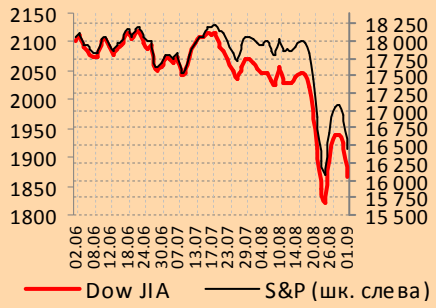
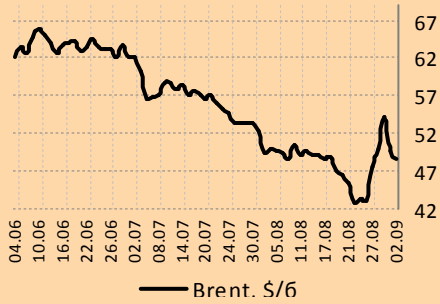
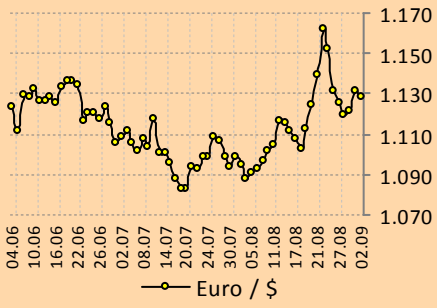
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

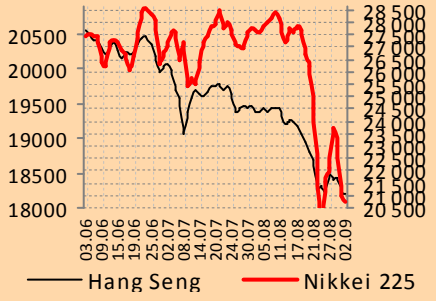
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

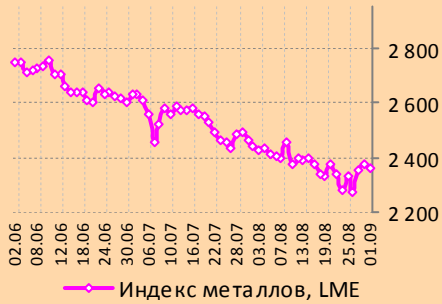
Ежедневный обзор

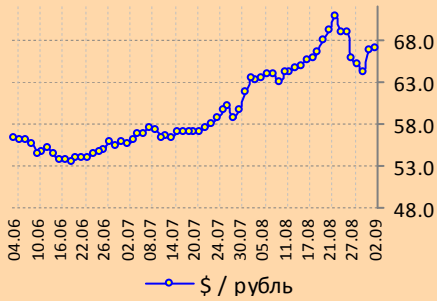






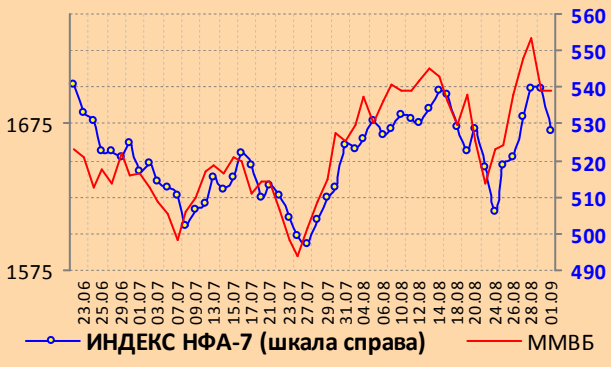






СОДЕРЖАНИЕ

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. Биржи вторника завершили торги снижением индексов, Nasdaq на 2,94, SandP на 2,96, Dow на 2,84%, обеспокоенность инвесторов была вызвана последними данными по китайской экономике и опасениями повышения ставок со стороны ФРС уже в сентябре (см. наш предыдущий обзор).

Россия. Биржевые торги вчера закрылись снижением индексов, ММВБ на 2,03, РТС на 3,42%. Рублевая ликвидность предлагалась в форме недельного аукциона РЕПО в сумме 730 млрд. руб. по минимальной ставке 11%, спрос превысил предложение на 324 млрд. руб., ставка по факту достигла 11,612%. Дефицит рублей лишь примерно наполовину был компенсирован казначейством, которое размещало 150 млрд. руб. под проценты на банковские депозиты сроком на 14 дней по минимальной ставке 10,6%.

Статистика имела негативный характер, так, индекс PMI обрабатывающих отраслей за месяц снизился с 48,3 до 47,9 пункта (минимум за 3 месяца).

ЦБ сегодня привлекает деньги банков к себе в депозиты, по предоставлению ликвидности действует схема рублевого кредитования под обеспечение и сделка валютный своп по продаже долларов за рубли. Фонд ЖКХ разместит на депозитах банков 11,5 млрд. руб.

Наша страна с 1 сентября стала председателем Совета Безопасности ООН, основными вопросами предложенной Россией программы работы на ближайший месяц станут регулирование конфликтов на Ближнем Востоке и севере Африки, а также борьба с террористической угрозой.

Отметим также, что индексу РТС исполнилось 20 лет, за это время он увеличился со своего первоначального значения в 100 пунктов более чем в восемь раз (по состоянию на 14.00 вчера до 823,39 пункта). И еще, возможно, правительство, в связи с высокой волатильностью на сырьевых рынках, временно откажется от принятия бюджета на 3 года и ограничится разработкой бюджета только на 2016 год, будут предложены соответствующие изменения в Бюджетный кодекс. Напомним, к примеру, что 2 года тому назад в проекте бюджета на трехлетку рост ВВП в 2014г. прогнозировался на уровне 3%, в 2015г. на 3,1%, в 2016г. на 3,3%.

Со стороны США введены новые санкции против ряда российских компаний, подозреваемых в деятельности, идущей вразрез с американским законом о нераспространении в отношении Ирана, КНДР и Сирии.

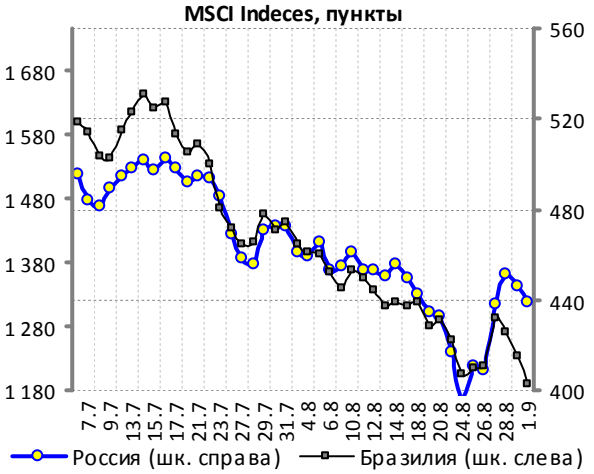
Европа. Фондовые торги вторника завершились снижением индексов, CAC на 2,40, DAX на 2,38, FTSE на 3,03%, что и понятно: Китай (см. ниже данные) является важнейшим торговым партнером Европы. Статистика по еврозоне показала улучшение ситуации на рынке труда (безработица за месяц снизилась с 1,1 до 10,9%, ожидалось 11,1%), но в целом ухудшились экономические индексы. Так, индекс деловой активности в промышленности за месяц обозначил небольшое снижение с 52,4 до 52,3 пункта (ожидалось 52,4 пункта), в Германии небольшое увеличение с 53,2 до 53,3 пункта (ожидалось 53,2 пункта), во Франции снизился с 48,6 до 48,3 пункта (ожидалось 48,6 пункта), в Италии снизился с 55,3 до 53,8 пункта (ожидалось 54,8 пункта), в Испании снизился с 53,6 до 53,2 пункта (что и ожидалось). В Великобритании соответствующий индекс снизился с 51,9 до 51,5 пункта (ожидалось 52 пункта).

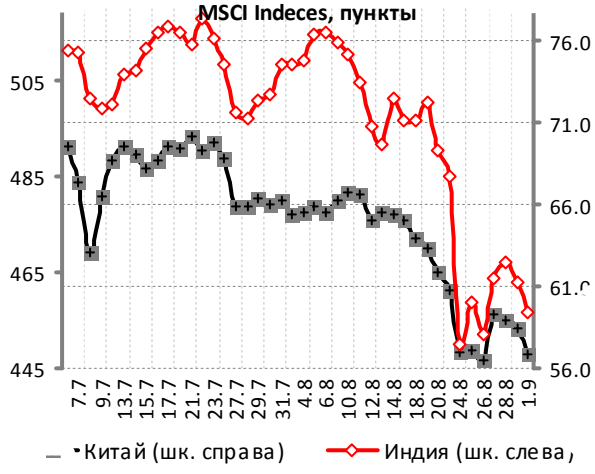
Азия. По итогам торгов вчера биржевые индексы снизились вслед за США накануне, Nikkei на 3,76, SSE на 1,23, Hang Seng на 2,31, Kospi на 1,40%. Кроме того, на котировки японских акций дополнительно влияло укрепление иены (особенно на экспортеров). В Китае вышла негативная макростатистика, так, официальный индекс деловой активности в промышленности за месяц снизился с 50 до 49,7 пункта, индекс деловой активности в сфере услуг Caixin снизился с 53,8 до 51,5 пункта. Инфляция в Южной Корее за месяц возросла на 0,2%, год к году рост показателя составил 0,7%. Золото. Цены неустойчивы, золото утром вчера продавалось по 1141,90, к 14.00 по 1142,40, утром сегодня по 1140,40 долл. за унцию.

Нефть. Brent и Light утром вчера шли по 52,77 и 47,55, к 14.00 по 52,92 и 48,34, утром сегодня по 48,41 и 44,32 долл. за барр., рынки опасаются роста запасов в США.

Статистика, прогноз. Из наиболее значимой статистики ждем инфляцию в сфере производства еврозоны (12.00), по Великобритании индекс PMI для строительного сектора (11.30), по США данные по рынку труда (15.15), изменение объема производственных заказов (17.00) и запасов нефти (17.30). Драйверы роста для российских акций к открытию торгов отсутствуют (если не считать ослабления рубля).

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 02.09.2015

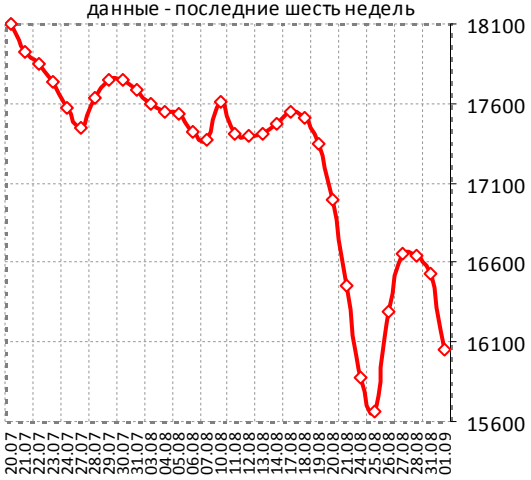




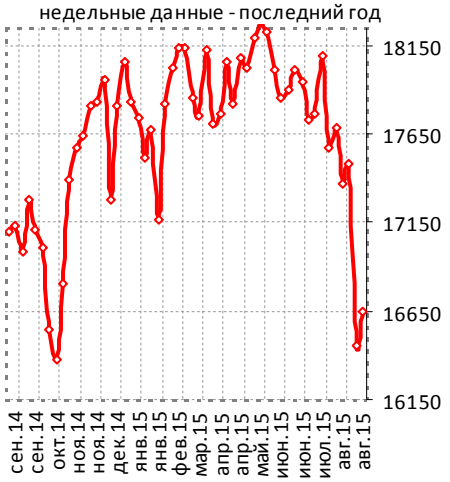
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

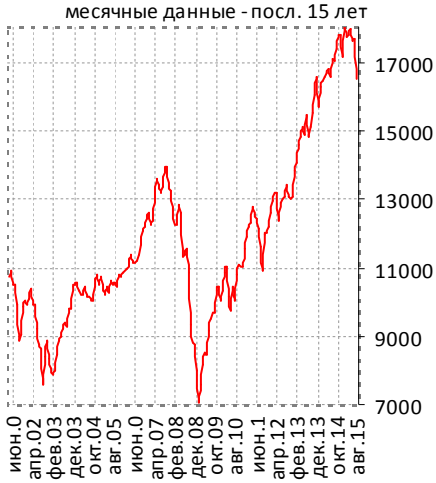
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



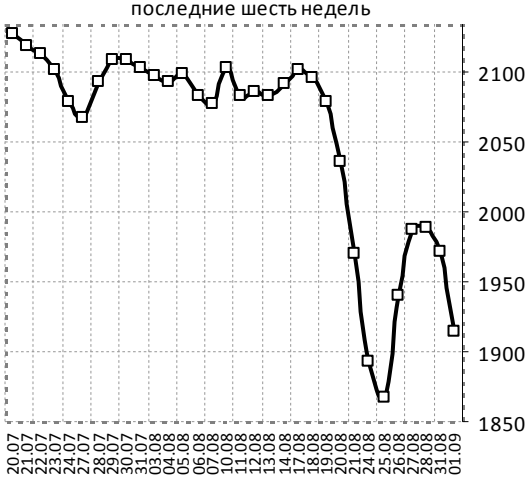
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



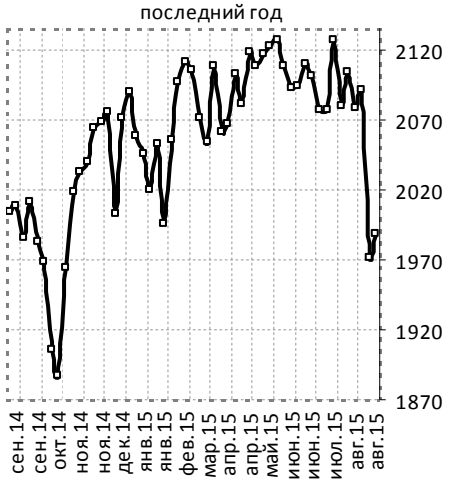
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



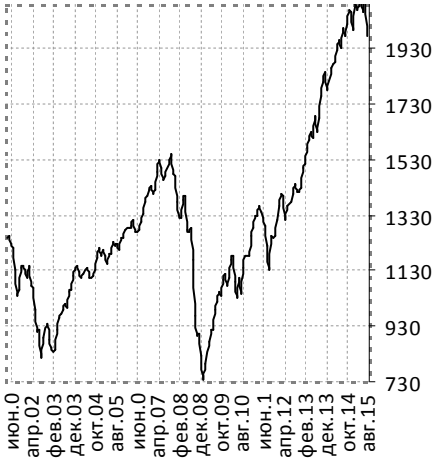
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



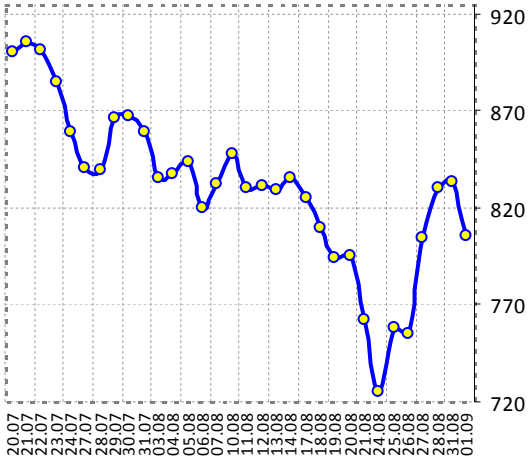
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



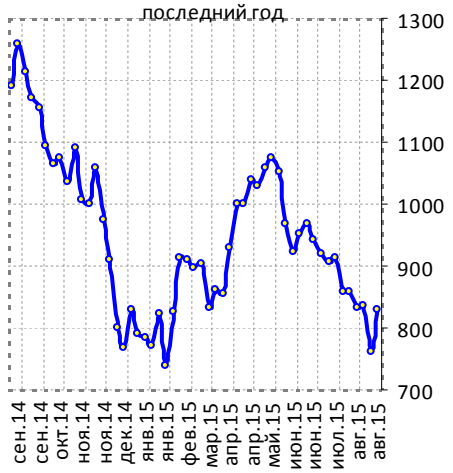
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



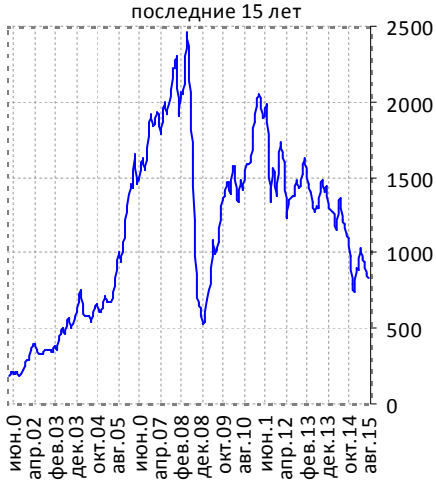
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



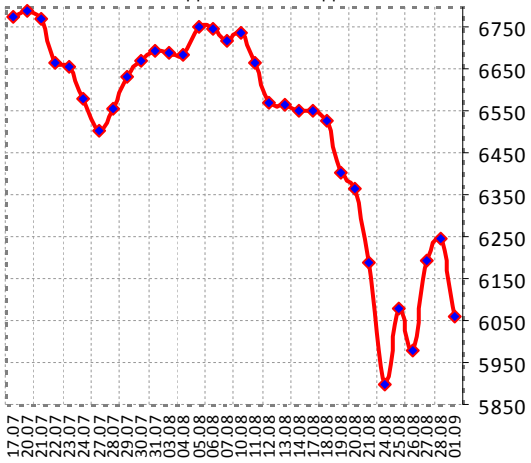
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



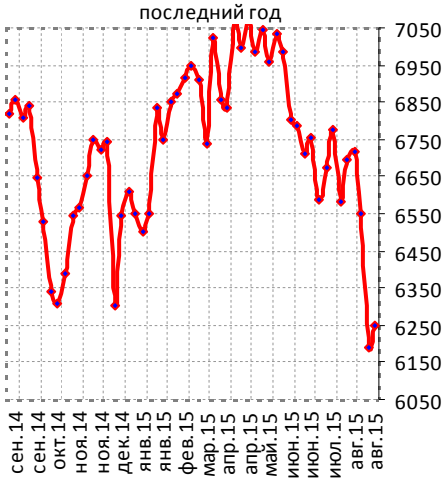
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

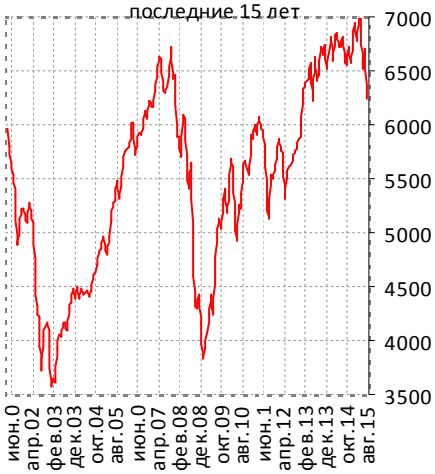
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



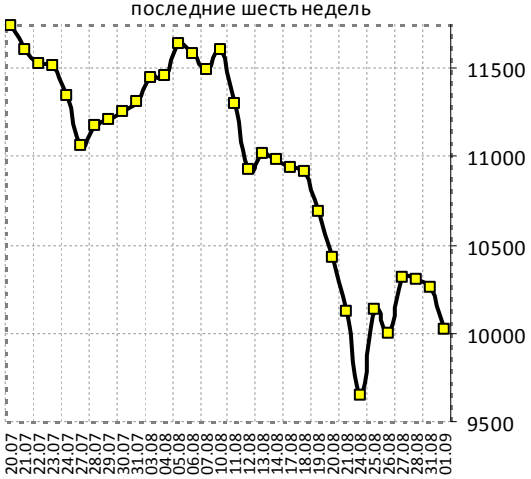
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



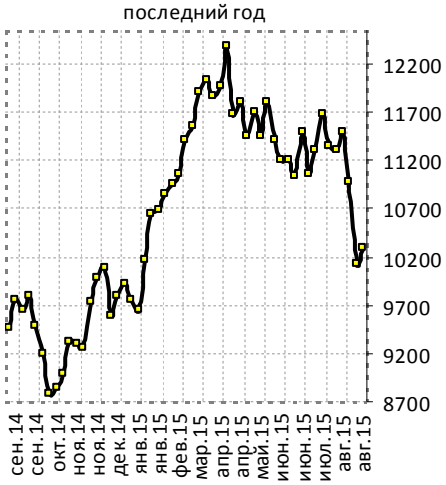
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



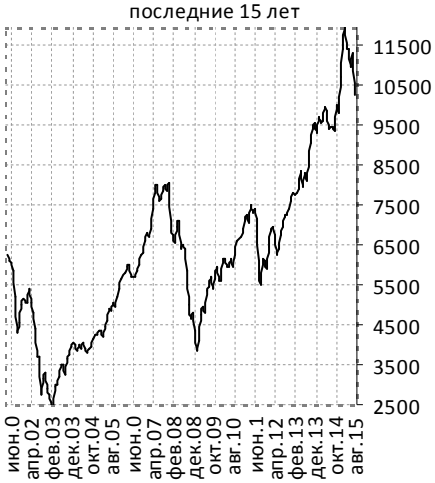
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



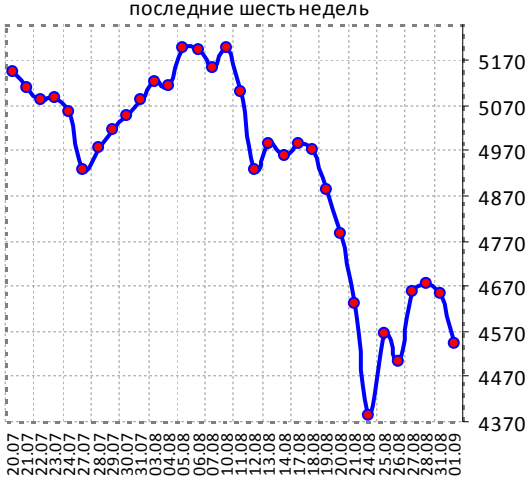
DAX Index: недельные данные - последний год



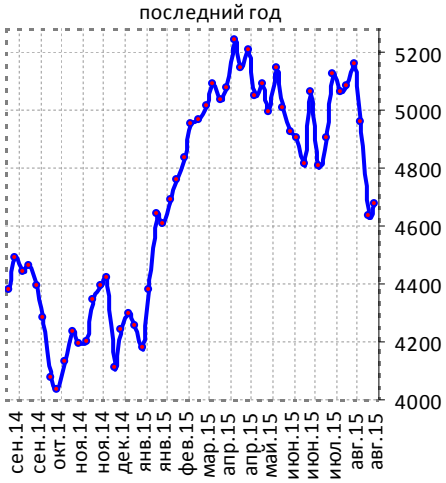
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



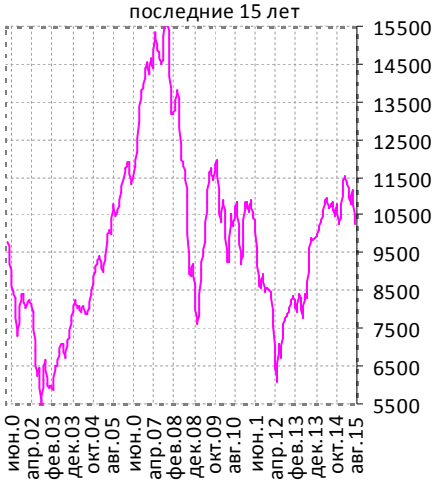
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

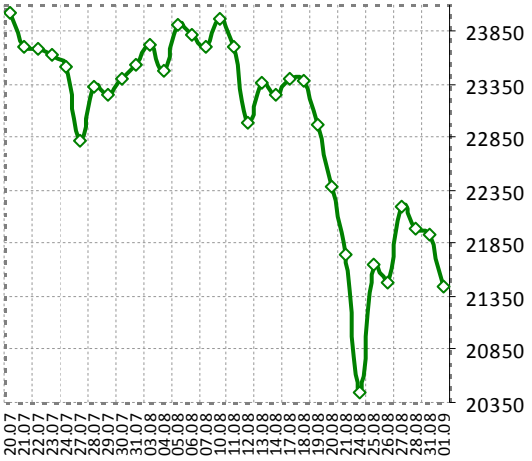


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

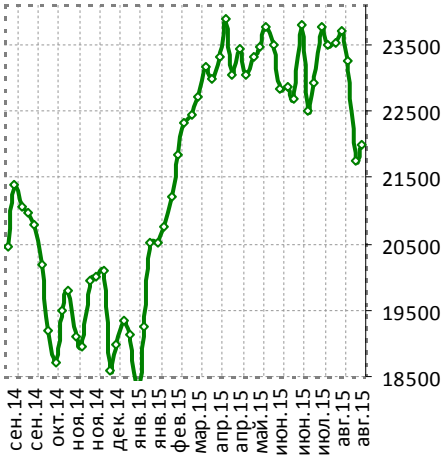


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



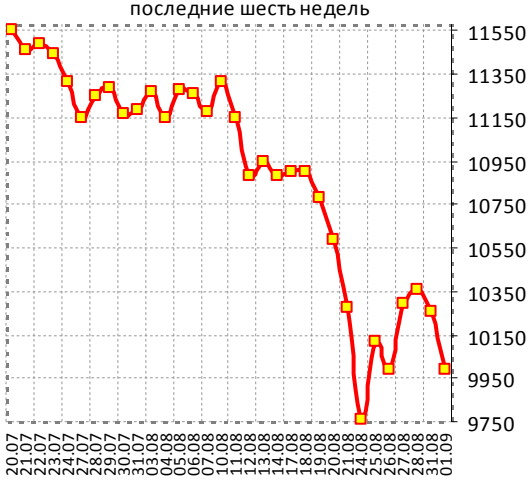
MIB Index: недельные данные - последний год



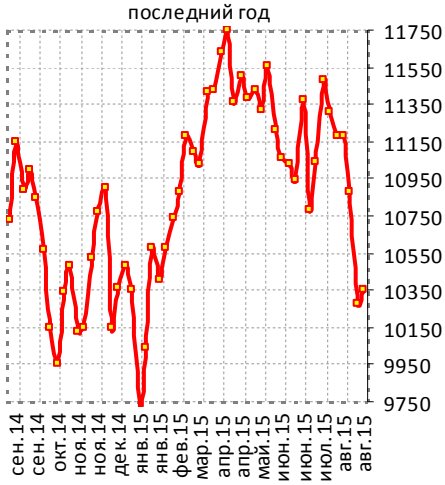
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



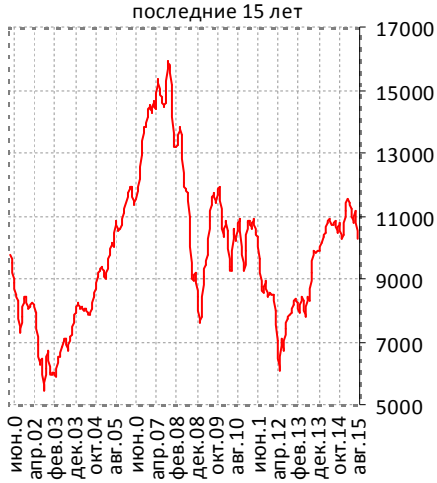
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



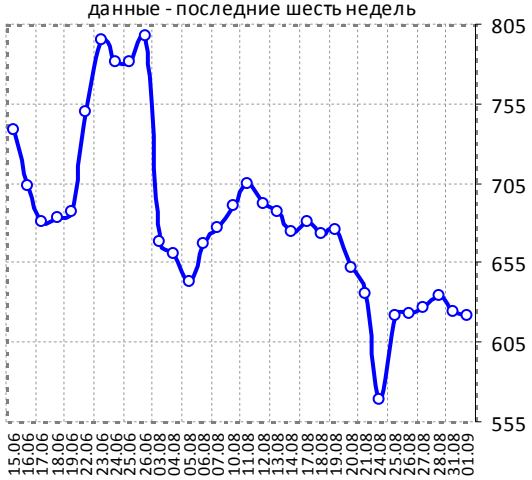
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



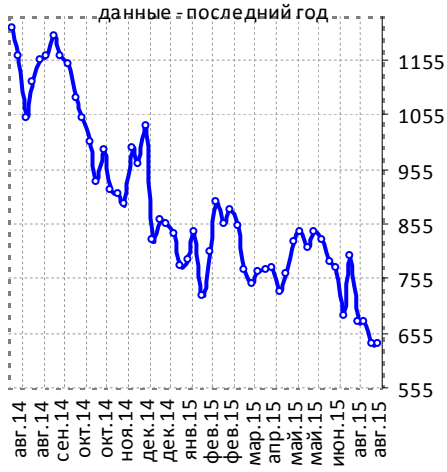
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



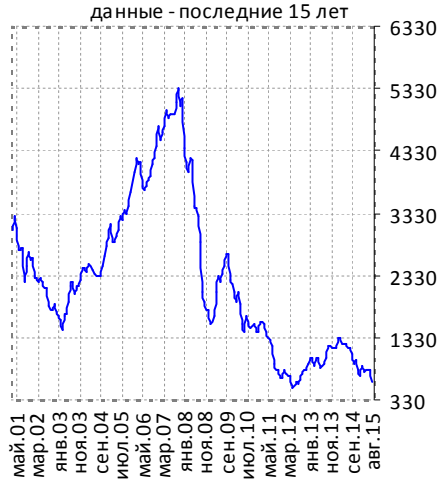
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



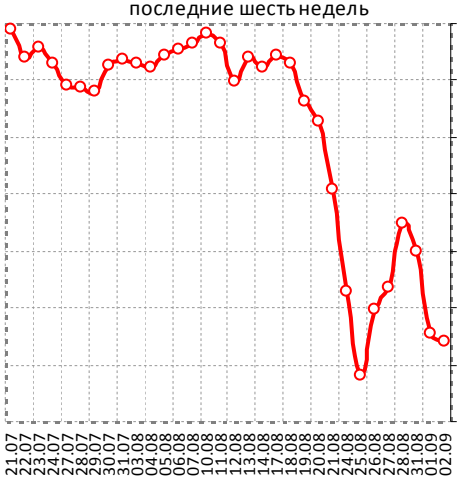
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



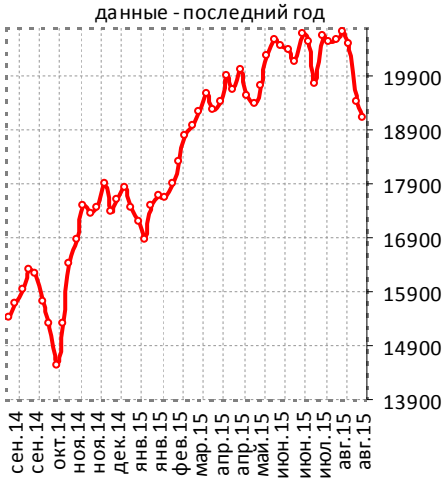
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

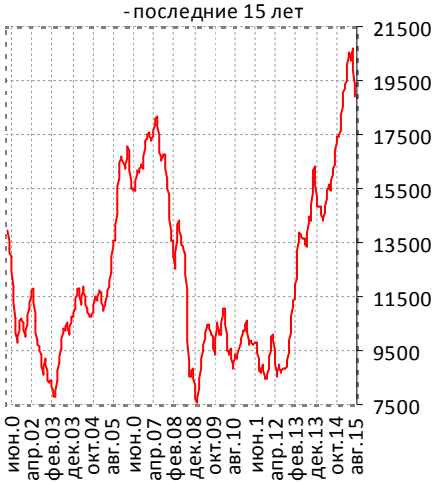
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



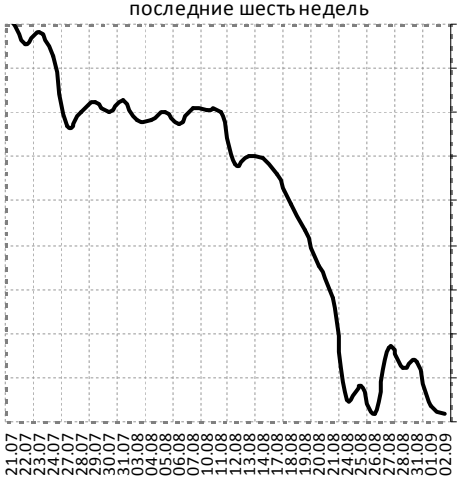
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



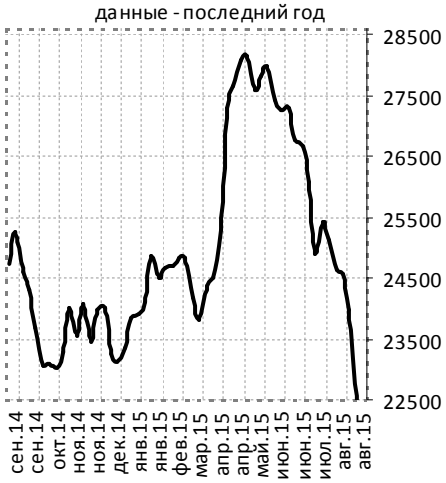
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



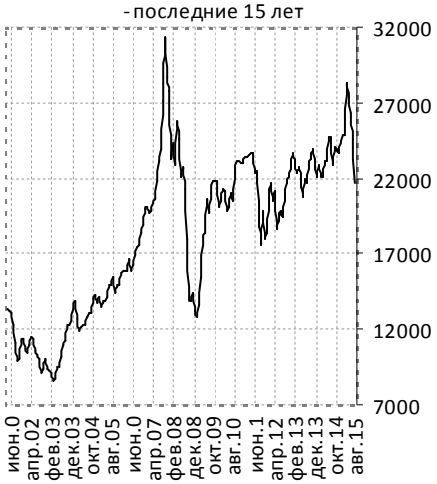
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



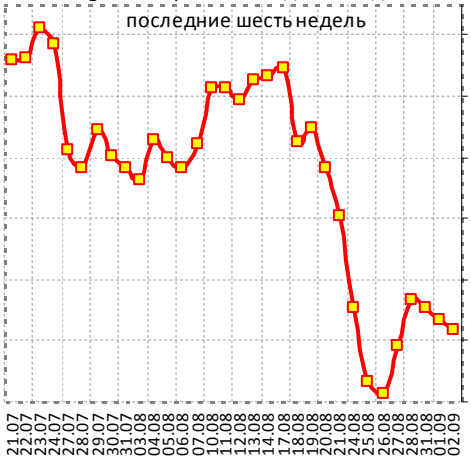
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



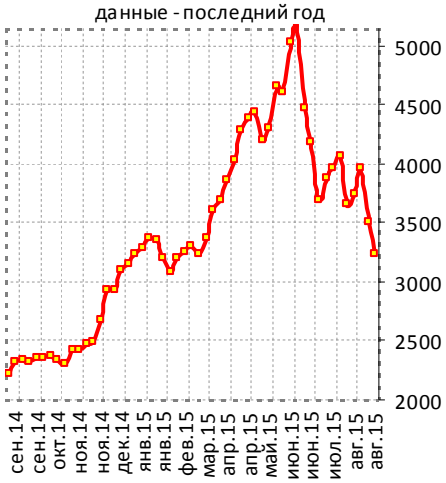
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



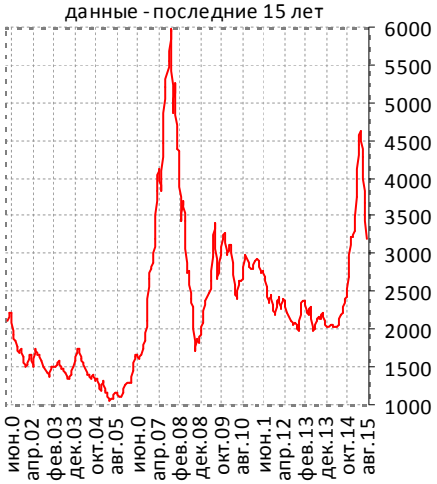
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



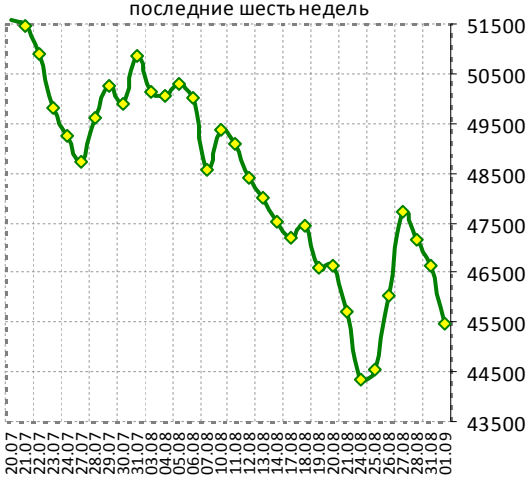
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



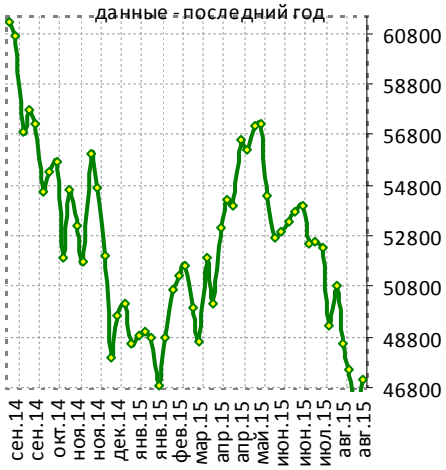
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

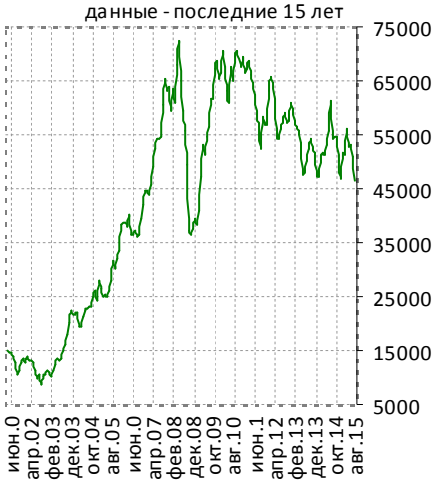
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



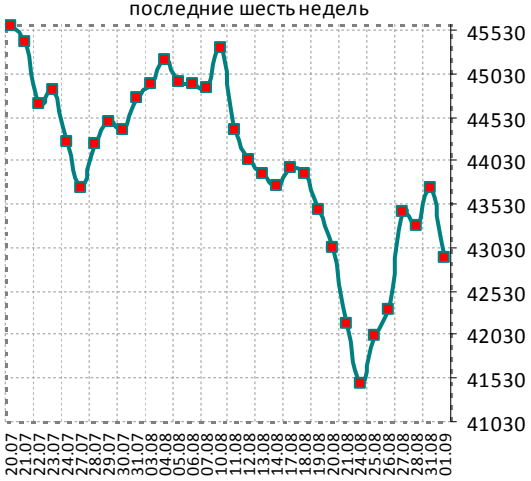
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



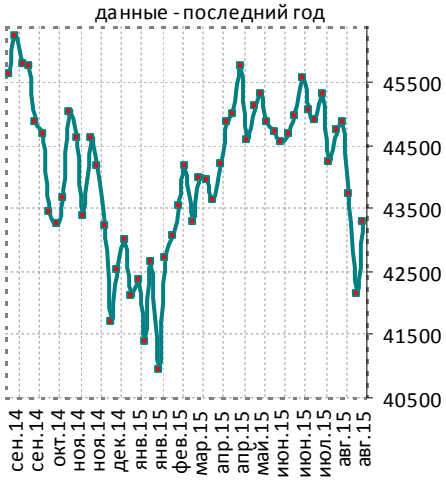
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



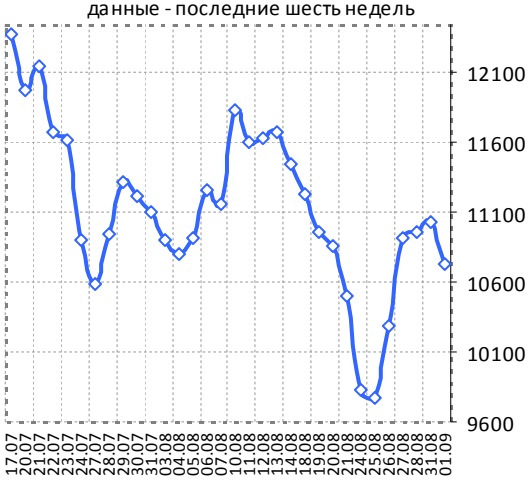
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



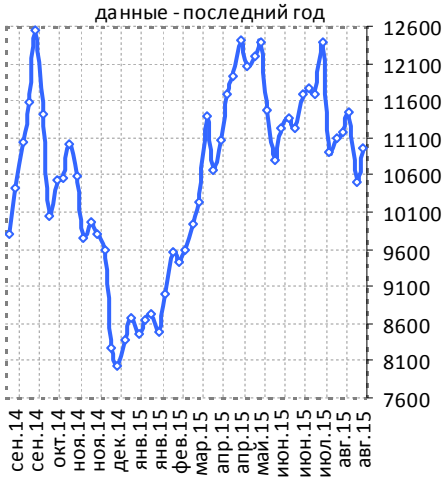
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



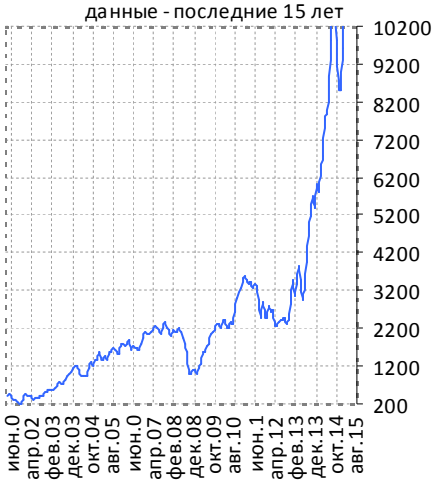
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

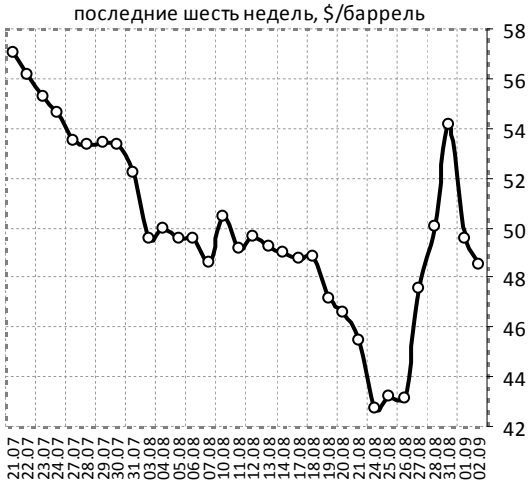


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

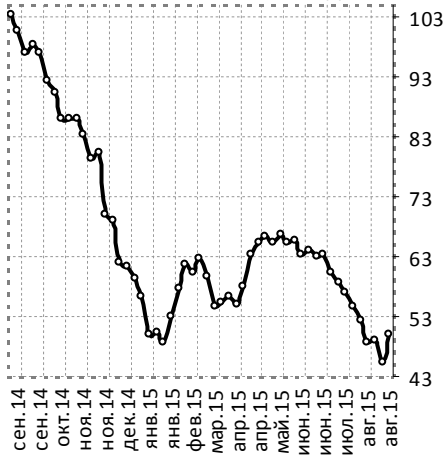
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

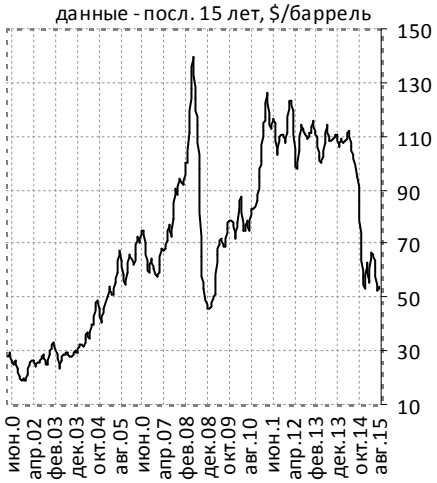
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



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



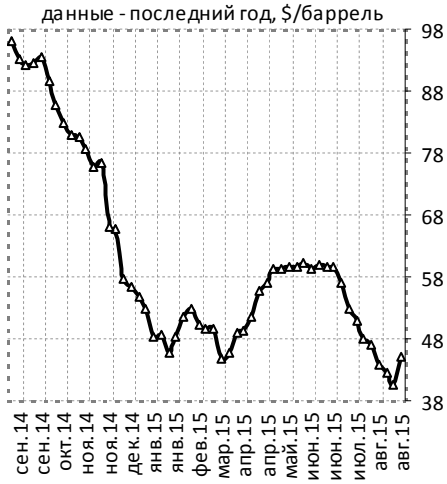
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



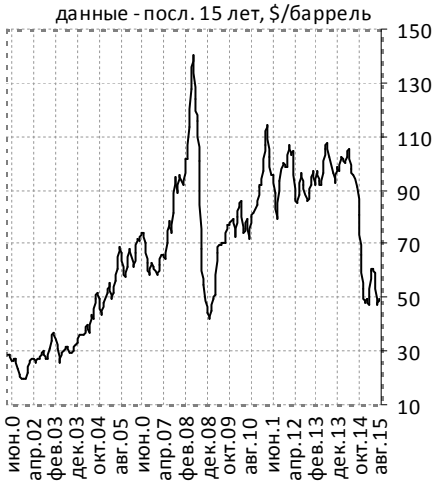
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



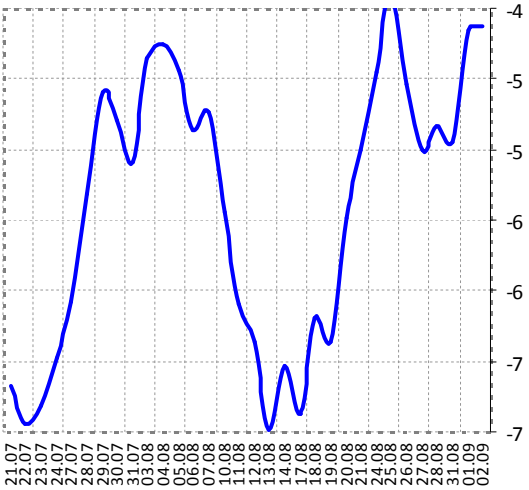
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



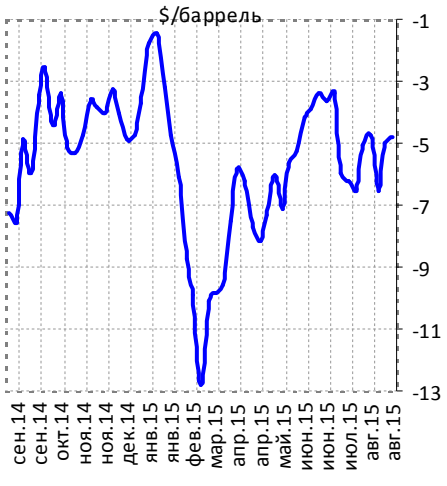
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



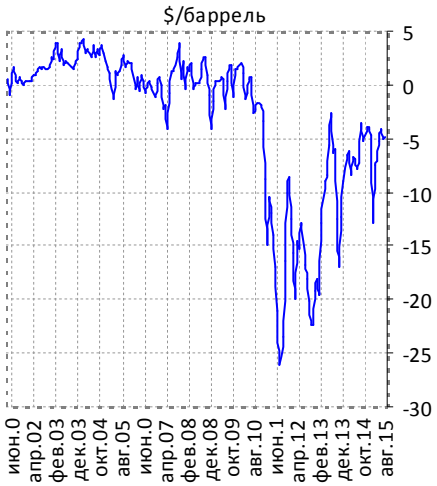
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



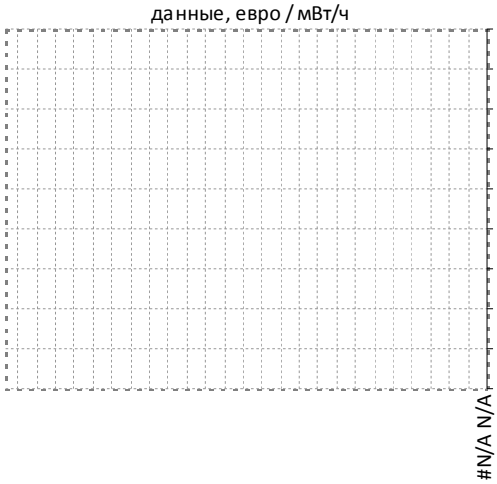
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



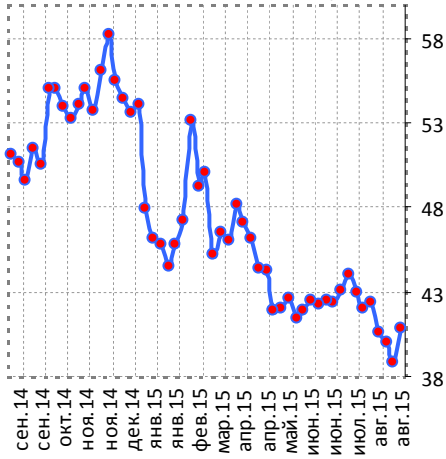
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

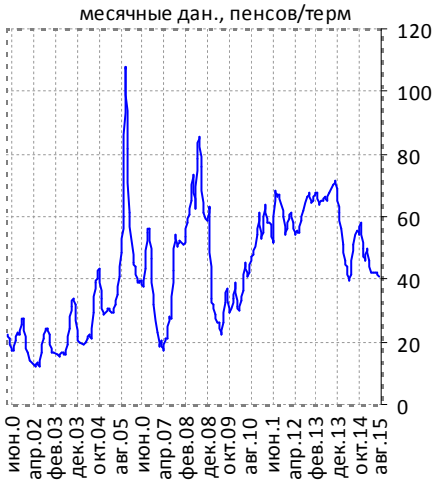
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



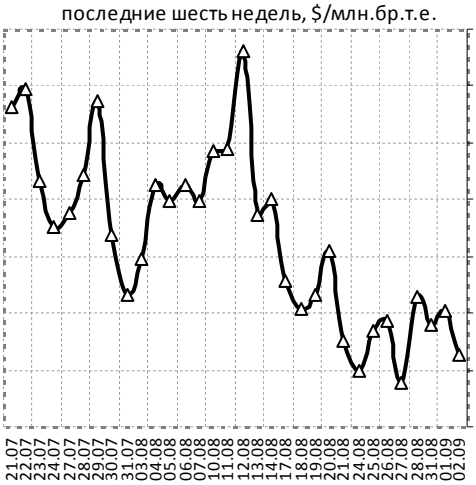
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



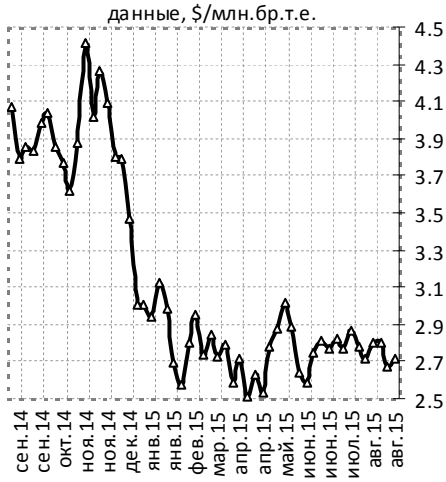
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



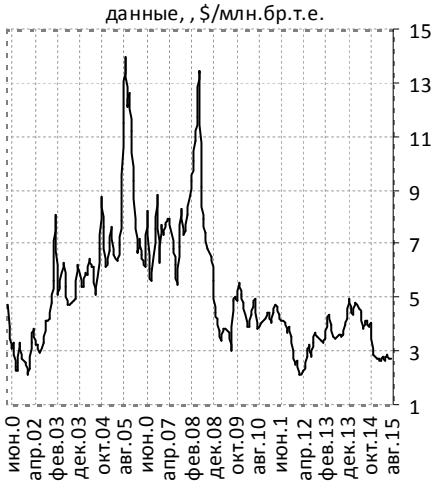
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



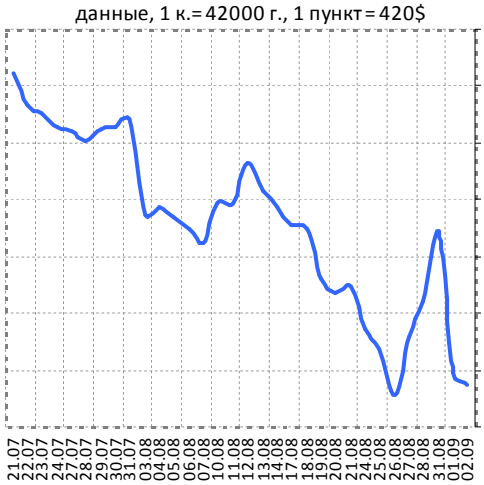
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



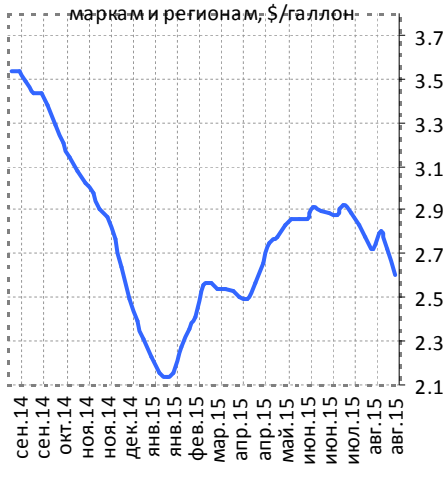
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



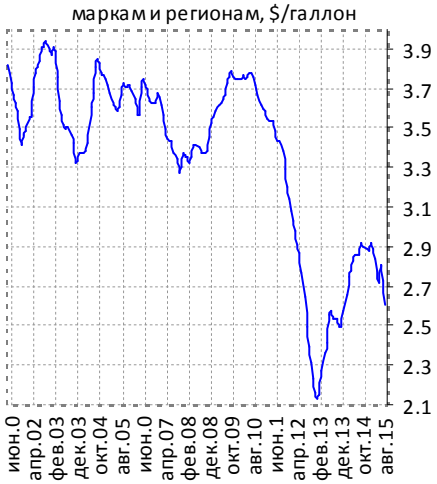
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



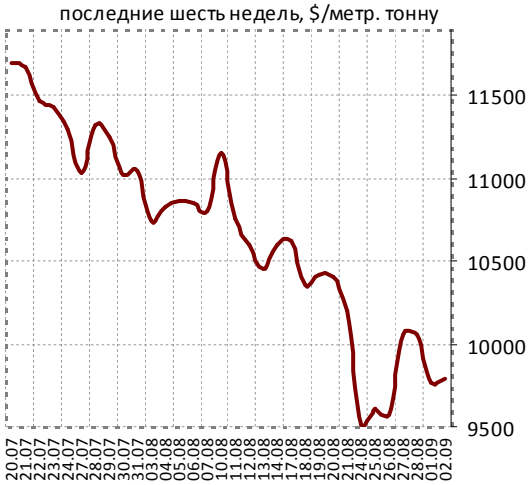
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



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

3.3. Рынок металлов

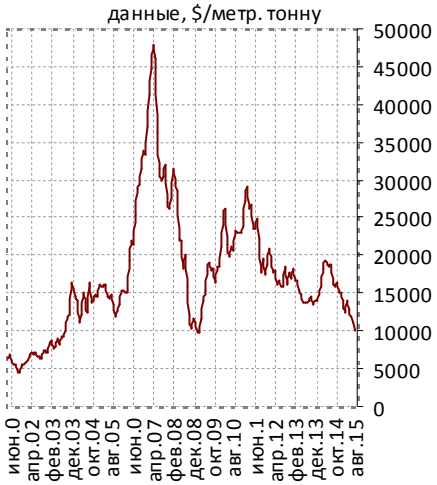
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



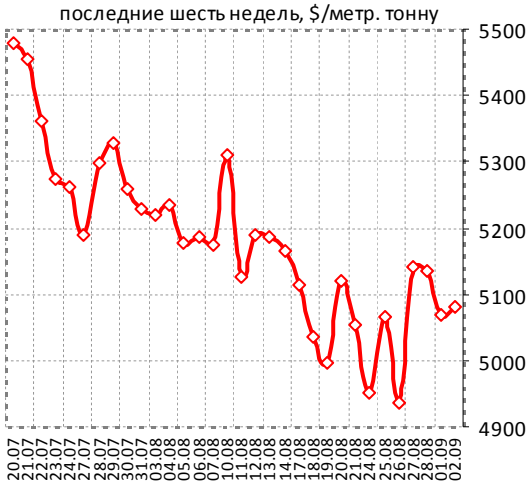
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



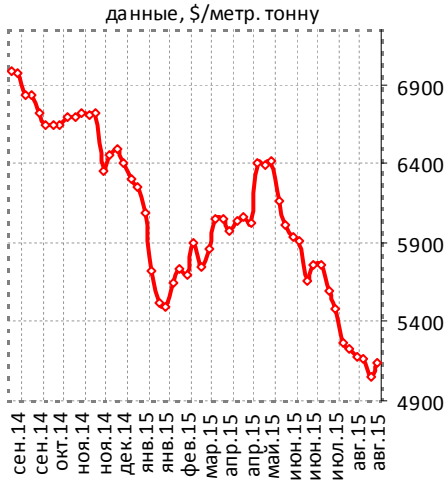
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



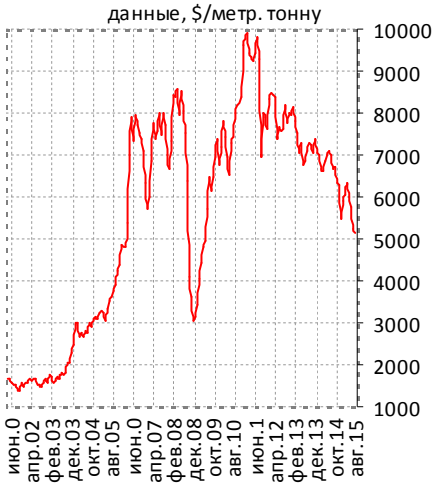
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



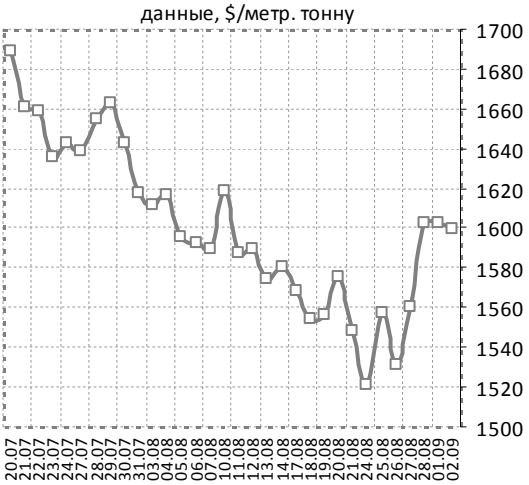
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



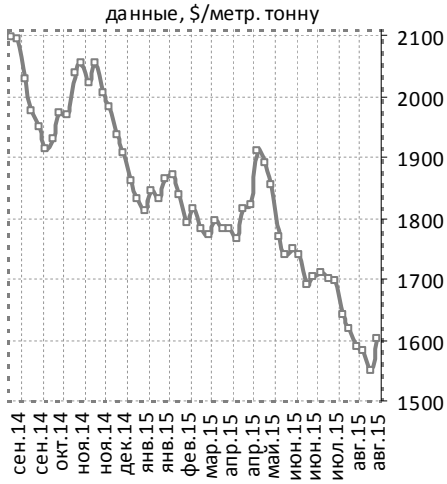
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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

Моисеева Людмила Филипповна, заместитель директора департамента аналитики
тел.: (495) 545-35-35 (доб. 131), e-mail: l.moiseeva@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.