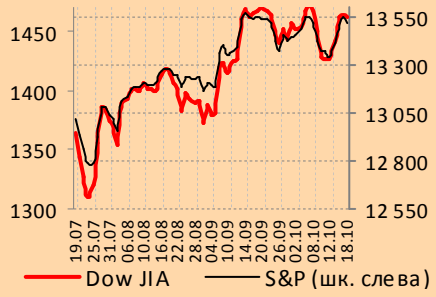
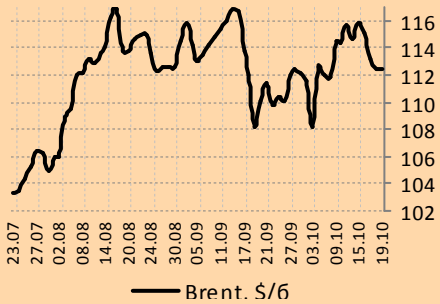
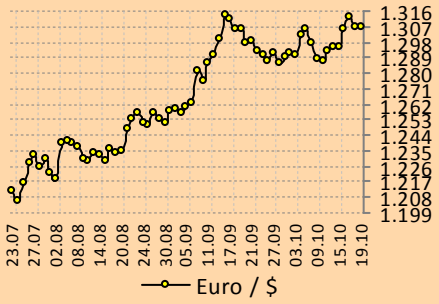
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

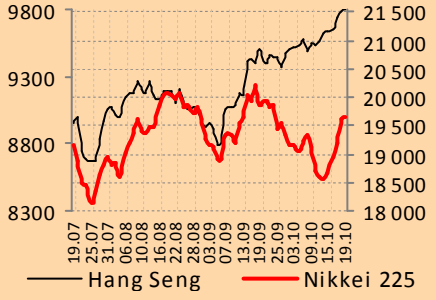
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

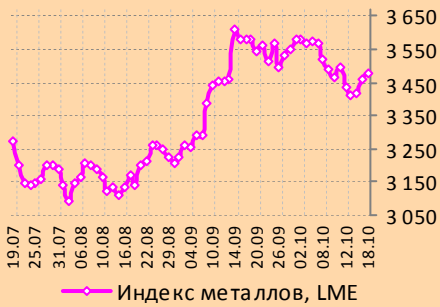
Ежедневный обзор

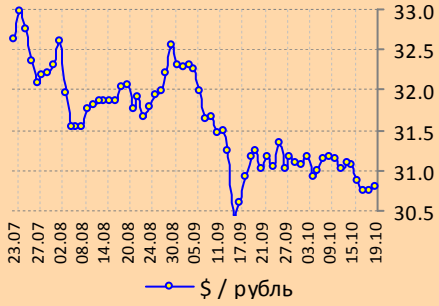






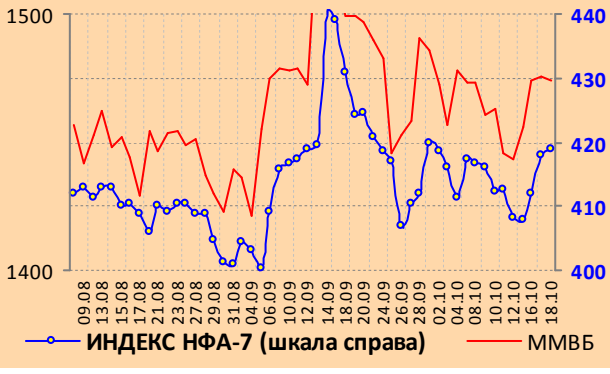






СОДЕРЖАНИЕ

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. Биржевые индексы, несмотря на ряд неплохой статистики, все же негативно отразили ухудшение ситуации на рынке труда: Dow Jones =-0,06, NASDAQ =-1,01, S&P =-0,24%. Действительно, количество первичных обращений за пособиями по безработице за неделю возросло с 342 до 388 тыс., ожидалось 365 тыс. Продолжается публикация квартальной отчетности и прогнозов компаний в США. Интересно сравнить прибыль на акцию по отчетности компаний различной отраслевой принадлежности. Так, квартальная прибыль второй по величине в США телефонной компании Verizon Communications увеличилась на 14%, прибыль на акцию возросла с 56 до 64 центов. Прибыль на акцию MandT Bank возросла с 1,32 до 2,17 долл. при средних прогнозах на уровне 1,86 долл. Fifth Third Bancorp показал 5%-е снижение квартальной прибыли в связи с увеличением резервов на покрытие расходов, связанных с погашением долговых обязательств, при этом чистая прибыль на акцию составила 38 центов (годом ранее 40). Промышленный конгломерат Danaher, хотя и зафиксировал рост квартальной прибыли на 5% (с 73 до 77 центов на акцию), но, тем не менее, прибыль оказалась ниже ожиданий. Страховщик Travelers получил рекордную операционную прибыль в результате снижения расходов, связанных с природными катастрофами, чистая прибыль на акцию возросла с 0,7 годом ранее до 2,21 долл. Наконец, Morgan Stanley отчитался об убытке.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, торги начались ростом, но во второй половине сессии, при ухудшении внешнего фона, котировки обозначили снижение, в результате индекс ММВБ +0,07, РТС =-0,09%. Отметим некоторые новостные моменты. Так, положительное сальдо торгового баланса РФ за 9 месяцев на 4,5% больше, чем за аналогичный период прошлого года. Профицит консолидированного бюджета за январь-август сложился в 1,5 раза меньше, чем в январе-августе 2011г. Казначейство размещало средства федерального бюджета на банковские депозиты в сумме 37 млрд. руб. на срок 91 день, дата возврата средств 18 января 2013 г., спрос составил 16 млрд., ставка 7,2% (на депозитах уже размещено 628 млрд. бюджетных денег). Годовая инфляция ускорилась до 6,8%, с начала года равна 5,5% (целевой ориентир правительства и ЦБ находится на уровне 5-6%).

ЦБ планирует в I квартале следующего года перейти на плавающие ставки по операциям предоставления ликвидности на сроки от 3-х месяцев до года. Переход на плавающие ставки коснется таких инструментов предоставления ликвидности, как РЕПО, валютные свопы и кредиты под нерыночные активы. Согласно обсуждаемым вариантам, ставки, скорее всего, будут привязаны к ставке RUONIA с добавлением небольшой маржи.

Состоится пленарное заседание Госдумы, в частности, будут рассмотрены проекты законов о федеральном бюджете на 2013г. и на плановый период 2014 и 2015гг., а также о бюджете Пенсионного фонда РФ.

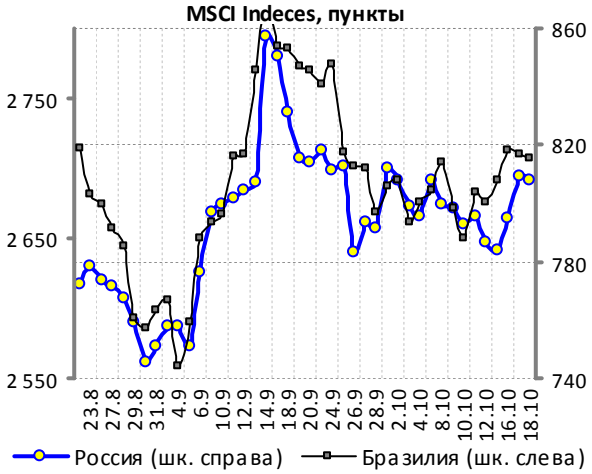
Европа. В дополнение к региональным проблема, на европейских инвесторов негативно повлияло ухудшение ситуации на рынке труда США, в результате FTSE 100 =-0,20, CAC 40 =-0,53, DAX =+0,09%. SandP снизило кредитный рейтинг Кипра сразу на 3 пункта, с BB до B, прогноз негативный. Кроме того, уменьшены рейтинги ряду испанский провинций и городов Барселоны и Мадрида. Мы считаем, что со стороны агентства данное решение является логическим продолжением недавнего понижения рейтинга Испании, поскольку рейтинг регионов не может превышать рейтинг страны. Между тем, Испания вчера разместила гособлигации на общую сумму 4,6 млрд. евро, доходность сократилась с 5,67 до 5,46%. Возросли розничные продажи в Великобритании, за месяц на 0,6% при ожиданиях в 0,4%.

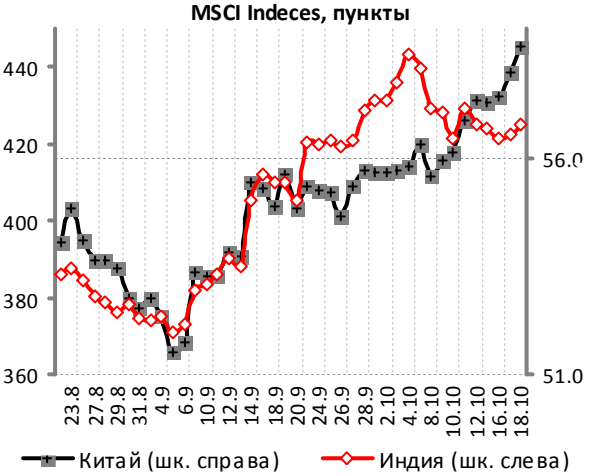
Азия. Итоги торгов четверга в плюсе, Nikkei +2,0, Hang Seng +0,48, SSE +1,24, Kospi +0,20%. Макростатистика по Китаю оказалась лучше, чем рассчитывали. Так, ВВП за 3 квартал показал рост на 7,4% по сравнению с аналогичным периодом прошлого года (7,6% в предыдущем квартале), динамика соответствует ожиданиям. В то же время рост ВВП ниже целевого значения правительства на текущий год (7,5%), что дает основание инвесторам рассчитывать на новые стимулирующие меры. Рост промпроизводства равен 9,2% в годовом исчислении, что выше ожиданий (9%). Объем розничных продаж за месяц вырос на 14,2% по сравнению с аналогичным периодом прошлого года, что также превысило прогноз в 13,2%. Капвложения с начала года увеличились на 20,5%.

Золото. На подросших накануне ценах драгметаллов некоторые инвесторы вчера фиксировали прибыль. Утром четверга золото торговалось по 1750,41, к 14.00 по 1748,31, сегодня с фьючерсы на золото = 1739,11, серебро = 32,76, платину = 1647, палладий = 641,95 долл. за унцию.

Нефть. В дополнение к информации о росте запасов нефти в США, стало известно о скором возобновлении производства североморской нефти, что повлияло на снижение цен. Снижение в какой-то мере компенсировалось ослаблением доллара, в результате Brent и Light утром в четверг шли по 113,49 и 92,08, к 14.00 по 113,36 и 92,49, сегодня утром по 112,41 и 92,06 долл. за барр.

События, прогноз. Сегодня продолжит работу саммит лидеров ЕС, и хотя он является промежуточным (основные решения предполагается принять в середине декабря), тем не менее, окажет серьезное влияние на рыночные настроения инвесторов. Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются в преобладающем минусе, Азия разнонаправлено, цены нефти не растут. Российские биржи могут попытаться обозначить рост (все же цена нефти не на худшем уровне и цены акций достаточно комфортны), будем надеяться, что рост удастся удержать.

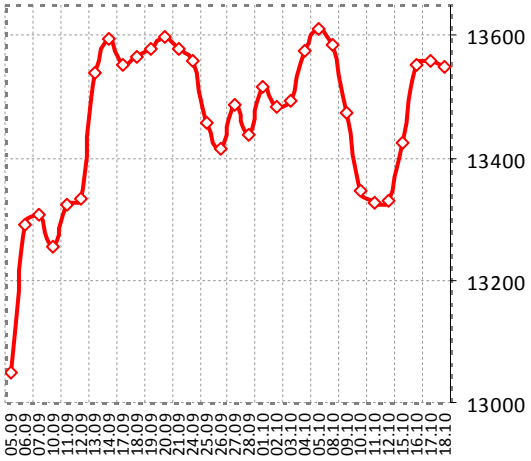




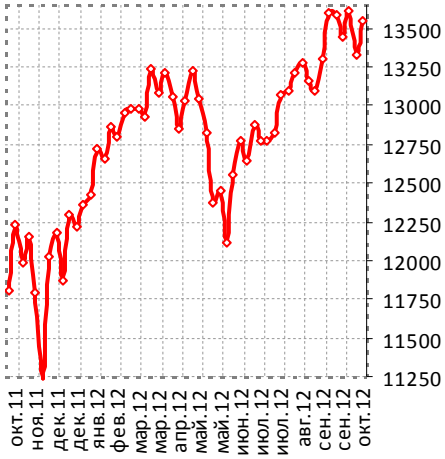
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

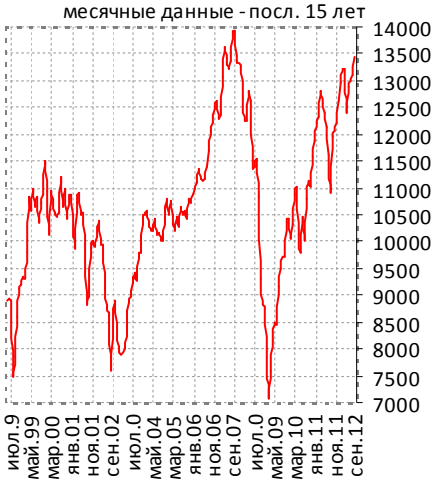
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



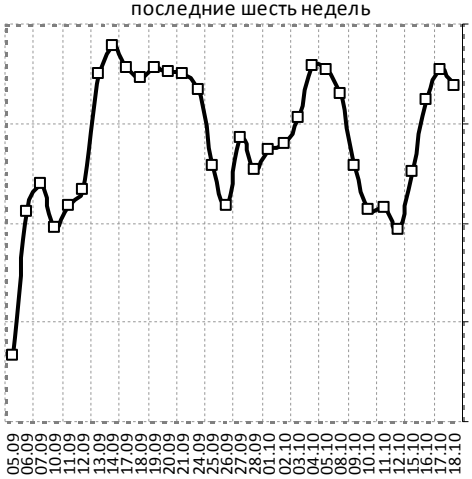
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



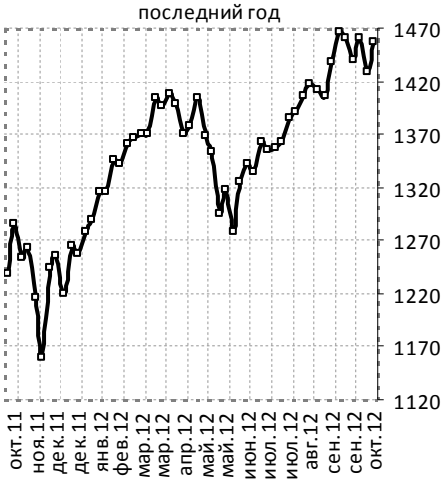
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



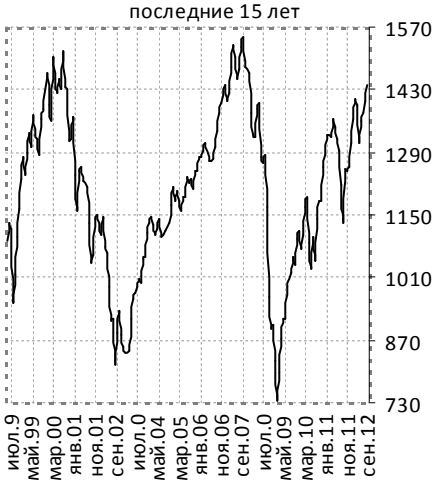
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



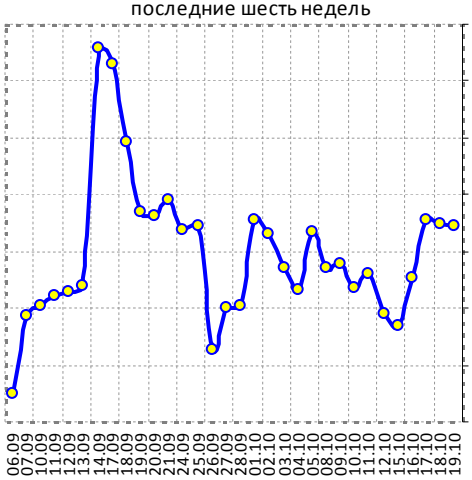
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



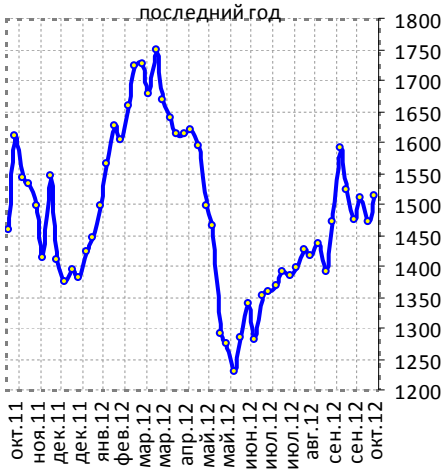
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



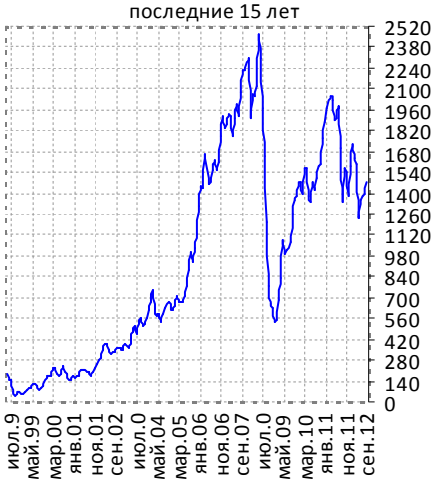
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



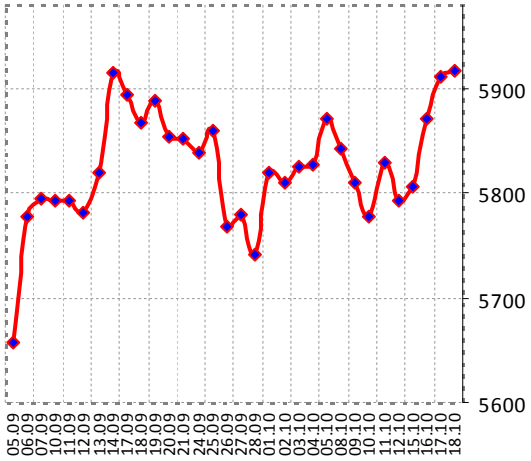
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



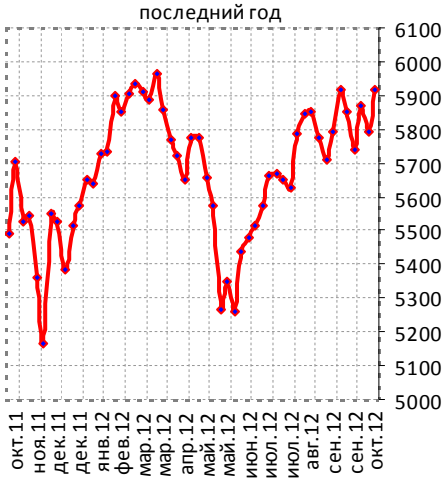
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

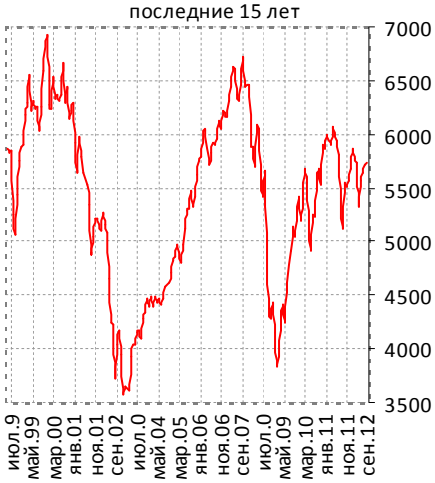
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



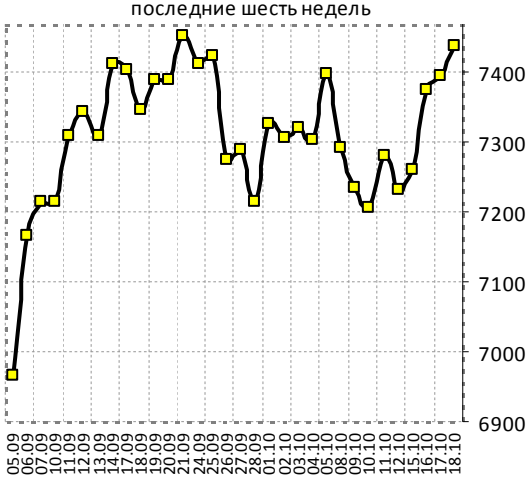
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



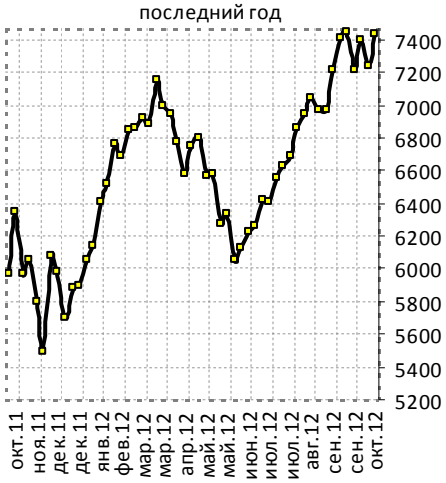
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



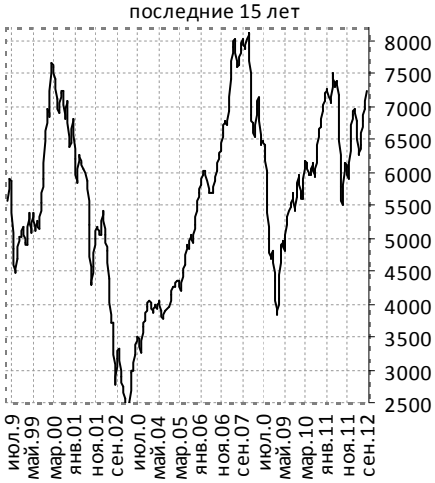
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



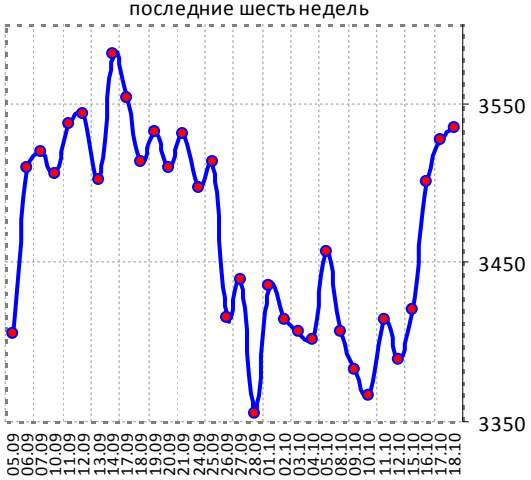
DAX Index: недельные данные - последний год



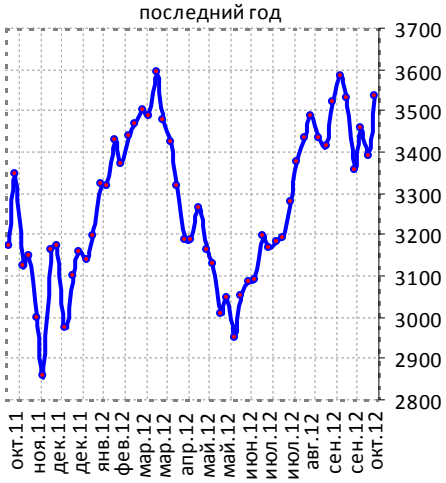
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



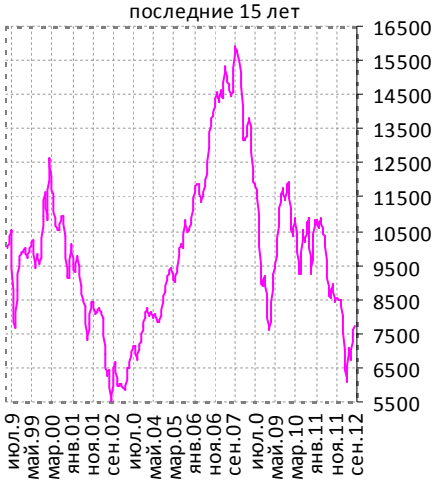
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

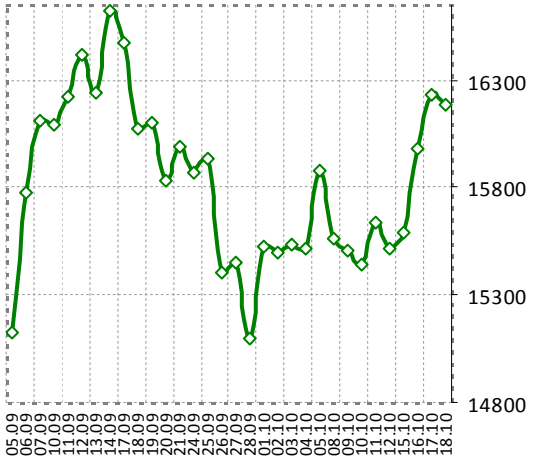


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

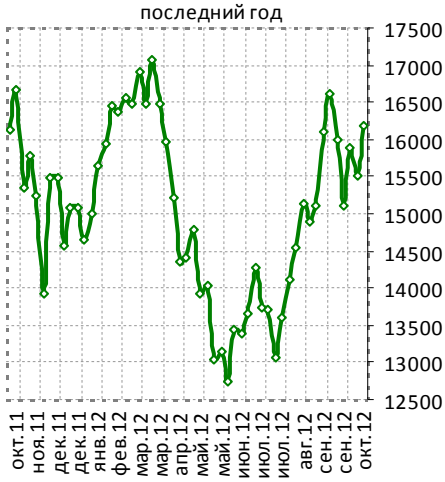


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



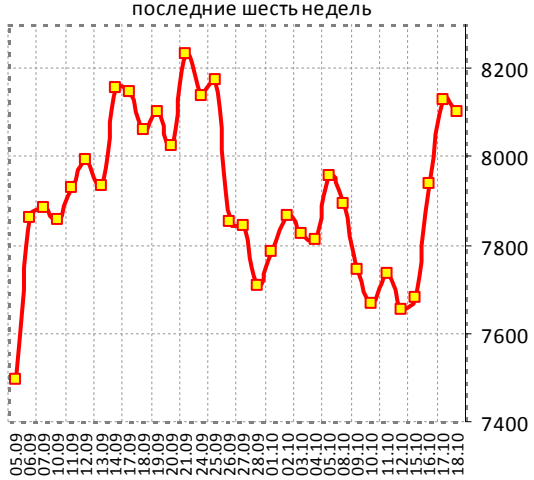
MIB Index: недельные данные - последний год



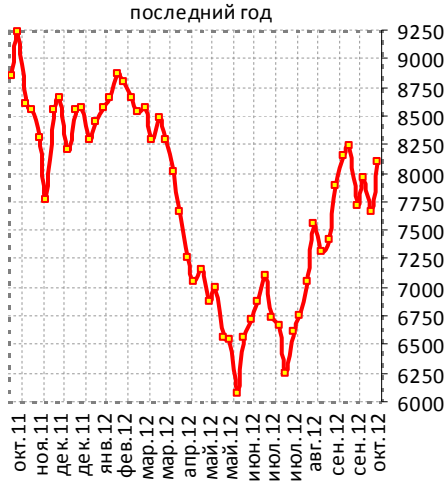
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



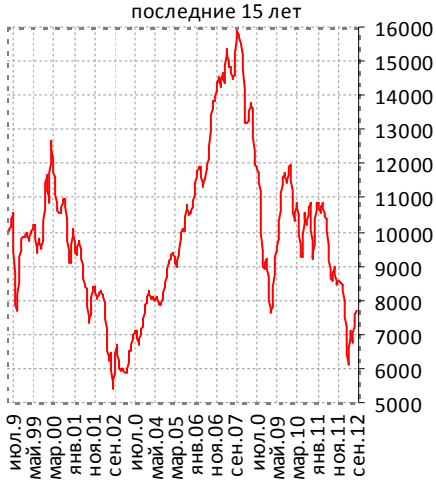
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



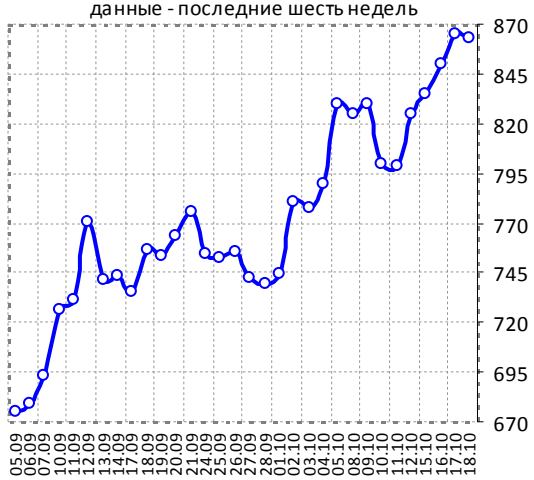
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



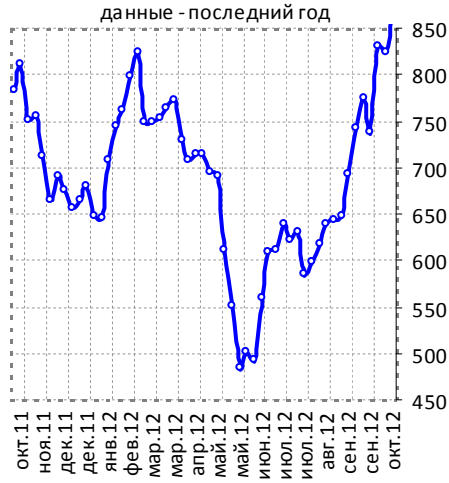
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



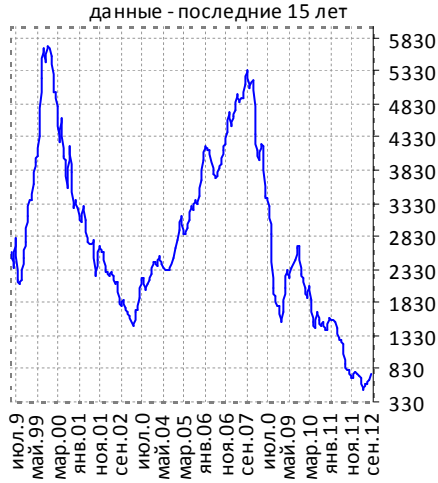
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



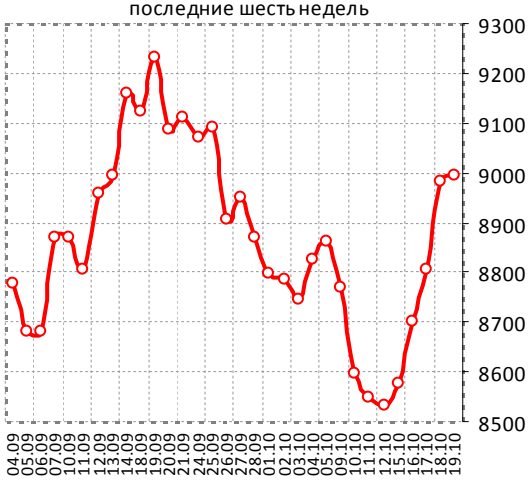
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



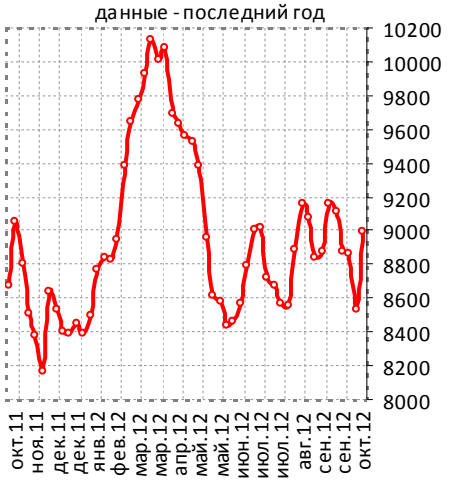
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

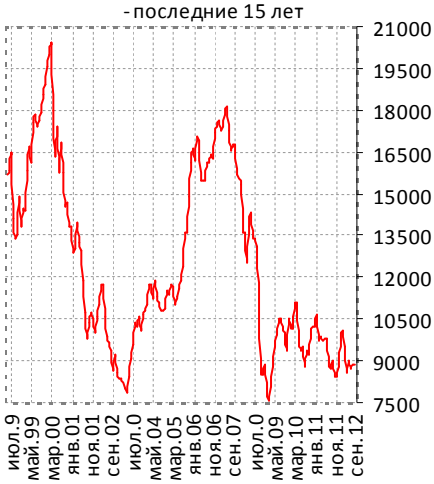
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



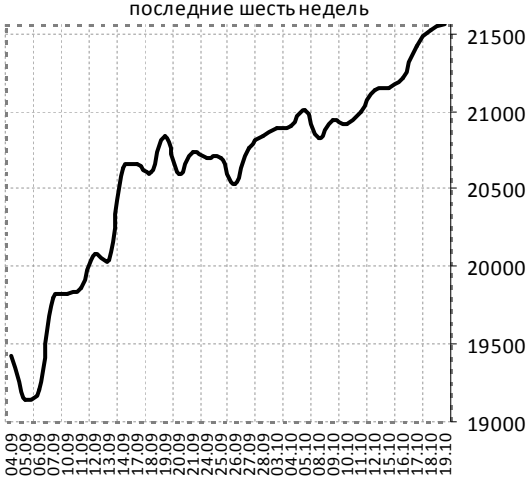
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



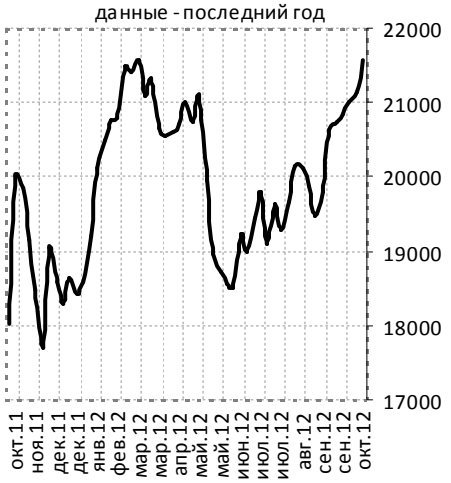
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



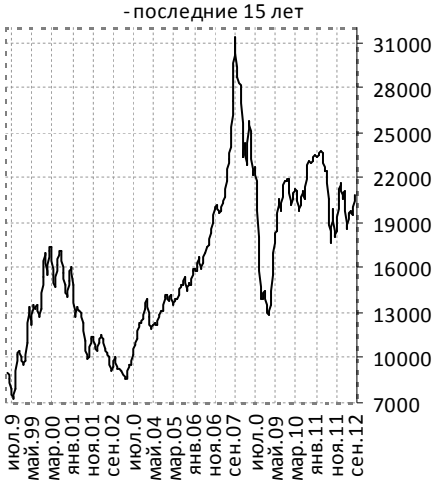
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



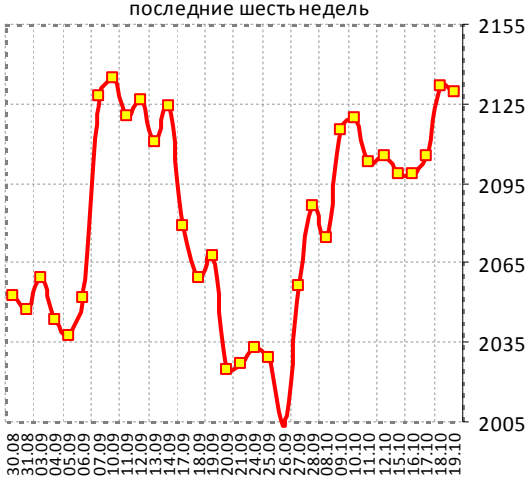
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



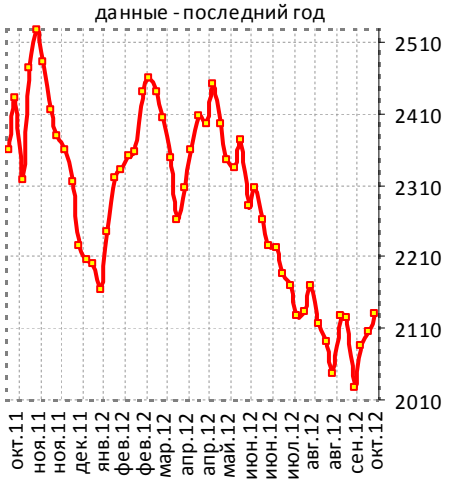
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



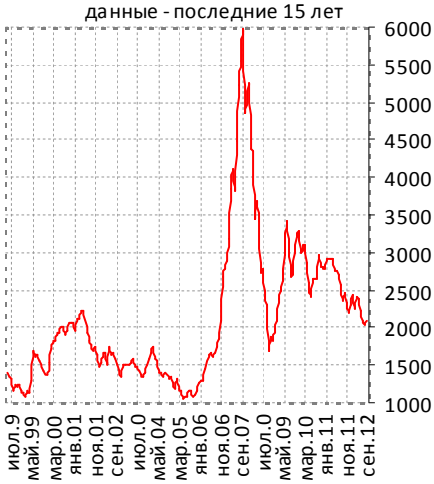
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



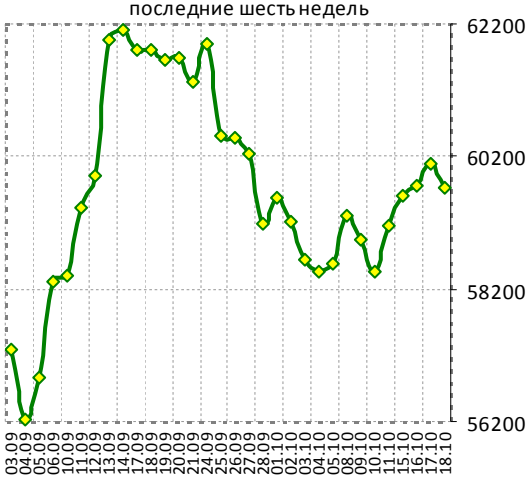
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



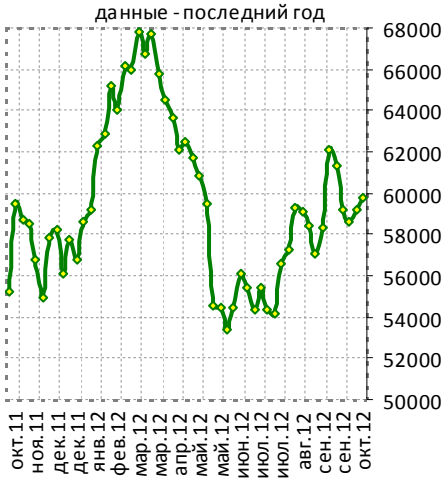
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

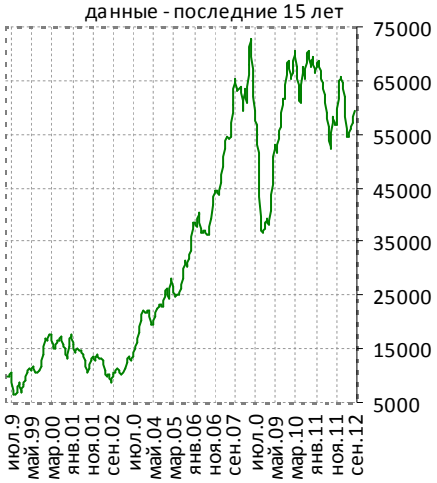
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



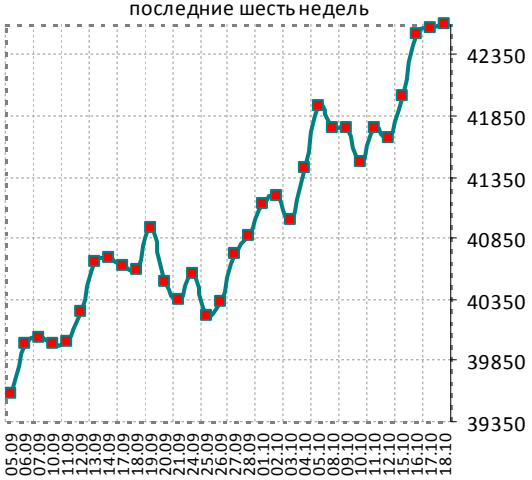
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



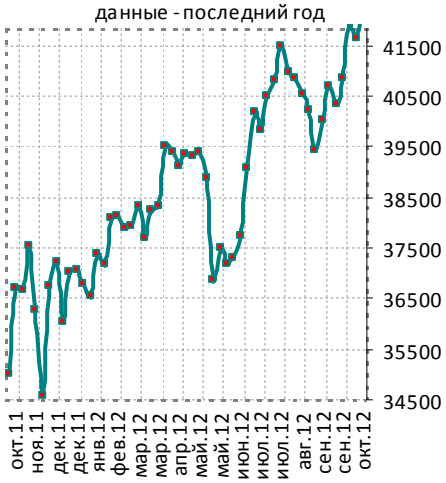
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



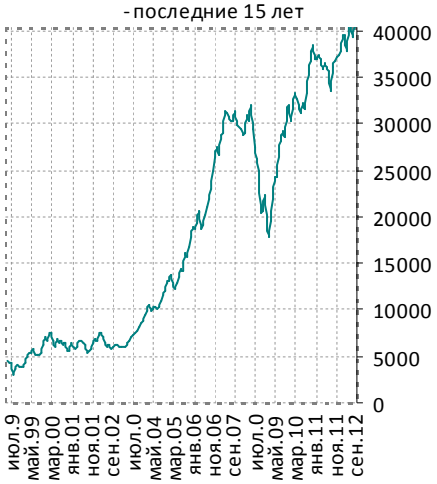
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



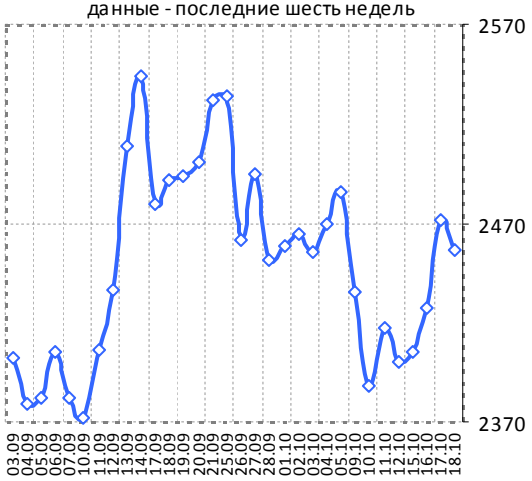
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



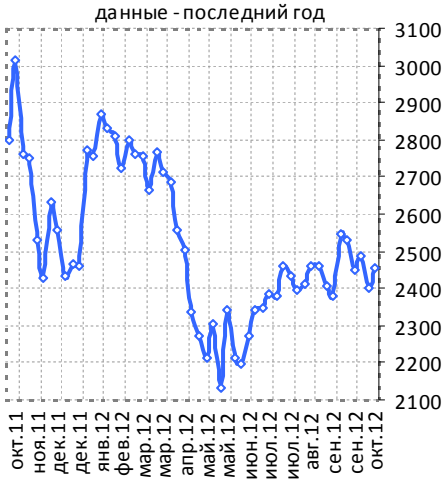
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



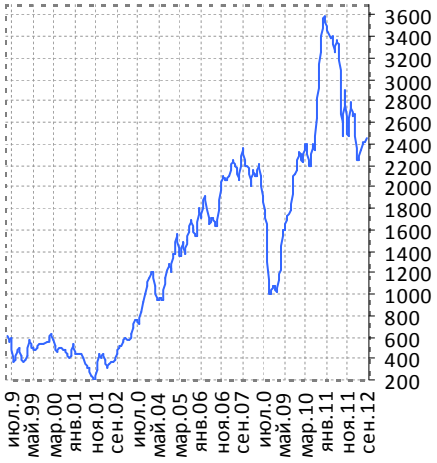
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

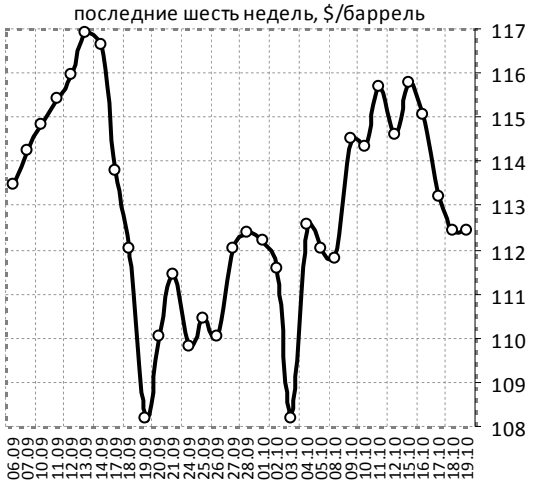


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

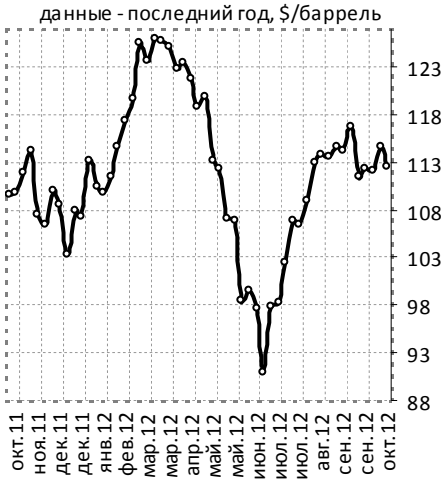
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

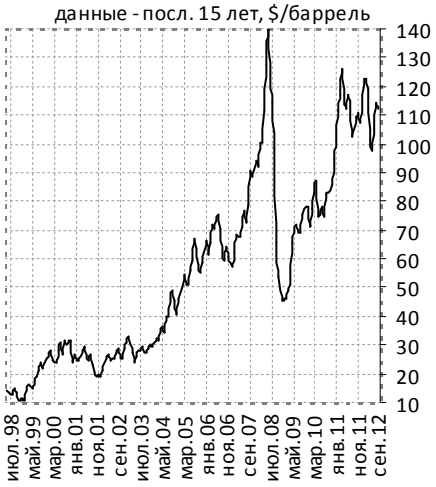
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



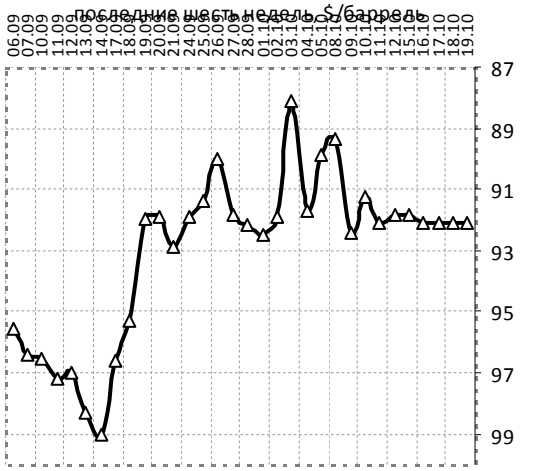
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



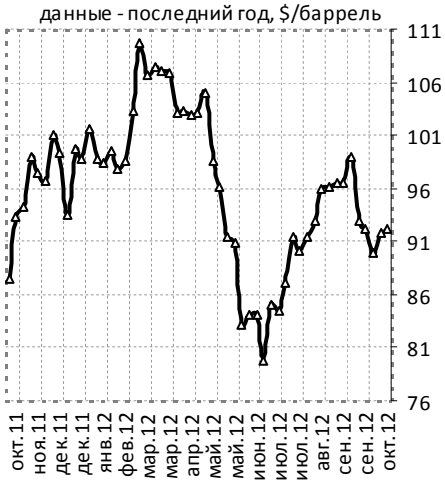
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



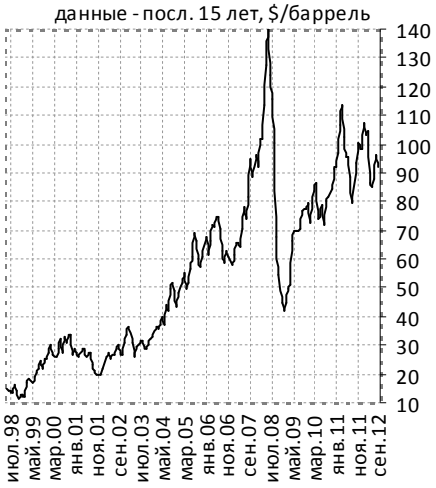
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



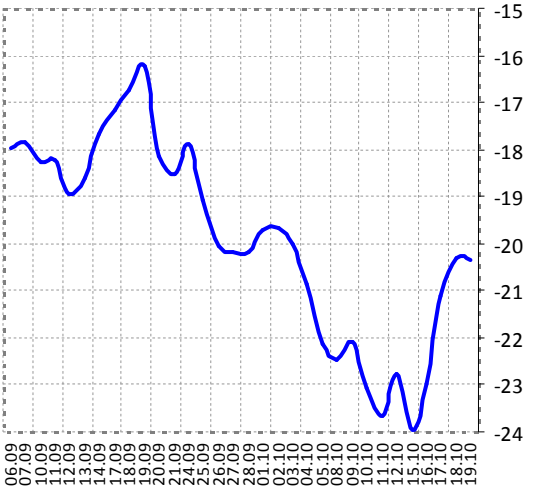
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



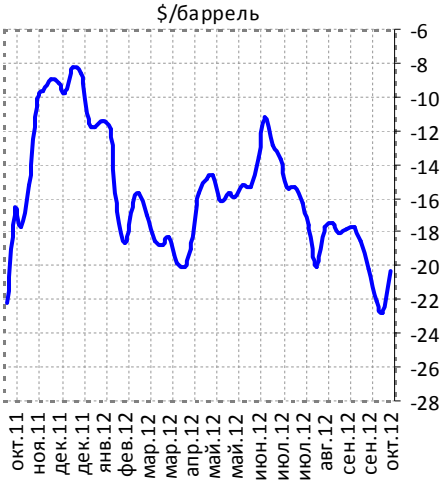
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



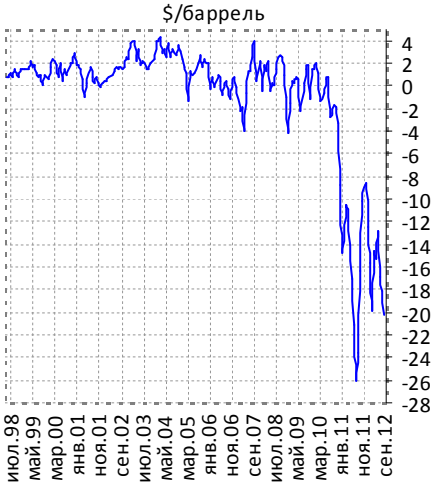
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



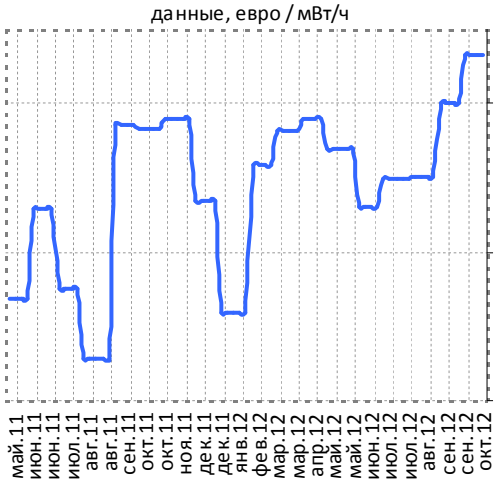
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



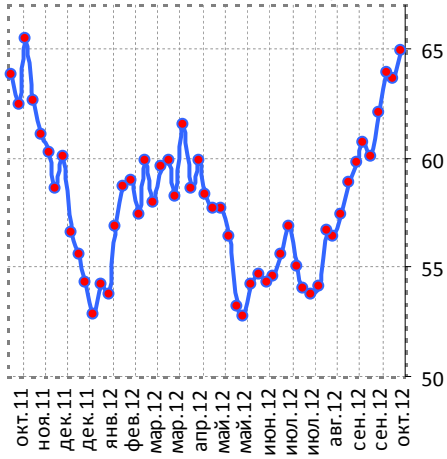
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

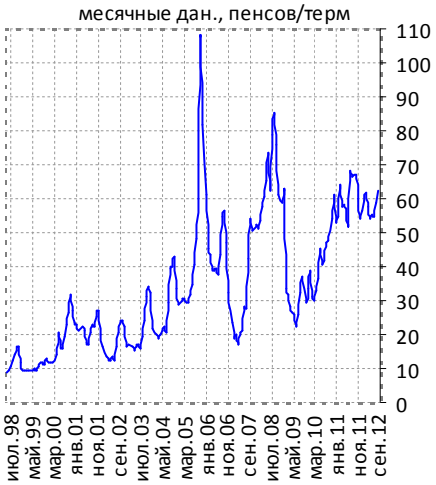
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



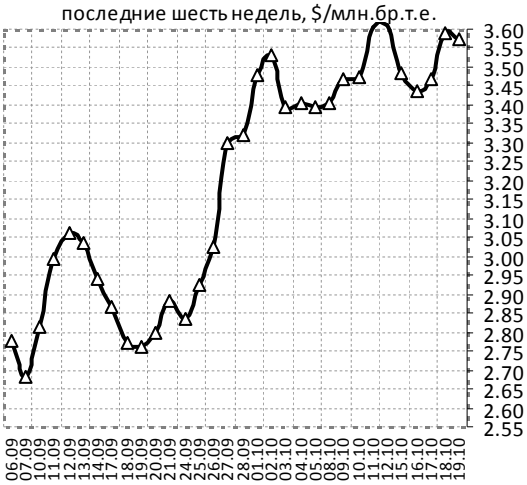
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



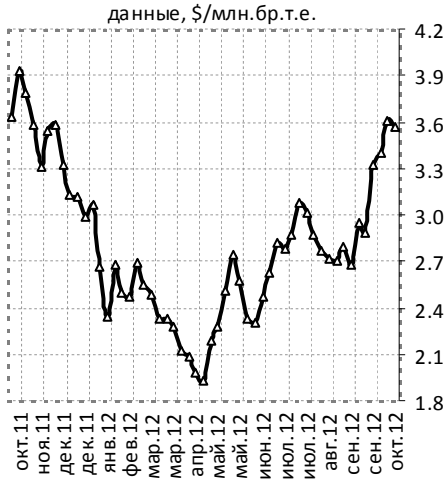
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



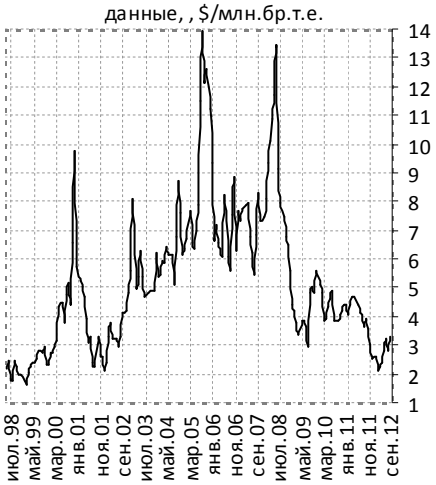
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



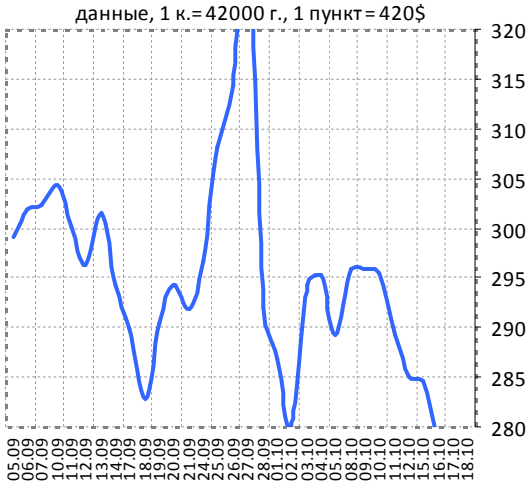
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



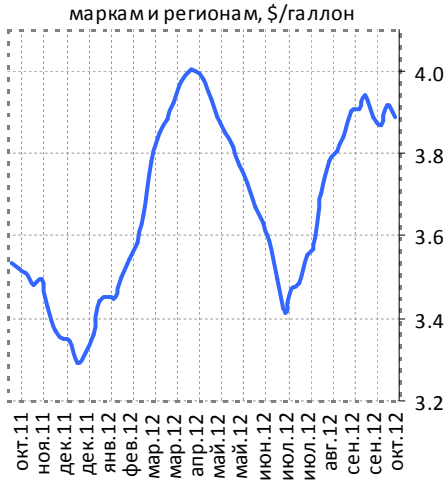
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



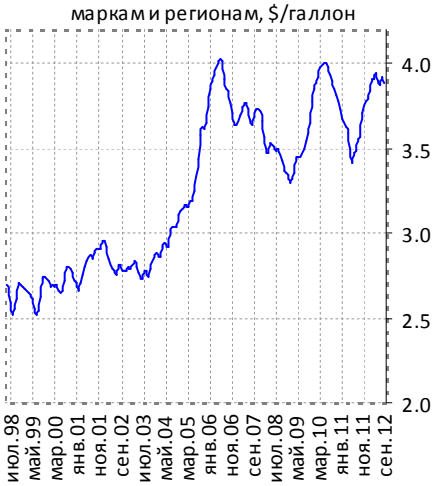
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



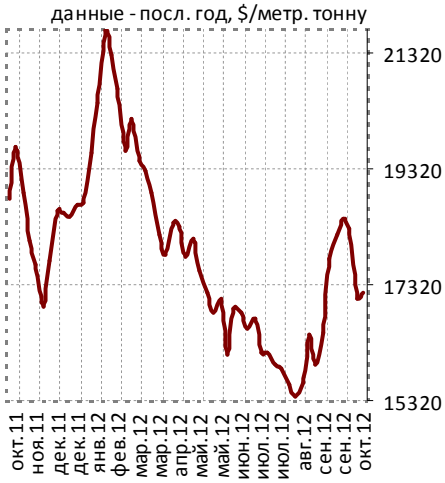
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

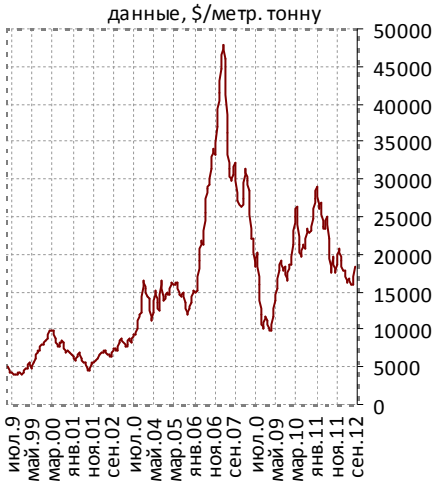
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



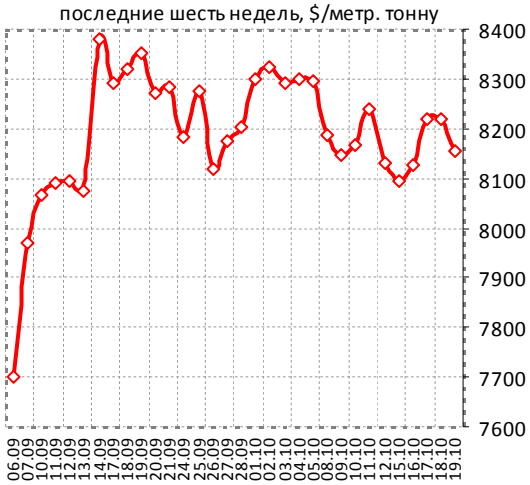
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



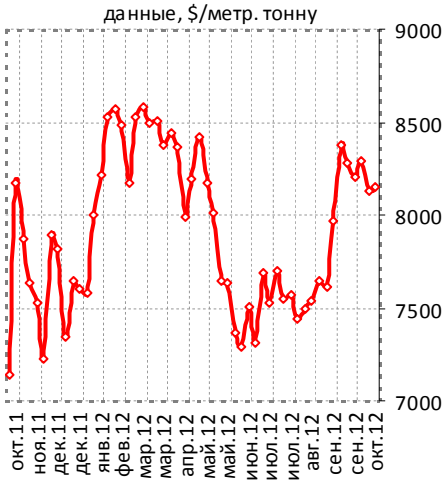
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



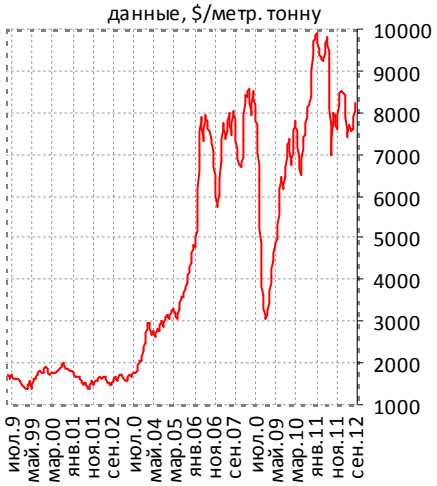
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



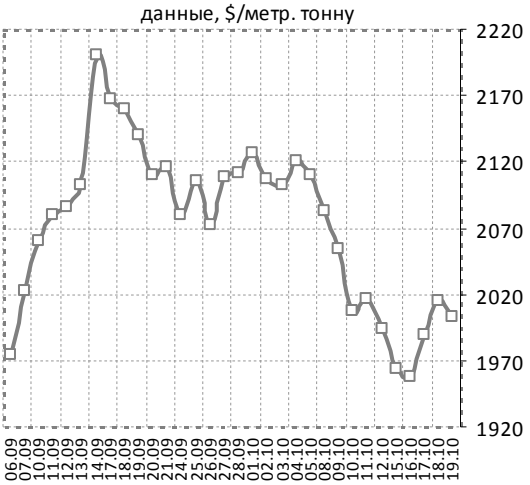
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



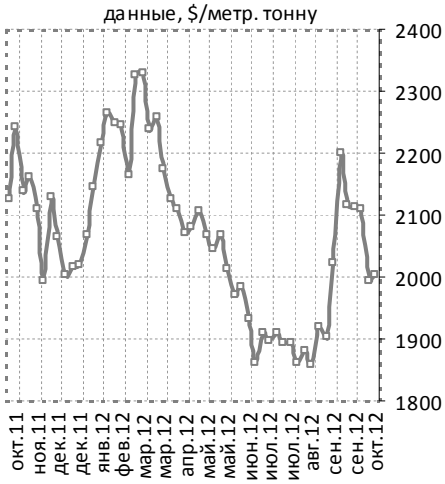
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



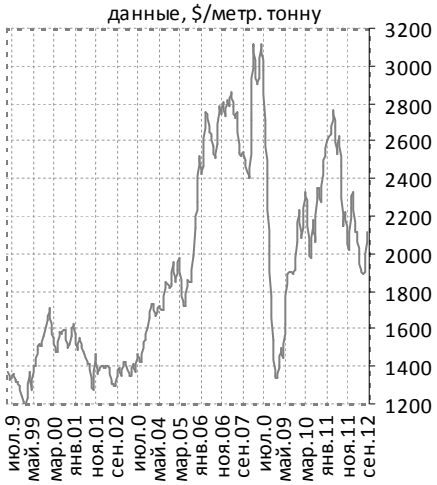
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.