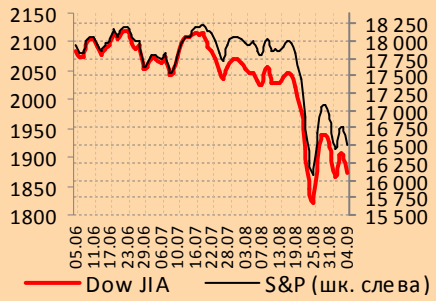
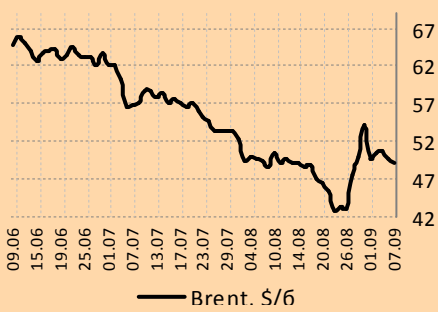
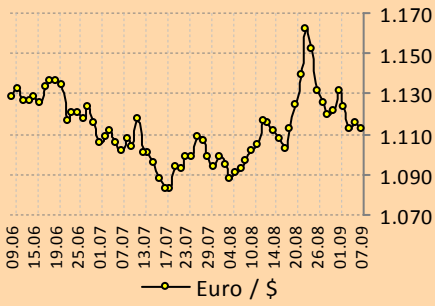
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

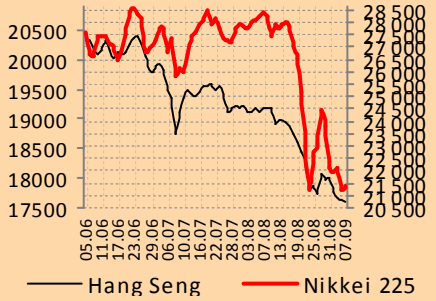
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

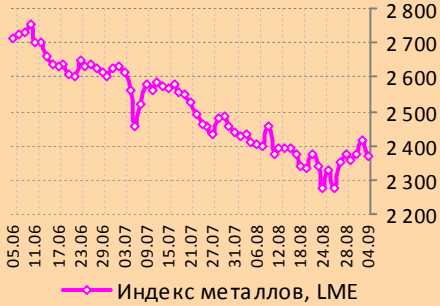
Ежедневный обзор

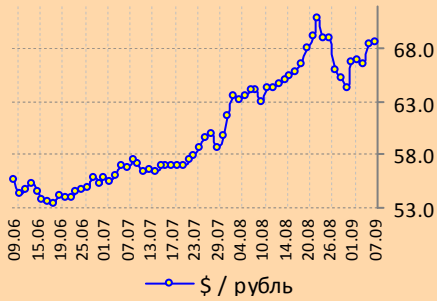












СОДЕРЖАНИЕ

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 сегодня отдыхают, в пятницу торги завершились снижением индексов, Nasdaq на 1,05, SandP на 1,53, Dow на 0,12 и 1,66%. Мировые площадки в пятницу жили ожиданием данных по рынку труда США, поскольку они могут сыграть определенную роль в принятии решения ФРС по ставкам (заседание начинается 16 сентября и продлится 2 дня). Вышли следующие данные: хорошие, уровень безработицы за месяц снизился с 5,3 до 5,1% (минимум с апреля 2008г., ожидалось 5,2%), средняя почасовая зарплата возросла на 0,3% (ожидался рост на 0,2%, предыдущее изменение 0,2%), а также не очень хорошие, занятость в несельскохозяйственном секторе возросла на 173 тыс. (ожидался рост на 218 тыс., предыдущее изменение 245 тыс., т.е. значительно ниже в сравнении с ожиданиями и фактическим ростом ранее), средняя продолжительность рабочей недели увеличилась с 34,5 до 34,6 часа (ожидалось 34,5), что тоже оценено рынками негативно. Главное, что при таких разноплановых характеристиках инвесторам трудно делать прогнозы относительно поведения ФРС на ближайшем заседании, а это, несомненно, привносит значительную нервозность на фондовые биржи.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, биржевые торги в пятницу закрылись снижение индексов (ММВБ на 0,73, РТС на 1,44%) под влиянием вечерней статистики из США (см. выше).

Что касается нашей макростатистики, то уровень безработицы составляет 5,3%, а задолженность по зарплате растет годовым темпом в 54%, как никакой другой показатель, хотя и равна, казалось бы, всего лишь 3,519 млрд. руб. Внешнеторговый оборот за 7 месяцев был равен 314,1 млрд. долл., что на 34% меньше аналогичного показателя прошлого года. Доходы от экспорта нефти снизились соответственно в 1,72 раза (до 56,229 млрд. долл.).

Стало известно, что бюджет 2016г. формируется, исходя из цены нефти в 50 долл. за барр., как и при формировании бюджета 2015г. (прогнозный курс рубля тогда был равен 61,5 руб. за долл.).

ЦБ в пятницу проводил аукцион по предоставлению кредитов в долларах, обеспеченных залогом прав требования по кредитам в долларах, максимальный объем средств 0,5 млрд. долл., срок 28 дней. Отметим, что ставки отсечения, сложившиеся по итогам таких кредитных аукционов за период с 26.01.2015 по 04.09.2015г. (последняя статистика ЦБ), непрерывно повышаясь, возросли с 0,9178 до 2,4543% или в 2,7 раза.

Европа. Фондовые торги в пятницу завершились снижением индексов (CAC на 2,81, DAX на 2,71, FTSE на 2,44%), основная причина та же – макростатистика по рынку труда США (см. выше), но и региональные данные не способствовали оптимизму. Так, в Германии промзаказы за месяц снизились на 1,4%, понижение ожидалось, но не более, чем на 0,6%, месяцем ранее был рост на 1,8%. Индекс потребительского доверия во Франции не изменился (составил 93 пункта, ожидался рост до 94 пунктов).

Относительно прошедшего заседания ЕЦБ отметим дополнительно, что рынки особенно реагировали на заверение регулятора при необходимости расширить и программу, и сроки QE, пока установлено, что программа будет действовать до сентября 2016 года. Кроме того, как и ожидалось, Банк снизил прогноз роста ВВП еврозоны на текущий год с 1,5 до 1,4%, прогноз по инфляции снижен с 0,3 до 0,1%. Глава ЕЦБ отметил, что таргетирование курса евро не входит в число задач Банка.

Азия. Биржа Шанхая в пятницу отдыхала (продолжалось празднование 70й годовщины поражения Японии во Второй мировой войне). По итогам торгов остальные азиатские индексы снизились, Nikkei на 2,08, Hang Seng на 0,38, Kospi на 1,54%. В Гонконге резко снизился индекс деловой активности в производственном секторе, за месяц с 48,2 до 44,4 пункта.

На Восточном экономическим форуме во Владивостоке со стороны Японии прозвучало предложение России использовать в расчетах японскую иену вместо американского доллара для минимизации деловых рисков.

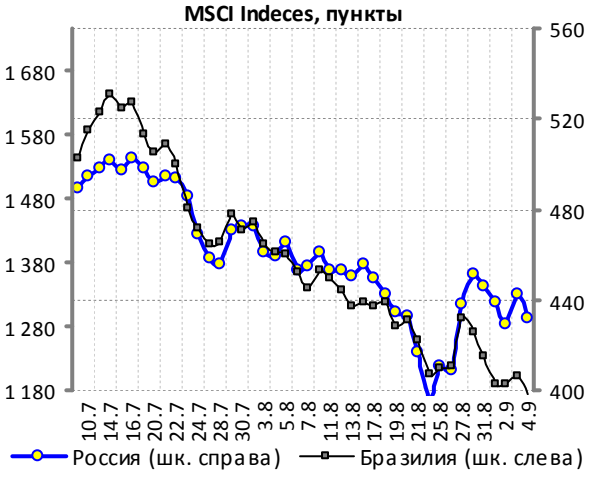
Принято решение об отмене эвакуации города Нараха, расположенног в 20-километровой зоне АЭС Фукусима. Ранее были приняты решения до конца 2016 финансового года (завершается 31 марта 2017 г.) отменить режим эвакуации в отношении большинства районов этой префектуры. К данному времени в Японии жители 7 населенных пунктов эвакуированы после землетрясения и цунами, которые привели к трагедии на атомной станции Фукусима и последующему радиоактивному заражению прилегающих территорий.

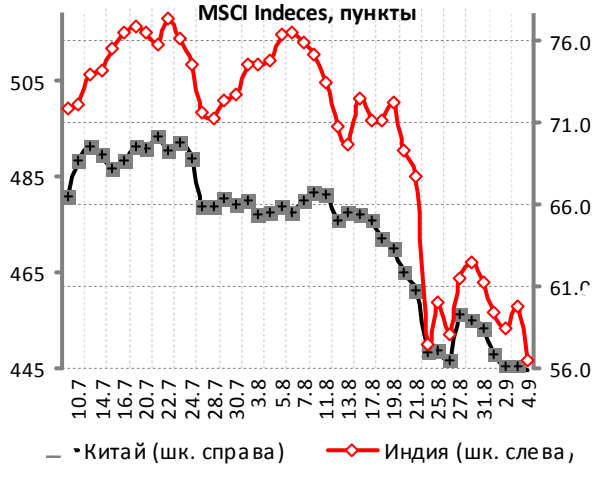
Золото. Золото утром пятницы продавалось по 1123,80, к 14.00 по 1122,30, на закрытии по 1121,40, утром сегодня по 1122,50 долл. за унцию.

Нефть. Brent и Light утром пятницы шли по 50,20 и 46,19, к 14.00 по 50,56 и 46,51, на закрытии по 49,61 и 46,05, утром сегодня по 49,12 и 45,63 долл. за барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее значимой статистики ждем индикатор уверенности инвесторов в еврозоне (11.30). Внешний фон к открытию российских бирж скорее негативный (хотя фьючерсы на биржевые индексы США растут, но Азия преимущественно снижается, нефть тоже), но все же возможно положительное открытие с использованием снизившихся накануне цен акций, дальнейшее изменение динамики зависит от хода торгов на европейских и азиатских биржах.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 07.09.2015

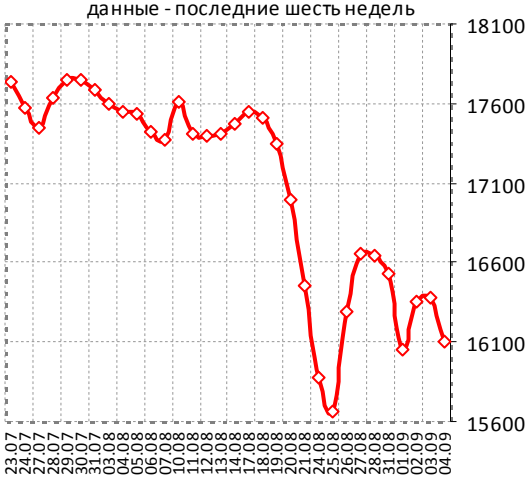




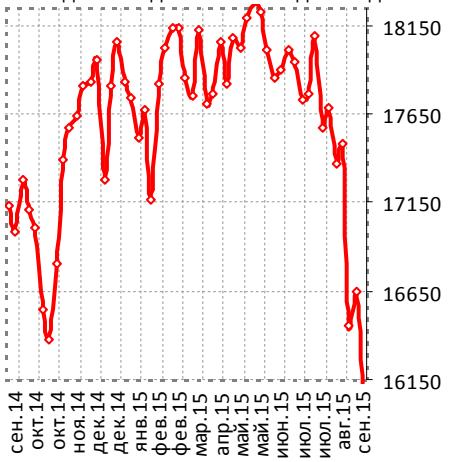
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

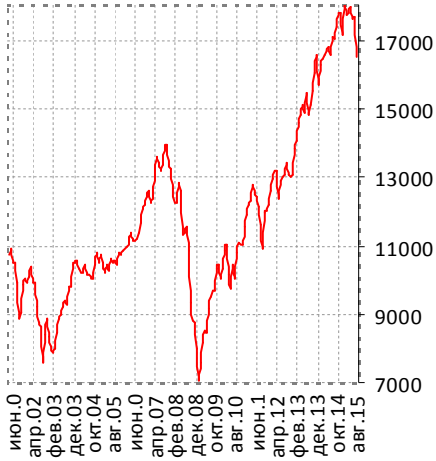
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



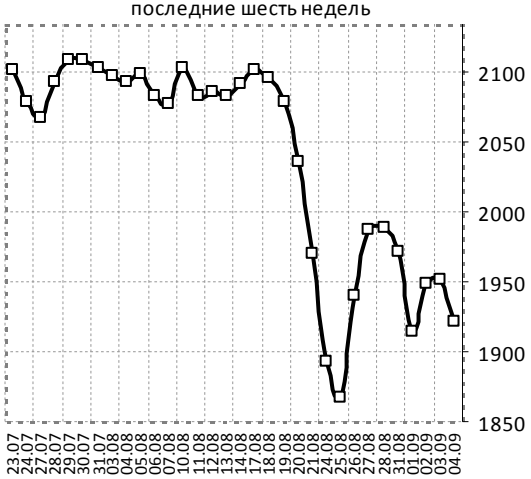
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



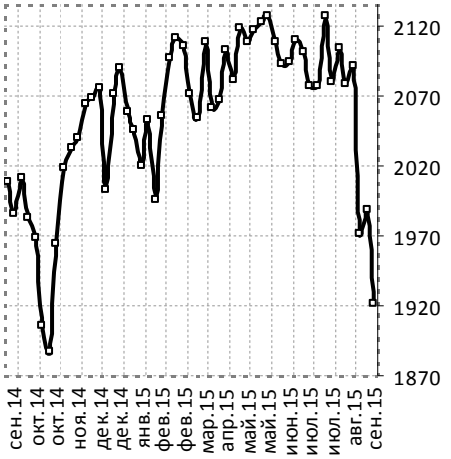
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



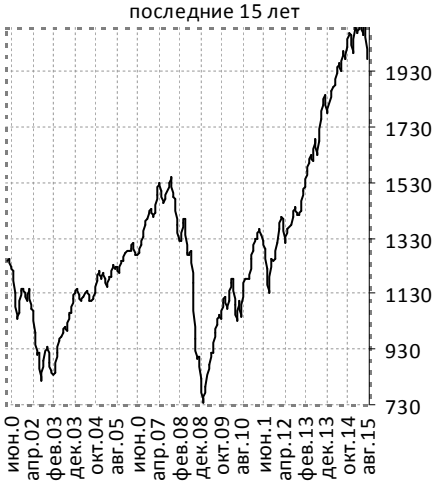
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



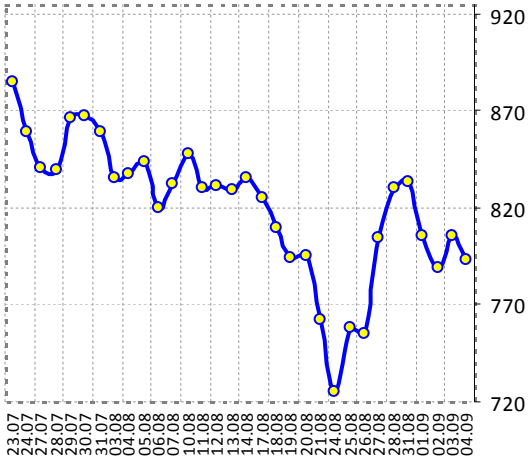
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



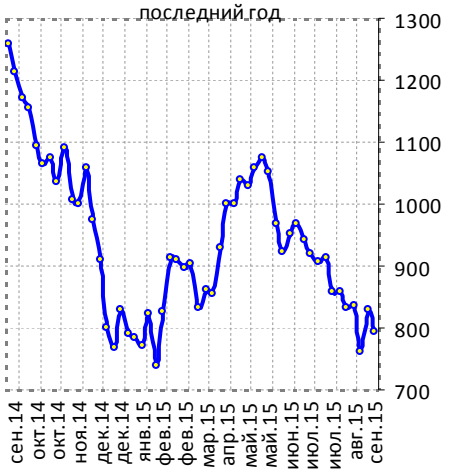
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



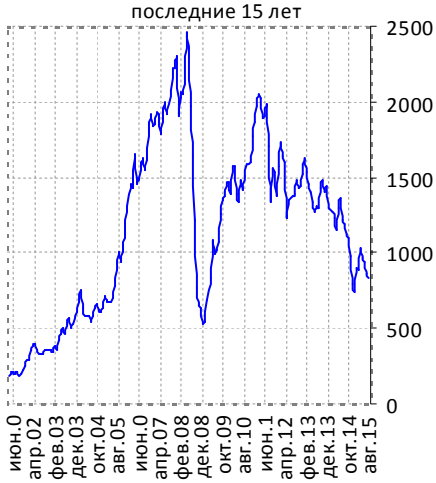
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



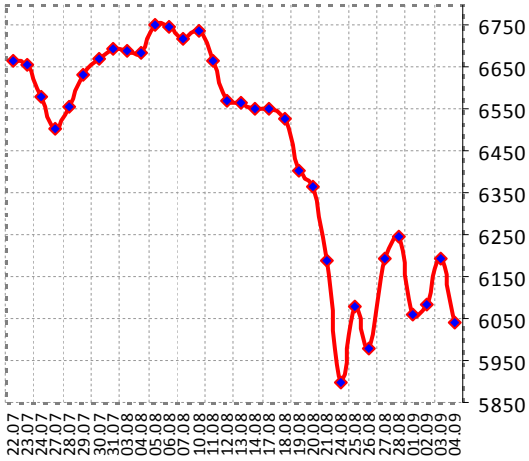
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



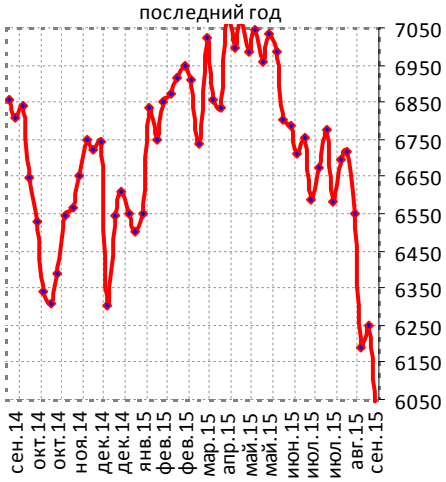
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

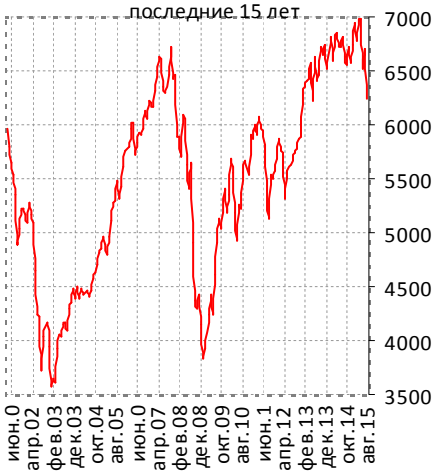
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



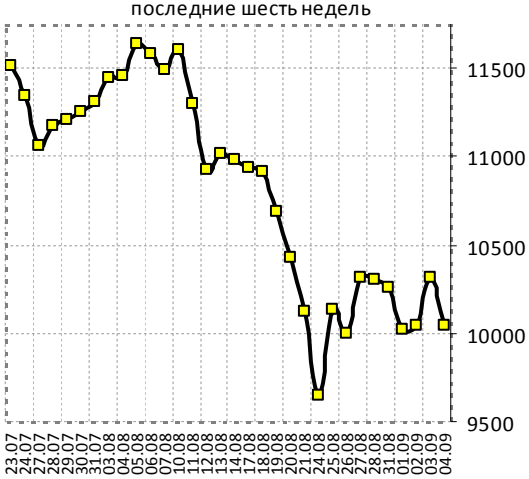
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



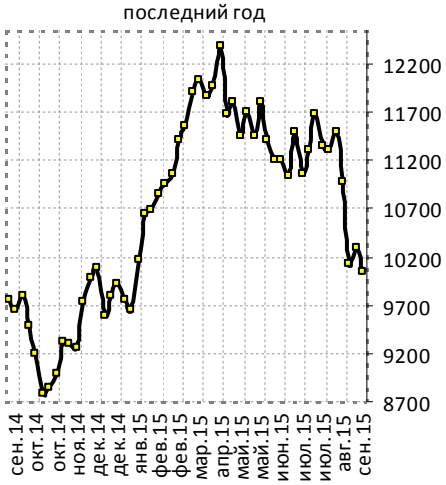
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



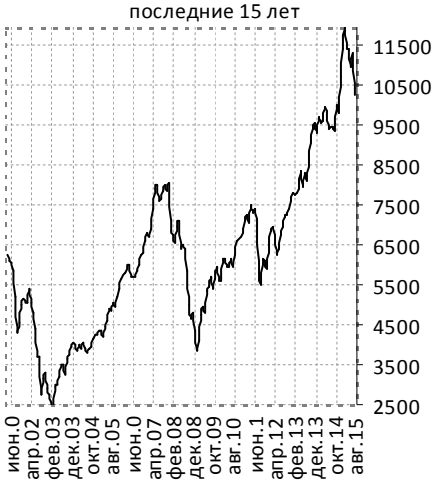
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



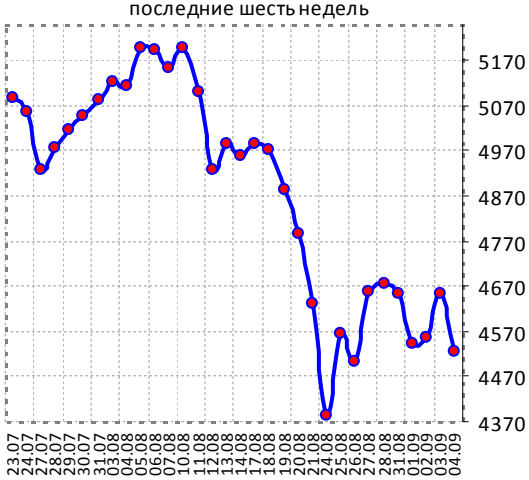
DAX Index: недельные данные - последний год



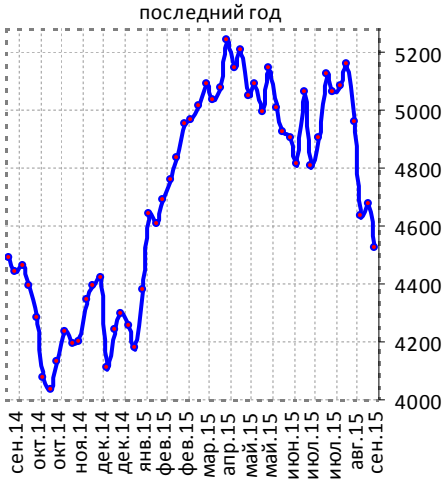
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



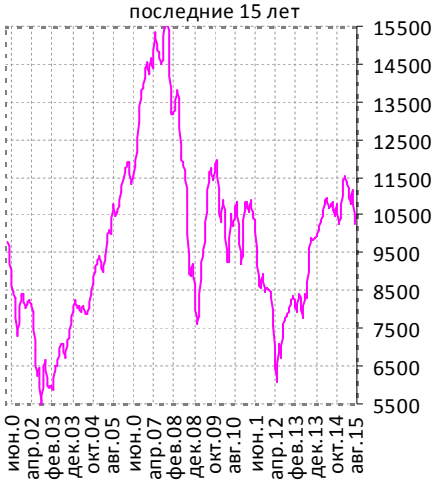
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

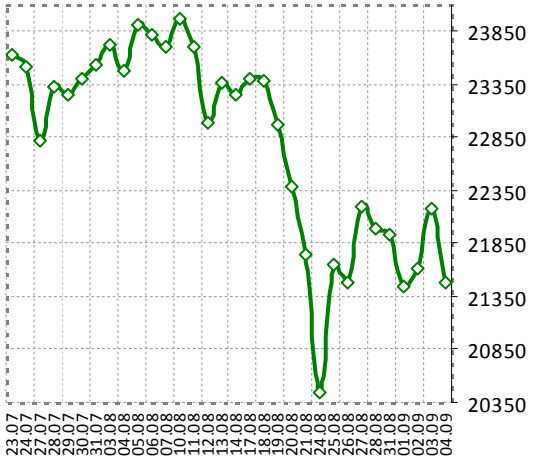


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

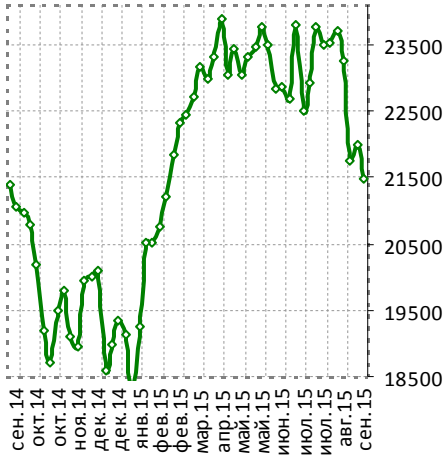


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



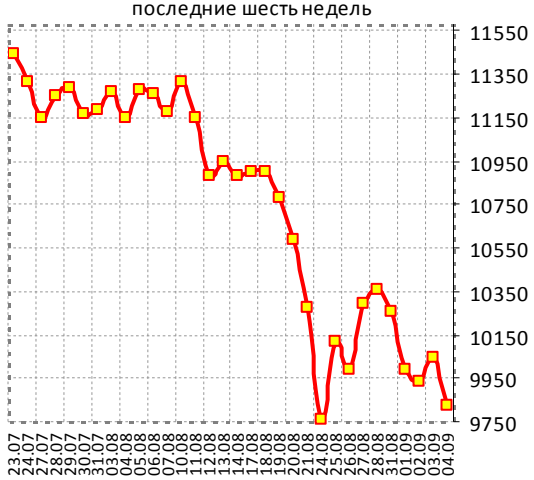
MIB Index: недельные данные - последний год



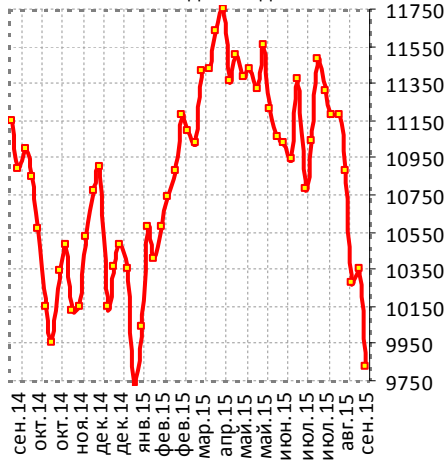
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



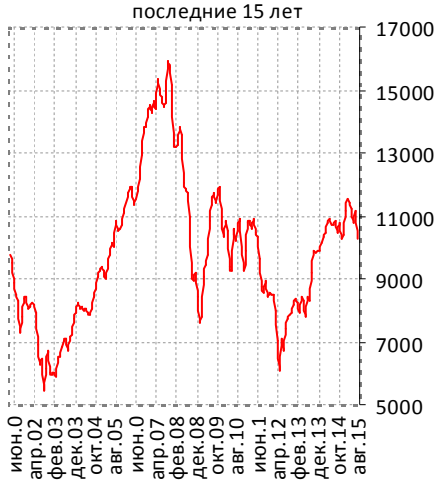
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



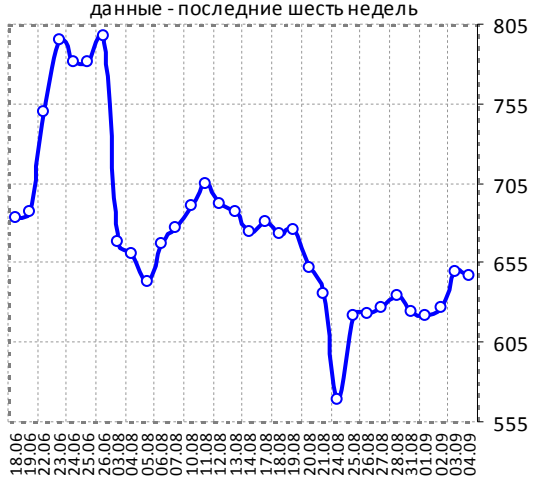
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



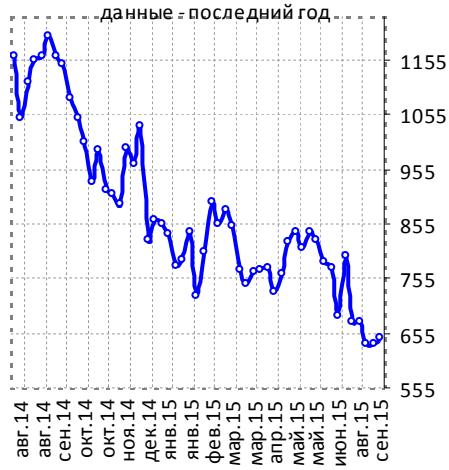
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



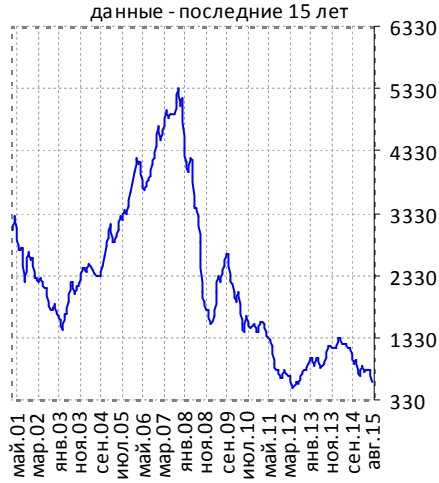
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



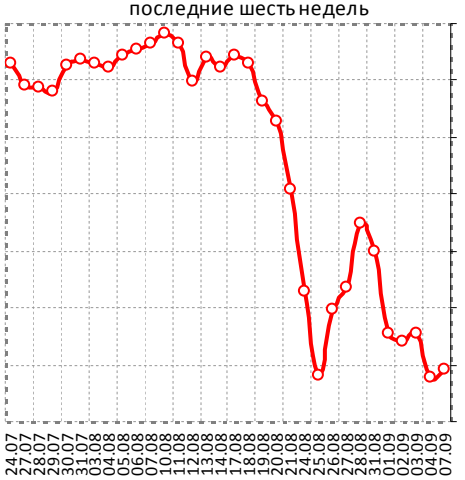
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



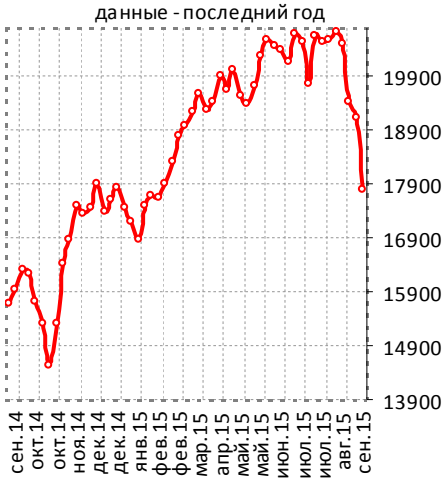
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

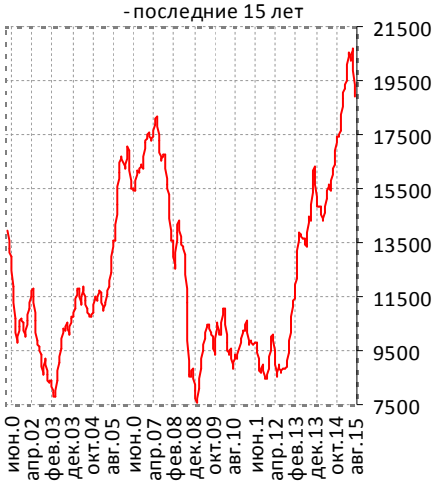
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



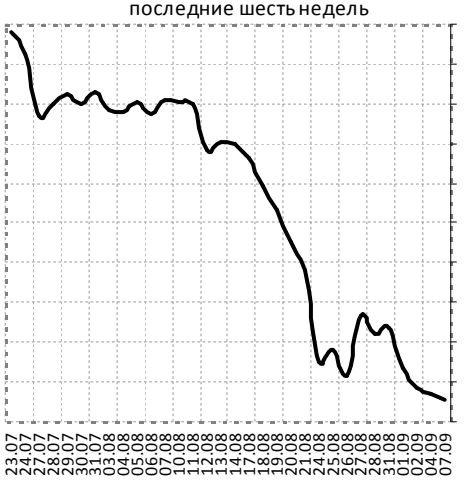
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



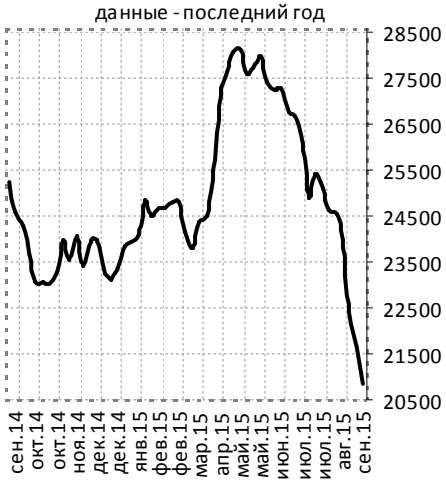
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



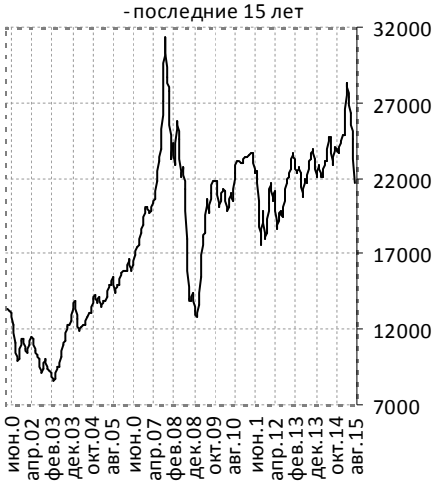
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



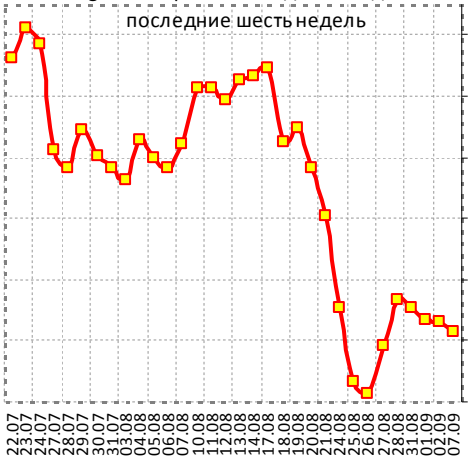
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



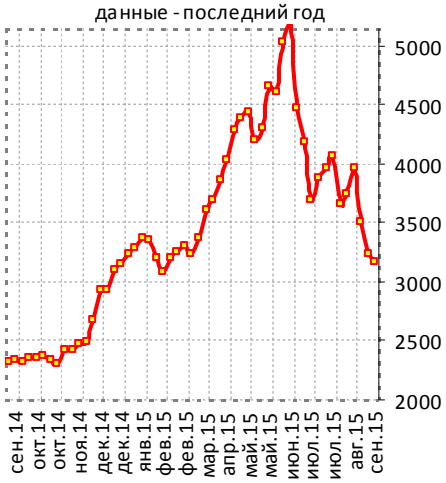
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



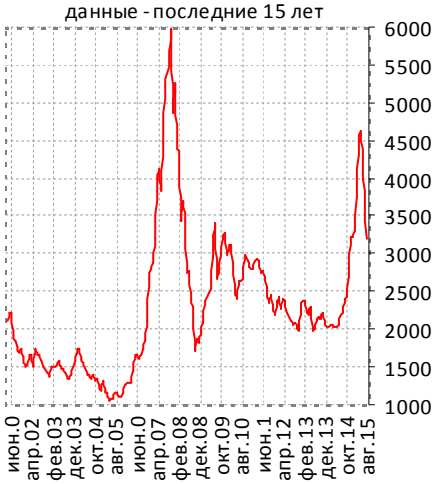
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



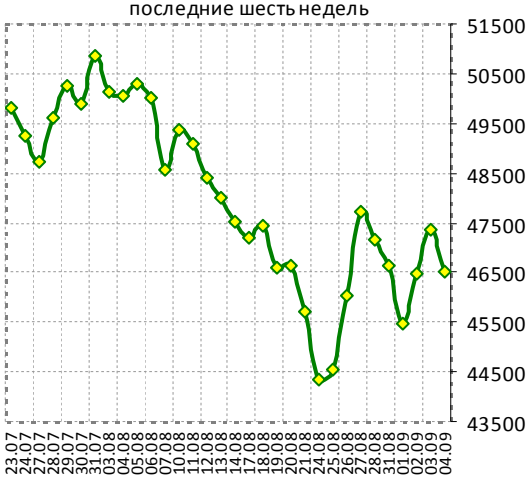
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



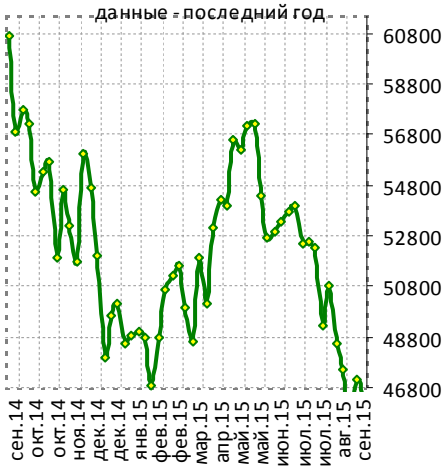
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

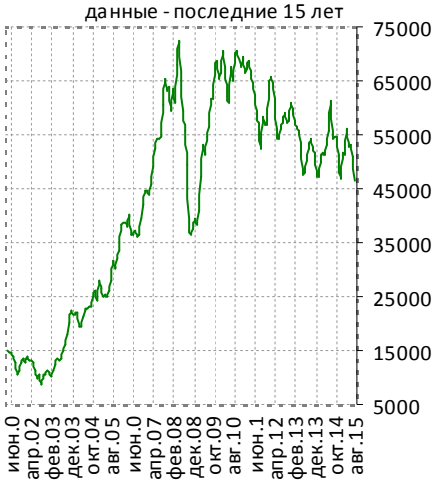
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



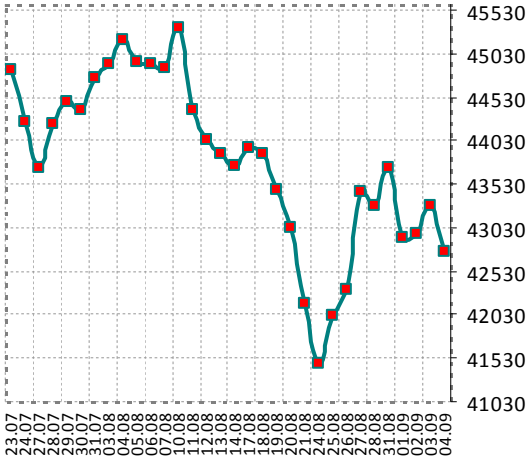
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



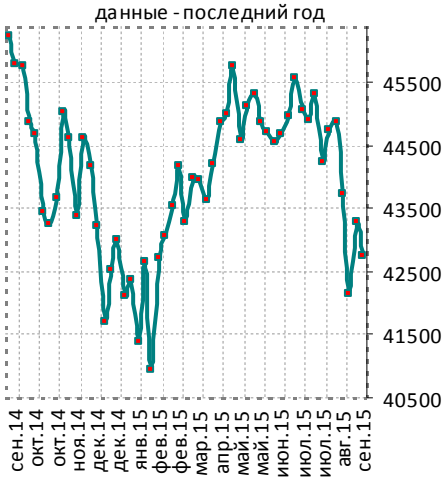
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



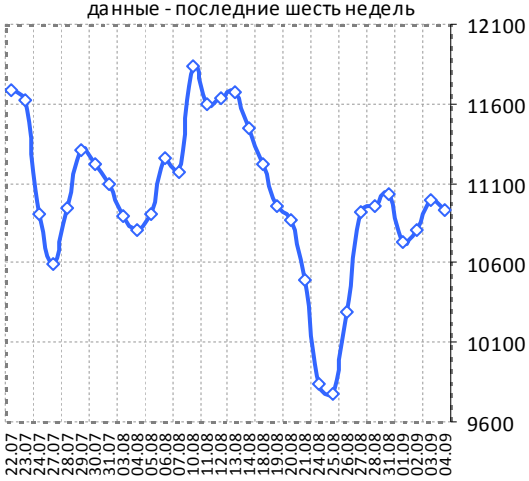
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



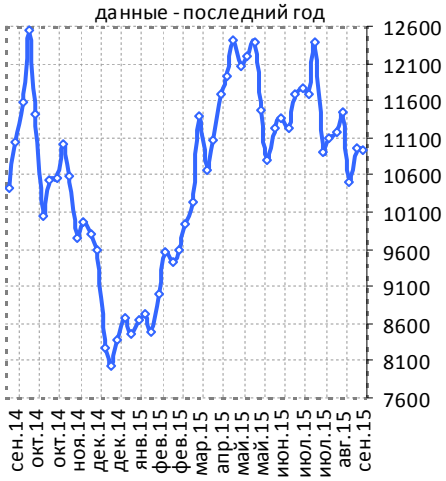
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



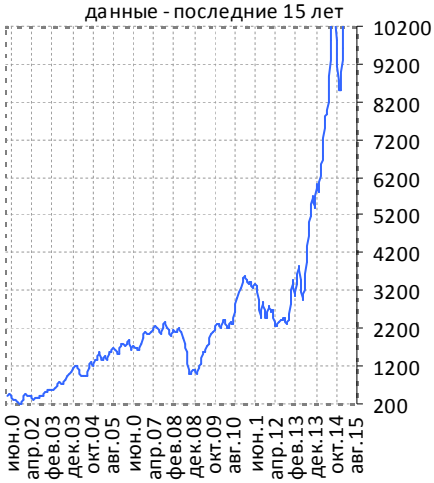
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

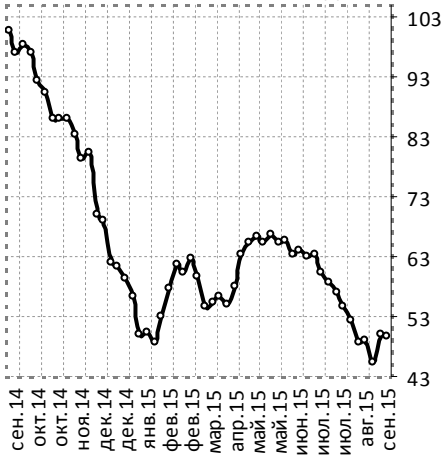
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

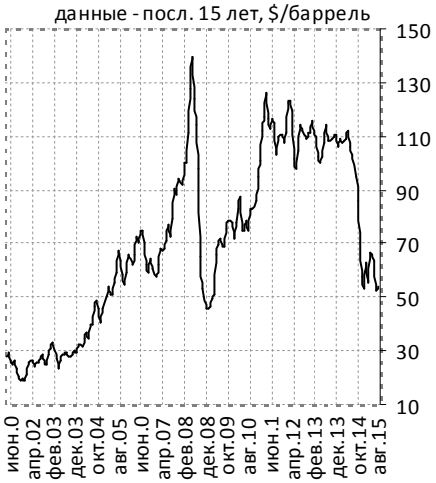
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



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



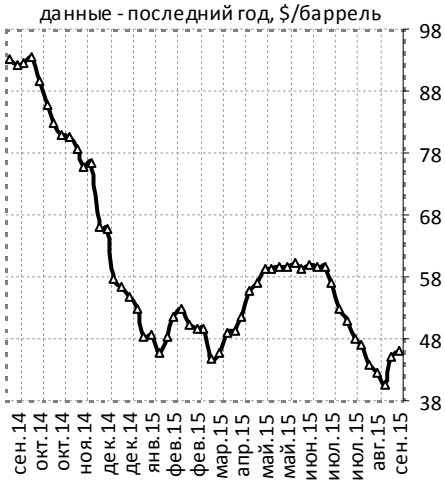
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



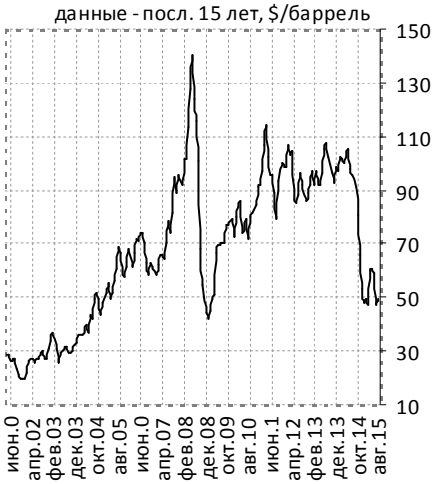
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



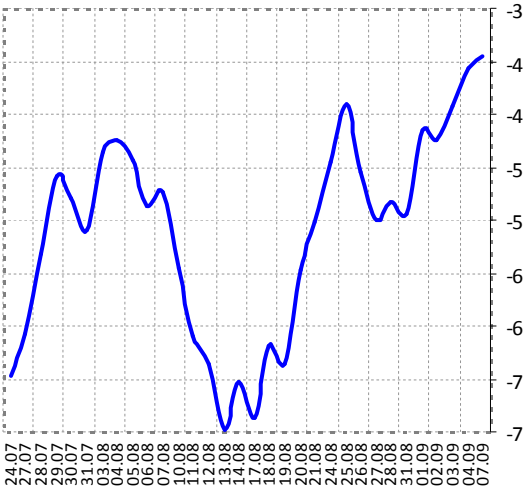
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



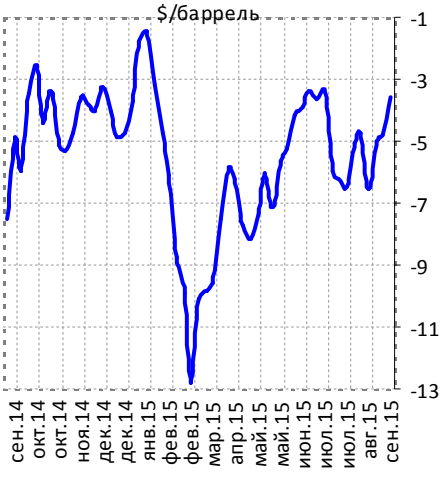
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



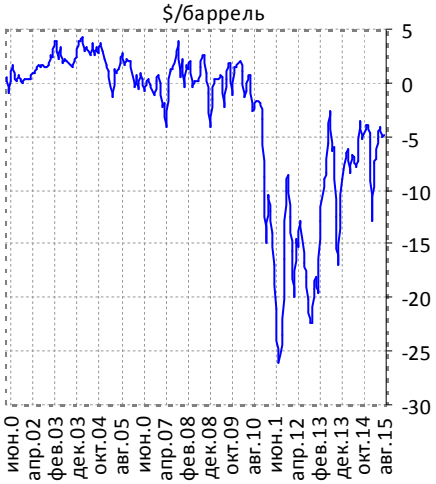
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



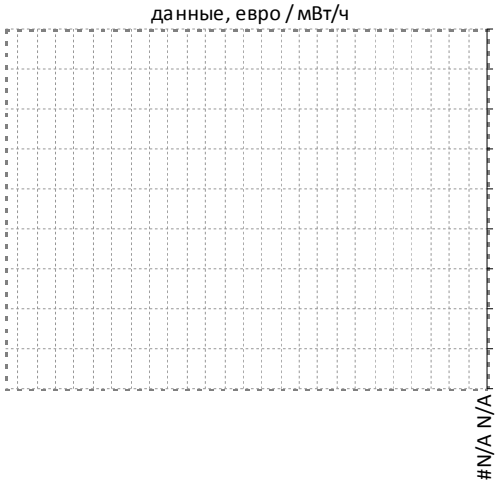
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



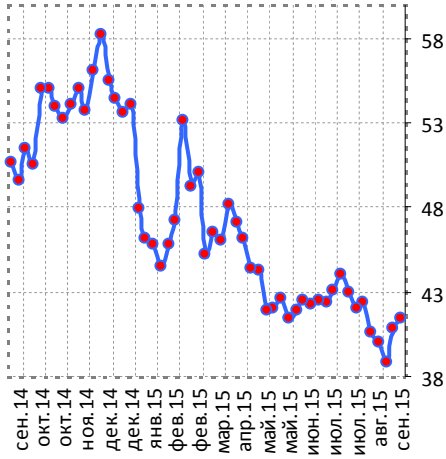
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

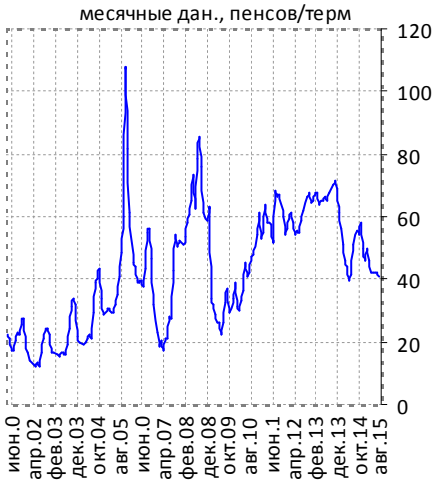
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



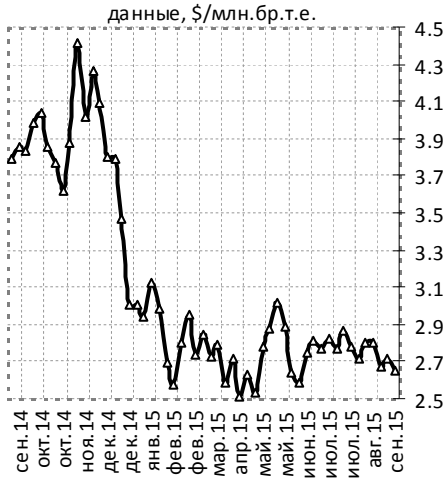
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



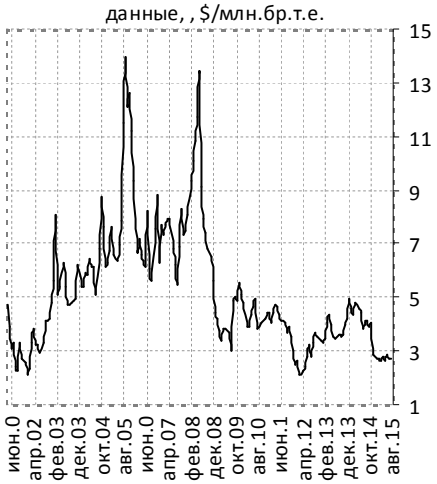
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



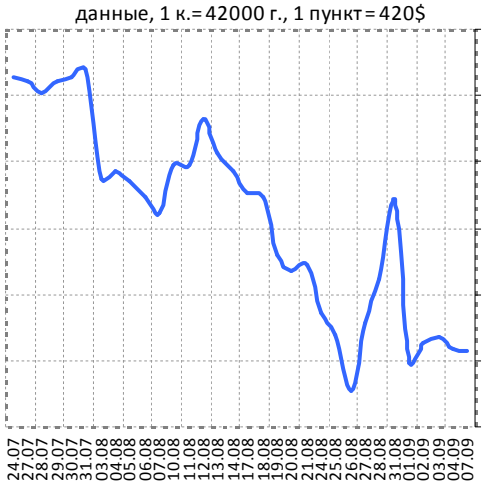
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



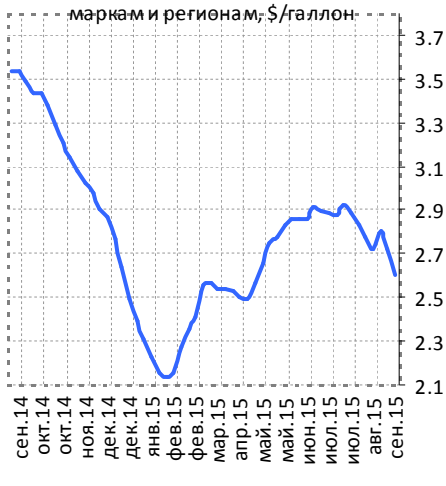
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



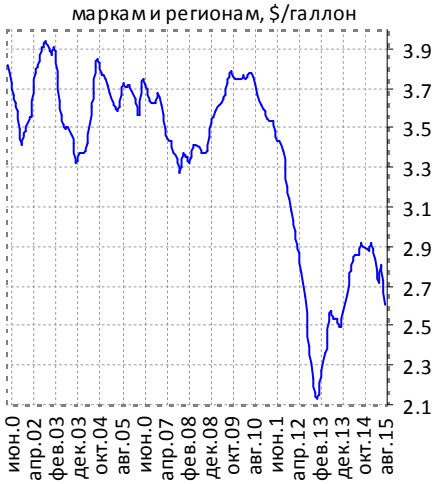
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



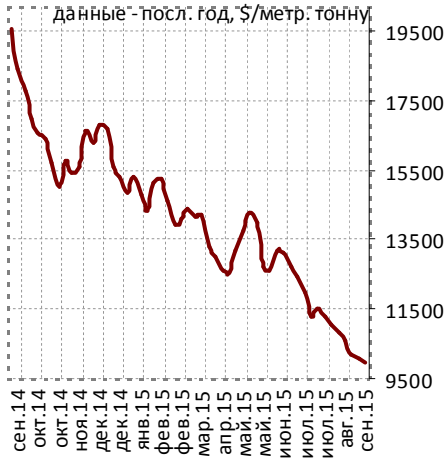
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

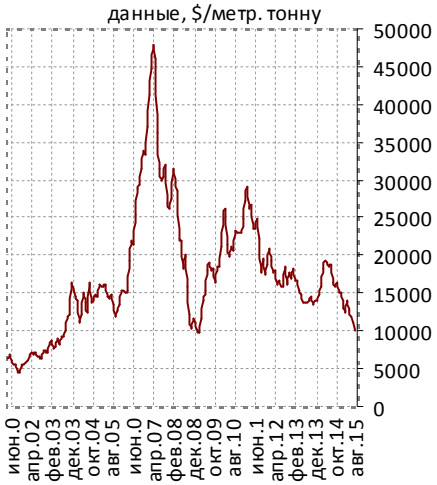
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



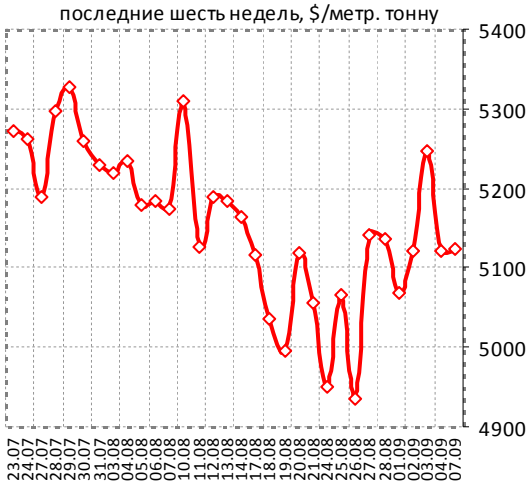
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



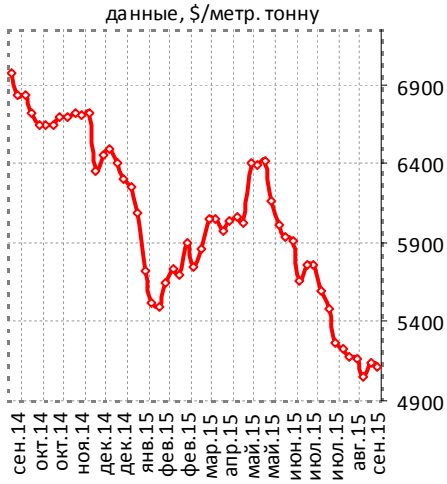
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



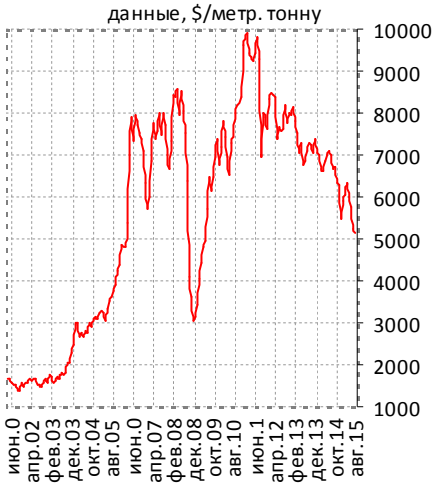
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



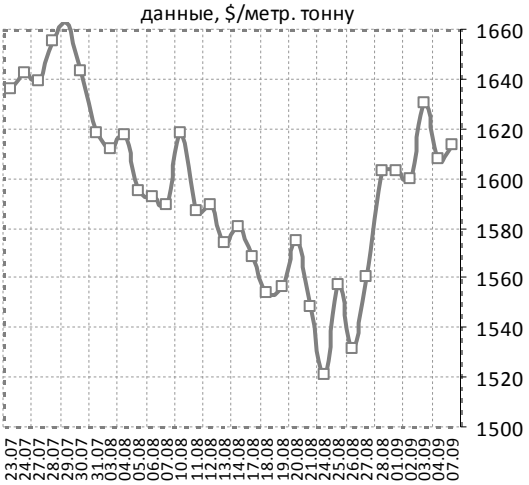
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



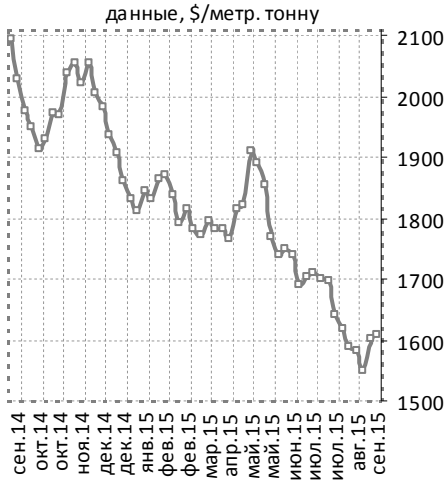
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



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.