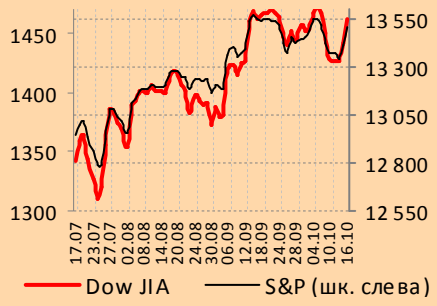
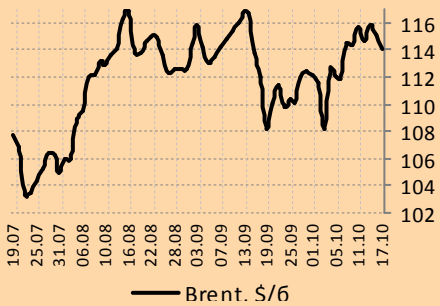
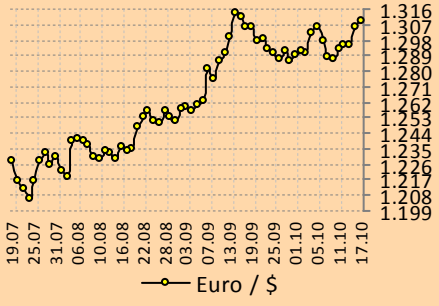
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

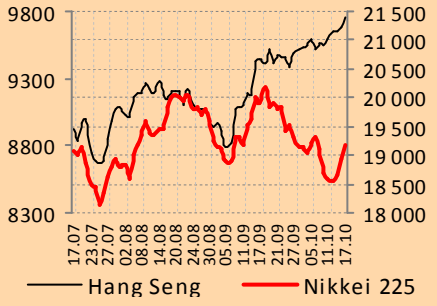
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

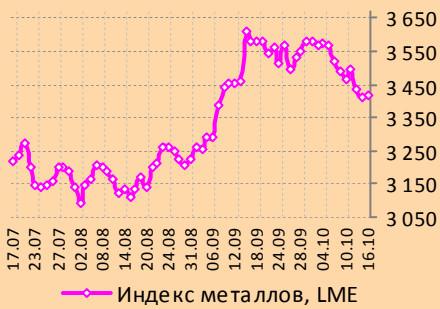
Ежедневный обзор

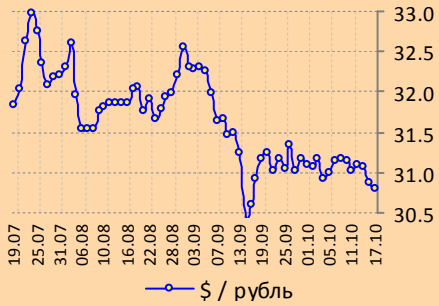






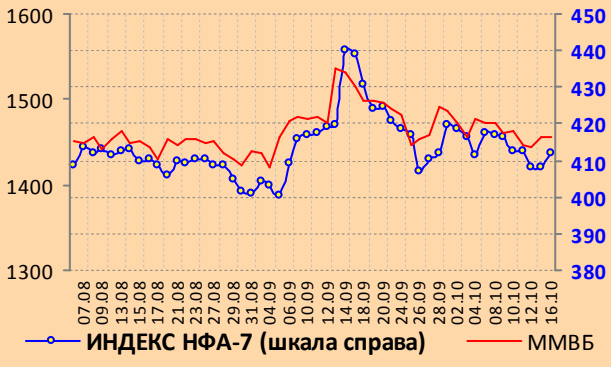






СОДЕРЖАНИЕ

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 вторника завершились ростом, индекс Dow Jones =+0,95%, NASDAQ =+1,21, S&P =+1,03%. Из макроэкономических показателей отметим рост потребительских цен с учётом сезонности за месяц на 0,6% относительно предыдущего месяца, ожидался рост на 0,5%. Зато базовая инфляция (без учета продуктов питания и энергоносителей) выросла меньше, чем ожидалось, соответственно на 0,1 и 0,2%.

Продолжается публикация отчетности. Так, прибыль Goldman Sachs Group превзошла прогнозы благодаря доходам по акциям и облигациям, а также росту выручки от инвестиционной деятельности. При этом прибыль на акцию равна 2,85 (ожидали 2,12) долл. по сравнению с убытком в 84 цента годом ранее, размер квартального дивиденда повышен с 46 до 50 центов на акцию. Крупнейшая в США компания в сфере страхования здоровья UnitedHealth Group не только показала 23%-ный рост прибыли в третьем квартале, но и повысила прогнозы на текущий год, чистая прибыль составила 1,50 долл. на одну акцию по сравнению с 1,17 долл. годом ранее.

Второй раунд дебатов между кандидатами в президенты показал изменение предпочтений избирателей в сторону действующего президента (соответственно 47 и 45%).

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, индексы выросли, ММВБ на 0,88, РТС на 1,46%. Казначейство размещало средства бюджета на банковских депозитах в сумме 37 млрд. руб., спрос составил 26 млрд., ставка 7,2%, возврат депозитов 16 января 2013 г. До этого размещения на депозитах банков под проценты уже находилось 608 млрд. руб. бюджетных денег. Учитывая, что с начала года профицит федерального бюджета составил 636 млрд. руб., можно видеть, что значительная его часть помещена в банки. Отметим также, что с начала года промпроизводство выросло на 2,9%, при этом цены промпроизводителей выросли на 9,4%, что вызывает вопросы относительно факторов роста цен и может ускорить инфляцию (сейчас она равна 5,2%).

Мы писали о принципиальном согласии правительства РФ повысить объем гарантированных страхованием вкладов с 700 тыс. до 1 млн. руб. Разработка конкретного механизма действия новой нормы еще не закончена, но, в частности, стало известно, что ЦБ в этой связи предполагает ужесточение контроля над депозитными ставками, если банк хотя бы в одном договоре превысит максимально допустимый уровень, сумма квартальных отчислений с базовых 0,1 от объема вкладов вырастет до 0,14%.

Сегодня банки возвращают в ЦБ основную сумму недельного кредита РЕПО в 1077 млрд. руб. плюс проценты по кредиту. С учетом этого вчера ЦБ предоставил кредит на 1 день в сумме спроса в 213 млрд. руб. под ставку от 5,7 до 6,35% (ставка рынка 6,25%), а также на 7 дней в сумме спроса в 1195 млрд. руб. под 5,54%.

Минфина размещает 15-летние ОФЗ в объеме 40 млрд. руб. в интервале доходности от 7,02% до 8,00%.

Европа. Биржи по-прежнему полны оптимизма в связи с нобелевской наградой, FTSE 100 =+2,17, DAX =+1,58, CAC 40 =+2,36%. Между тем, новая статистика по еврозоне имеет неоднозначный характер. Так, до 2,6% снизилась инфляция (правда, комфортным уровнем считается 2,5%), но снизился и профицит торгового баланса. SandP понизило кредитный рейтинг крупнейших банков Испании (включая Banco Santander и Banco Bilbao), что после понижения странового рейтинга было ожидаемым и вряд ли окажет серьезное влияние на поведение инвесторов. В Германии улучшились экономические ожидания инвесторов, соответствующий индекс за месяц показал рост с -18,2 до -11,5 пункта при ожиданиях в -15,0 пункта. Снизилась инфляция в Великобритании, с 2,5 до 2,2%. Поддержку инвесторам оказала информация от Минэкономики Испании о подготовке к официальному обращению страны за финансовой помощью евросоюза. В Мадриде начали работу инспекторы МВФ по оценке финансового сектора Испании в рамках соглашения об оказании помощи банковскому сектору страны. Греции разместила трехмесячные госбумаги с доходностью 4,24%, что на 7 базисных пунктов ниже, чем в ходе предыдущего аукциона.

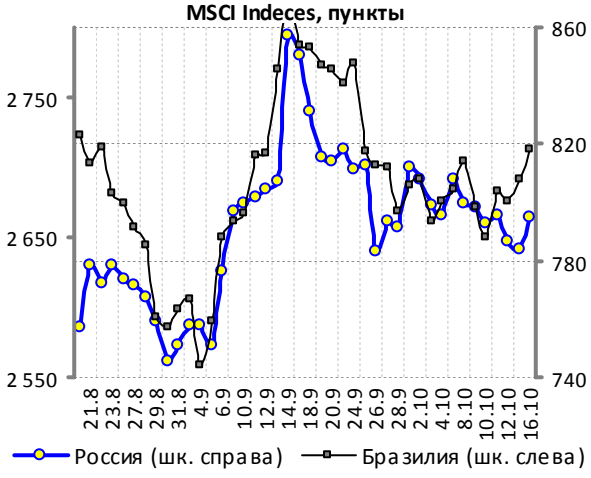
Азия. Итоги торгов вторника, вслед за позитивным закрытием бирж США, тоже в плюсе, Nikkei +1,44, Hang Seng +0,28, SSE +0,01, Kospi +0,83%. Значительный рост котировок в Японии наблюдался особенно для предприятий экспортеров и обусловлен ослаблением иены. Так, котировки акций Sony росли выше рынка до 2,4%, Softbank до 9,6%. А низкая инфляция в Китае усиливает ожидания, что Народный банк возобновит политику снижения ставок и резервных требований.

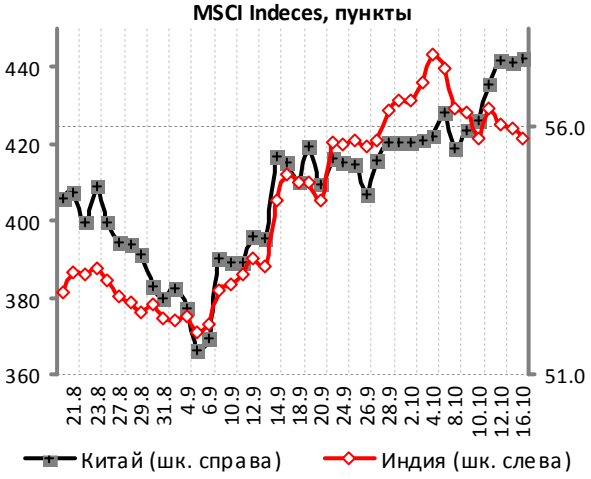
Золото. Ослабление доллара привело к повышению цен драгметаллов, с утра вторника фьючерсы на золото торговались по 1738,4, к 14.00 по 1741,04, сегодня утром золото = 1753,34, серебро = 33,1, платина = 1658,1, палладий = 642,5 долл. за унцию.

Нефть. Нефть находится под воздействием противоречивых факторов текущего характера. Так, с одной стороны, ЕС ужесточил санкции против Ирана, в частности, введен запрет на импорт природного газа в ЕС. С другой стороны, инвесторы ждут сегодня отчет по запасам нефти в США, опасаясь их роста. В результате Brent и Light утром вторника шли по 115,6 и 91,74, к 14.00 по 114,53 и 92,36, сегодня с утра по 113,92 и 92,2 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем по Великобритании протоколы октябрьского заседания Банка Англии и уровень безработицы (12.30), по США данные об объеме начатого строительства (16.30) и запасы нефти и нефтепродуктов (18.30). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются разнонаправлено, Азия растет, цены нефти снижаются. Российские биржи, не получая поддержки от нефти, могут расти только при сильной внешней поддержке.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 17.10.2012

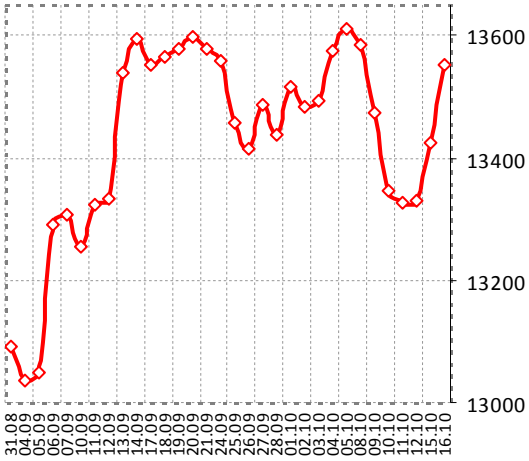




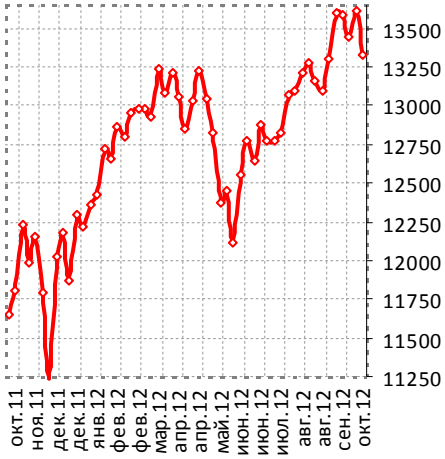
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

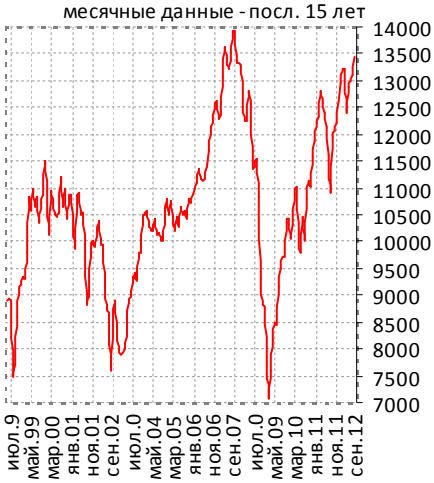
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



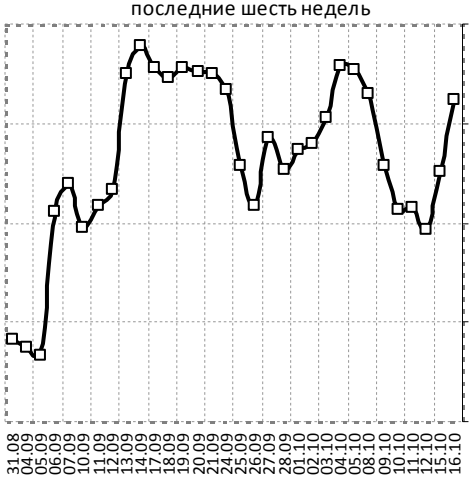
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



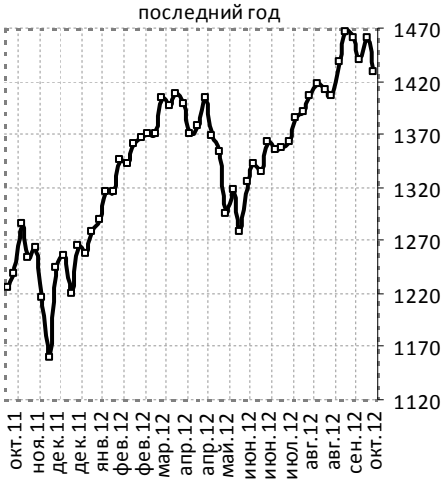
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



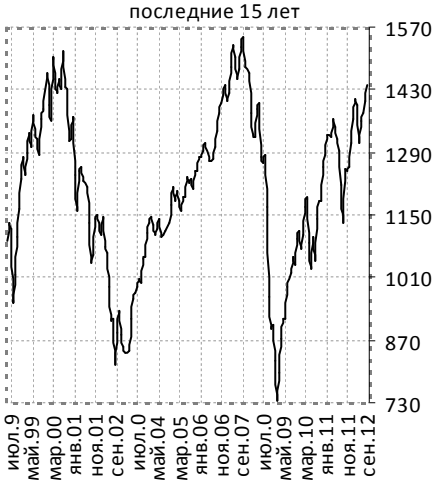
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



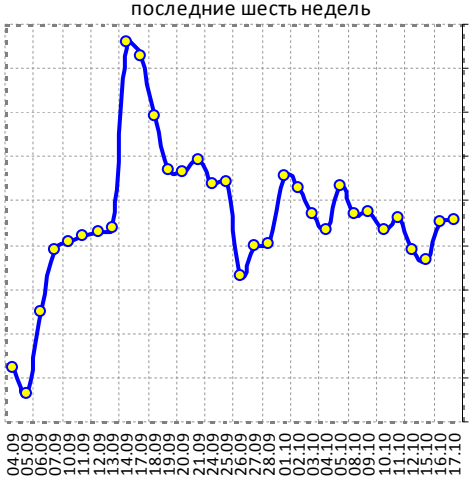
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



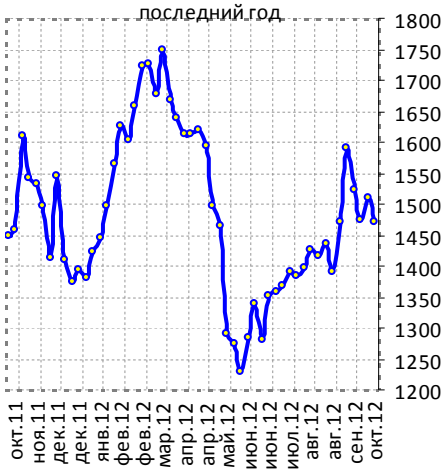
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



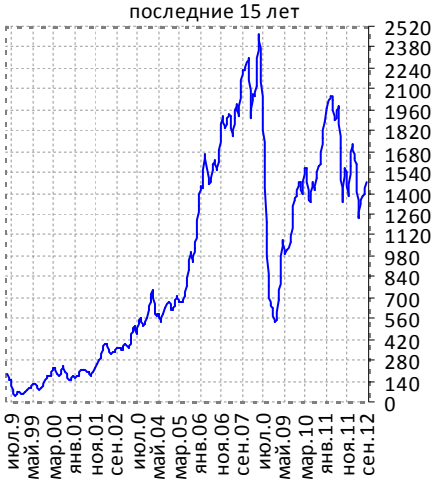
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



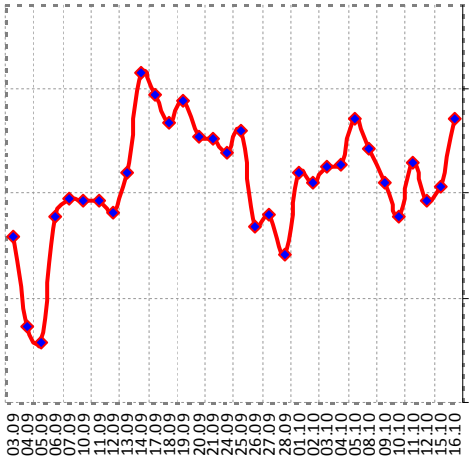
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



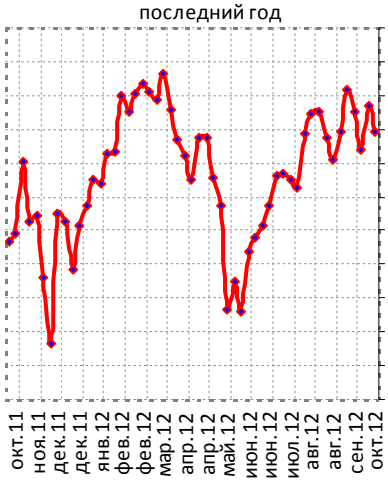
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

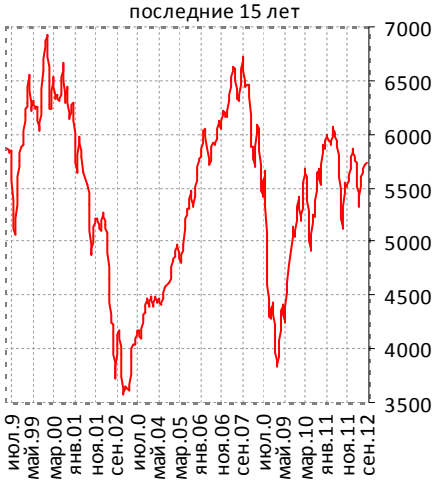
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



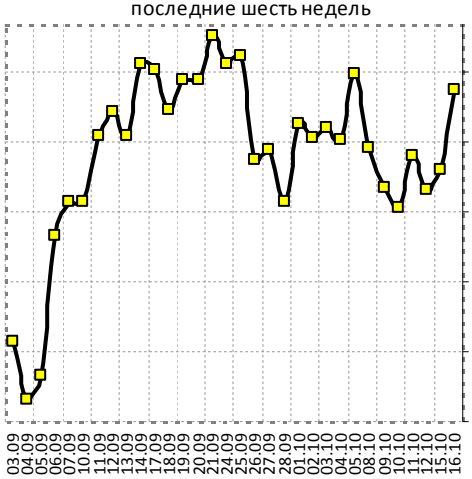
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



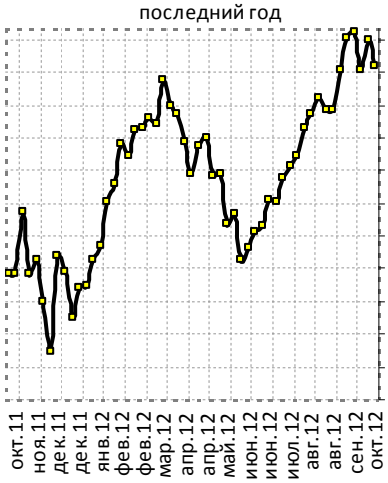
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



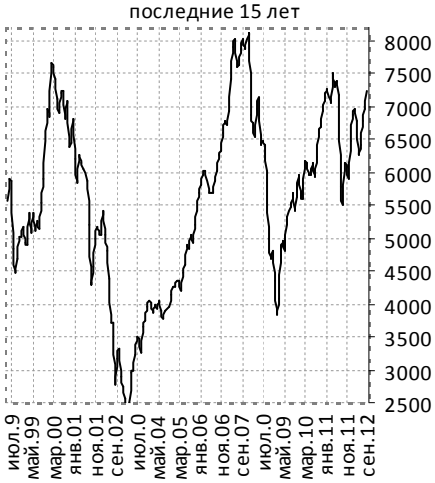
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



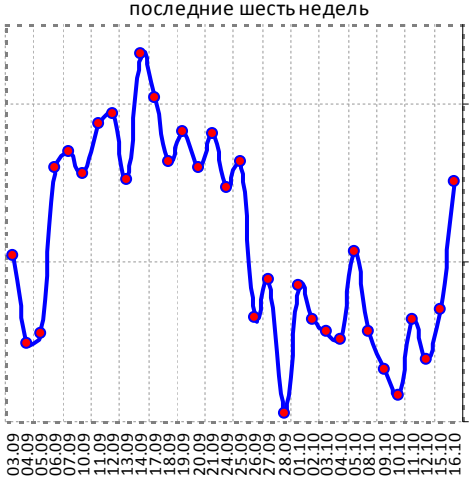
DAX Index: недельные данные - последний год



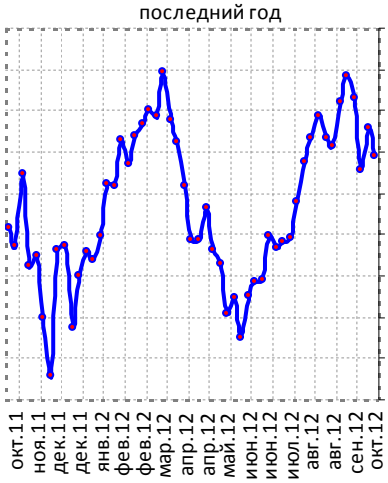
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



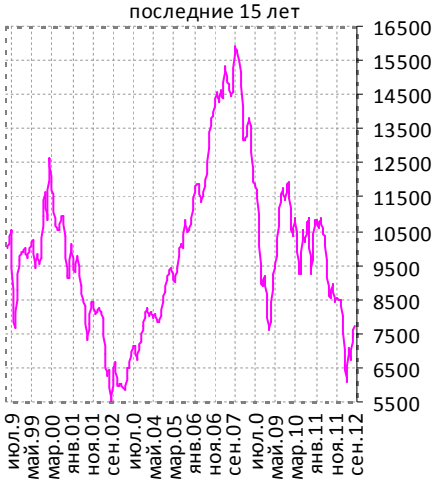
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

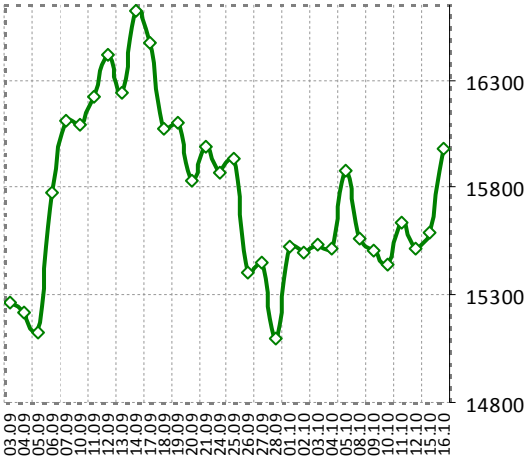


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

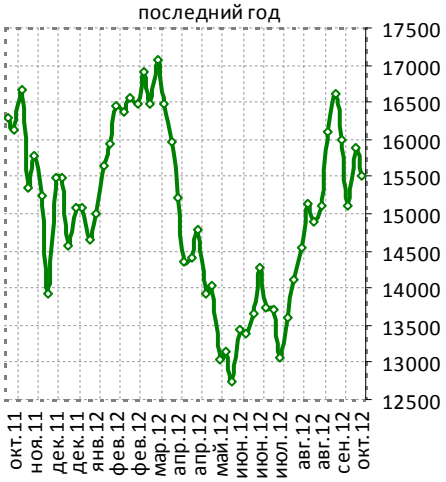


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



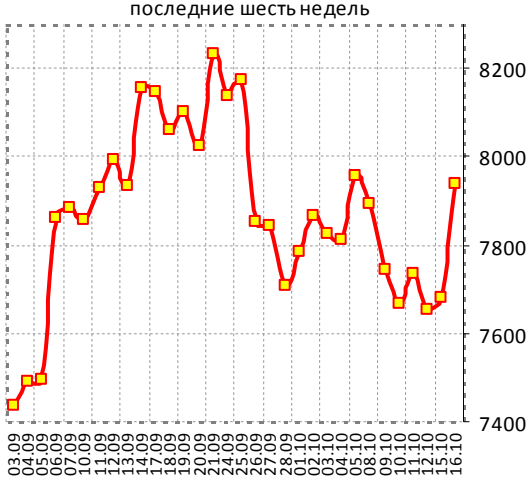
MIB Index: недельные данные - последний год



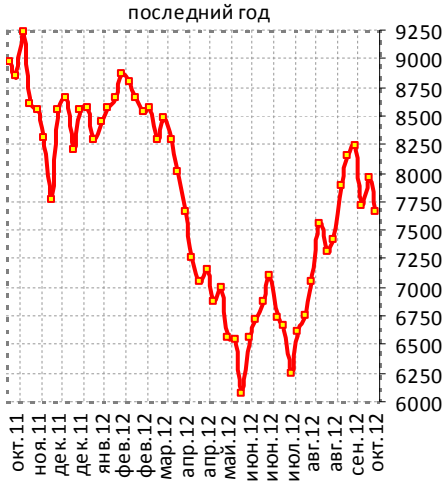
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



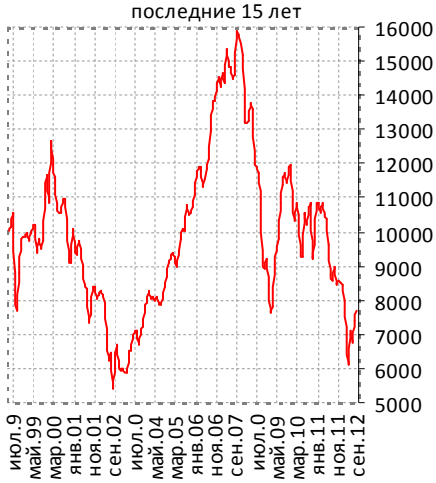
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



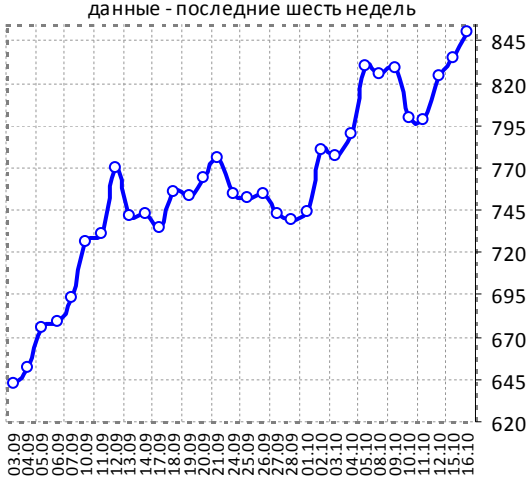
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



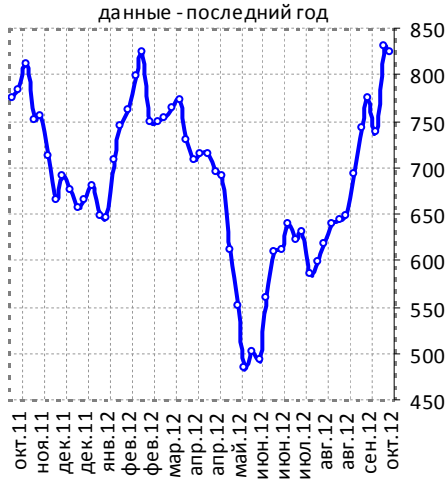
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



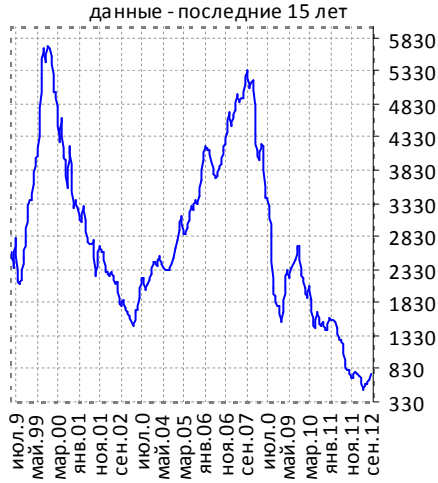
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



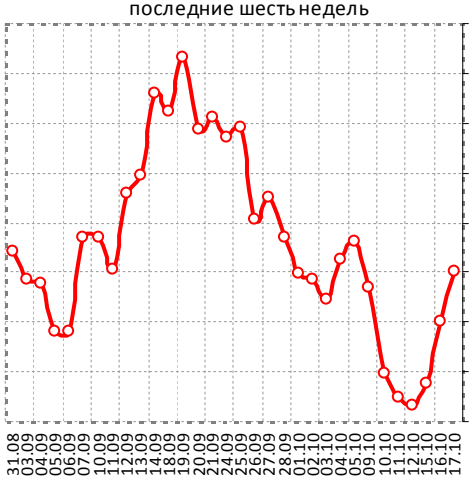
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



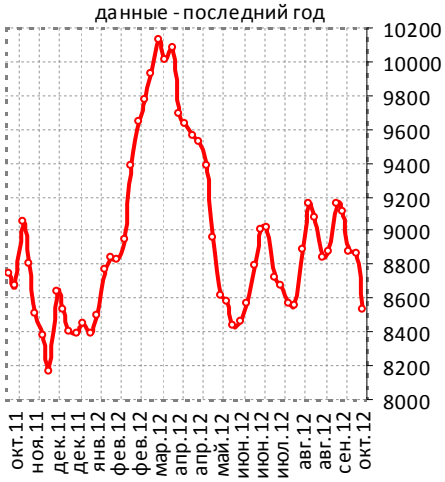
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

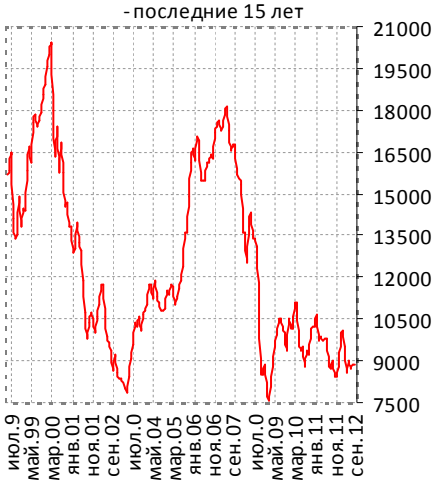
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



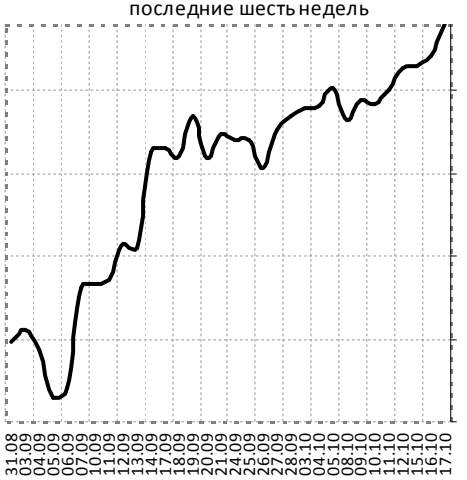
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



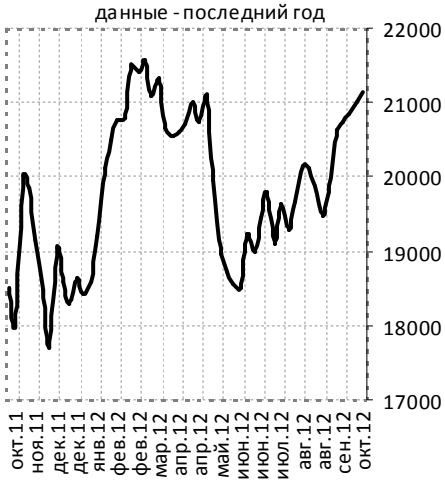
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



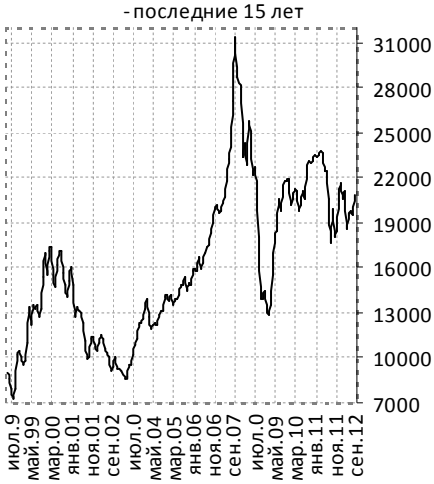
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



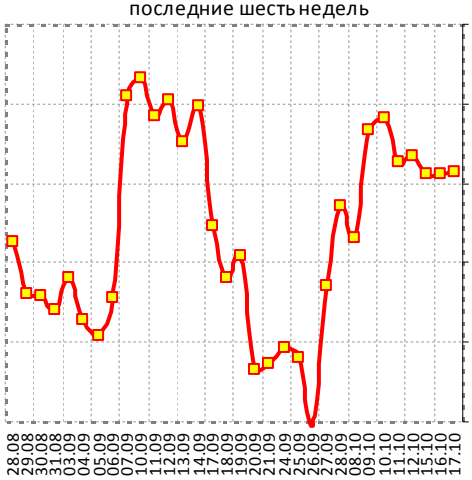
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



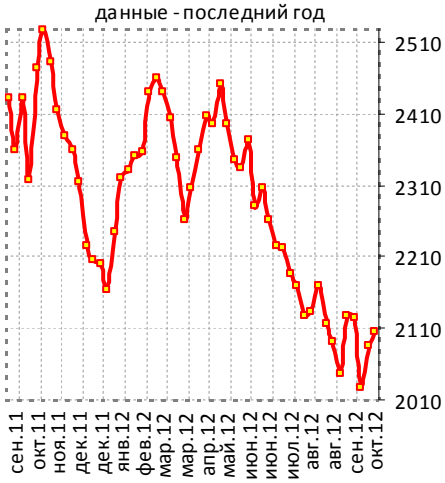
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



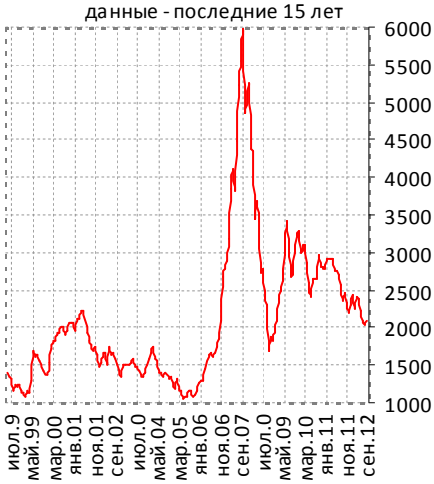
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



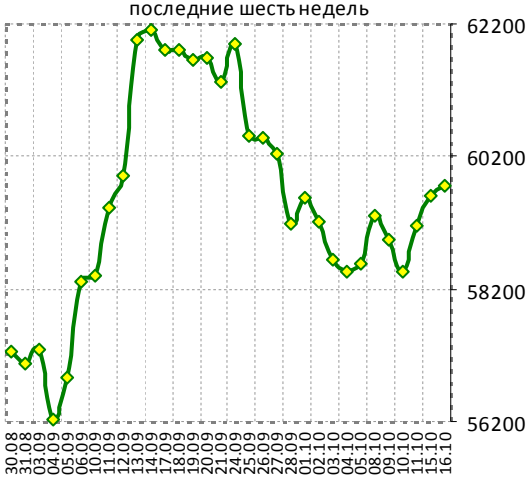
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



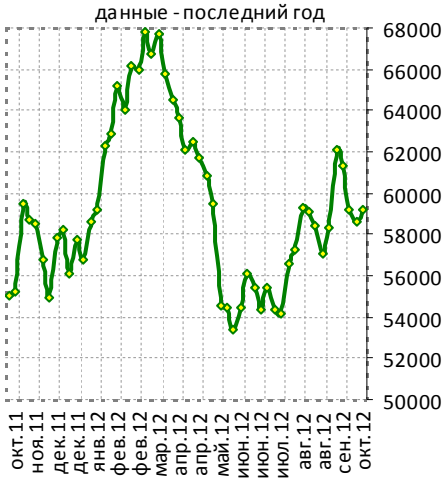
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

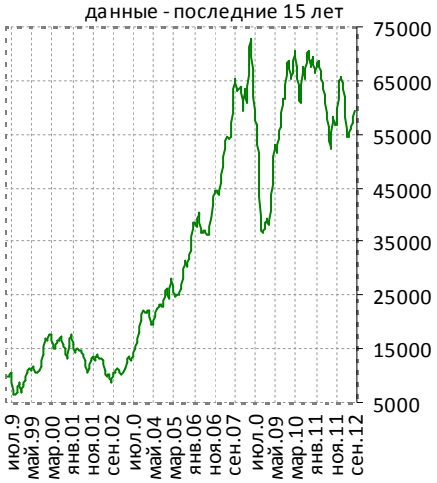
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



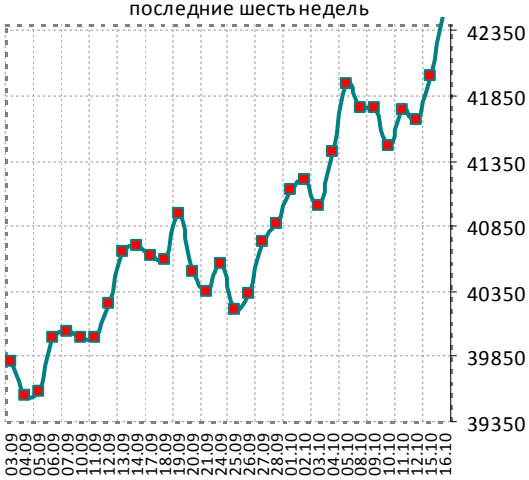
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



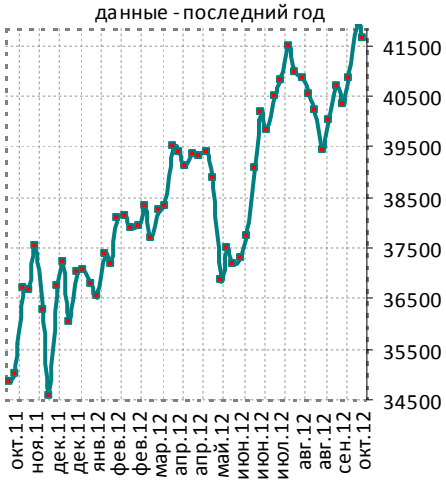
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



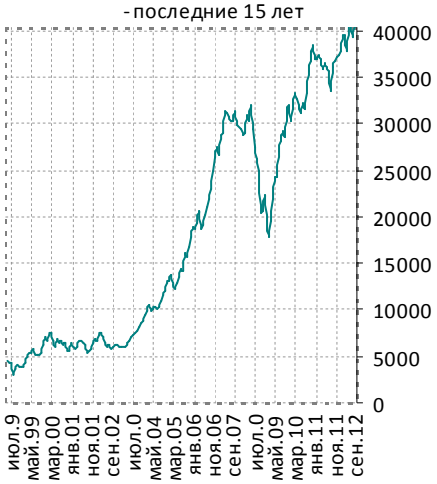
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



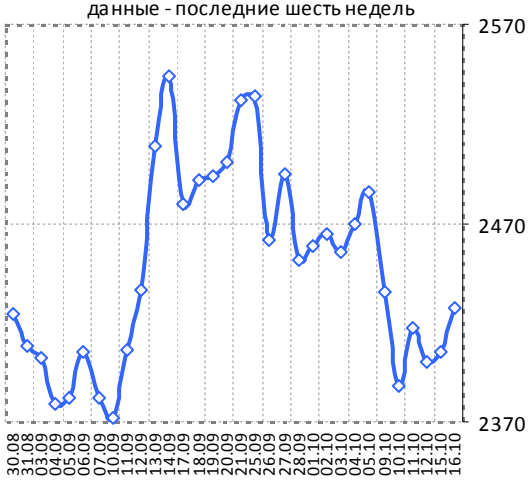
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



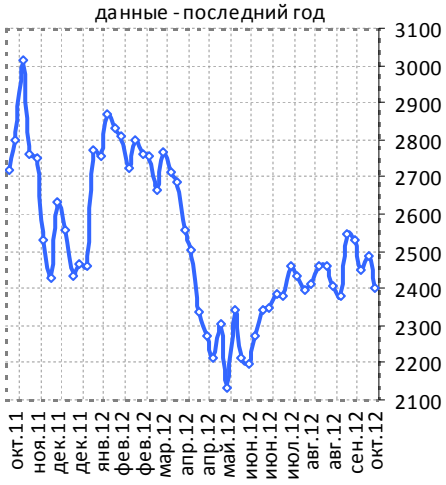
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



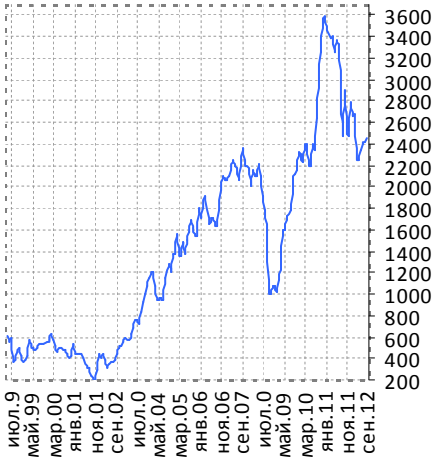
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

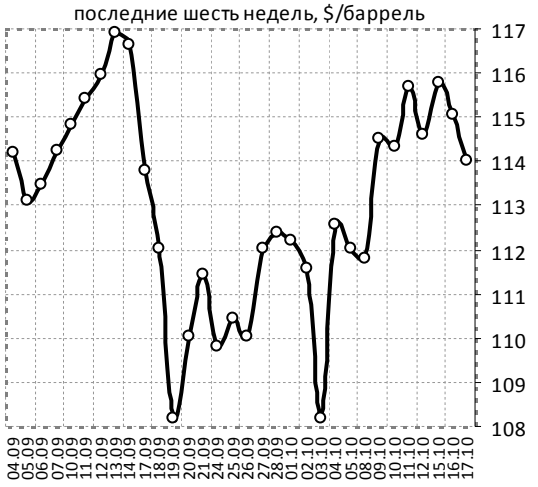


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

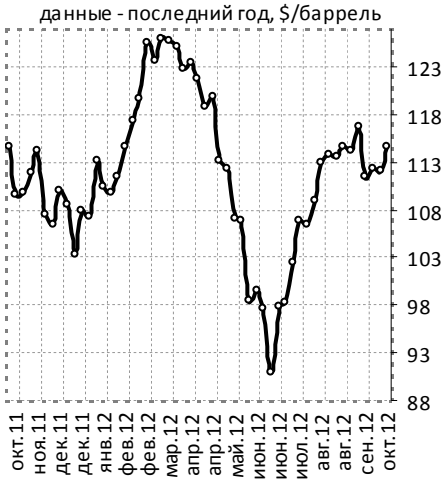
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

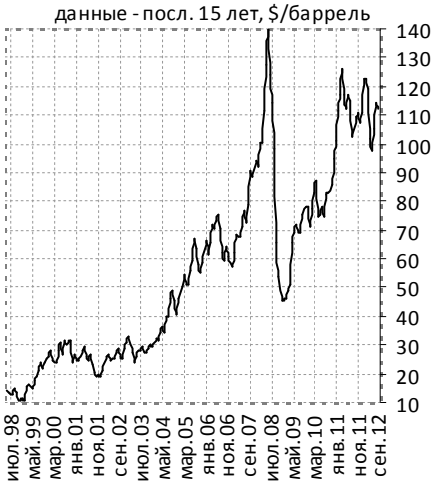
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



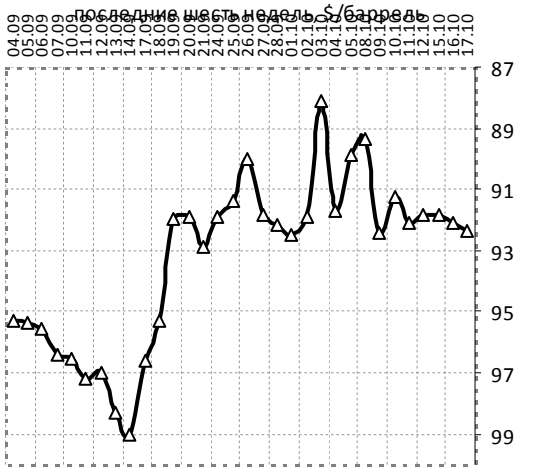
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



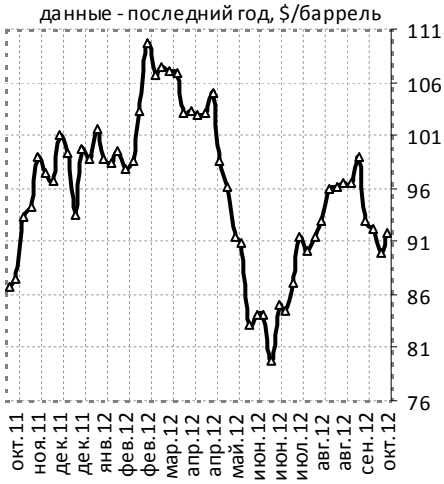
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



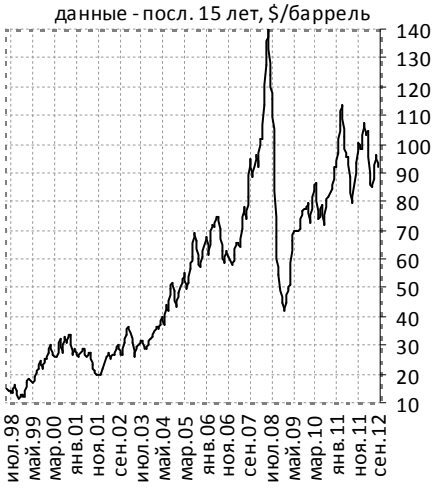
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



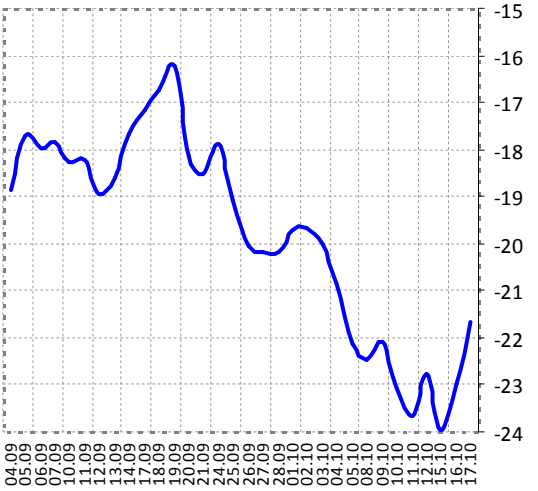
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



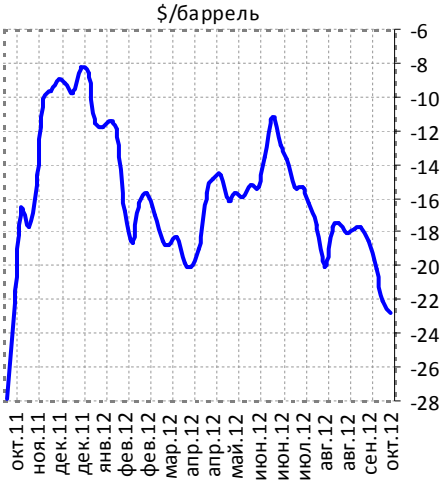
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



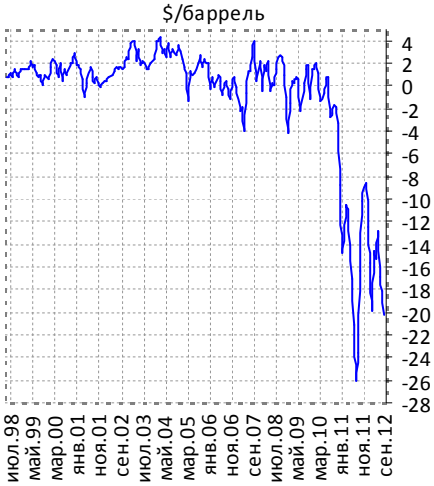
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



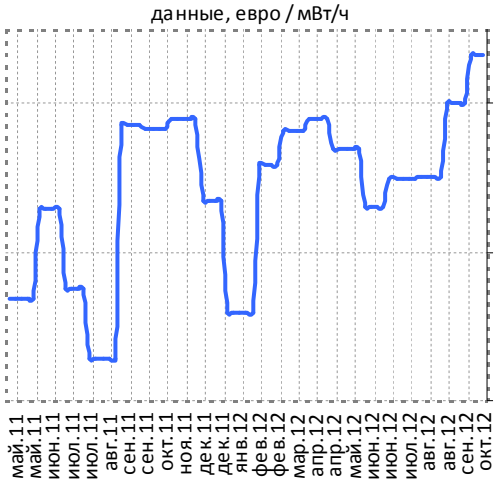
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



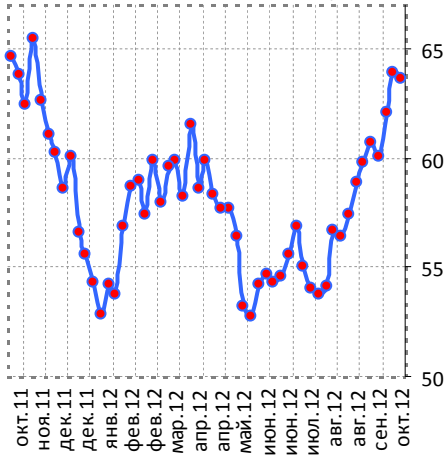
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

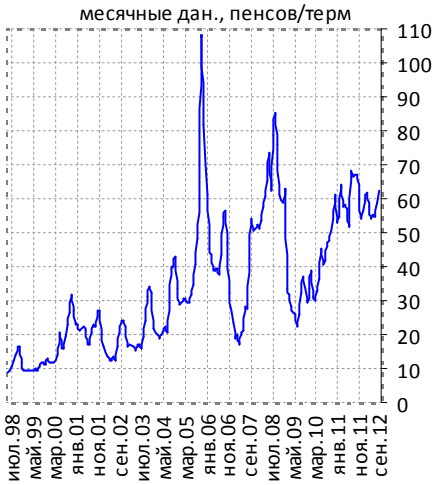
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



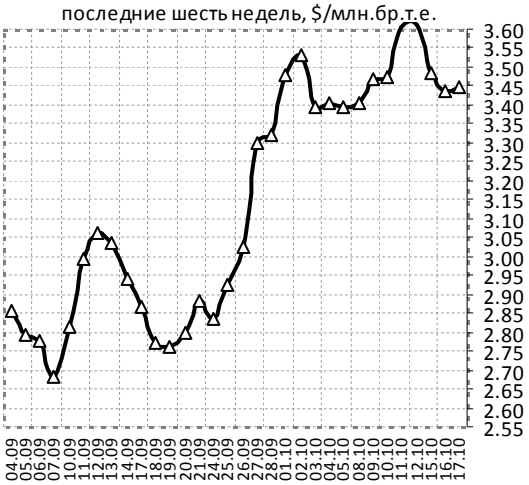
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



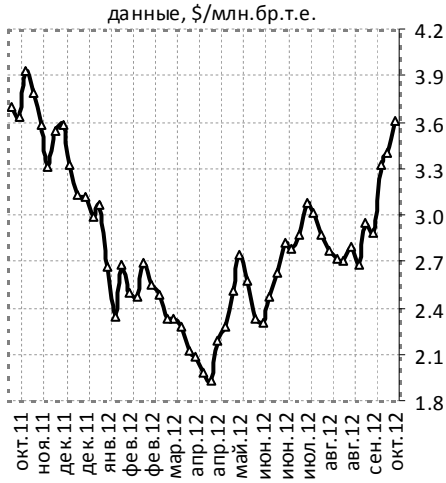
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



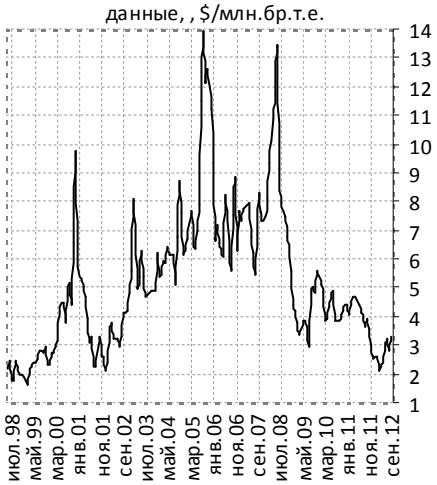
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



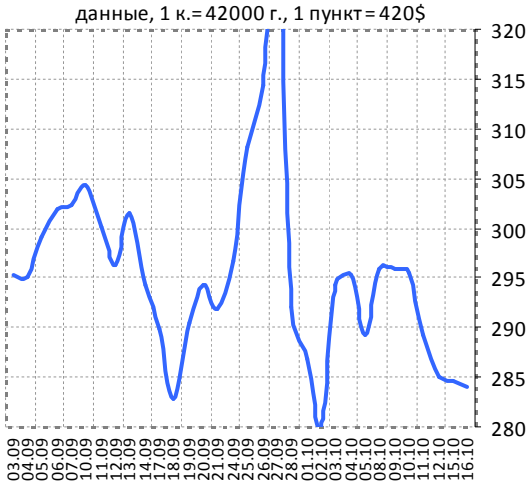
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



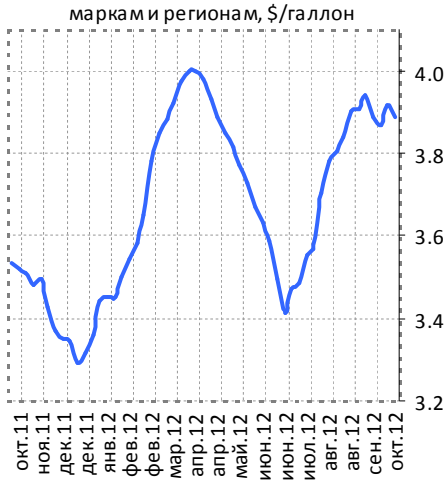
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



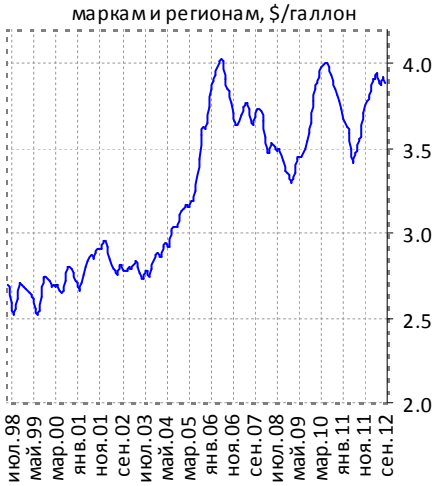
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



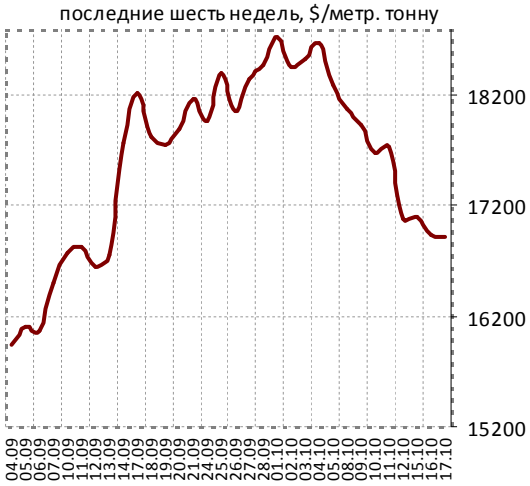
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



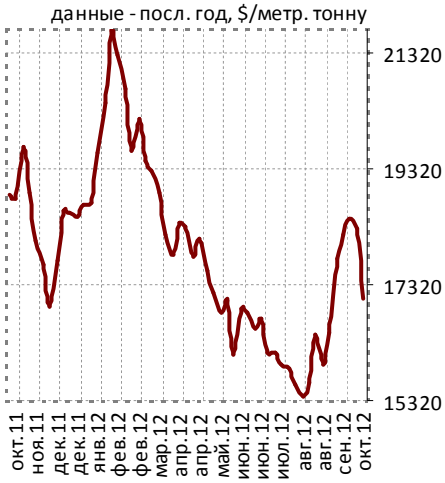
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

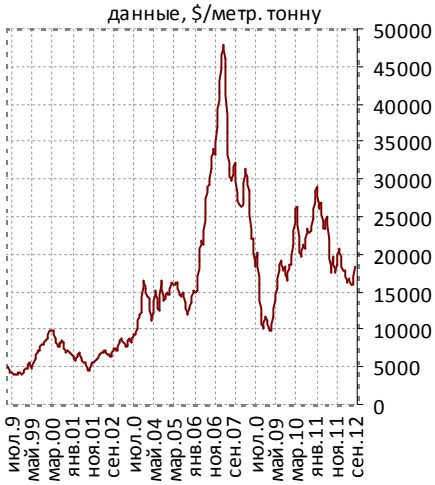
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



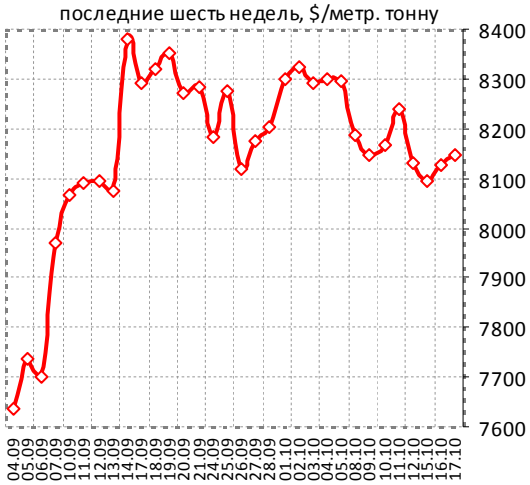
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



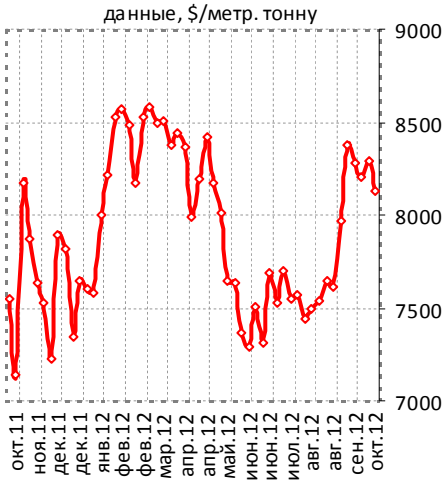
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



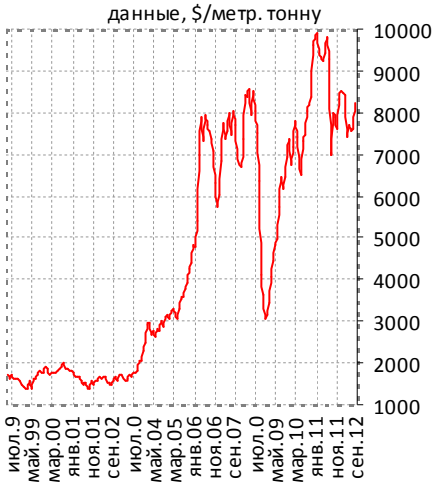
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



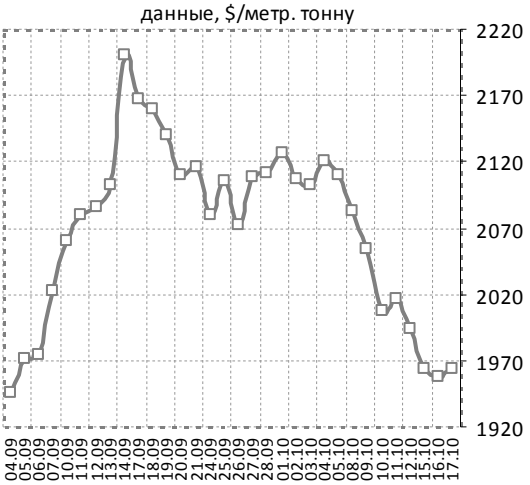
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



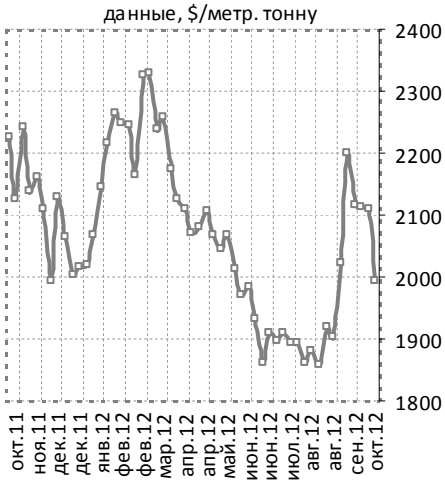
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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.