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
http://www.eufn.ru/
e-mail: info@eufn.ru

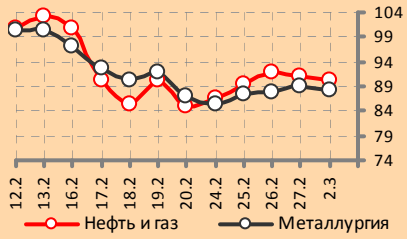
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

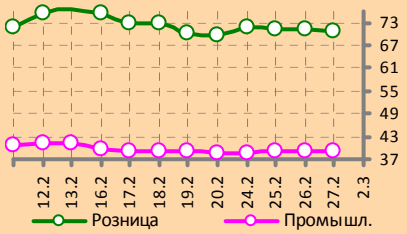
АНАЛИТИЧЕСКИЙ ОБЗОР

ЕЖЕДНЕВНЫЙ ОБЗОР: 03.03.2009

www.eufn.ru



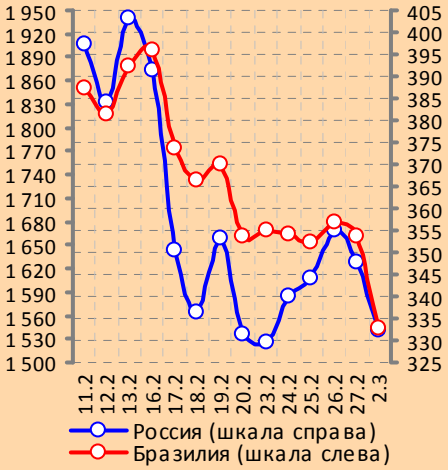


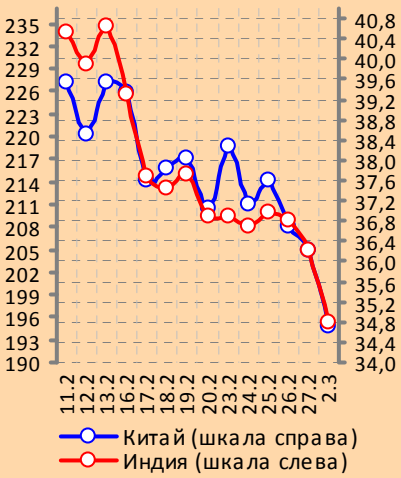




Отраслевые индексы РТС

Национальные дневные индексы Morgan Stanley Capital International





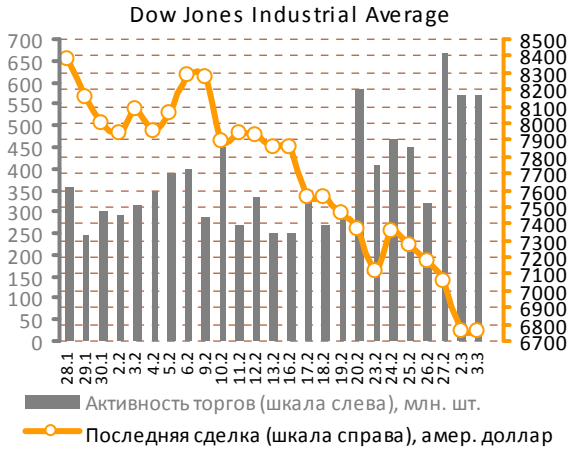
СОДЕРЖАНИЕ ОБЗОРА

Мировые рынки акций 2
Рынок металлов 5
Нефтяной рынок..... 7
Российский рынок акций 8
Статистика: сырьевые, долговые и валютные рынки 9

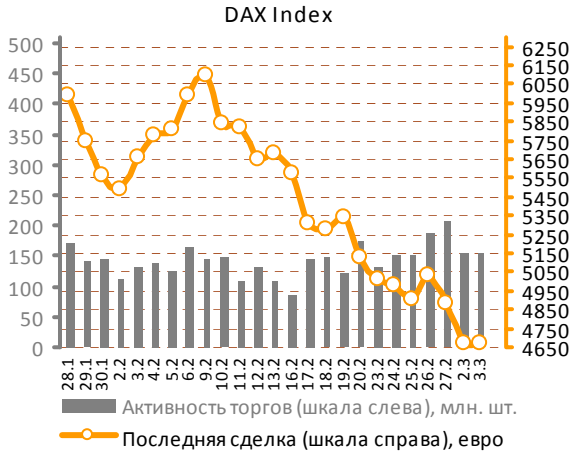
Версия 2009-03-03

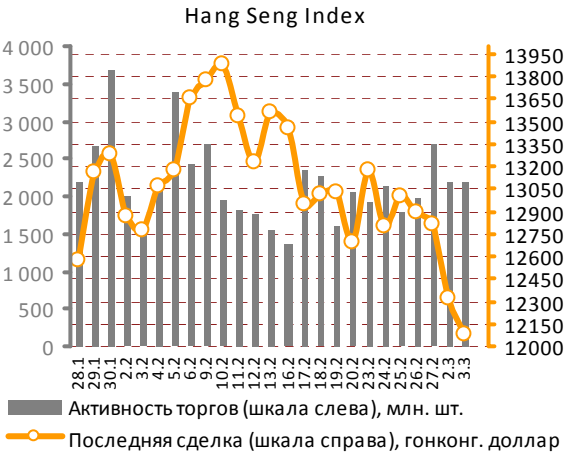
МОСКВА

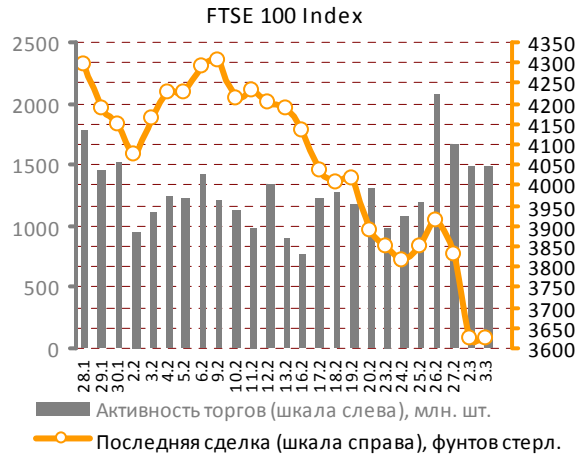
Мировые рынки акций

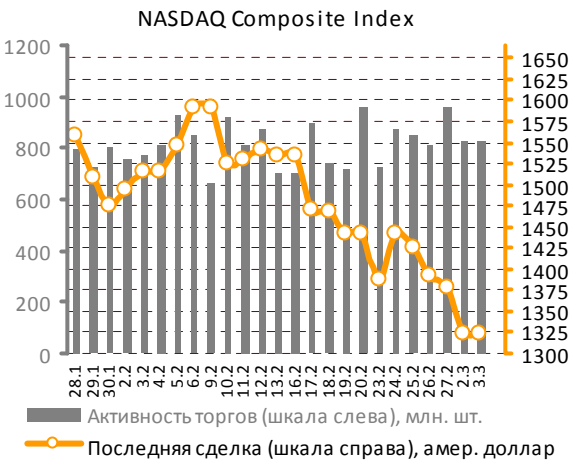










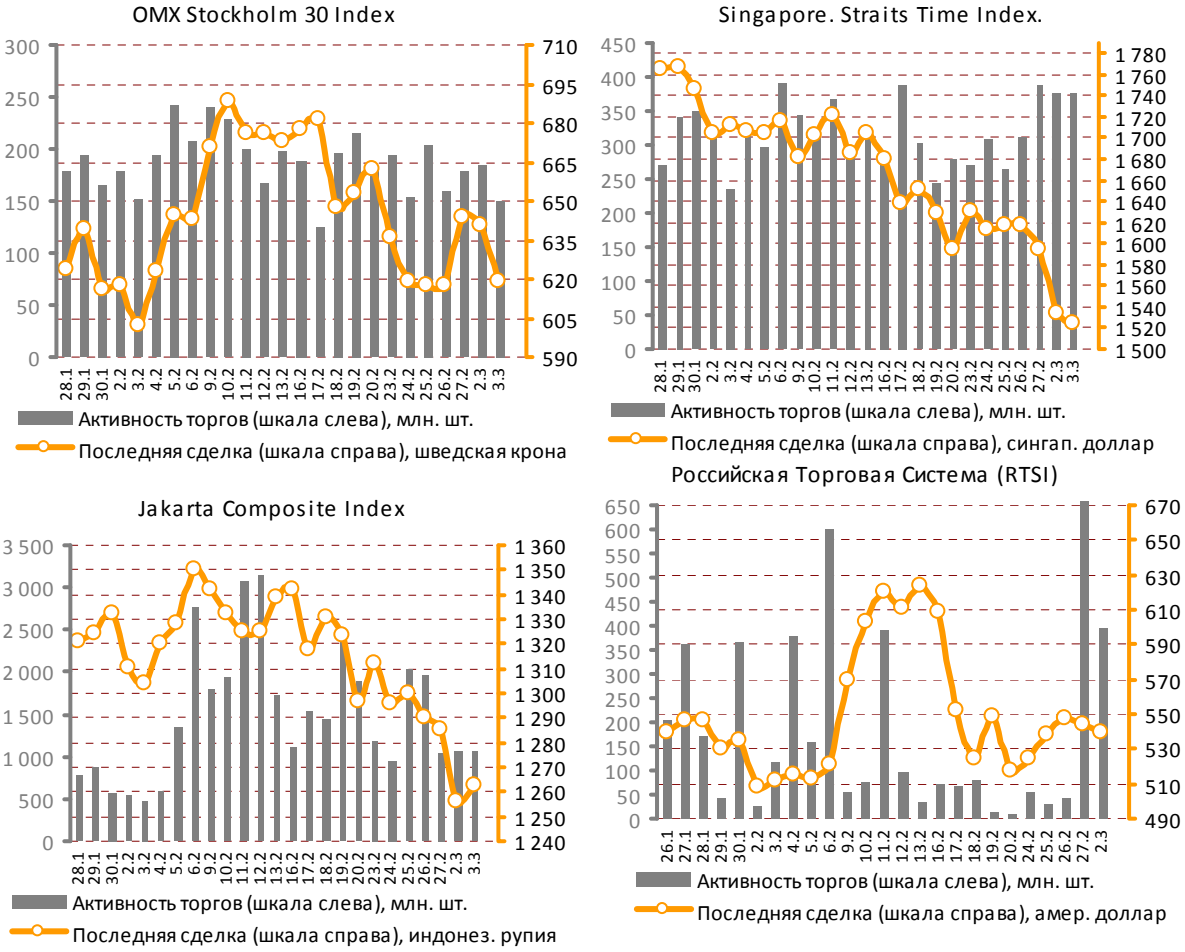


Источник данных: Bloomberg.

Понедельник завершился обвалом фондовых индексов по всему миру. Европейские площадки окончили торговую сессию падением 3,5%-5,5%, чему способство-

вали как неблагоприятные корпоративные известия европейских банков, так и негатив из-за океана.

Еще до начала торговой сессии в Америке на рынок поступила информация от крупнейшего страховщика AIG: компания объявила по итогам

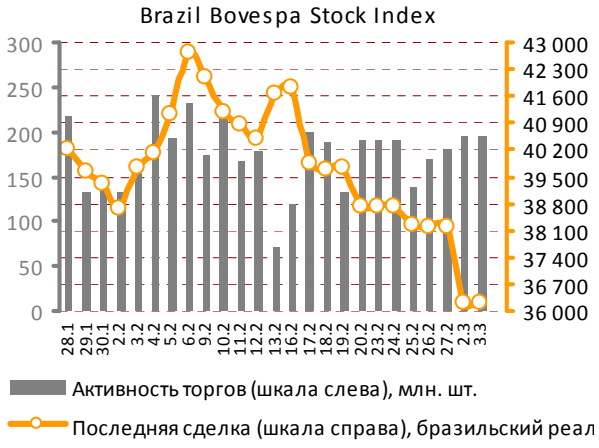


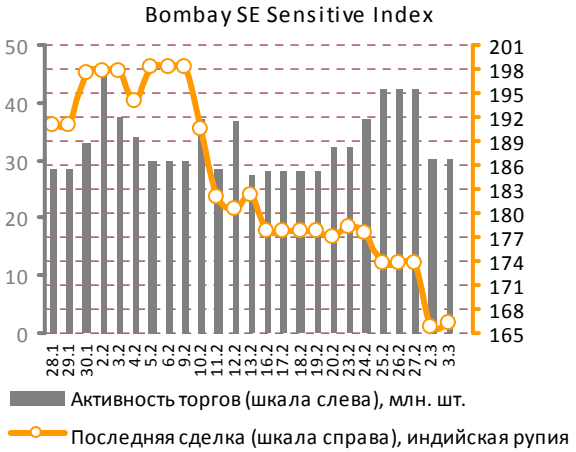
Источник данных: Bloomberg.

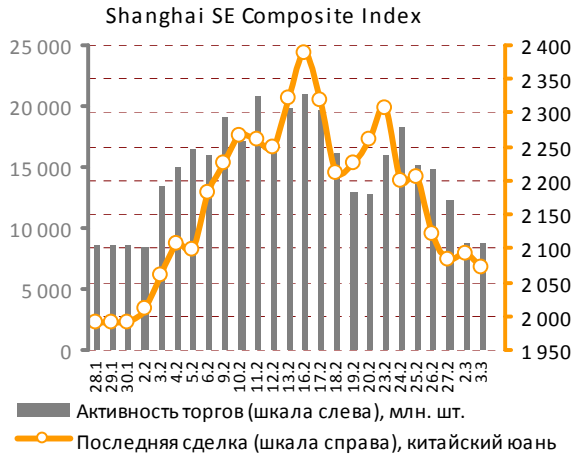
четвертого квартала 2008 года скорректированный убыток в размере 14,17 долл. на акцию, в то время как американские эксперты в среднем прогнозировали отрицательный финансовый результат в размере 0,37 долл. на акцию.

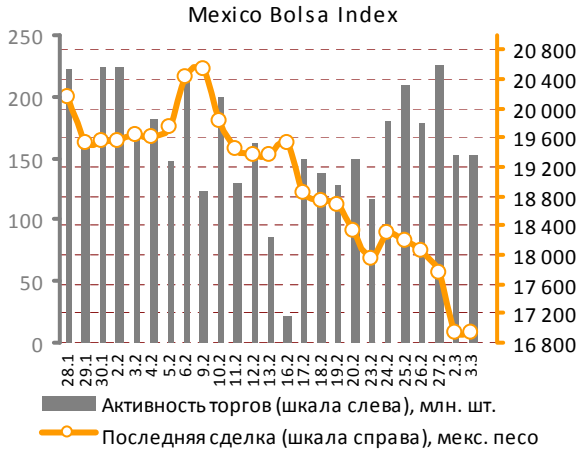
Негативный фон сформировали и заявления известного во всем мире инвестора У. Баффета. В прошедшем году принадлежащая миллиардеру инвестиционная компания Berkshire Hathaway получила прибыль в размере 4,99 млрд. долл. – это на 59% ниже показателя 2007 года и наихудший за всю историю существования компании результат. По словам Баффета, в течение текущего года и, вероятно, еще длительного периода экономика США будет пребывать «в разрухе».

Опубликованные вчера макроэкономические данные также не добавили позитива, оказавшись весьма противоречивыми. С одной стороны, в январе отмечается рост показателей личных доходов и расходов граждан, с другой – индекс-дефлятор цен продолжает увеличивать-









Источник данных: Bloomberg.

ся и в январе его прирост составил 0,7% к уровню аналогичного периода предыдущего года.

На фоне всех этих событий американский индекс Dow Jones Industrial Average рухнул вчера ниже отметки 7000 пунктов и составил 6763,29 пункта – снижение 4,24%. Standart&Poor's 500 потерял 4,66% и еле удержался чуть выше психологических 700 пунктов. Nasdaq Composite стал меньше на 3,99%, зафиксировав значение 1322,85 пункта.

Утром во вторник азиатские площадки продолжают находиться в отрицательной области.

Рынок металлов

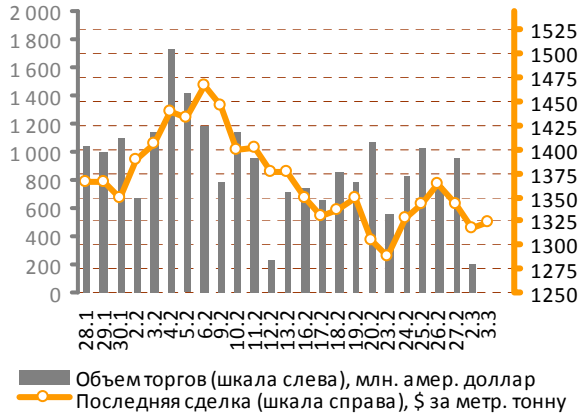
Фьючерсы на золото, COMEX, $ за тр. унцию



Фьючерсы на никель, LME, $ за метр. тонну



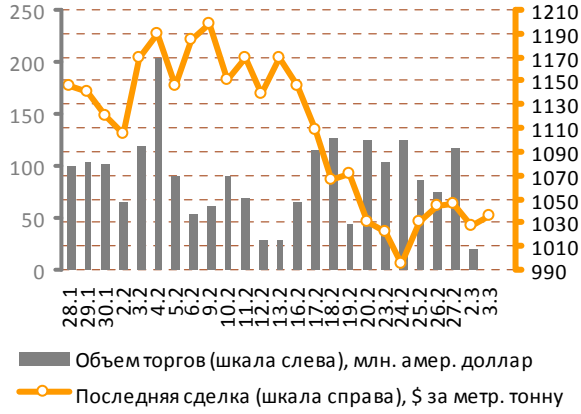
Фьючерсы на алюминий, LME, $ за метр. тонну



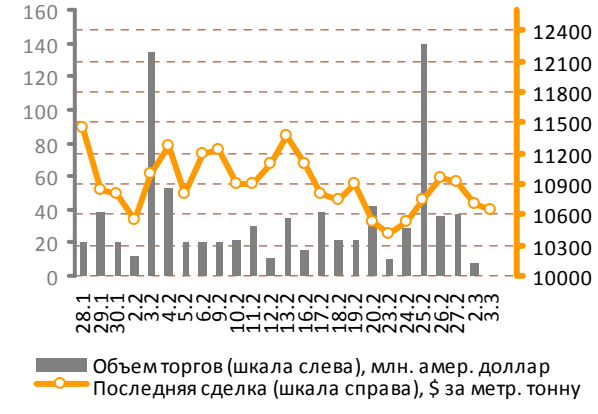
Фьючерсы на медь, LME, $ за метр. тонну



Фьючерсы на свинец, LME, $ за метр. тонну

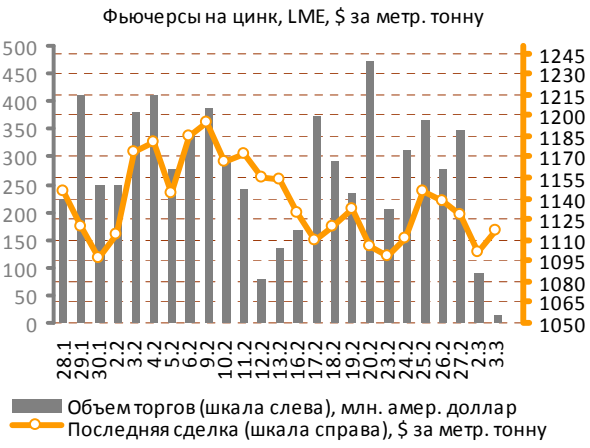


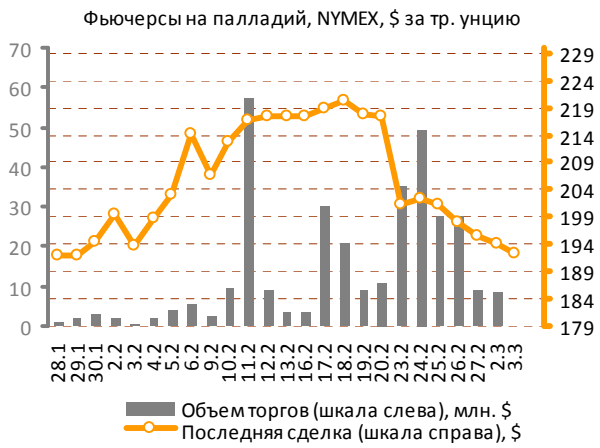
Фьючерсы на олово, LME, $ за метр. тонну



Источник данных: Bloomberg.

Вектор движения и промышленных металлов, и драгоценных продолжает быть направленным вниз. В понедельник на Лондонской бирже все металлы, без исключения, завершили торговый день снижением.





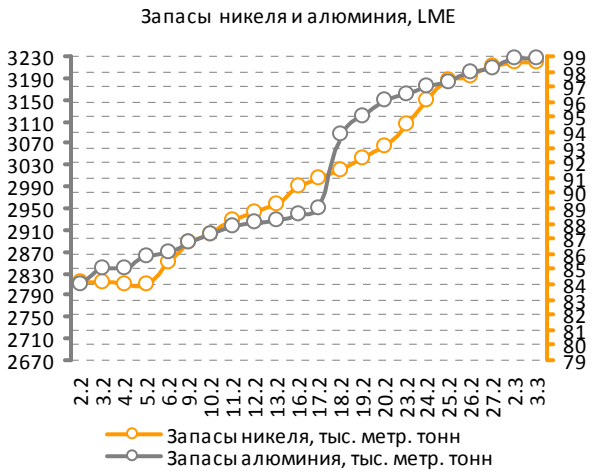
Источник данных: Bloomberg.

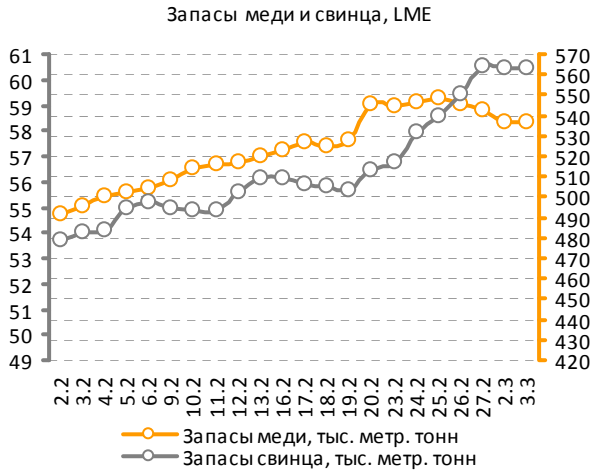
В группе драгоценных металлов падение цен незначительное.

В группе промышленных металлов сильнее прочих подешевел никель – его цена изменилась на 4,5% и остановилась на значении 9550 долл. за тонну. Алюминий подешевел на 1,8%. Запасы обоих металлов на бирже продолжают расти.

Цинк стал меньше стоить на 2,4% и зафиксировал отметку 1101 долл. за тонну. Цены на медь и свинец, несмотря на сокращение их запасов на складах LME, упали на 1,9% (3385$) и 1,7% (1028$), соответственно. Олово подешевело на 2,1% (10700 $).

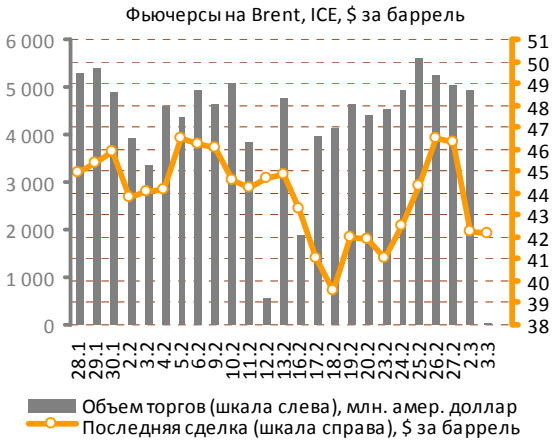
Во вторник наблюдается небольшая восходящая динамика цен на промышленные металлы.

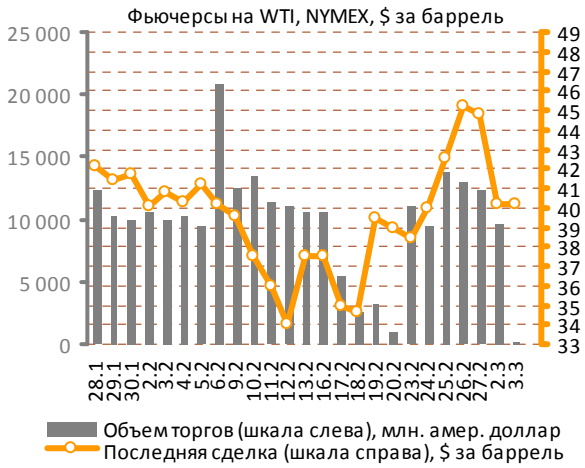




Источник данных: Bloomberg.

Нефтяной рынок



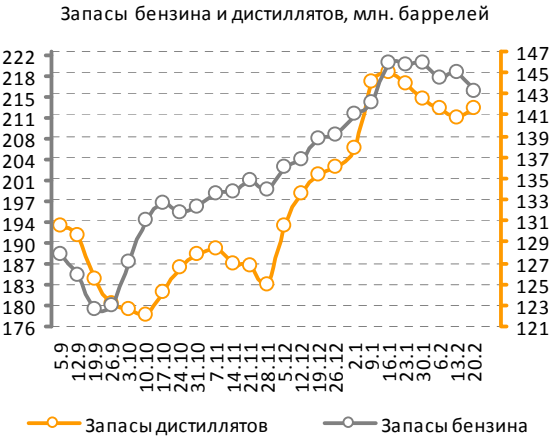


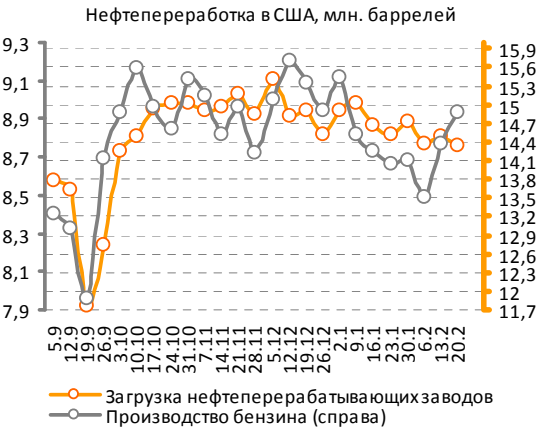
Источник данных: Bloomberg.

Следуя повсеместному негативному настрою, рынок нефти завершил торговую сессию понедельника со значительными потерями.

Апрельский контракт марки Brent подешевел на 8,93% и остановился на отметке 42,21 долл. за баррель, нефтефьючерс марки WTI рухнул в цене на 10,3%, но все же удержался выше психологического уровня в 40 долл., зафиксировав значение 40,15 долл. за баррель.

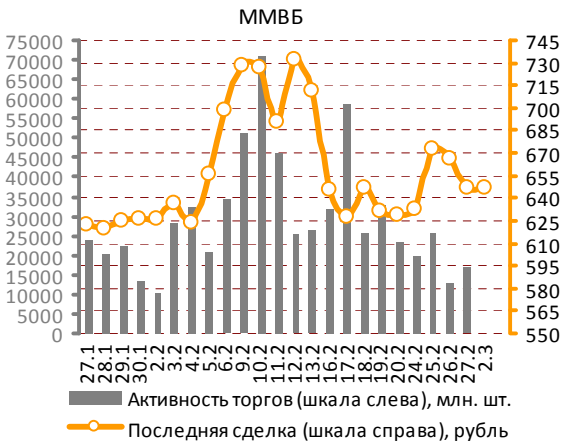
Утром во вторник цены на углеводороды несколько стабилизировались. Накануне министр нефти Алжира сделал заявление о вероятном принятии решения о сокращении объемов нефтедобычи странами ОПЕК на следующем заседании, которое состоится уже 15 марта. Кроме того, по его словам члены картеля к концу февраля все-таки снизили объемы поставок в соответствии с установленными ранее квотами. Ш. Хелил ожидает, что к концу года стоимость нефти достигнет 60 долл. за баррель.

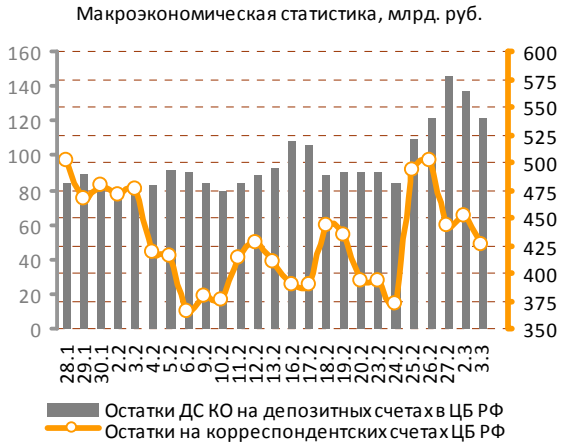




Источник данных: Bloomberg.

Российский рынок акций





Источник данных: Bloomberg.

Российский рынок акций

Российские индексы на торгах в понедельник обвалились вслед за мировыми фондовыми площадками. Под давлением оказались и акции нефтяных компаний, и банков, и металлургического сектора.

Сегодня внешний фон продолжает оставаться напряженным, вместе с тем в течение дня, вероятно, мы будем иметь возможность наблюдать небольшую техническую коррекцию. В плане выхода важных статистических данных предстоящая сессия не насыщена. Информационный фон будет формироваться, в основном, одним событием: в 18:00 Глава Федеральной резервной системы Б.Бернанке выступит с экономическим прогнозом и обзором бюджета в бюджетном комитете Сената США.

ММВБ	Цена, руб.	Изм., %	Объем, млрд. р.	ММВБ	Цена, руб.	Изм., %	Объем, млн. р.	РТС	Цена, $	Изм., %	Объем, тыс. $
Газпром	112,0	0,18%	1,24	Полюс золото	1193,0	-2,63%	136,95	CHZN	0,95	0,00%	0,0
Лукойл	1115,7	0,95%	0,55	Газпромнефть	74,6	-1,02%	42,88	CHEP	0,500	0,00%	0,0
Роснефть	122,0	0,78%	0,26	ОГК-5	0,3	0,30%	0,07	DVEC	#N/A N/A	0,00%	0,0
Сургутнефтегаз	20,0	1,57%	0,20	ТГК-3	0,9	-0,12%	0,14	GRAZ	0,750	-6,25%	22,3
Татнефть	64,2	1,01%	0,02	Иркутскэнерго	6,2	-0,76%	0,36	FESH	0,200	0,00%	0,0
ГМК НорНикель	1628,5	0,94%	0,35	Аэрофлот	26,2	0,42%	0,41	KZRU	0,050	0,00%	0,0
Сбербанк	14,4	0,77%	0,98	ММК	7,1	2,16%	3,22	RASP	0,910	-4,21%	27,6
ВТБ	0,0193	-0,52%	0,06	СеверСталь	128,4	2,01%	22,14	SILM	0,048	0,00%	0,0
Ростелеком	288,9	-0,09%	0,01	НЛМК	36,5	0,22%	4,64	VSMO	18,00	0,00%	0,0

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

Прочая статистика

Сырьевые рынки

NYMEX	Цена, $	Изм., %	Макс.*	Мин.*
Платина / тр. унц.	1075,9	-0,87%	1098,90	791,90
Уран / фунт	45,0	0,00%	55,00	44,00
Газ/ млн. брит. тепл. ед.	4,2	-1,10%	13,58	4,01
Бензин / галлон	1,3	0,78%	3,57	0,79
Rubber Research Institute				
Натуральный каучук (RSS1) / кг	1,5	0,00%	3,36	1,16
Metal Bulletin Steel Prices**				
Сталь ГК, экспорт ФОБ / тонна	475,0	0,00%	1137,50	475,00
Сталь ХК, экспорт ФОБ / тонна	580,0	0,00%	1275,00	580,00

Сельское хозяйство Reuters/Jefferies CRB Movers	Цена, $	Изм., %	Макс.*	Мин.*
Пшеница / бушель	5,0625	0,00%	10,8750	4,5625
Кофе / фунт	1,1100	0,00%	1,6600	1,0200
Кукуруза / бушель	3,6250	0,00%	7,8750	2,9375
Соя / бушель	8,7500	0,00%	16,3125	8,5625
Какао / тонна	2582,0	0,00%	3252,0	1912,0
Хлопок / фунт	0,4200	0,00%	0,9600	0,3900
Сахар / фунт	0,1300	0,00%	0,1600	0,1100
Manitoba Agriculture and Food Spot Price / Canada**				
Рожь / тонна	102,6500	0,81%	#Н/Д	#Н/Д
Овес / тонна	104,9800	-11,15%	238,4500	104,5500
Рапс / тонна	326,5600	2,49%	649,9400	264,9700

* Максимальная и минимальная цены представлены за период 52 недели.

** Цены на рожь, овес и рапс изменяются раз в неделю по пятницам, на сталь—раз в неделю по четвергам.

Долговые рынки

U.S. Treasuries Notes/Bonds	Дата погашения	Цена	Купон, %	Доход-ность, %	Изм., %
2-Year	30.11.10	100,02	1,25	0,871	-10,57%
5-Year	30.11.13	100,28	2,00	1,817	-8,51%
10-Year	15.11.18	99,02	3,75	2,864	-
30-Year	15.05.38	97,97	4,50	3,611	-2,64%

Валютные рынки

	с утра	вчера
Доллар / Рубль	36,1199	36,1719
Евро / Рубль	45,5782	45,5782
Евро / Доллар	1,2656	1,2578
Евро / Японская йена	123,5000	122,7000

	с утра	вчера
Евро / Швейцарский франк	1,4816	1,4796
Доллар / Швейцарский франк	1,1706	1,1764
Доллар / Гонконгский доллар	7,7582	7,7580
Фунт стерлингов / Доллар	1,4126	1,4052

Мировые индексы

Индексы Morgan Stanley Capital International	Индекс	Изм., %
MSCI World	713,85	-4,93%
MSCI EM	475,08	-4,85%
MSCI Eastern Europe	88,44	-3,84%
MSCI BRIC	153,85	-5,24%
MSCI Russia	332,39	-4,43%

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

Аналитический отдел

Берсенев Евгений Павлович,
начальник аналитического отдела
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 158), e-mail: ebersenev@eufn.ru

Митрофанова Светлана Александровна,
ведущий аналитик
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 156), e-mail: mitrofanova@eufn.ru

Белкина Анастасия Александровна,
аналитик (специализация: фундаментальный анализ)
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 131), e-mail: belkina@eufn.ru

Контакты

Открытое Акционерное Общество «ИК «Еврофинансы»

Аналитический отдел: (495) 545-35-35, доб. 158, 156, 131

Отдел активных операций: (495) 545-35-35, доб. 120, 103, 113

Клиентский отдел: (495) 545-35-35, доб. 168

117049 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

Фотографии на титульной странице отчета: официальный сайт World News.

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.