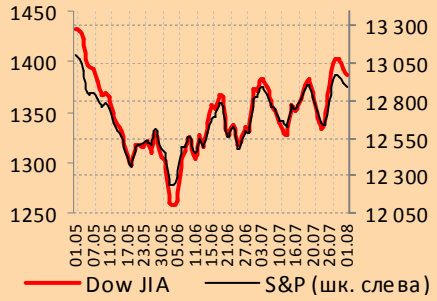
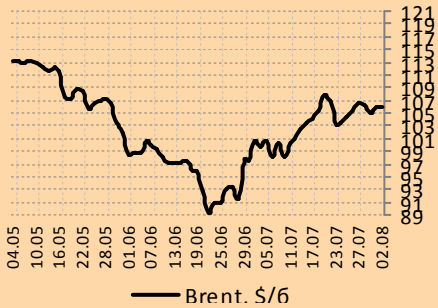
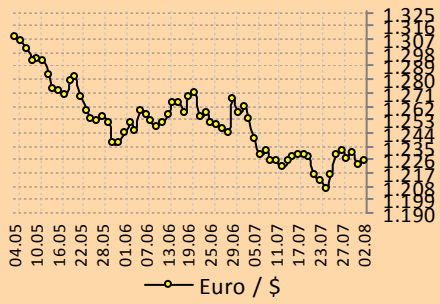
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

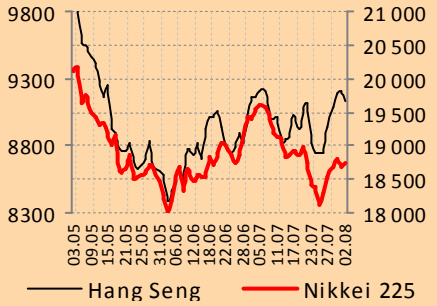
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

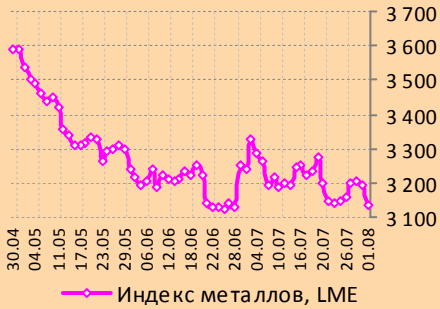
Ежедневный обзор

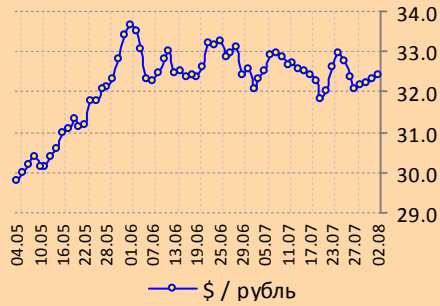






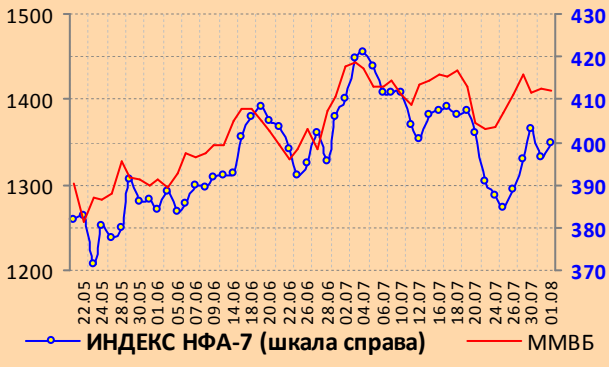






СОДЕРЖАНИЕ

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. Американские биржи первыми отыграли решение двухдневного заседания ФРС не менять ничего. В принципе это было ожидаемо, и инвесторы придавали значение выходящим отчетам и статистике (так, данные по строительству показали рост за месяц на 0,4%). В итоге индексы хоть и снизились, но не намного, Dow Jones =-0,29, S&P 500 упал =-0,3, NASDAQ =-0,66%.

Конгресс утвердил предложения президента по финансированию правительственных расходов до марта 2013г., что в определенной мере сняло возможные дебаты по бюджету накануне выборов. США ввели новые санкции против Ирана. Частным лицам запрещается оказывать содействие властям Ирана в продаже нефти и нефтепродуктов, усиливается контроль над финансовыми организациями, которые ведут дела с иранскими банками, включая Центральный банк Ирана. Приостанавливается деятельность на территории США китайского Bank of Kunlun и иракского Elaf Islamic Bank of Iraq, через которые проходило финансирование сделок в пользу Ирана. Кроме того, в Конгрессе ожидается голосование по введению дополнительных санкций в отношении морского флота Ирана.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, комфортные цены сыграли свою роль, индексы на закрытии преимущественно подросли, ММВБ =+0,34, РТС =-0,18%. Из предложенных в среду ЦБ на 1 день 380 млрд. руб. на аукционе прямого РЕПО банки взяли 344 млрд. под 5,32% (ставка рынка 5,84%). На аукционе Минфина по размещению ОФЗ-ПД было предложено бумаг на 35 млрд. руб., взяли 13,0 млрд. с доходностью 7,68%, погашение 19 апреля 2017 г. Сегодня Минфин проведет аукцион по размещению средств федерального бюджета в сумме до 25 млрд. руб. на банковские депозиты под проценты, минимальная ставка размещения 6,5%, возврат средств 7 сентября. Инфляция с начала текущего года равна 4,5%.

Европа. На ожиданиях позитива решений ФРС и ЕЦБ биржевые котировки пытались расти, в результате FTSE 100 =+1,38, CAC 40 =+0,91, индекс DAX на 17,8 =-0,26%. При этом индекс деловой активности в промышленности еврозоны продолжает оставаться ниже 50 пунктов и за месяц снизился с 44,1 до 44,0 пункта, ожидалось 44,1 пункта. По Испании есть хорошие новости: вопреки ожиданиям, индекс деловой активности в промышленности повысился с 41,1 месяцем ранее до 42,3 пункт, а S&P подтвердило на прежнем уровне краткосрочный и долгосрочный рейтинги Испании с негативным прогнозом, но при этом заявило, что прогноз может быть повышен до стабильного, если кредитоспособность страны улучшится.

Начала действовать программа Банка Англии Funding for Lending. Механизм такой, что Банк предоставляет в заем комбанкам свои краткосрочные бумаги, а банки используют их в качестве залога для получения кредитов в Банке Англии по льготной ставке в 0,25% на цели кредитования экономики. Срок привлечения банками средств составляет 4 года, сумма привлечения ограничена.

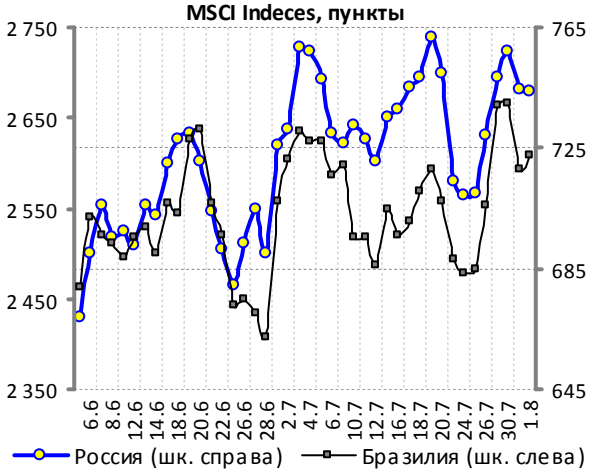
Азия. Появилась информация о снижении с 49,50 до 49,3 пункта индекса деловой активности в промышленности Китая. Индекс не только остался ниже 50 пунктов (что означает сокращение экономической активности), но и уменьшился, что влечет масштабные риски для зарубежных экспортеров и не может быть принято биржами иначе, как негатив. Тем не менее, в самом Китае торги среды завершились в плюсе (SSE вырос на 0,94, Hang Seng на 0,12%), негатив был принят как самый что ни есть позитив, в расчете, что в такой ситуации правительство может ускорить введение дополнительных мер монетарного стимулирования экономического роста и рынка труда. В Южной Корее снизился профицит торгового баланса, и больше, чем ожидали, уменьшились объемы экспорта и импорта. Увеличение резервов на покрытие плохих долгов и снижение маржи привели к резкому сокращению совокупной прибыли корейских банков. ВВП Южной Кореи во втором квартале увеличился относительно первого на 0,4%, ожидался рост на 0,5%, предыдущее изменение +0,9%. И вот результат, индексы Kospi и Nikkei показали снижение соответственно на 0,61и 0,11%.

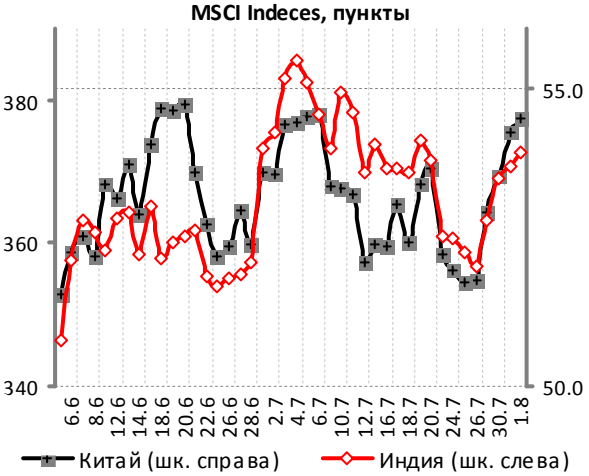
Золото. Укрепление доллара в результате решений ФРС привело к снижению цен драгметаллов, утром среды золото торговалось по 1623,8 долл. за унцию, утром сегодня фьючерсы на золото = 1604,46, серебро = 27,41, платину = 1399,2, палладий = 583,45 долл./унция.

Нефть. Введение со стороны США новых санкций против Ирана способствовало росту нефтяных цен, так же, как и решение ФРС ничего не менять, утром среды Brent и Light шли по 104,7 и 87,86 долл./барр., сегодня с утра по 105,95 и 88,75 долл./барр.

События, статистика, прогноз. Основным событием сегодня станет заседание ЕЦБ, результаты будут известны в 15.45 мск. Состоится также заседание Банка Англии (15.00). Ждем по США данные по рынку труда (16.30) и объем промзаказов (18.00). Внешний фон сформирован биржами США, которые уже в полной мере отреагировали на итоги заседания ФРС и теперь фьючерсы на американские индексы торгуются в плюсе. Азия еще реагирует и находится с утра преимущественно в минусе, нефть не растет. Наши биржи, конечно, тоже ожидали от ФРС лучшего решения, а сегодня будут надеяться на более сильные решения со стороны ЕЦБ, ориентируясь на динамику фьючерсов США и европейские площадки.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 02.08.2012.

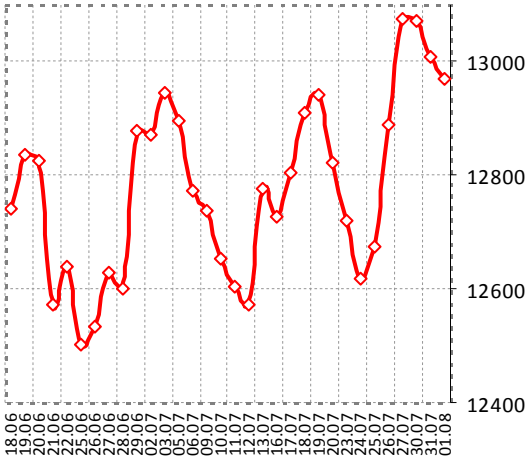




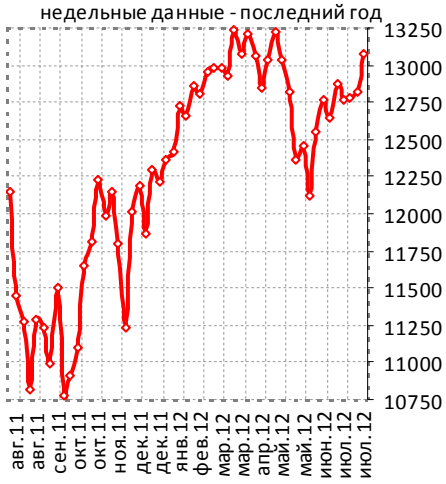
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

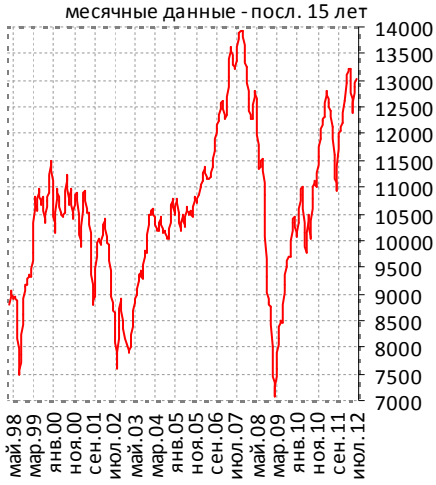
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



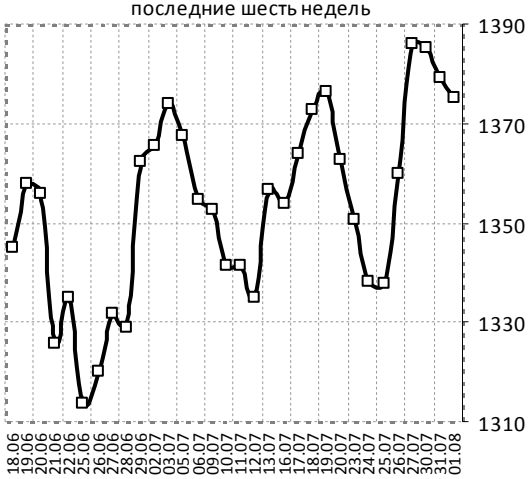
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



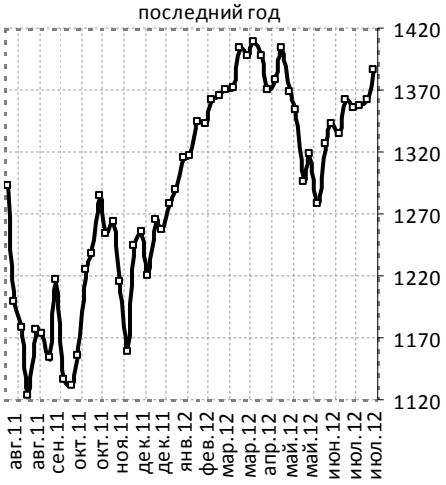
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



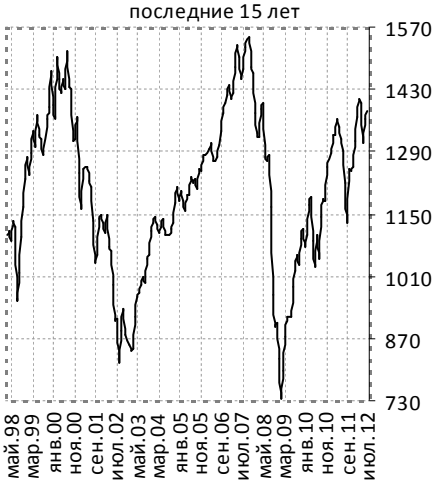
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



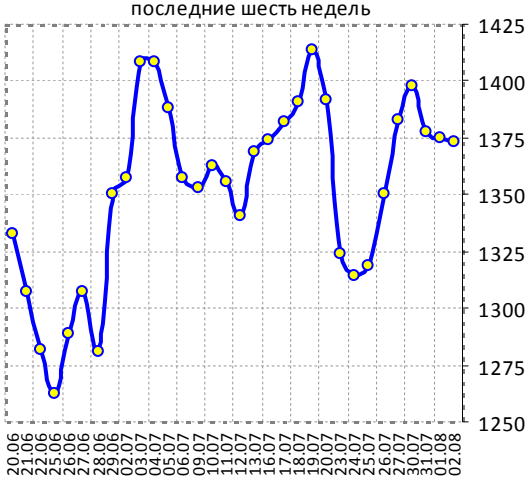
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



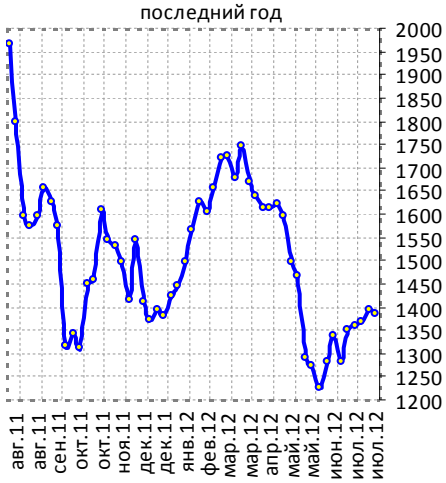
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



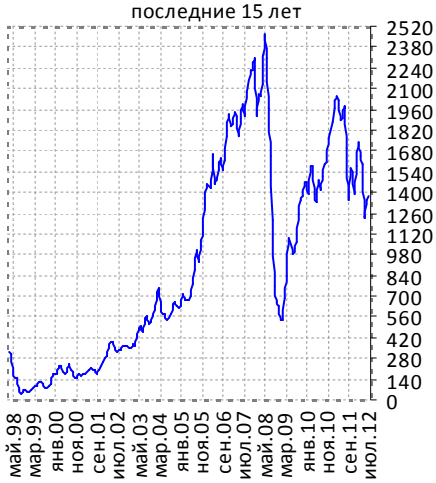
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



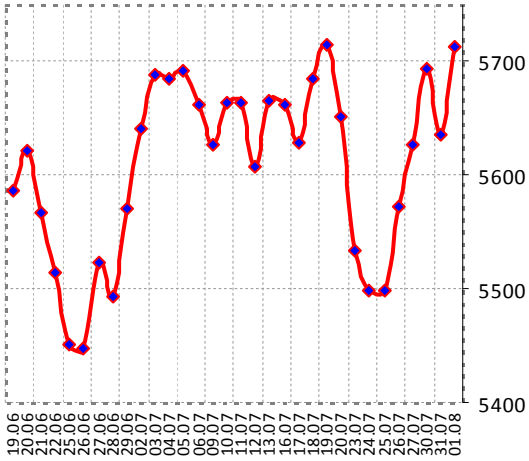
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



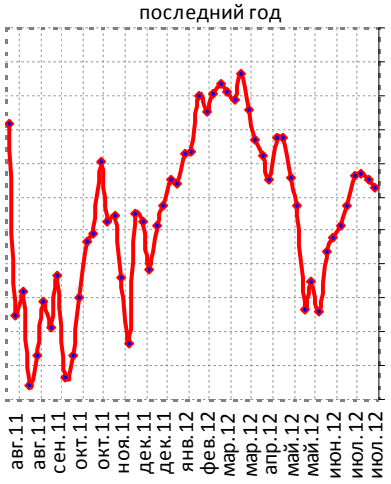
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

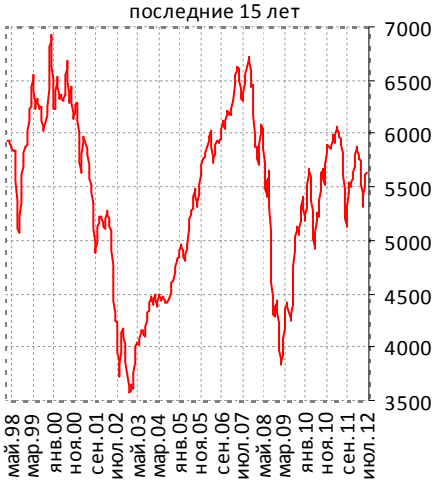
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



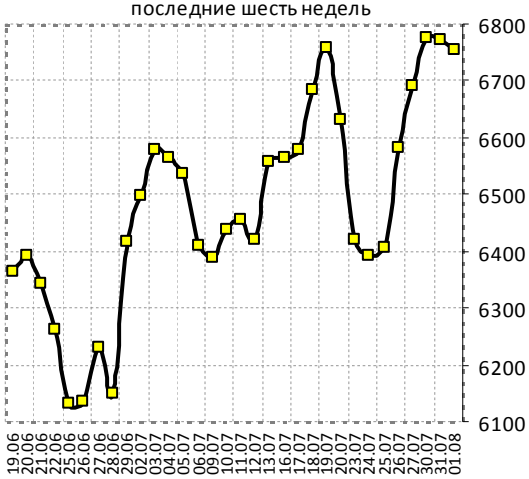
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



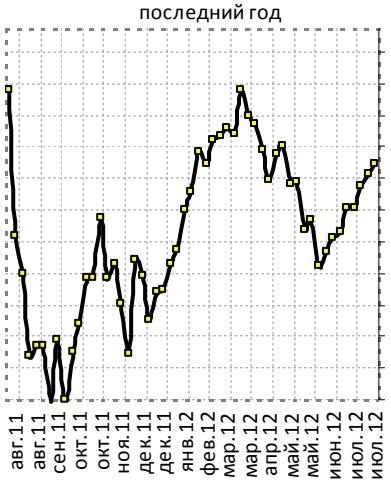
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



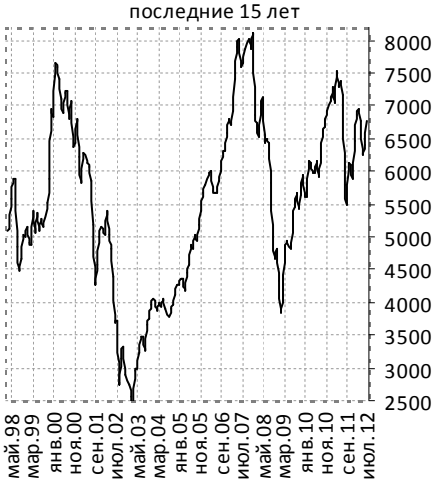
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



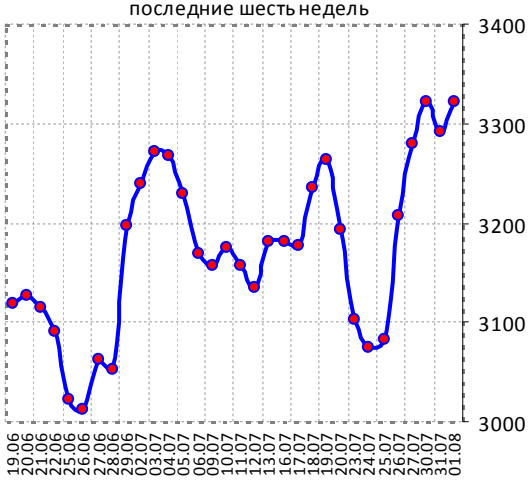
DAX Index: недельные данные - последний год



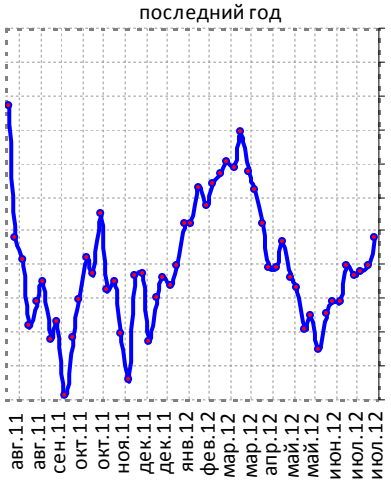
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



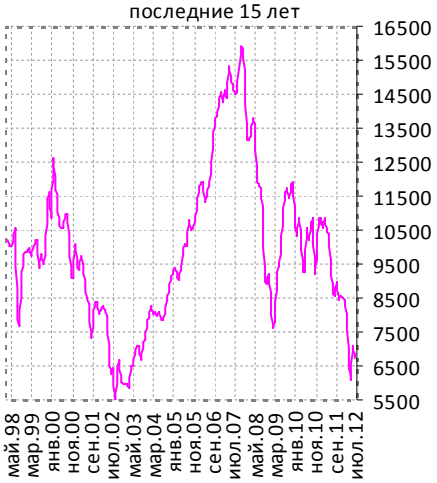
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

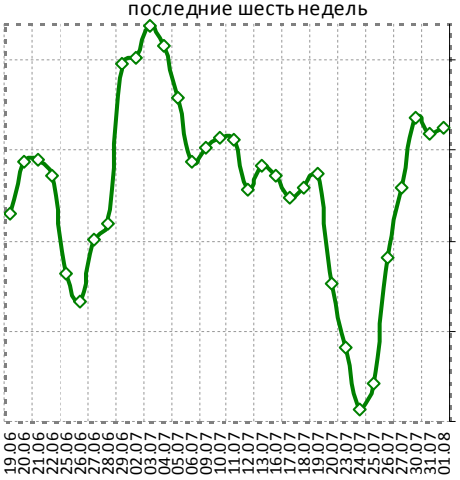


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

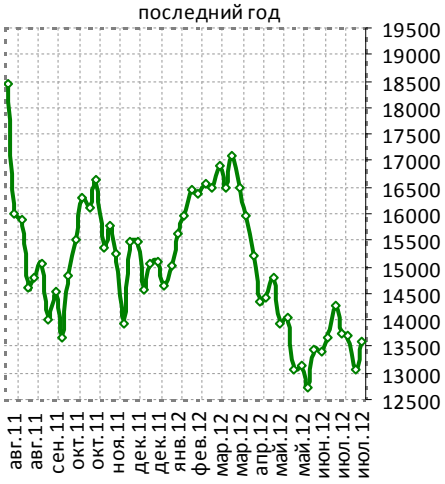


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



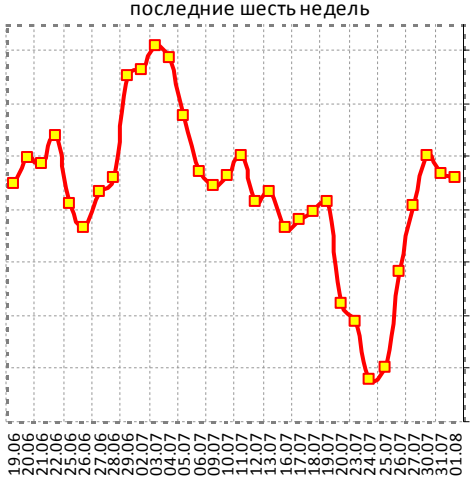
MIB Index: недельные данные - последний год



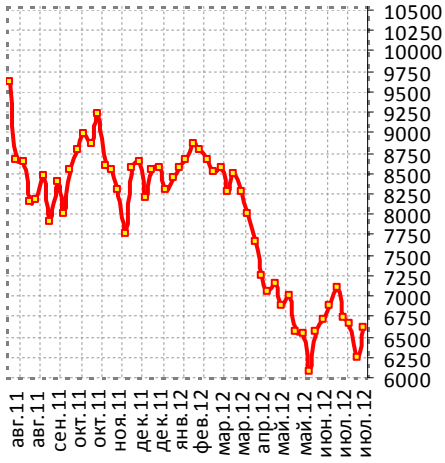
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



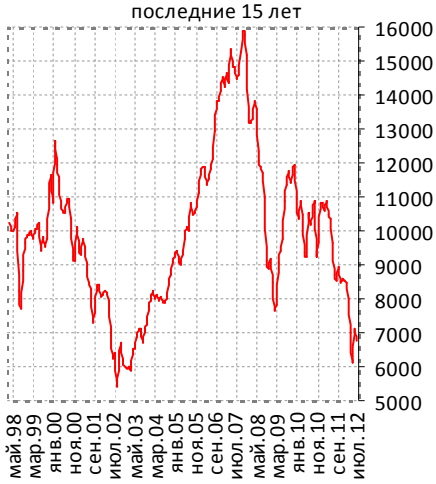
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



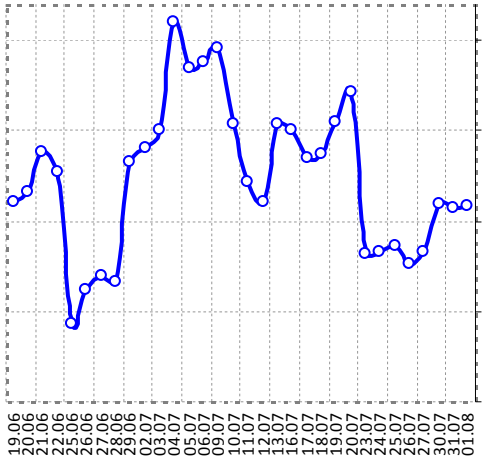
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



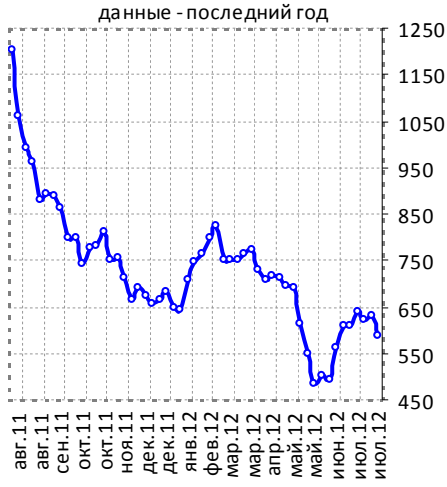
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



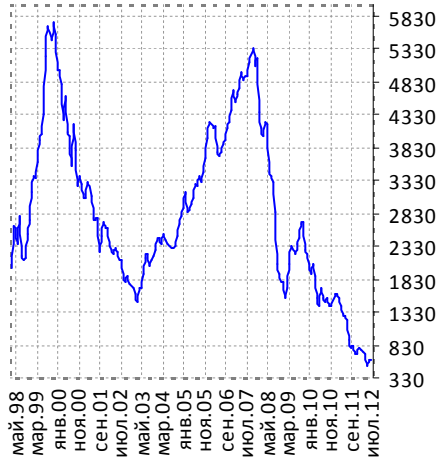
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



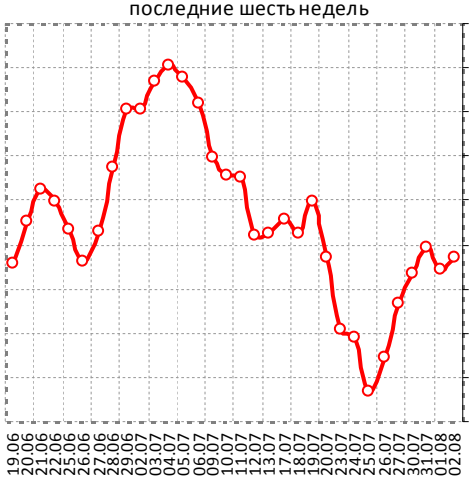
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



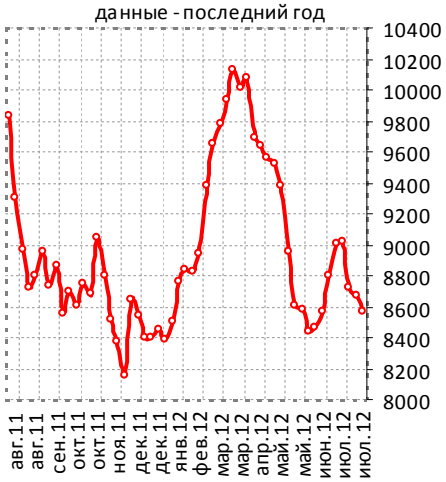
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

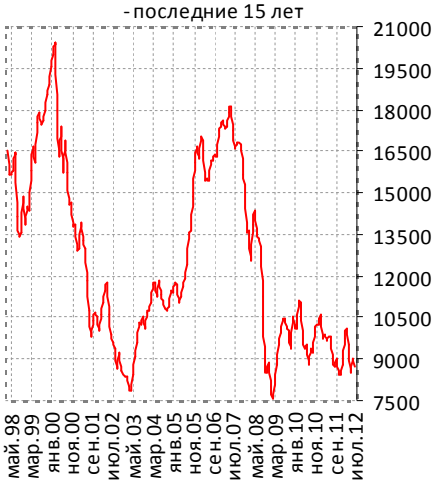
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



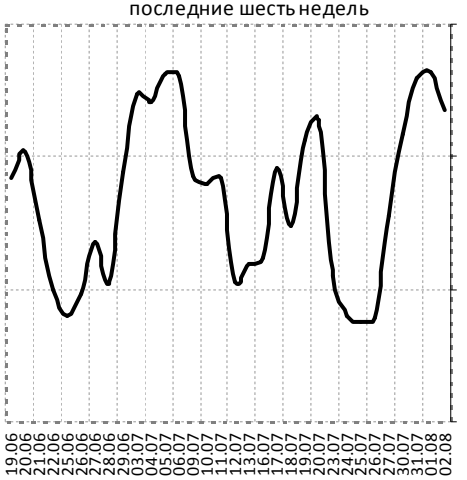
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



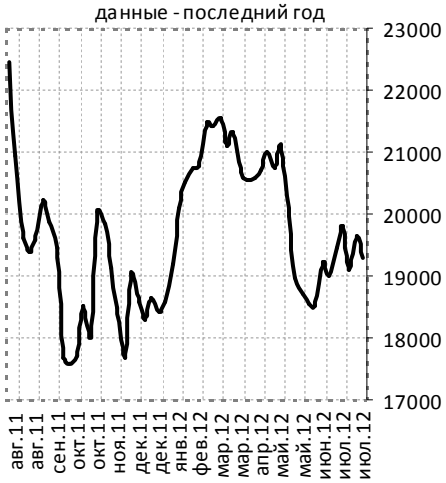
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



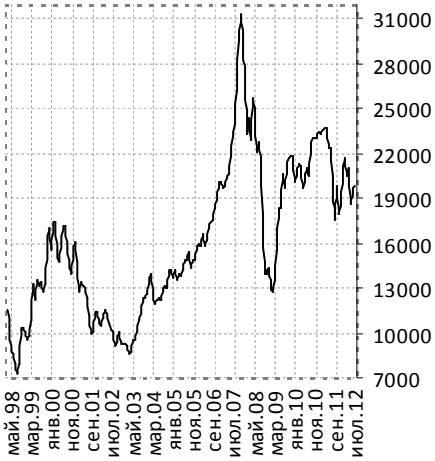
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



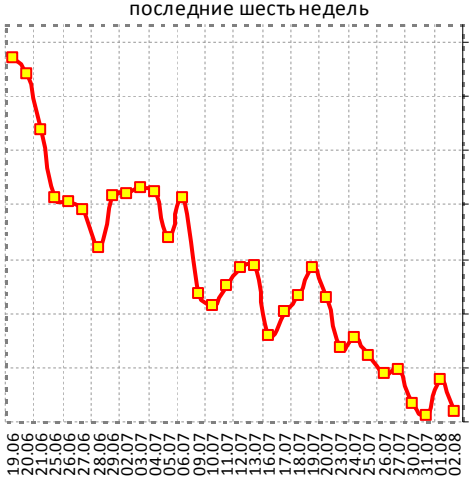
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



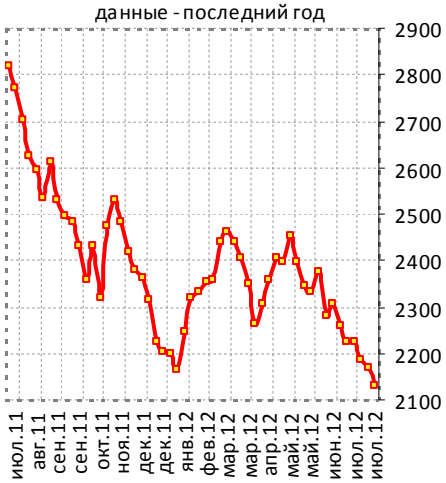
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



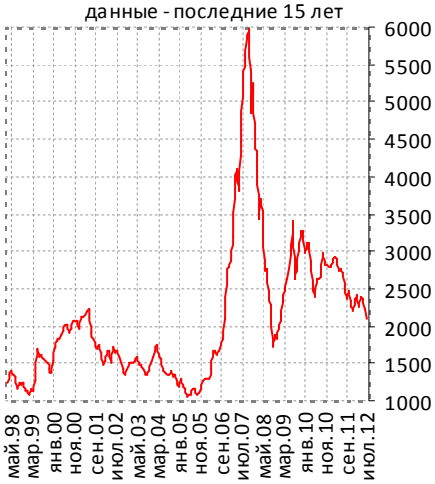
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



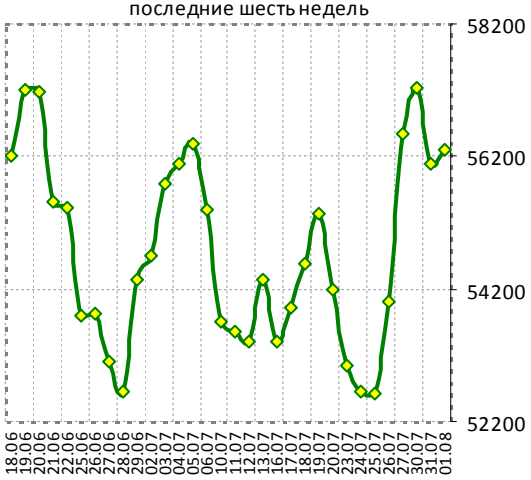
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



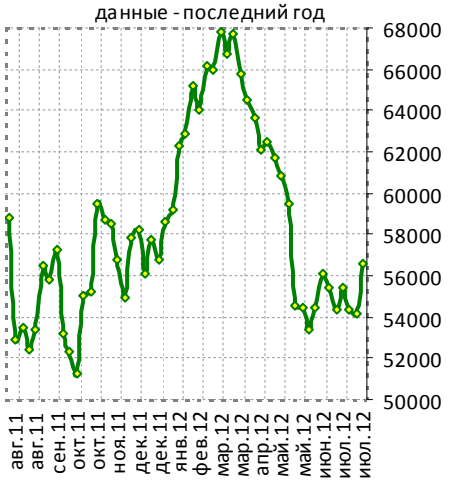
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

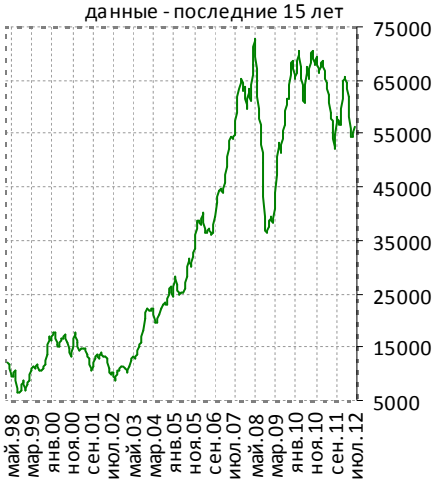
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



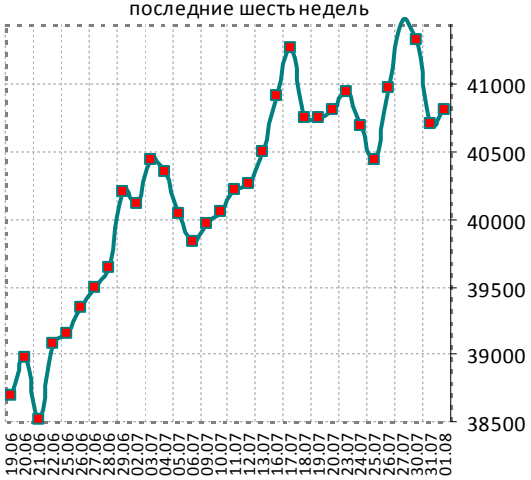
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



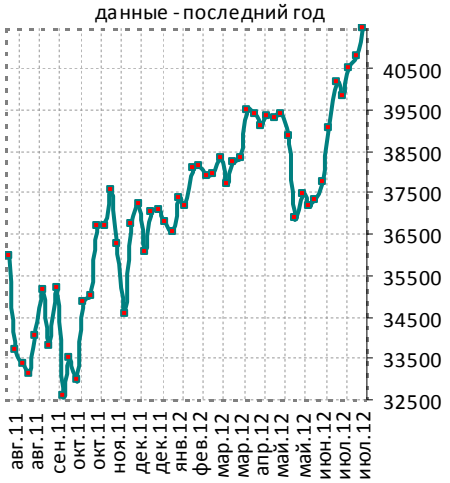
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



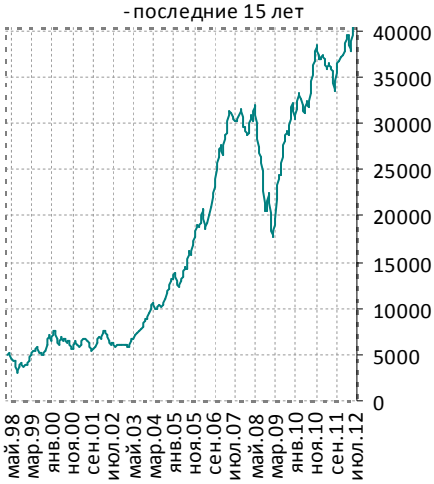
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



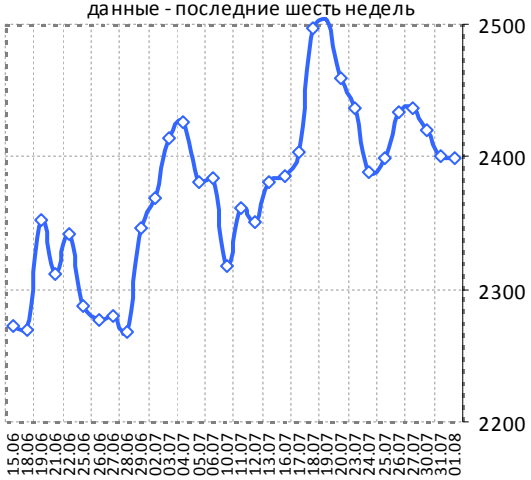
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



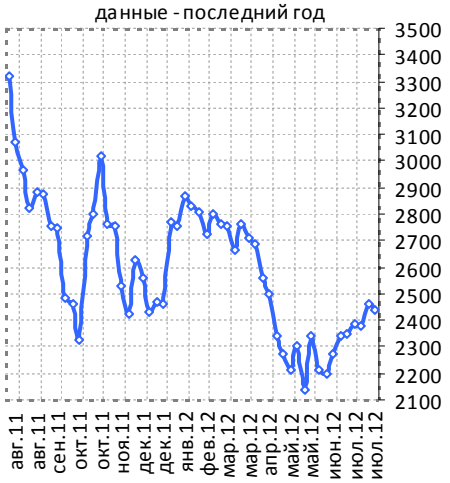
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



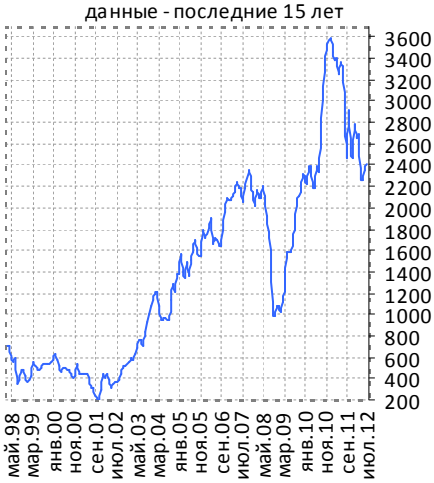
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

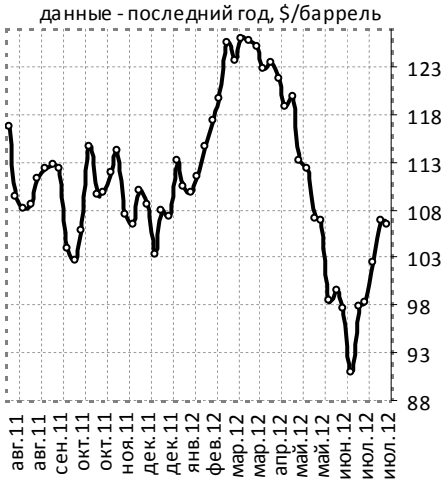
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

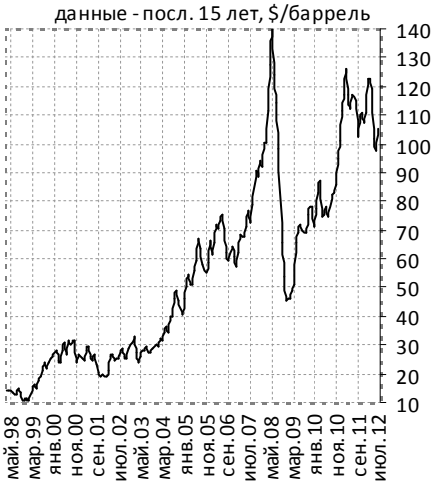
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



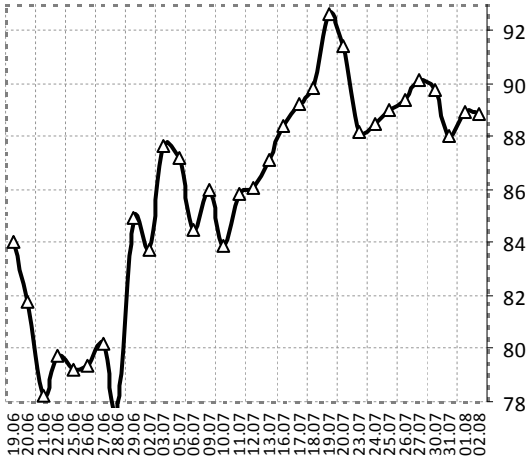
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



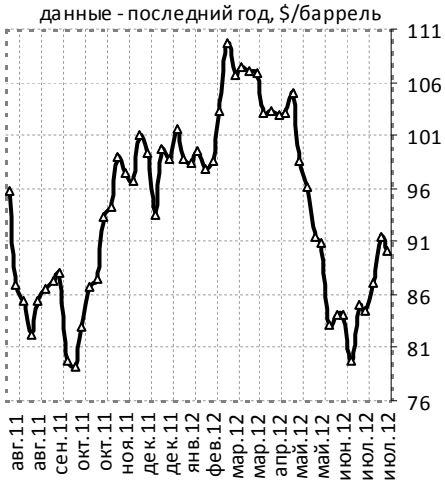
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



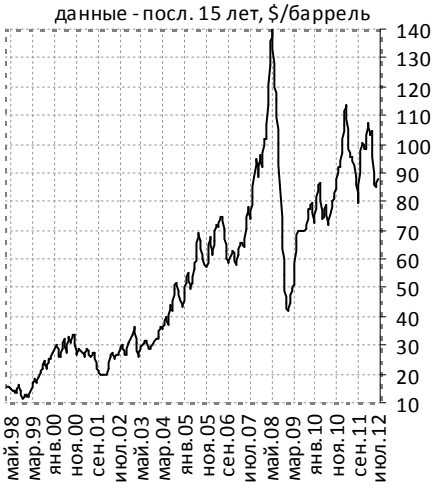
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



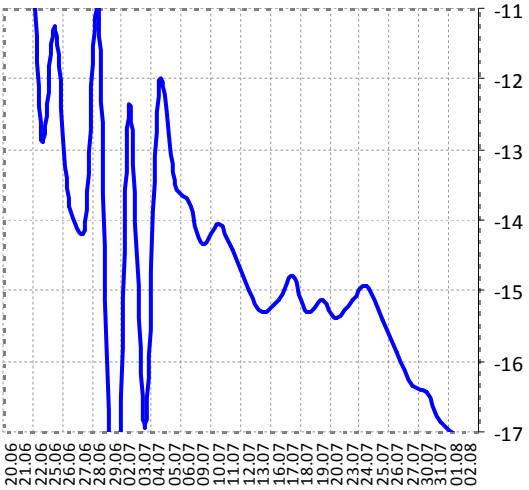
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



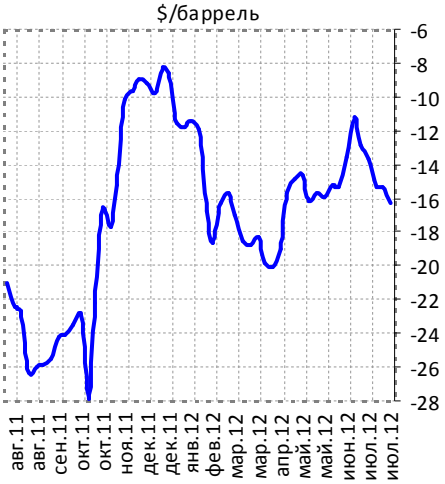
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



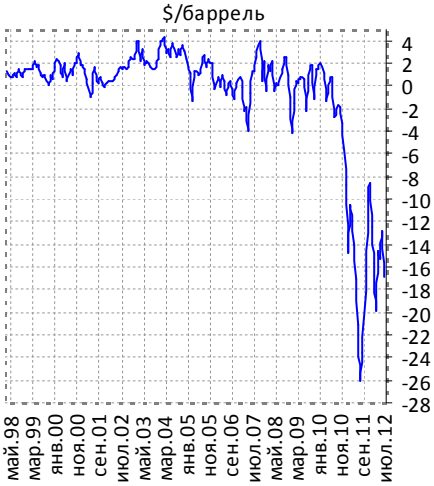
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



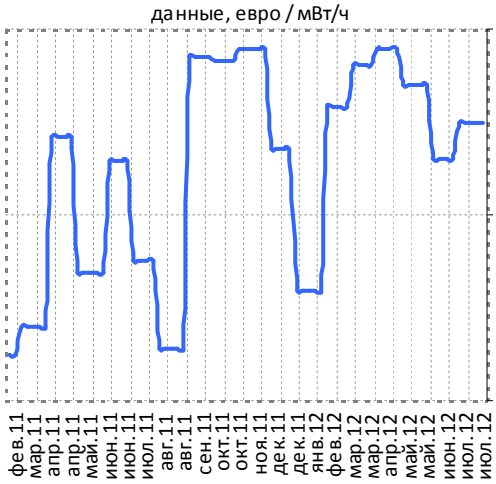
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



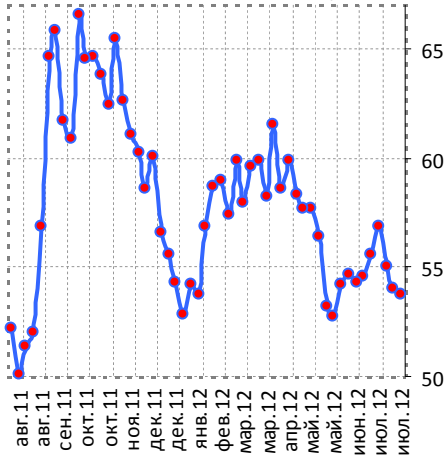
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

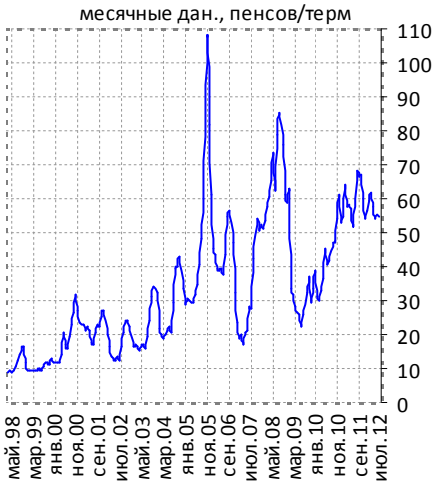
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



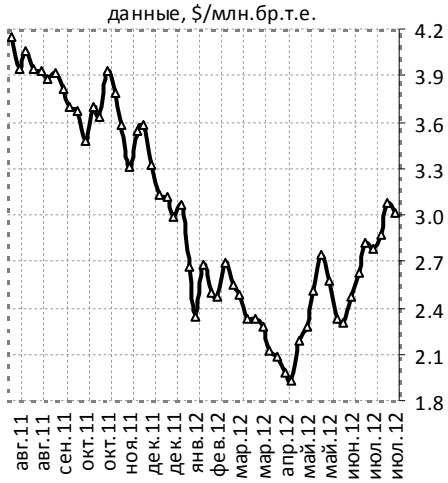
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



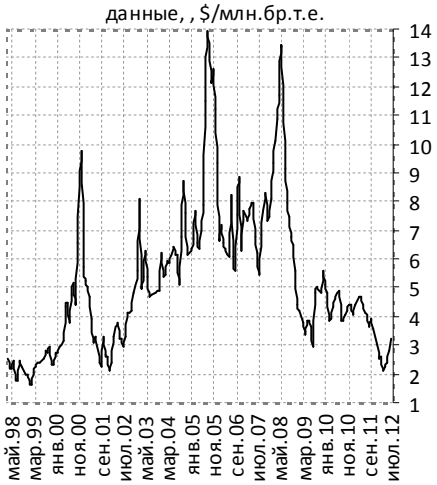
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



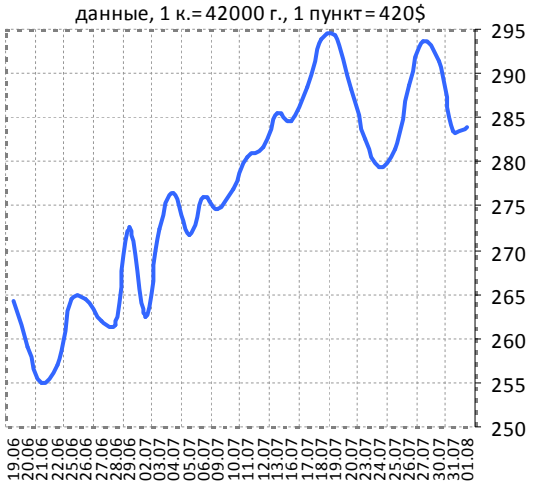
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



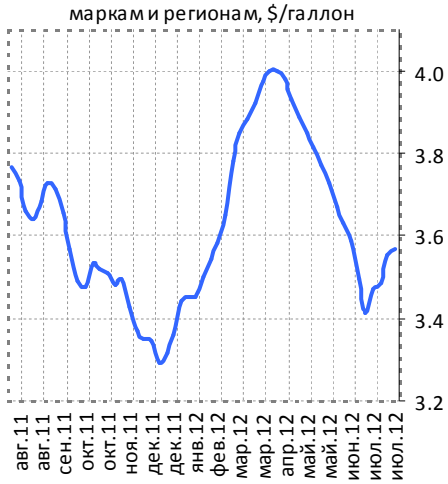
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



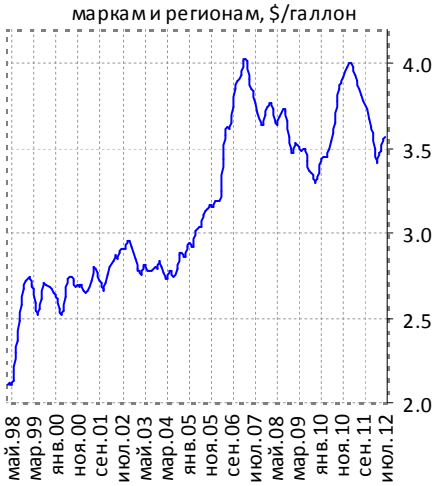
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



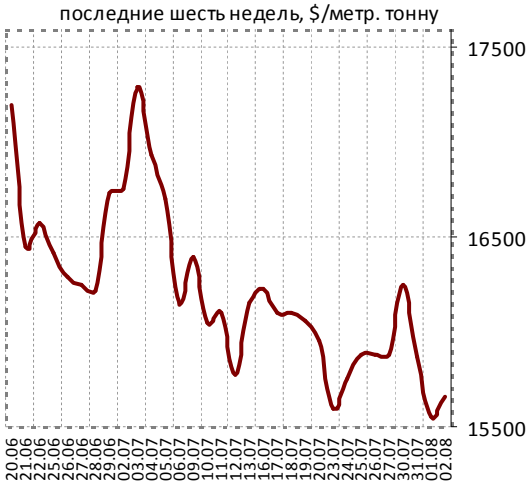
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



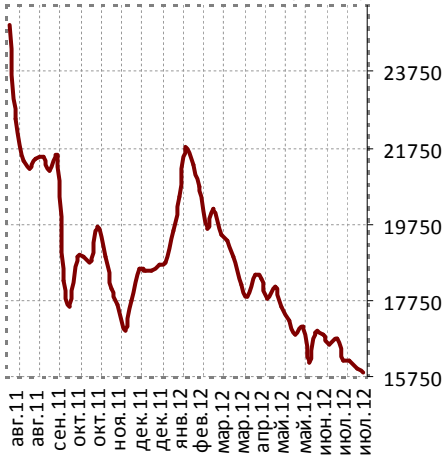
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

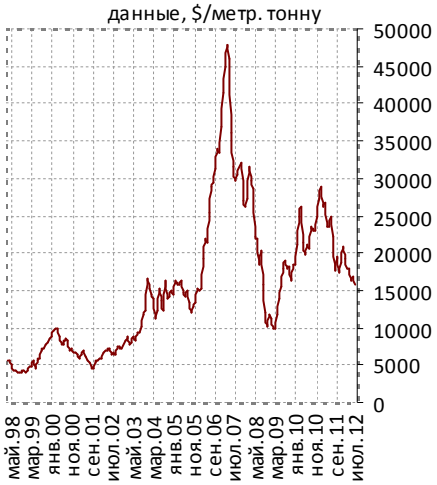
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



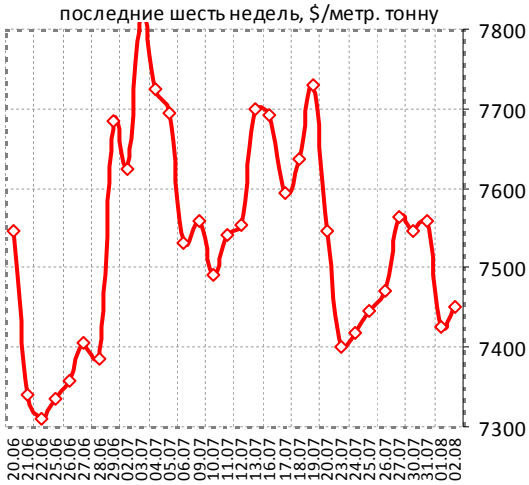
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



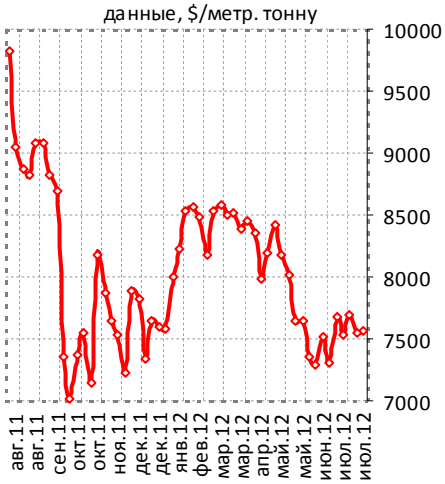
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



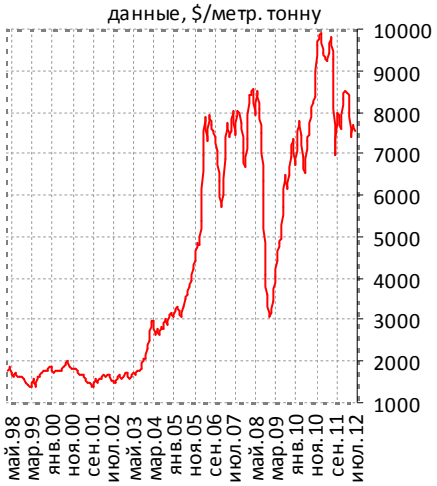
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



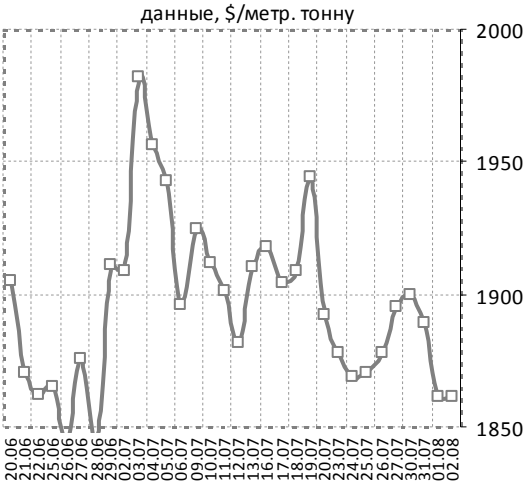
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



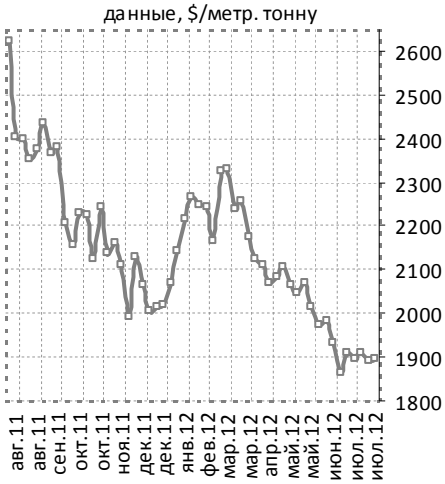
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



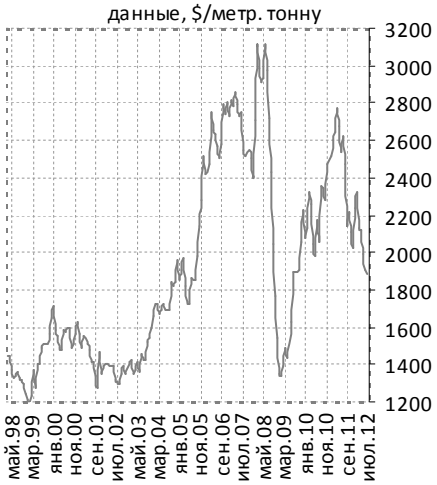
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.