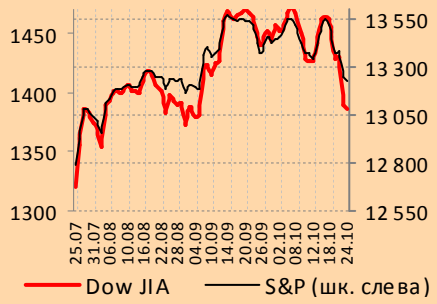
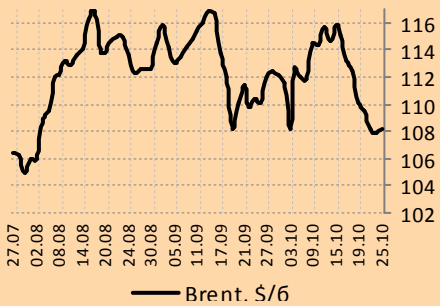
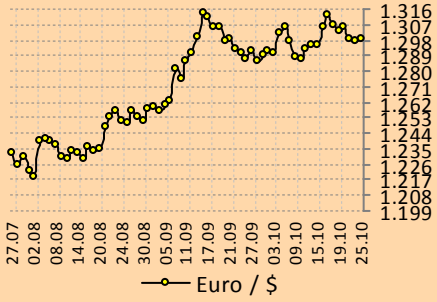
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

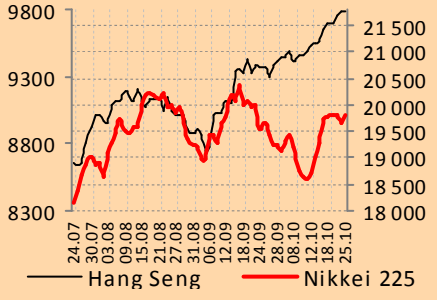
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

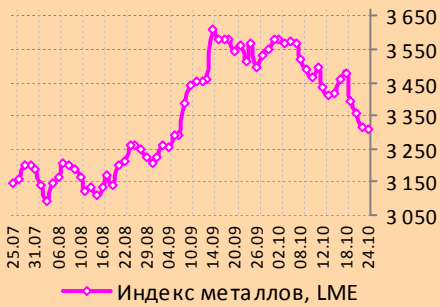
Ежедневный обзор

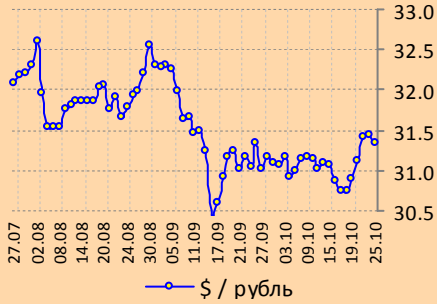






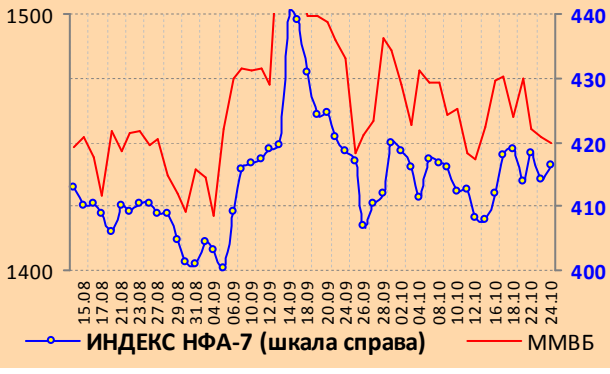






СОДЕРЖАНИЕ

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. Итоги среды: индекс Dow Jones -0,19, NASDAQ -0,29, S&P -0,31%. ФРС сохранила все ранее принятые решения: выкупать с рынка ипотечные облигации на сумму 40 млрд. долл. ежемесячно до появления существенных признаков улучшения ситуации на рынке труда, а также удерживать ставки на низком уровне 0-0,25% по крайней мере до середины 2015 г. Цель такой политики в снижении ставок по ипотечным кредитам, чтобы придать дополнительный импульс восстановлению рынка жилья и одновременно повлиять на уровень занятости в данном секторе. Против сохранения сверхмягкой денежно-кредитной политики голосовал лишь один член Комитета, президент ФРС Ричмонда, который не видит необходимости держать ставки на минимальном уровне в течение столь длительного периода.

Продолжается отчетность компаний за 3-й квартал. Так, чистый убыток Facebook составил 59 млн. долл., однако инвесторов воодушевило объяснение убытка единовременными факторами и акции компании росли. Netflix (видеопрокат) показала снижение чистой квартальной прибыли на 88%, с 1,16 долл. до 13 центов на акцию (ожидали, правда, еще меньше, 5 центов). Прибыль Boeing составила 1,35 долл. на одну акцию по сравнению с 1,46 долл. годом ранее (ожидали 1,13 долл.), прогноз на следующий год повышен.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, в условиях снижения цены нефти биржевые индексы пытались, но не смогли в целом завершить сессию среды в плюсе, ММВБ=-0,25, РТС = +0,39%.

Минфин проводил аукцион по размещению ОФЗ в объеме 30 млрд. руб., заявленный интервал доходности от 7,12 до 7,17%, погашение в феврале 2019 г. Аукцион не состоялся в связи с тем, что доходность в поданных заявках превысила верхнюю границу установленного интервала. После покупки Роснефтью ТНК - ВР на госкомпанию будет приходиться 70% нефтедобычи в стране, а пока Moodys поместило рейтинги Роснефти и ТНК ВР на пересмотр с возможностью понижения.

ВЭБ проведет депозитный аукцион по размещению средств пенсионных накоплений в объеме 25 млрд. руб., срок размещения средств 357 дней, минимальная процентная ставка 8,5%. Казначейство также размещает на депозитах 15 млрд. руб. средств федерального бюджета, дата возврата 18 января 2013г., минимальная ставка размещения 7%.

Правительство России рассмотрит прогнозный план приватизации до 2013г. Президент провел первое заседание Совета при президенте по модернизации экономики и инновационному развитию России, а премьер-министр - совещание по развитию международного финансового центра в РФ. Госдума приняла в первом чтении законопроект, разрешающий президенту России продлевать срок пребывания руководящих чиновников в должности до 70-летнего возраста.

Инфляция с начала года составила 5,7%.

Европа. Торги закрылись ростом, FTSE 100 +0,12, DAX =+0,27, CAC 40 =+0,59%. Глава ЕЦБ в выступлении перед немецкими парламентариями заявил, что новая программа по покупке облигаций не приведёт к инфляции, не окажет негативного воздействия на независимость центробанка, не создаст дополнительных рисков для налогоплательщиков еврозоны.

Госдолг еврозоны во II квартале составил 90% ВВП (в I квартале 88,2% ВВП), при этом в Греции 150,3% ВВП (136,9% ВВП), рост госдолга Греции обусловлен притоком в страну новых кредитов по линии внешней помощи. По другим странам еврозоны госдолг к ВВП равен: Испания 126,1%, Португалия 117,5%, Ирландия 111,5, Эстония 7,3%, Болгария 16,5%, Люксембург 20,9%. В Европейском суде начались слушания по вопросу законности создания постоянного фонда помощи проблемным странам (европейского механизма стабильности), окончательное решение может быть вынесено уже до конца текущего года. Во Франции за месяц индекс деловой активности в промышленности увеличился с 42,7 до 43,5 пункта (ожидалось 44,0), в сфере услуг с 45 до 46,2 пункта (ожидалось 45,7). Соответствующие показатели в Германии снизились с 47,4 до 45,7 (48) и с 49,7 до 49,3 (50).

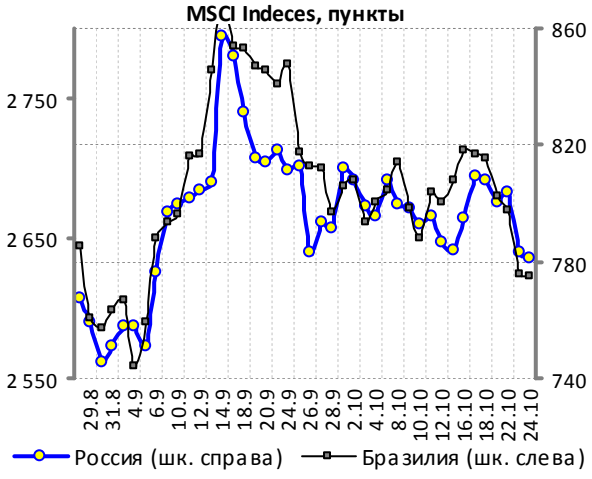
Инфляция с начала года по евросоюзу в целом равна 1,9%, самый высокий рост цен на Мальте (+6%), в Венгрии (+4,9%) и в Румынии (+4%), самый низкий в Греции (0,2%).

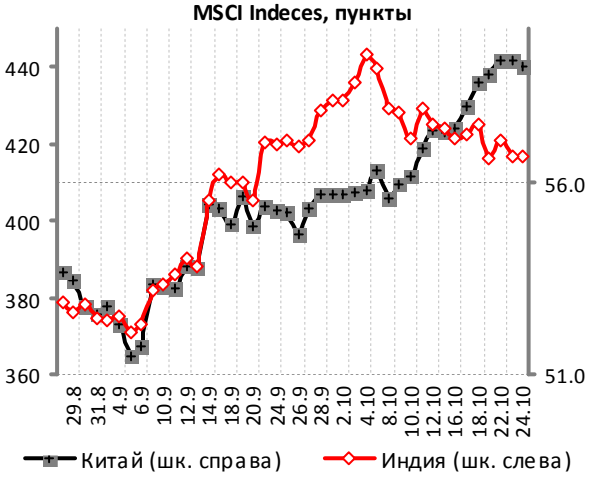
Азия. Улучшение ситуации в производственном секторе Китая (индекс деловой активности в промышленности HSBC, хотя и остался ниже отметки в 50 пунктов, увеличился с 47,9 до 49,1 пункта) смогло замедлить снижение биржевых индексов, но в целом фондовые торги завершились разнонаправлено, снижение Nikkei и Kospi на 0,67 каждого, рост Hang Seng и SSE соответственно на 0,31 и 0,07%.

Золото. Сохранение прежней политики ФРС (отсутствие нового QE) повышает привлекательность более рисковых активов, с утра среды фьючерсы на золото торговались по 1711,7, к 13.17 по 1709,57, сегодня утром золото = 1706,49, серебро = 31,85, платина = 1578,4, палладий = 601,15 долл. за унцию.

Нефть. Запасы нефти в США, как оказалось согласно официальной статистике, выросли больше, чем ожидалось. Brent и Light утром среды шли по 108,93 и 87,17, к 13.17 по 108,71 и 86,80, сегодня утром по 108,07 и 85,82 долл. за барр.

Статистика, события, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем новые данные по рынку труда США (16.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются разнонаправлено, Азия преимущественно в плюсе, цена нефти не растет. У нас сегодня уплата НДПИ и акцизов, ликвидности хватает и российские биржи попытаются выйти в плюс, используя поддержку других площадок, но вероятность устойчивого роста невелика.

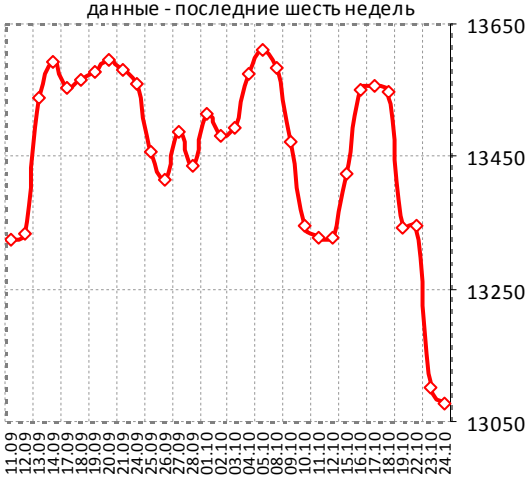




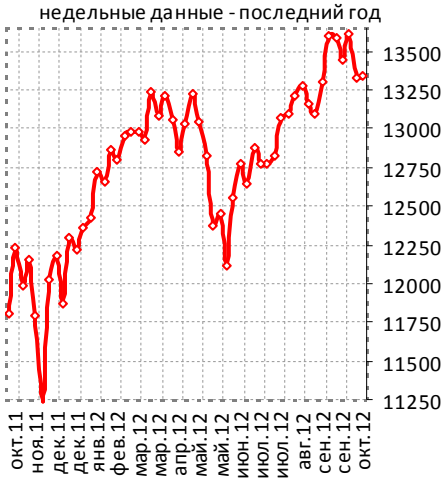
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

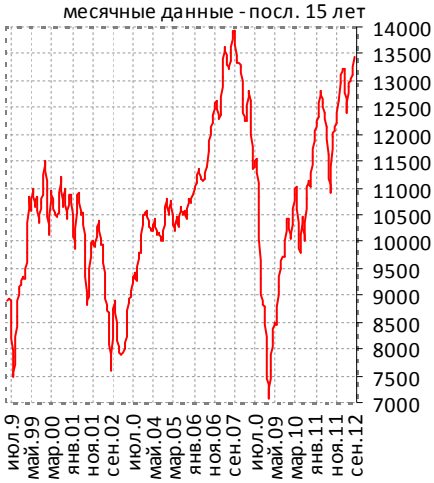
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



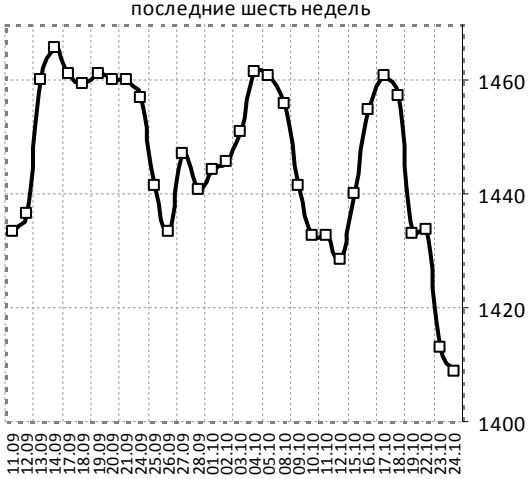
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



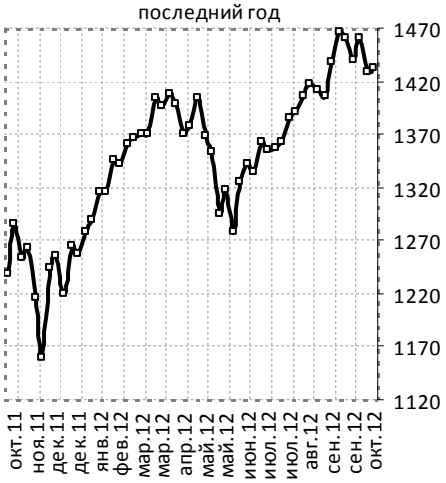
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



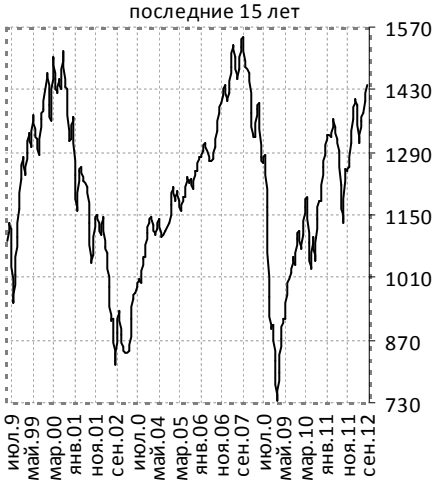
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



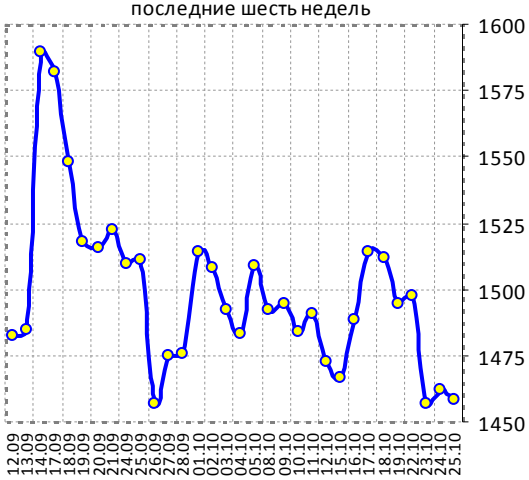
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



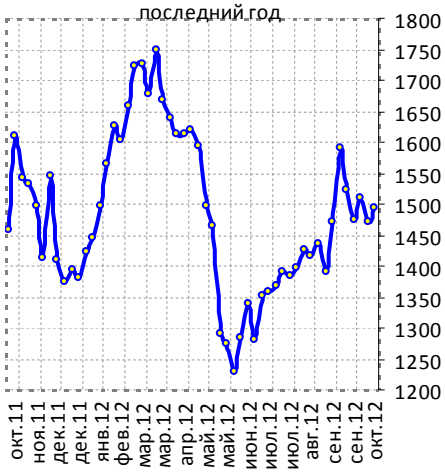
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



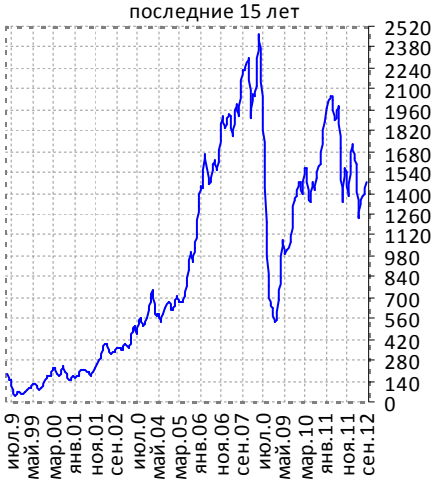
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



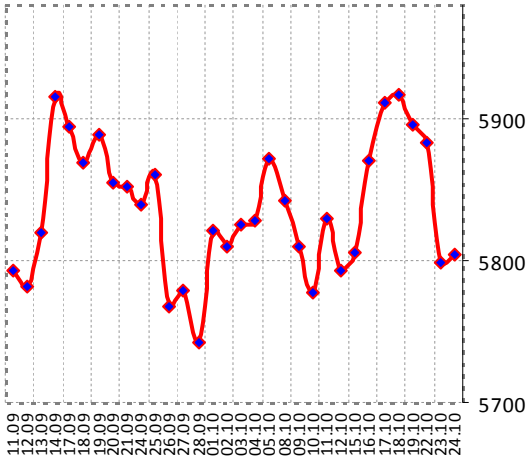
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



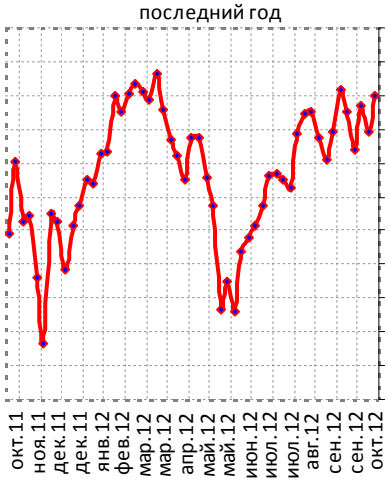
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

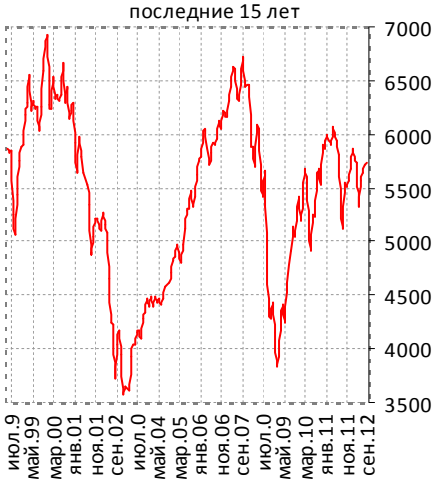
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



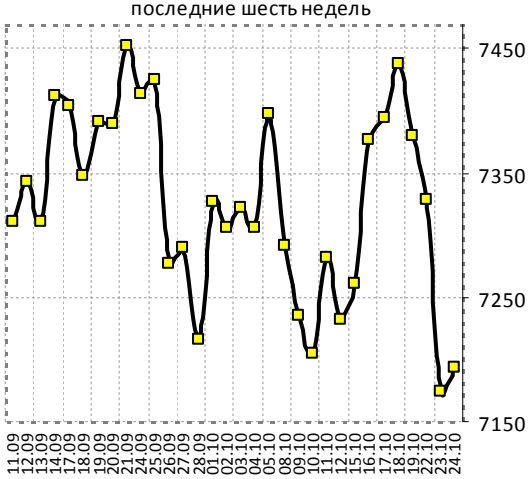
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



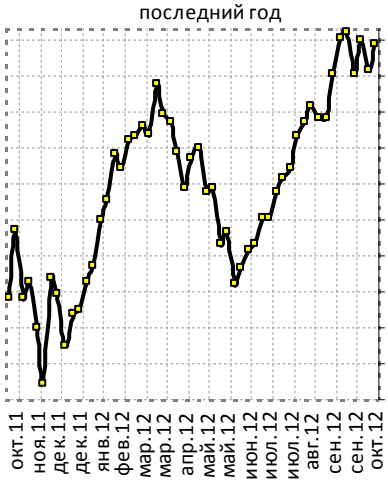
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



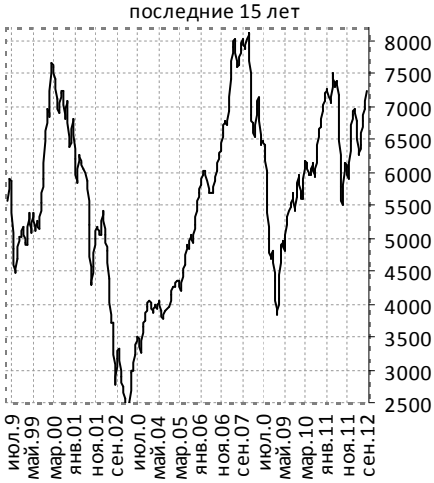
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



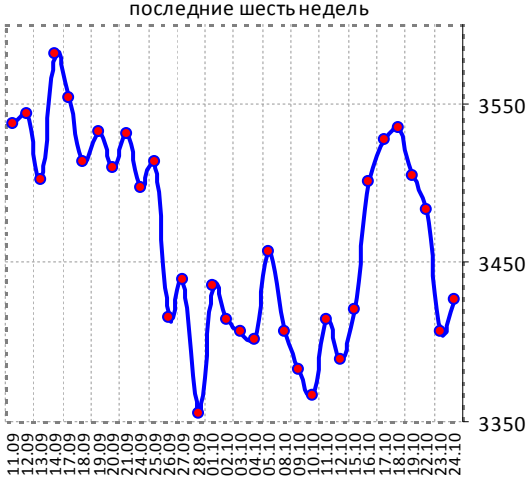
DAX Index: недельные данные - последний год



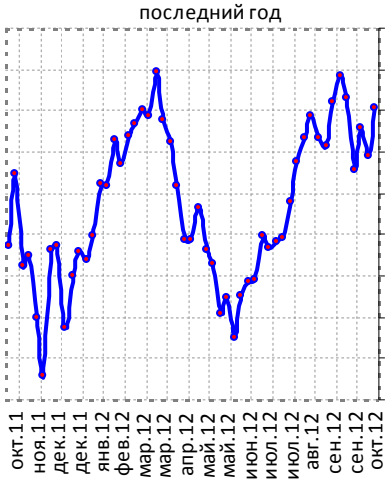
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



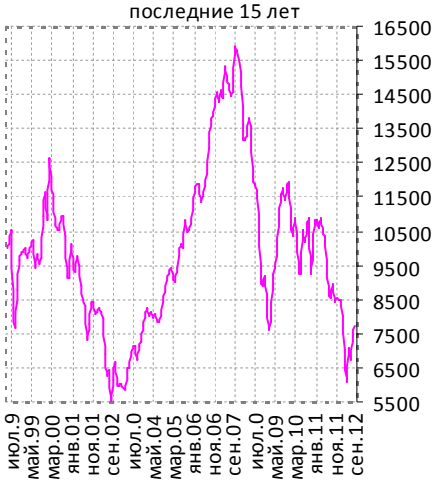
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

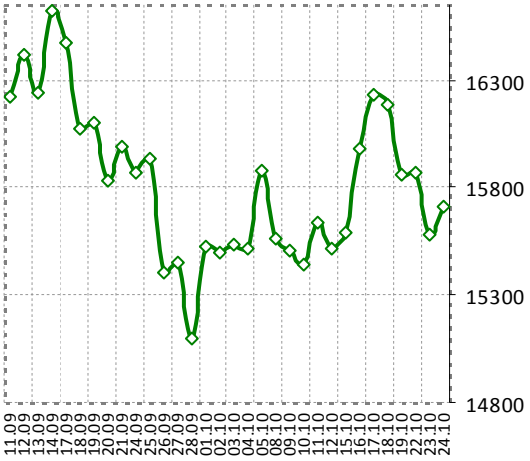


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

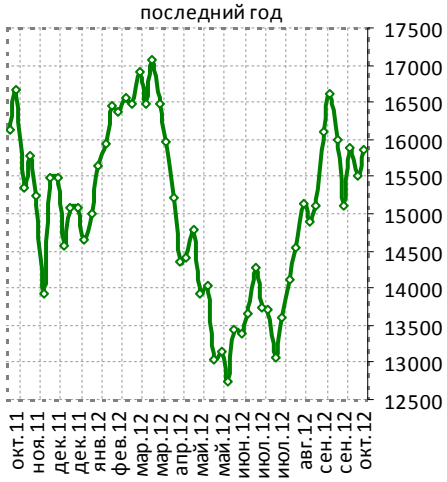


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



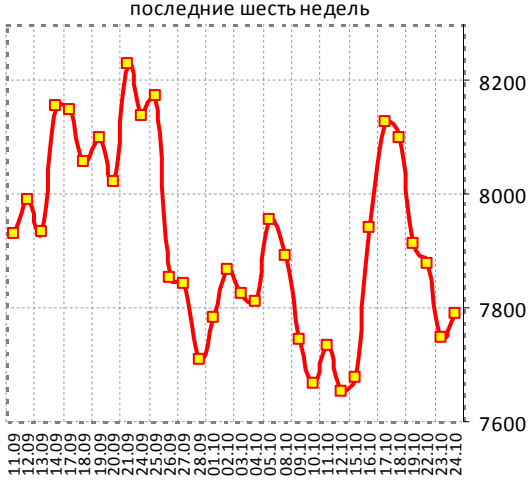
MIB Index: недельные данные - последний год



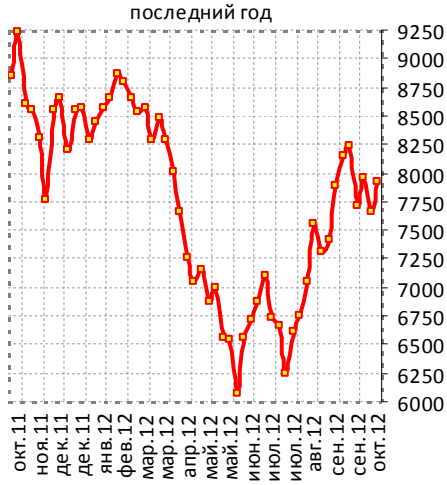
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



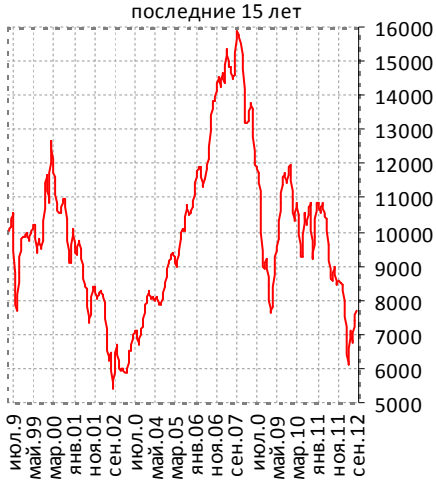
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



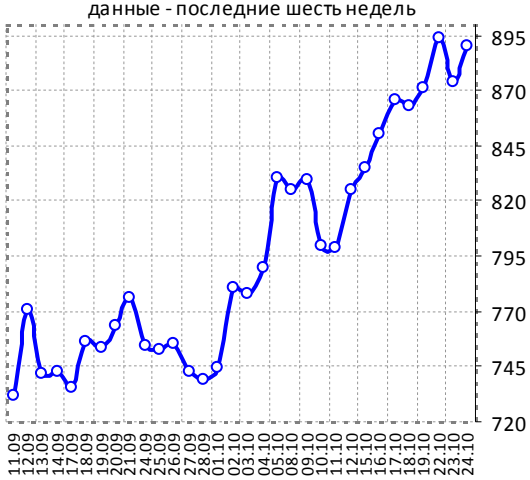
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



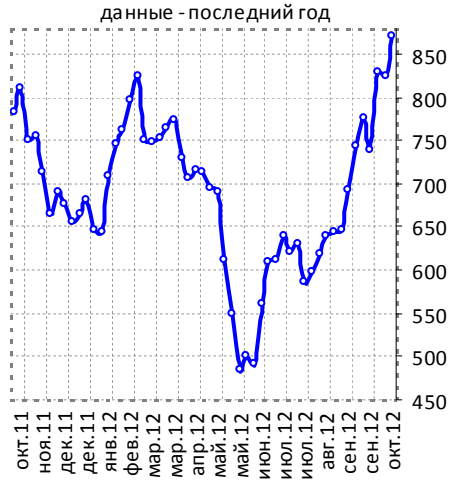
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



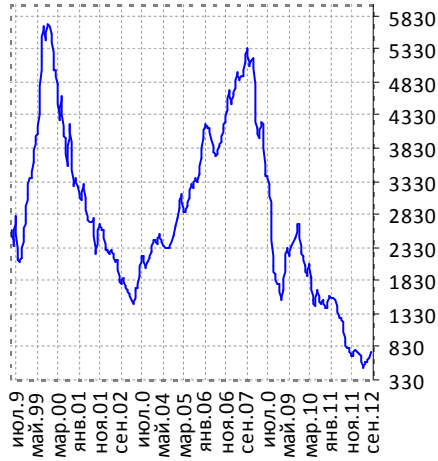
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



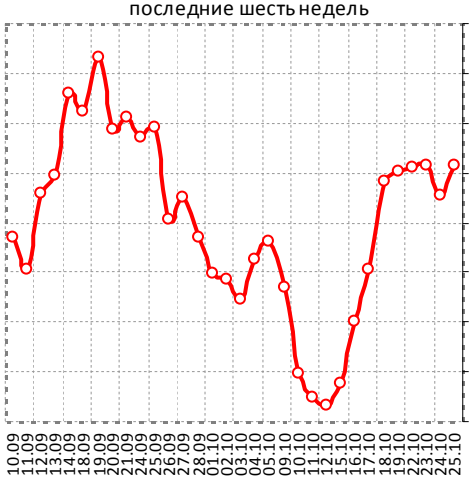
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



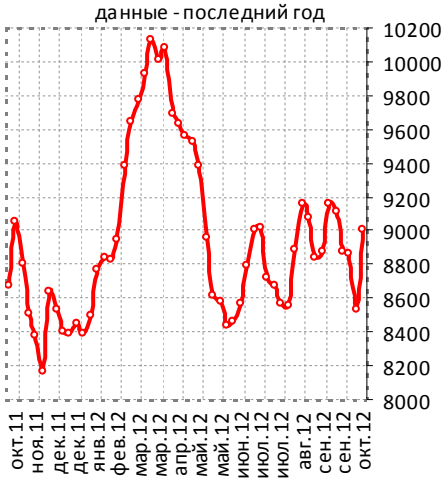
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

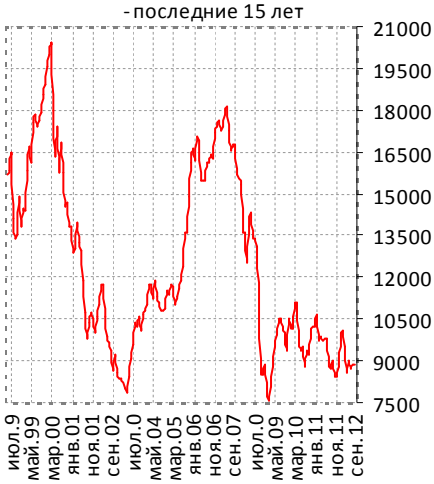
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



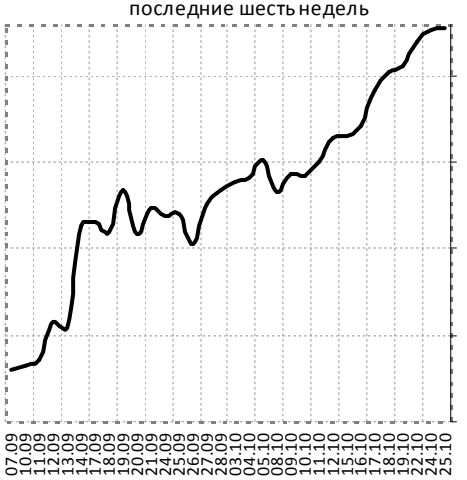
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



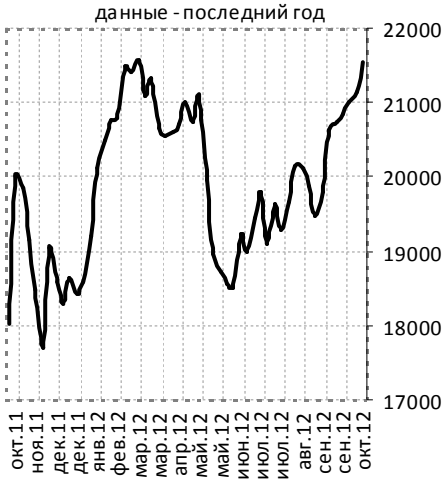
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



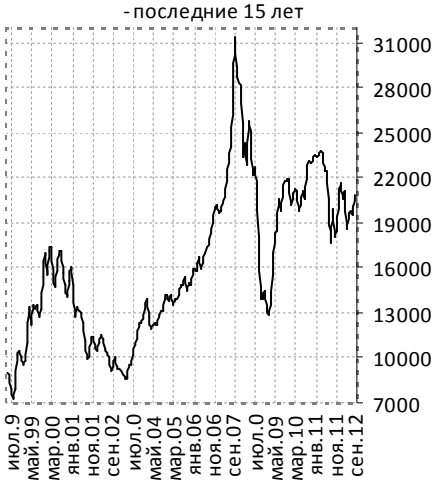
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



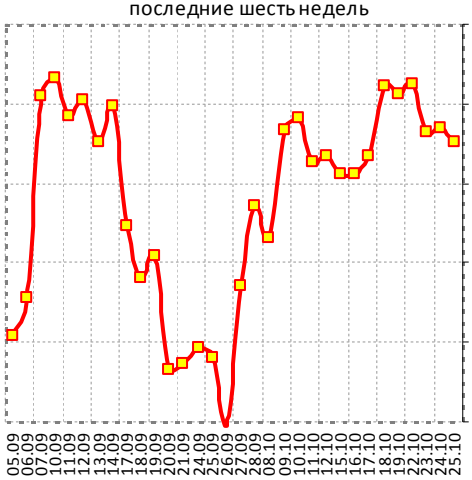
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



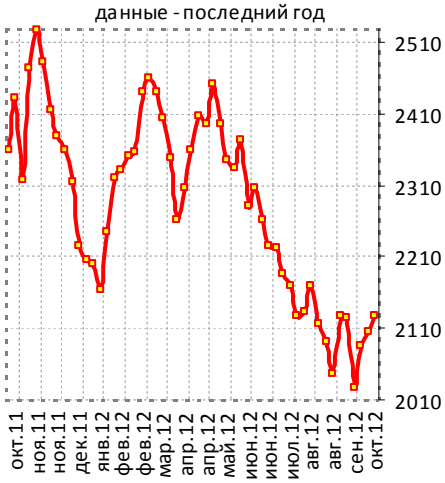
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



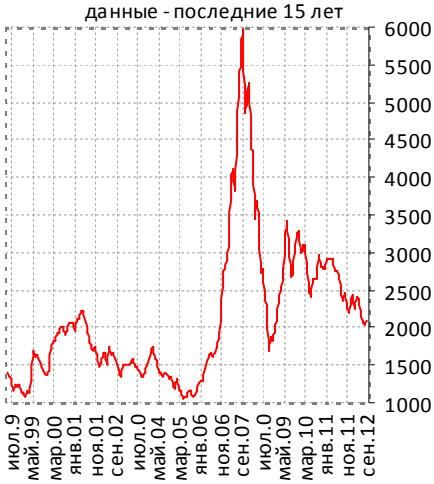
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



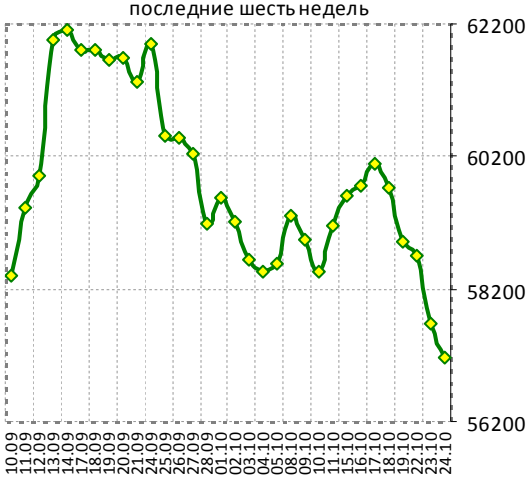
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



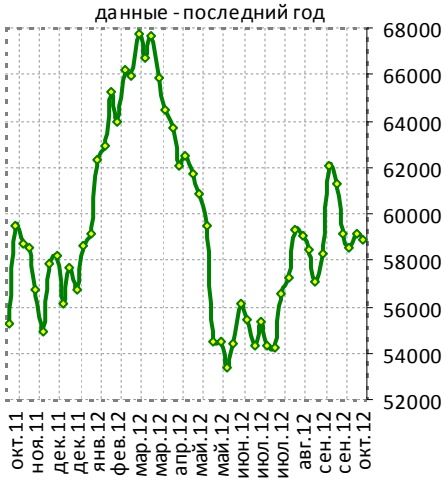
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

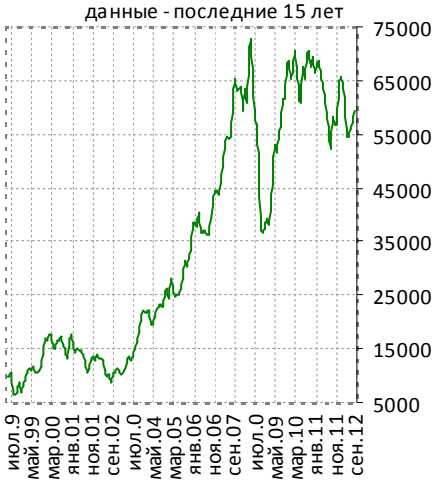
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



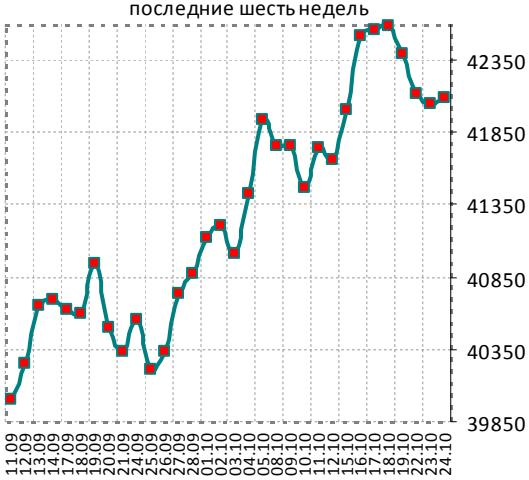
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



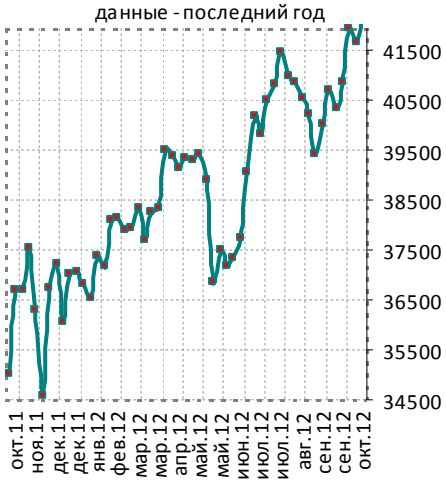
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



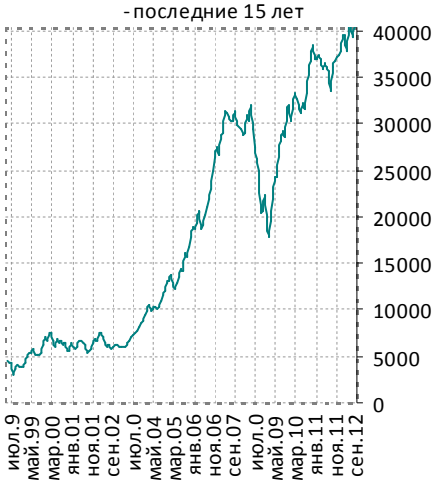
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



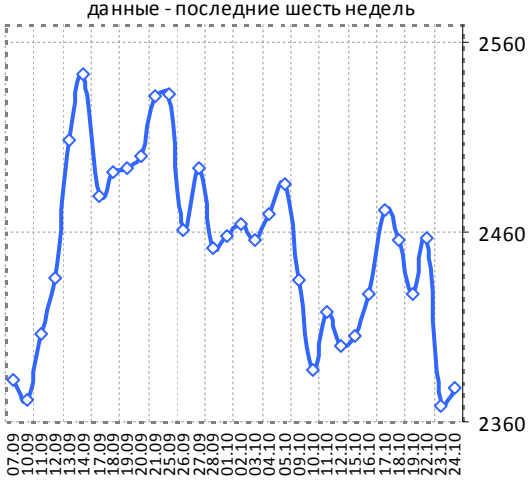
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



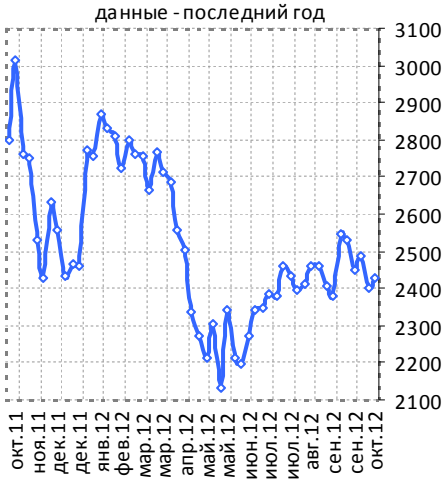
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



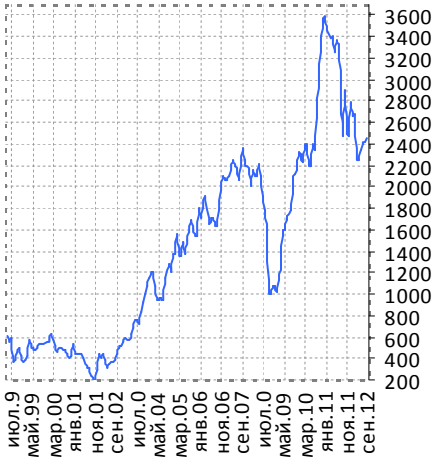
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

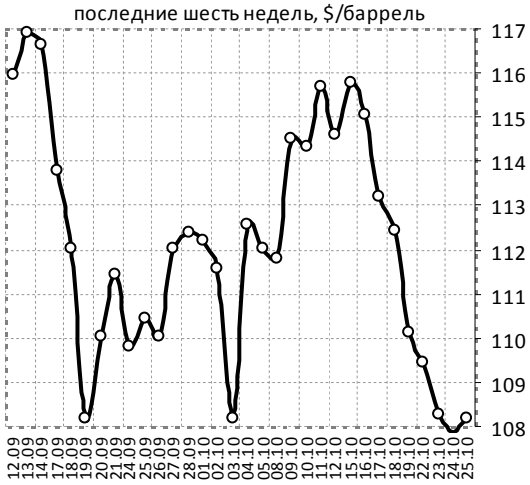


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

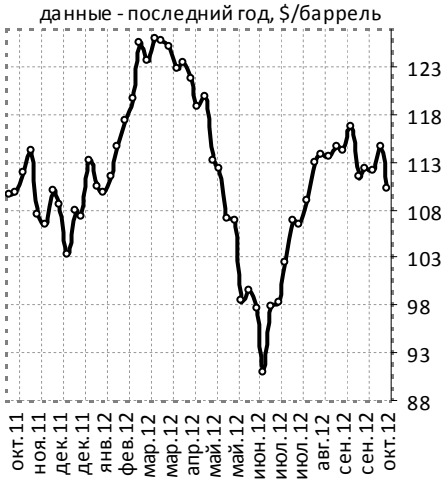
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

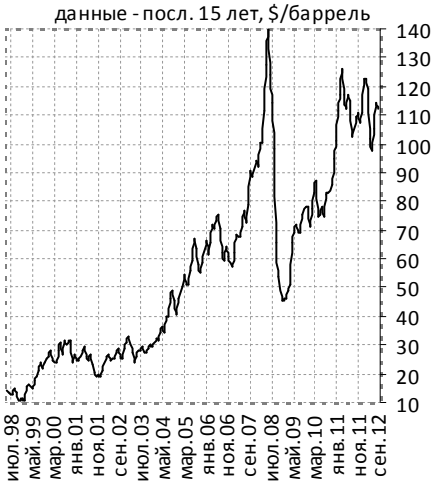
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



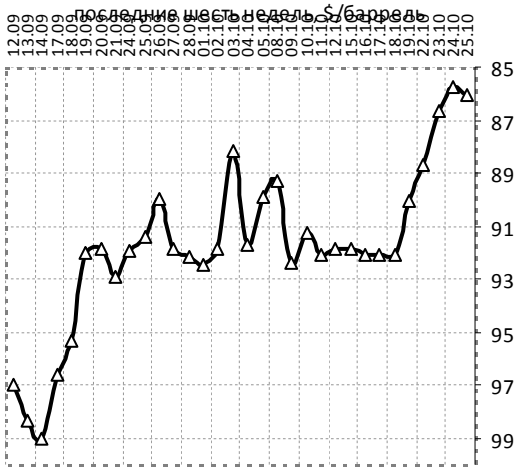
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



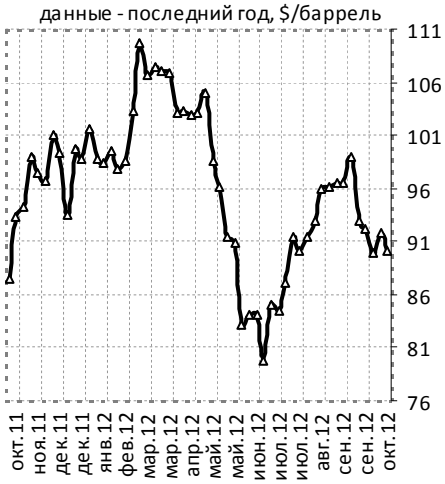
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



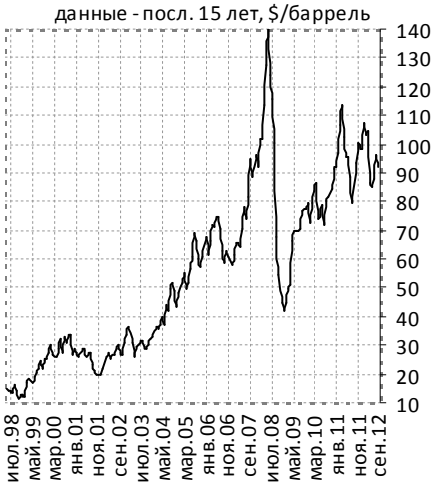
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



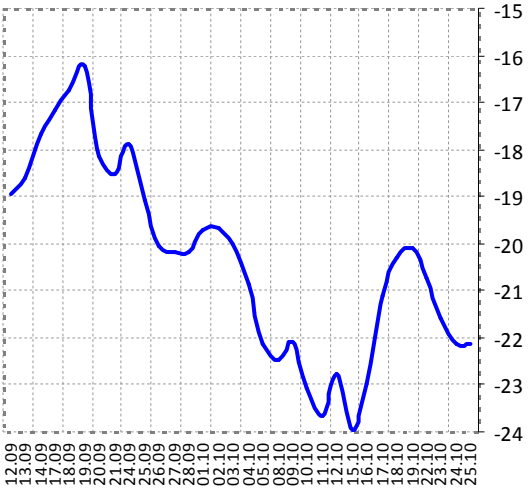
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



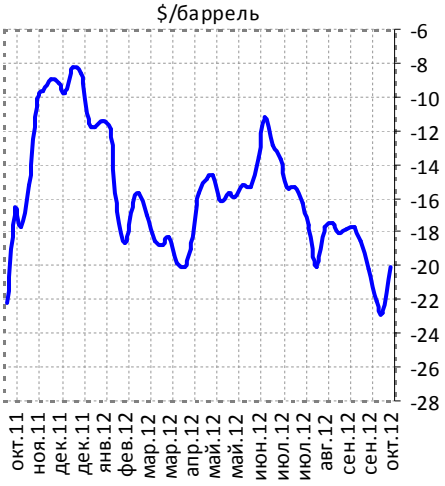
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



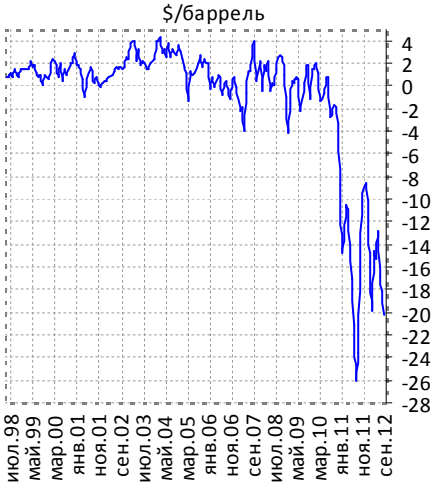
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



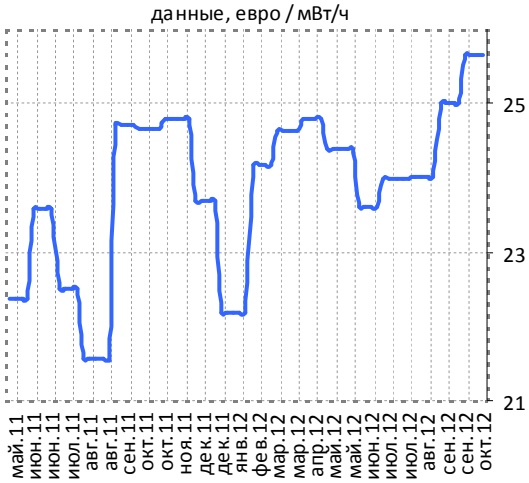
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



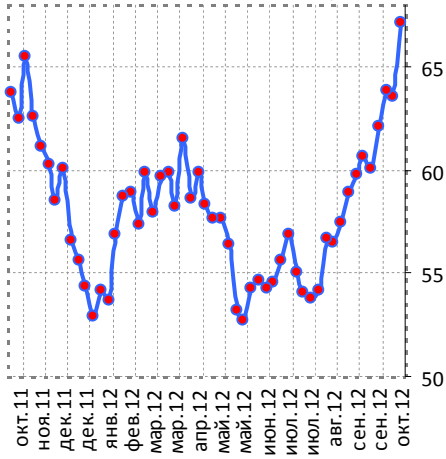
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

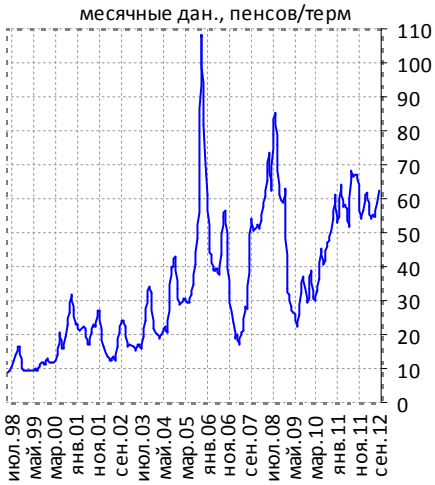
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



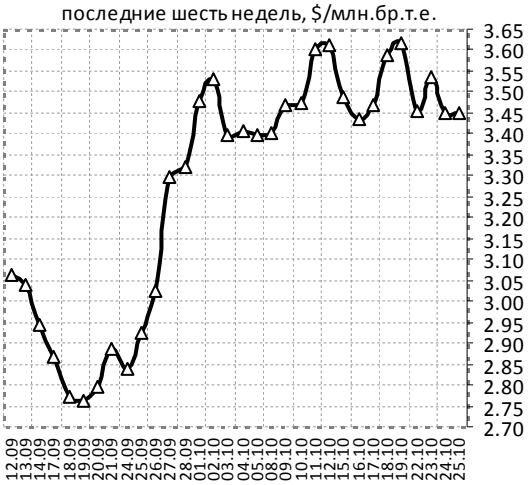
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



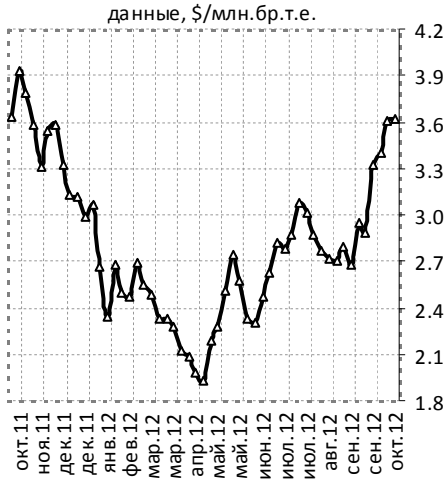
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



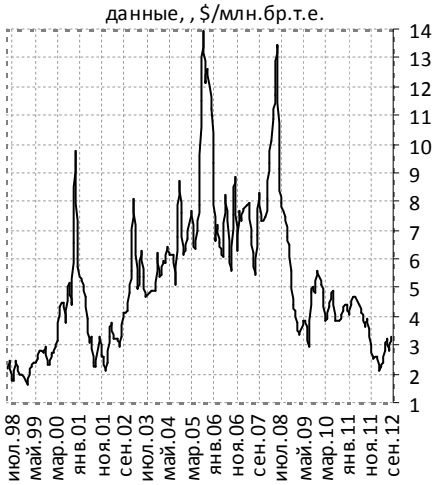
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



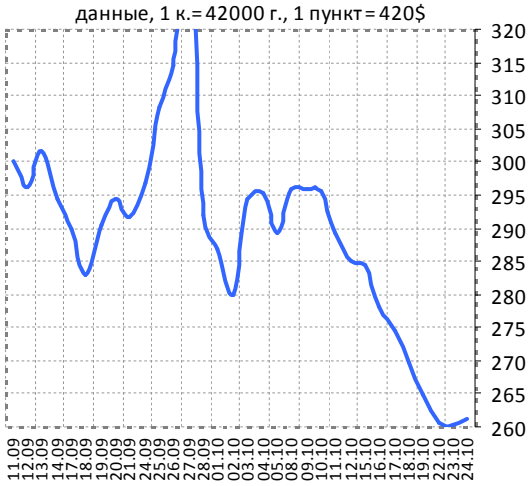
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



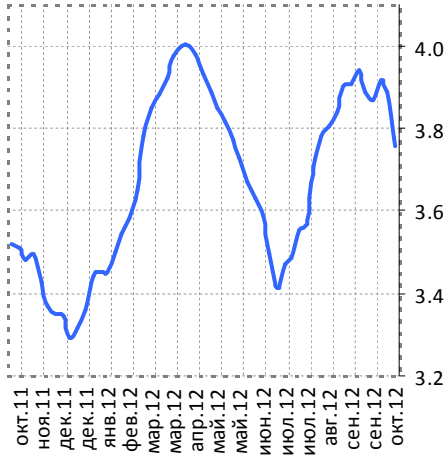
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



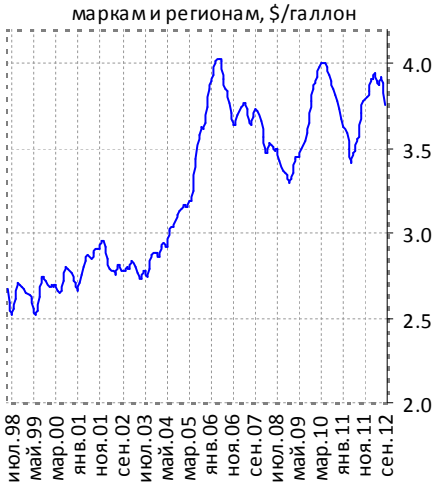
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



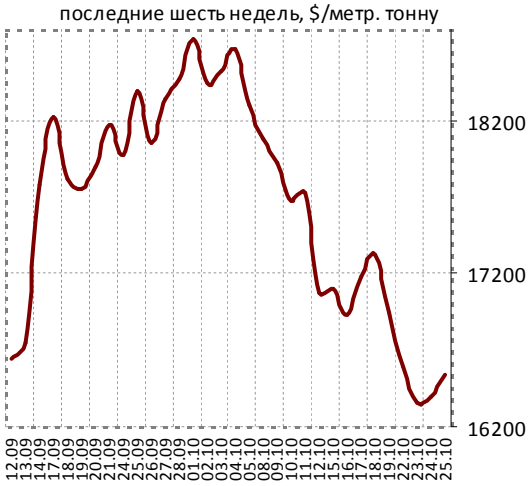
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



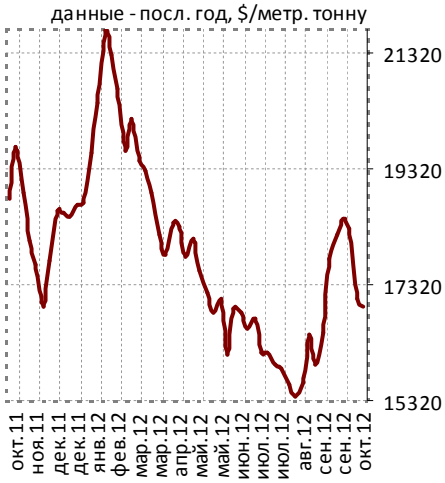
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

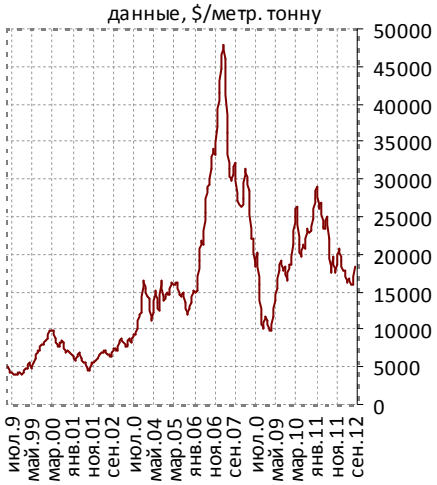
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



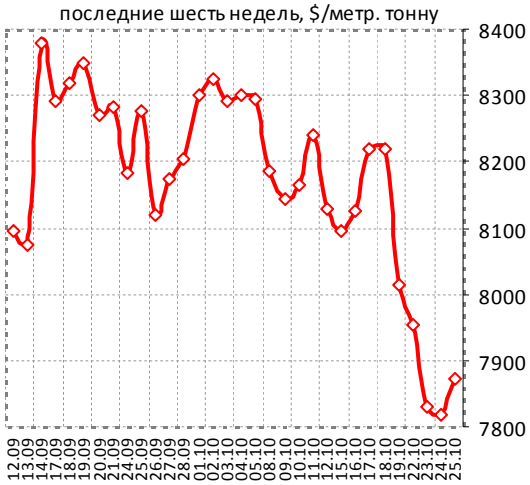
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



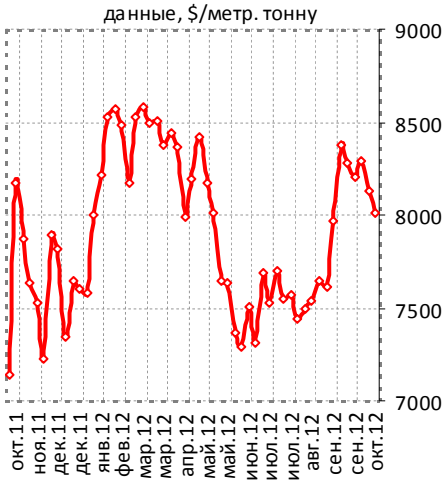
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



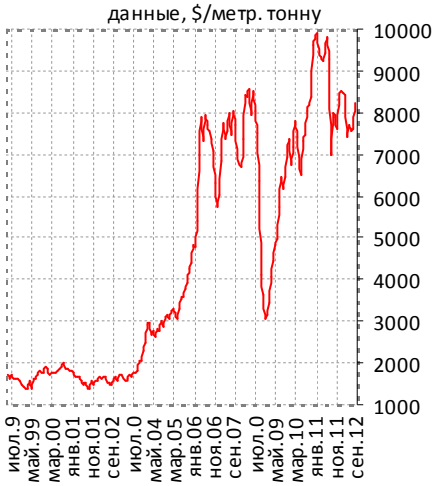
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



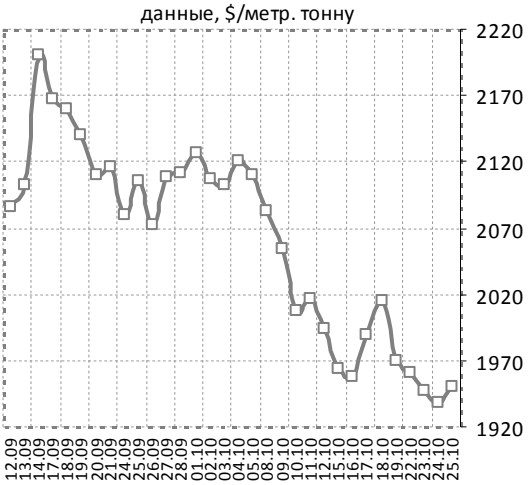
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



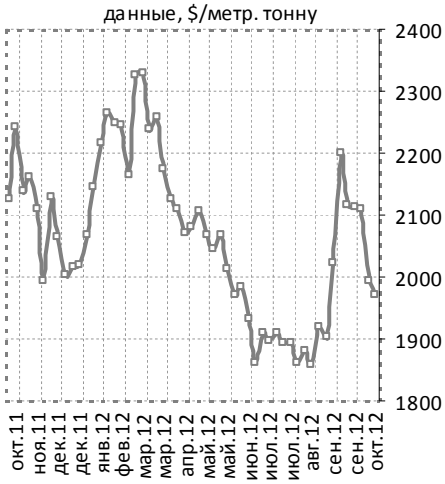
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



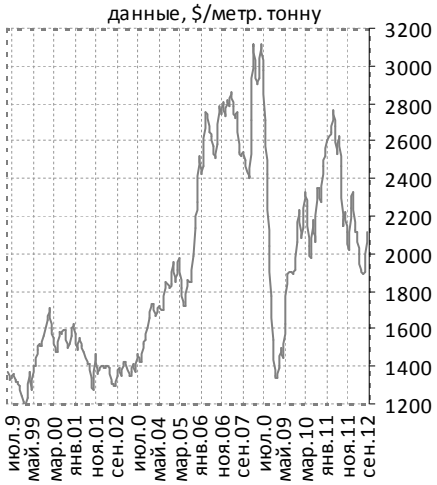
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.