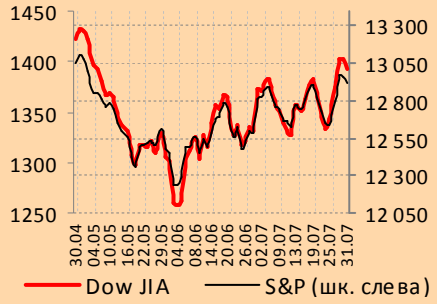
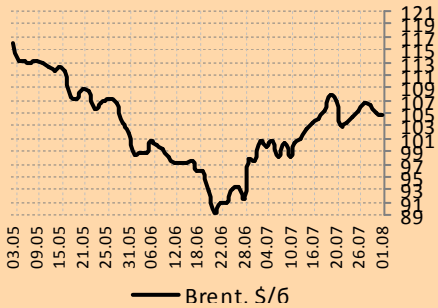
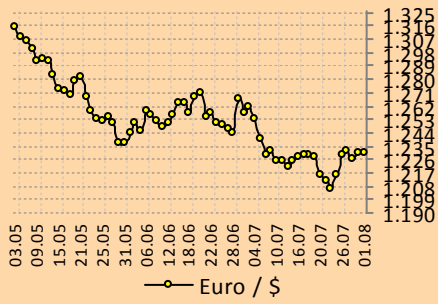
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

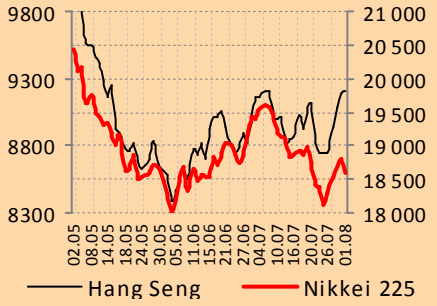
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

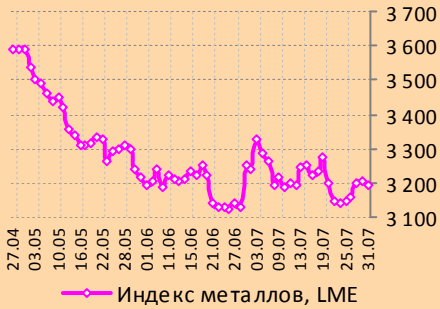
Ежедневный обзор

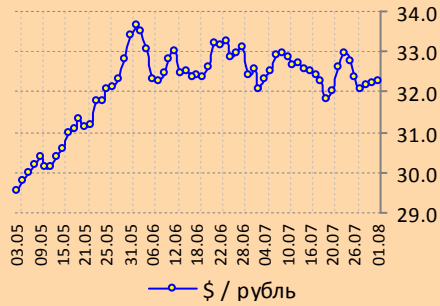












СОДЕРЖАНИЕ

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. Инвесторы сыграли на опережение, вопреки традиционному росту накануне решений ФРС, индексы показали небольшое снижение, Dow Jones =-0,49, S&P 500 =-0,43, NASDAQ =-0,21%.

Продолжается публикация корпоративной отчетности. Так, Chrysler, контролируемый итальянской компанией Fiat, сообщил о квартальной прибыли после убытка годом ранее, продажи возросли на 23%. Появилась новая макростатистика. Например, личные доходы увеличились на 0,5% в месячном исчислении (ожидалось повышение на 0,4%), личные расходы за месяц не изменились. Стоимость рабочей силы выросла во втором квартале на 0,5%, как и ожидалось, предыдущее изменение +0,4%.

Россия. Биржевые индексы снизились – инвесторы психологически не смогли удержаться от фиксации прибыли ввиду неопределенности ожиданий от заседаний центробанков, индекс ММВБ =-1,51, РТС =-1,48%.

Банки сегодня возвращают в ЦБ 1026 млрд. руб. прямого РЕПО, взятого 24 июля под 5,27%. Поэтому во вторник на аукционе прямого РЕПО банкам на 1 день было предложено 520 млрд. руб. (взяли 507 под 5,29%, ставка рынка 5,84%) и на 7 дней 1300 млрд. руб. (взяли 1098 млрд. под 5,27%, ставка рынка 6,25%). Видим, что ставки ЦБ не только ниже рынка, но и против логики: кредит на больший срок дается под меньший процент.

ЦБ РФ в течение двух дней накануне продал на внутреннем рынке в рамках интервенций (для поддержания рубля) валюту в эквиваленте 30 и 400 млн. руб. соответственно. Минфин продолжит изъятие рублевой ликвидности и проведет аукцион по размещению ОФЗ-ПД в объеме 50 млрд. руб. с интервалом доходности от 7,63 до 7,92%, погашение в 2017 и 2022 гг.

Европа. По ЕС появилась новая статистика. Так, инфляция в еврозоне осталась на прежнем уровне, равном 2,4%, как и ожидалось. То же с безработицей, она составляет 11,2%. Безработица в Германии также не изменилась (как, кстати, и прогнозировалось) по сравнению с предыдущим месяцем и составила 6,8%, в Италии возросла с 10,6 до 10,8% (ожидалось снижение до 10,2%). Чистая прибыль Deutsche Bank во втором квартале относительно аналогичного периода прошлого года сократилась в 1,8 раза в результате роста общих и административных издержек. Чистая прибыль UBS, доступная для распределения среди акционеров, за первое полугодие снизилась в 2,2 раза по сравнению с прошлым годом. Тем не менее, несмотря на неоднозначный характер статистики, котировки в ходе сессии преимущественно росли, потому что ожидания действий ЕЦБ (заседание в четверг) считаются более реальными, чем ФРС. Исключением стала Великобритания, страновые события которой оказали негативное влияние на котировки акций. Дело в том, что Moody's подтвердило негативный прогноз кредитного рейтинга Великобритании, понизив при этом прогнозы по ВВП страны на 2012 и 2013 годы, а также сыграла роль неудовлетворительная отчетность BP. К концу торгов начались продажи, Итак, FTSE 100 =-1,02, DAX =-0,03, CAC 40 =-0,87%.

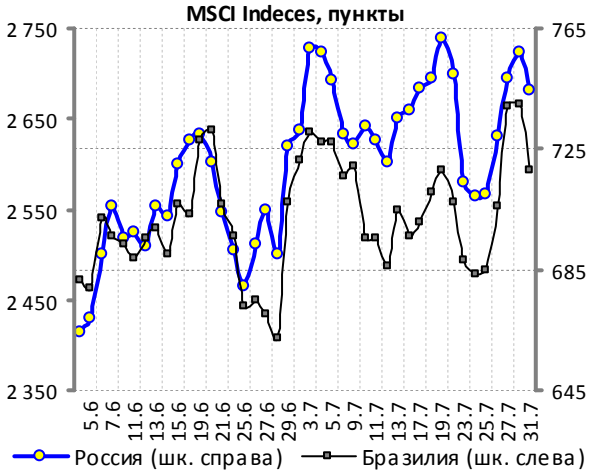
Азия. Данные по закупкам менеджеров в производственной сфере Японии оказались ниже прогнозов, но зато более 50% компаний, входящих в расчетную базу индекса Nikkei, к настоящему времени показали квартальные результаты выше ожиданий рынка, а уровень безработицы снизился за месяц с 4,4 до 4,3%. С учетом хорошей отчетности и ослабления иены по итогам сегодняшних торгов индекс Nikkei повысился на 0,69%. При этом другие биржевые индексы Азии показали как рост (Kospi +2,07, Hang Seng +1,08%), так и снижение (SSE -0,30%). Китай объявил об увеличении расходов на строительство железных дорог и мостов, а также призвал частные компании инвестировать в коммунальное хозяйство, телекоммуникационные отрасли и здравоохранение (список проектов, в реализации которых могут принять участие частные компании, будет опубликован дополнительно). Кроме того, идет активное строительство линий метро, к 2015 г. их протяженность в 28 городах достигнет 2500 км. Сегодня утром появилась информация о снижении с 49,50 до 49,3 пункта индекса деловой активности в промышленности.

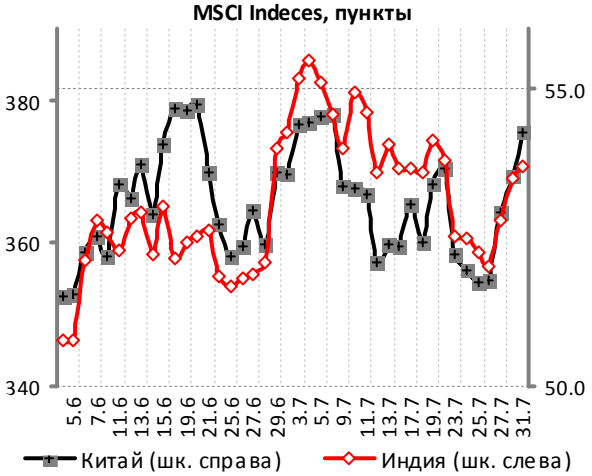
Золото. Укрепление доллара привело к снижению цен драгметаллов, утром вторника золото торговалось по 1623,8 долл. за унцию, к 14.00 по 1622,7 долл., утром сегодня фьючерсы на золото = 1617,26, серебро = 27,9, платину = 1413,7, палладий = 589,7 долл./унция.

Нефть. Сокращении добычи ОПЕК способствовало бы росту цен, но укрепление доллара не дает ценам развернуться, утром вторника Brent и Light шли по 106,29 и 90,0 долл. за барр., к 14.00 по 106,21 и 90,02 долл., утром в среду по 104,7 и 87,86 долл./барр.

События, статистика, прогноз. Несомненно, основным событием сегодня остается заседание ФРС, которое продолжит работу. Результаты заседания станут известны только после завершения торгов в Европе в 22.15 мск. Кроме того, ждем данные по США по рынку труда (16.15) и запасам нефти (18.30). Внешний фон неоднозначный, фьючерсы на американские индексы торгуются преимущественно в минусе, Азия тоже, нефть не растет. Наши биржи могут попытаться использовать снизившиеся цены акций, если внешнее окружение не сыграет на опережение решений ФРС.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 01.08.2012.

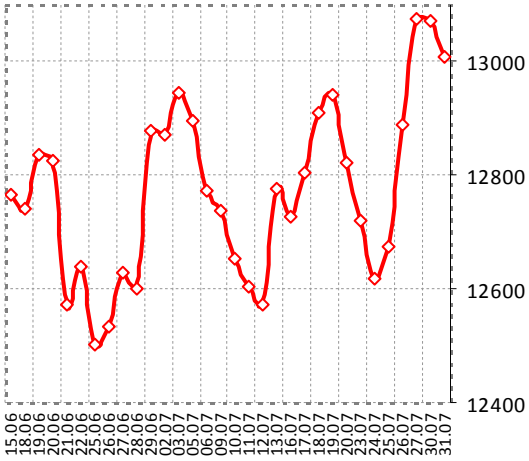




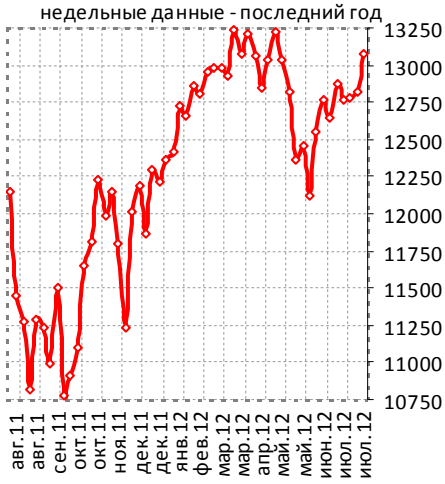
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

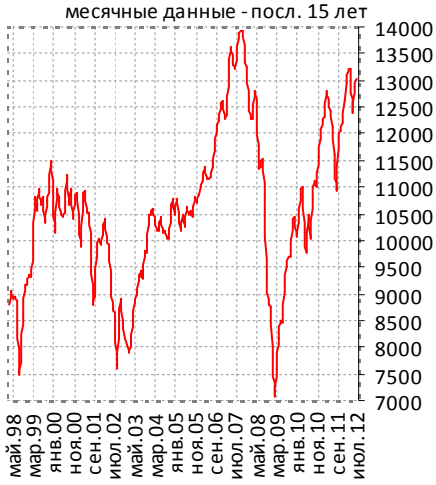
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



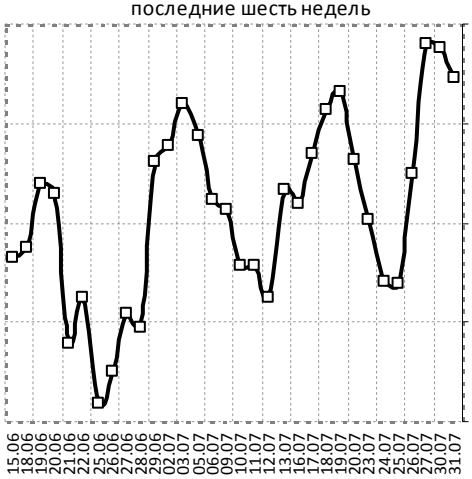
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



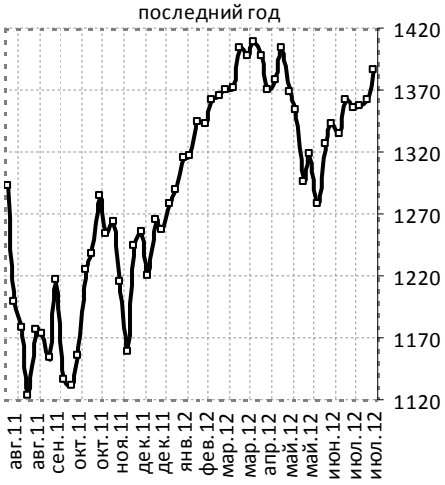
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



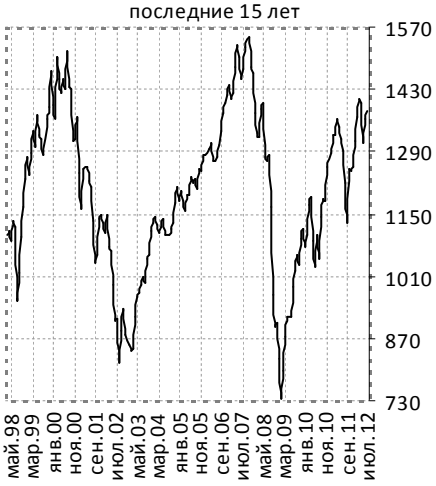
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



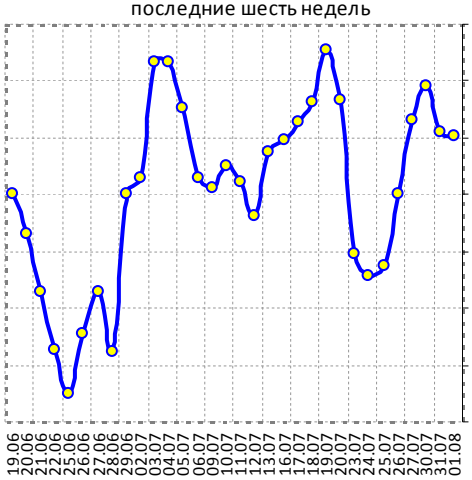
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



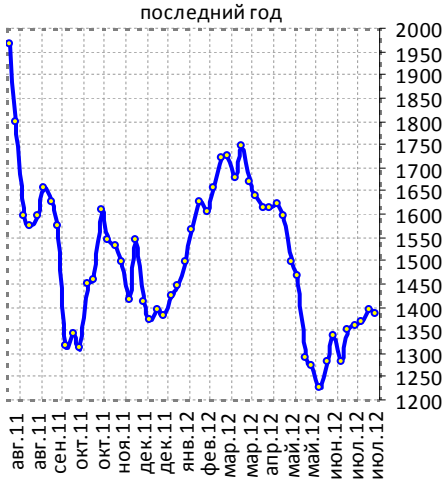
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



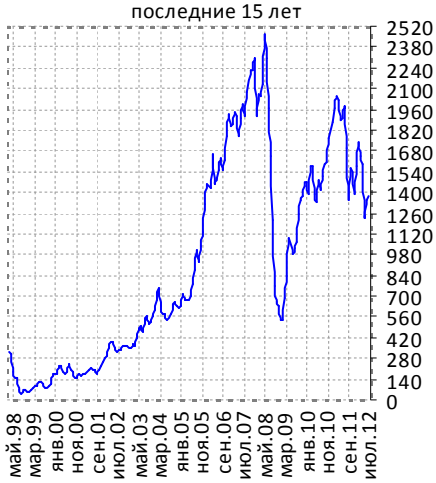
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



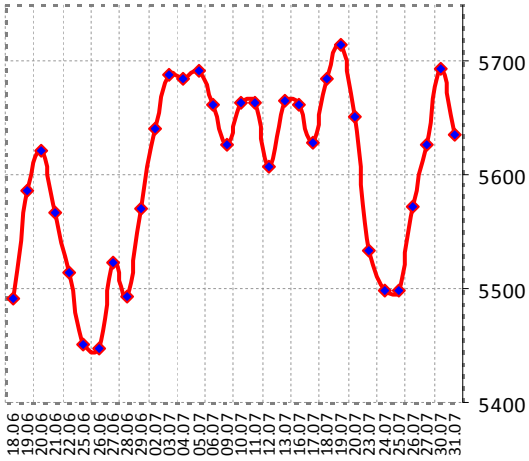
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



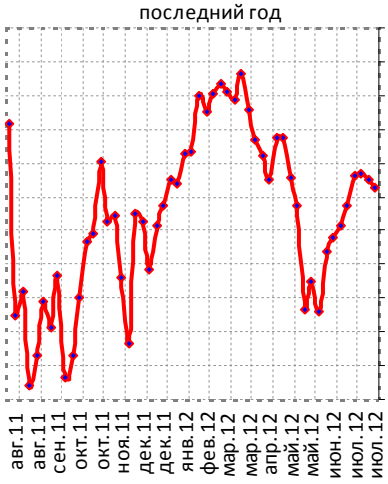
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

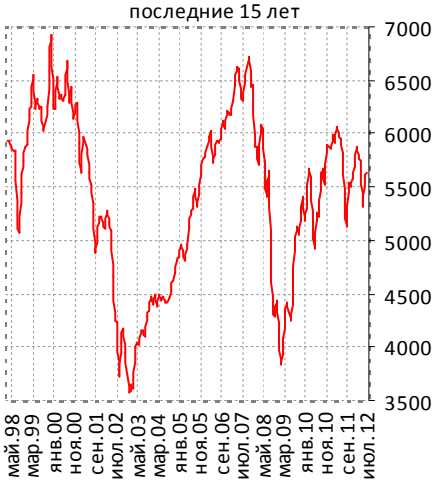
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



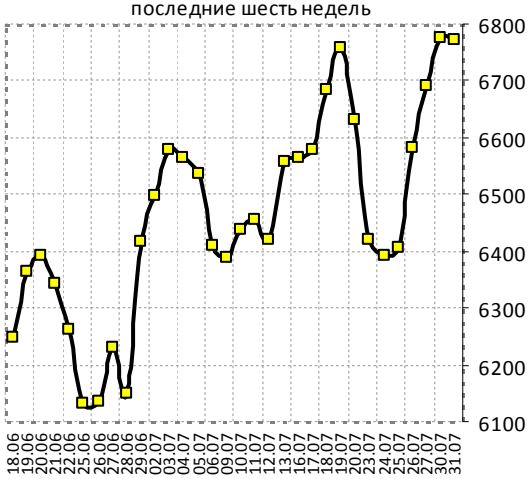
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



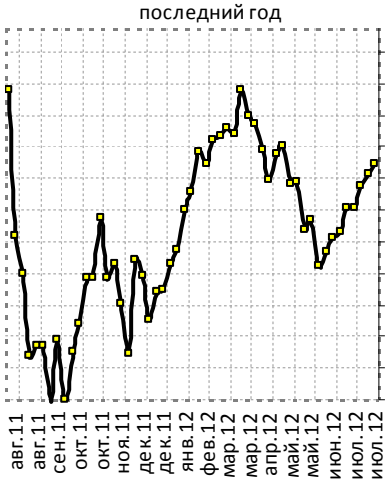
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



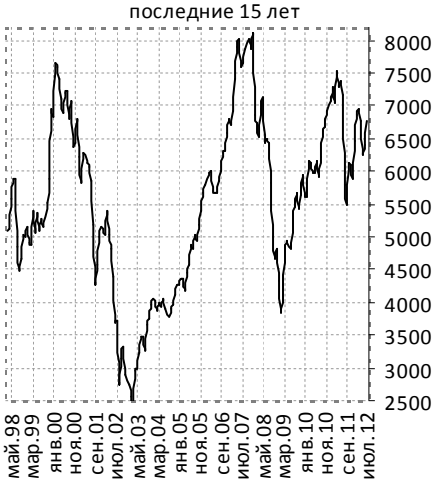
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



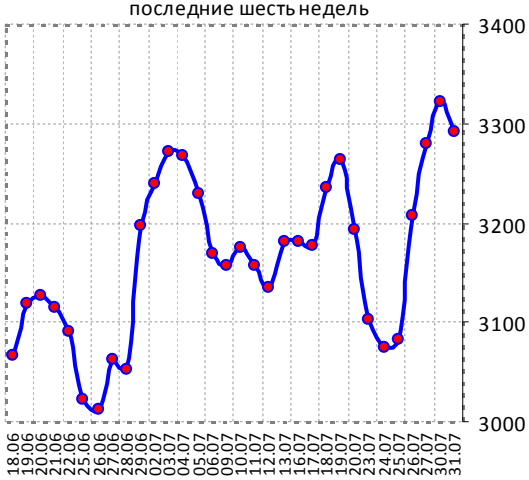
DAX Index: недельные данные - последний год



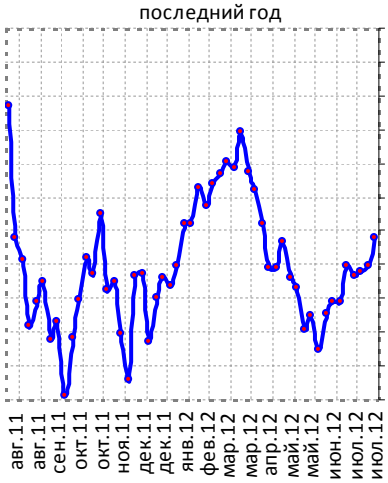
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



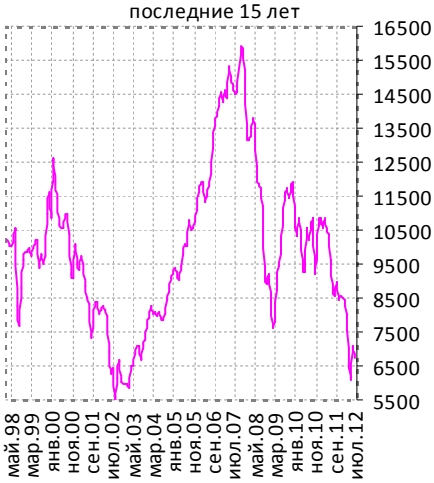
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

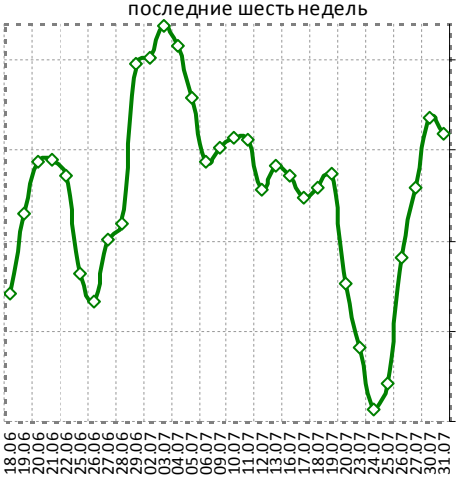


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

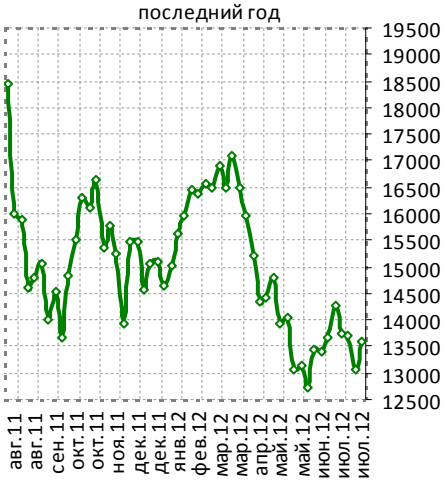


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



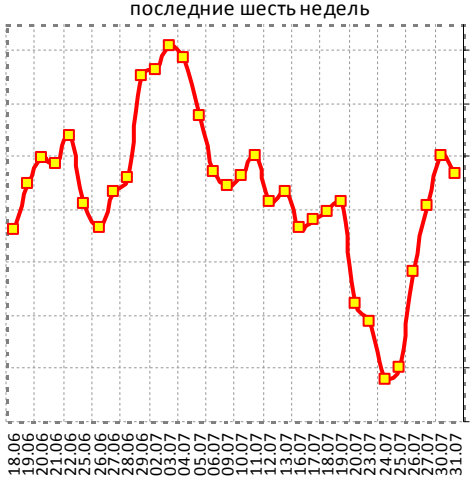
MIB Index: недельные данные - последний год



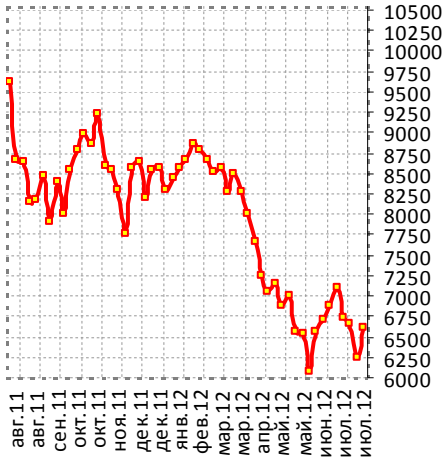
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



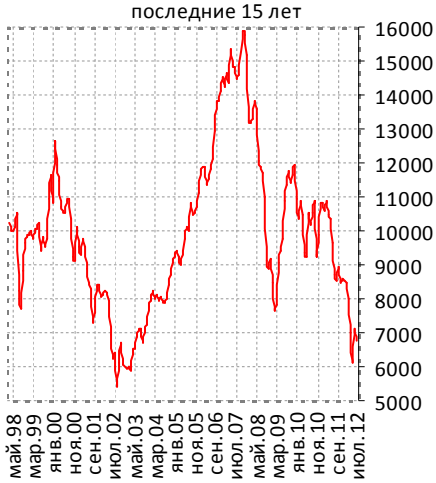
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



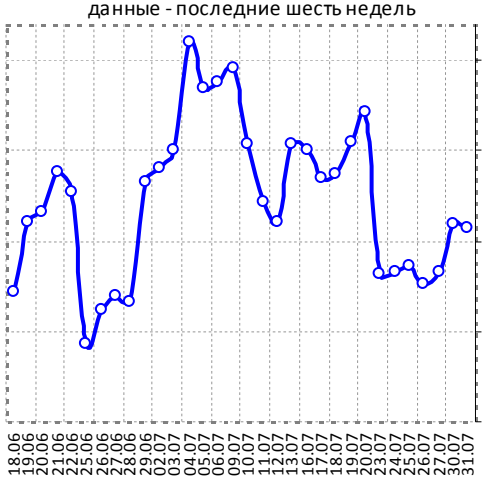
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



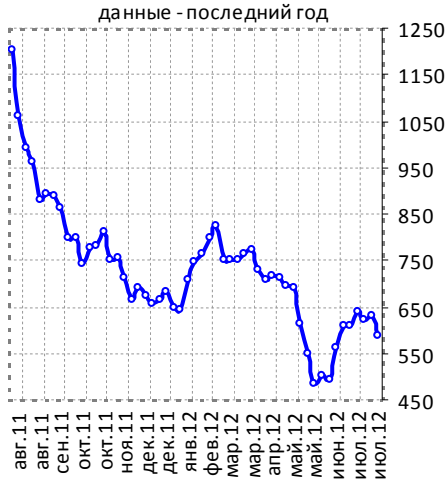
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



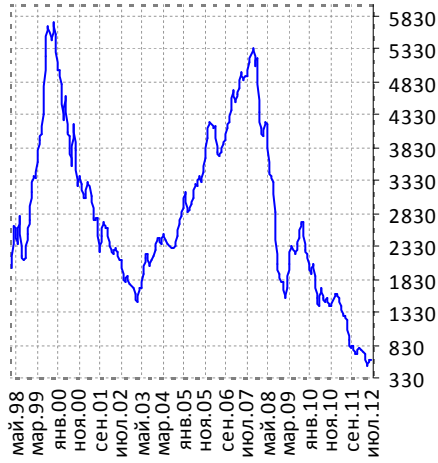
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



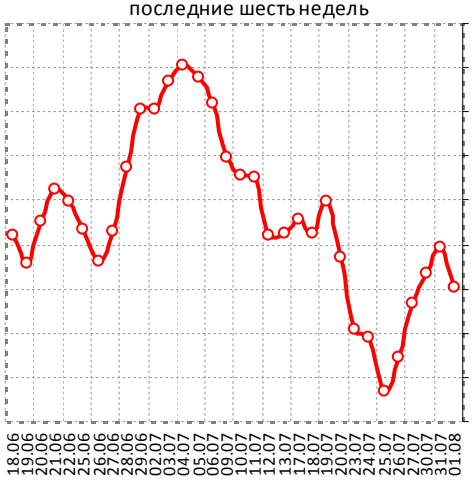
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



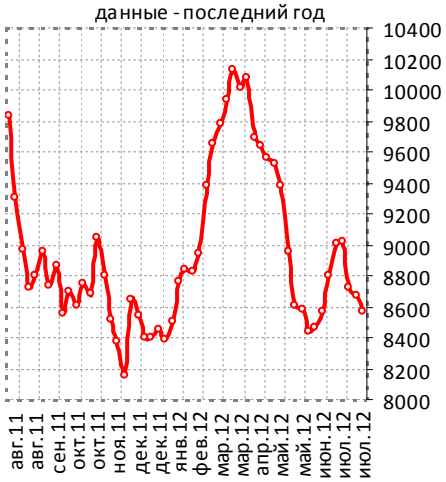
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

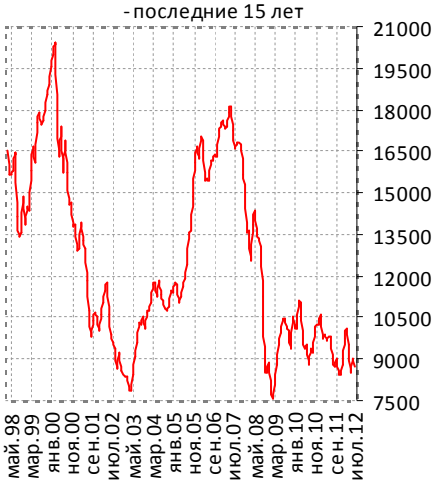
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



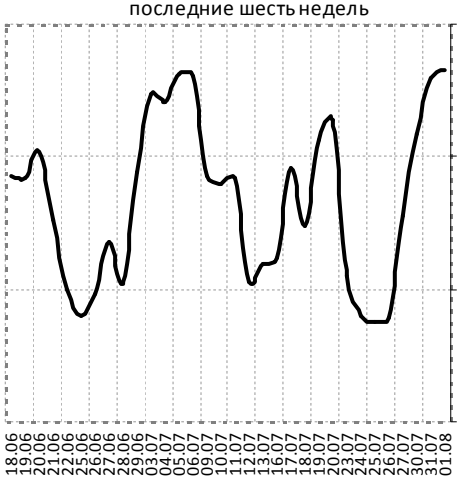
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



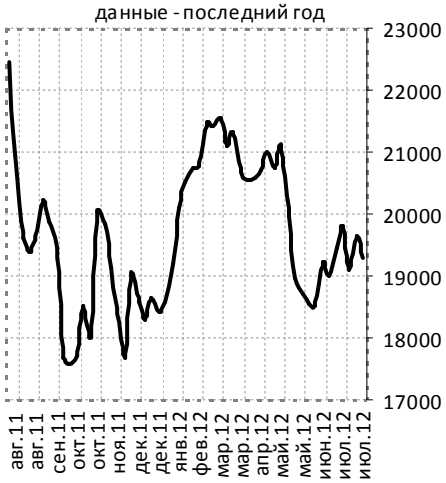
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



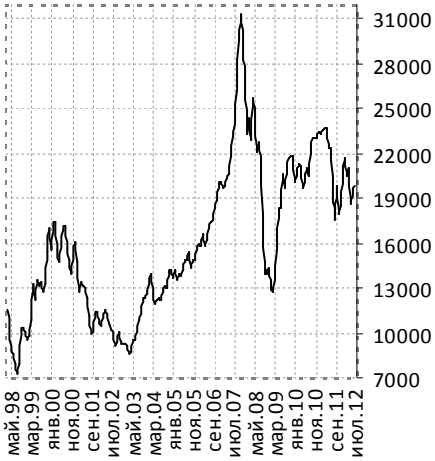
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



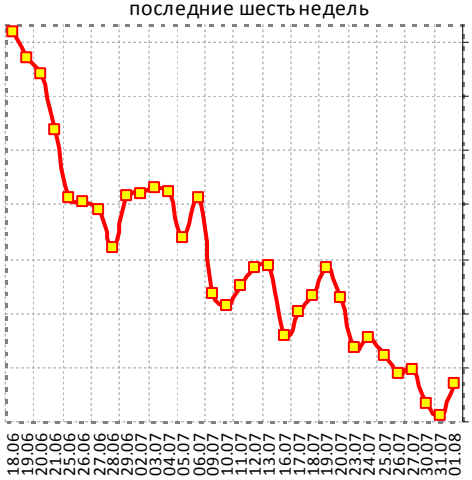
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



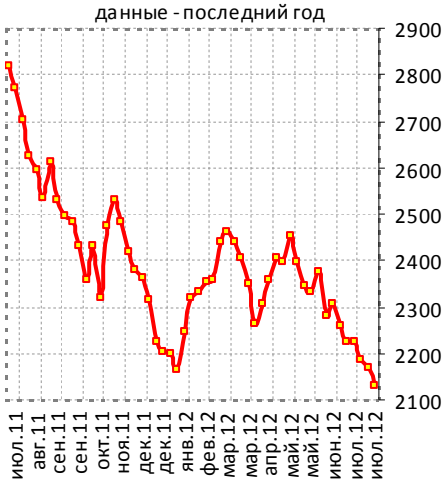
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



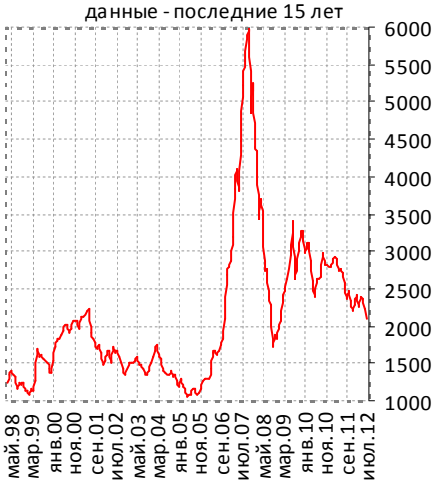
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



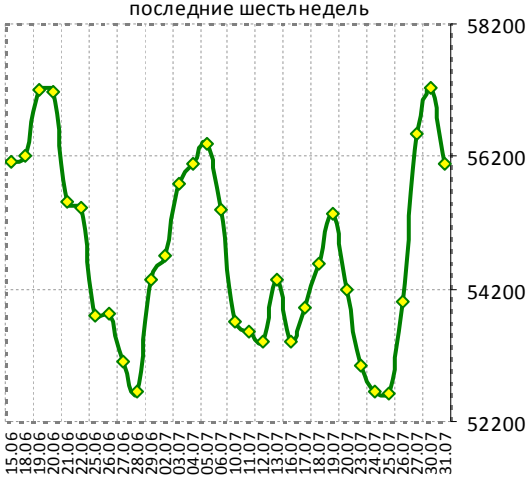
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



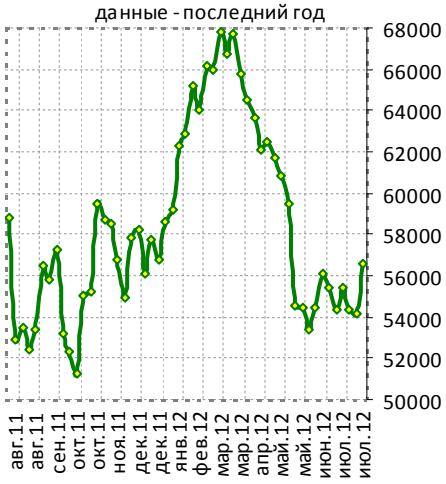
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

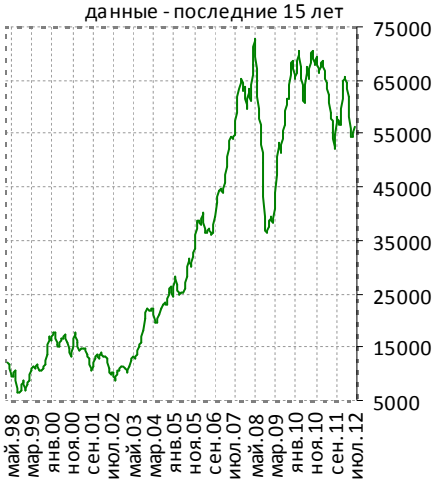
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



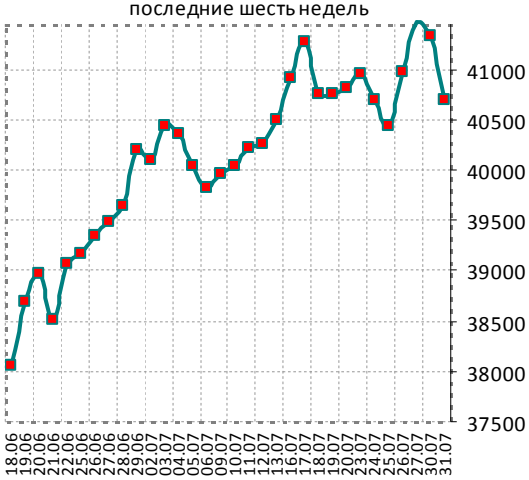
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



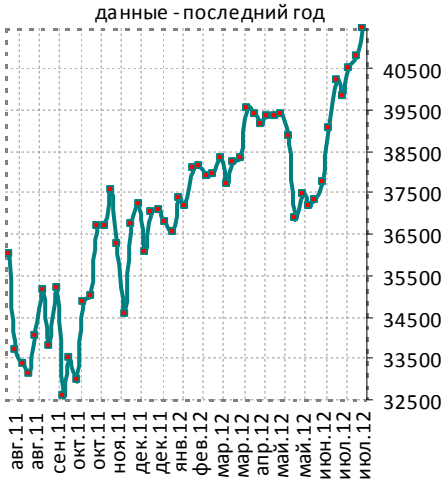
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



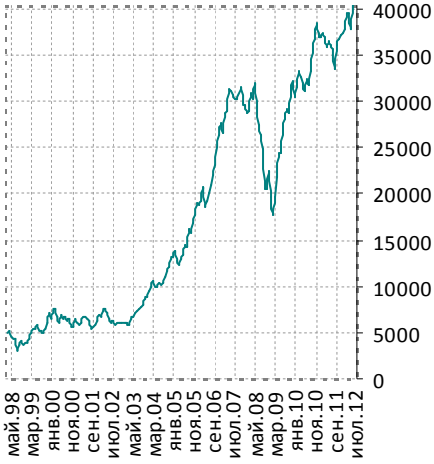
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



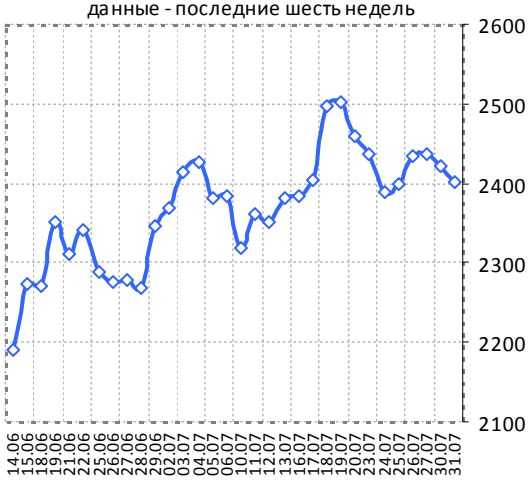
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



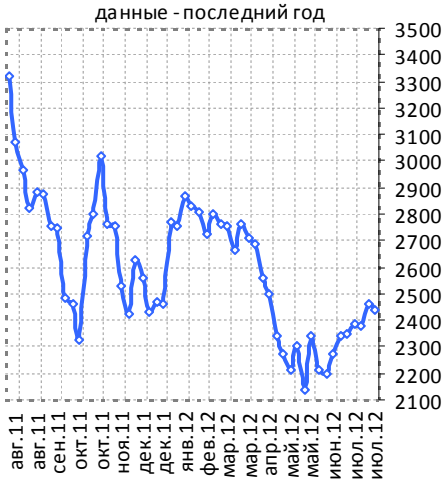
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



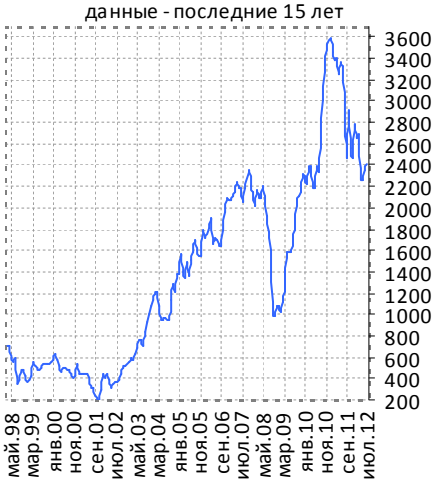
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

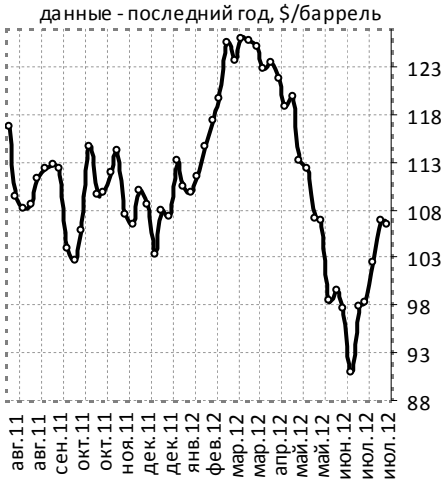
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

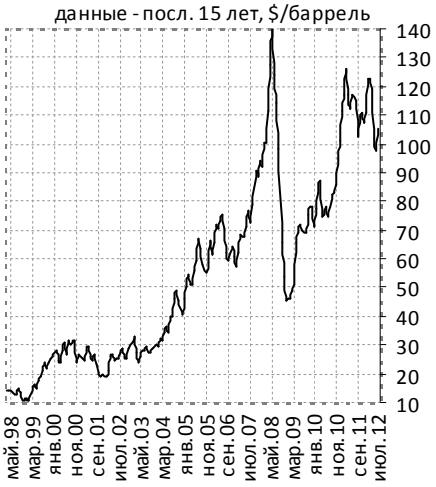
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



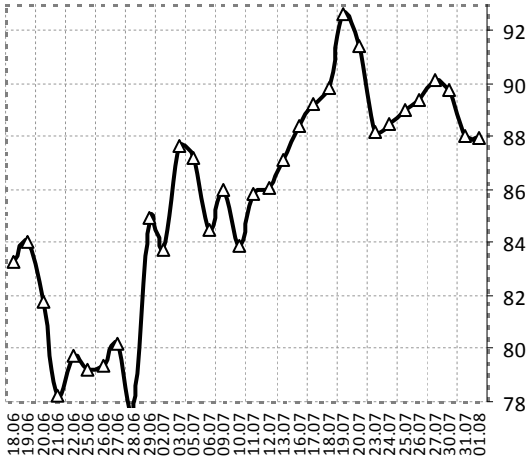
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



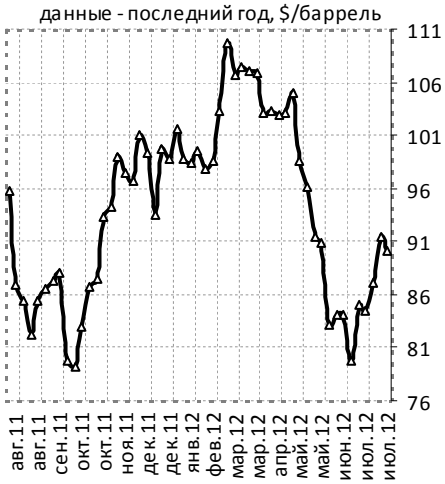
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



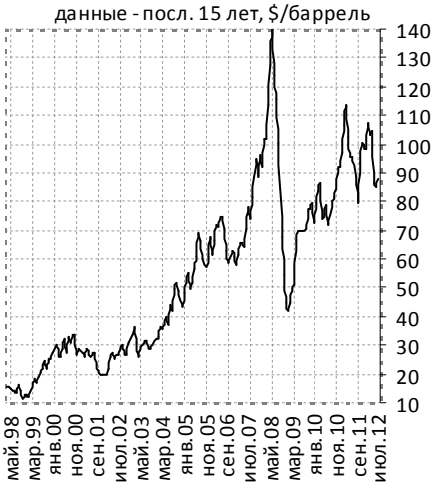
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



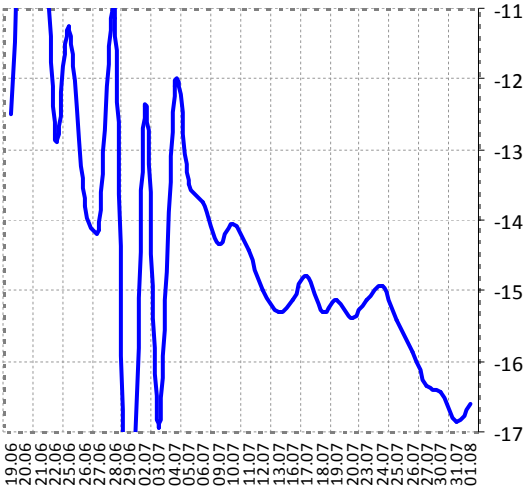
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



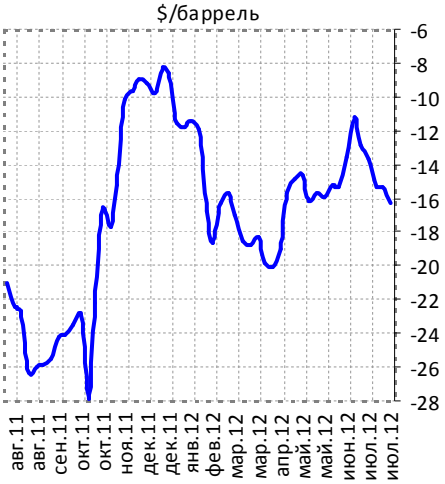
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



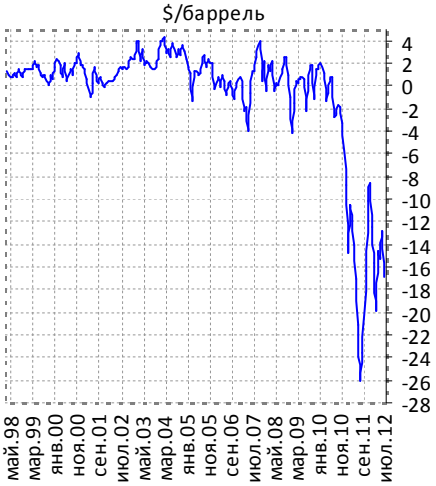
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



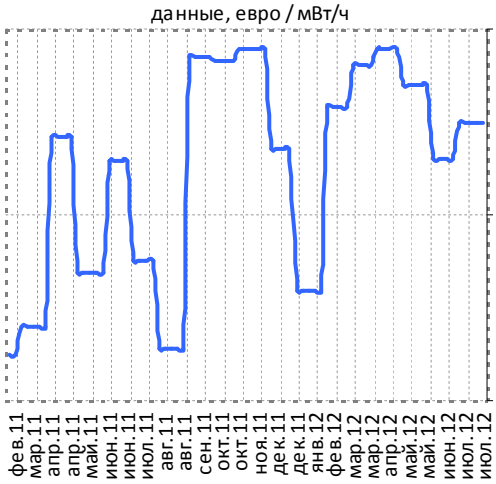
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



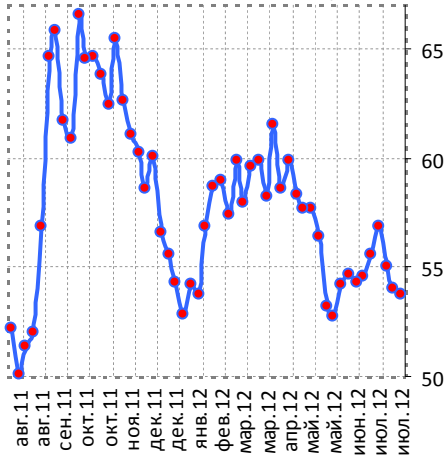
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

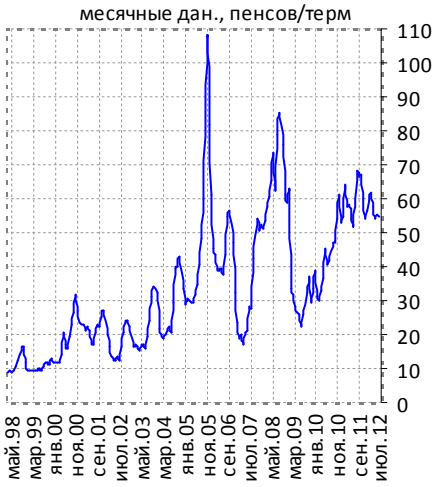
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



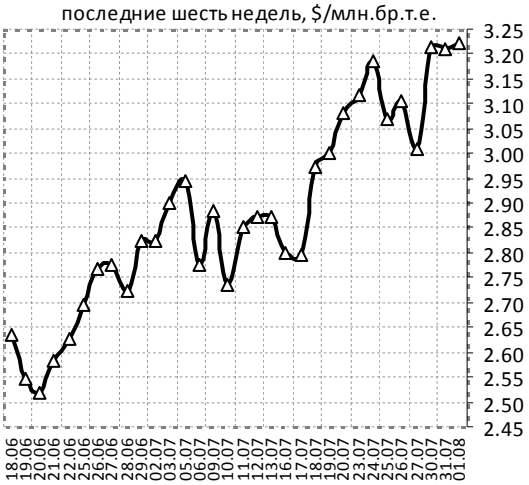
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



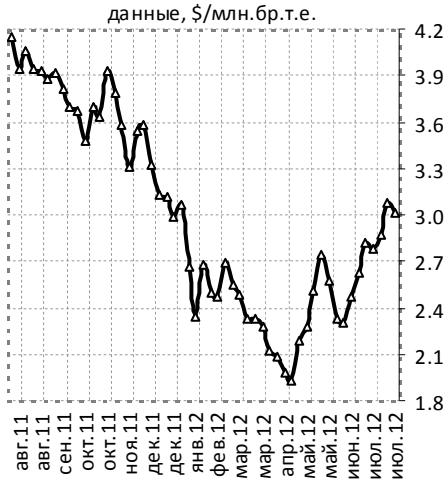
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



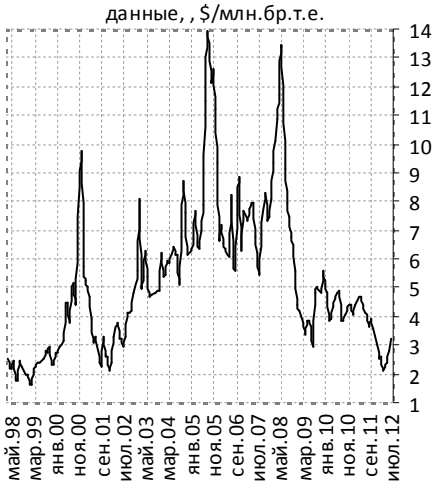
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



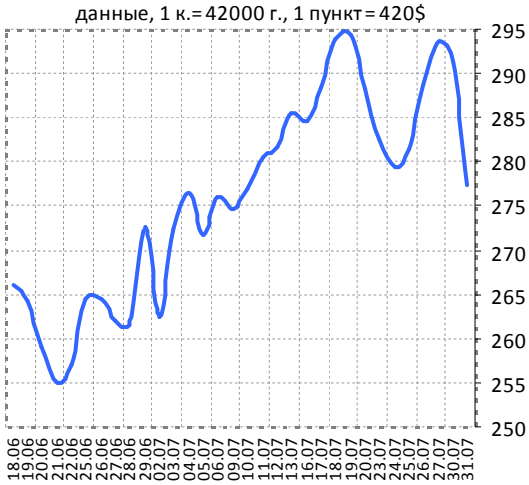
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



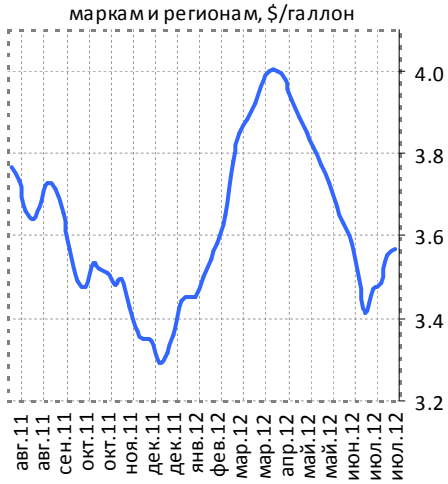
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



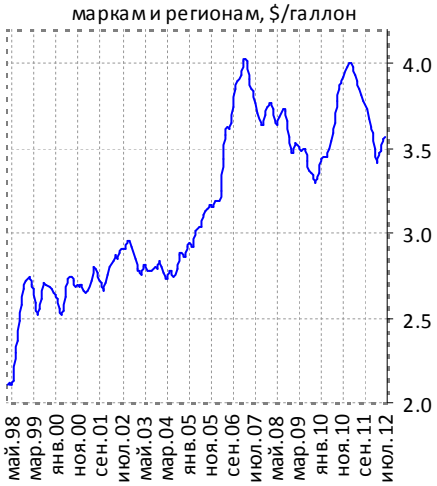
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



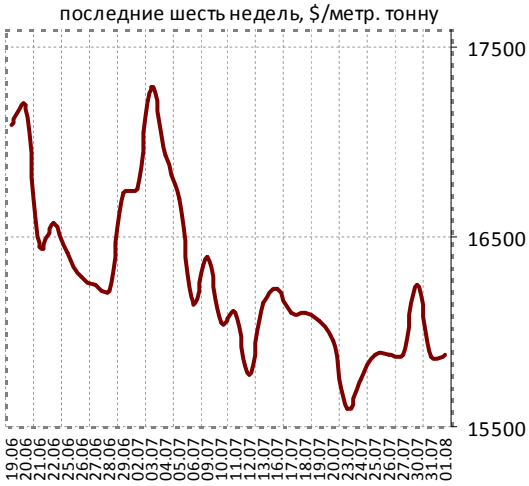
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



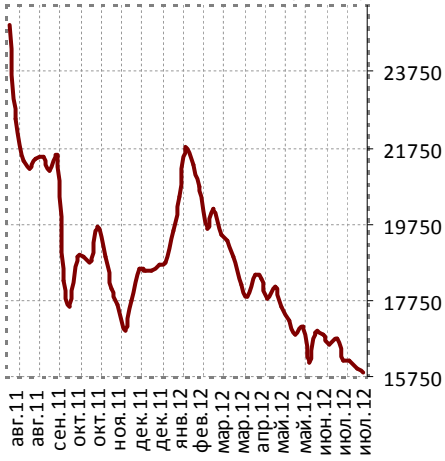
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

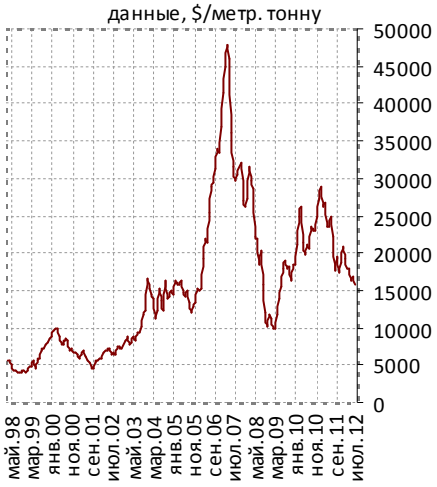
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



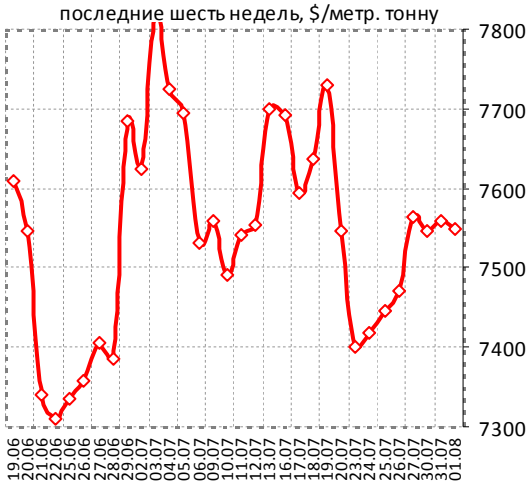
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



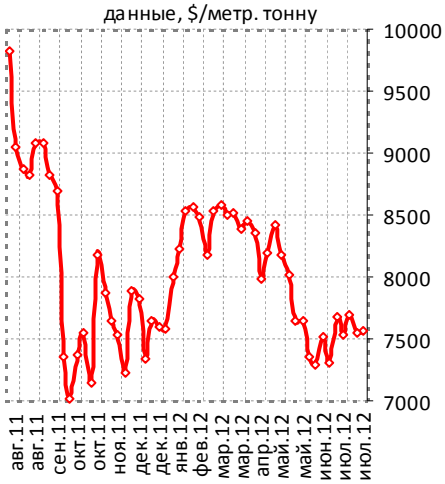
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



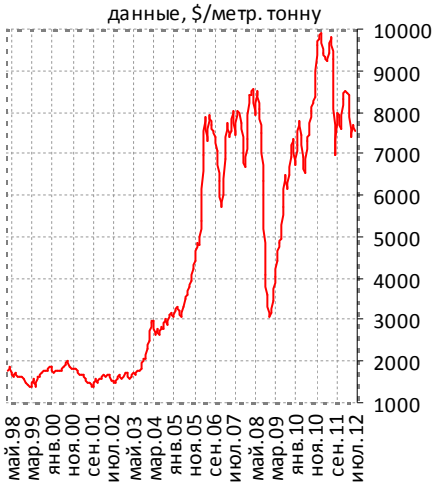
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



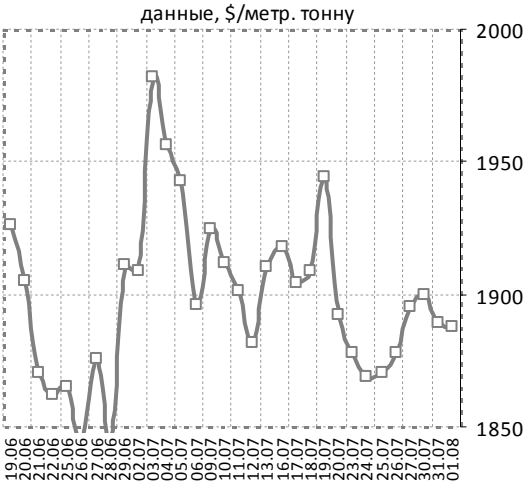
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



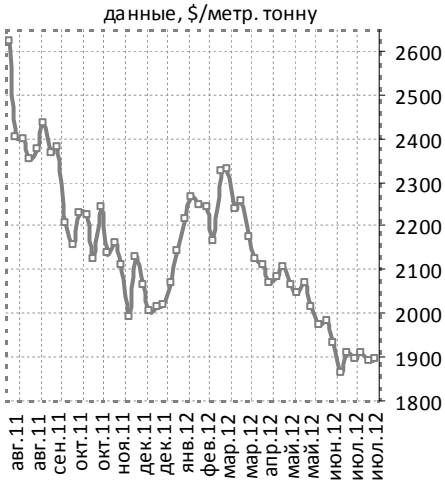
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



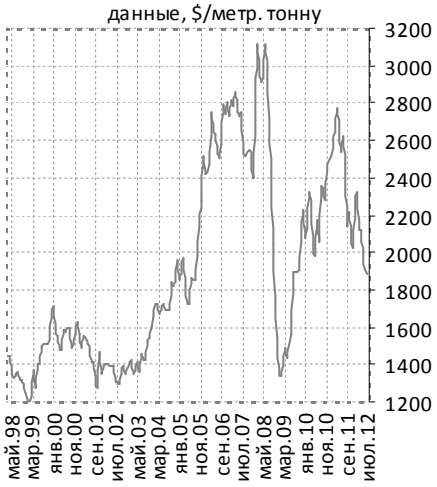
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.