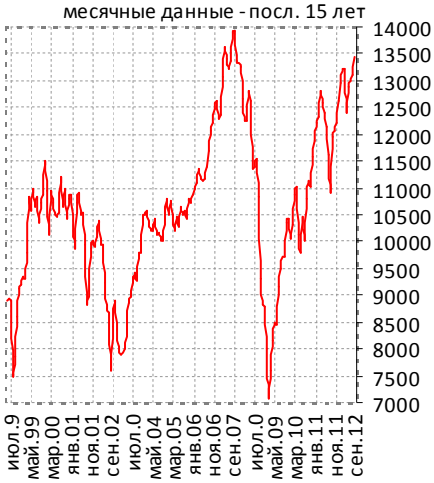
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



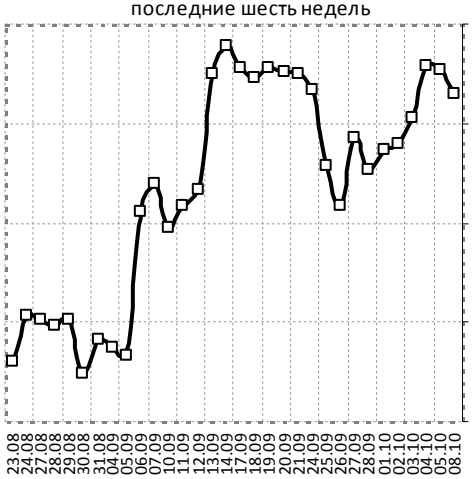
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



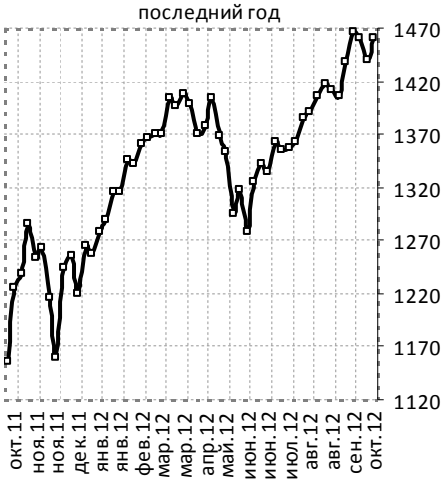
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



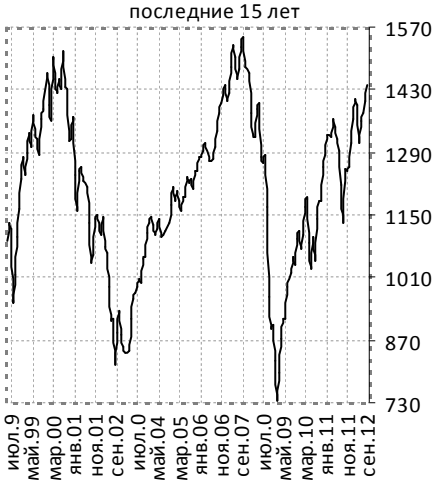
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



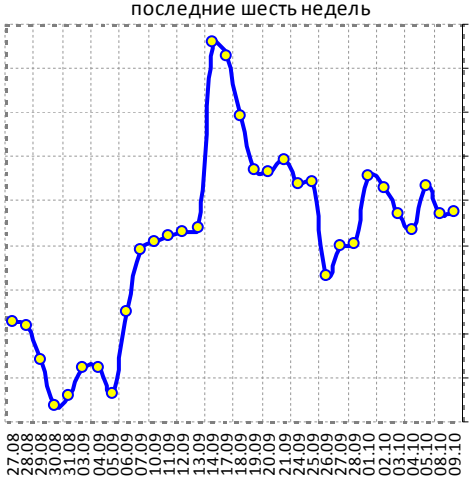
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



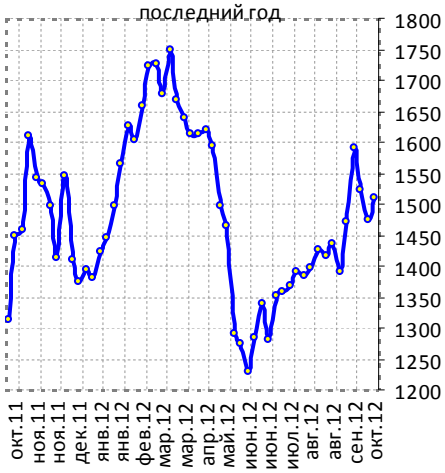
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



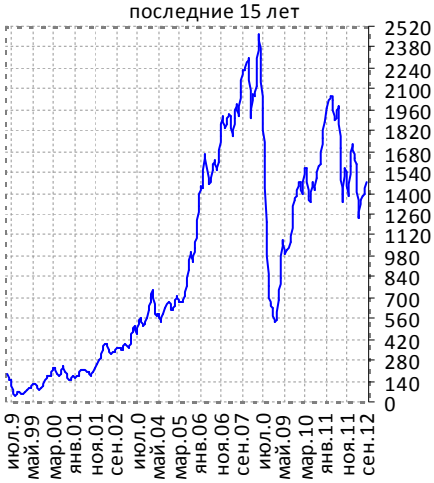
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



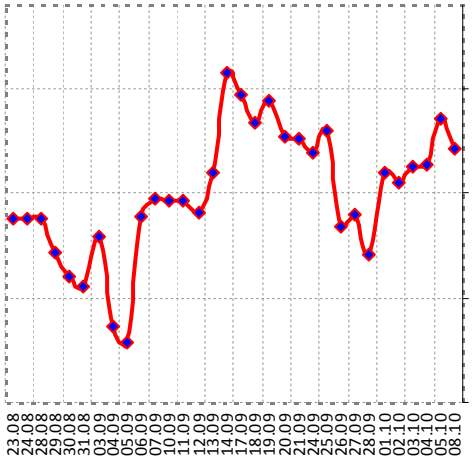
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



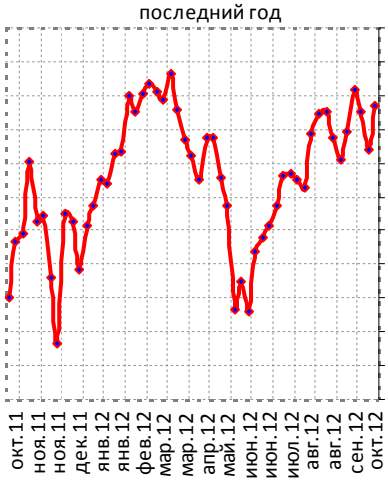
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

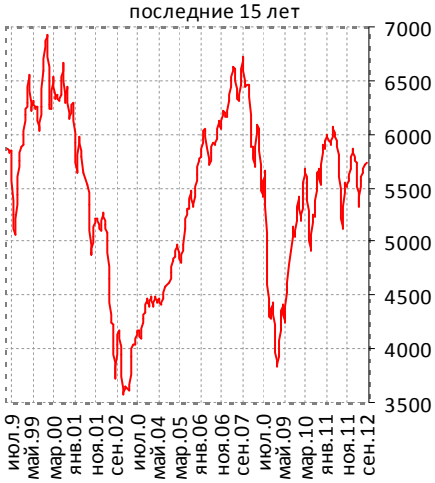
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



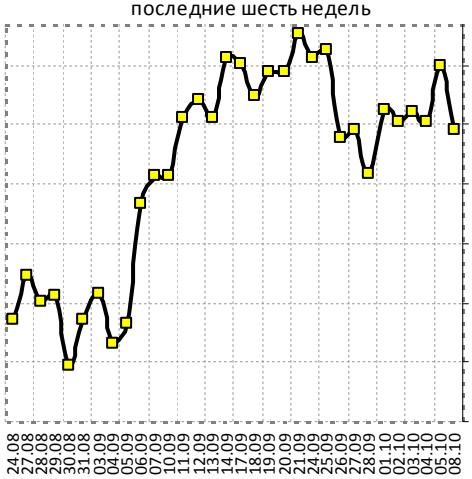
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



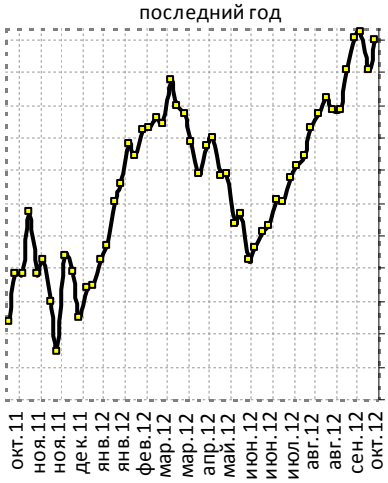
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



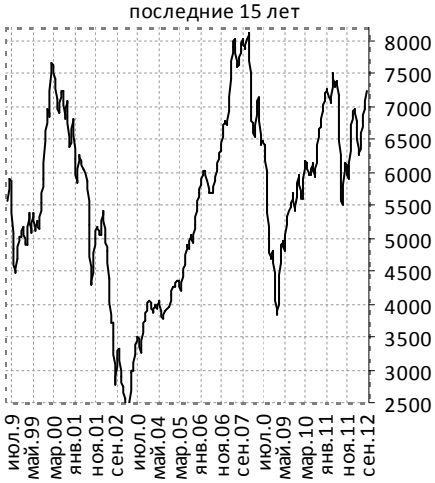
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



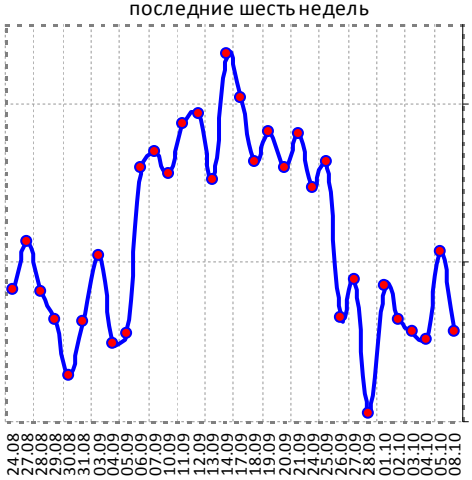
DAX Index: недельные данные - последний год



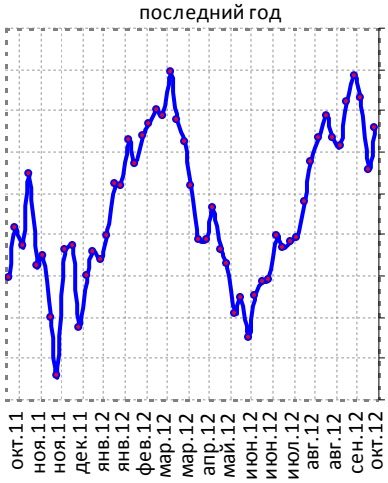
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



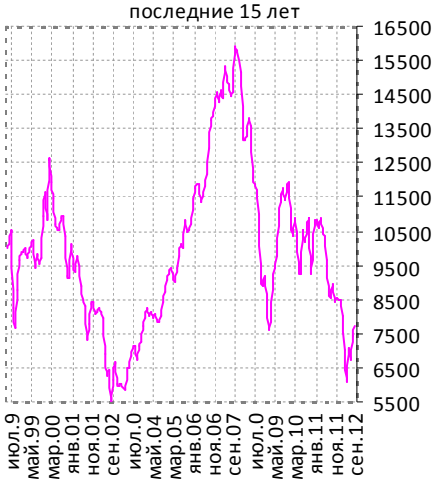
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

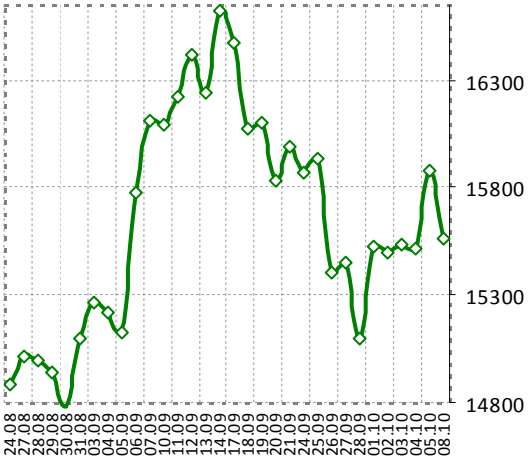


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

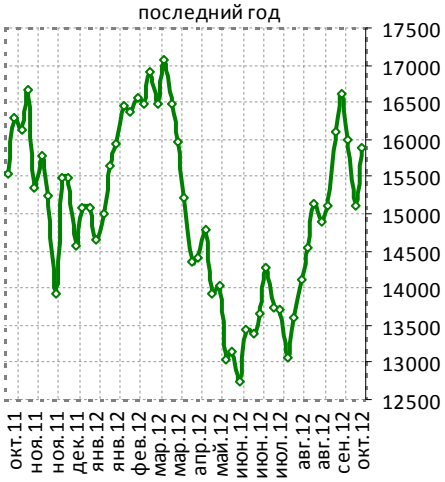


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



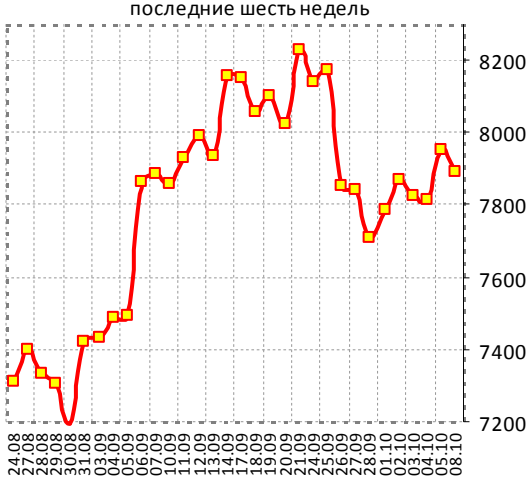
MIB Index: недельные данные - последний год



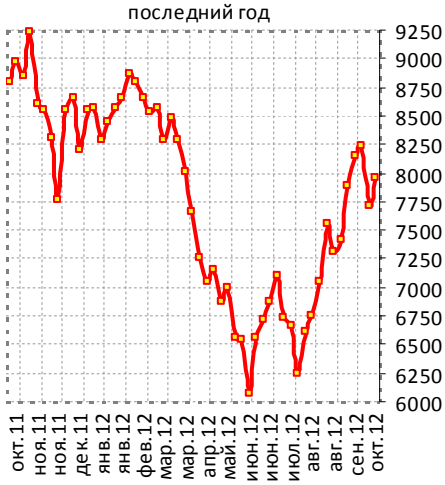
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



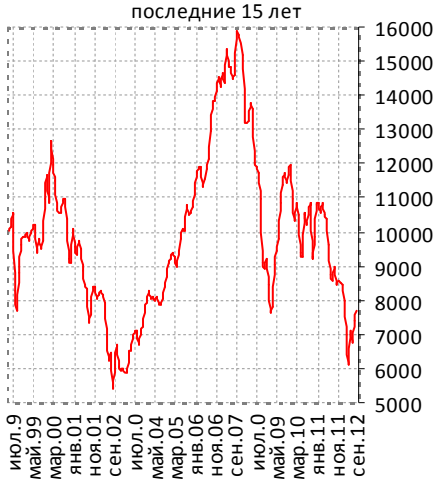
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



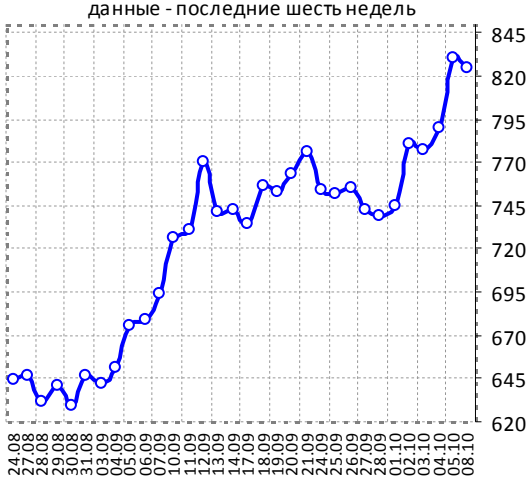
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



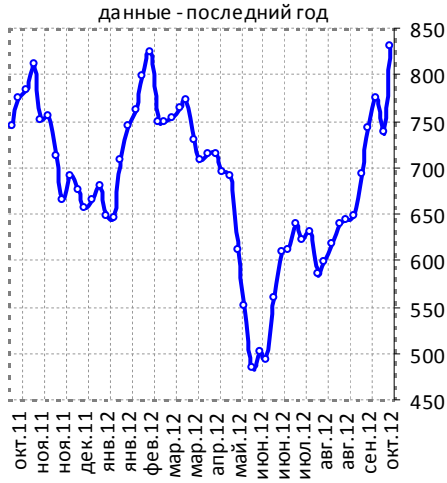
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



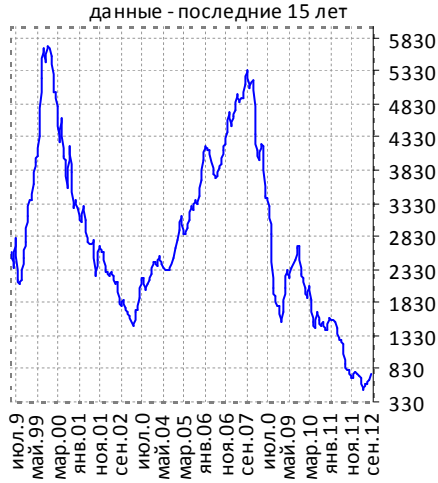
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



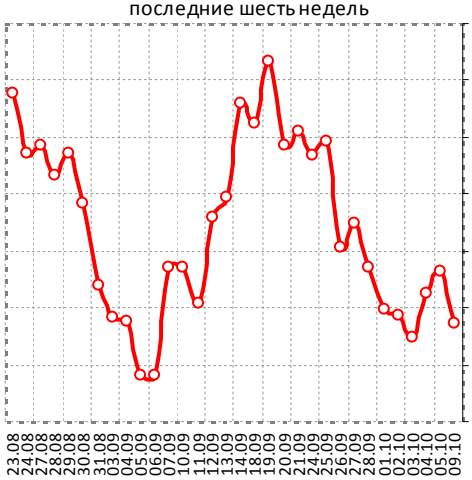
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



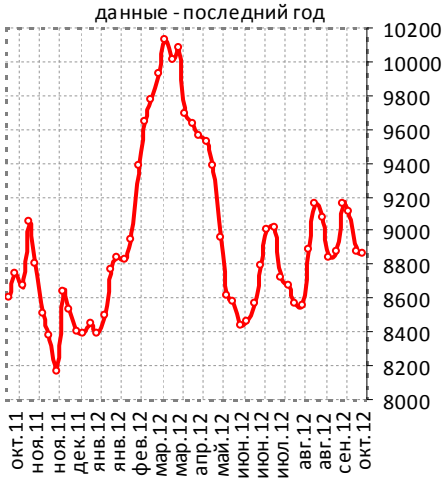
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

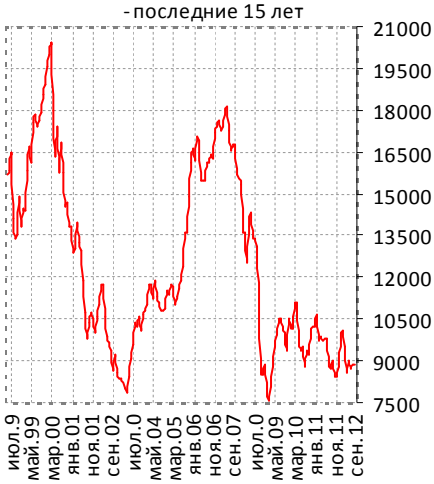
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



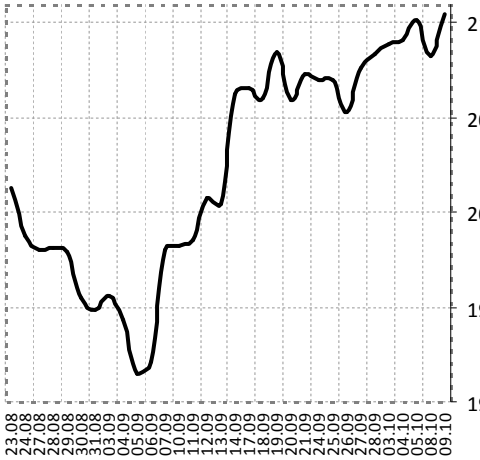
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



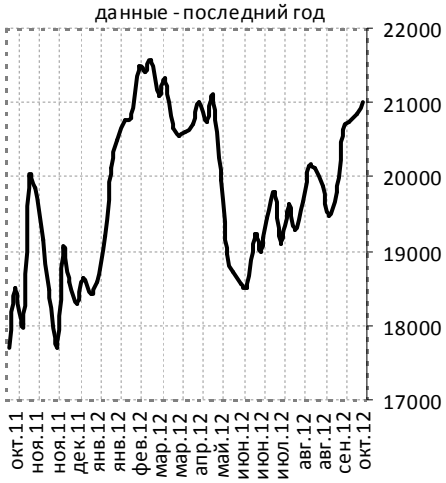
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



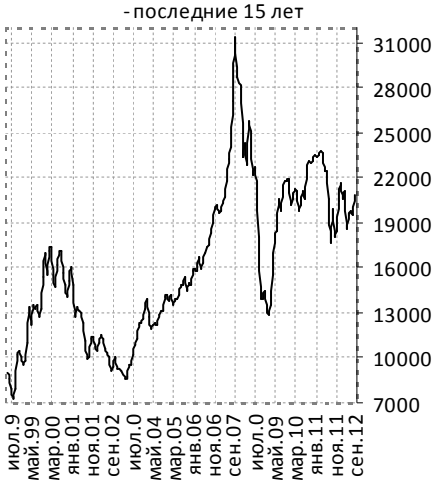
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



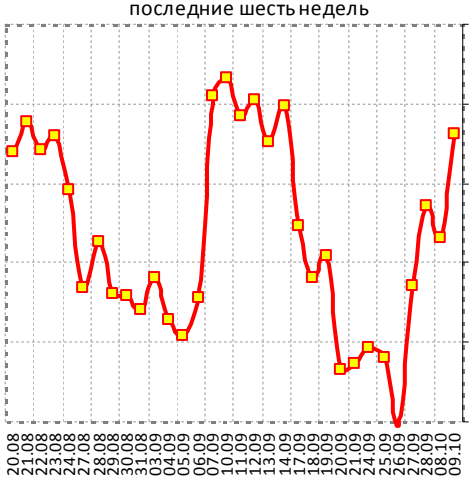
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



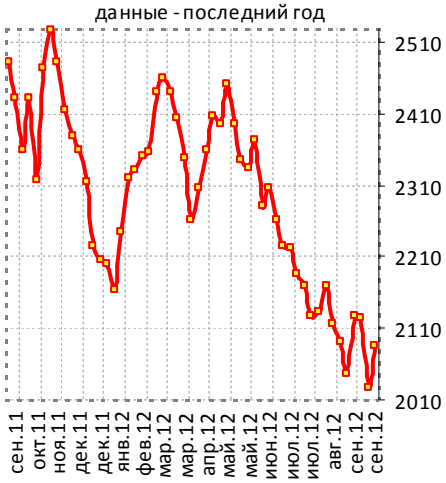
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



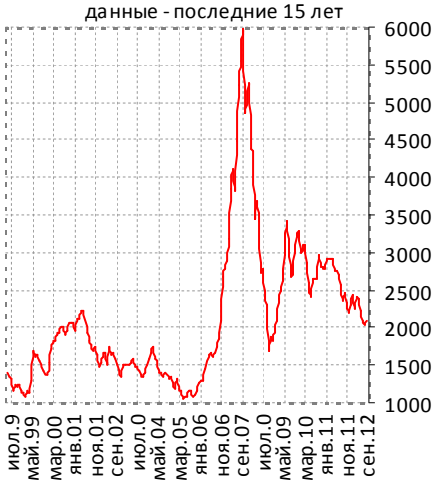
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



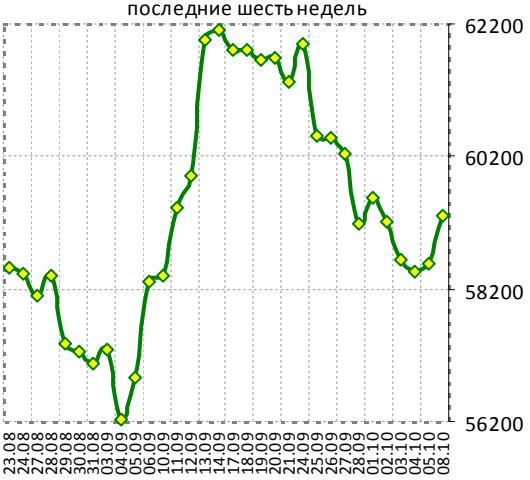
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



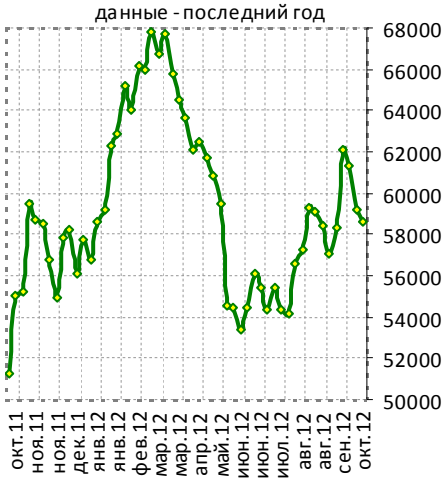
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

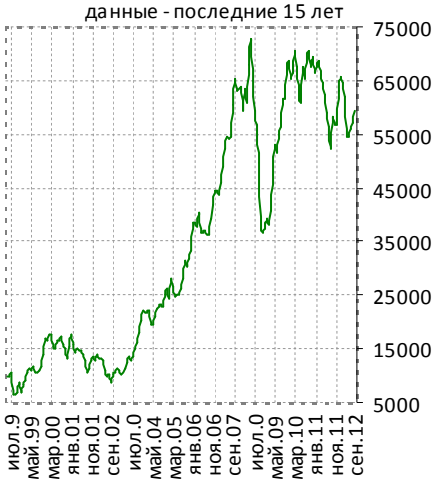
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



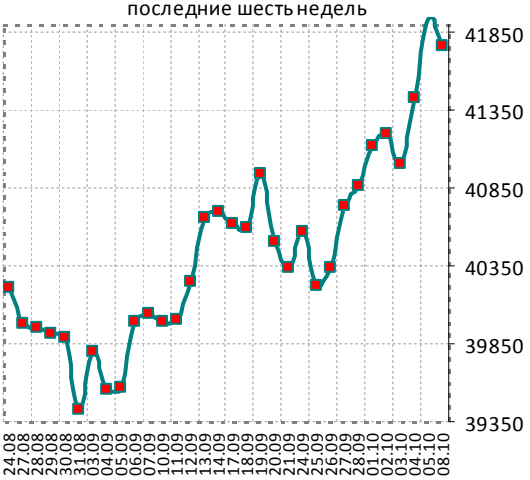
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



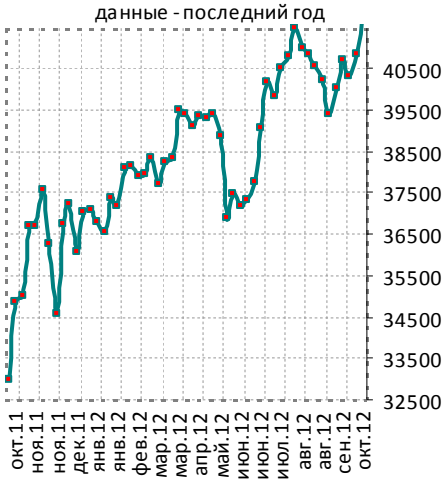
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



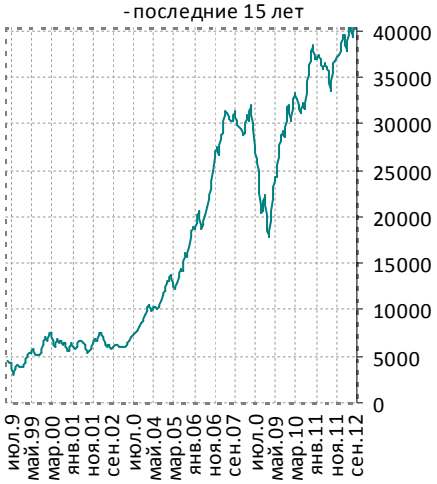
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



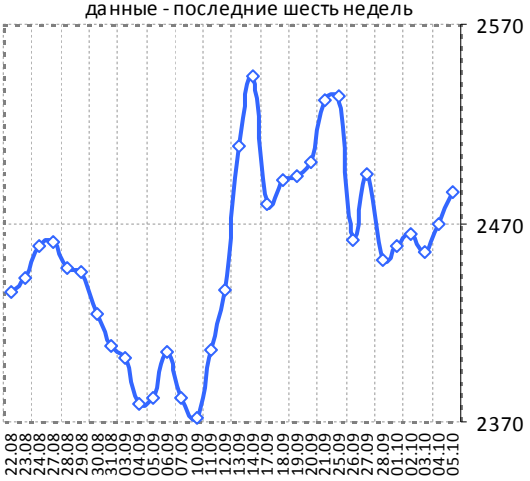
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



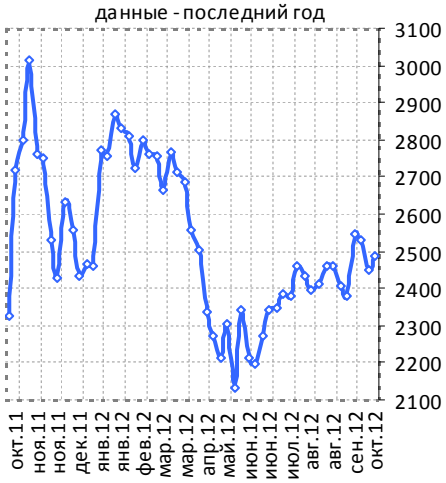
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



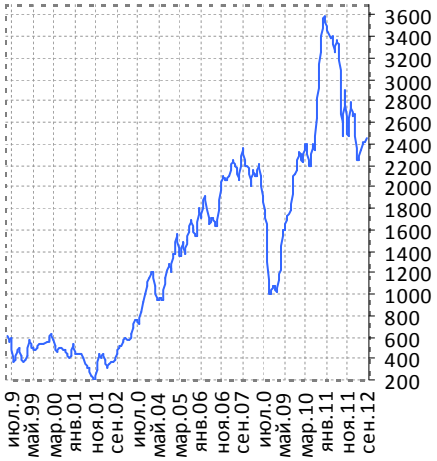
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

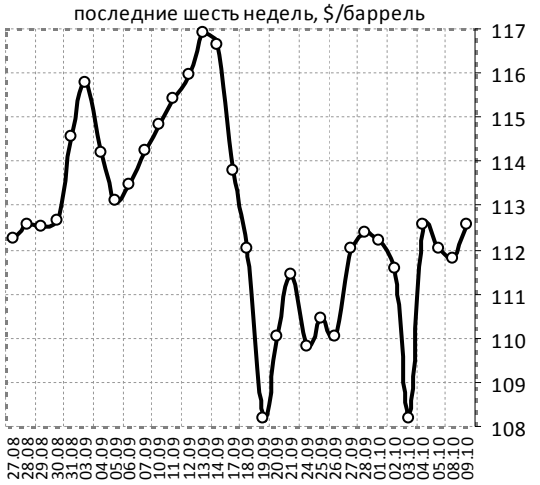


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

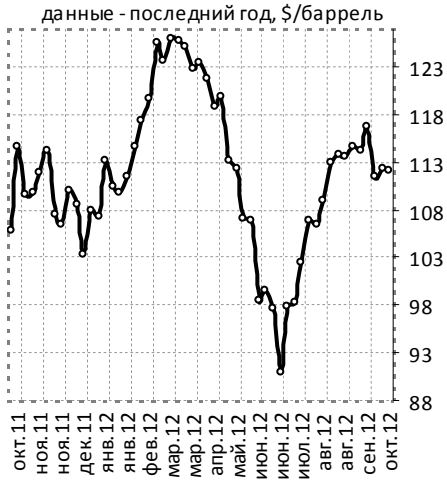
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

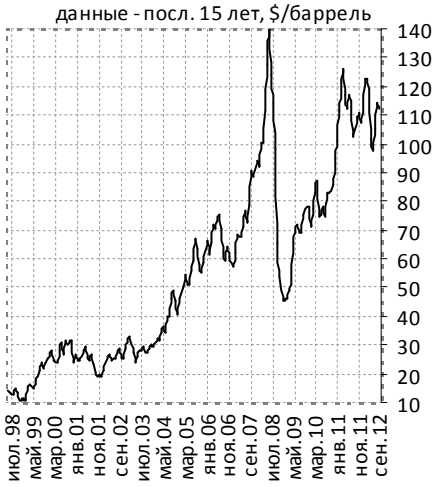
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



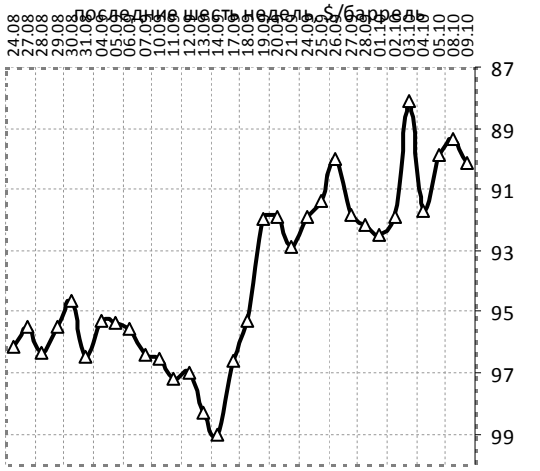
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



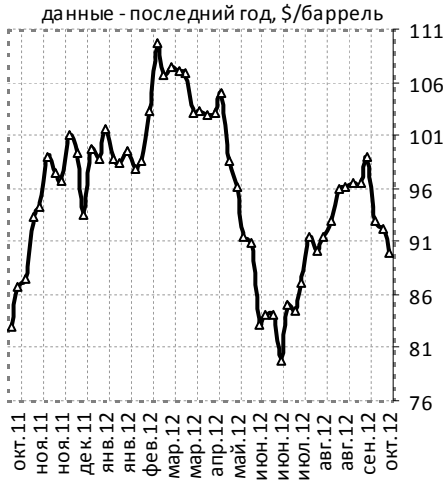
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



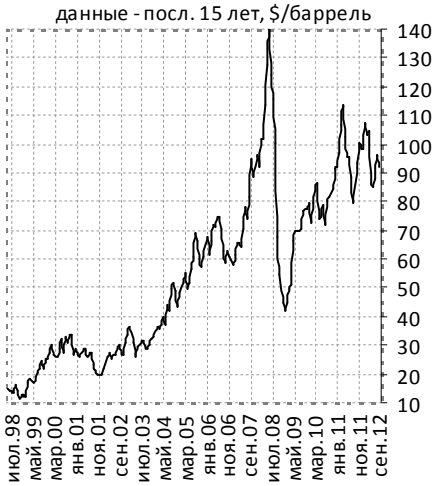
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



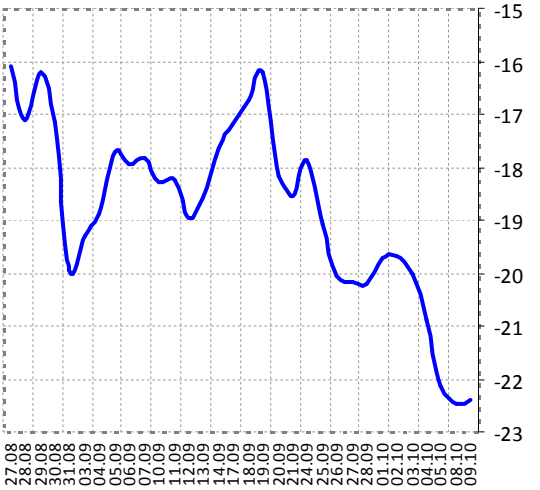
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



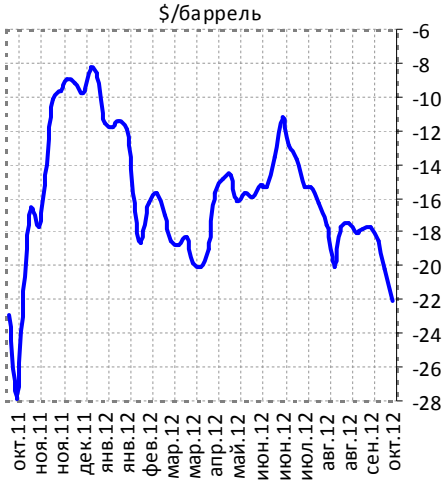
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



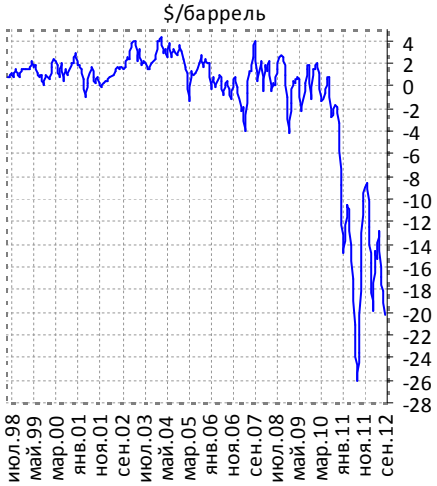
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



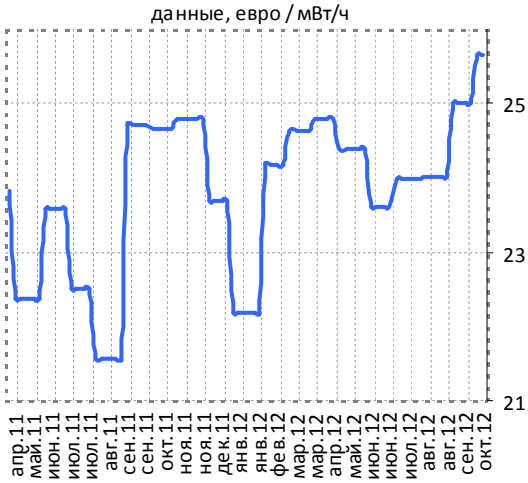
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



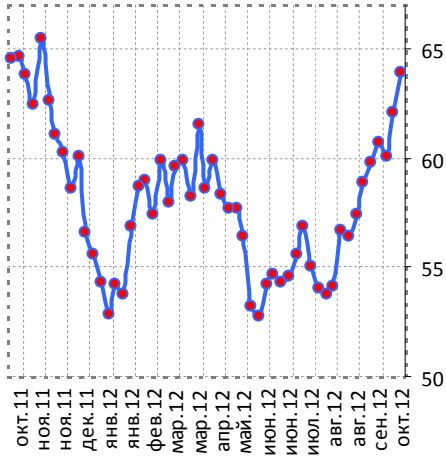
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

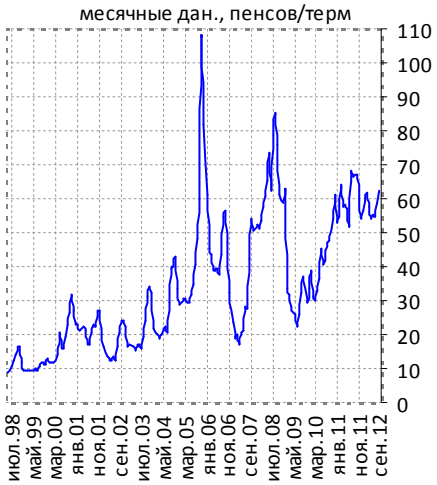
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



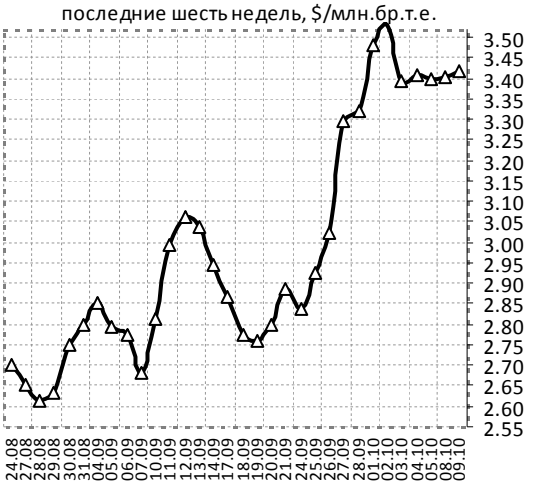
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



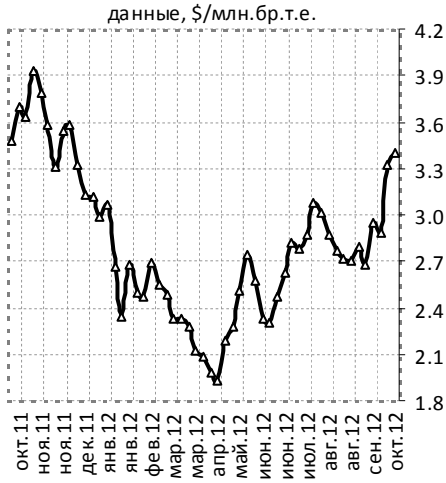
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



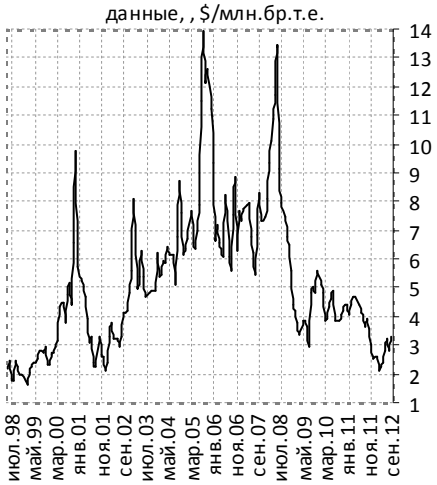
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



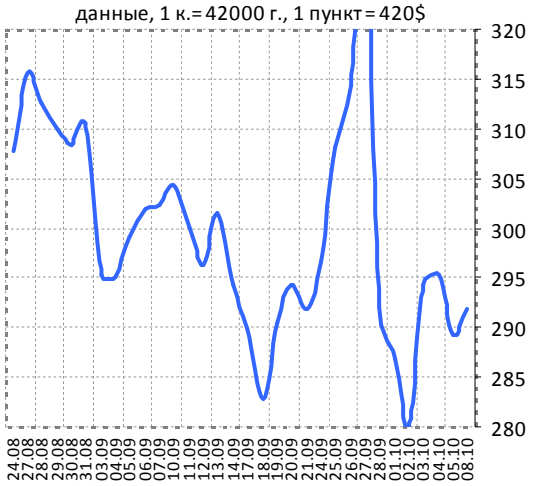
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



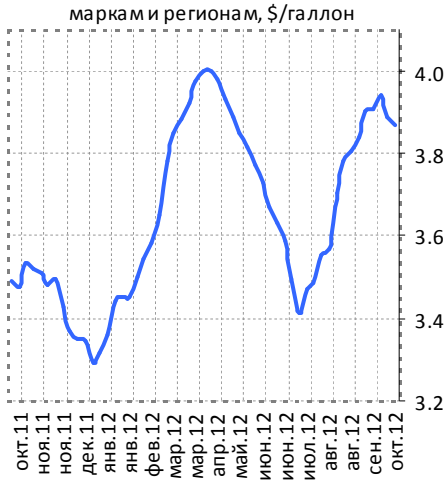
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



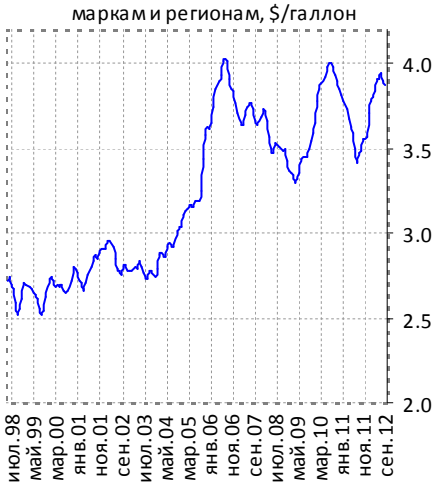
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



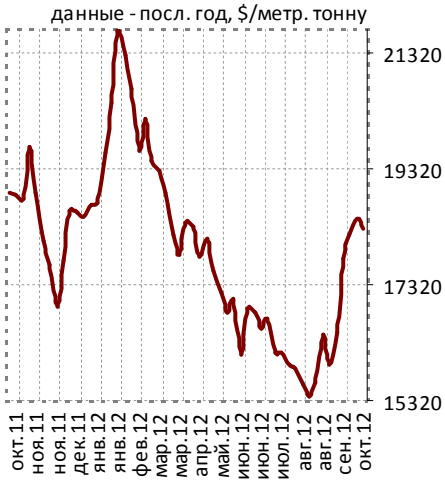
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

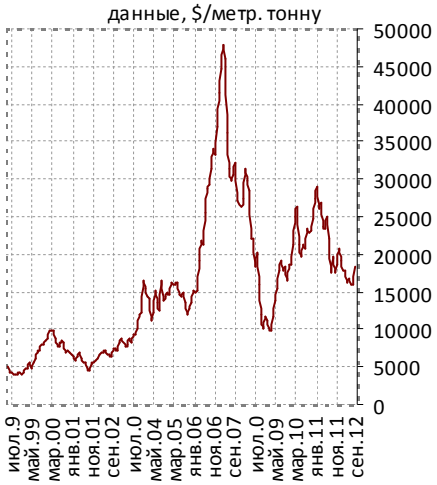
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



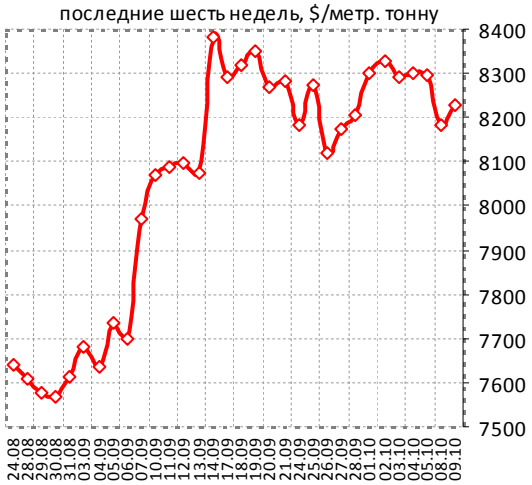
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



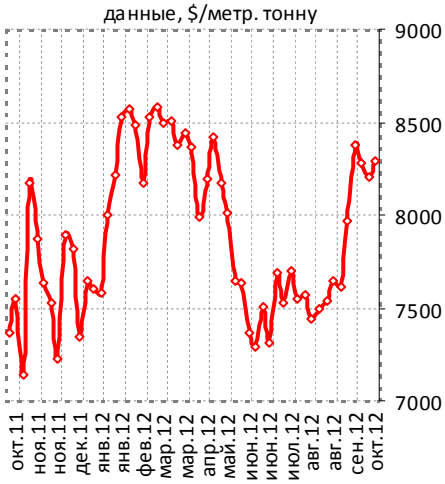
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



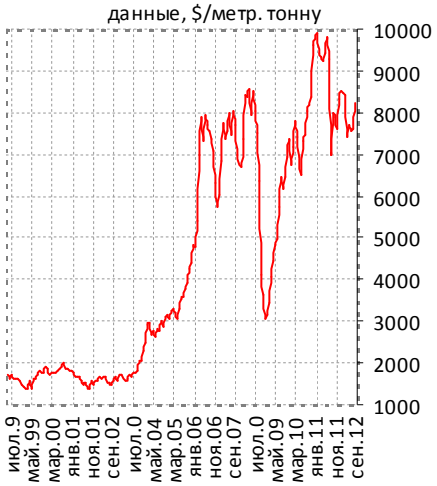
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



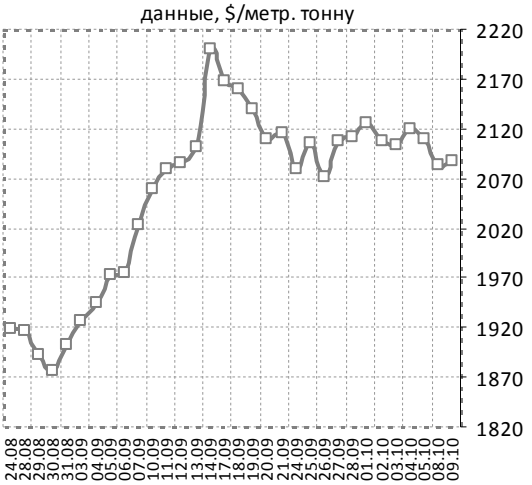
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



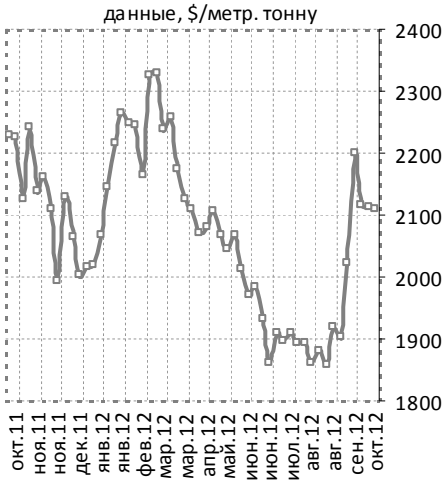
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



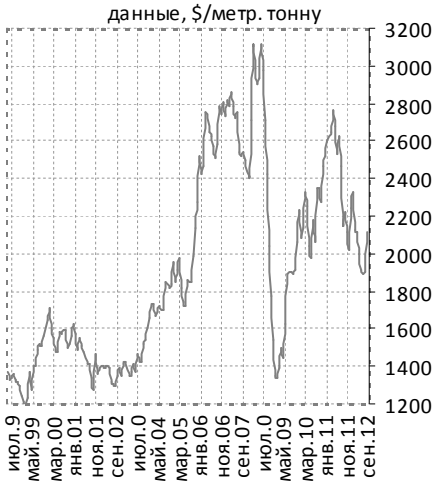
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.