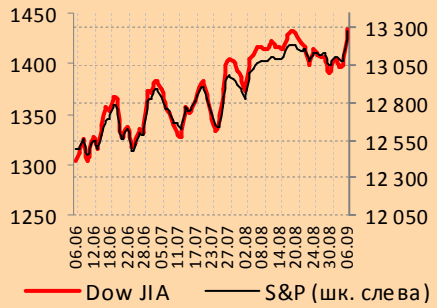
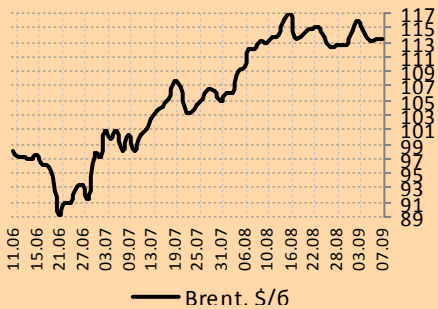
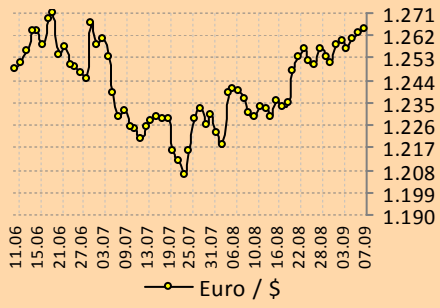
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

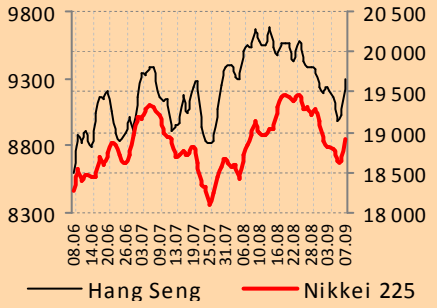
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

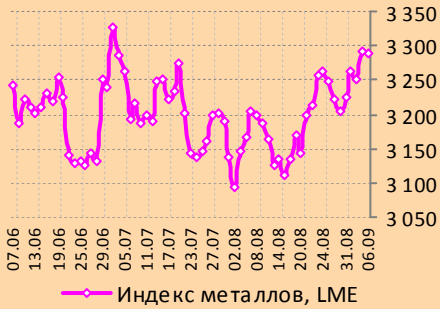
Ежедневный обзор

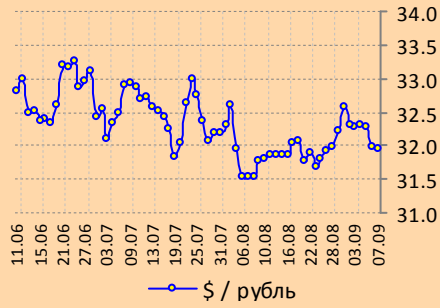






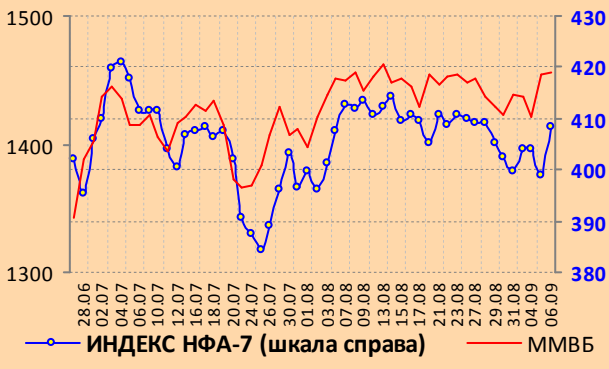






СОДЕРЖАНИЕ

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. Количество первичных обращений за пособиями по безработице за неделю снизилось даже больше, чем ожидалось, с 377 до 365 тыс. при ожиданиях в 370. Динамика фьючерсов на биржевые индексы на ожиданиях от ЕЦБ тоже в течение дня менялась в лучшую сторону, инвесторы все больше склонялись к позитиву и в итоге индекс Dow Jones =+1,87, S&P 500 =+2,04, NASDAQ =+2,17%.

ОЭСР понизила прогноз по ВВП на текущий год с 2,4 до 2,3%, отметив, что долговой кризис в Европе негативно отражается на темпах роста экономики стран G7.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, биржи росли, используя внешнюю поддержку и снизившиеся накануне цены акций, в итоге ММВБ =+ 2,35, РТС =+3,33%.

На аукционе ЦБ РФ по кредитованию под прямое РЕПО на 1 день при предложении в 20 млрд. руб. спрос оказался в два раза выше, ставка составила 5,66% (на рынке ставка равна 4,47%). Почта России собирается разместить облигации общим объемом 9 млрд. руб. с номиналом 1000 руб. каждая, срок обращения 2548 дней. Предусмотрена возможность досрочного погашения по усмотрению эмитента и по требованию владельцев. Сейчас в обращении уже находится один выпуск облигаций Почты объемом 7 млрд. руб. и датой погашения в марте 2016 г.

Европа. Итак, итоги вчерашнего заседания ЕЦБ: ставка по депозитам и ставка рефинансирования остались на прежних уровнях, соответственно 0 и 0,75%, а также одобрен запуск новой программы по покупке на вторичном рынке облигаций проблемных стран для снижения доходностей и повышения устойчивости евро. Конечно, учитывая отрицательный рост ВВП еврозоны (-0,2% за второй квартал относительно первого), мы ожидали снижения ключевой ставки. Видимо, на весах рецессии или инфляции приоритет был отдан инфляции. В таком случае основанием для сохранения (понимай: не снижения) ставок, видимо, стали инфляционные риски, последние данные показали рост инфляции за месяц с 2,4 до 2,6% при целевом ориентире ЕЦБ в 2%. Что касается новой программы, пока известно, что она будет безлимитной, но при этом покупки будут стерилизованными (без печатания денег), с использованием механизмов изъятия ликвидности, подобных недельным срочным депозитам. Интересно, что до появления информации с заседания ЕЦБ биржи росли с самого открытия, невзирая на статистику по ВВП. Правда, был и позитив, так, по Германии промзаказы выросли за месяц на 0,5%, при том, что ожидалось повышение на 0,2%, а предыдущее изменение было отрицательным -1,7%. Вчера Испания размещала на аукционе гособлигации со сроками обращения 2, 3 и 4 года, привлекла деньги по верхней границе, с доходностью для двухлетних бумаг в 2,798% (4,706% в ходе предыдущего аукциона), трехлетних в 3,676% (5,086%), четырехлетних в 4,603% (5,971%). Результат сессии: FTSE 100 =+2,11, DAX =+2,91, CAC 40 =+3,06%.

Прогноз ОЭСР по росту ВВП на текущий год для Германии понижен с 1,2 до 0,8%, по Франции с 0,6 до 0,1%, по Италии с -1,7 до -2,4%, по Великобритании с +0,5 до -0,7%.

Появилась информация, что Греция намерена потребовать от Германии компенсации в размере примерно 7,5 млрд. евро за оккупацию во время Второй мировой войны. Для определения конкретной суммы назначена специальная комиссия, но вряд ли Греция рассчитывает на реальные выплаты, скорее, это тактический ход накануне решения кредиторов о выделении очередного транша помощи стране. Безработица в стране возросла с 23,5 до 24,4%.

Банк Англии сохранил программу количественного смягчения на прежнем уровне, т.е. как и прежде, планирует выкупить облигации на сумму 375 млрд. фунтов стерлингов.

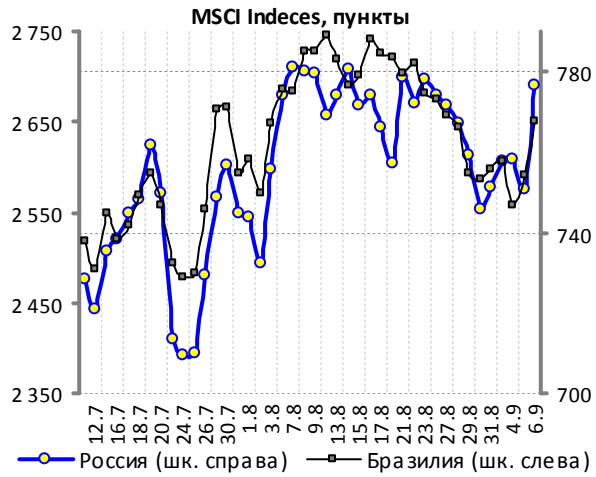
Азия. Инвесторы в Азии покупали акции в ожидании решений ЕЦБ, Nikkei +0,01, SSE +0,7, Kospi +0,38, Hang Seng +0,34%. Кроме того, японским инвесторам помогло небольшое ослабление иены. Кстати, если по остальным странам G7 прогноз ОЭСР был понижен, то по Японии, наоборот, повышен с +2,0 до +2,2%.

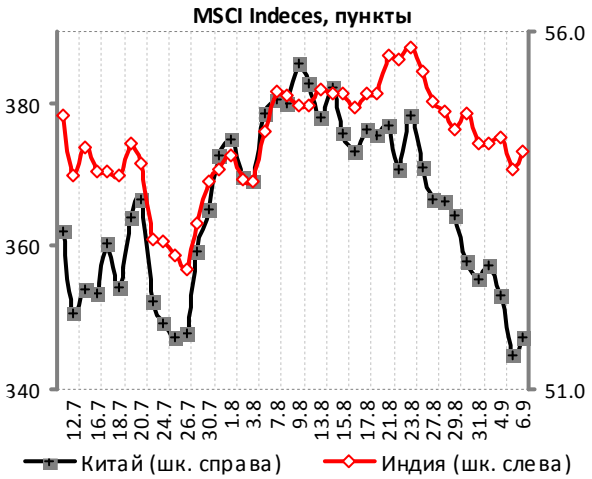
Золото. Позитивные ожидания от о заседания ЕЦБ способствовали укреплению евро относительно доллара и, соответственно, росту цен товаров, номинированных в долларах. Утром четверга фьючерсы на золото торговались по1697,77, к 14.00 по 1711,06, сегодня утром золото = 1693,7, серебро = 32,177, платина = 1570,6 долл. за унцию.

Нефть. Brent и Light утром четверга шли по 113,25 и 96,34, к 14.00 по 113,54 и 96,66, утром сегодня 112,58 и 95,179 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из основной статистики ждем данные по торговому балансу еврозоны (10.00), а также по рынку труда США (16.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас в плюсе, Азия тоже, но нефть не растет, к тому же, сегодня – пятница. При таком наборе противоречивых параметров наши биржи все же постараются обозначить рост, если внешний фон не изменит динамику.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 07.09.2012.

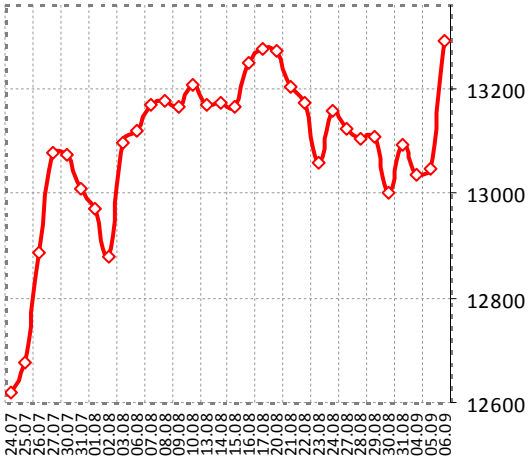




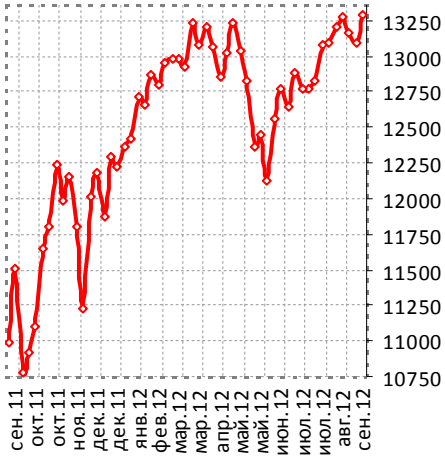
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

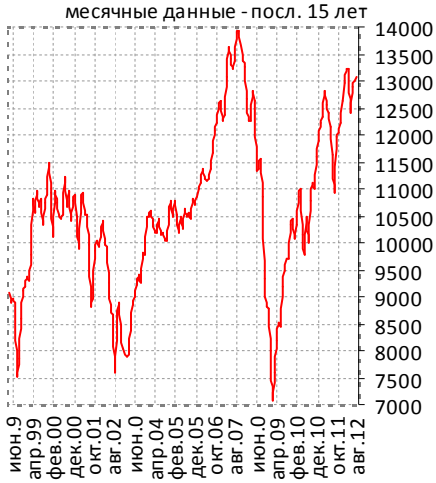
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



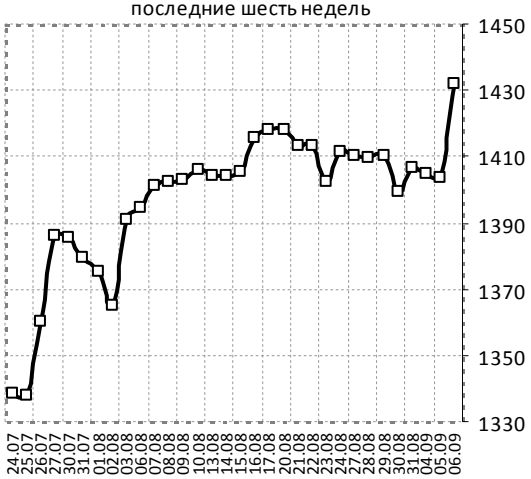
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



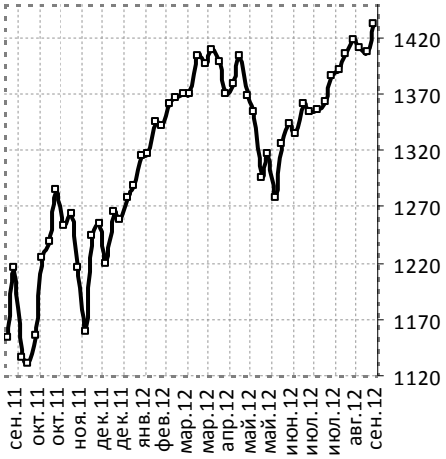
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



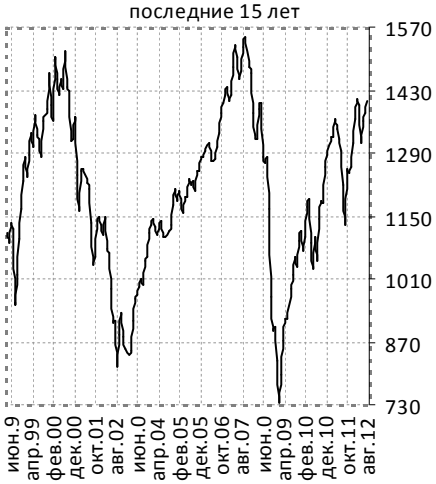
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



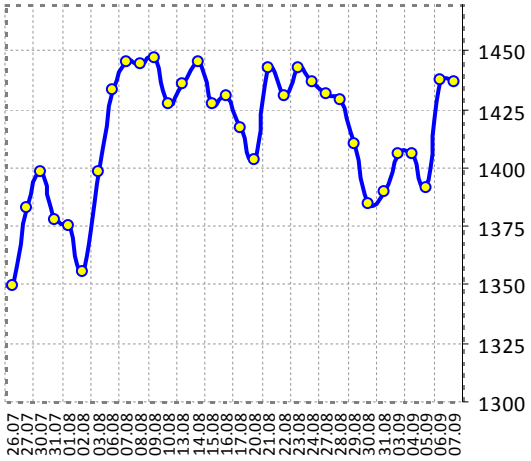
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



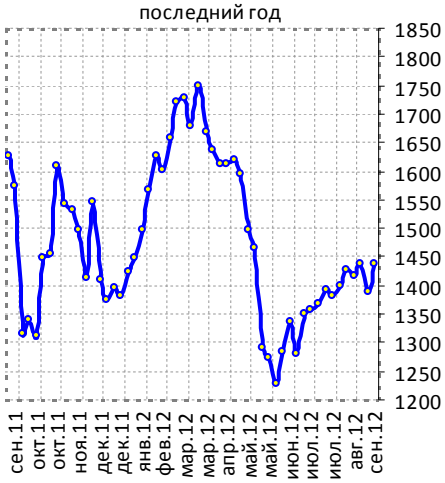
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



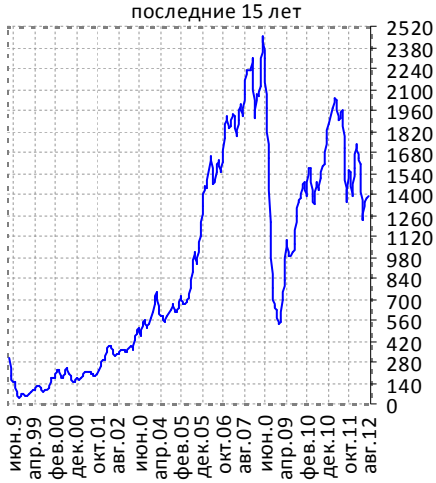
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



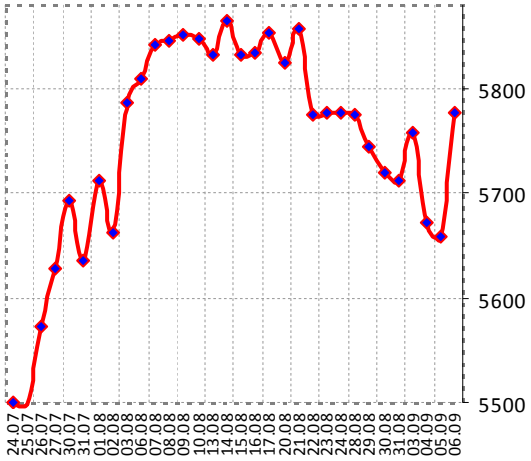
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



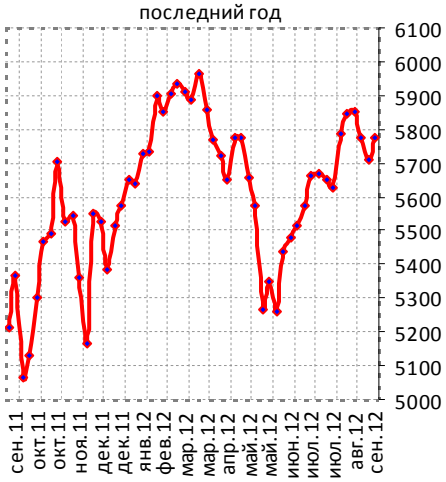
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

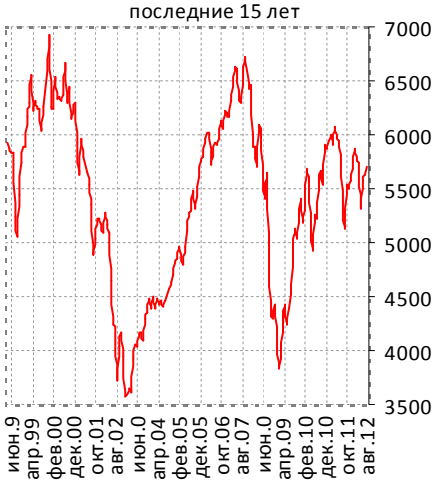
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



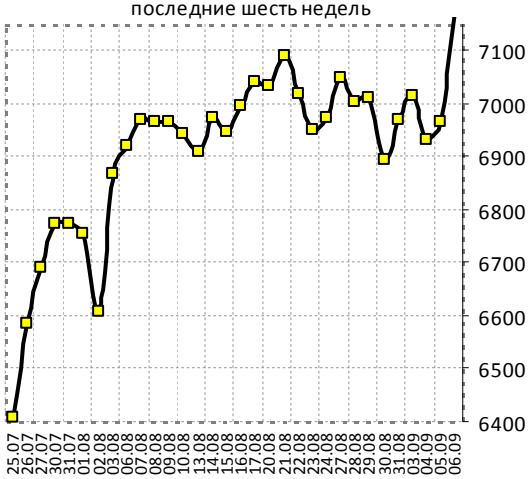
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



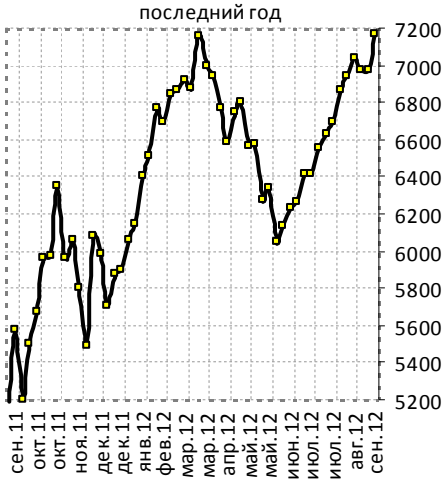
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



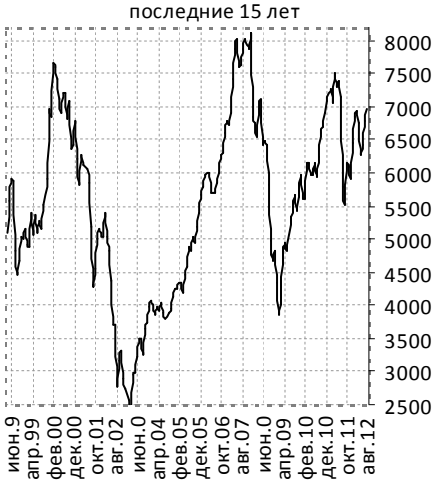
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



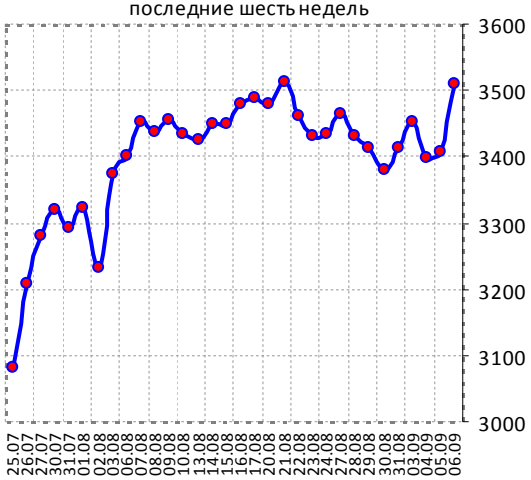
DAX Index: недельные данные - последний год



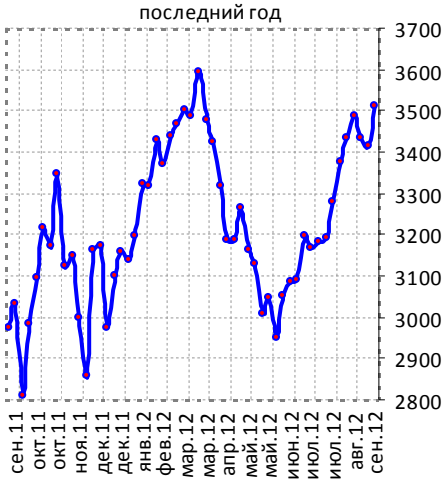
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



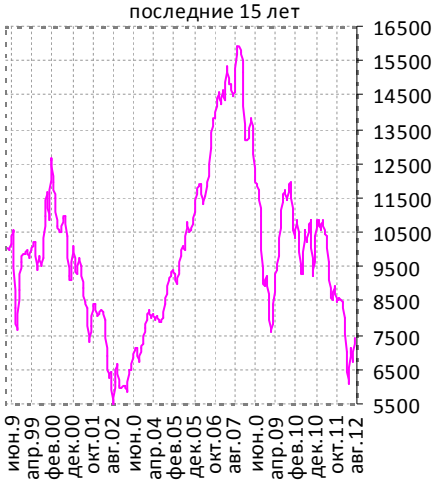
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

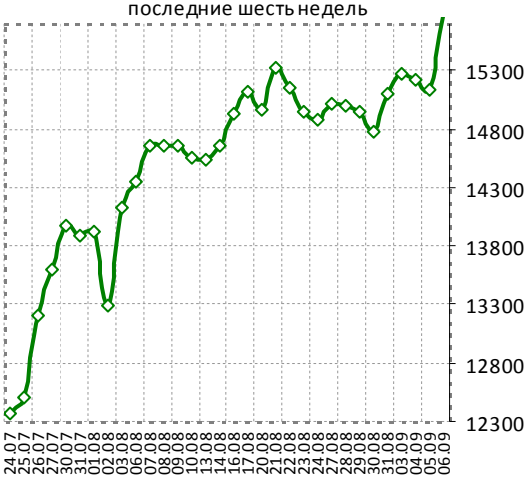


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

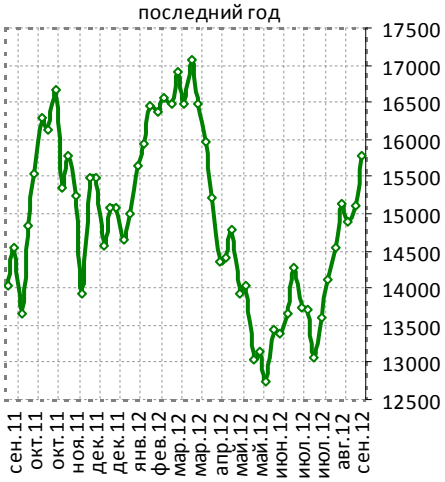


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

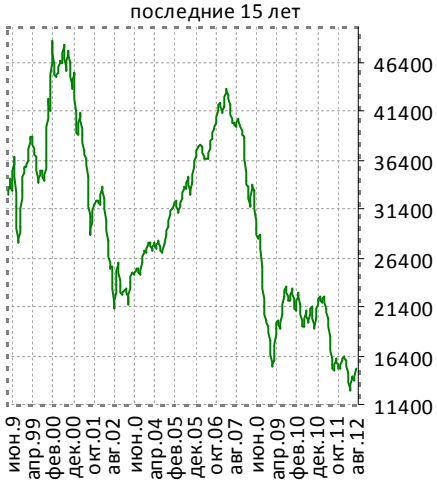
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



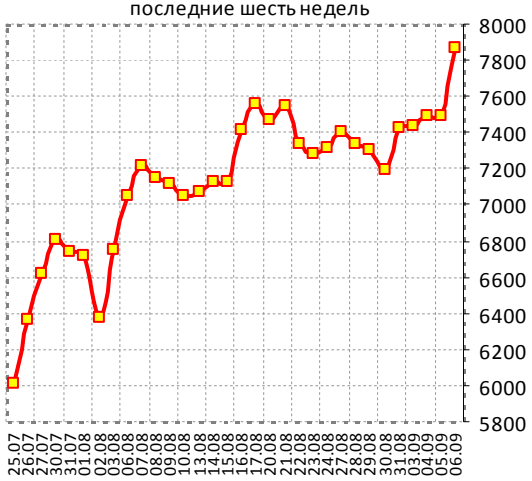
MIB Index: недельные данные - последний год



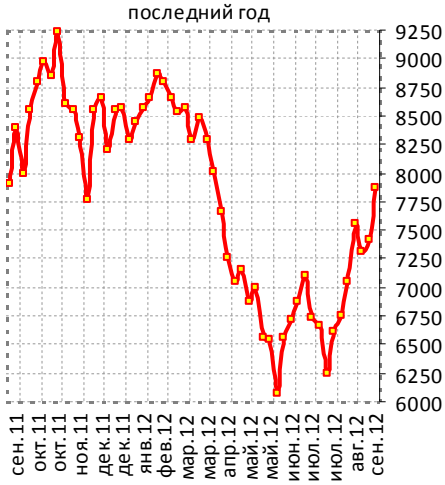
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



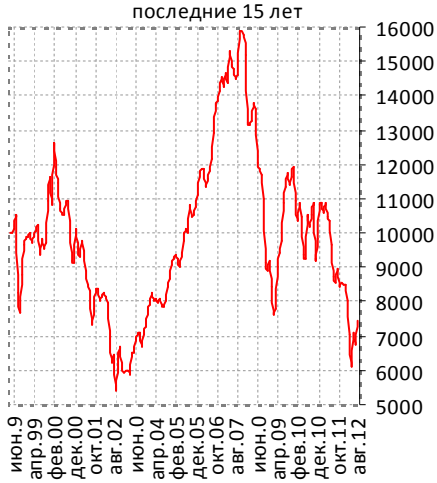
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



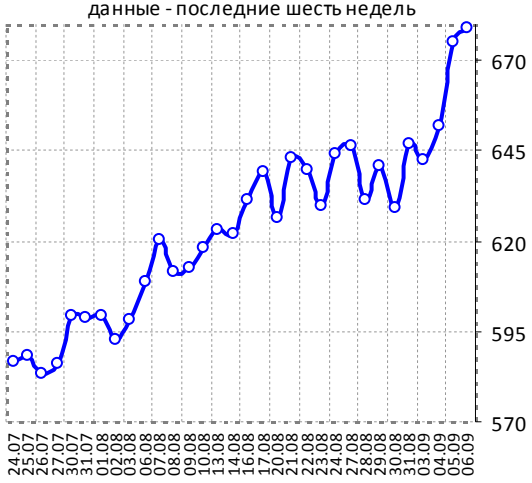
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



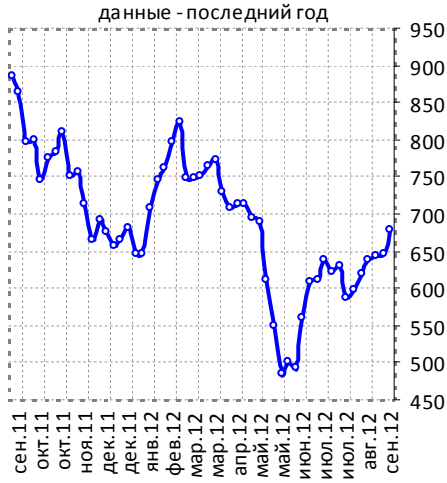
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



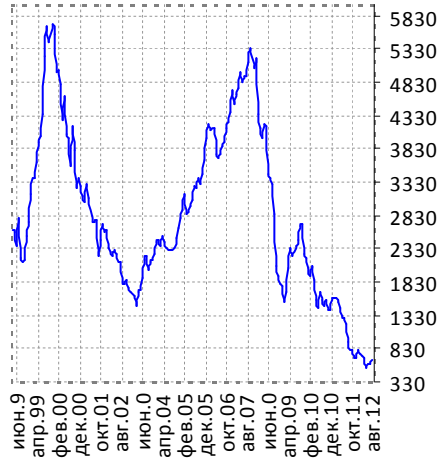
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



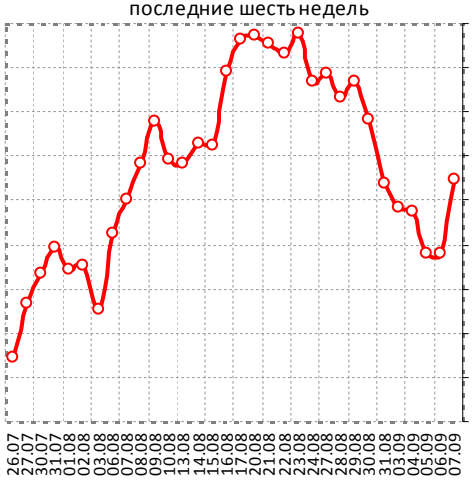
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



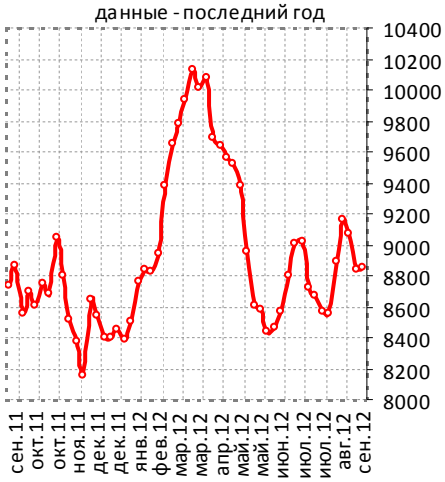
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

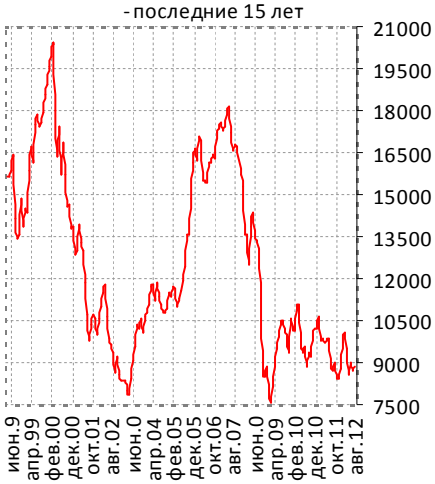
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



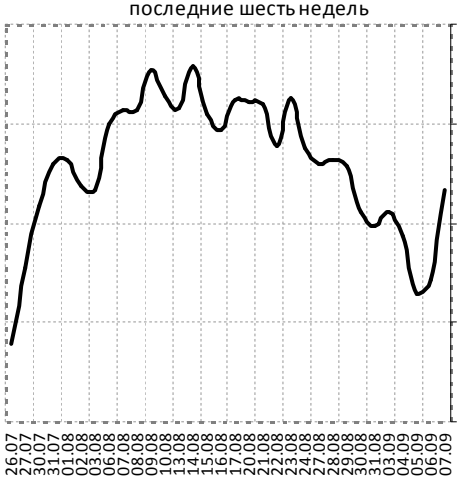
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



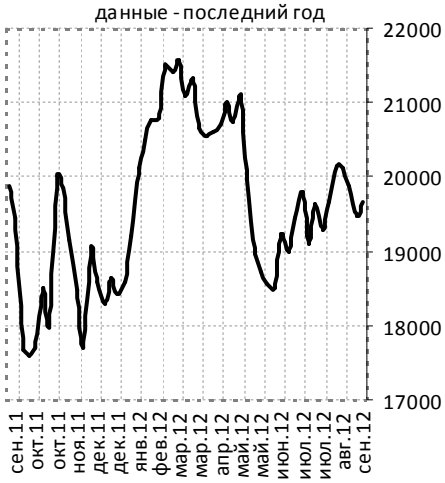
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



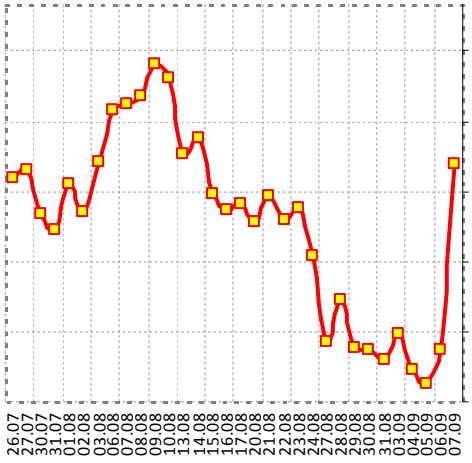
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



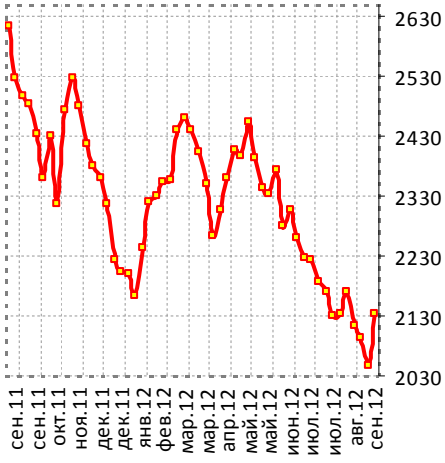
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



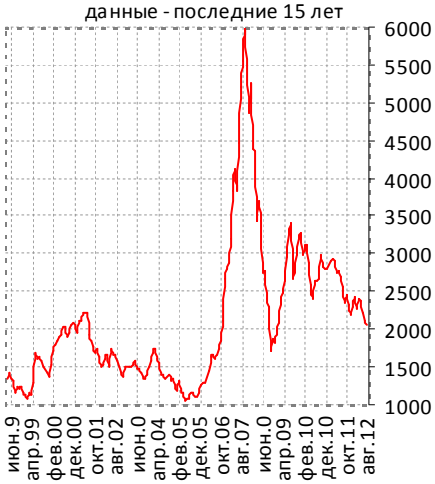
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



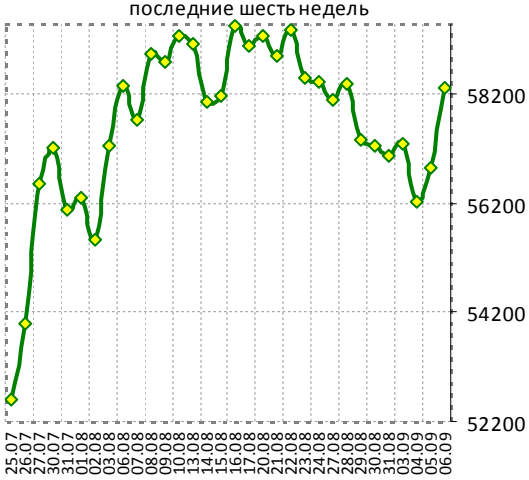
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



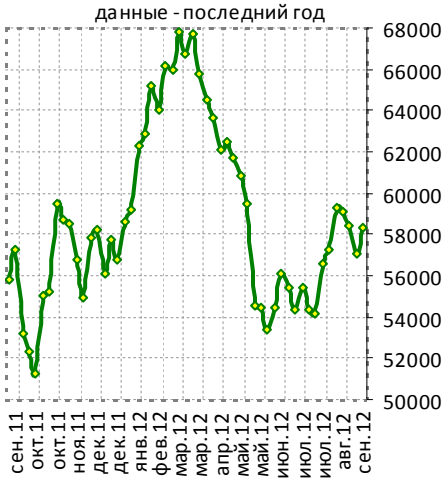
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

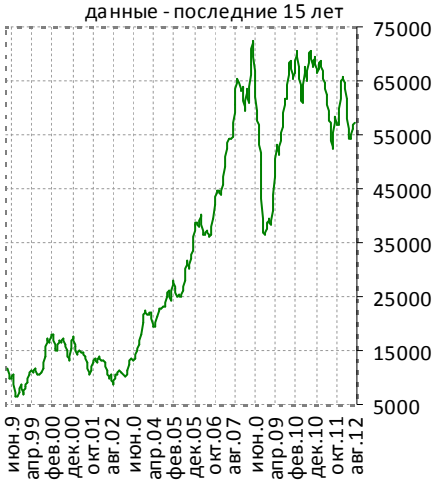
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



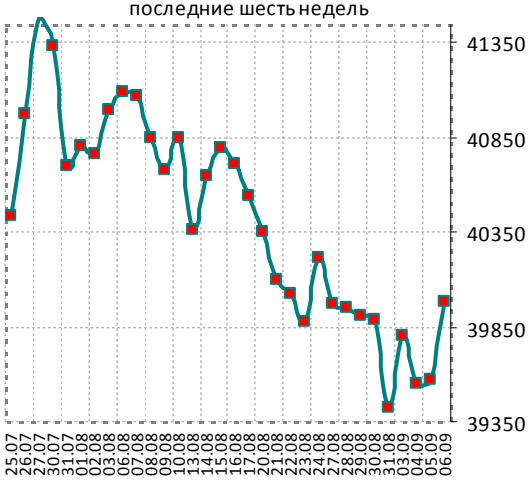
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



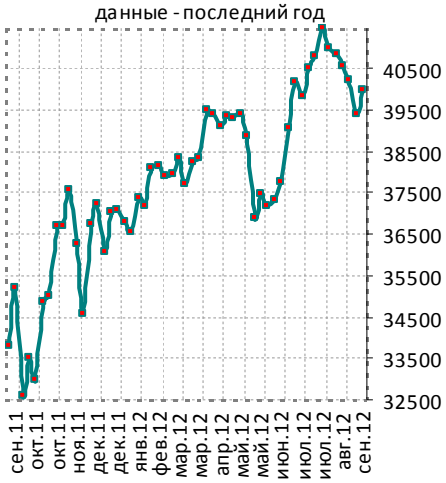
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



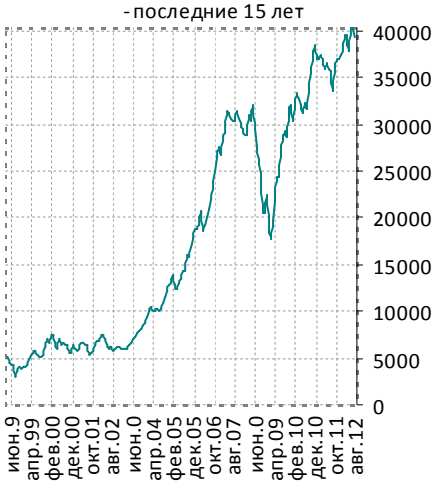
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



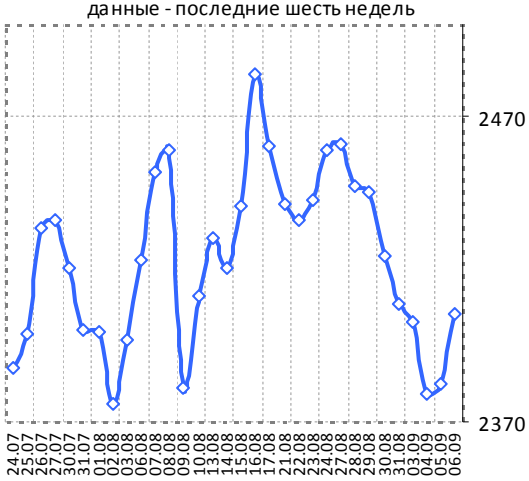
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



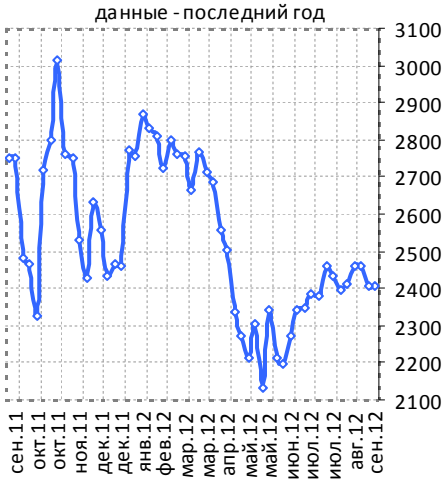
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



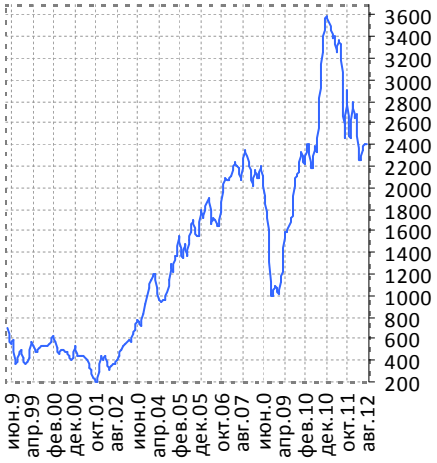
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

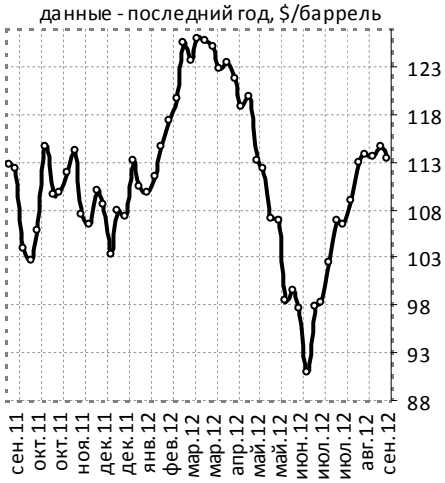
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

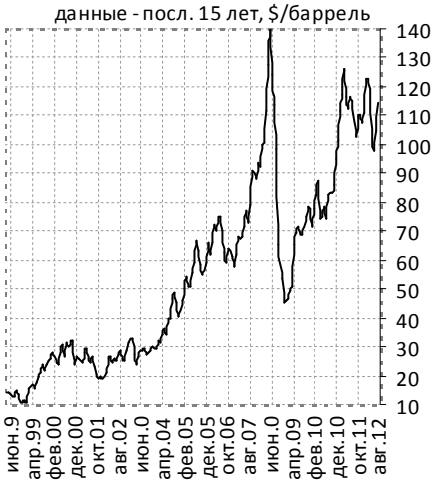
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



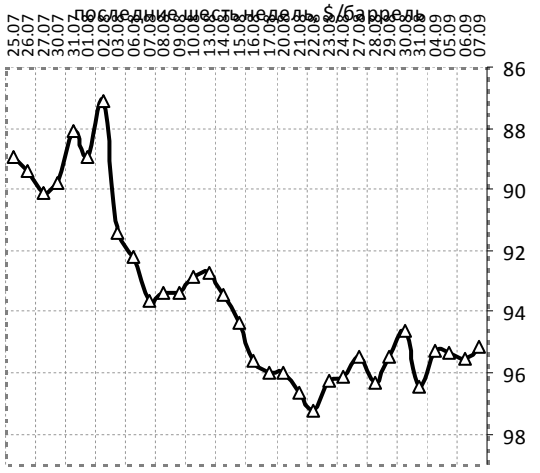
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



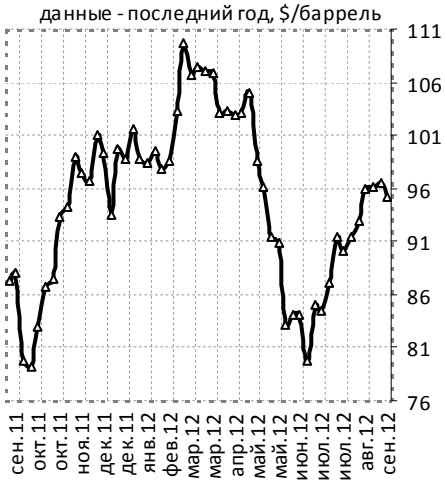
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



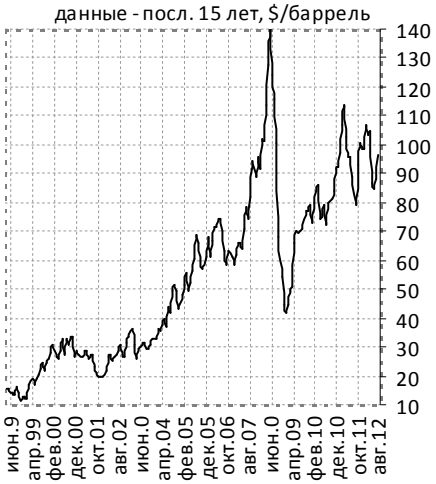
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



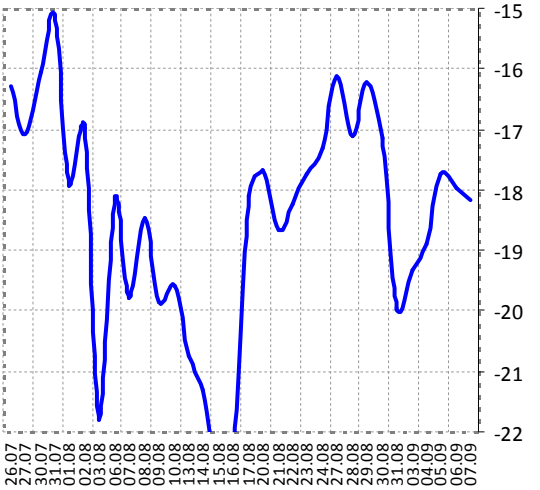
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



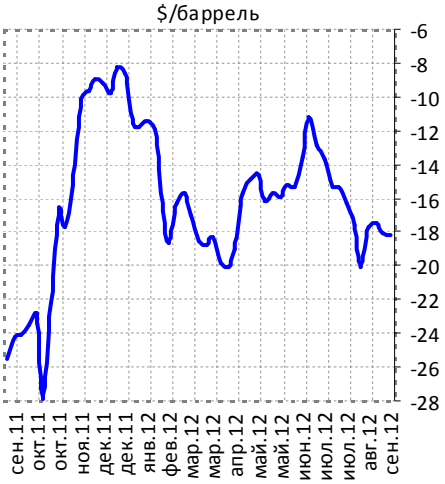
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



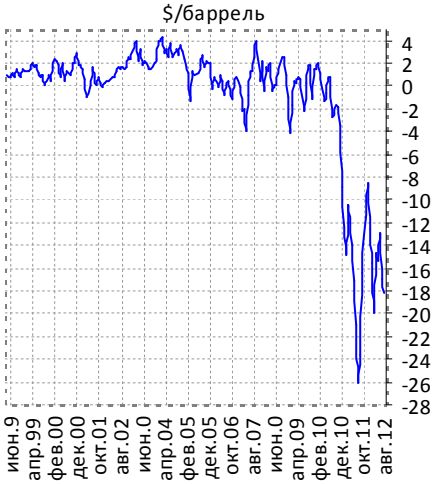
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



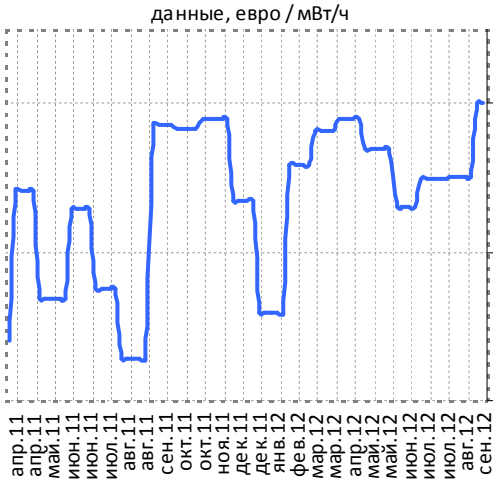
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



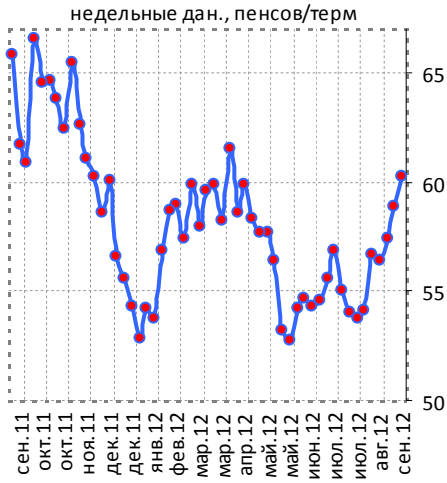
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

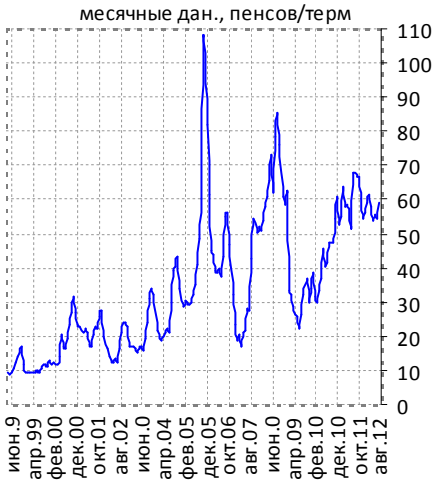
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



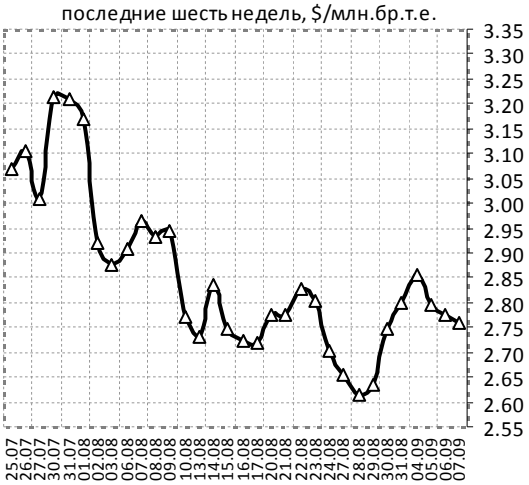
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



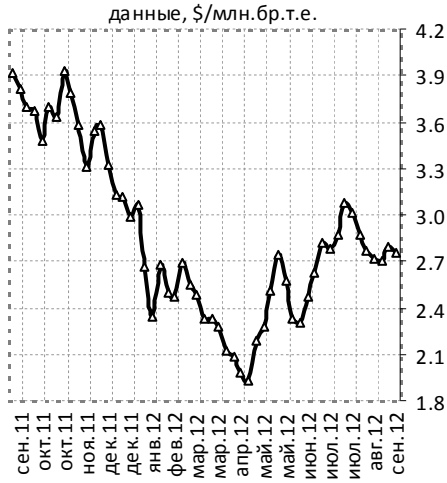
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



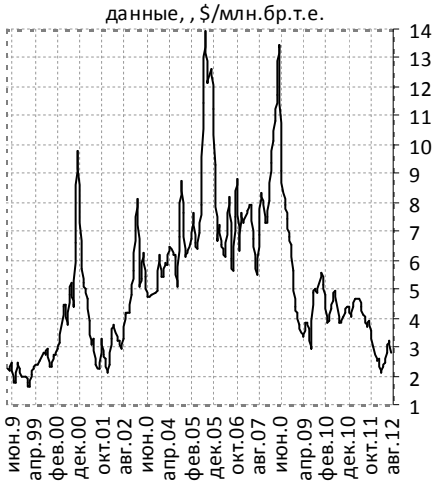
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



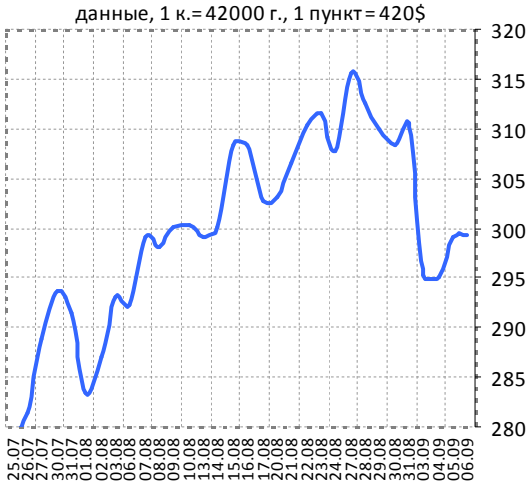
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



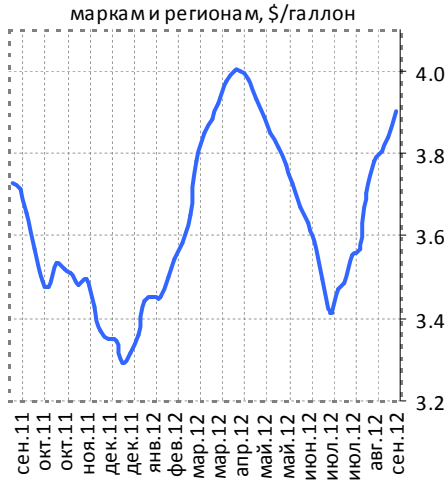
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



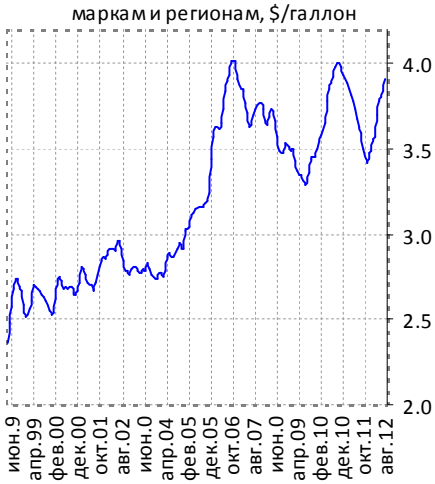
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



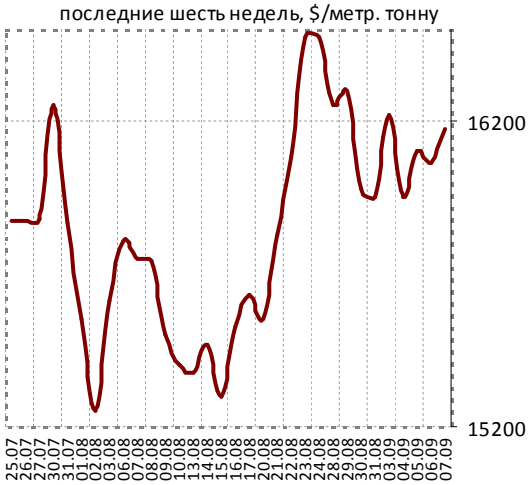
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



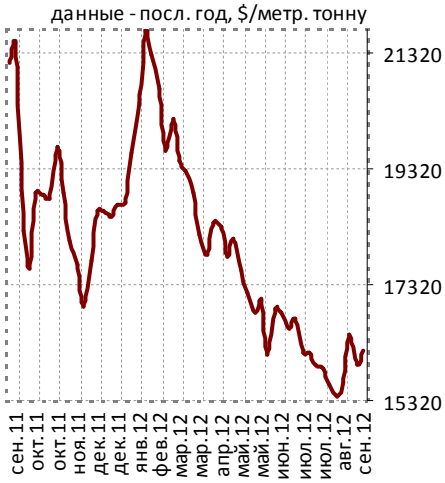
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

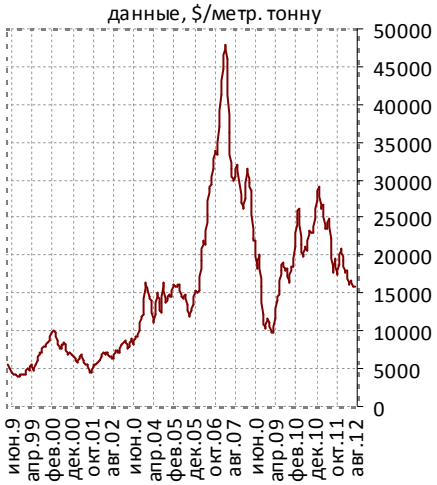
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



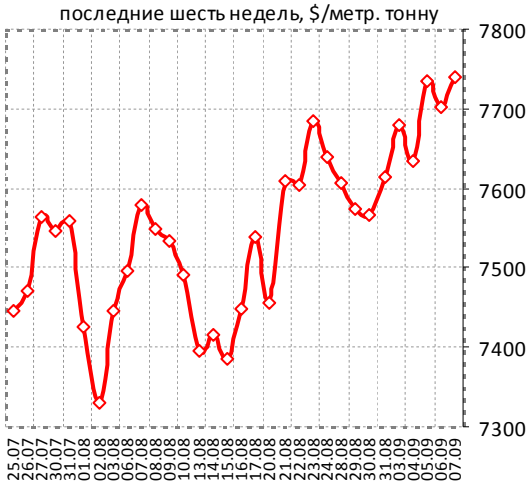
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



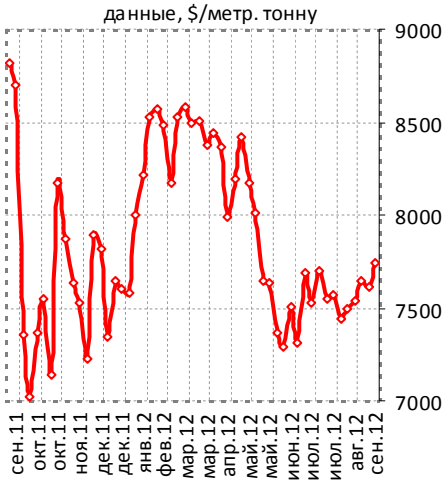
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



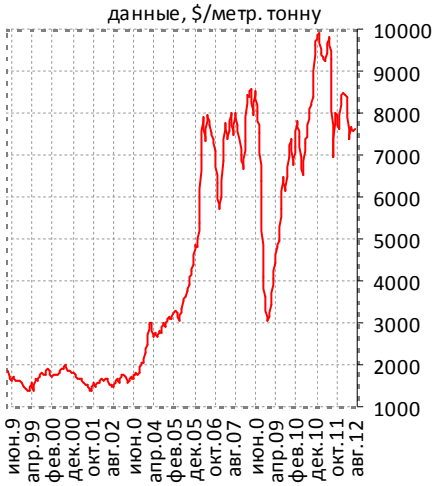
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



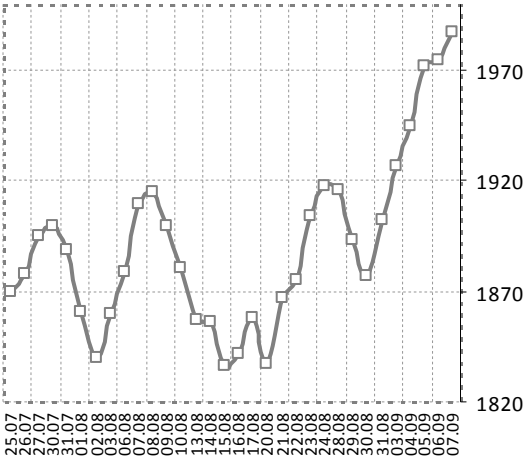
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



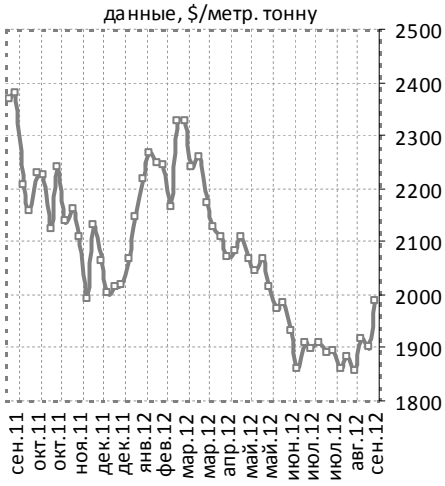
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



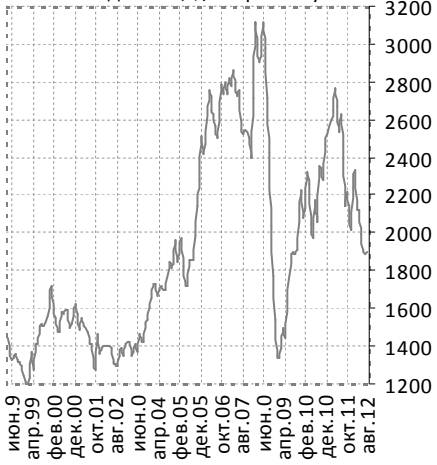
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.