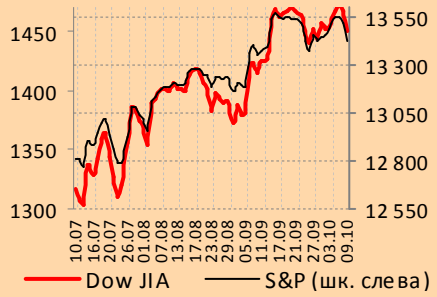
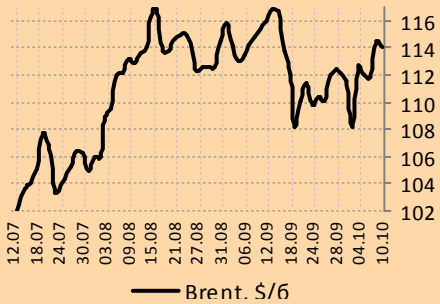
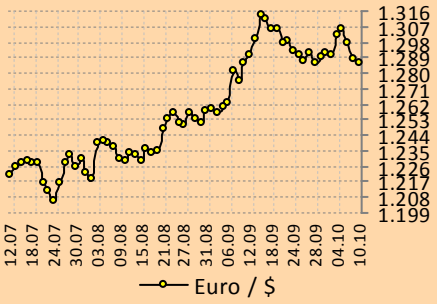
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

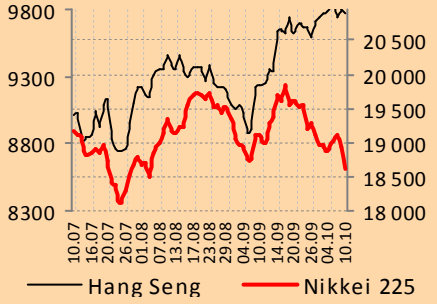
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

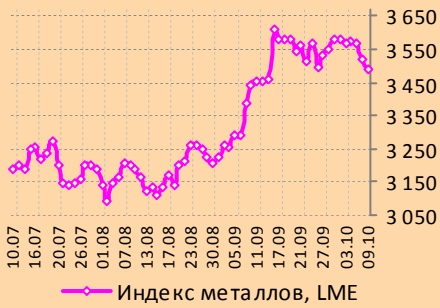
Ежедневный обзор

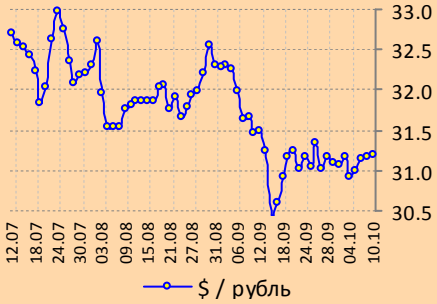






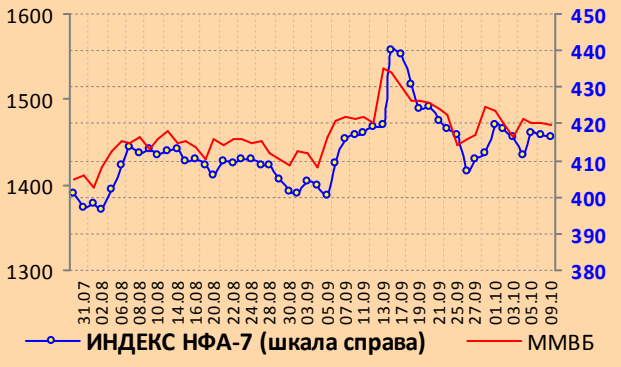






СОДЕРЖАНИЕ

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. Ряд факторов способствовал снижению. Так, котировки от роста удерживало напряжение перед публикацией отчетности, МВФ сократил на текущий год прогноз роста мировой экономики с 3,5 до 3,2%, на 2013г. с 3,9 до 3,6%, после закрытия наших бирж состоялось размещение трехлетних гособлигаций на сумму 32 млрд. долл., что традиционно отвлекает часть капиталов с рынка акций. После нашего закрытия был опубликован финансовый отчет алюминиевой компании Alcoa, по итогам 3 квартала ожидался убыток. И действительно, компания получила квартальный убыток в связи с ослаблением спроса и снижением цен на металл, но при этом прибыль на акцию превзошла ожидания. Отчетность Alcoa, как правило, оценивается рынками как индикатор состояния промпроизводства в целом. Итоги торгов: индекс Dow Jones =-0,81, S&P =-0,99, NASDAQ =-1,52%.

Шансы двух кандидатов в президенты поменялись местами, согласно последнему опросу, Митт Ромни набирает 49% голосов, за действующего президента сейчас готовы проголосовать 46% американцев (ранее лидировал действующий президент).

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, котировки росли на комфортных ценах, но внешний фон сдерживал, итоги торгов нейтральные, индекс ММВБ =-0,05, РТС =+ 0,11%.

Перед новым периодом усреднения банки стремятся нарастить остатки на корсчетах для соблюдения нормативов обязательного резервирования. Так, вчера на аукционе прямого РЕПО на 1 день было предложено 200 млрд. руб., спрос составил 311 млрд., на утреннем аукционе банки взяли все 200 млрд. под 5,61% (ставка рынка такая же). На дополнительном аукционе спрос на кредит в 1 день составил 10,4 млрд., а выдано было 0,2 млрд., т.е. в 52 раза меньше спроса. Прямое РЕПО на 7 дней предлагалось в объеме 1080 млрд. руб., при спросе в 1110 млрд. оформлен кредит на 1077 млрд. под 5,55% (ставка рынка 5,77%). Казначейство, в свою очередь, размещало средства федерального бюджета на банковских депозитах в сумме 38 млрд. руб., возврат 18 января следующего года. Не считая последнего размещения, на депозитах комбанков под проценты уже находилось 557 млрд. руб. бюджетных денег, представители Минфина заявили о возможности переноса 300 млрд. руб. депозитов на 2013 г. И если вчера Минфин размещал деньги, то сегодня он их изымает, размещая ОФЗ-ПД в объеме 35 млрд. руб., интервал доходности от 7,78 до 7,83%, полное погашение облигаций 20 июля 2022 года.

По оценке МЭР, инфляция с начала года равна от 5,7 до 5,8%, в годовом измерении инфляция составляет от 6,7 до 6,8%.

Европа. FTSE 100 =-0,54, DAX =-0,78, CAC 40 =-0,70%. На фоне противоречивой информации инвесторы предпочли фиксацию прибыли. С одной стороны, понижение Moodys долгосрочного кредитного рейтинга Кипра сразу на три ступени (с Ba3 до B3 с негативным прогнозом) негативно повлияло на динамику котировок. С другой, наметилось продвижение в разрешении европейского долгового кризиса, официально объявлено о возможности использования средств постоянного стабфонда в размере 500 млрд. евро (652 млрд. долл.). Fitch присвоило постоянному фонду наивысший рейтинг AAA, хотя и с негативным прогнозом. Негативный прогноз отражает аналогичный прогноз стран с наибольшим вкладом в фонд (Германия, 27,1%, Франция 20,4%, Нидерланды, 5,7%). Вчера по итогам первого дня заседания министров финансов еврозоны было объявлено, что Испания не нуждается в полномасштабной финансовой помощи, предпринимает попытки оживить экономику и успешно привлекает финансирование на рынке. Что касается Греции, то окончательная оценка состояния экономики будет дана после отчета кредиторов, при этом отмечено, что в реформах страны ожидается значительный прогресс.

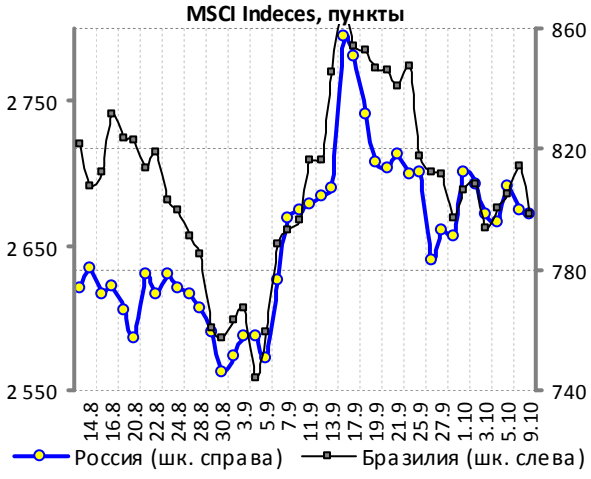
Азия. После снижения Всемирным банком прогнозов по росту Китая инвесторы пришли к заключению, что теперь китайские партнеры в других азиатских странах будут снижать свои прогнозы по прибылям на текущий год. На этих опасениях торги вторника завершились понижением индекса Nikkei на 1,06%, Kospi на 0,14%, китайские биржи показали рост, SSE на 1,97, Hang Seng на 0,54%. Инвесторы в Китае снова делают ставку на то, что будут введены новые стимулы экономического роста. Показатель состояния сектора услуг в Китае, рассчитываемый HSBC, оказался лучше ожиданий.

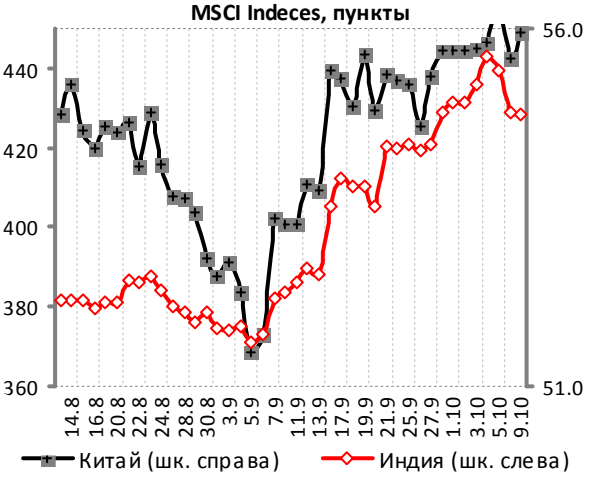
Золото. Возможность управлять параметрами QE для снижения инфляционных рисков, как это было отражено в последнем протоколе заседания ФРС, повысило интерес инвесторов к более рискованным вложениям и способствовала отливу капиталов из драгметаллов. К 14.00 вторника золото торговалось по 1775,15, сегодня утром фьючерсы на золото = 1765,75, серебро = 33,89, платину = 1689,8, палладий = 656 долл. за унцию.

Нефть. Сохранение напряженности между Турцией и Сирией удерживает цену на достаточно высоком уровне, а понижение со стороны МВФ прогнозов по мировой экономике, напротив, влияет на понижение цен. Brent и Light вчера утром шли по 112,7 и 90,3, к 14.00 по 111,51 и 90,19, сегодня с утра по 114,08 и 91,92 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем объемы промпроизводства Франции и Италии (10.45 и 12.00), по США оптовые запасы (18.00), отчет ФРС "Бежевая книга" и данные о состоянии бюджета (22.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия тоже, нефть находится на достаточно высоком уровне. Российские биржи, благодаря нефти, подрастут на открытии, но далее динамика зависит от характера поступающих внешних новостей.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 10.10.2012

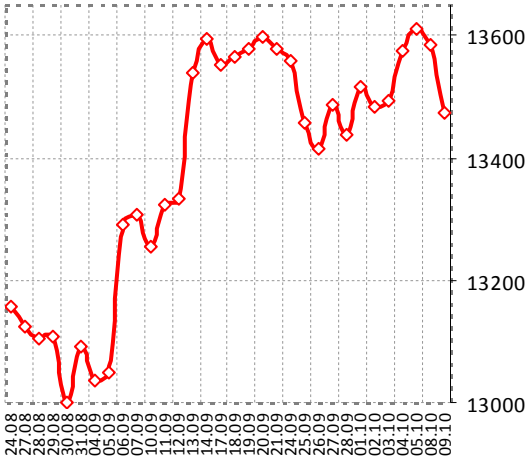




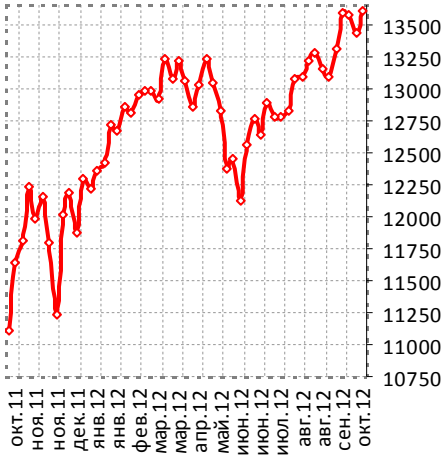
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

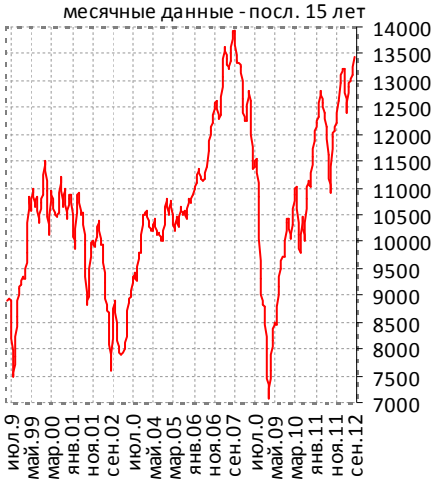
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



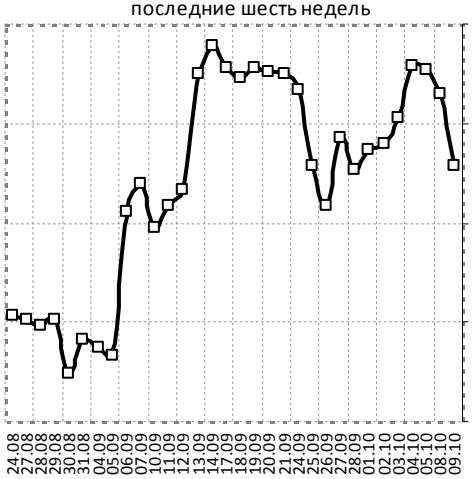
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



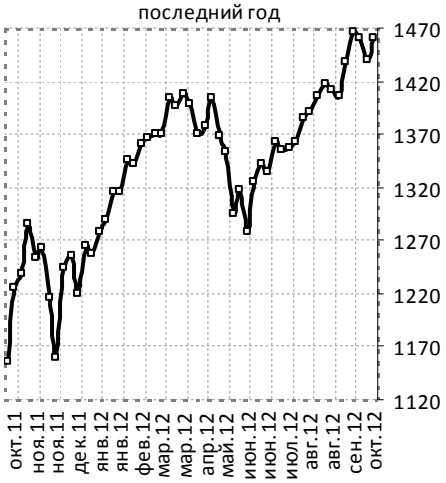
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



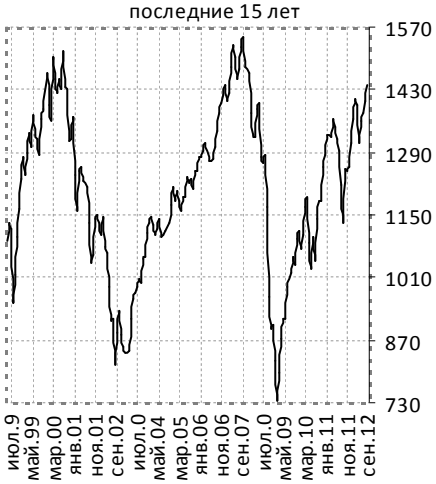
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



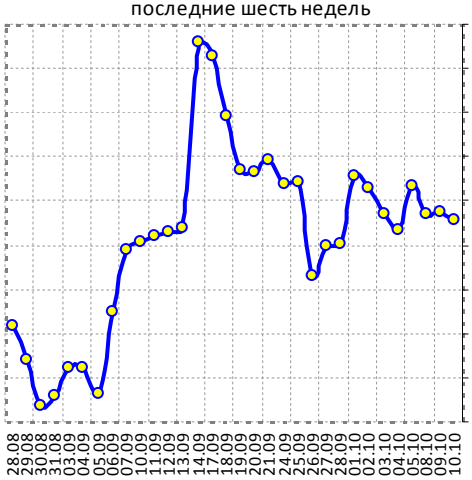
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



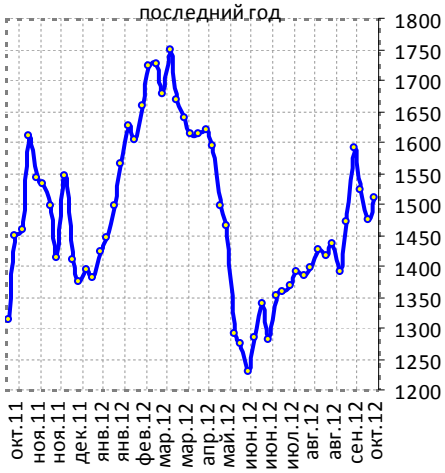
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



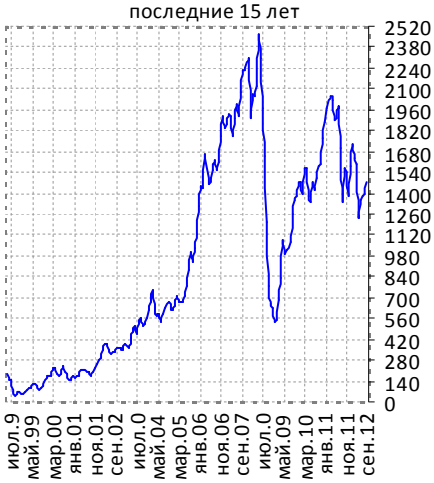
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



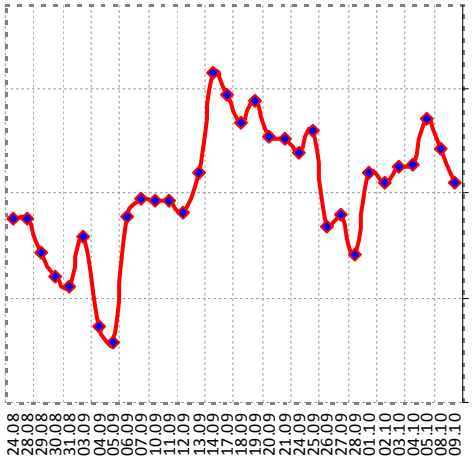
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



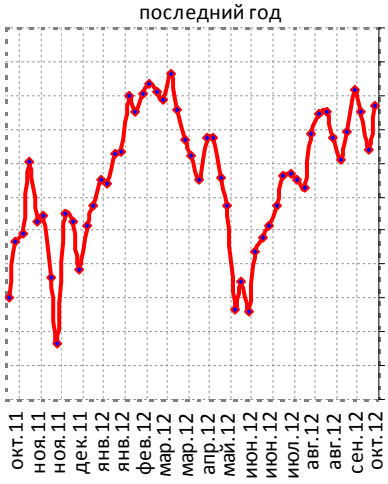
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

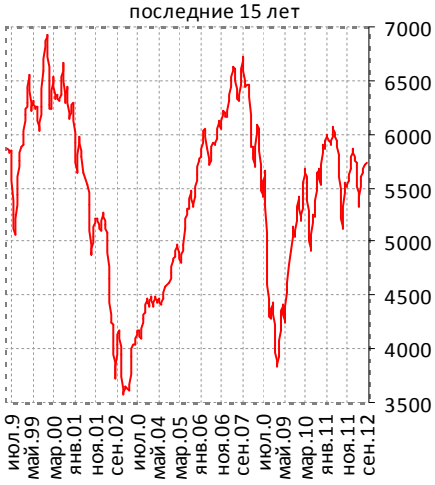
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



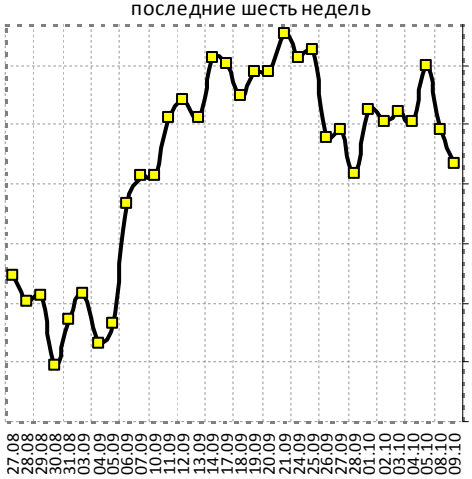
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



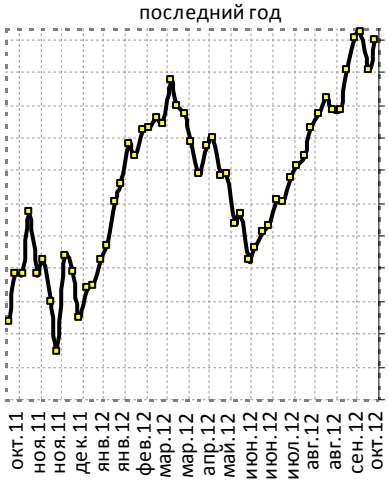
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



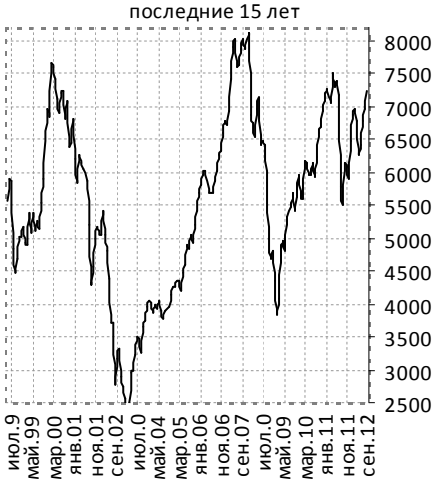
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



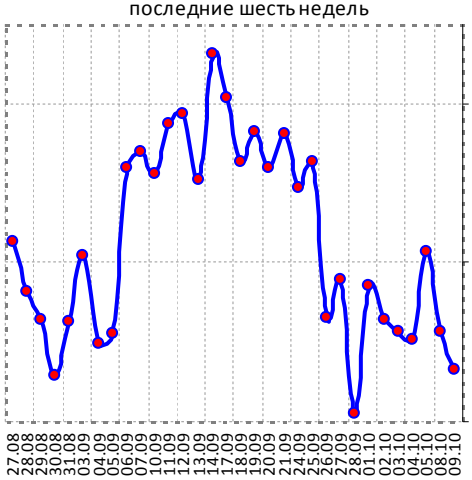
DAX Index: недельные данные - последний год



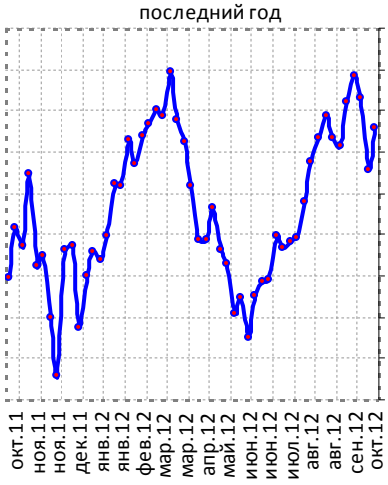
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



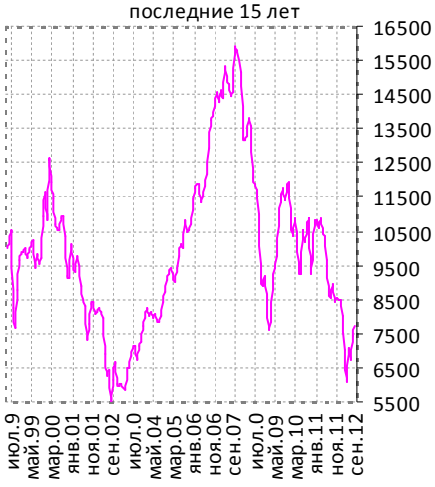
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

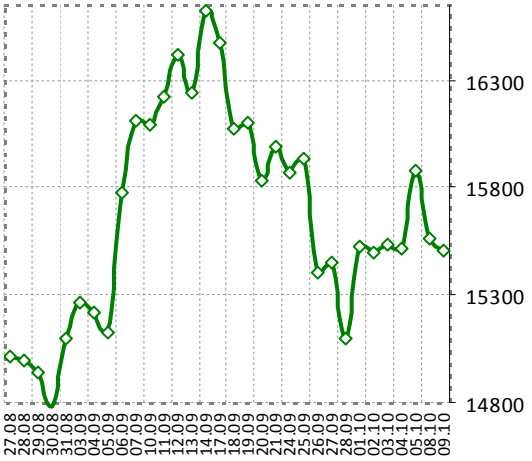


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

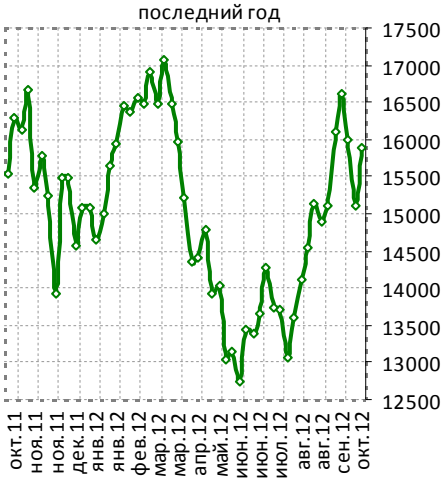


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



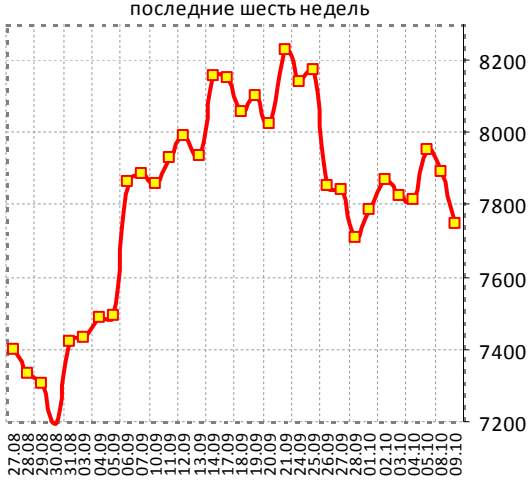
MIB Index: недельные данные - последний год



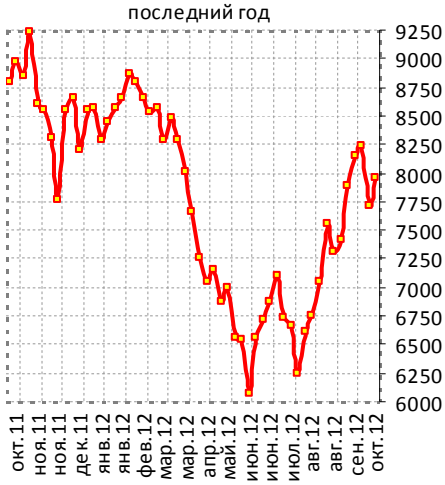
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



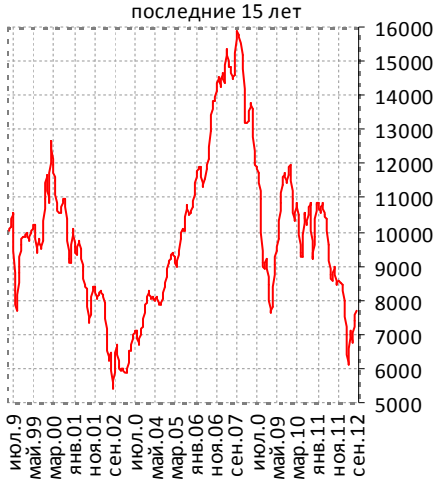
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



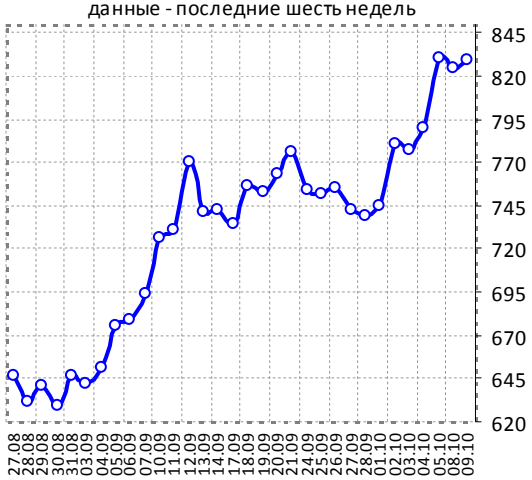
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



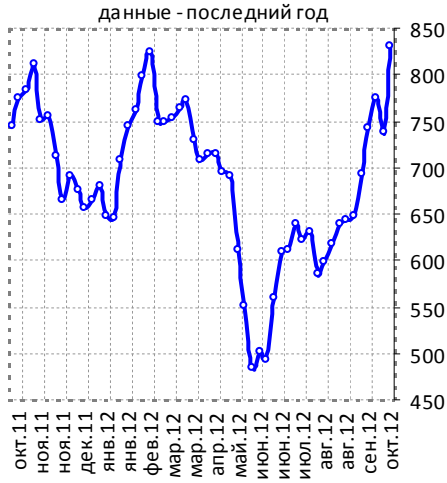
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



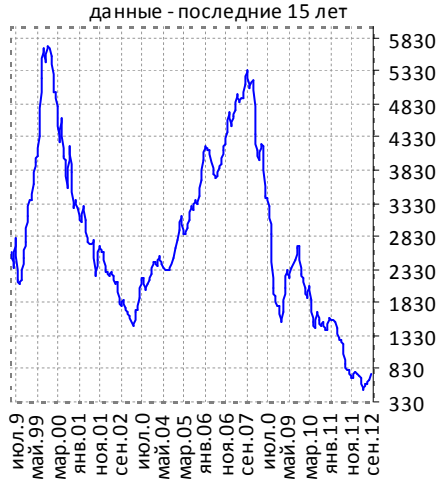
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



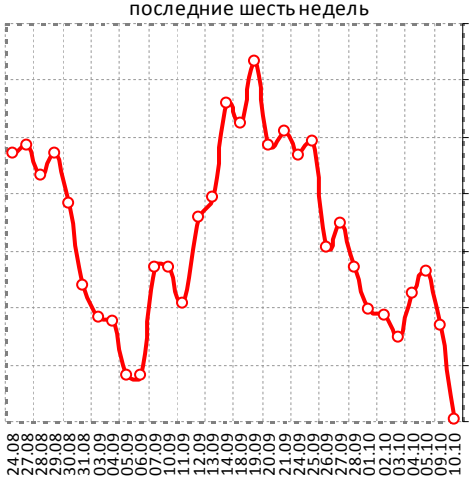
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



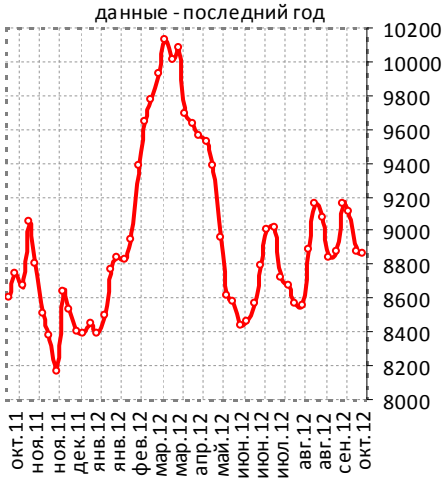
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

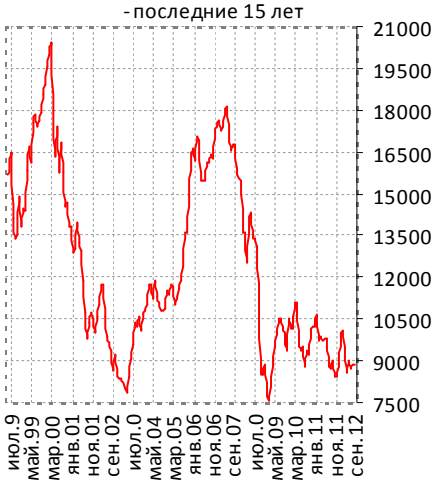
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



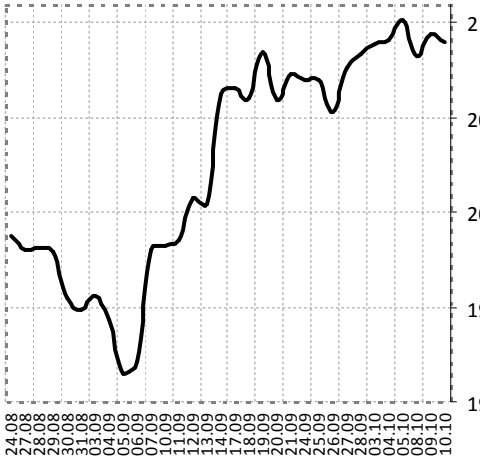
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



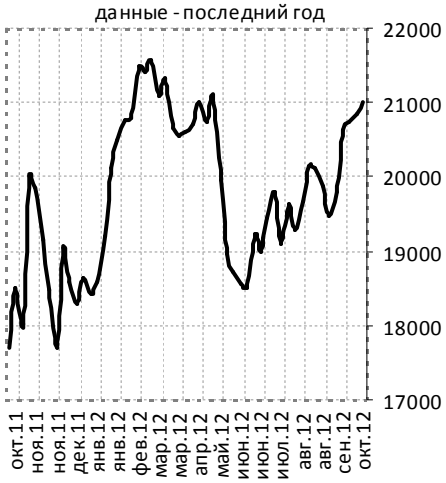
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



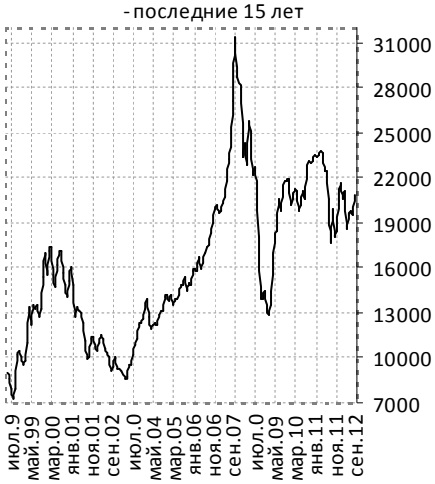
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



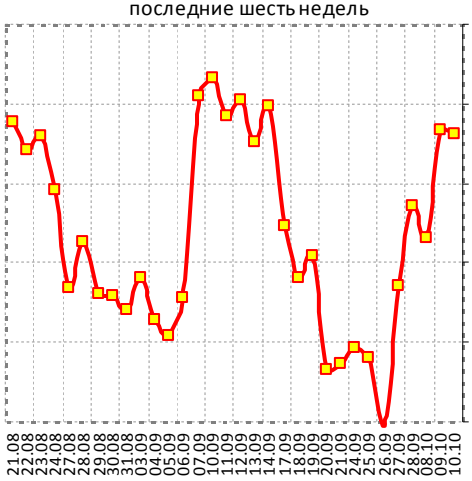
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



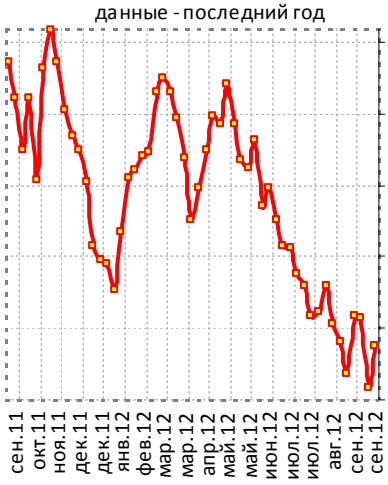
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



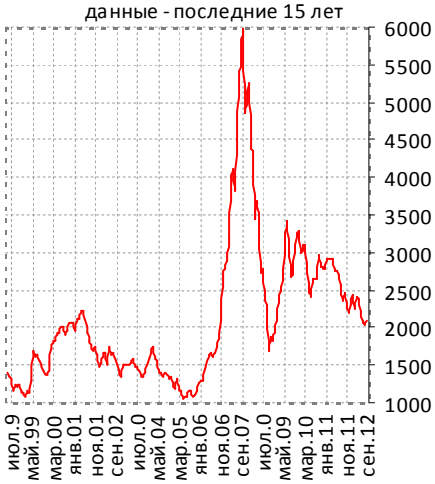
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



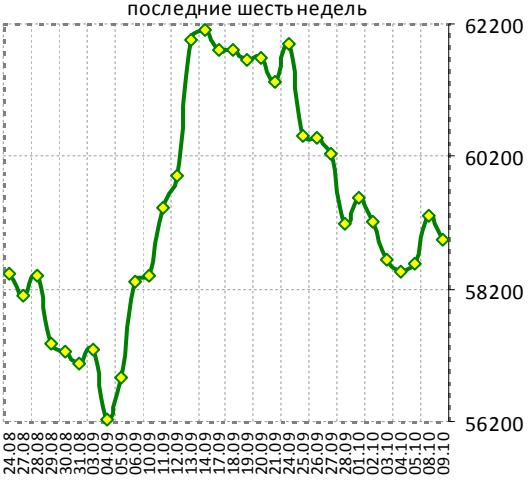
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



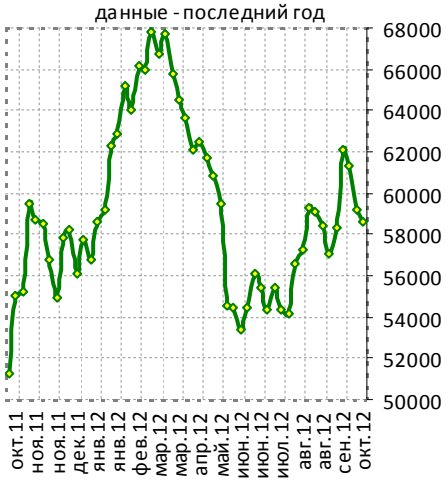
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

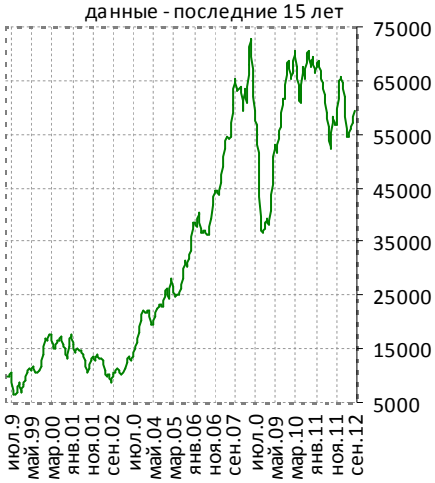
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



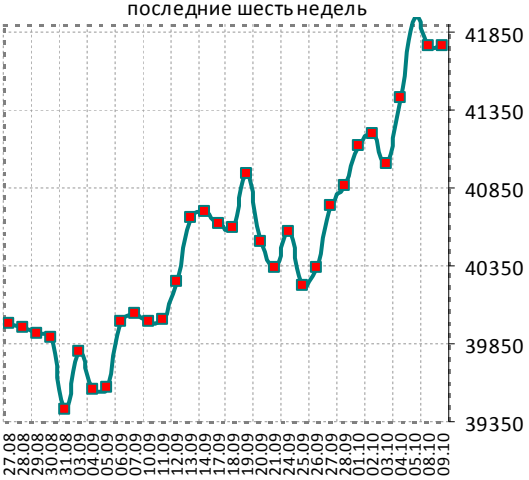
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



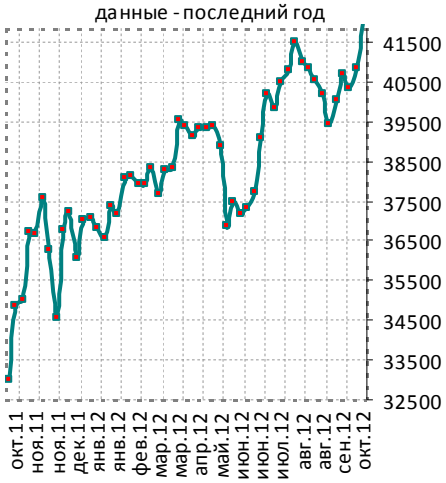
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



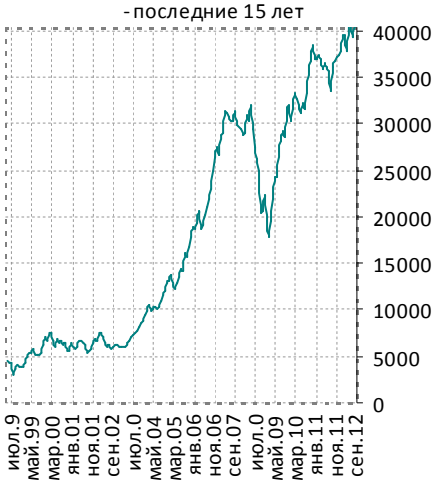
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



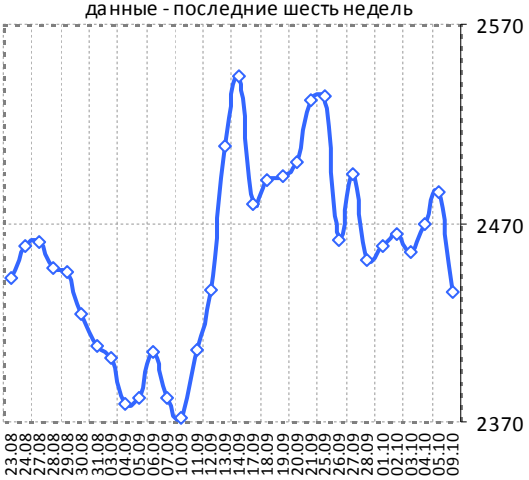
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



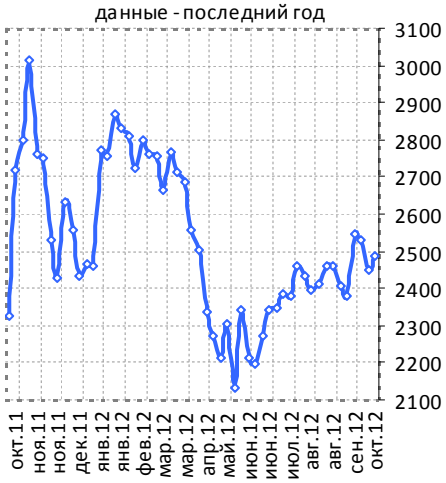
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



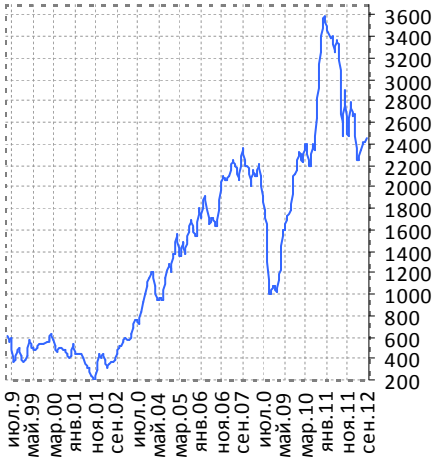
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

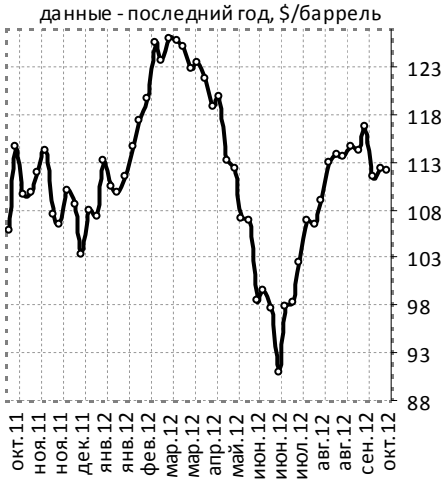
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

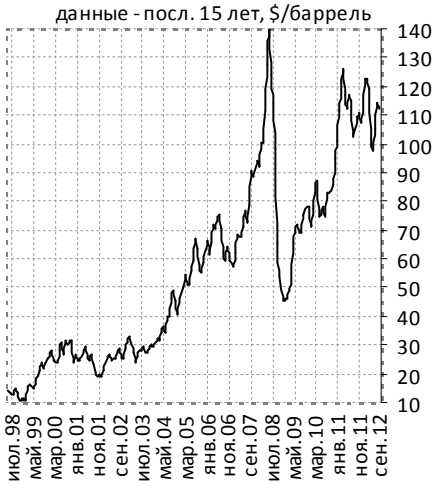
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



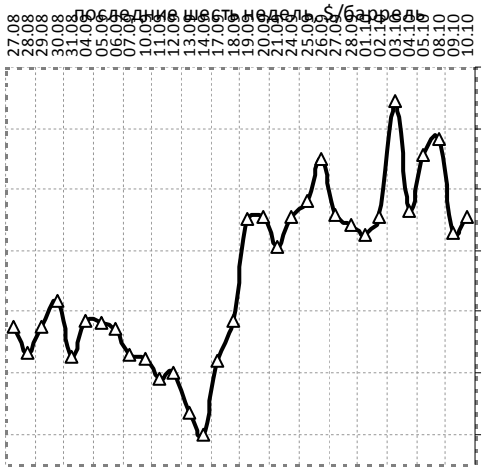
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



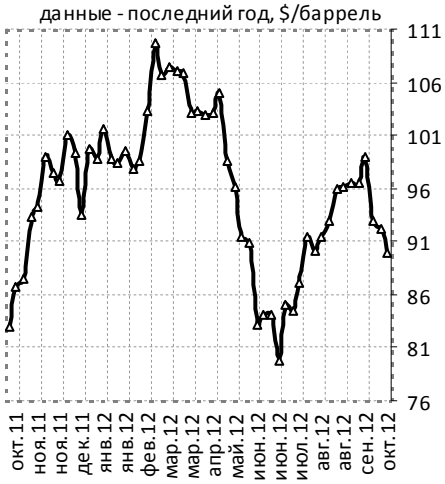
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



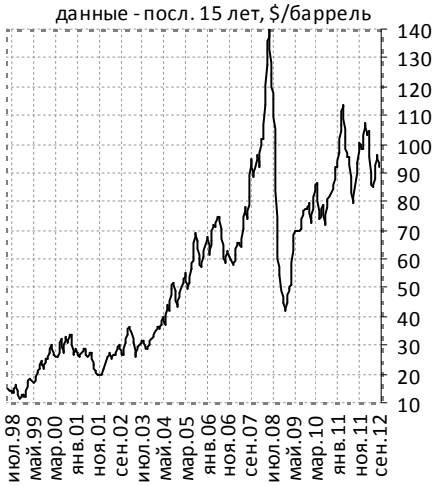
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



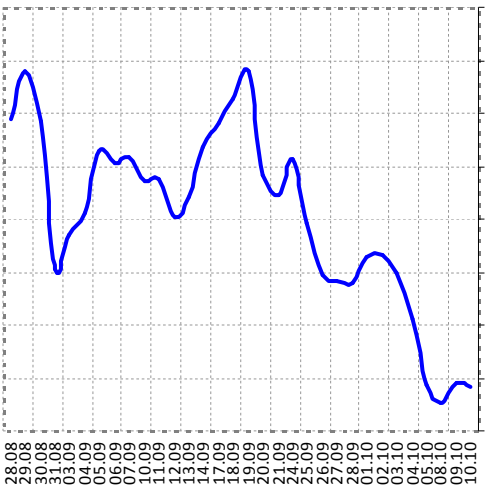
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



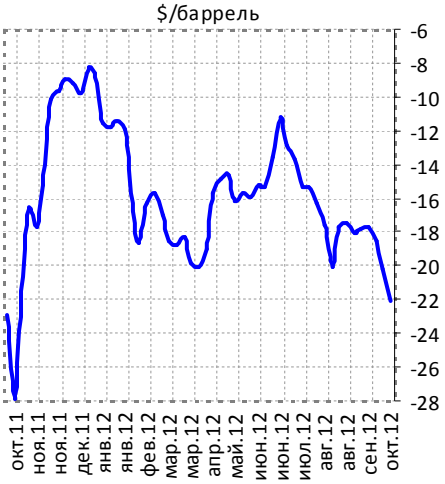
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



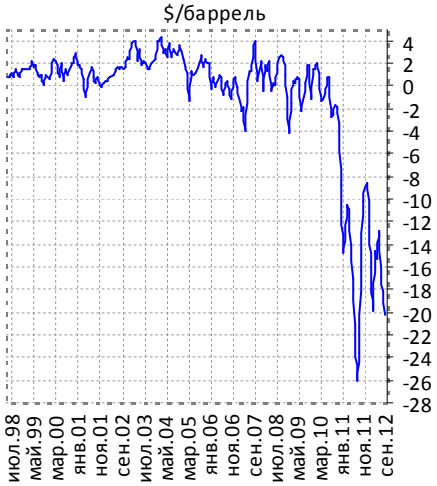
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



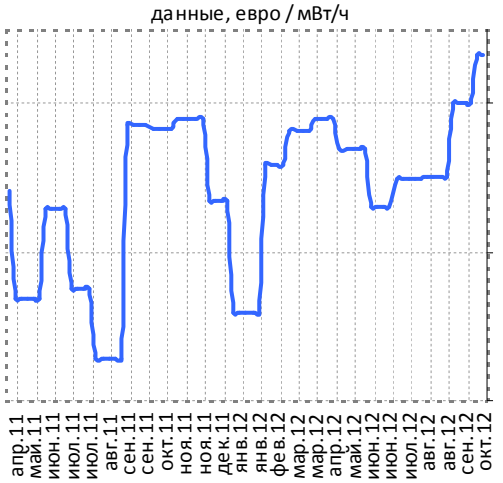
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



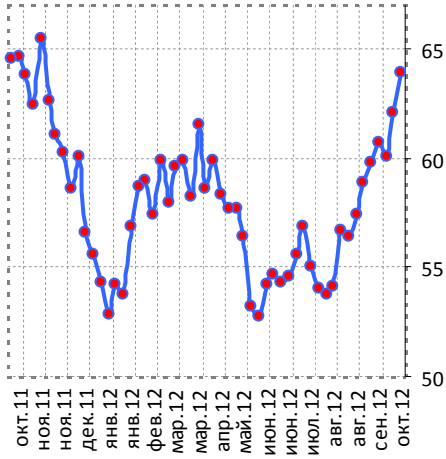
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

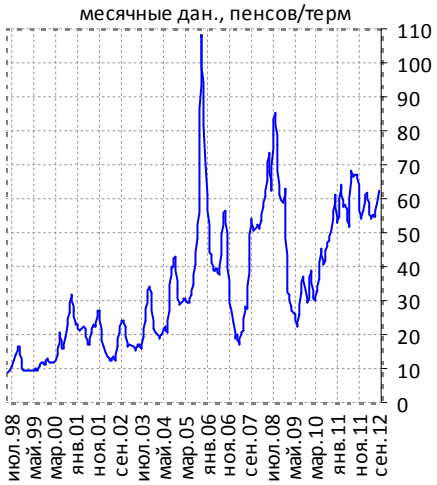
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



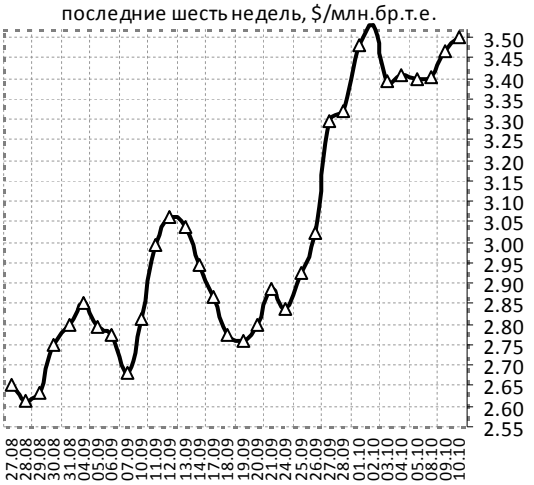
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



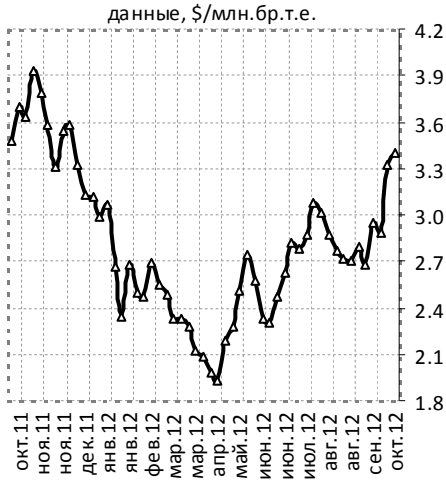
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



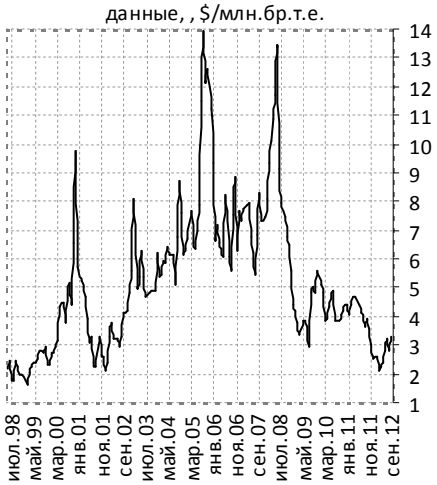
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



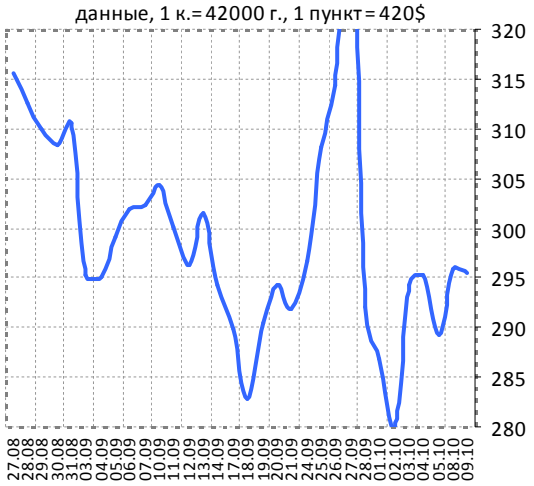
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



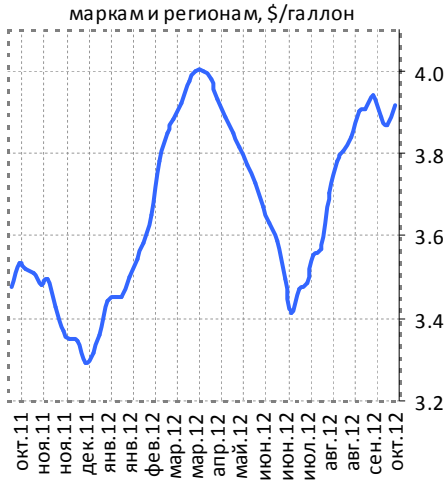
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



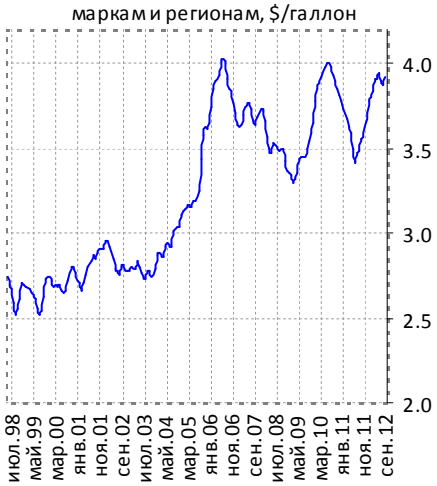
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



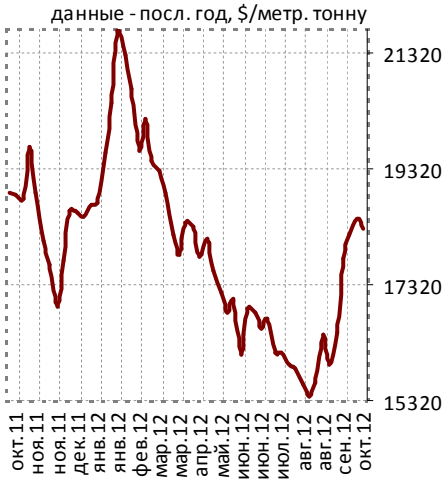
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

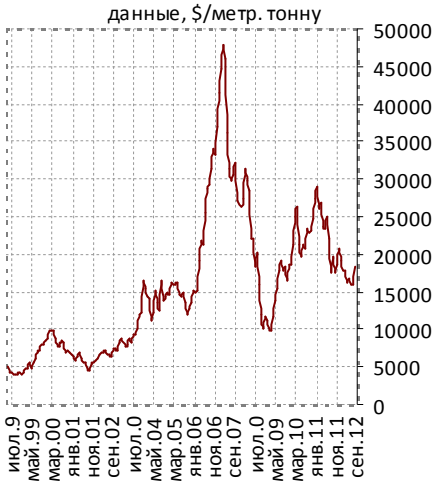
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



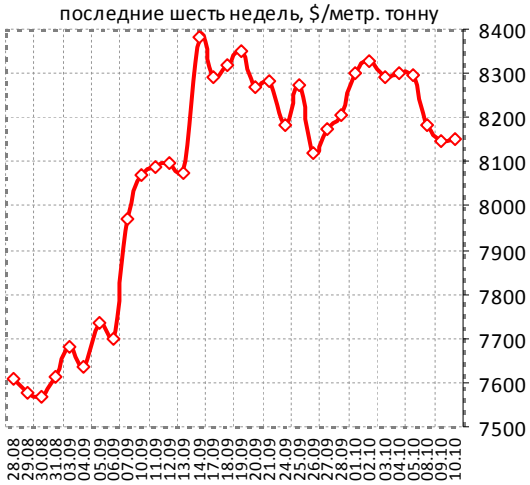
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



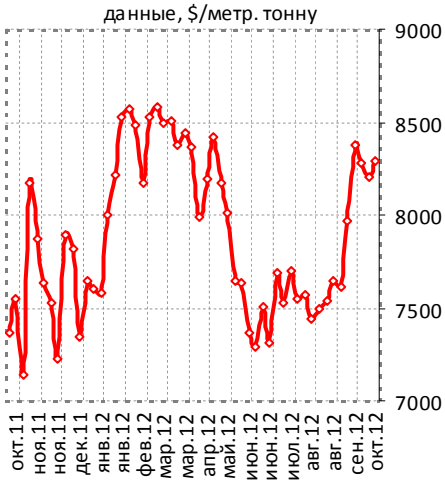
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



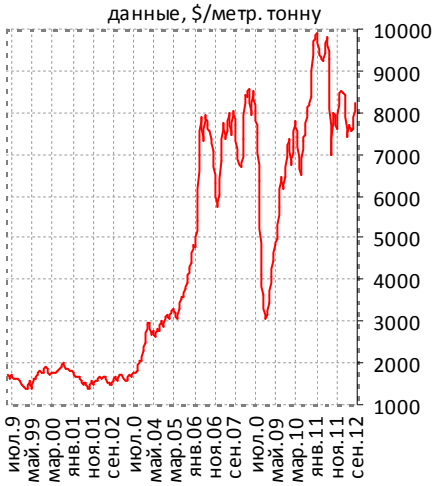
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



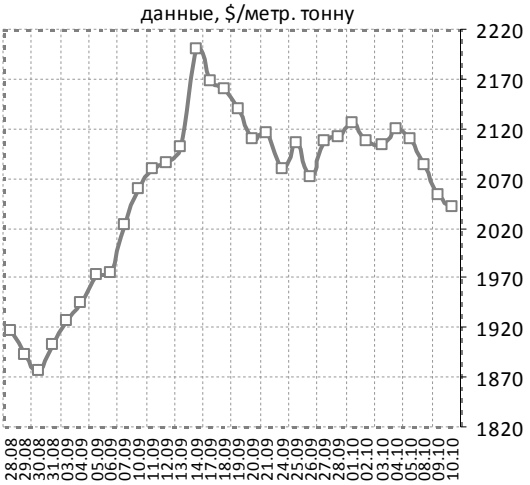
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



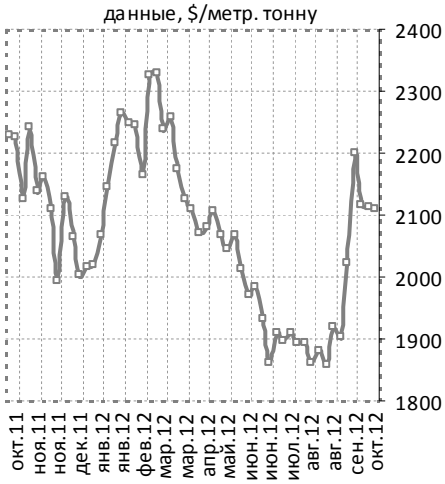
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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.