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

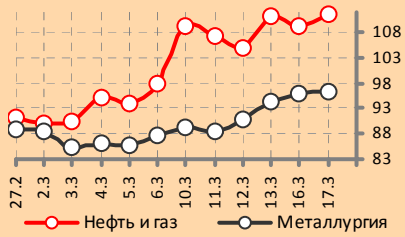
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

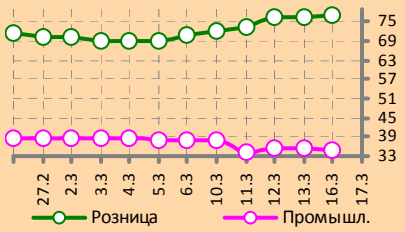
АНАЛИТИЧЕСКИЙ ОБЗОР

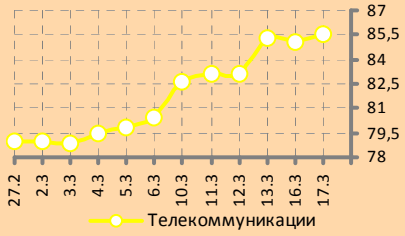
ЕЖЕДНЕВНЫЙ ОБЗОР: 18.03.2009

www.eufn.ru



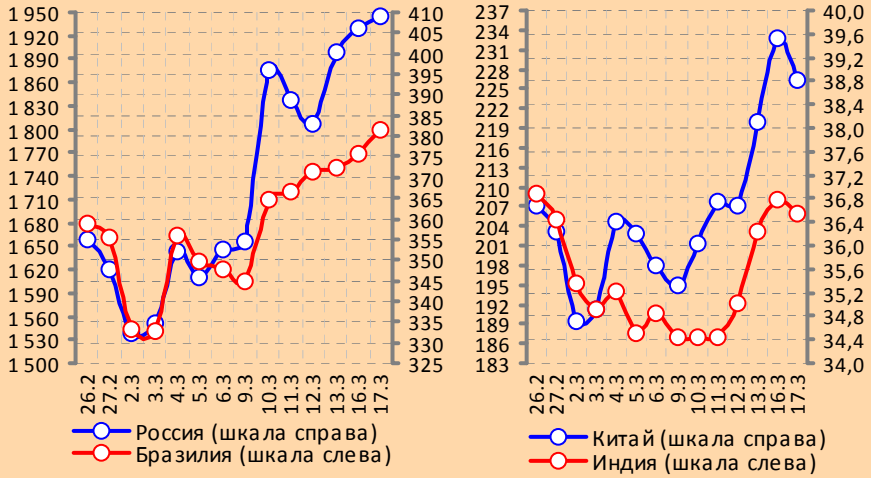






Отраслевые индексы РТС

Национальные дневные индексы Morgan Stanley Capital International



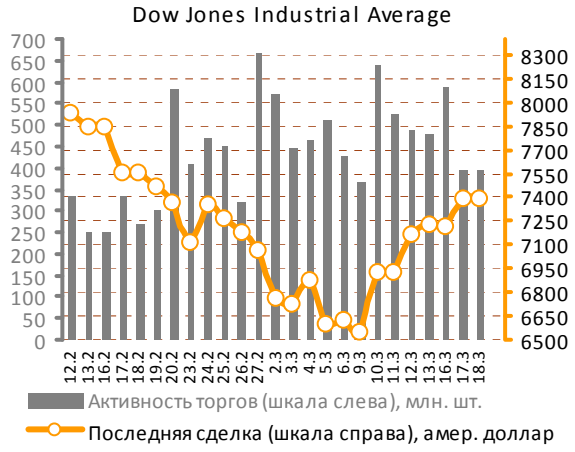
СОДЕРЖАНИЕ ОБЗОРА

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

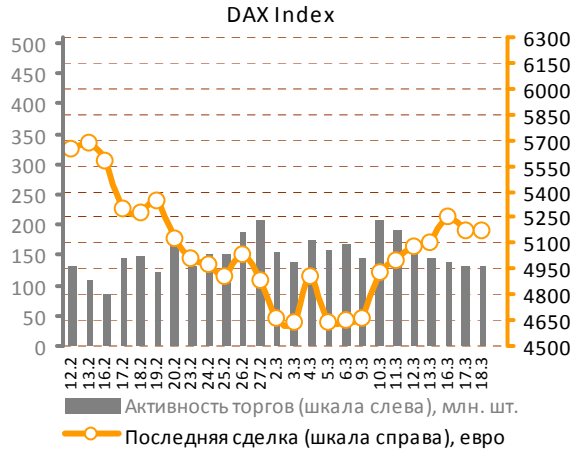
Версия 2009-03-18

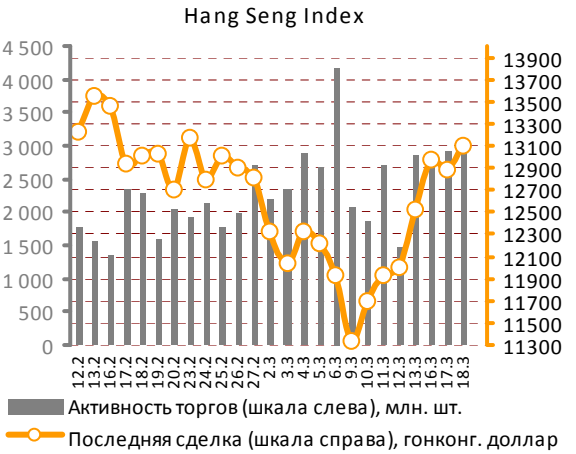
МОСКВА

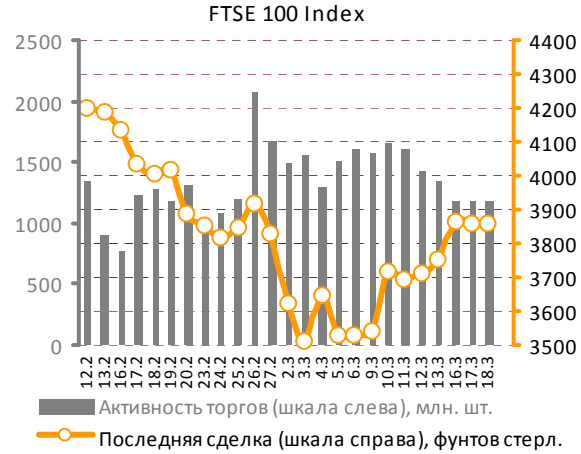
Мировые рынки акций

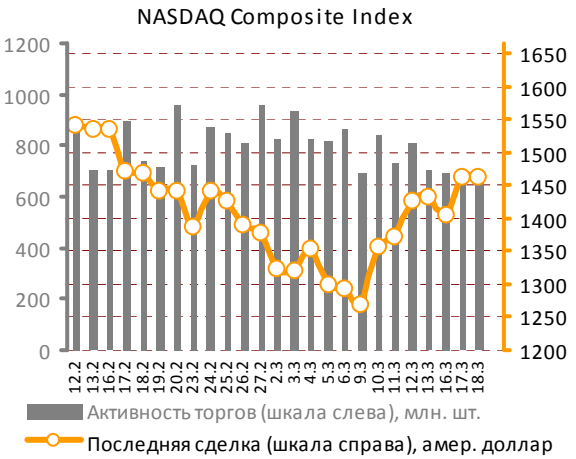








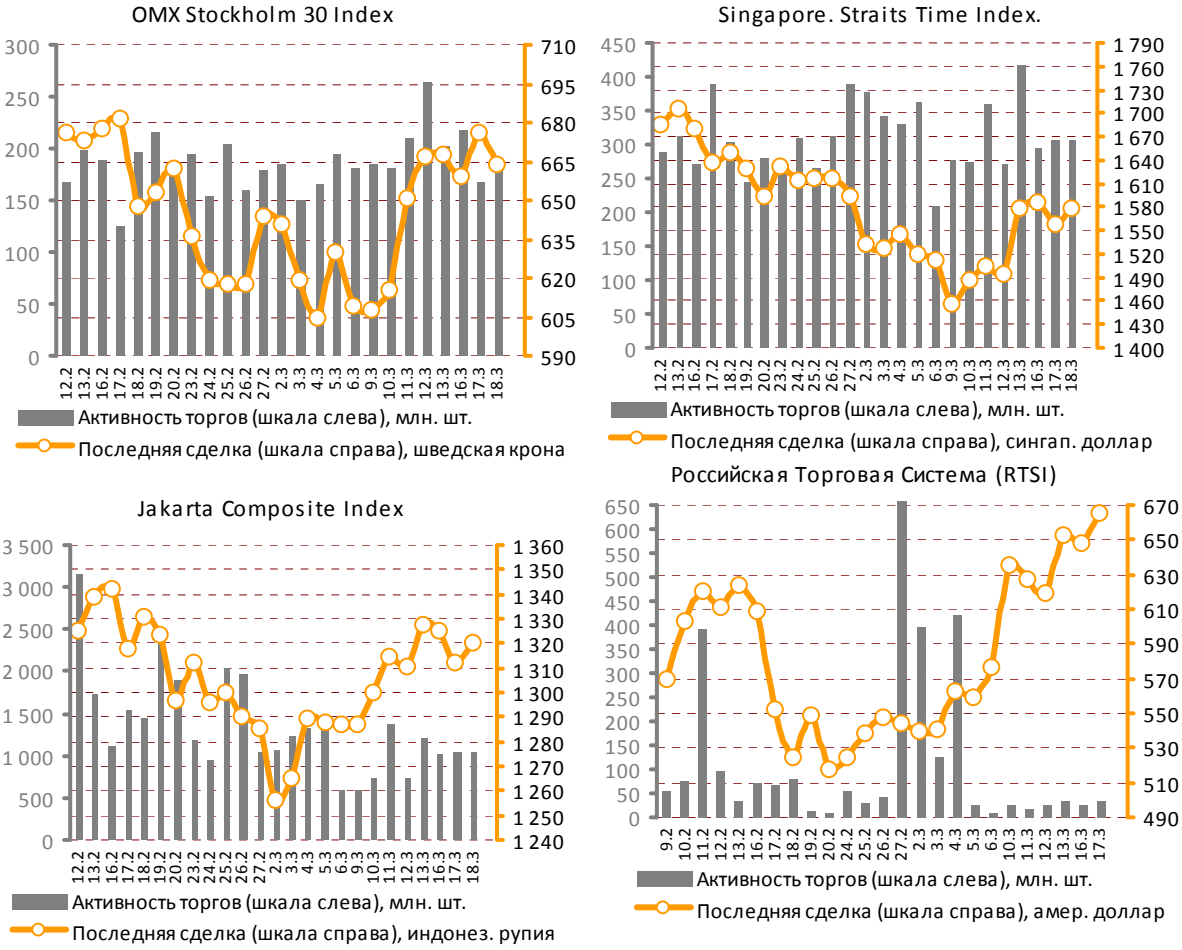




Источник данных: Bloomberg.

Американские фондовые индексы продолжают набирать высоту, следуя восходящему краткосрочному тренду. Во вторник поддержку рынку акций оказали опубликованные показатели по строительному рынку: количество новостроек в США выросло на 22,2% и дос-

тигло в феврале 583 тыс. домов в годовом выражении, а число выданных разрешений на строительство домов составило в феврале 547 тыс., что на 3% выше уровня предыдущего месяца.

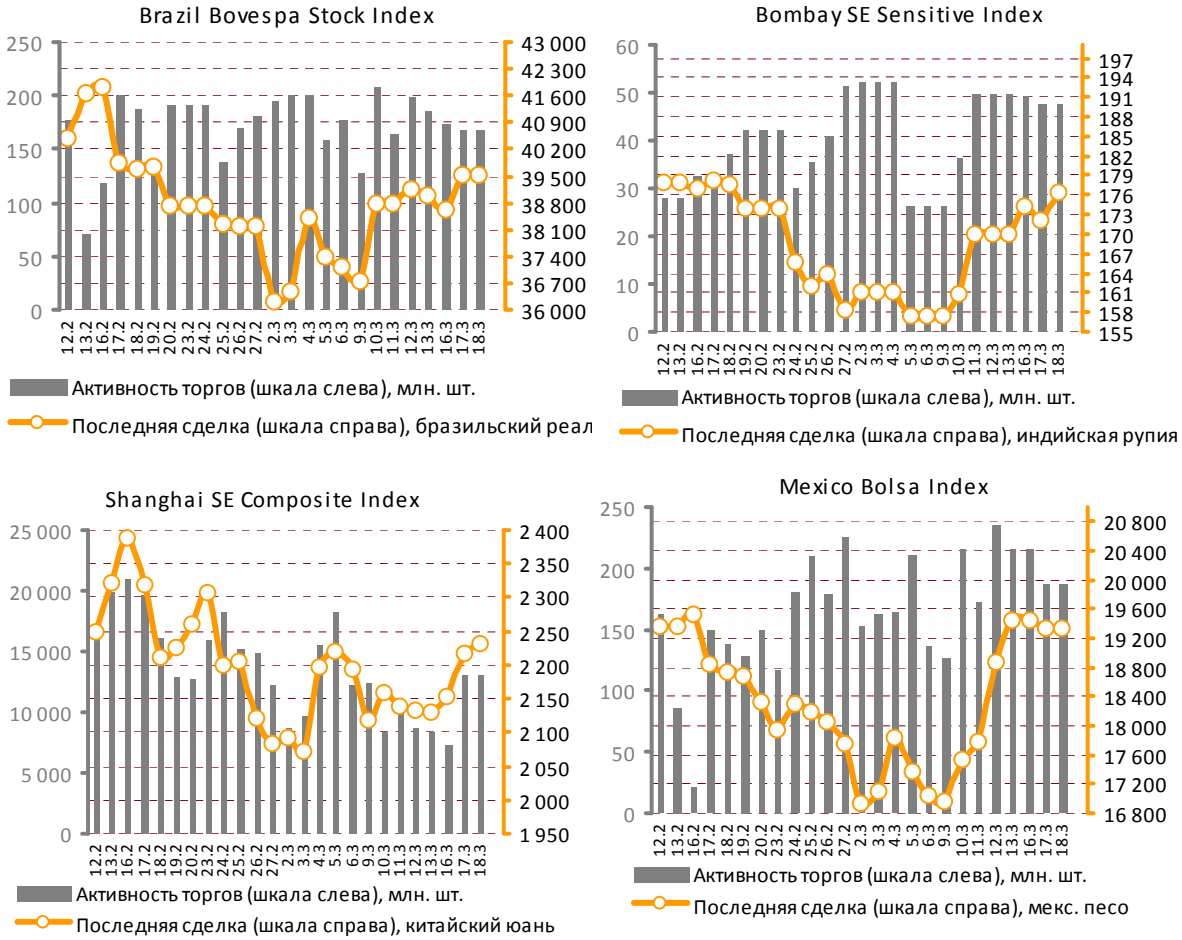


Источник данных: Bloomberg.

На фоне вышедших макроэкономических данных взлетели в цене, прежде всего, бумаги строительных компаний. Основные индикаторы американского фондового рынка завершили прошедшую торговую сессию в положительной области.

Индекс Dow Jones Industrial Average увеличился на 2,48%, достигнув 7395,7 пункта, Standart&Poor's 500 прибавил 3,21%, зафиксировав отметку 778,12 пункта, Nasdaq Composite стал больше на 4,14% и остановился на значении 1462,11 пункта.

Сегодня Комитет по открытым рынкам (FOMC) ФРС США завершит заседание, на котором в числе прочих будет рассмотрен вопрос изменения уровня базовой процентной ставки – ожи-



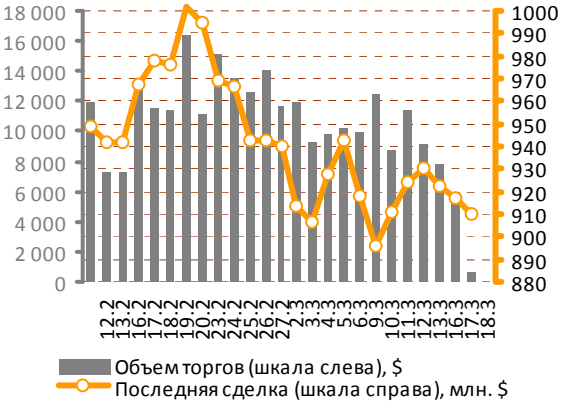
Источник данных: Bloomberg.

дается, что ставка останется без изменений, а в качестве мер стимулирования экономики будет принято решение об увеличении объемов покупки ипотечных ценных бумаг.

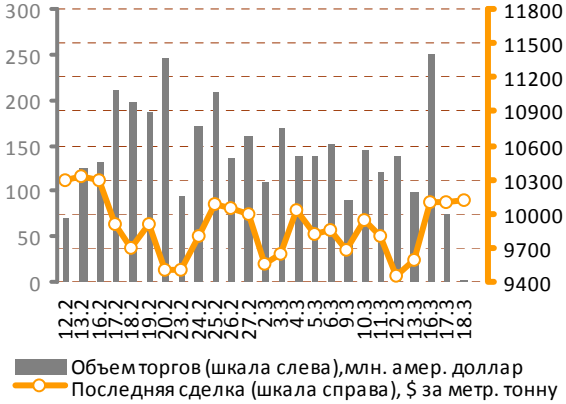
Благоприятные известия продолжают поступать со стороны азиатских рынков. Так, в опубликованном в среду квартальном докладе Всемирного банка отмечается, что экономика Китая, вследствие предпринимаемых государством мер, легче переносит кризис и уже демонстрирует «первые признаки» стабилизации. Эксперты Всемирного банка по итогам 2009 года прогнозируют рост ВВП КНР на 6,5%. Утром в среду площадки Азиатско-Тихоокеанского региона торгуются, преимущественно, в зеленом цвете.

Рынок металлов

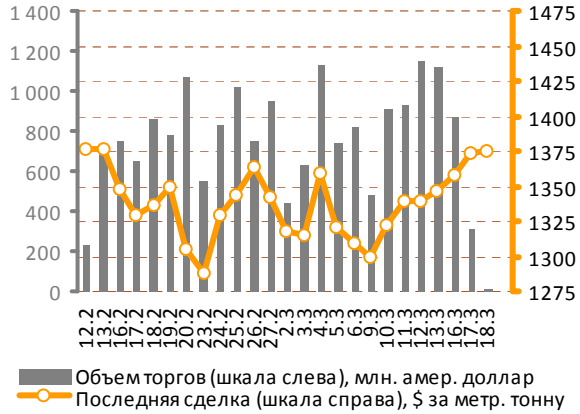
Фьючерсы на золото, COMEX, $ за тр. унцию



Фьючерсы на никель, LME, $ за метр. тонну



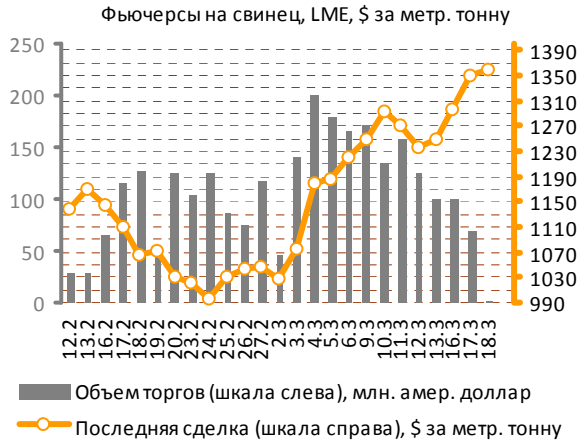
Фьючерсы на алюминий, LME, $ за метр. тонну



Фьючерсы на медь, LME, $ за метр. тонну



Фьючерсы на свинец, LME, $ за метр. тонну

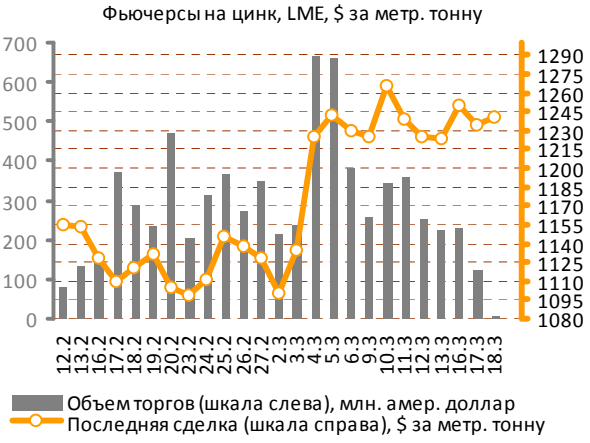


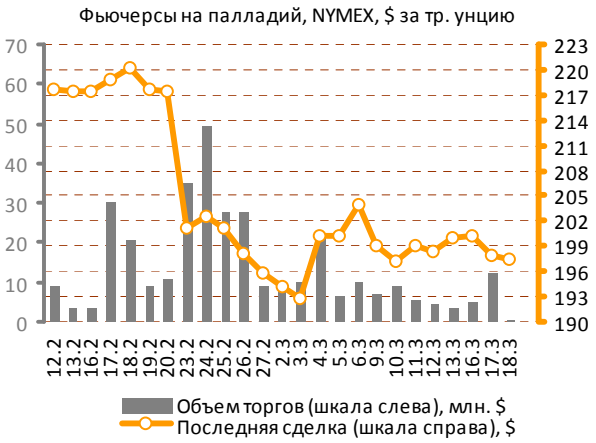
Фьючерсы на олово, LME, $ за метр. тонну



Источник данных: Bloomberg.

Во вторник торги на LME характеризовались разнонаправленными изменениями цен на металлы. Спросом пользовались свинец и алюминий. Первый закрылся в плюсе на 4,1%, продолжив развитие позитивных тенденций марта. С начала месяца свинец подорожал уже



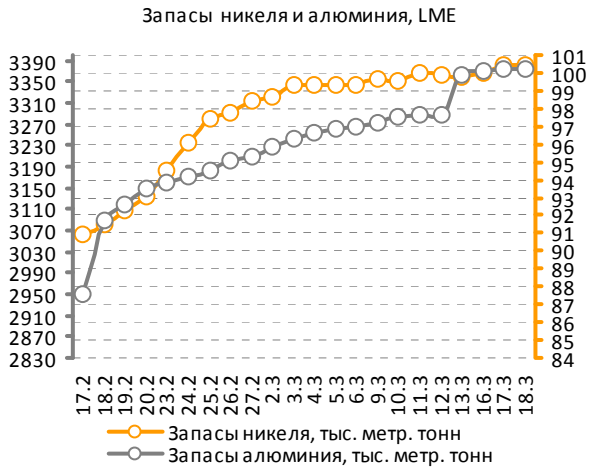


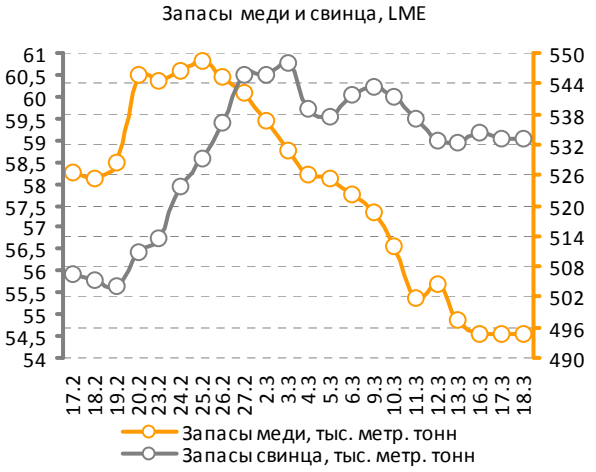
Источник данных: Bloomberg.

на 30% на фоне оживления спроса на него, о чем свидетельствуют снижающиеся складские запасы металла.

Стоимость алюминия выросла на 1,1%, завершив в зеленом цвете шестую торговую сессию подряд. Цена никеля, больше месяца торгующегося в боковом коридоре, поднялась на 0,05%.

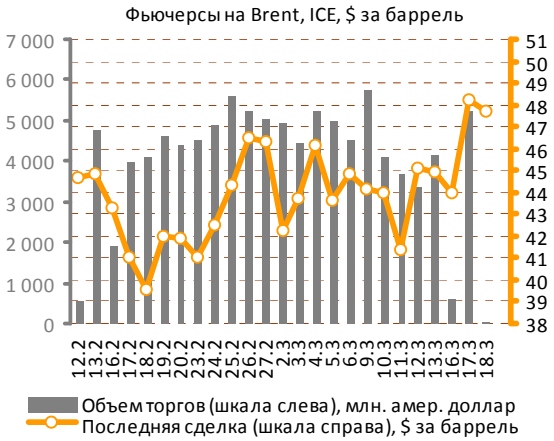
Хуже рынка во вторник стали медь, цинк и олово, убавившие в цене 0,8%, 1,2 и 1,4% соответственно.

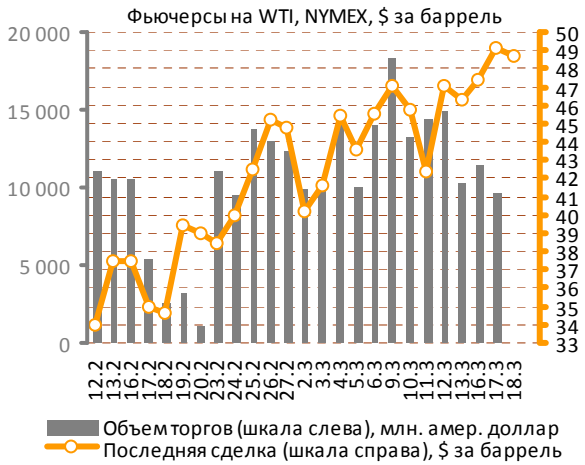




Источник данных: Bloomberg.

Нефтяной рынок



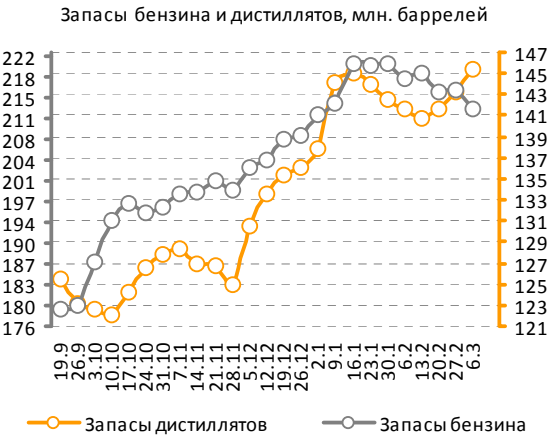


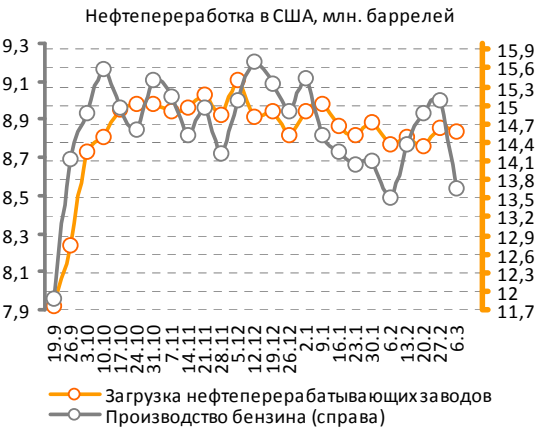
Источник данных: Bloomberg.

По итогам торговой сессии вторника углеводороды резко подскочили в цене. Поводом для чего, вероятно, стали известия из Японии: нефтеперерабатывающие заводы страны озвучили накануне планы по закрытию в этом году на регулярный профилактический ремонт НПЗ объемом мощностей в 1,2 млн. баррелей в сутки, что на 14% больше уровня 2008 года.

Майские контракты марки Brent подорожали вчера на 9,7% - до 48,24 долл. за баррель, апрельский нефтефьючерс WTI вырос на 3,8%, зафиксировав отметку 49,16 долл. за баррель.

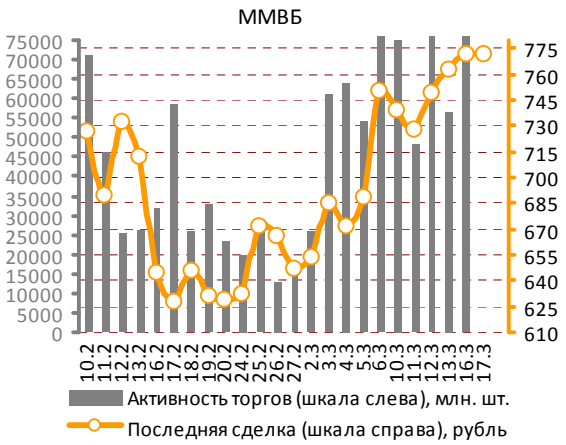
Традиционно в среду американское министерство энергетики опубликует данные о состоянии топливного рынка в стране за прошедшую неделю. Участники рынка ожидают, что с 7 по 13 марта коммерческие запасы дистиллятов увеличились на 1 млн. баррелей, в то время как товарные запасы бензина сократились на 1,5 млн. баррелей. В среду утром «черное золото» демонстрирует нисходящую динамику.

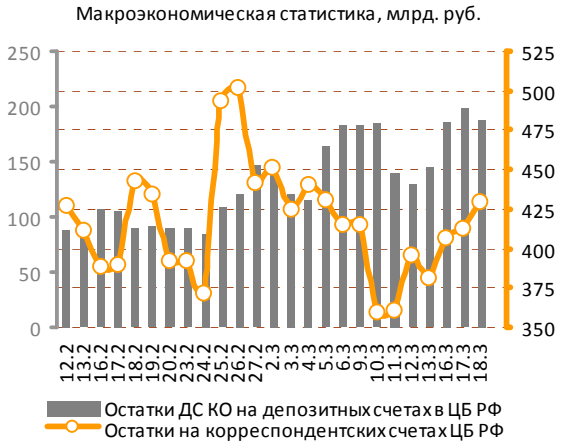




Источник данных: Bloomberg.

Российский рынок акций





Источник данных: Bloomberg.

Сегодня на фоне роста стоимости углеводородов и большинства зарубежных площадок ожидаем продолжения подъема котировок по широкому спектру бумаг российских компаний.

Предстоящая торговая сессия информационно не насыщена. В 12:30 британское правительство обнародует данные по безработице в стране за февраль. В 15:30 Министерство труда США опубликует февральские показатели динамики потребительских цен. Министерство торговли США опубликует баланс счета текущих операций за четвертый квартал также в 15:30. Федеральный комитет по открытым рынкам (FOMC) Федеральной резервной системы США завершит двухдневное заседание, по итогам которого объявит уровень базовой процентной ставки в 21:15.

ММВБ	Цена, руб.	Изм., %	Объем, млрд. р.	ММВБ	Цена, руб.	Изм., %	Объем, млн. р.	РТС	Цена, $	Изм., %	Объем, тыс. $
Газпром	127,0	0,80%	1,62	Полюс золото	1192,0	-0,16%	48,94	CHZN	0,90	0,00%	0,0
Лукойл	1315,9	0,90%	0,96	Газпромнефть	84,2	0,92%	24,09	CHEP	0,500	0,00%	0,0
Роснефть	160,3	0,72%	0,34	ОГК-5	0,4	0,27%	0,12	DVEC	#N/A Com	#ЗНАЧ!	#ЗНАЧ!
Сургутнефтегаз	24,8	0,40%	0,14	ТГК-3	0,9	0,79%	1,21	GRAZ	0,750	0,00%	0,0
Татнефть	84,6	0,95%	0,04	Иркутскэнерго	5,8	0,09%	0,54	FESH	0,200	0,00%	0,0
ГМК НорНикель	1991,0	-0,12%	0,47	Аэрофлот	31,2	-0,26%	0,49	KZRU	0,065	0,00%	0,0
Сбербанк	22,0	8,28%	5,94	ММК	8,4	0,04%	2,38	RASP	0,880	4,14%	30,9
ВТБ	0,0279	2,20%	0,58	СеверСталь	134,1	0,01%	16,91	SILM	0,048	0,00%	0,0
Ростелеком	299,0	0,48%	0,00	НЛМК	43,4	-0,89%	9,68	VSMO	19,25	6,94%	9,6

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

Прочая статистика

Сырьевые рынки

NYMEX	Цена, $	Изм., %	Макс.*	Мин.*
Платина / тр. унц.	1051,8	0,23%	1098,90	791,90
Уран / фунт	43,0	0,00%	55,00	43,00
Газ/ млн. брит. тепл. ед.	3,8	-0,99%	13,58	3,80
Бензин / галлон	1,4	3,65%	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	465,0	0,00%	1137,50	465,00
Сталь ХК, экспорт ФОБ / тонна	560,0	0,00%	1275,00	560,00

Сельское хозяйство Reuters/Jefferies CRB Movers	Цена, $	Изм., %	Макс.*	Мин.*
Пшеница / бушель	5,0625	0,00%	9,7500	4,5625
Кофе / фунт	1,1100	0,00%	1,6000	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%	0,8600	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	99,70	1,25	1,033	3,30%
5-Year	30.11.13	99,53	2,00	1,976	2,92%
10-Year	15.11.18	97,80	3,75	3,008	1,79%
30-Year	15.05.38	94,22	4,50	3,826	1,78%

Валютные рынки

	с утра	вчера
Доллар / Рубль	34,4615	34,5024
Евро / Рубль	44,7465	44,7465
Евро / Доллар	1,3034	1,3018
Евро / Японская йена	128,3600	128,3600

	с утра	вчера
Евро / Швейцарский франк	1,5384	1,5388
Доллар / Швейцарский франк	1,1804	1,1860
Доллар / Гонконгский доллар	7,7527	7,7530
Фунт стерлингов / Доллар	1,4080	1,4040

Мировые индексы

Индексы Morgan Stanley Capital International	Индекс	Изм., %
MSCI World	778,58	1,75%
MSCI EM	541,92	0,42%
MSCI Eastern Europe	106,38	-0,49%
MSCI BRIC	175,15	-0,26%
MSCI Russia	408,86	0,64%

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.