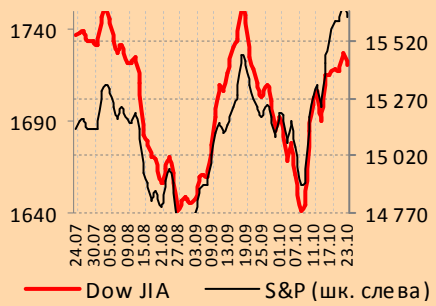
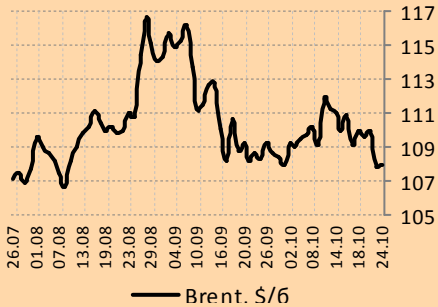
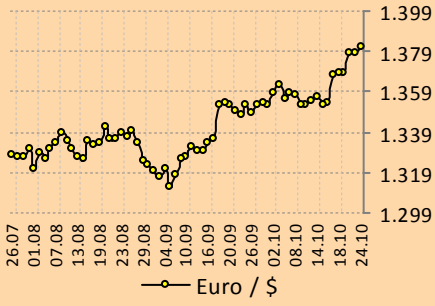
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

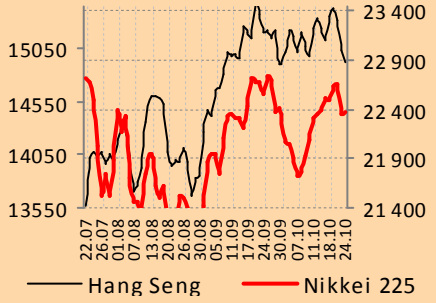
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

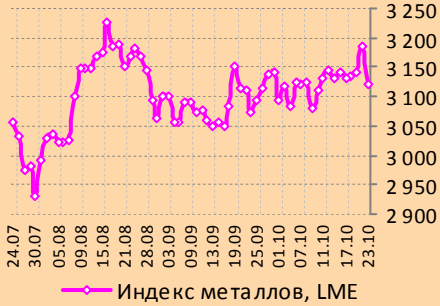
Ежедневный обзор

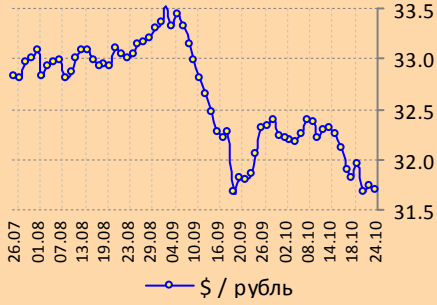






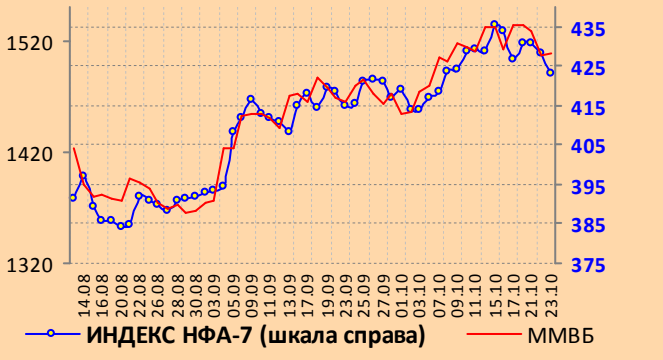






СОДЕРЖАНИЕ

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



Представители Банка Франции считают, что стране может потребоваться проведение частичной реструктуризации госдолга в связи с недостаточными объемами поступлений в бюджет (ЦБ РФ, Обзор глобальных рисков, сентябрь, 2013, стр. 6).

США. Сессия среды закончилась снижением индексов, Dow Jones на 0,35, S&P 500 на 0,4, NASDAQ на 0,57%, помимо технической коррекции, инвесторы выразили озабоченность корпоративной отчетностью, а на NASDAQ – негативное отношение к презентации нового iPad (котировки акций Apple снижались особенно интенсивно). Вышла информация по динамике экспортных и импортных цен в сентябре, первые увеличились на 0,3%, вторые на 0,2%. Крупнейший в мире производитель горнодобывающего и строительного оборудования Caterpillar оказался в условиях низкого спроса на продукцию, прибыль в третьем квартале составила 946 млн. долл. или 1,45 долл. на акцию (соответственно 1,7 млрд. долл. и 2,54 долл. годом ранее), при этом ожидания рынков были на уровне 1,66 долл. на акцию.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, сессия среды закрылась снижением биржевых индексов, ММВБ на 1,41, РТС на 1,55%. Банки остро нуждаются в ликвидности, так, ЦБ вчера провел аукцион по предоставлению однодневного РЕПО в сумме 10 млрд. руб., спрос в 12 раз (!) превысил предложение и составил 120 млрд., кредит выдан в размере лимита под 6,29%, ставка рынка 6,20%. Казначейство сегодня тоже пополняет ликвидность банков, размещает 25 млрд. руб. на 35 дней, минимальная процентная ставка размещения 5,7%.

Инфляция с начала года равна 5,2%. Сальдо текущего счета платежного баланса за январь-сентябрь составило 29,5 млрд. долл. США, что в два раза меньше, чем за аналогичный период прошлого года (61,5 млрд. долл.). Госдума приняла в первом чтении законопроект об установлении с 1 января 2014 г. МРОТ в размере 5554 руб. в месяц, при этом величина прожиточного минимума (повышена недавно с 6705 до 7095 руб.), какой бы минимальной она не была, превышает МРОТ, в прошлом году численность населения с денежными доходами ниже прожиточного минимума в целом по стране составляла 15,8 млн. человек или 11,2% от общей численности населения.

Европа. Торги среды закрылись в минусе, шла техническая коррекция после роста накануне, FTSE 100 =0,32, DAX 30 = 0,31, CAC 40 =0,81%, в основном инвесторы реагировали на возможные негативные последствия для банков в результате проведения со стороны ЕЦБ масштабного стресс-тестирования в ноябре. Макростатистика имела неоднозначный характер. Так, растет госдолг, если на середину прошлого года совокупный показатель еврозоны был ниже 90% ВВП, на конец I квартала текущего года 92,3% ВВП, то на конец II квартала уже 93,4% ВВП, максимальный госдолг у Греции (169,1% от ВВП страны), Италии (133,3%), Португалии (131,3%) и Ирландии (125,7%). При этом быстрее других стран госдолг увеличился на Кипре, за квартал с 87,5 до 98,3% (что неудивительно, учитывая кредиты от ЕС и МВФ), а в Германии снизился на 0,% до 79,8% ВВП. Инфляция в еврозоне с начала года равна 0,8%. По Испании статистика радовала, ВВП в 3 квартале увеличился на 0,1% относительно 2 квартала, впервые после девяти кварталов снижения, экономика вышла из двухлетней рецессии.

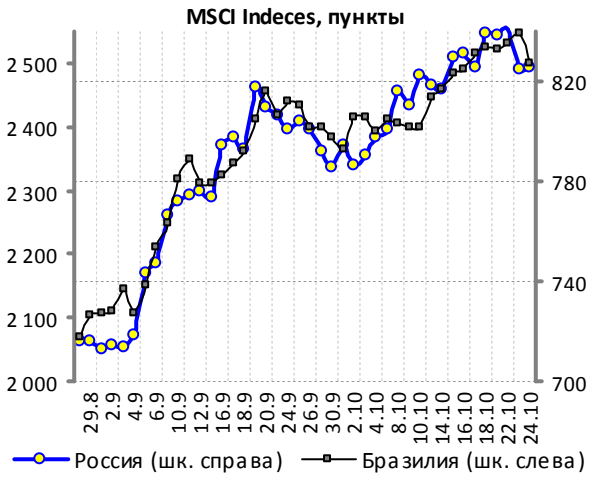
Азия. Торги среды закрылись снижением биржевых индексов (Nikkei на 1,95, Kospi на 0,99, SSE на 1,25, Hang Seng на 1,36%), вызванным укреплением иены и ростом ставок на рынке МБК Китая. Китай, кстати, сократил на 0,9% вложения в госбумаги США, а последняя статистика хорошая, индекс опережающих экономических индикаторов Conference Board месяц к месяцу повысился на 0,9%, индекс деловой активности в промышленности HSBC вырос с 50, 2 до 50,9 пункта.

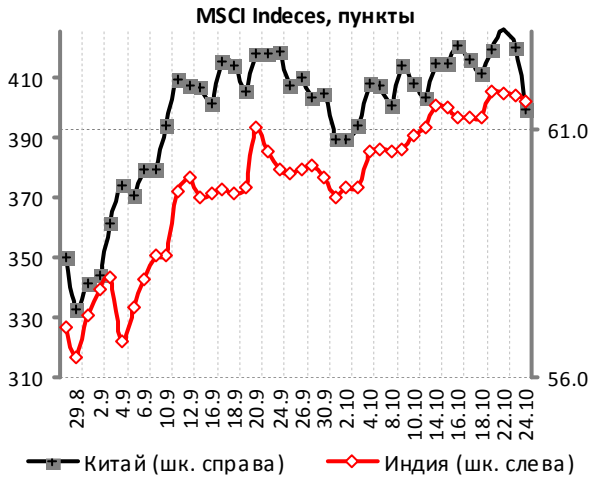
Золото. Фьючерсы на золото утром среды торговались по 1339,15, к 14.00 по 1332,39, утром сегодня золото = 1335, серебро = 22,7, платина = 1442,, палладий = 747 долл. за унцию.

Нефть. Brent и Light утром вчера шли по 109,68 и 97,87, к 14.00 по 109,34 и 97,20, сегодня с утра по 107,89 и 97,47 долл. за барр., инвесторы выходили из сырья в опасении очередного роста запасов в США, что вечером и подтвердила официальная статистика (рост почти в 2 раза превысил ожидания).

События, статистика, прогноз. Президент РФ примет участие в заседании Высшего евразийского экономического совета (главного органа Таможенного союза и Единого экономического пространства России, Белоруссии и Казахстана), основное внимание будет направлено на формирование к 1 января 2015г. Евразийского экономического союза. Из наиболее значимой статистики ждем из зоны евро ряд индексов деловой активности (11.00-12.00), из США данные по рынку труда (16.30) и продажи новых домов (18.00). Фьючерсы на биржевые индексы США сейчас торгуются в преимущественном плюсе, Азия в основном снижается, нефть не растет, но цены наших акций комфортны после вчерашнего снижения, что, вместе взятое, формирует неопределенный фон на открытии российских бирж.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 24.10.2013



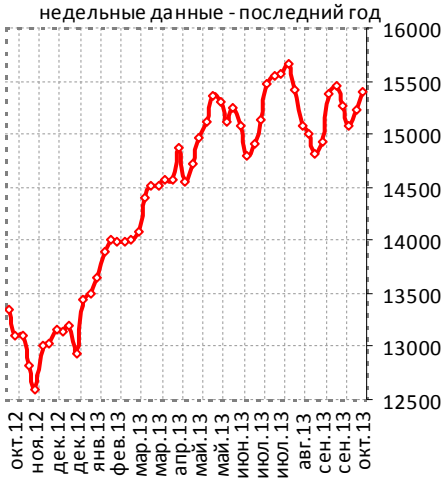


II. Фондовые рынки

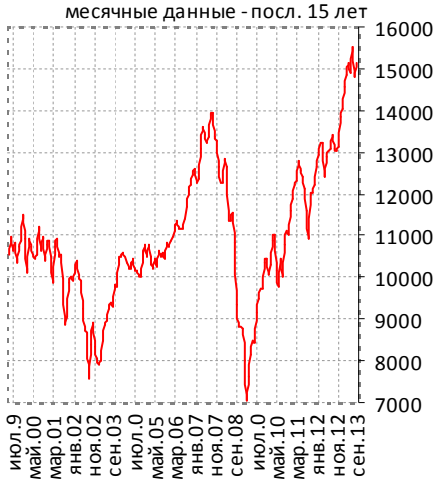
2.1. Америка & Россия

Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель

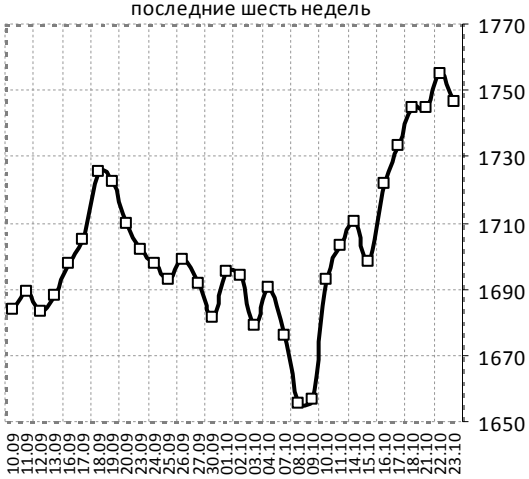
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



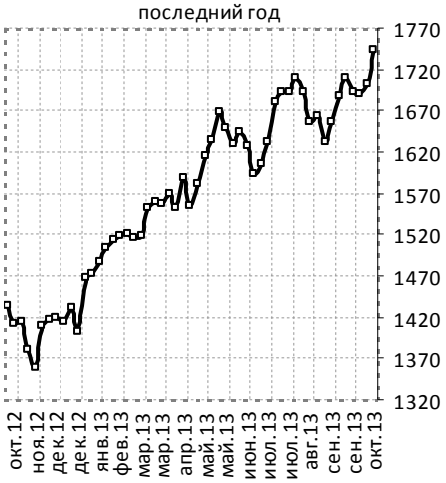
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



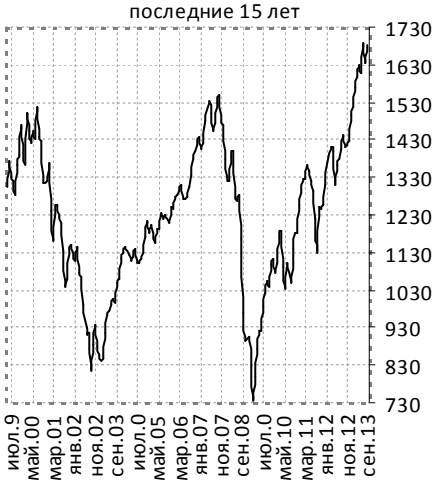
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



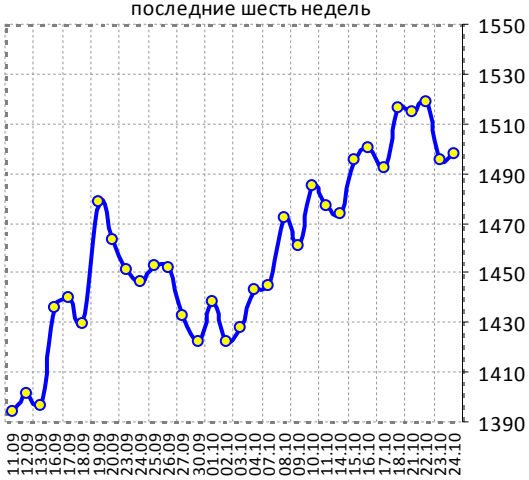
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



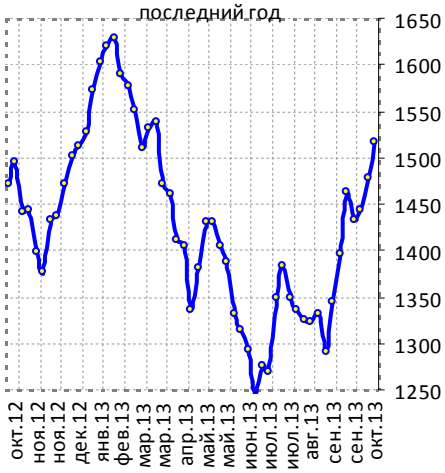
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



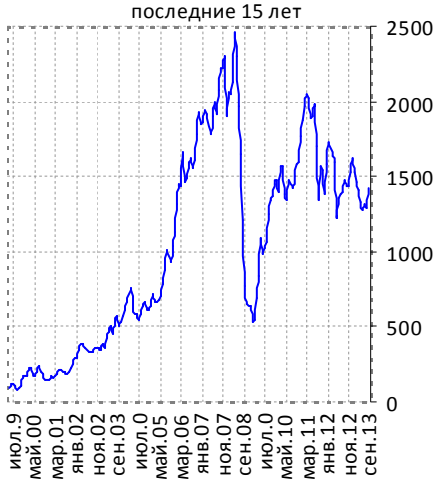
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



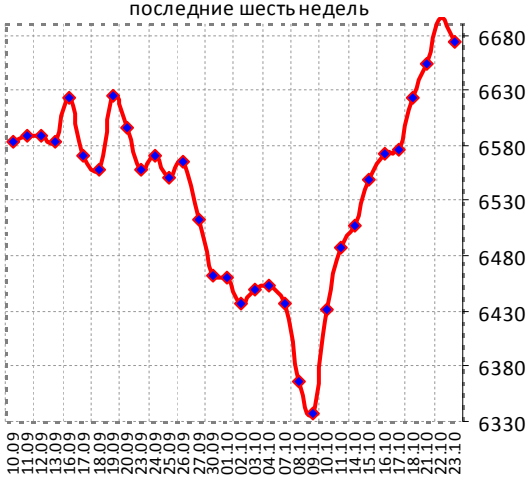
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



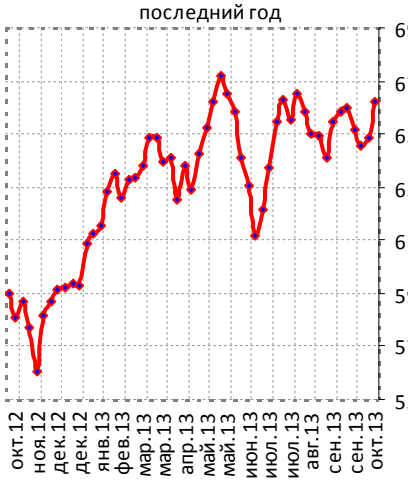
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

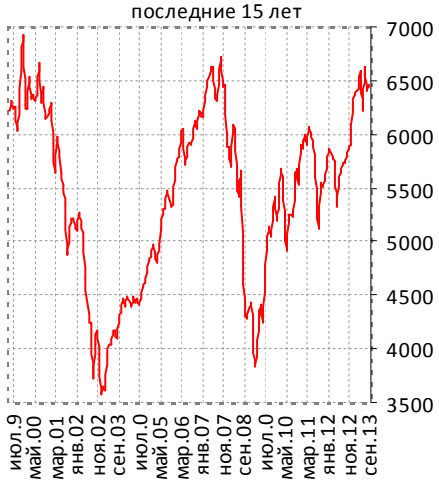
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



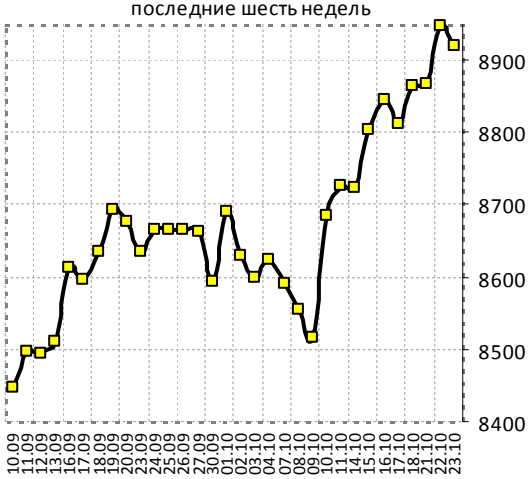
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



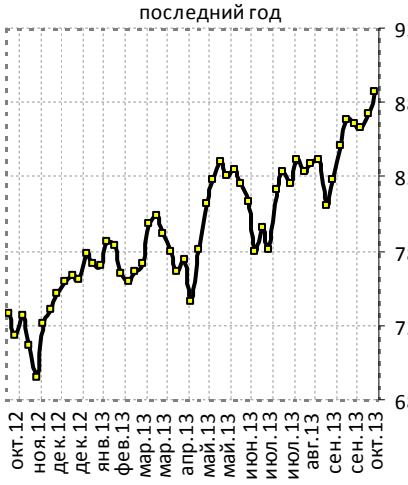
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель

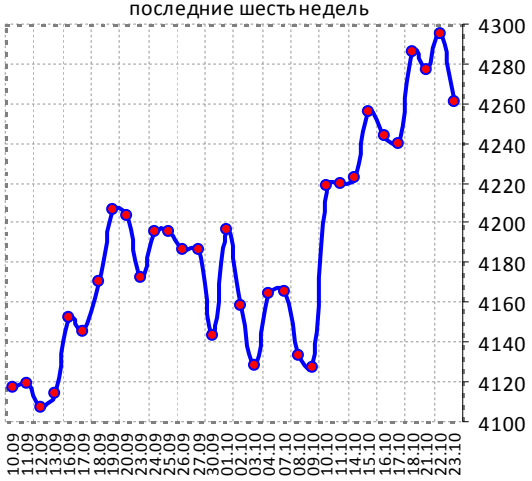


DAX Index: недельные данные - последний год

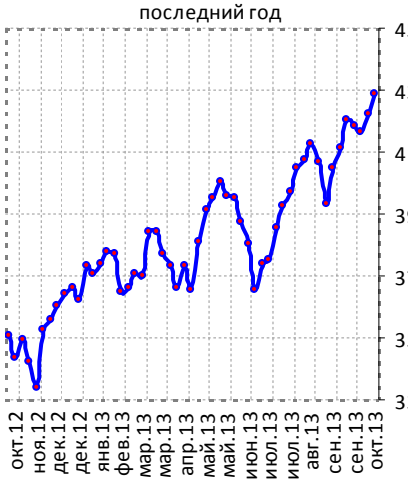


DAX Index: месячные данные - последние 15 лет

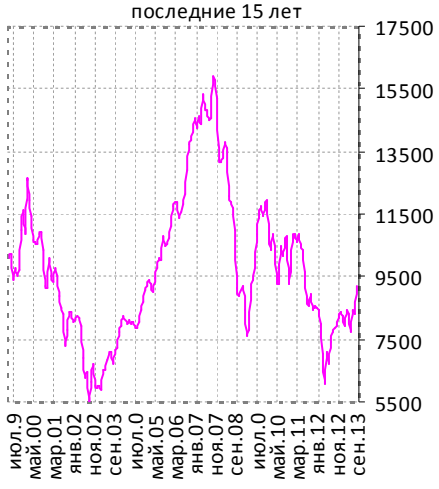
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

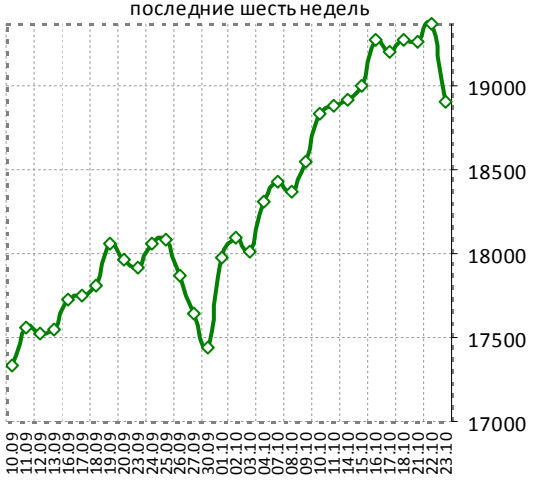


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

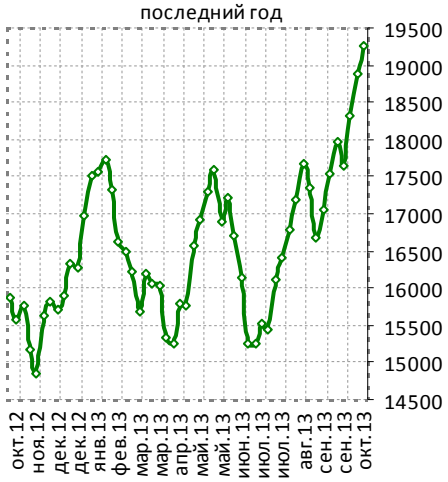


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

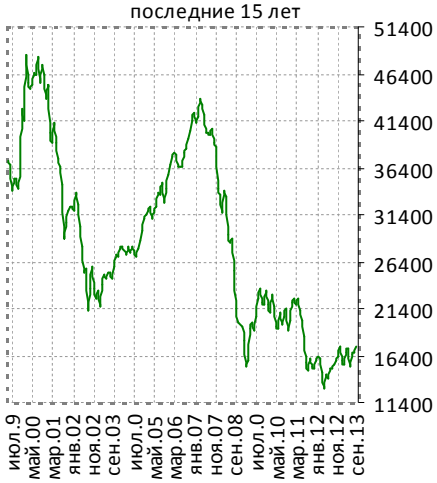
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



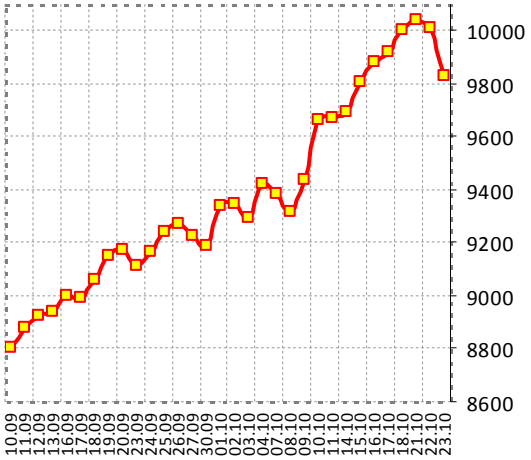
MIB Index: недельные данные - последний год



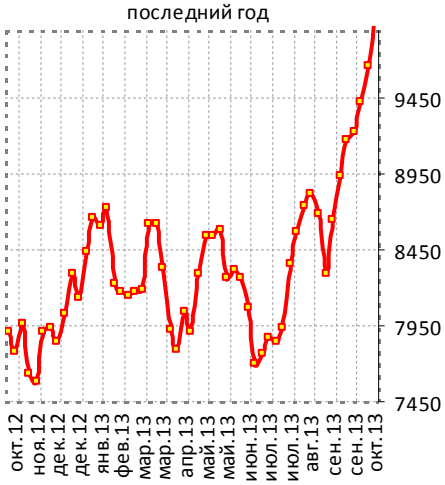
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



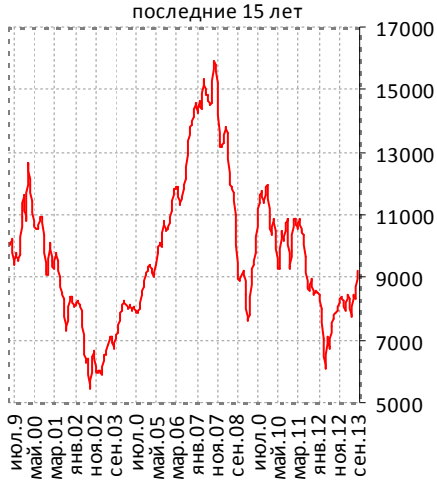
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



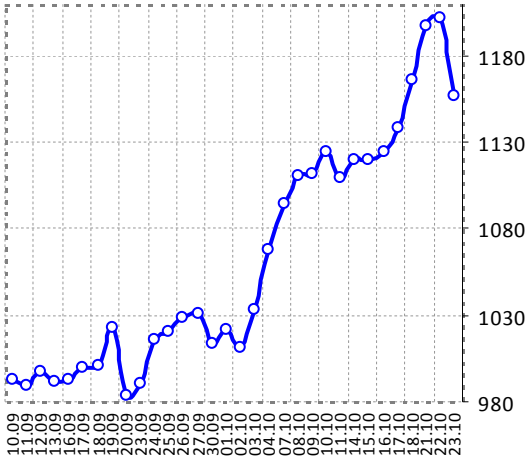
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



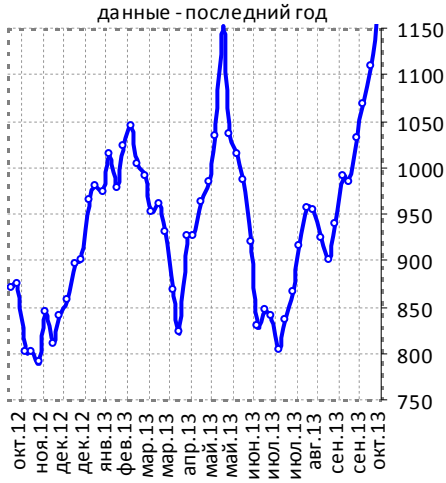
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



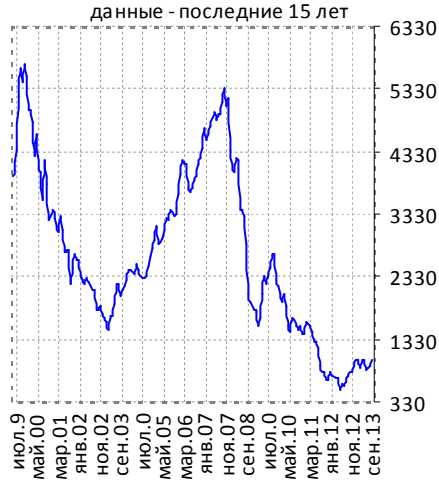
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



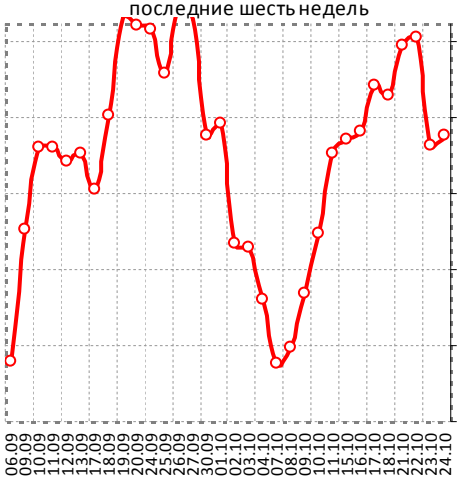
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



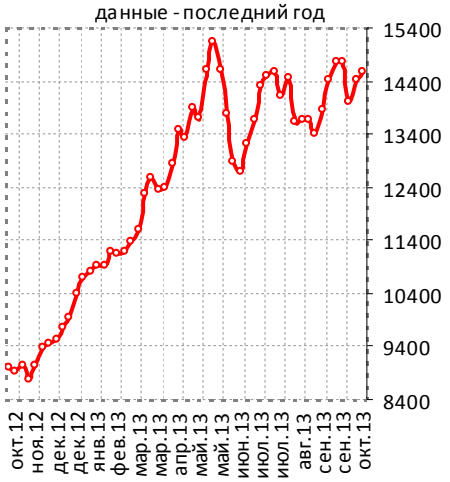
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

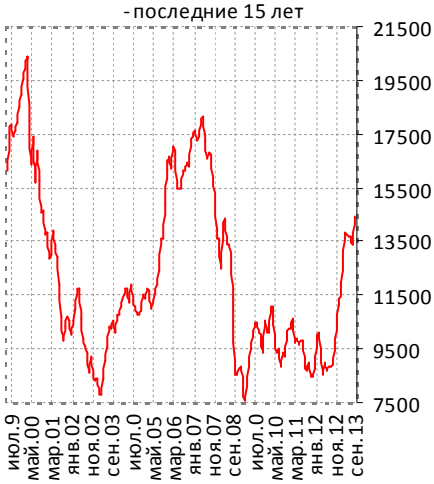
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



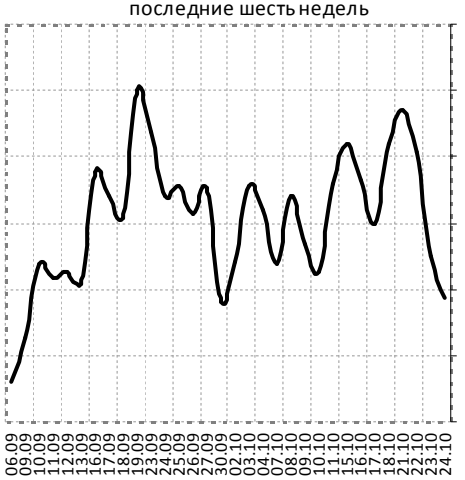
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



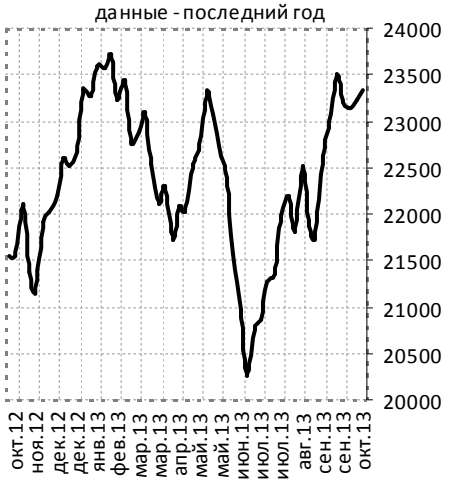
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель

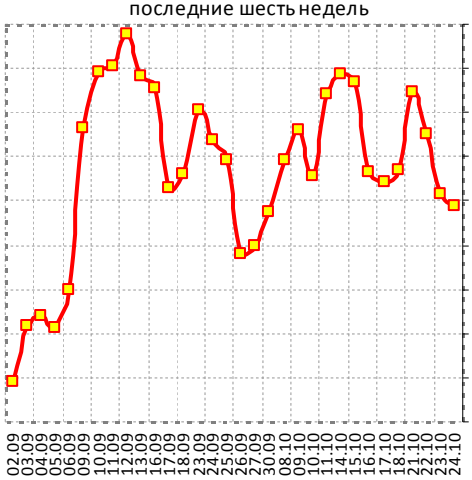


Hang Seng Index: недельные данные - последний год

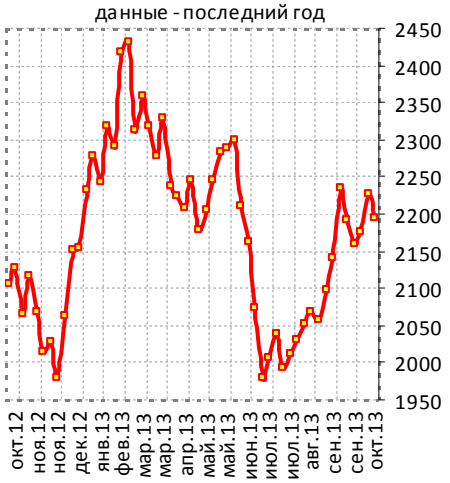


Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет

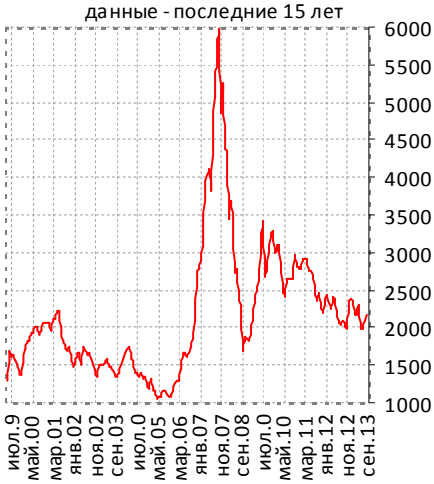
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



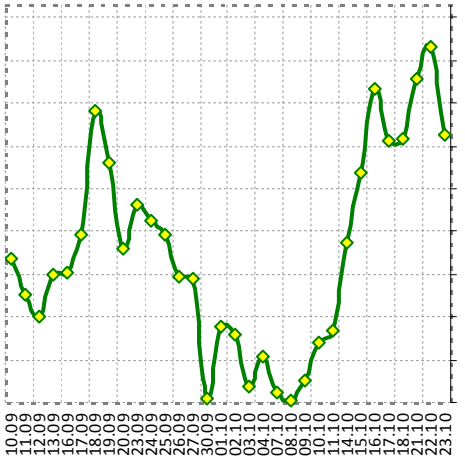
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



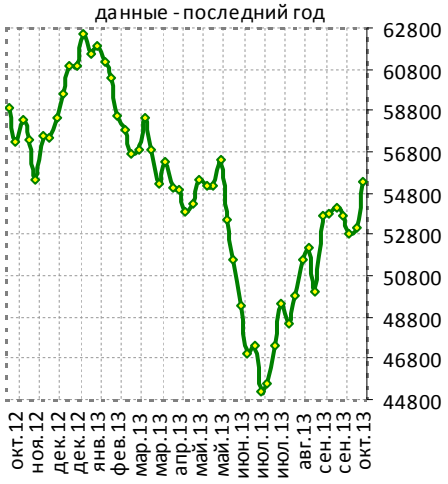
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

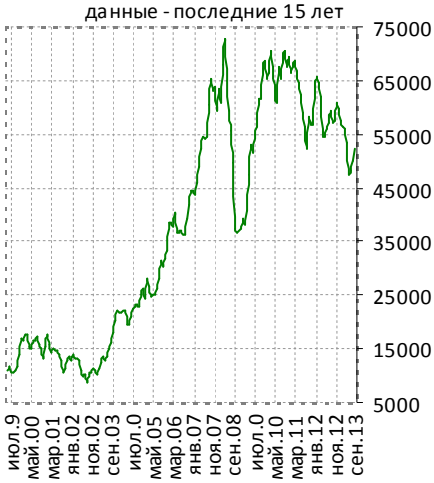
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



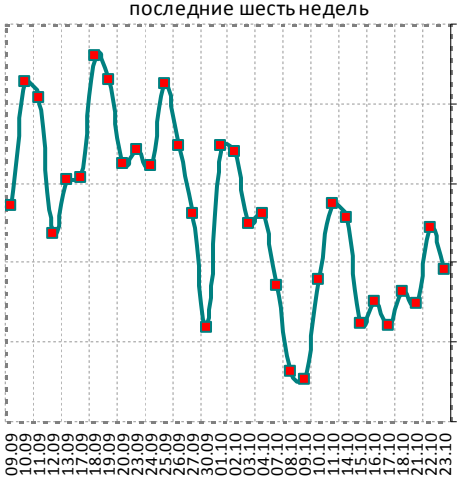
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



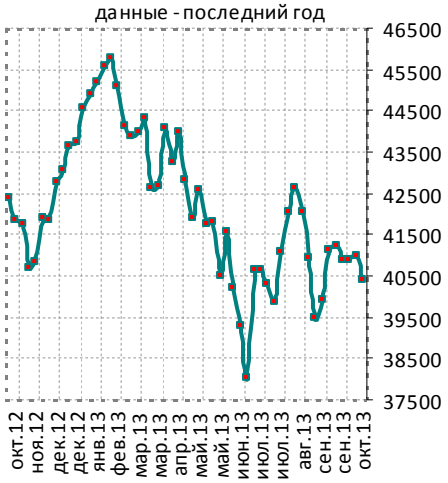
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



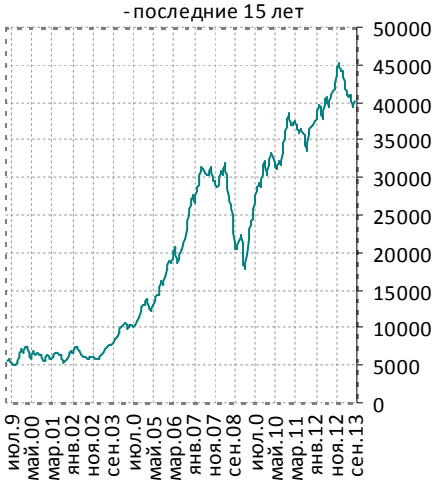
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



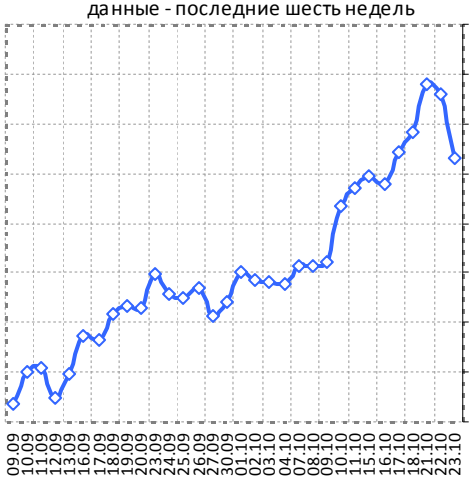
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



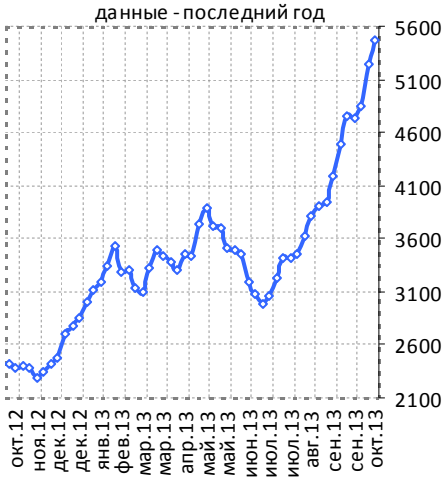
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



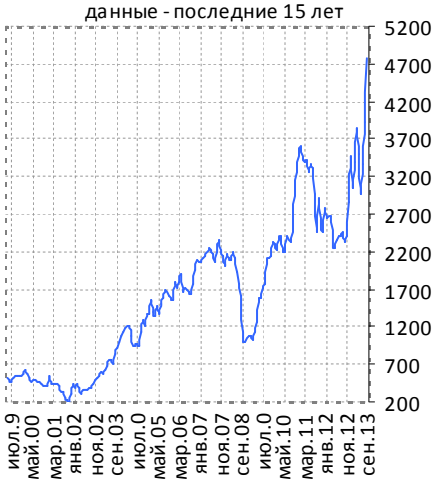
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

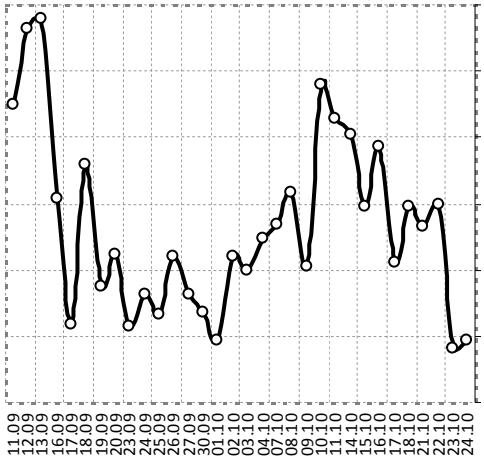


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

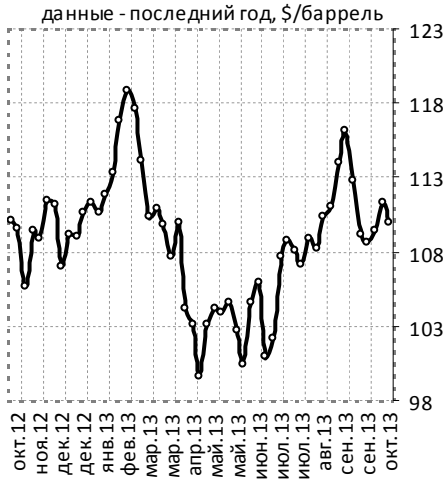
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

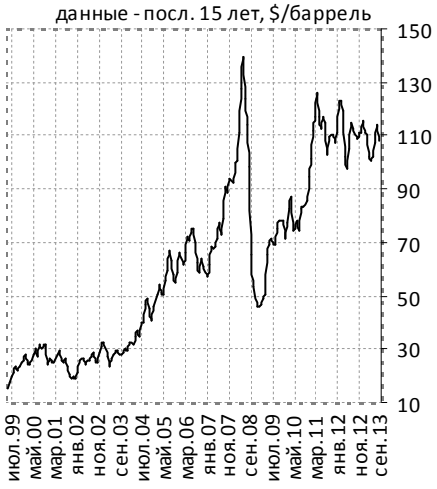
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



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

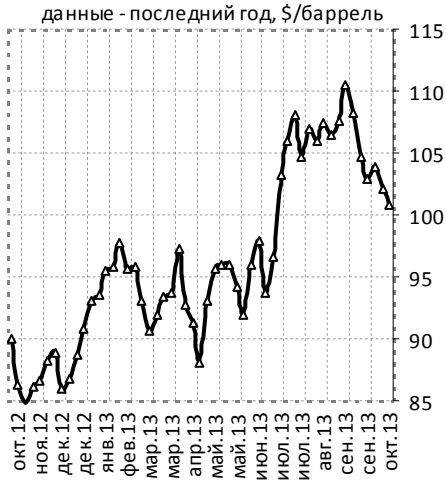


Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель

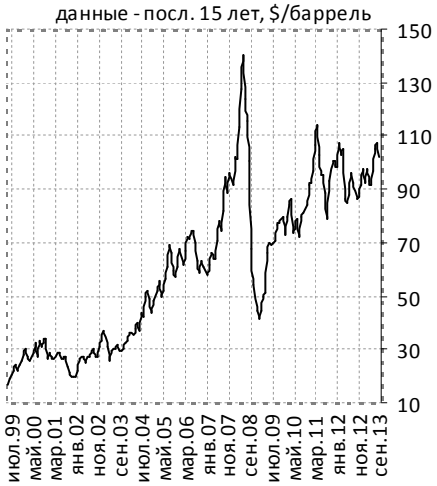


Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель

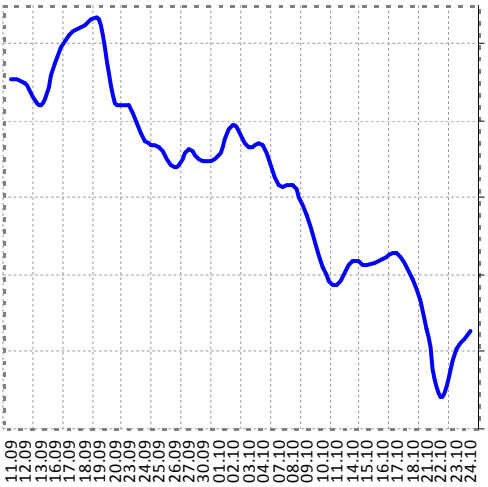
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



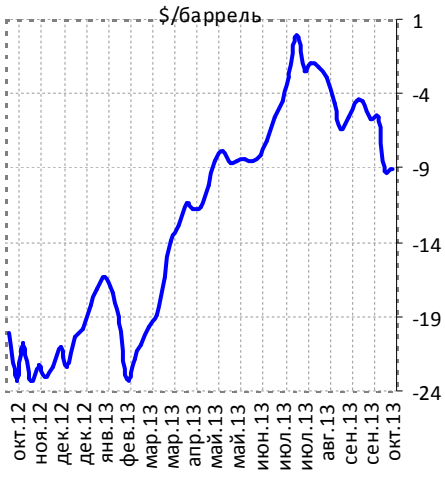
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



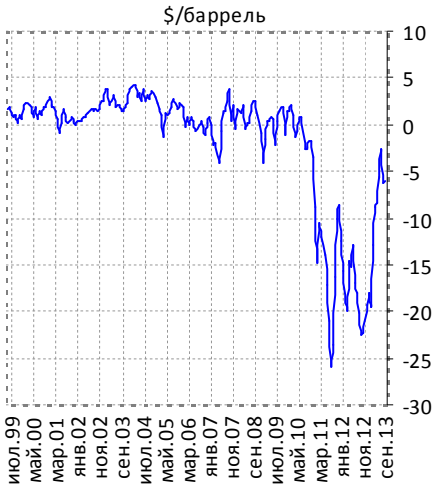
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



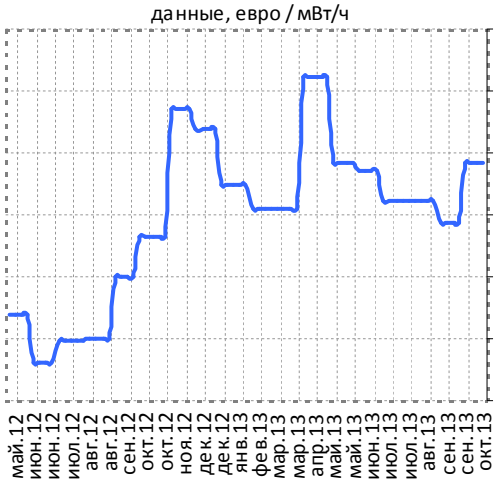
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



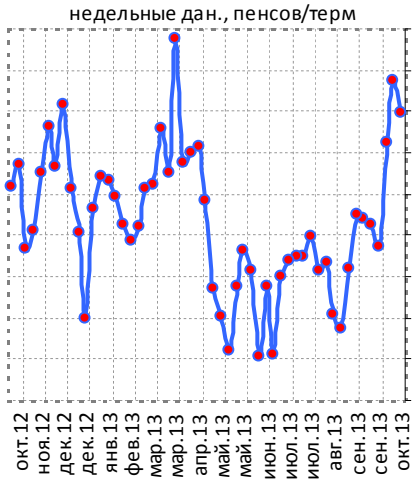
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

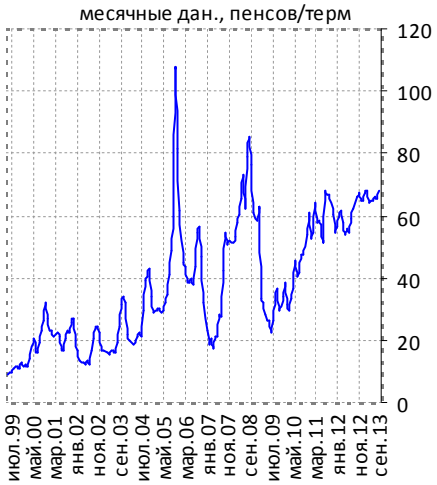
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



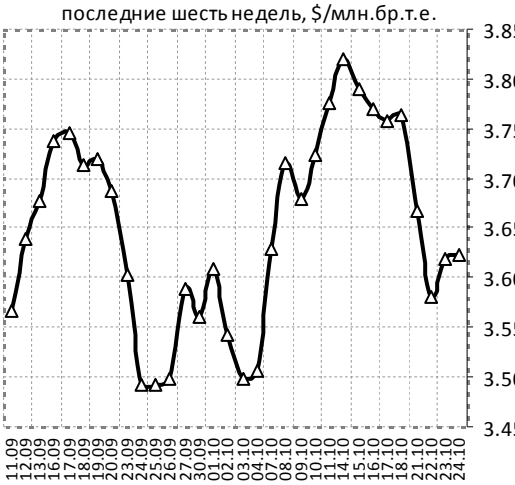
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



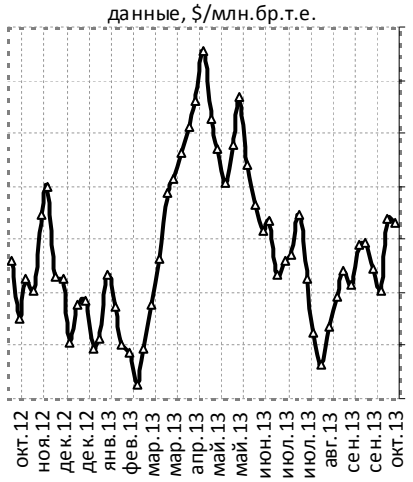
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



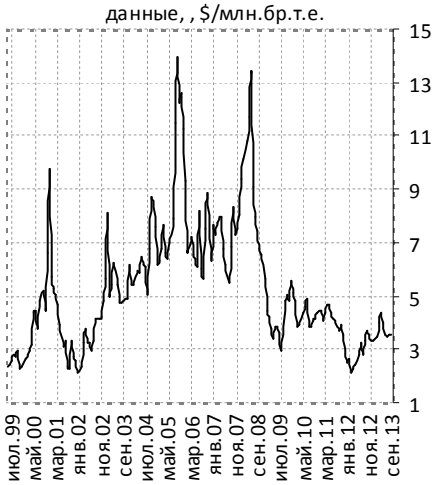
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



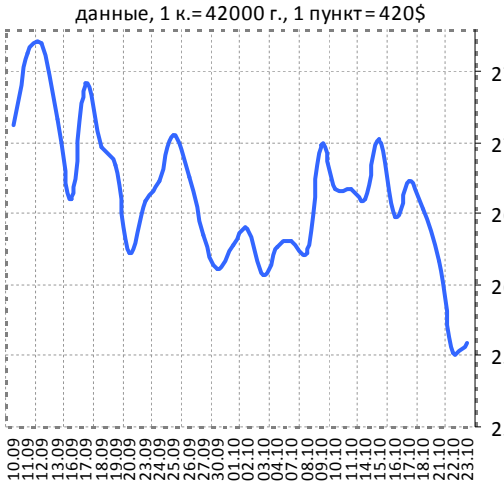
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



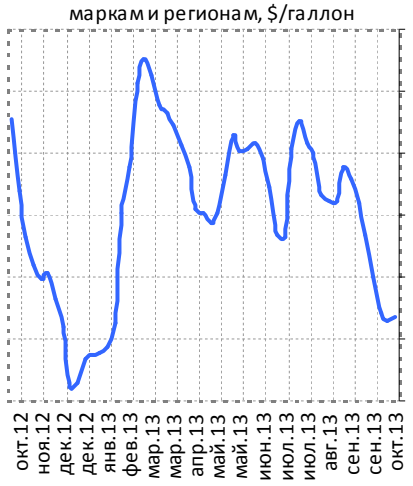
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



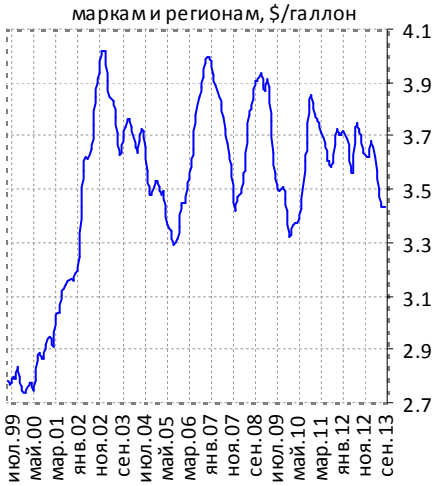
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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

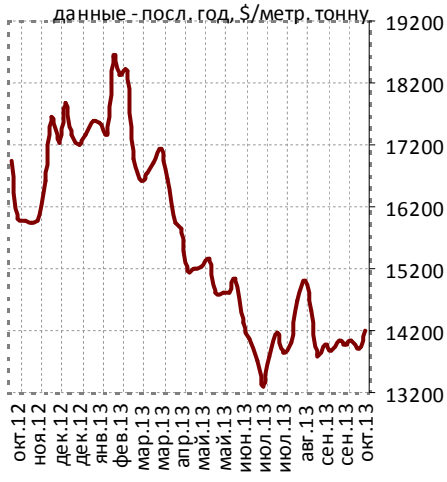


Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

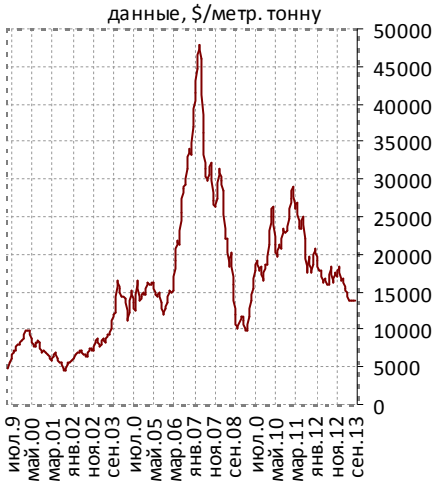
3.3. Рынок металлов

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

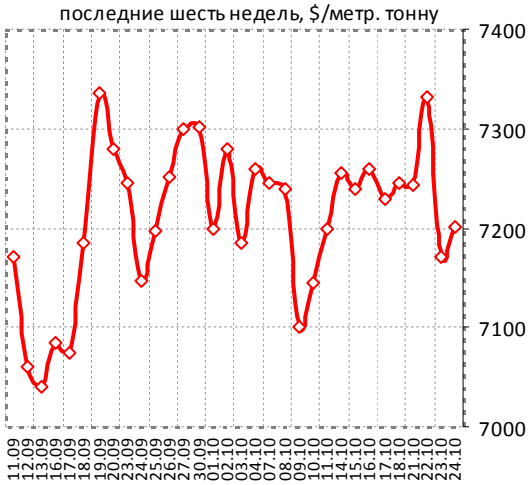
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



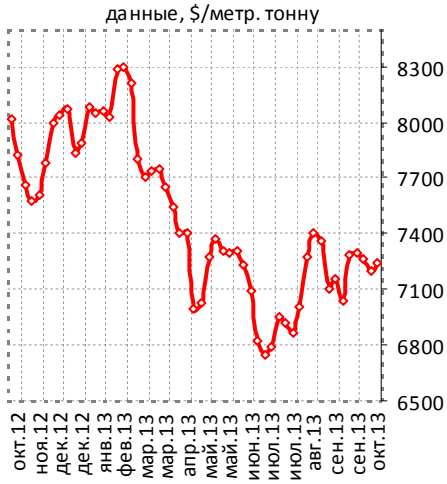
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



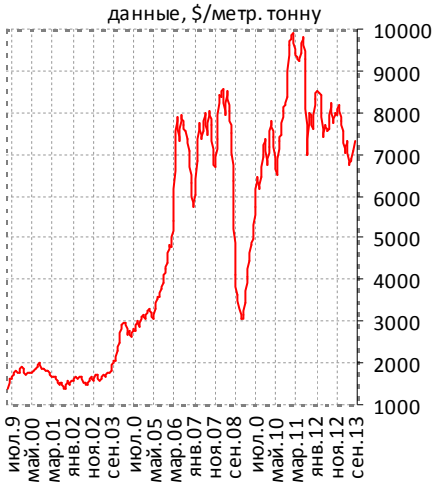
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



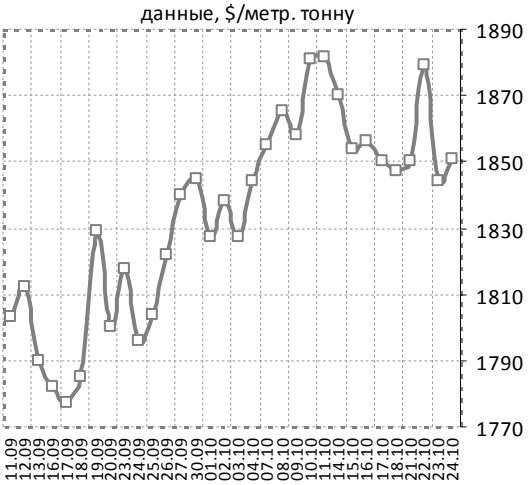
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



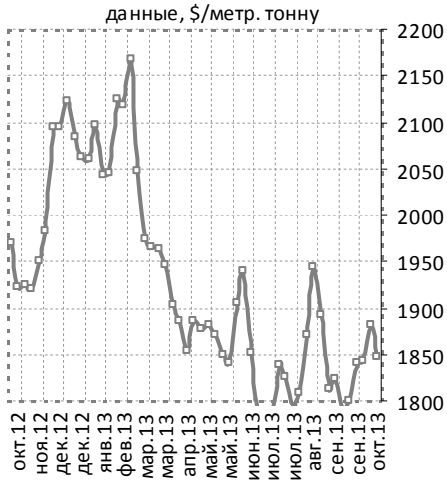
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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.