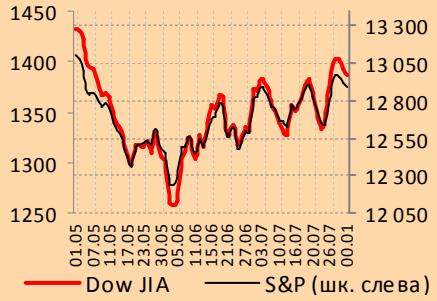
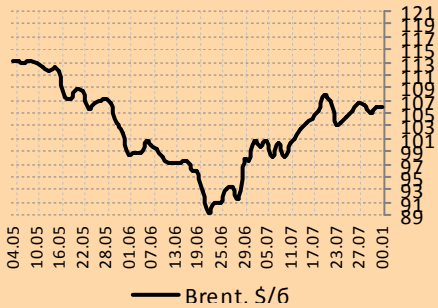
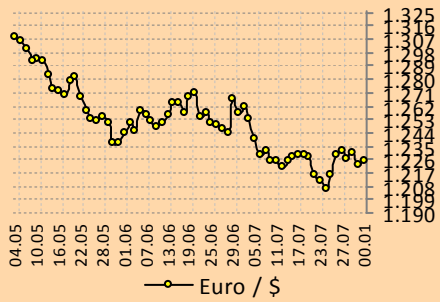
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

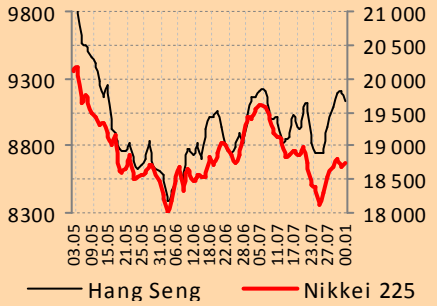
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

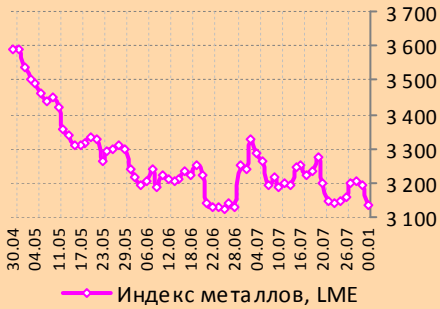
Ежедневный обзор

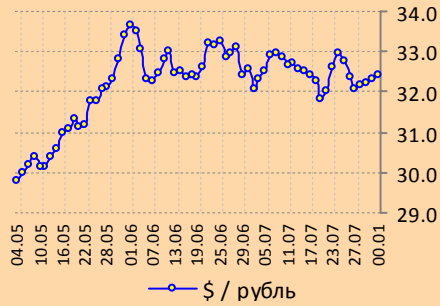






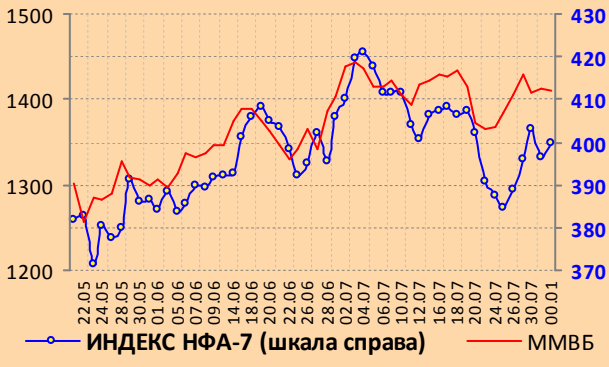






СОДЕРЖАНИЕ

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. Фьючерсы на биржевые индексы мгновенно ушли в красную зону, как только стало известно, что и ЕЦБ по итогам заседания решил ничего не менять. Слишком велики были ожидания после заявления главы банка неделю тому назад, что банк сделает все, «поверьте мне!», - сказал Марио Драги. Результаты торгов в минусе, гораздо более сильном, чем после заседания ФРС, индекс Dow Jones =-0,71, S&P 500 =-0,74, NASDAQ =-0,36%.

Данные по рынку труда показали рост рабочих мест за месяц на 163 тыс. при прогнозе 120 тыс. А вот количество первичных обращений за пособиями по безработице возросло с 357 неделей ранее до 365 тыс., хотя и меньше, чем ожидалось (370). Индекс деловой активности в промышленности повысился с 49,7 до 49,8 пункта, ожидали рост до 50,2 пункта (в мае индекс был равен 53,5 пункта, значение ниже 50 пунктов указывает на снижение деловой активности). Президент подписал распоряжение, разрешающее ЦРУ и другим американским ведомствам оказывать помощь сирийским оппозиционерам.

Россия. Котировки уже показывали уверенный рост и – стремительно снизились по факту публикации от ЕЦБ, индекс ММВБ понизился на 1,05, РТС на 1,42%. На аукционе прямого РЕПО в четверг из предложенных на 1 день 270 млрд. руб. банки взяли у ЦБ 211 млрд. под 5,30% (ставка рынка 5,53%).

Европа тоже была полна ожиданий накануне решений ЕЦБ и стала резко снижаться после их объявления. Торги закрылись минусом, FTSE 100 =-0,88, DAX =-2,2, CAC 40 =-2,68%. Оставив все по-прежнему (ключевая ставка = 0,75%)., ЕЦБ объявил, что разрабатывает новый механизм антикризисных интервенций на рынке облигаций еврозоны, который позволит осуществлять прямые операции на открытом рынке.

Из других новостей отметим, что SandP подтвердило высокие рейтинги Германии, а в отношении Кипра их понизило с негативным прогнозом. Подтверждены рейтинги Ирландии, прогноз по долгосрочному рейтингу остался негативным, имея в виду, что ограниченный доступ страны к рынкам капитала.

Испания разместила госбумаги с повышением доходностей по всем срокам. Правительство Греции в общих чертах согласовало пакет мер по сокращению бюджетных расходов на 11,5 млрд. евро в течение двух следующих лет, детали будут объявлены в конце августа. Теперь новый план бюджетных сокращений должен быть утвержден в сентябре парламентом, после чего возможен очередной транш помощи со стороны тройки кредиторов в размере 31 млрд. евро. Но здесь есть подводные камни, все дело в том, что 1). 20 августа страна должна выплатить 3,2 млрд. евро по гособлигациям, находящимся на балансе ЕЦБ, и 2). под сокращение попадают зарплаты бюджетникам, пенсии и другие социальные выплаты, что, учитывая сильную оппозицию, которая только и ждет момента подставить правительство, будет непросто провести через парламент.

Банк Англии также оставил учетную ставку без изменения в 0,5% годовых. Но если решение Банка Англии, как и в случае с ФРС, совпало с ожиданиями рынков, то от ЕЦБ ждали большего.

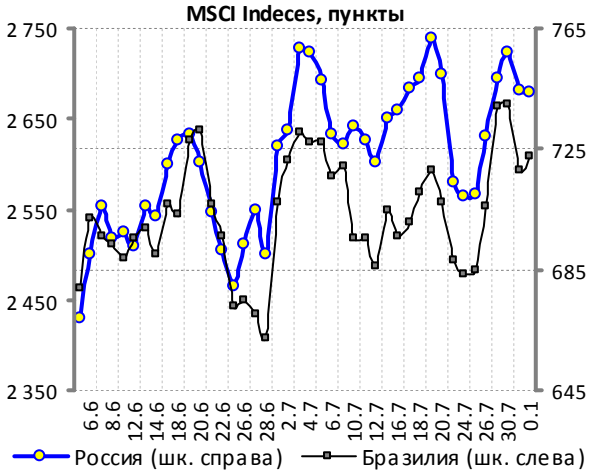
Азия. По итогам торгов четверга рост показал только Nikkei (+0,13%), остальные индексы в минусе, SSE -0,57, Kospi -0,56, Hang Seng -0,66%. Помимо негативной глобальной реакции относительно решения ФРС ничего не менять, инвесторы ориентировались на локальную ситуацию. Так, в Японии выходили хорошие корпоративные отчеты, а в Китае, напротив, на поведение инвесторов оказывали негативное влияние опасения охлаждения рынка недвижимости.

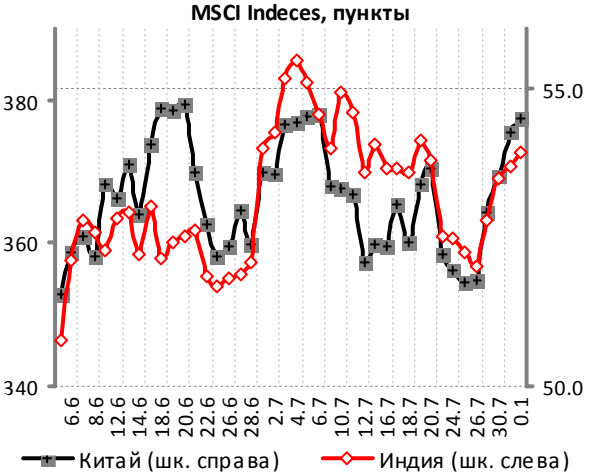
Золото. Укрепление доллара в результате решений ФРС привело к снижению цен драгметаллов, утром четверга фьючерсы на золото торговались по 1604,46 долл. за унцию, к 14.00 по 1609,18 долл., сегодня с утра золото = 1589,5, серебро = 27,16, платина = 1392, палладий = 572,3 долл./унция.

Нефть. На цены нефти влияло снижение запасов нефти и нефтепродуктов в США, которое в основном произошло вследствие уменьшения объемов импорта, а эта величина достаточно волатильная. Поэтому инвесторы на биржах хоть и отреагировали ростом, но довольно сдержанным, учитывая еще и укрепление доллара. Удерживает цены от снижения и введение США новых санкций против Ирана. Утром в четверг Brent и Light шли по105,95 и 88,75 долл. за барр., к 14.00 по 105,38 и 89, 50 долл., а сегодня с утра по 106 и 87,24 долл.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем данные по индексам деловой активности в еврозоне, а также по рынку труда в США (16.30). Если вчера с утра внешний фон был сформирован биржами США, которые к тому времени уже в полной мере отреагировали на итоги заседания ФРС, то сегодня то же самое, но уже по отношению к заседанию ЕЦБ. Фьючерсы на американские индексы сейчас торгуются от -3,0 до +0,04%, Азия преимущественно в минусе, нефть практически не растет. Наши биржи, как и все мировые площадки, не столько от ФРС, сколько именно от ЕЦБ ожидали активного решения. Теперь день уйдет на выражение разочарования, тем более, что этот день, к тому же, пятница…

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 03.08.2012.

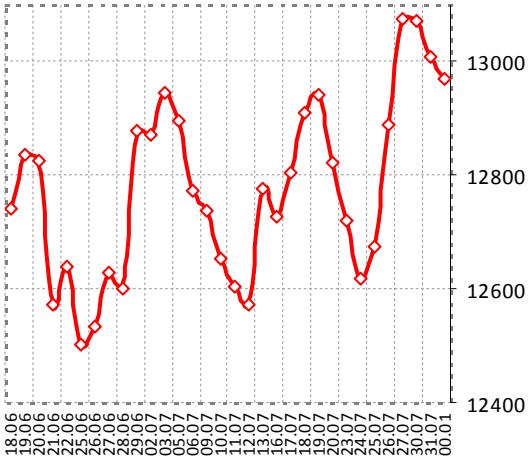




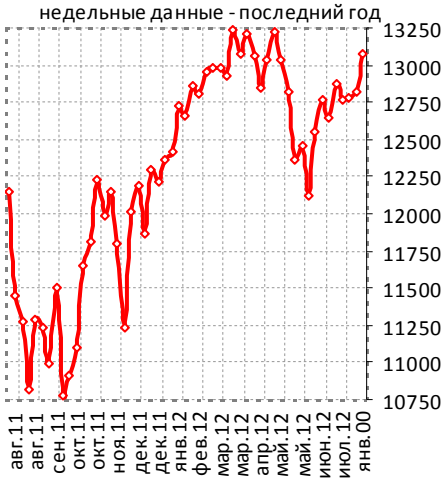
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

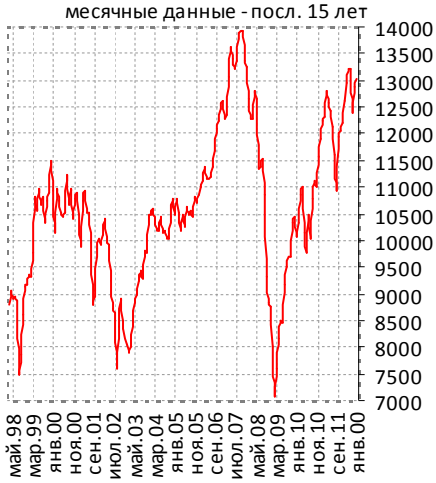
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



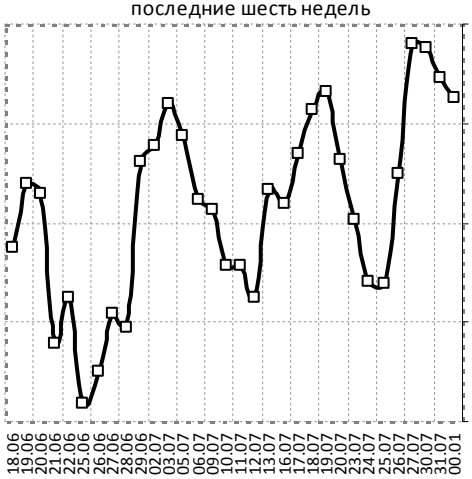
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



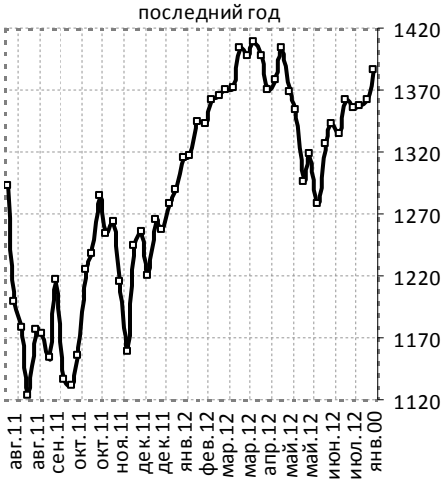
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



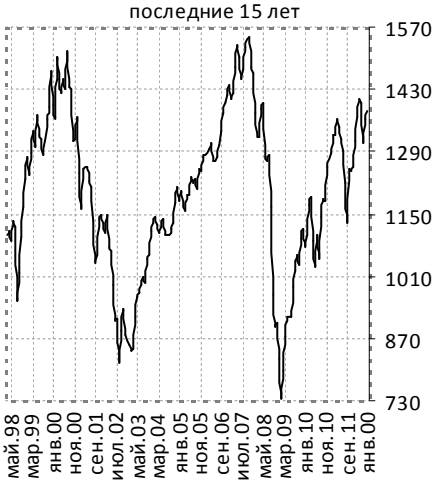
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



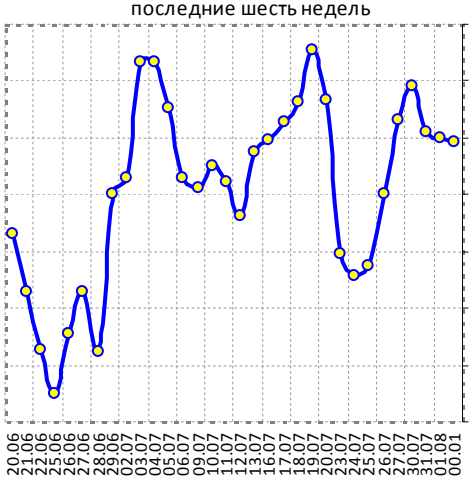
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



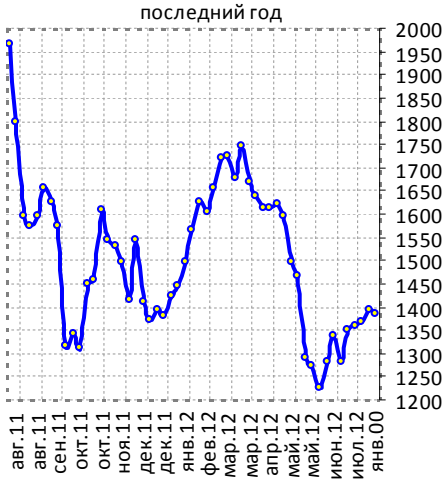
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



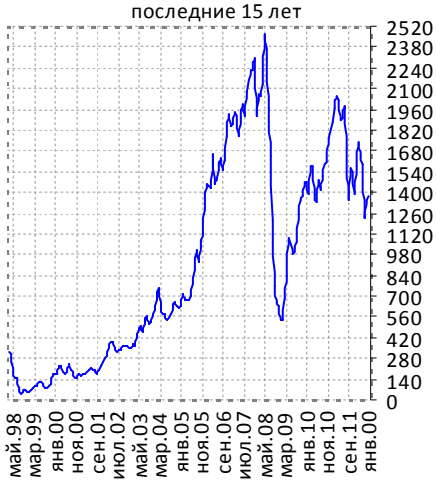
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



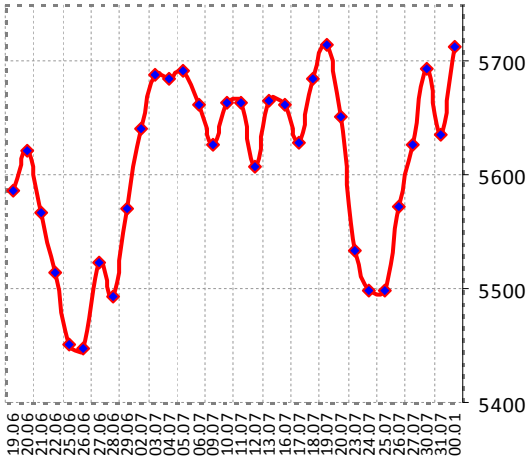
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



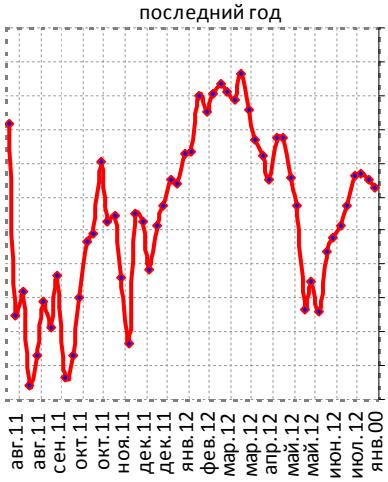
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

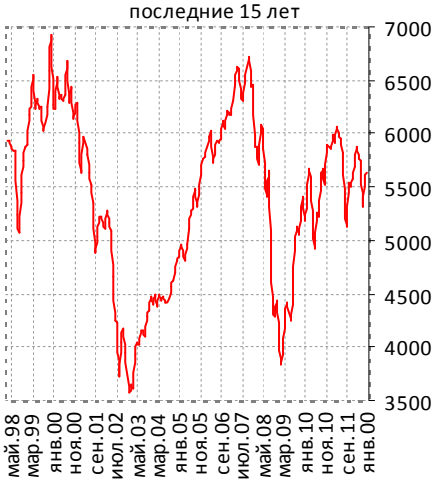
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



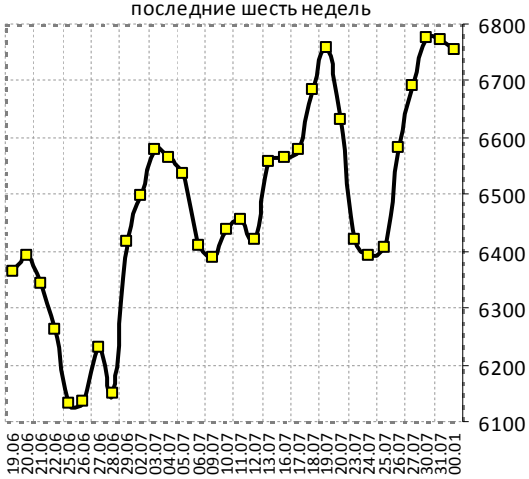
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



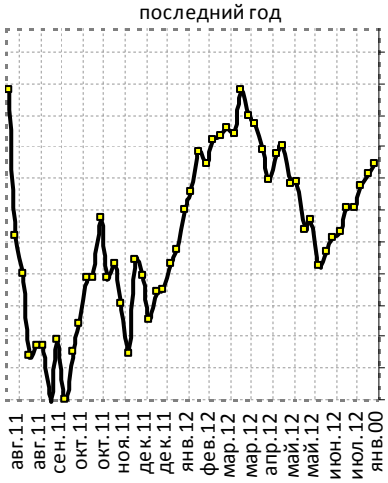
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



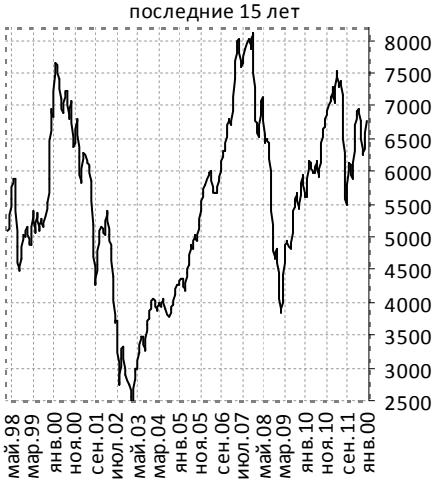
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



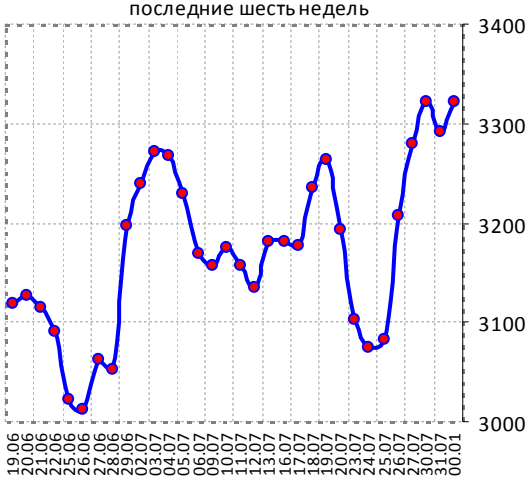
DAX Index: недельные данные - последний год



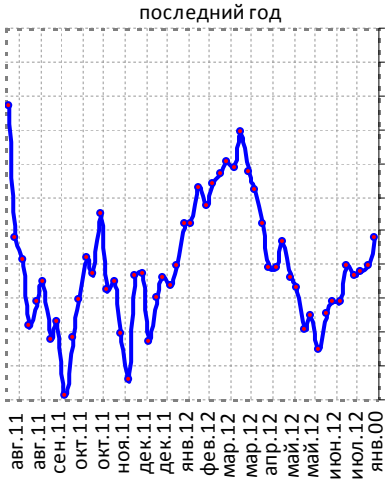
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



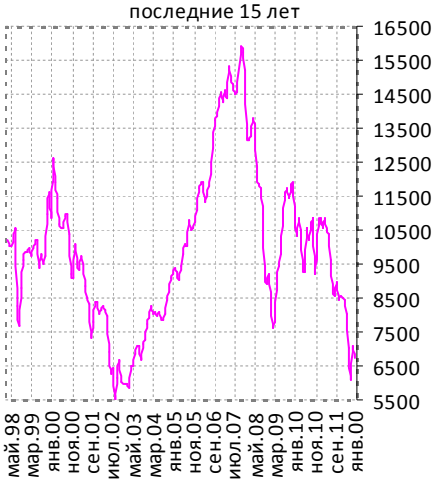
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

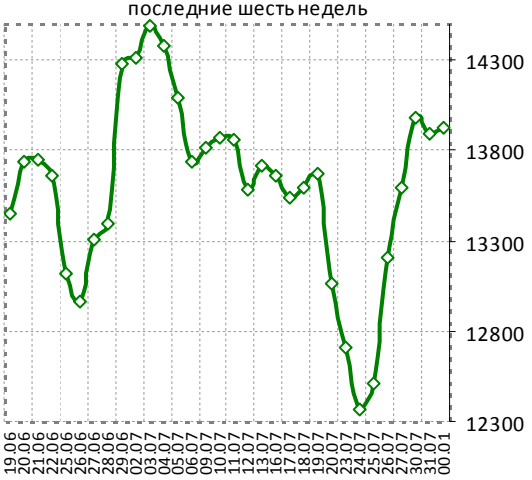


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

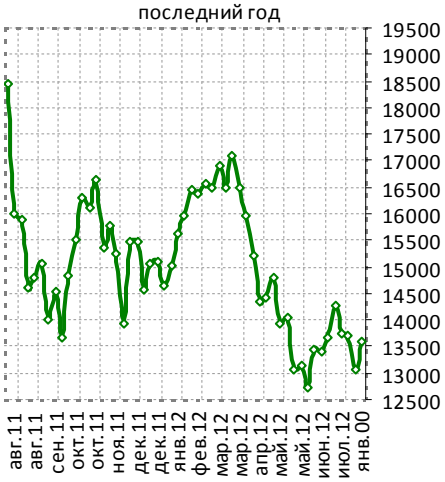


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



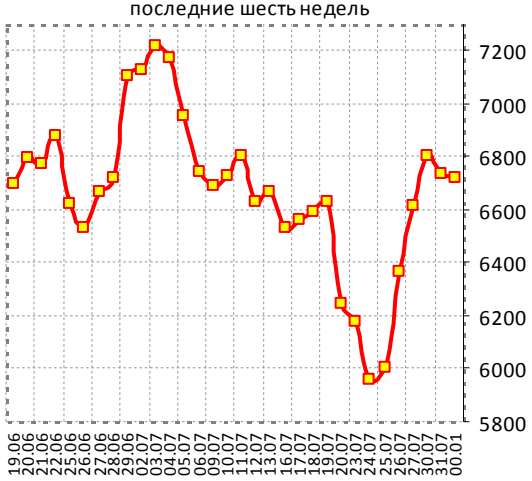
MIB Index: недельные данные - последний год



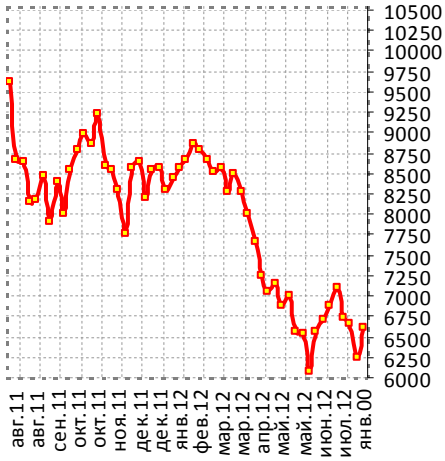
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



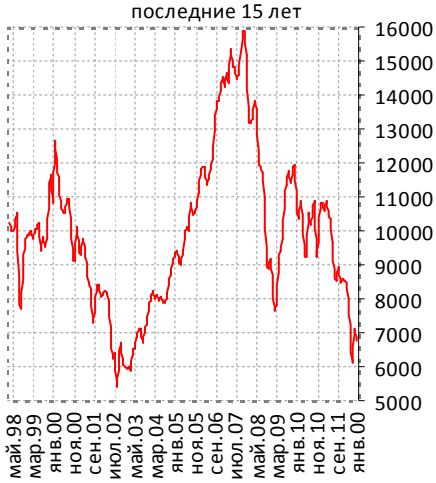
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



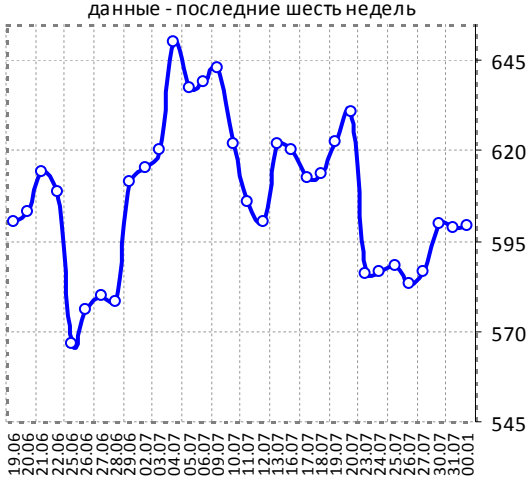
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



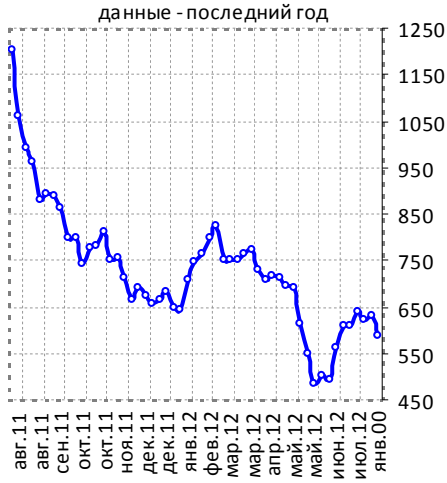
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



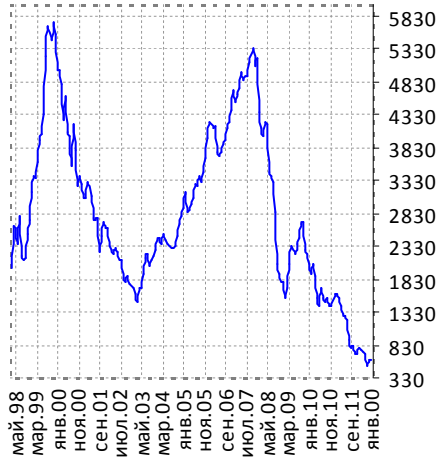
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



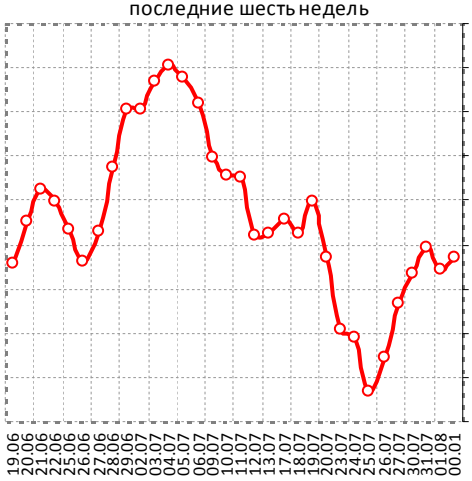
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



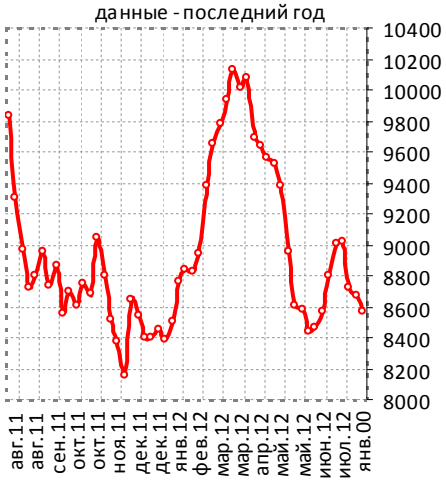
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

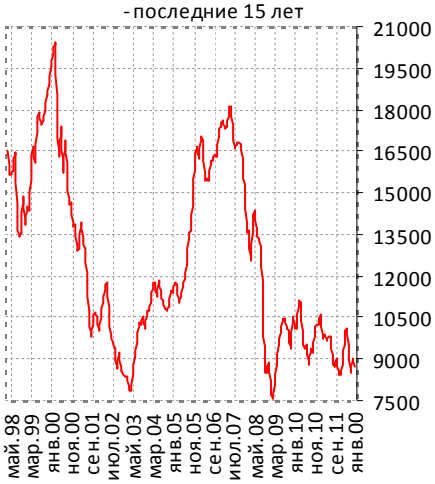
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



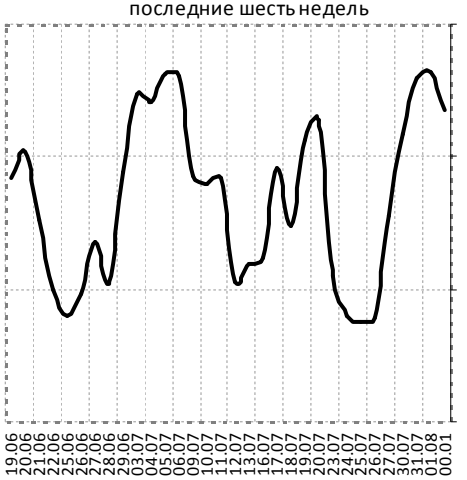
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



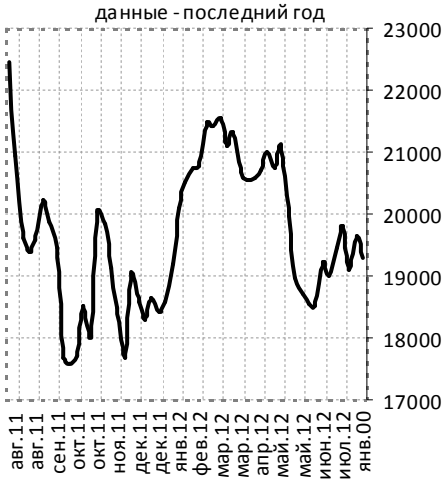
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



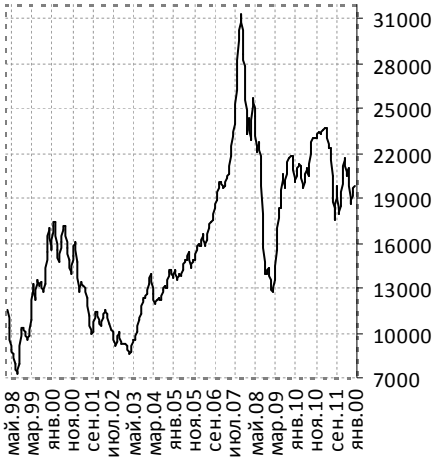
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



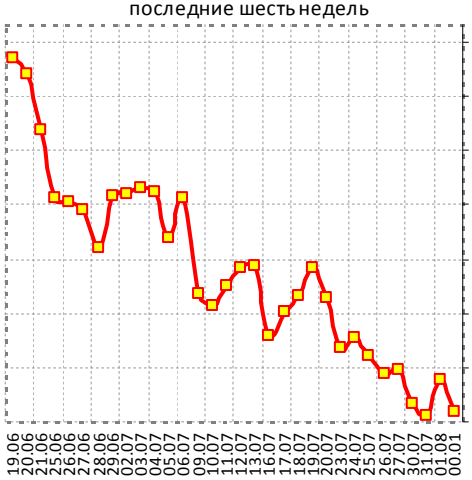
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



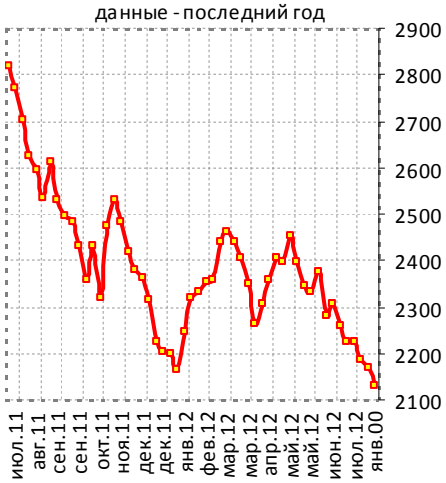
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



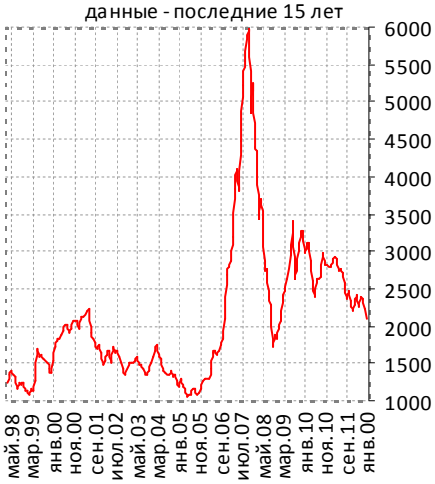
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



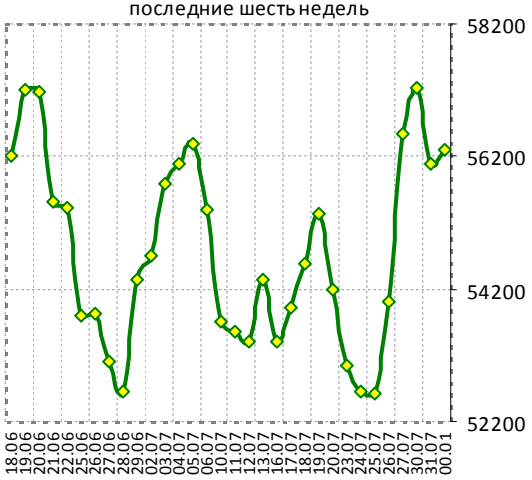
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



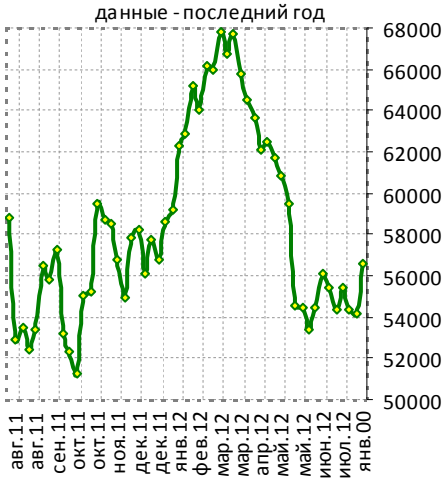
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

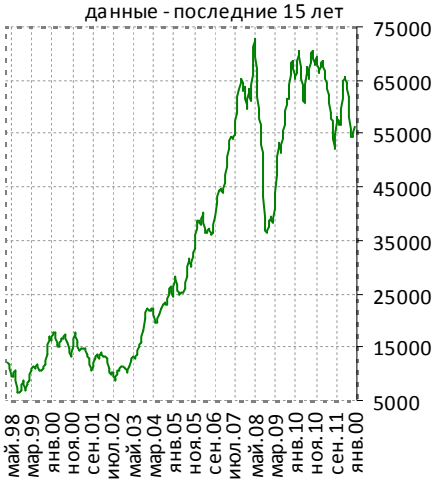
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



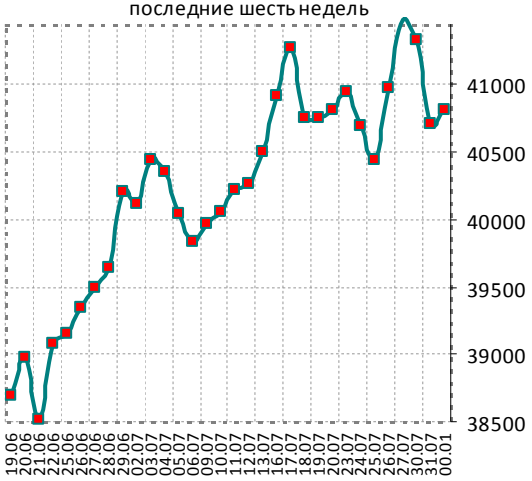
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



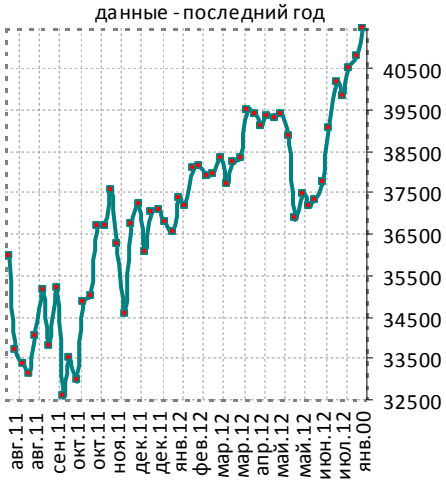
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



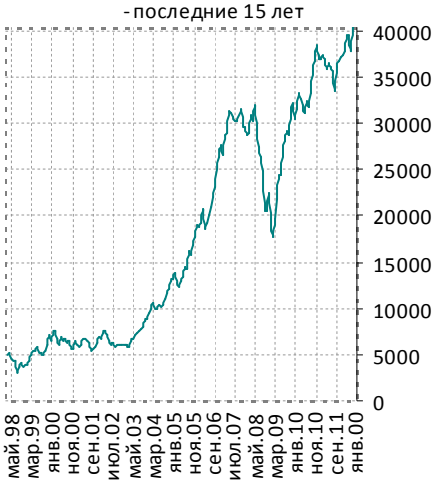
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



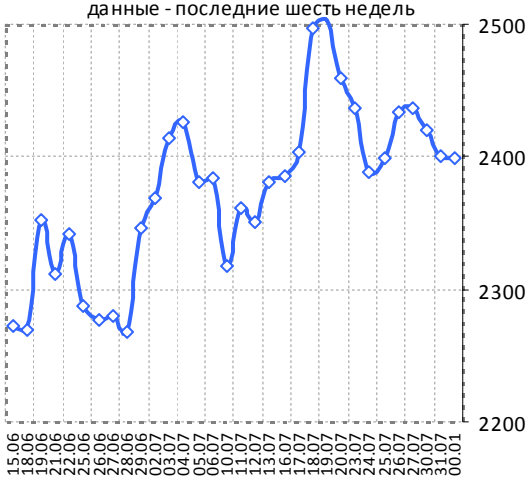
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



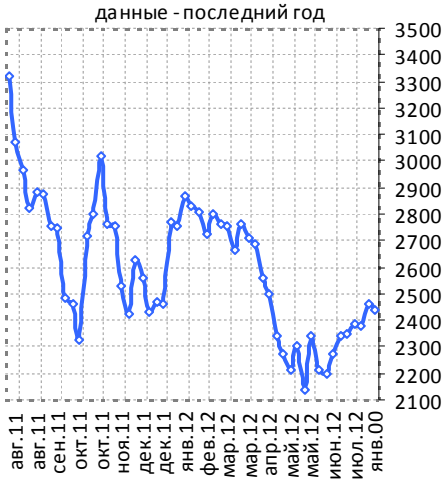
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



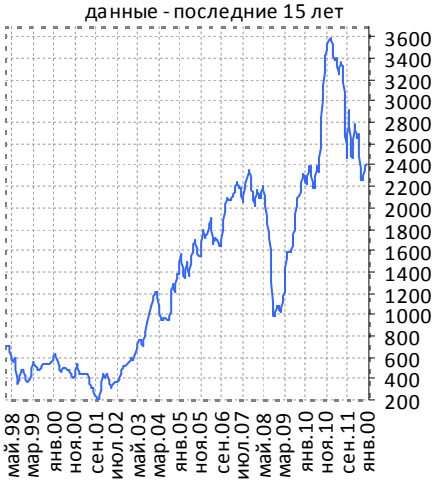
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

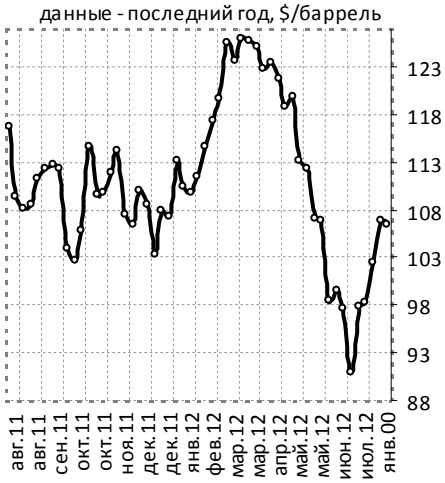
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

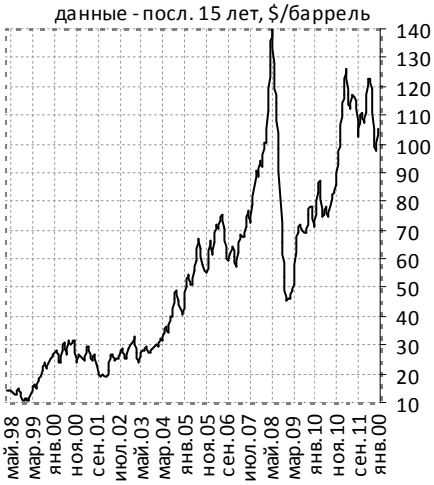
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



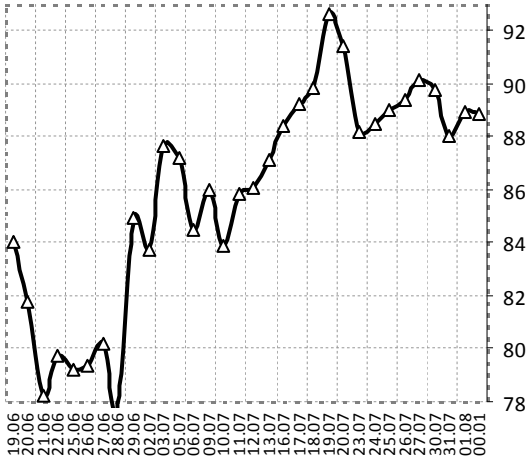
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



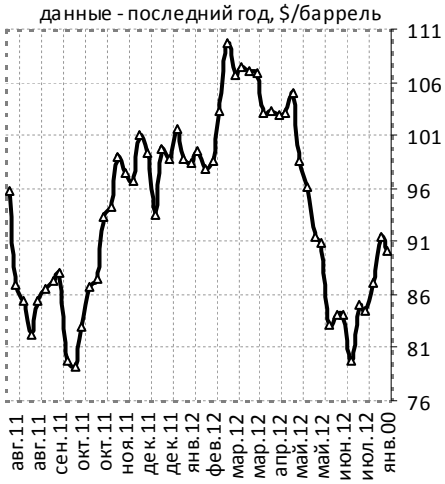
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



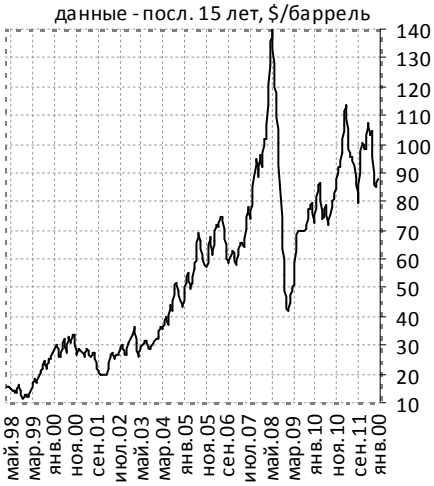
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



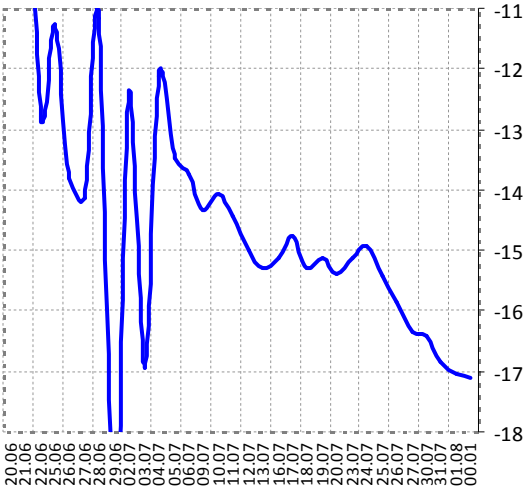
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



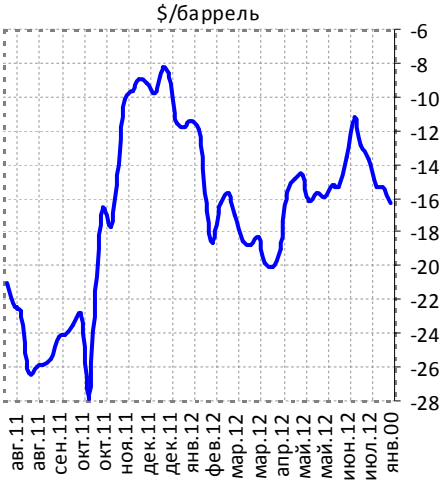
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



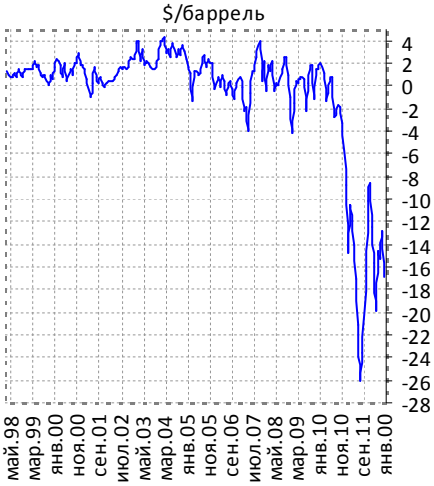
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



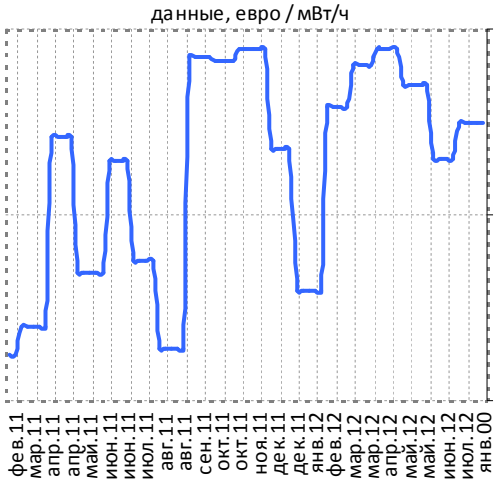
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



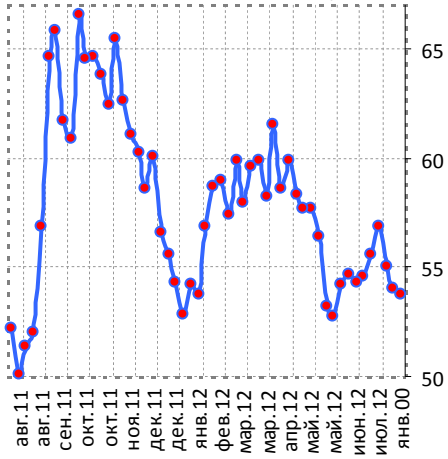
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

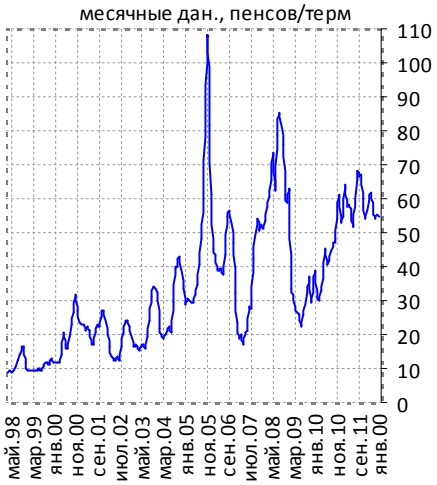
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



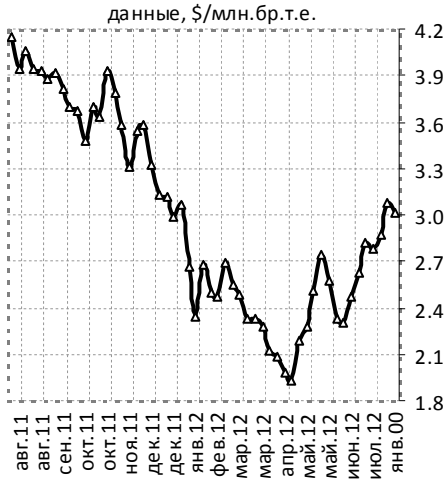
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



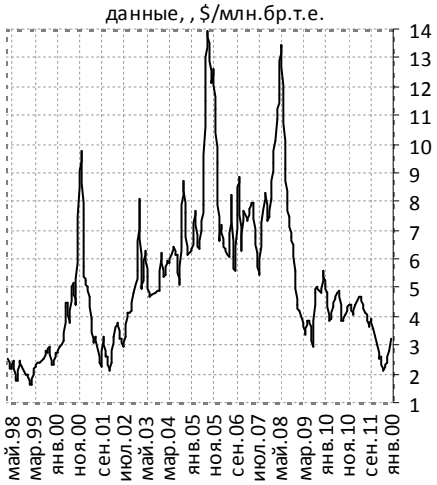
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



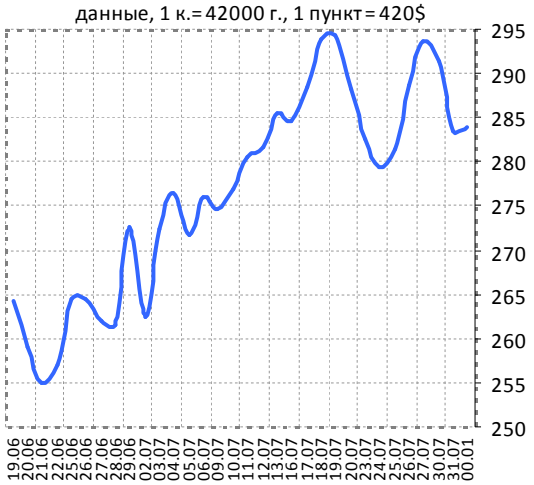
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



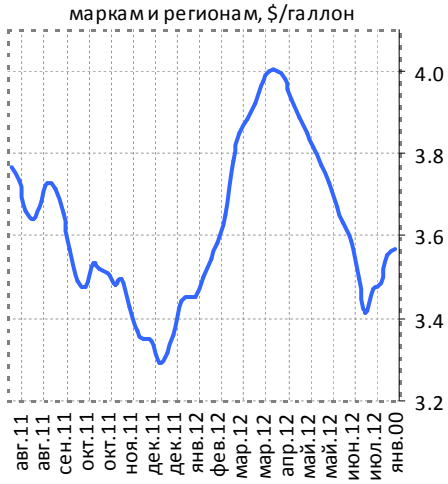
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



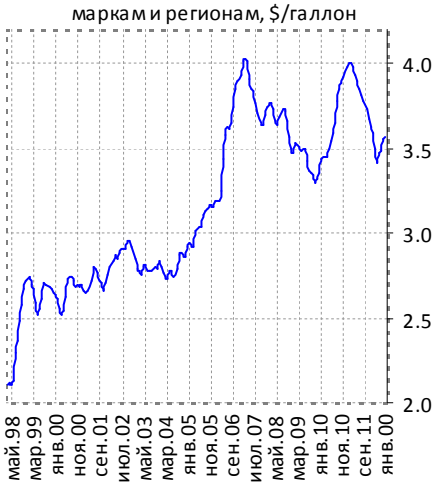
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



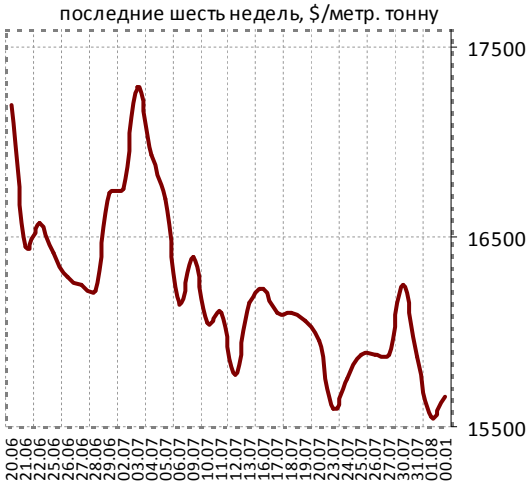
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



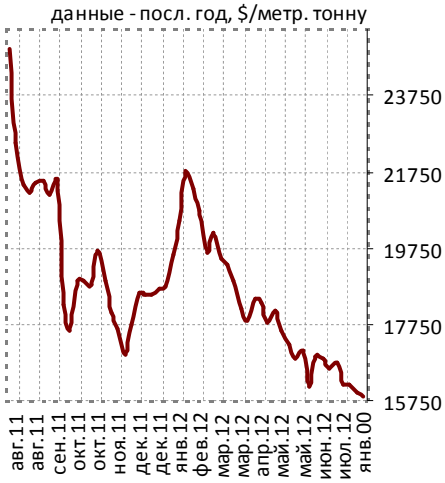
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

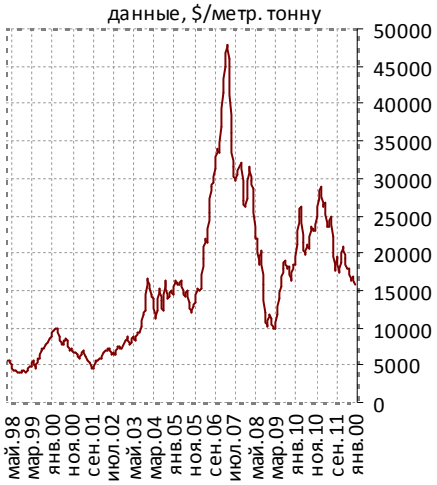
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



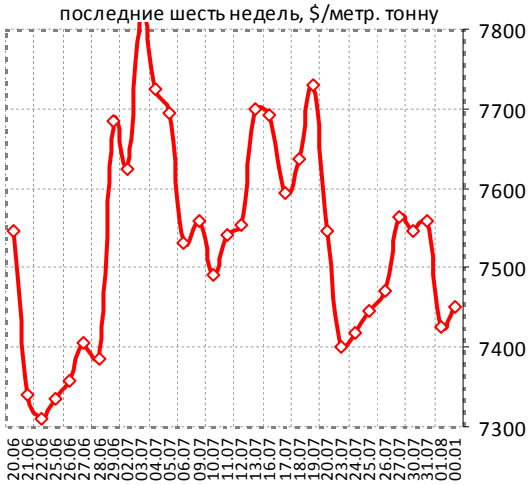
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



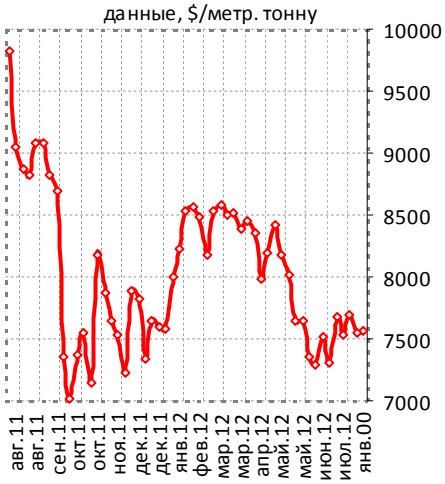
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



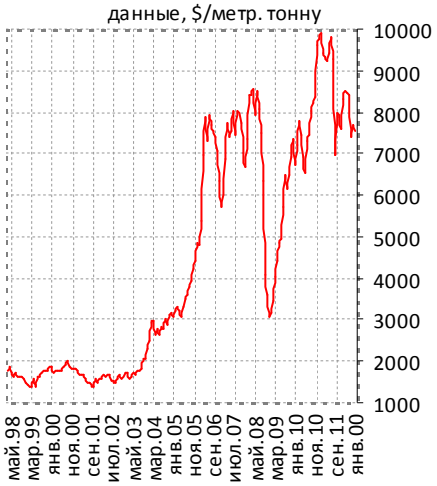
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



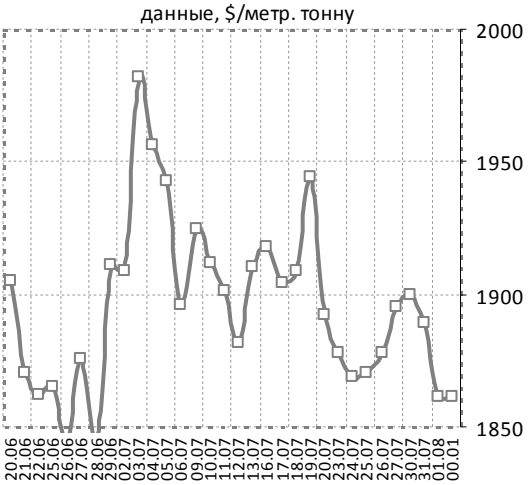
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



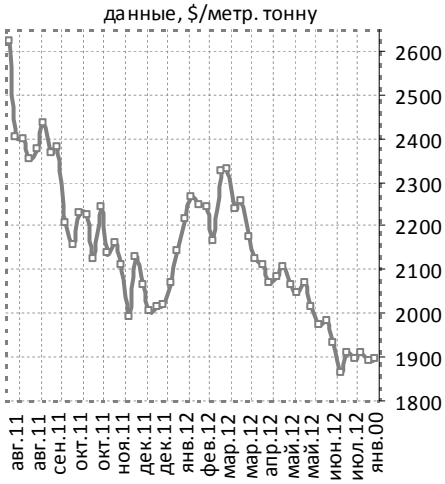
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



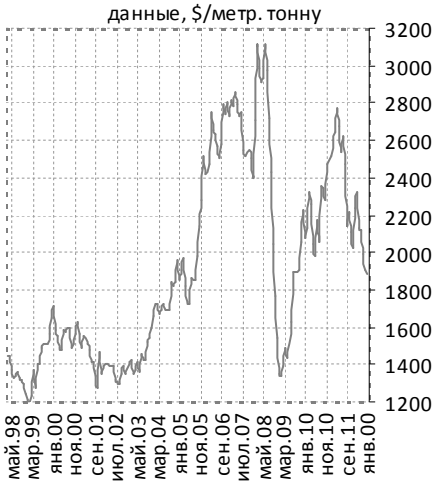
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.