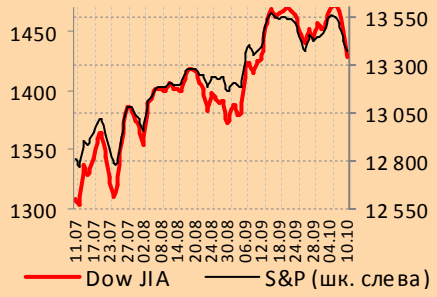
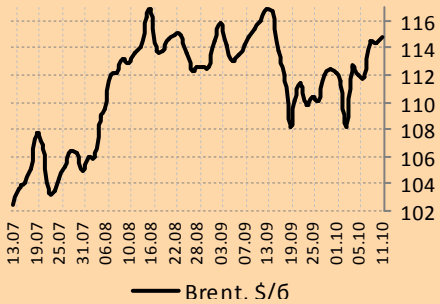
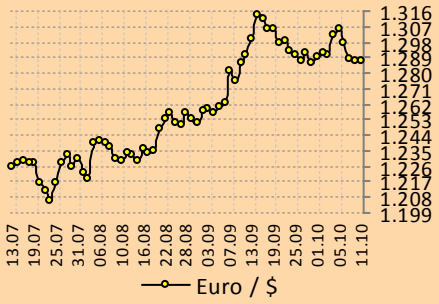
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

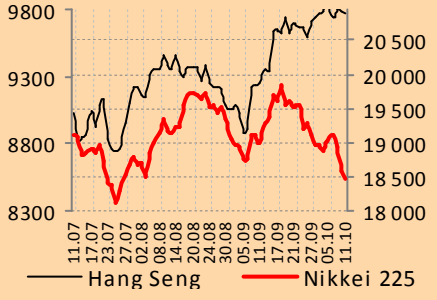
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

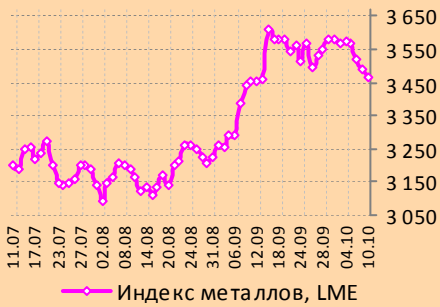
Ежедневный обзор

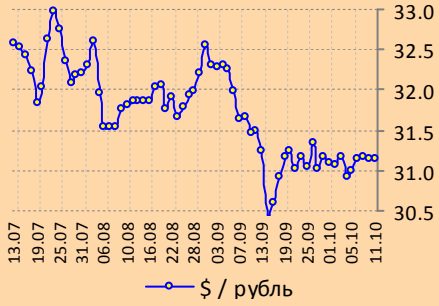






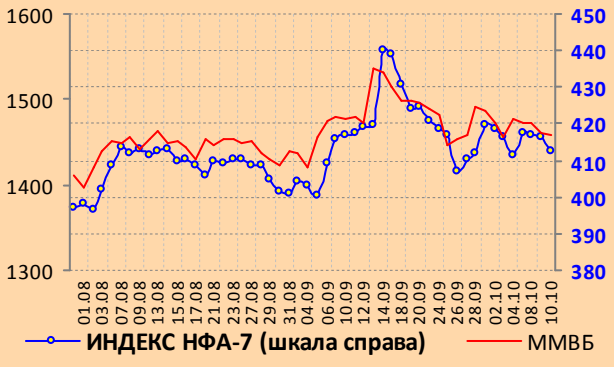






СОДЕРЖАНИЕ

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. Торги среды закрылись минусом (индекс Dow Jones =-0,95, S&P =-0,62, NASDAQ =-0,43%), биржи отыграли запоздалую реакцию на отчетность Alcoa. Компания Costco Wholesale отчиталась о 27%-м росте квартальной прибыли благодаря успешным продажам и снижению цен, что отчасти поддержало котировки. Второй день размещались гособлигации, это традиционно отвлекает часть капиталов с рынка акций. ФРС намерена в 2 этапа провести стресс-тесты крупнейших американских банков, на первом этапе банки будут проводить проверку самостоятельно, на втором этапе проведут тестирование по сценариям, разработанным ФРС.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, утренние попытки роста среды сменились в сторону общего негативного тренда, индекс ММВБ =-0,82, РТС =-0,69%.

Регулятор явно не расположен пополнять ликвидность банков в меру потребности. Вчера ЦБ предложил на утреннем аукционе прямого РЕПО на 1 день 70 млрд. руб., спрос составил 155 млрд., было выдано 69,2 млрд. под 5,9% (ставка рынка 6,0%). Вечером банки дополнительно просили 9 млрд. руб., но было выдано 0,6 млрд. под 6,4%.

ЦБ с октября ввел новый способ расчета максимальной ставки по депозитам населения, а именно без учета комбинированных депозитных продуктов. Новый расчет привел к понижению ставки примерно от 1 до 1,5%, в первой декаде октября максимальная ставка 10 банков с наибольшим объемом вкладов населения в рублях составила 9,4% (на 01.01.2012 была равна 9,514%). Превышение банками указанной ставки на 2 и более процентов сразу привлекает внимание ЦБ для принятия мер к понижению. Сбербанк России с сегодняшнего дня повышает процентные ставки по ряду срочных вкладов для физических лиц в рублях (размер повышения составит от 0,55 до 1,5%), выводы об уровне ставок Сбера относительно других банков сделать нетрудно.

Европа. Торги среды завершились в минусе, FTSE 100 =-0,58, DAX =-0,41, CAC 40 =-0,50%. Сегодня утром стало известно, что SandP понизило с BBB+ до BBB- долгосрочный кредитный рейтинг Испании, сразу на две ступени в связи с усилением экономических и политических риски. Краткосрочный суверенный рейтинг был снижен с A-2 до A-3.

Главная положительная новость прошла вчера незамеченной - тройка международных кредиторов одобрила план экономии греческого правительства. Теперь доклад будет представлен саммиту ЕС 18-19 октября. Итоги встречи еврогруппы фактически ограничились общими формулировками. По итогам визита канцлера Германии в Грецию были одобрены усилия греческого правительства по бюджетным реформам, но не более того. Правда, канцлер подчеркнула важность сохранения Греции в еврозоне, в том числе по экономическим соображениям (так, 60% немецкого экспорта приходится на ЕС). Премьер Греции, в свою очередь, отметил значимость нахождения страны в еврозоне как самой южной ее части в условиях обострения ситуации на Ближнем Востоке. Для Германии коалиционное правительство Греции является последней надеждой выполнения обязательств, необходимых для страны – участницы еврозоны. В случае неудачи, к власти придет оппозиция во главе с Алексисом Ципрасом, которая потребует полного изменения условий помощи.

Премьер-министр Великобритании заявил, что восстановление экономики страны займет больше времени, чем ожидалось ранее.

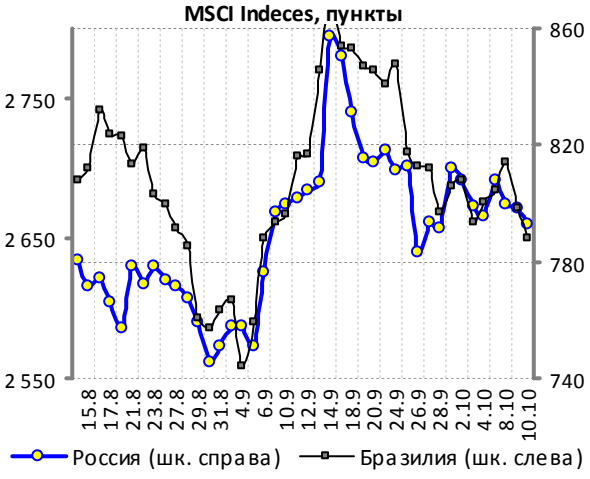
Азия. На торгах всреды рост показал только индекс SSE (+0,22%). Остальные биржи закрылись в минусе, Nikkei -1,98, Kospi -1,56, Hang Seng -0,08%. На азиатских инвесторов оказывает негативное влияние продолжение конфликта между Японией и Китаем. Министр финансов Китая и глава Народного банка даже отказались приехать в Токио на ежегодную сессию МВФ и Всемирного банка, представлять Китай будут заместители глав соответствующих ведомств. Инвесторы опасаются, что замедление темпов роста экономики Китая и ее территориальный спор с Японией негативно отразятся на корпоративных прибылях.

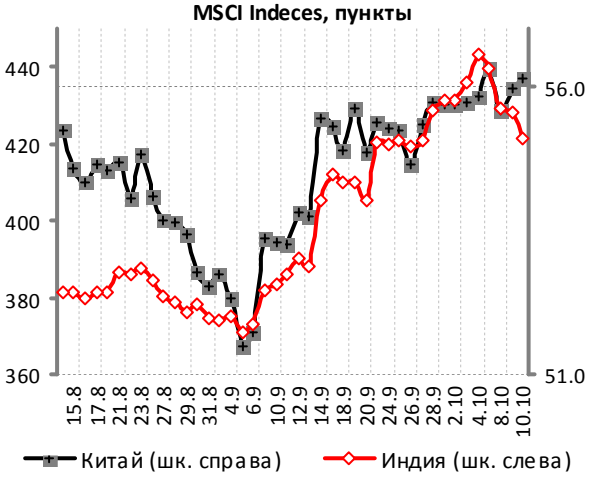
Золото. Укрепление доллара удерживает цены драгметаллов от роста, утром среды фьючерсы на золото торговались по 1765,75, к 14.00 по 1763,38, сегодня утром золото = 1765,26, серебро = 34,05, платину = 1674,5, палладий = 645,35 долл. за унцию.

Нефть. Очередные слухи о возможности атаки Израиля на ядерные объекты Ирана, а также решение НАТО поддержать Турцию в конфликте с Сирией держит цены нефти на высоком уровне, динамика доллара действует в обратном направлении. В результате Brent и Light с утра среды шли по 114,08 и 91,92, к 14.00 по 112,82 и 92,08, сегодня утром по 114,84 и 91,53 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем по США: данные по рынку труда (16.30), данные об изменении запасов нефти и нефтепродуктов (19.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия в минусе, нефть замерла, хотя и находится на достаточно высоком уровне. Российские биржи, несмотря на комфортную цену нефти, последуют в русле общей негативной реакции инвесторов на понижение рейтинга Испании.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 11.10.2012

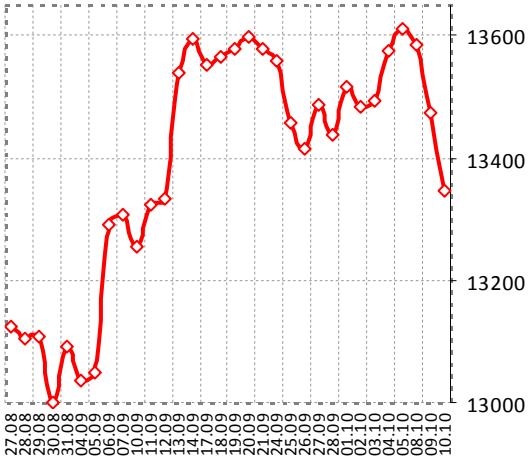




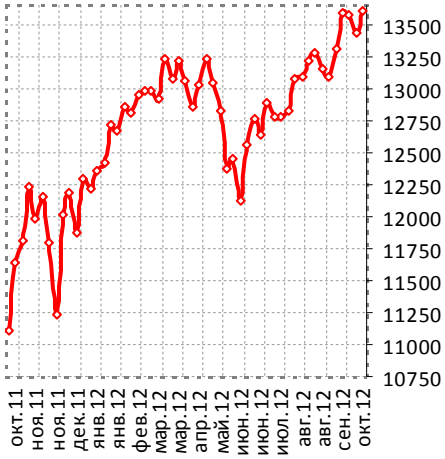
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

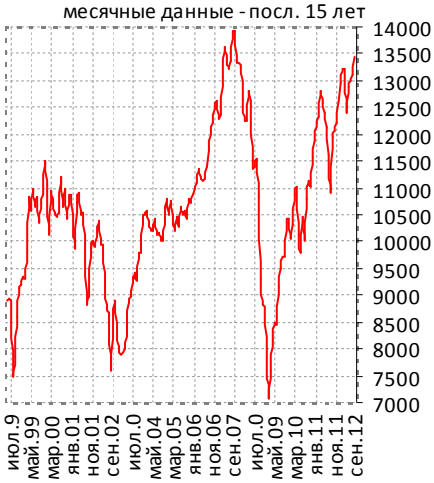
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



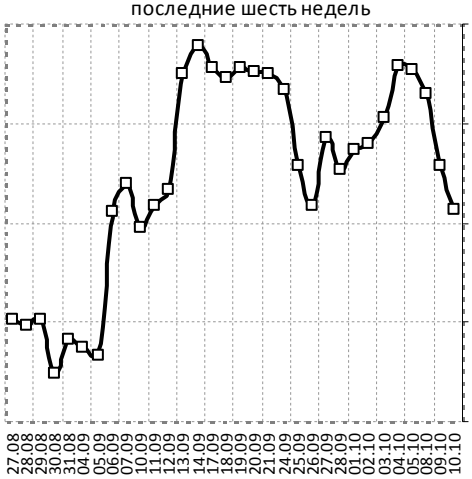
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



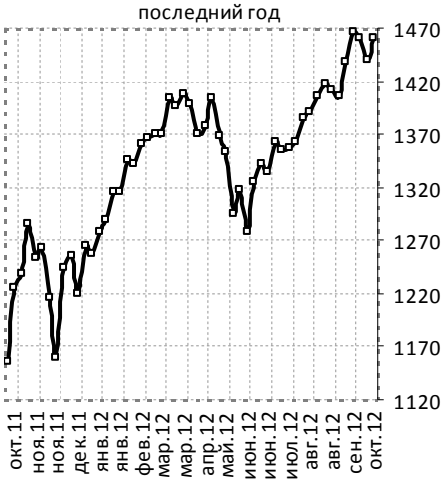
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



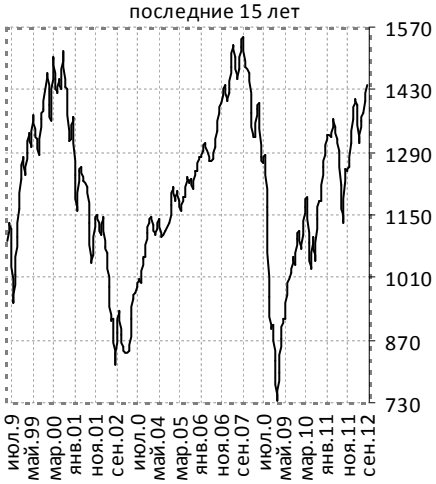
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



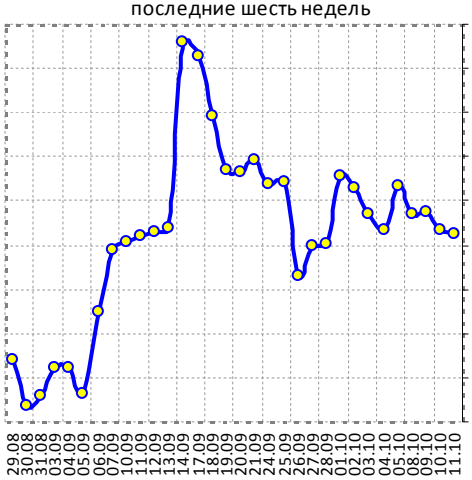
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



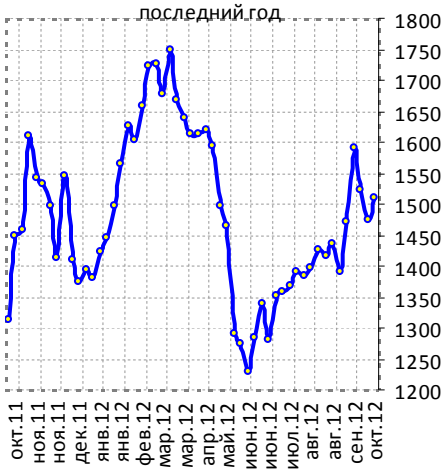
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



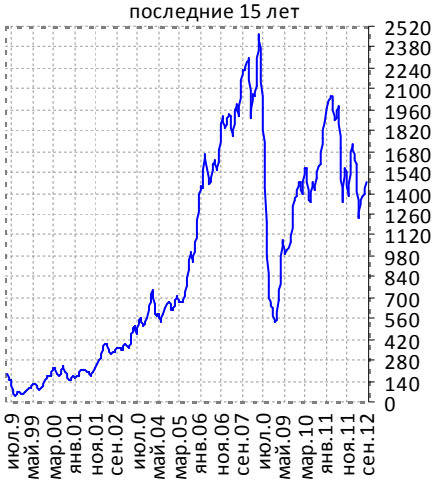
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



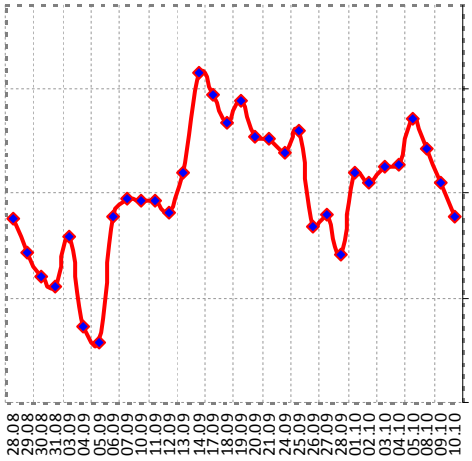
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



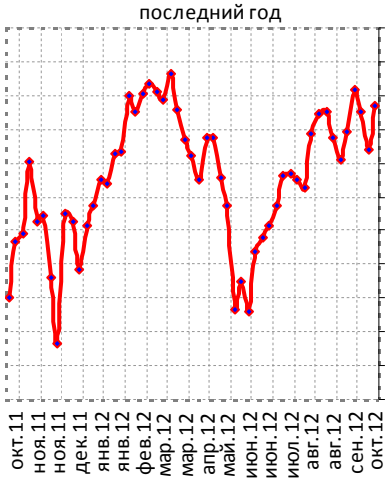
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

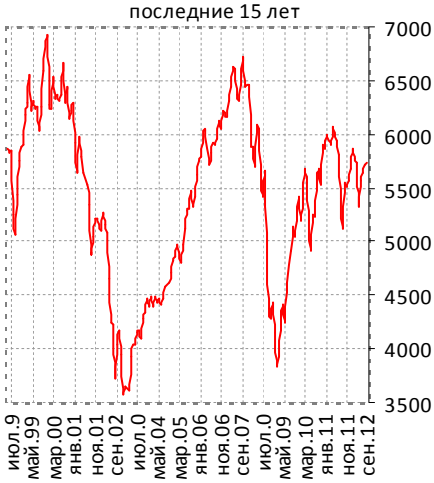
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



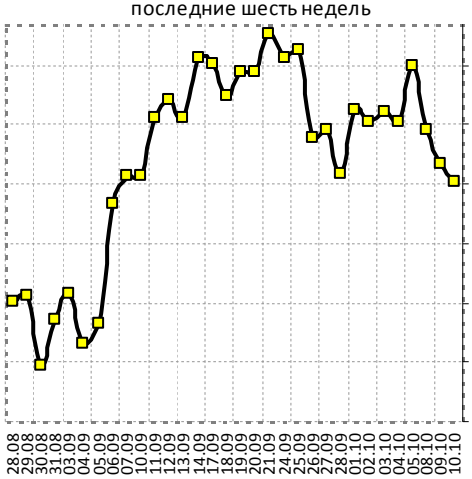
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



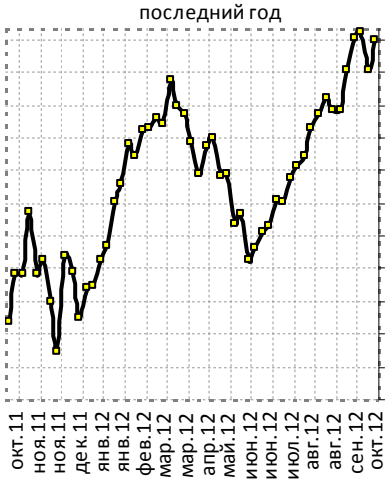
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



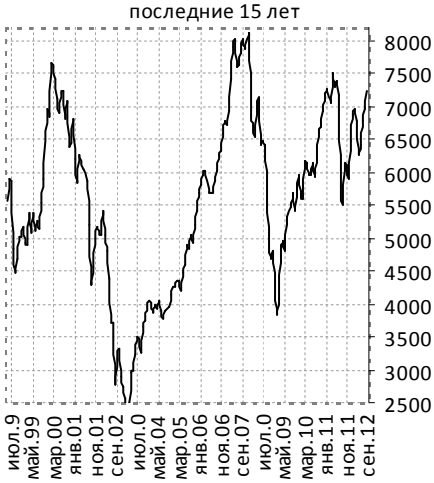
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



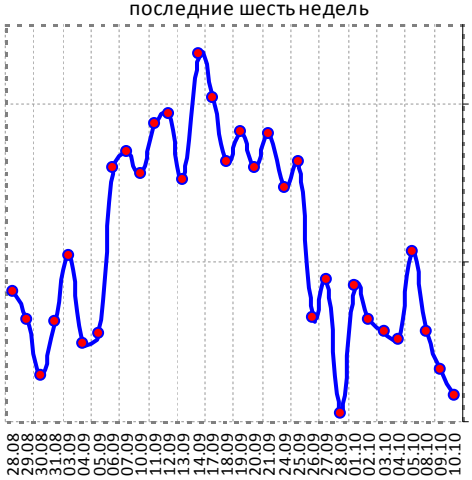
DAX Index: недельные данные - последний год



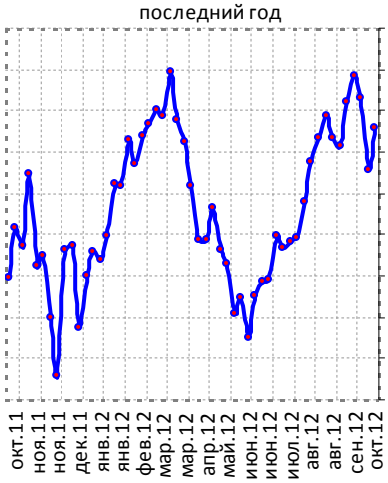
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



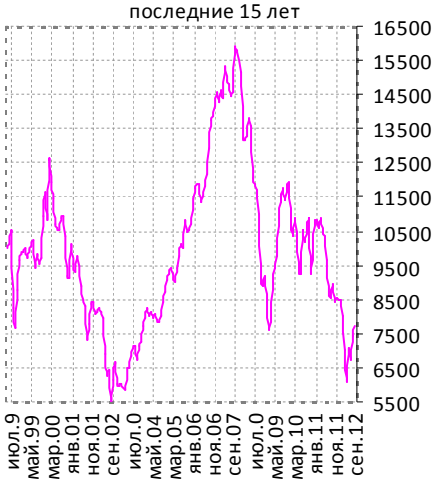
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

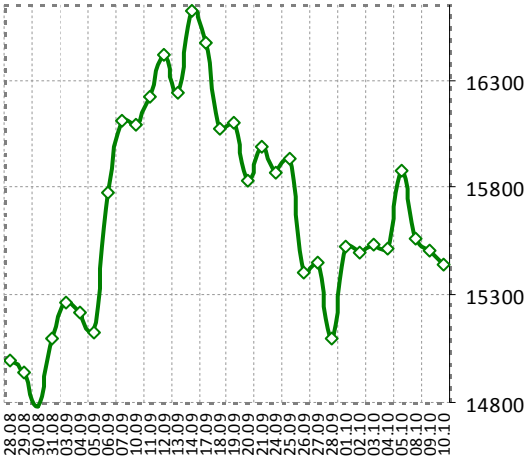


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

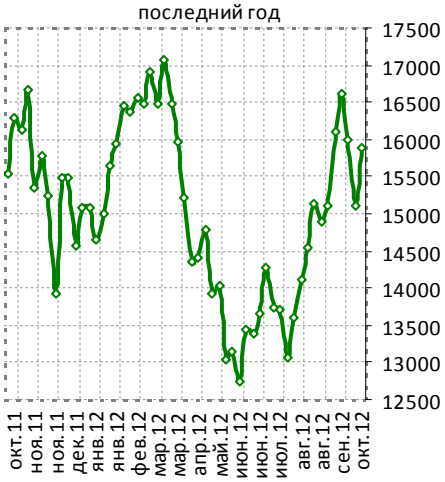


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



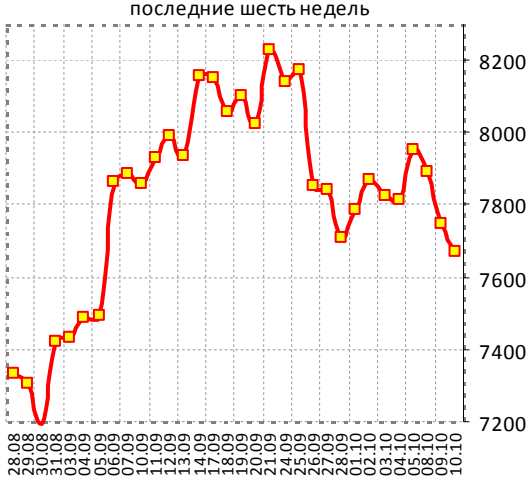
MIB Index: недельные данные - последний год



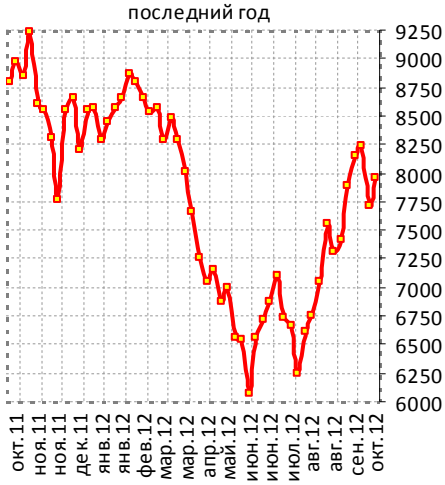
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



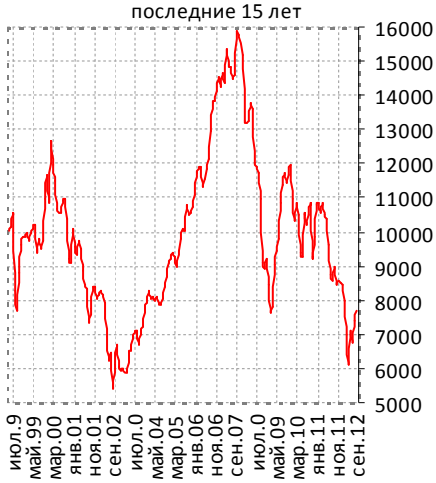
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



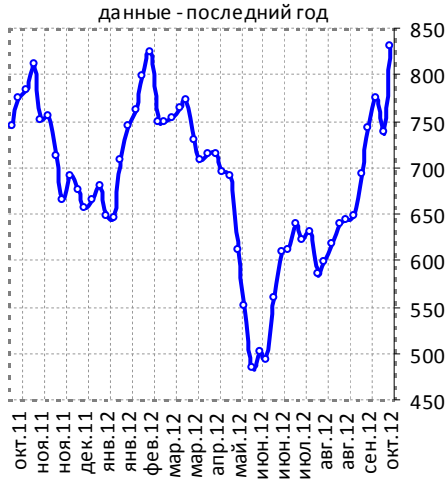
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



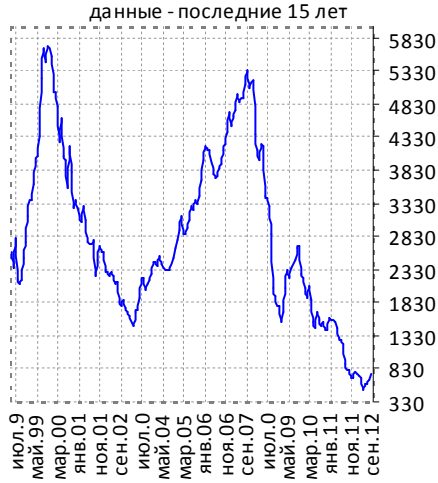
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



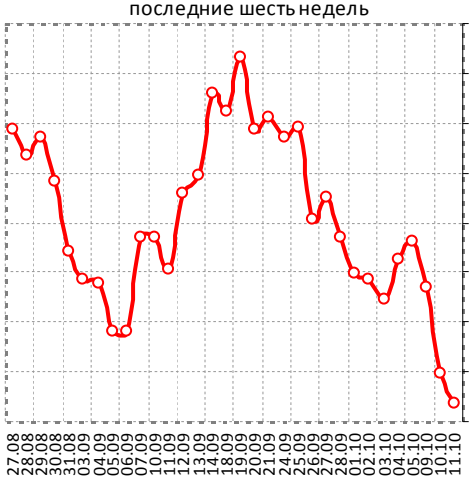
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



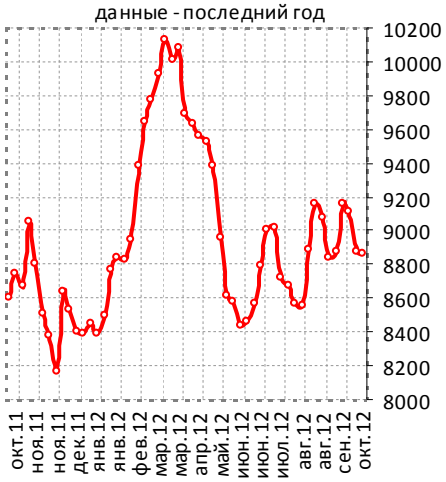
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

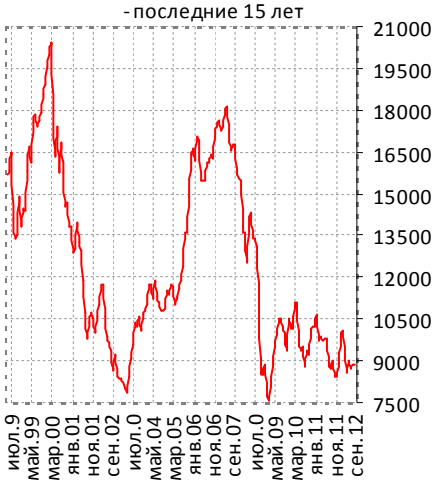
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



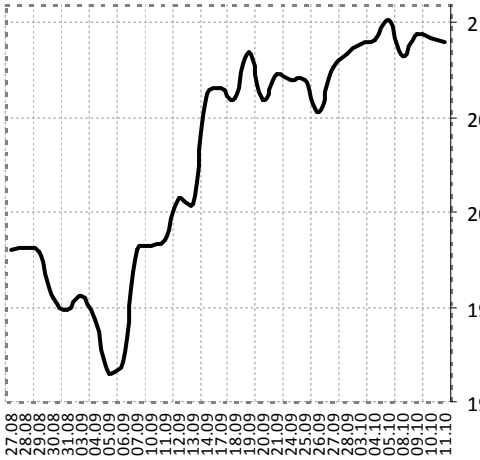
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



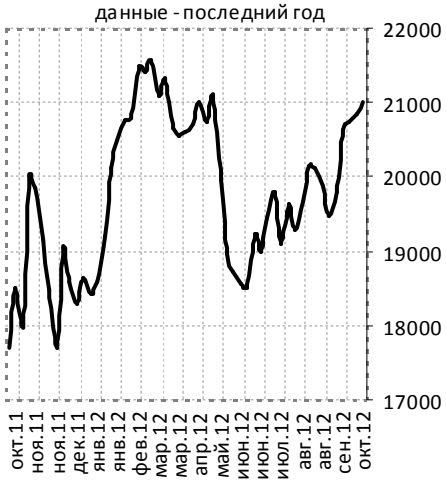
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



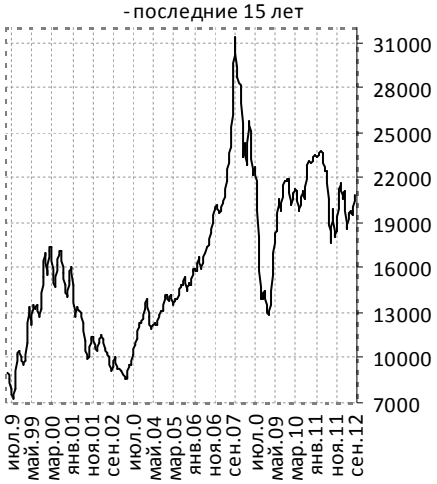
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



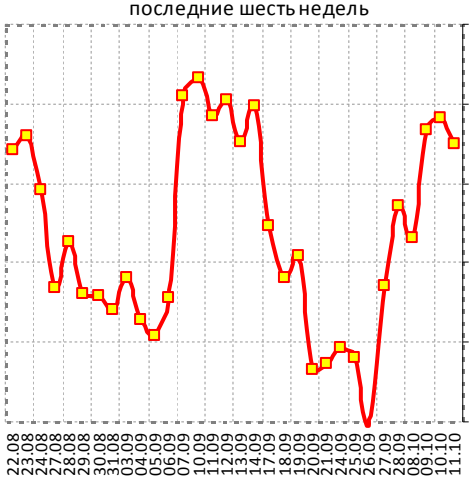
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



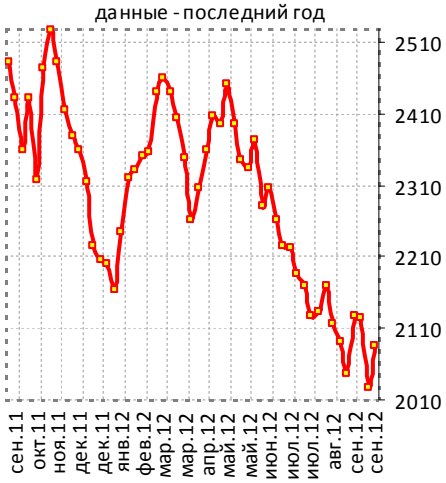
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



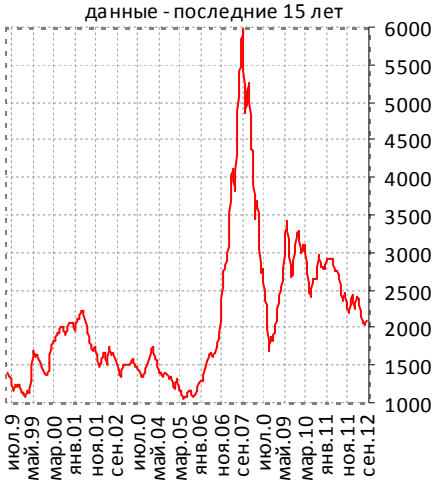
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



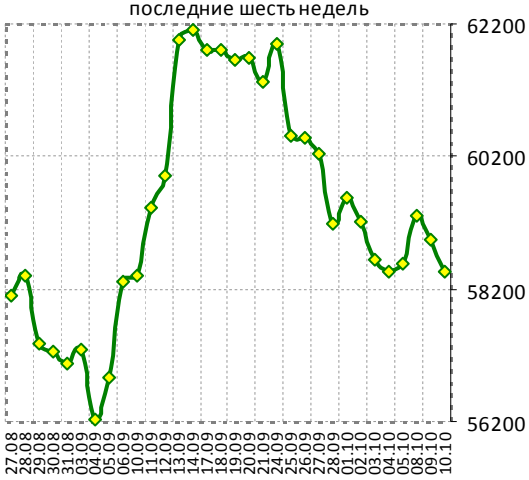
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



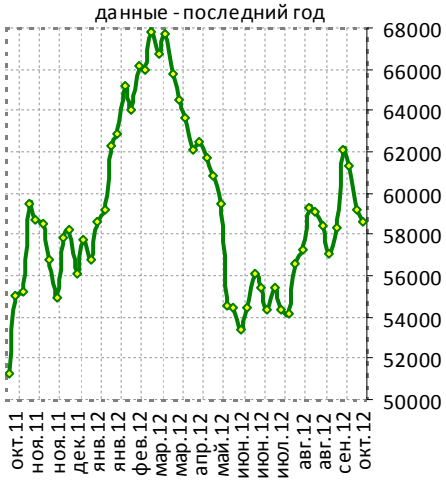
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

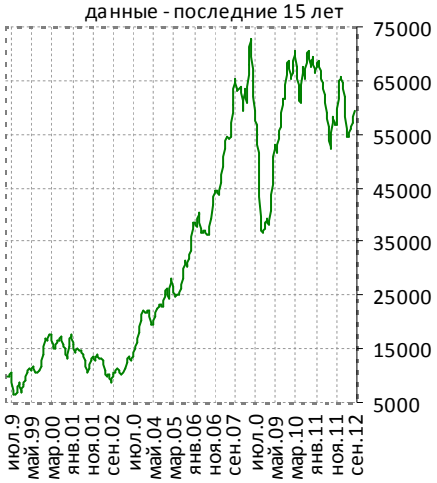
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



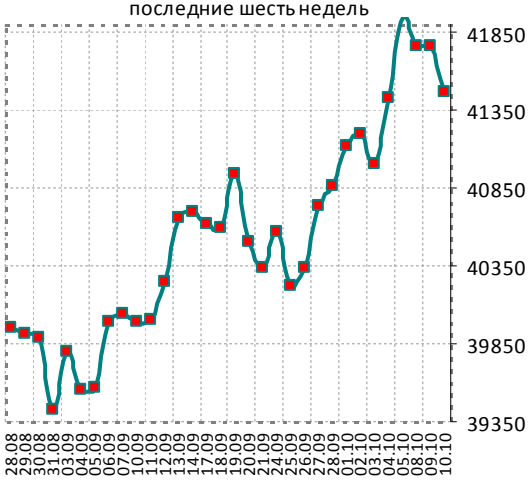
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



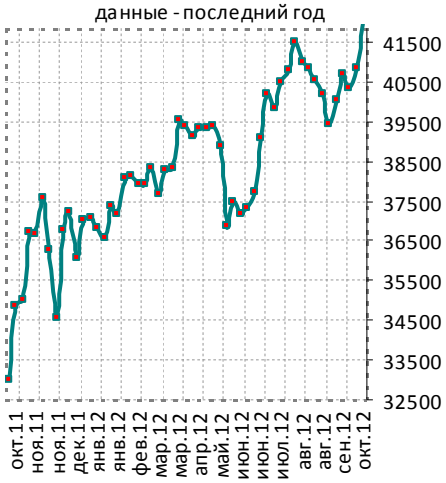
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



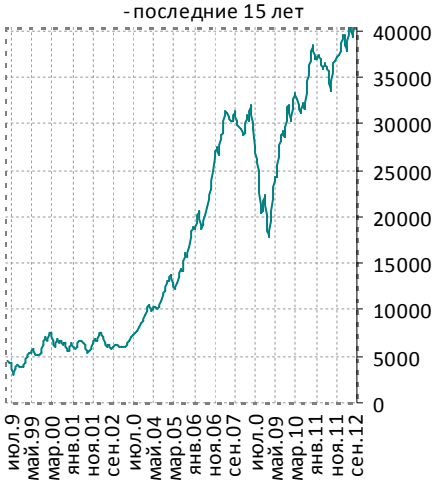
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



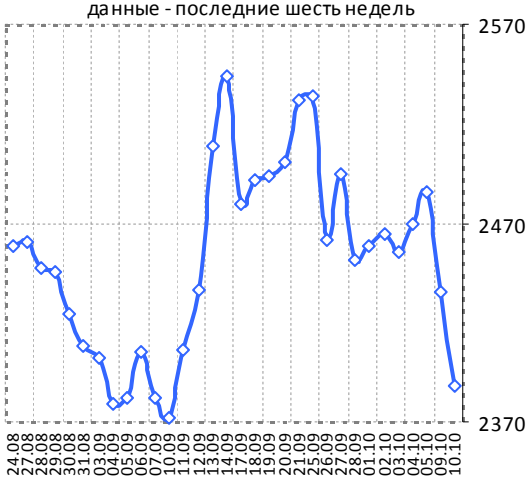
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



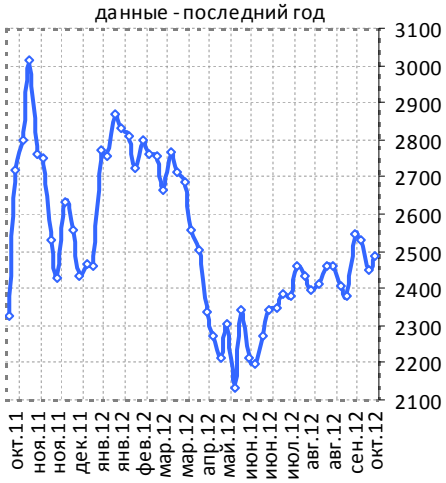
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



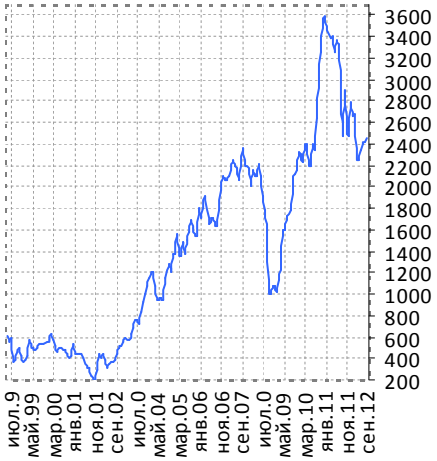
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

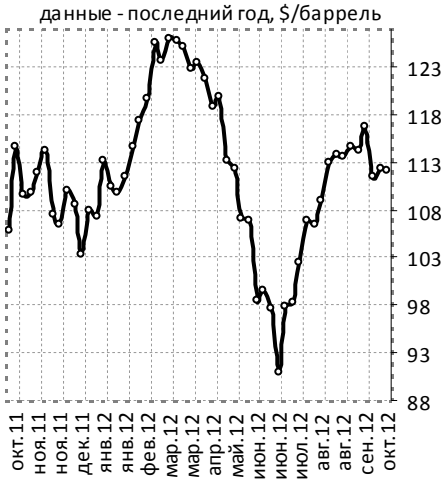
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

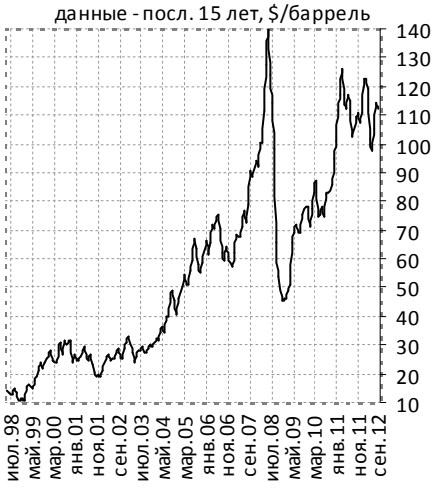
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



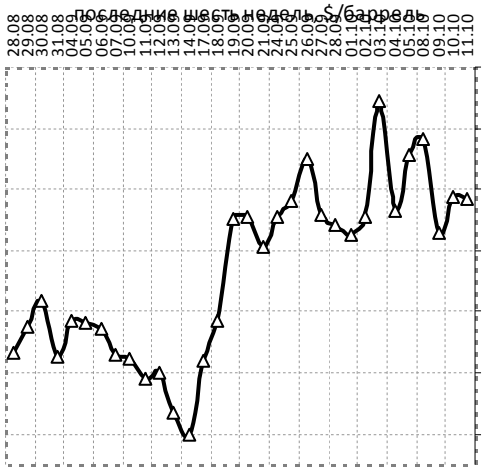
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



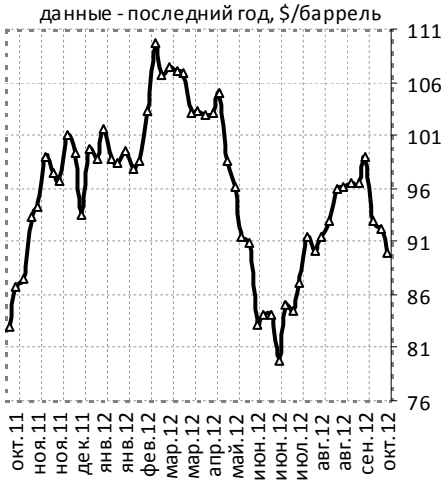
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



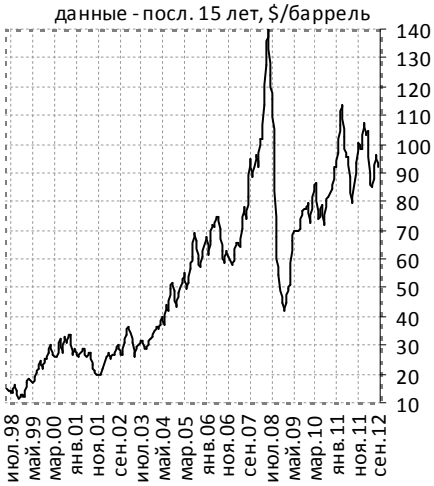
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



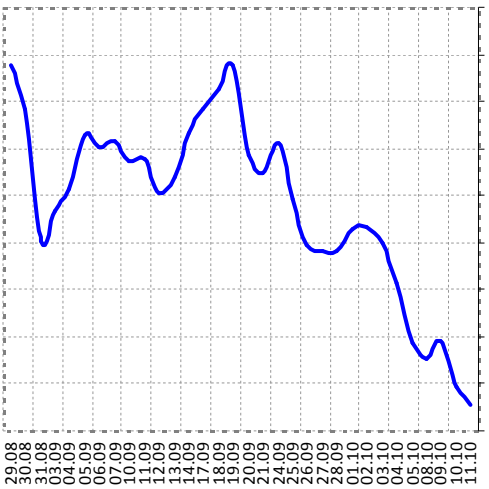
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



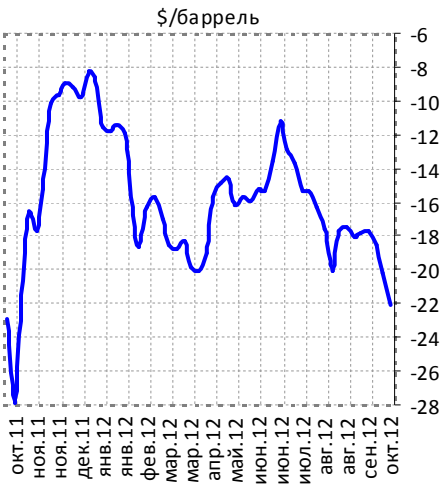
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



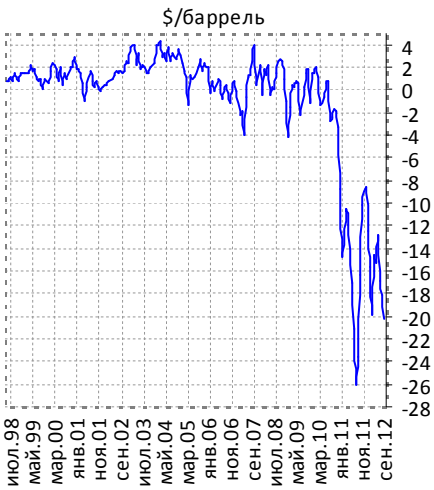
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



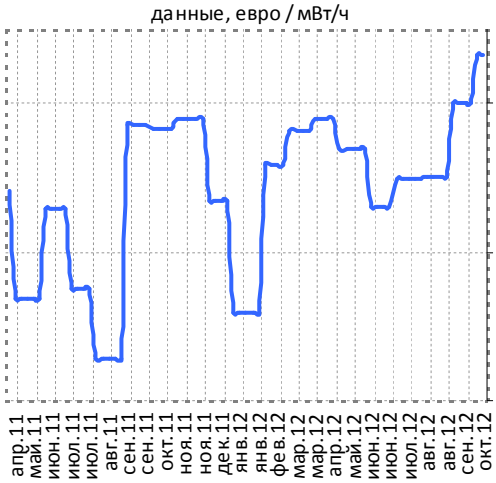
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



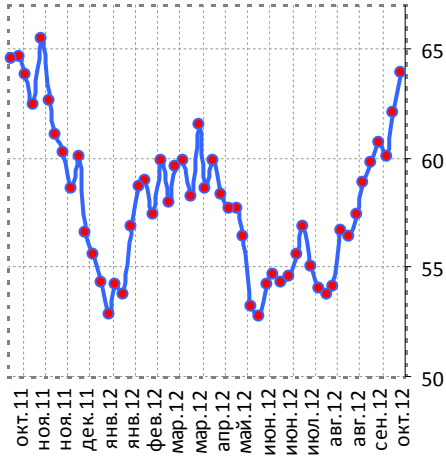
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

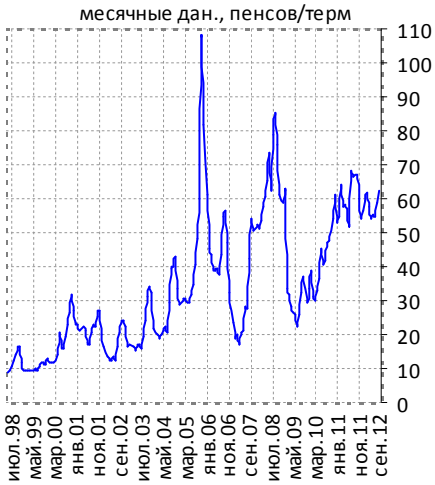
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



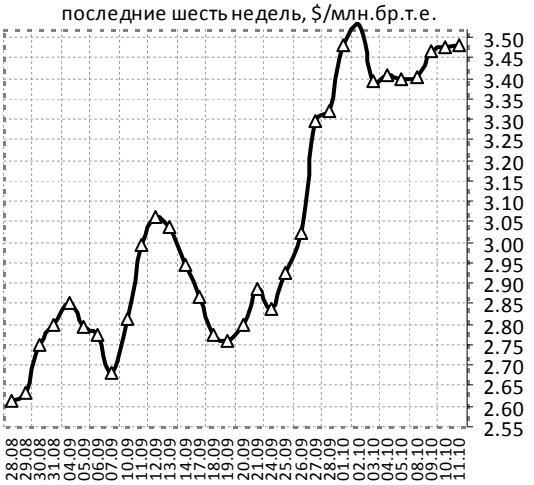
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



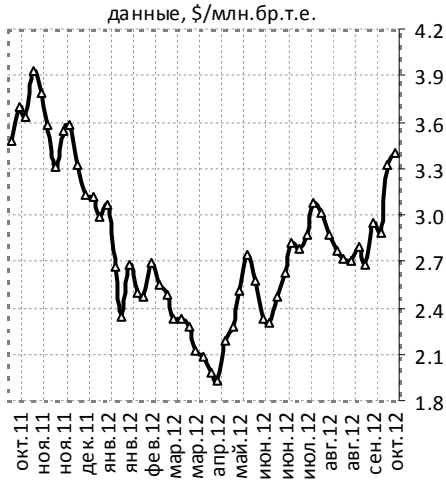
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



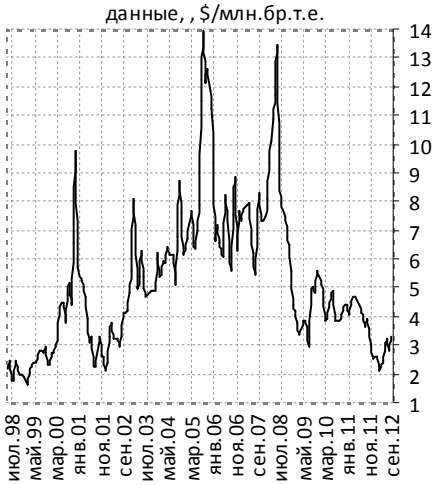
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



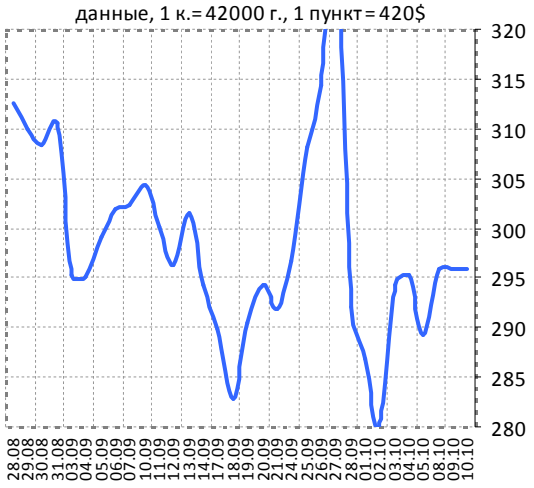
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



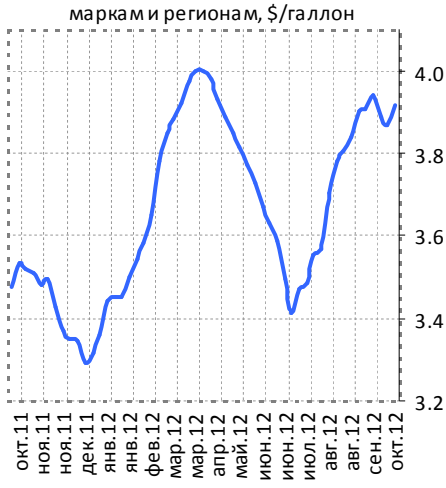
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



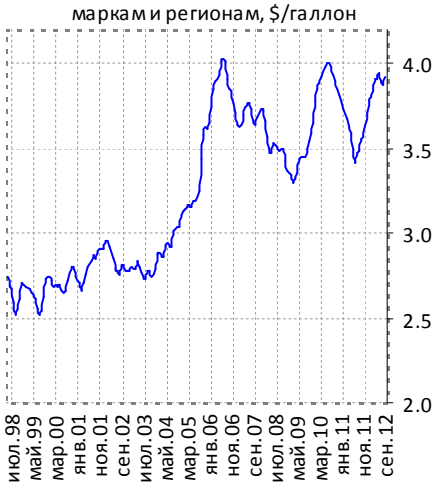
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



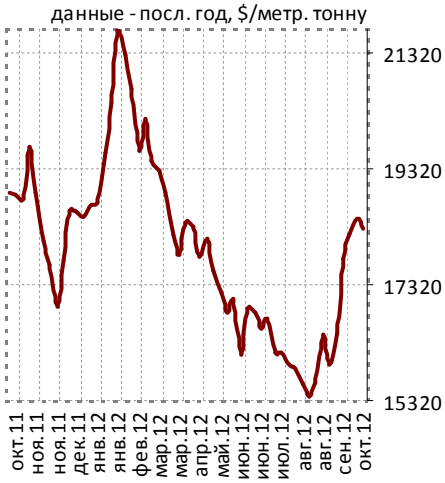
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

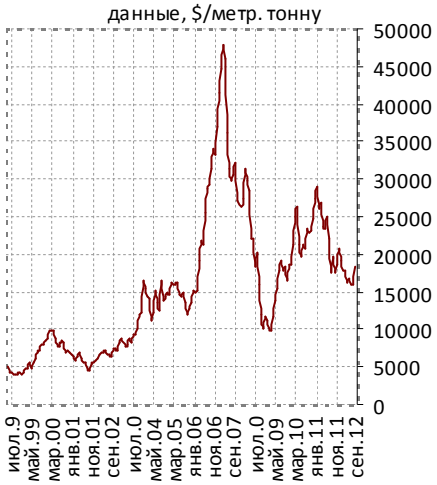
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



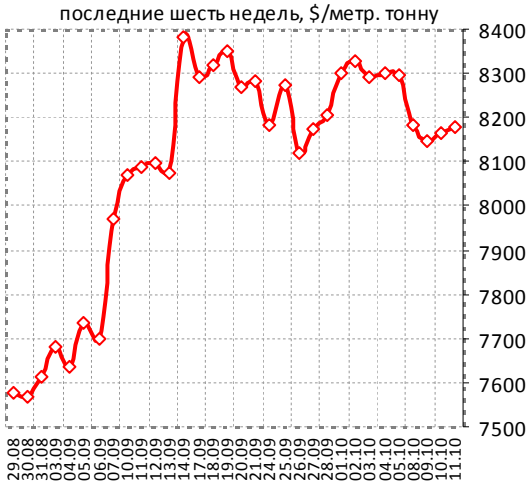
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



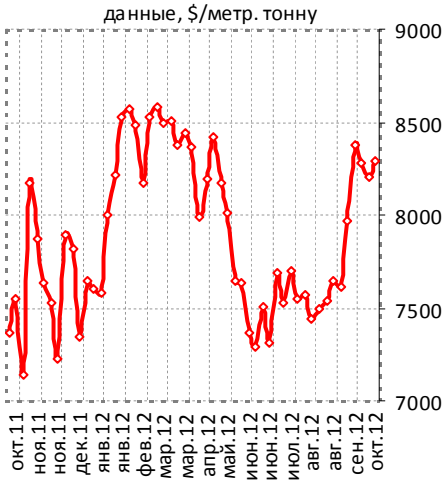
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



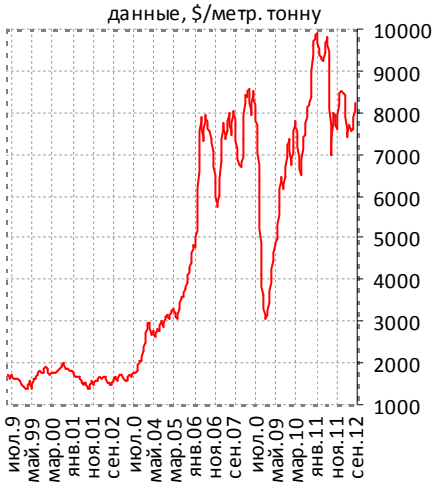
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



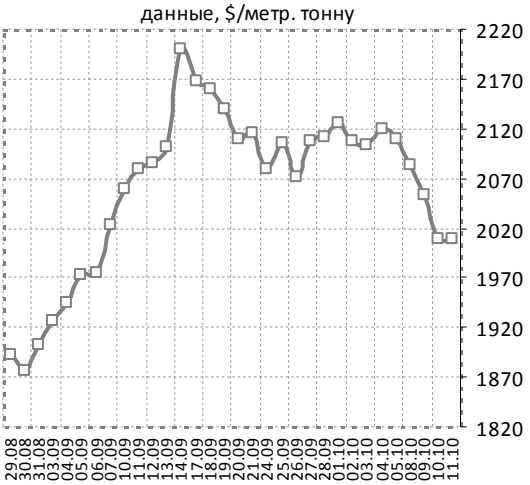
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



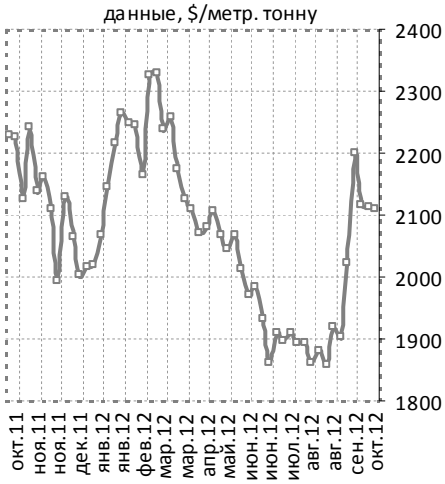
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



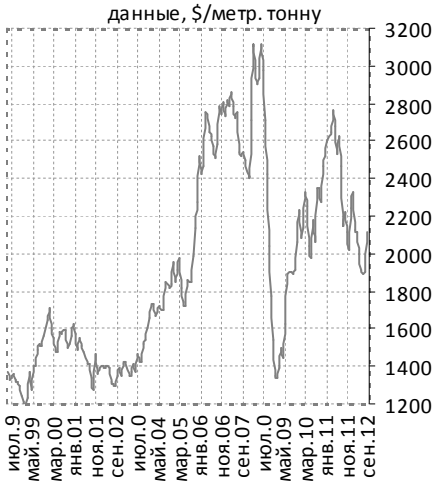
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.