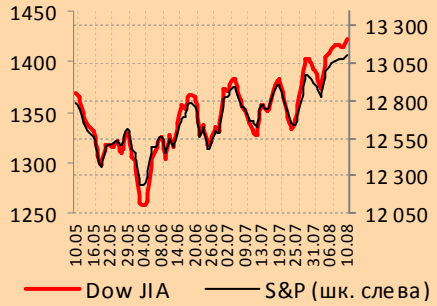
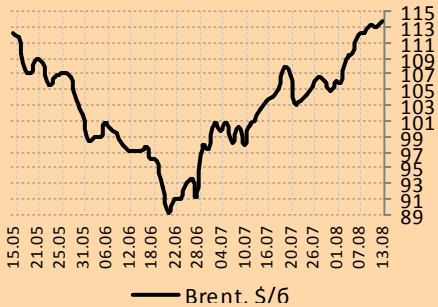
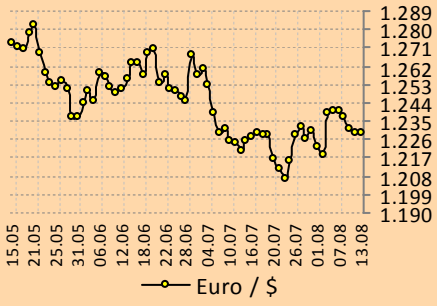
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

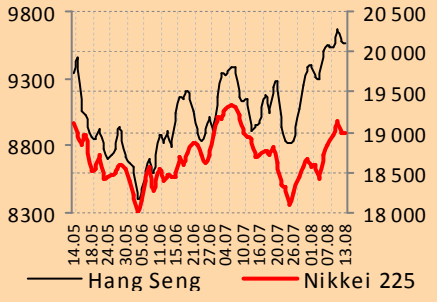
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

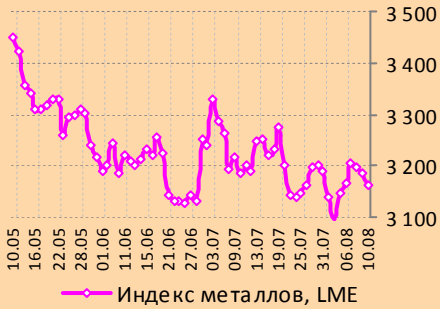
Ежедневный обзор

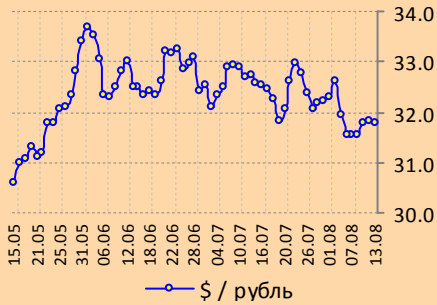






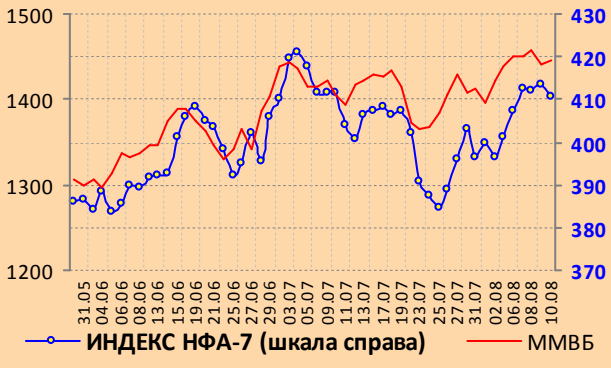






СОДЕРЖАНИЕ

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. Важной новостью стало утверждение госбюджета с дефицитом меньше, чем ожидалось. Последние данные по Китаю, после первоначального разочарования, были расценены тоже как позитивный сигнал на возможность стимулирующих мер, к примеру, снижения процентных ставок или сокращения норматива обязательных банковских резервов. Инвесторы, кроме того, чутко отслеживают малейшие намеки на количественное смягчение со стороны собственных регуляторов, на этот раз с мнением о необходимости скорейшего QE3 выступил один из руководителей регионального резервного банка, обосновывая его замедлением темпов восстановления американской экономики и ростом безработицы. В результате итоги торгов последнего дня недели в плюсе, Dow Jones =+0,32, S&P 500== +0,22, Nasdaq Composite = +0,07%.

Из интересных новостей общего характера отметим, что пять крупнейших банков (Bank of America, Goldman Sachs, Citigroup, Morgan Stanley и JPMorgan Chase) получили предписание подготовить меры на случай банкротства при замедлении роста мировой экономики, поскольку в таком случаи банки не смогут рассчитывать на помощь правительства. И еще, на Нью-Йоркской фондовой бирже начали торговаться акции английского футбольного клуба "Манчестер Юнайтед", первая торговая сессия для клуба открылась незначительным ростом котировок (на 0,21%).

Россия. Биржевые торги, как мы и прогнозировали, завершились снижением котировок, ММВБ =- 1,02, РТС =-1,37%. ЦБ РФ принял решение оставить без изменения уровень ставки рефинансирования (8%) и процентных ставок по своим операциям. Инфляция в годовом измерении составила 5,7%, что находится в плановом интервале правительства и ЦБ (от 5 до 6%).

Европа. Сессия пятницы завершилась снижением биржевых индексов, Futsee =-0,08, Dax =-0,29, CAC =-0,61%. Инвесторы негативно реагировали на новую статистику. Так, промпроизводство во Франции за месяц осталось без динамики, ожидался рост на 0,4%, предыдущее изменение -1,9%. Годовая инфляция в Италии составила 3,1%, ожидалось 3,0%, предыдущее изменение +3,0%. На фоне скандалов с рядом банков по поводу манипулирования ставкой LIBOR, председатель Банка Англии считает, что нужно вообще эту ставку отменить (и мы с ним согласны). LIBOR сейчас является ориентиром для предоставления межбанковских и корпоративных кредитов, при отмене ориентира банки сами будут устанавливать процентные ставки по кредитам, что, по крайней мере, персонифицирует их ответственность за уровень процента.

Азия. Результаты сессии пятницы преимущественно в минусе, индекс Nikkei понизился на 0,97, SSE на 0,24, Hang Seng на 0,66%, Kospi увеличился на 0,30%. Виной стала статистика по Китаю, так, рост промпроизводства составил в годовом измерении 9,2% (ожидали 9,7%), с начала года 10,3% (ожидали 10,4%). Розничные продажи выросли на 13,1%, ожидали 13,5%. Инвестиции в средства производства, за исключением сельскохозяйственных районов, увеличились с начала года на 20,4%, ожидали 20,6%. Можно видеть, что основной негатив показателей в том, что все они ниже ожиданий. Правда, есть и факты, в Китае, в связи с ростом нефтяных цен и впервые за последние пять месяцев, повышены цены на бензин и дизельное топливо.

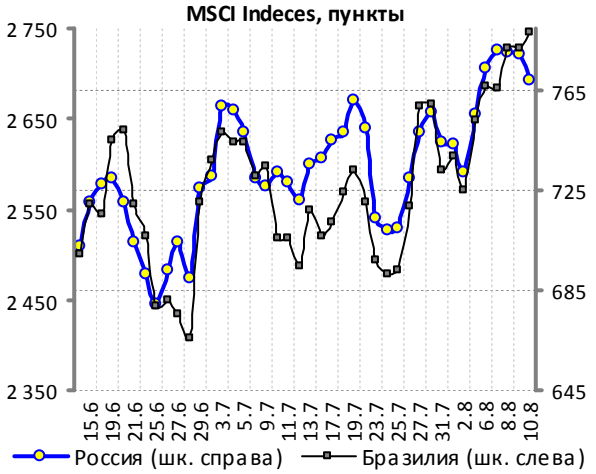
В Японии промпроизводство за месяц увеличилось на 0,4%, а в годовом измерении снизилось на 1,5%, тоже не оправдав прогнозов. ВВП страны, согласно утренней информации, вырос во втором квартале относительно первого квартала на 0,3%, ожидалось увеличение на 0,6%, предыдущее изменение +1,2%.

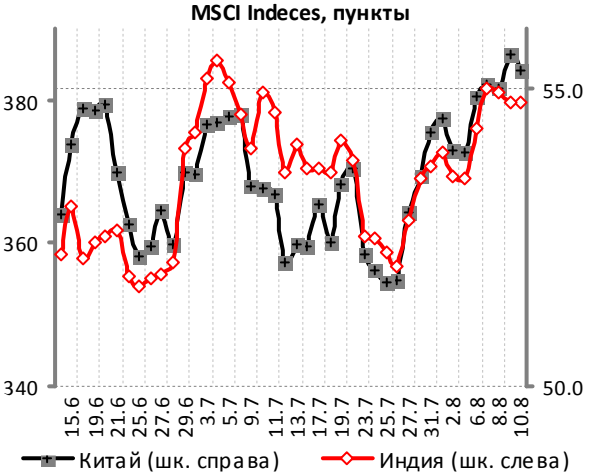
Золото. Снижение внешнеэкономических показателей Китая, вызвав первоначальную негативную реакцию, усилило надежды на стимулирующие действия правительства и Народного банка. Утром пятницы фьючерсы на золото торговались по 1616,93 долл. за унцию, к 14.00 по 1611,76 долл., на закрытии по 1622,8 долл.

Нефть. Кроме данных по замедлению темпов роста импорта и экспорта в Китае, все другие факторы удерживают цены от снижения. Так, ОПЕК оставила практически неизменным прогноз мирового спроса на нефть в текущем и следующем годах, уменьшились запасы нефти и нефтепродуктов в США. На Light также влияют опасения формирования урагана в районе, где расположено около 30% всех нефтедобывающих мощностей США, Brent может получить поддержку от сокращения поставок нефти из Северного моря (в сентябре начинается профилактический ремонт на платформах), сентябрьские фьючерсы на Brent уже дороже октябрьских. Отыграв статистику по замедлению китайской экономики (утром пятницы Brent и Light шли по 113,23 и 93,42 долл. за барр., к 14.00 по 110,60 и 92,61 долл.), цены начали восстановление, торги закрылись соответственно на 112,95 и 92,87 долл. Развивается ближневосточная тема: Саудовская Аравия уведомила Израиль о намерении сбивать самолеты израильских ВВС, если они направятся в Иран через воздушное пространство королевства.

Прогноз. Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются в минусе от 0,57 до 0,22%, Азия от -0,54 до -0,01%, нефть обозначила рост, но это – единственный возможный драйвер роста для наших бирж сегодня. С оглядкой на внешнее поведение и поддержке нефти можем даже пытаться расти на комфортных ценах после предыдущего снижения.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 13.08.2012.

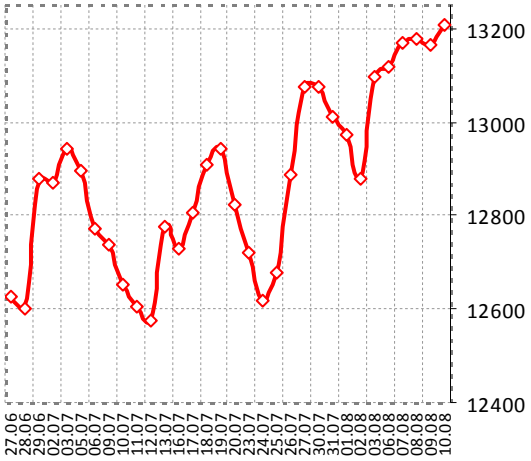




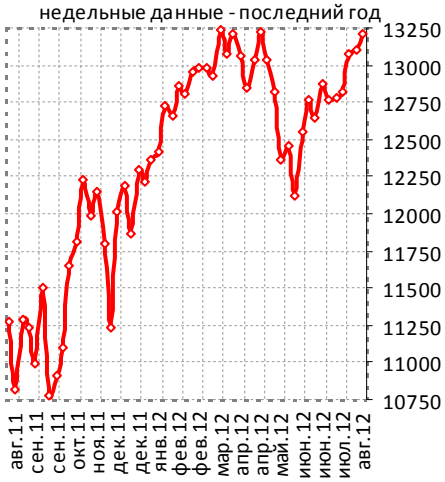
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

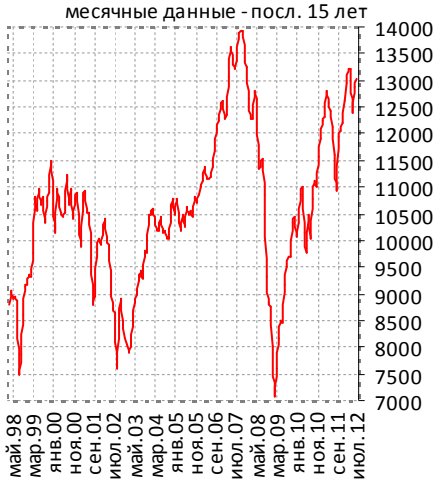
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



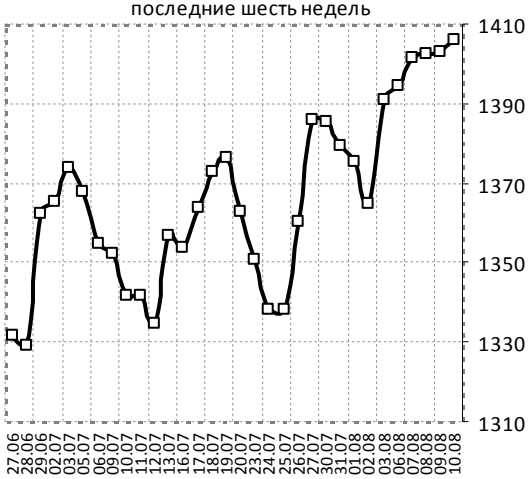
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



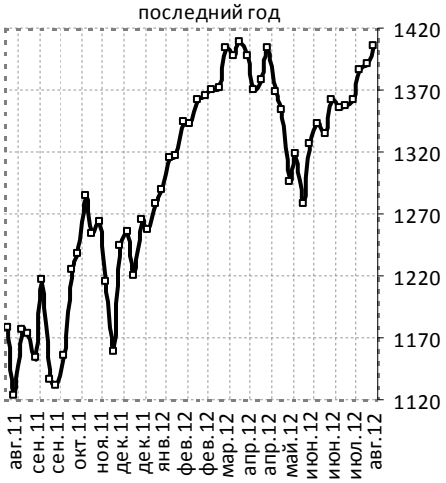
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



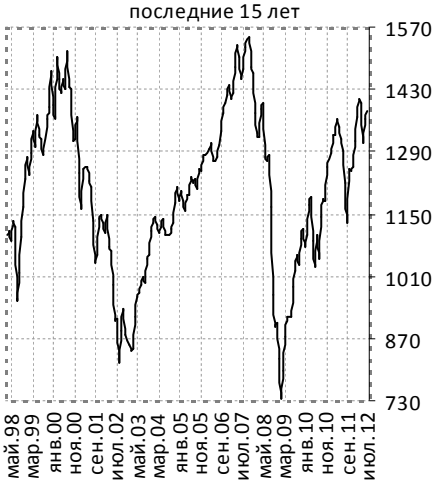
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



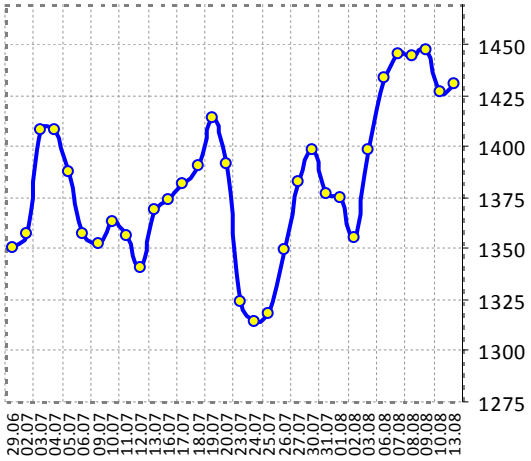
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



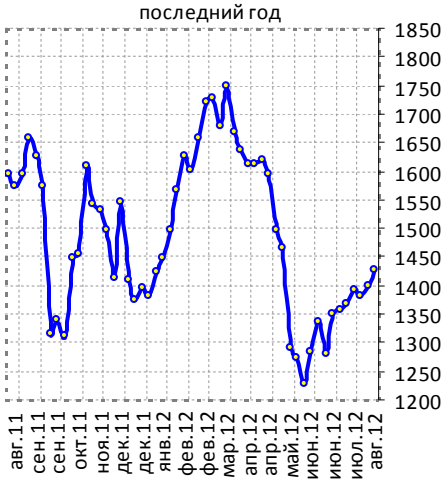
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



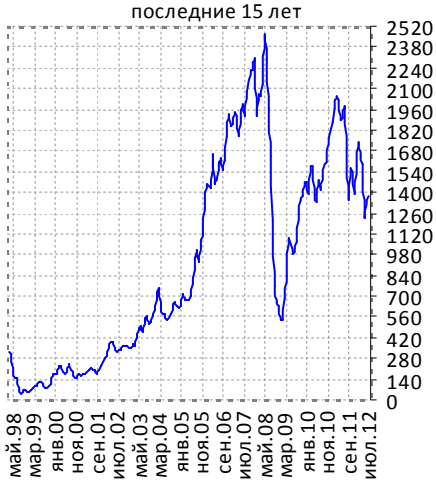
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



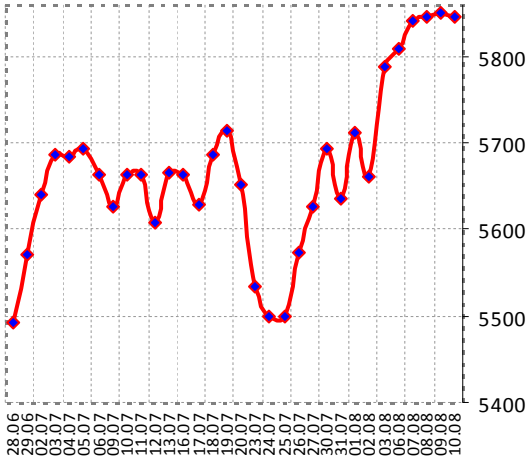
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



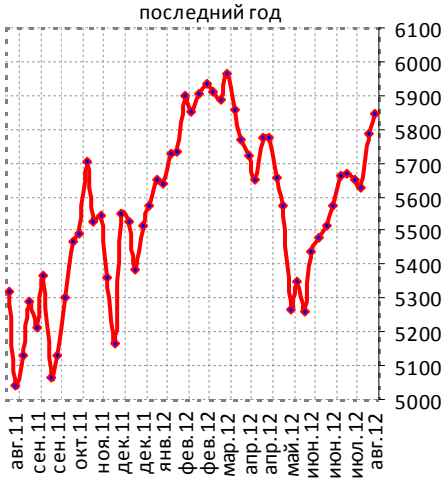
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

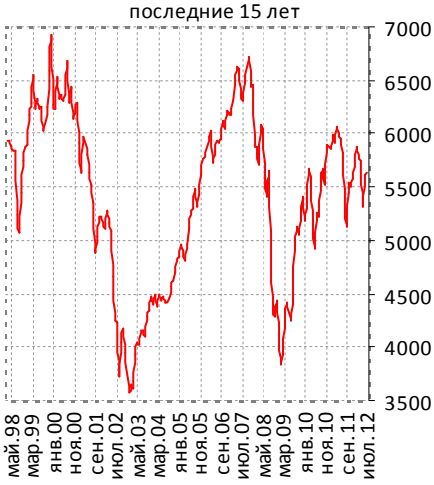
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



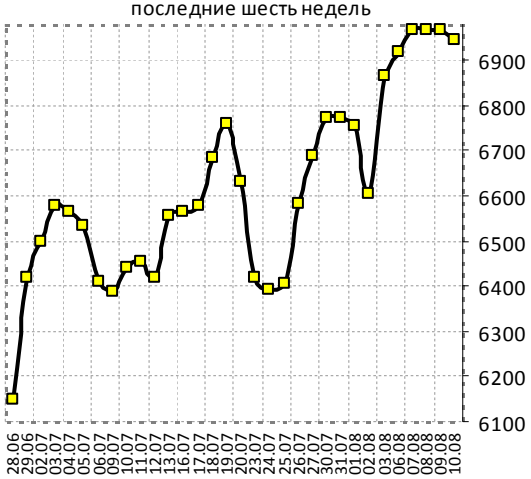
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



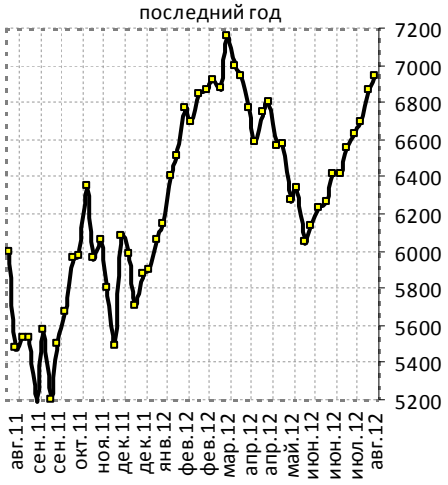
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



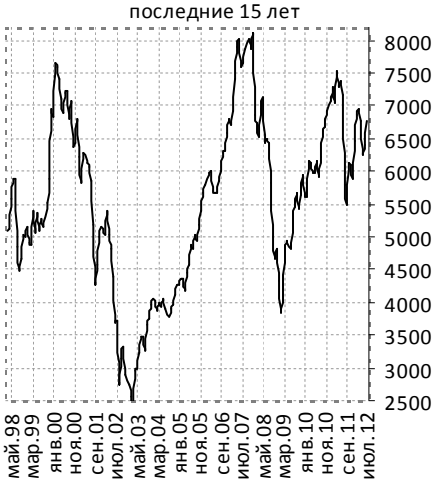
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



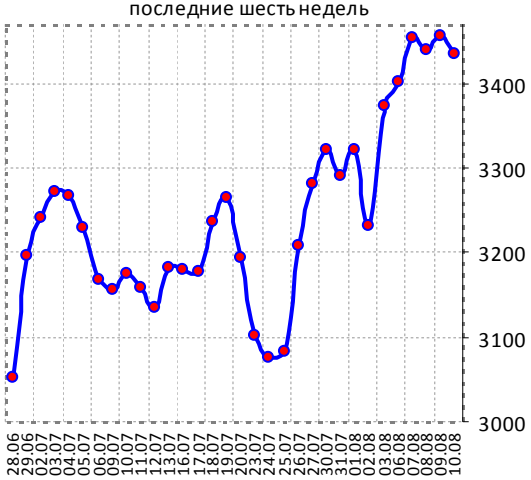
DAX Index: недельные данные - последний год



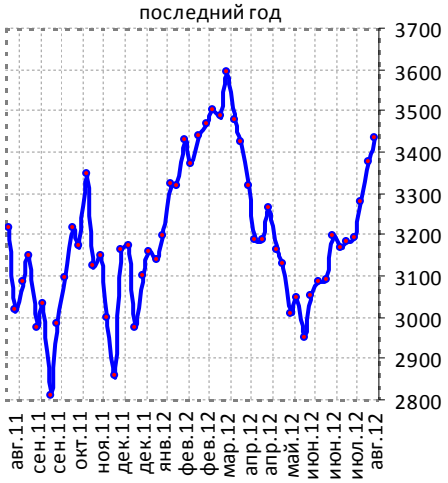
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



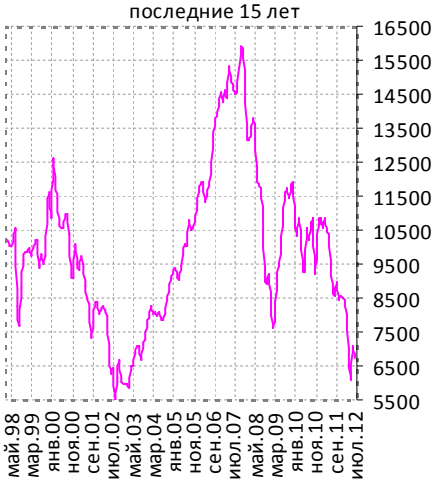
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

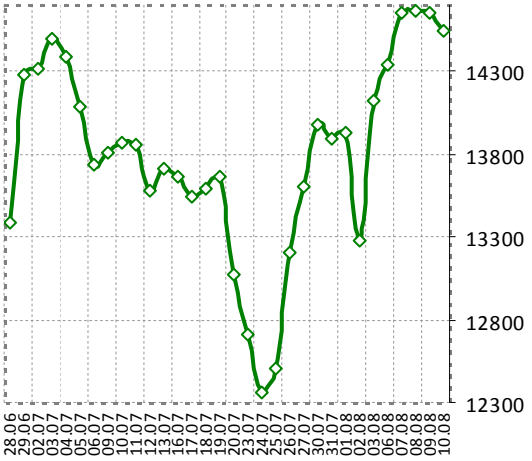


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

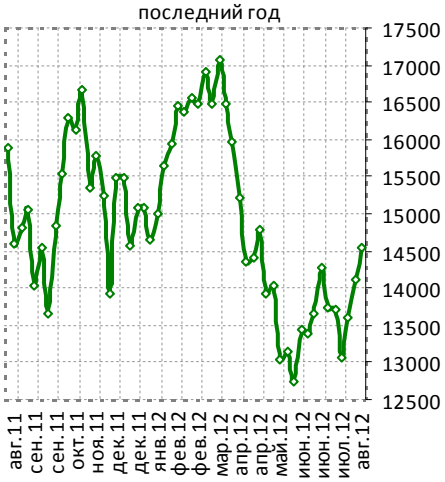


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



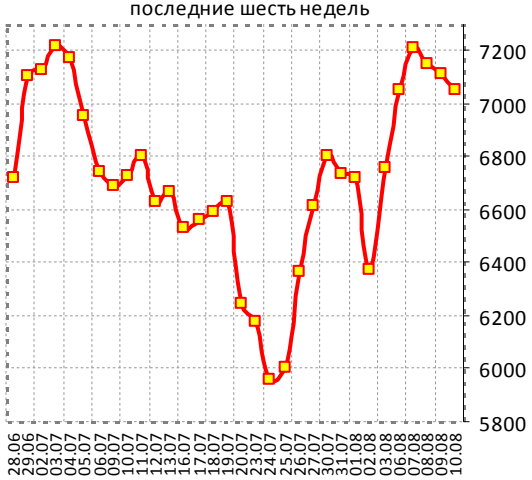
MIB Index: недельные данные - последний год



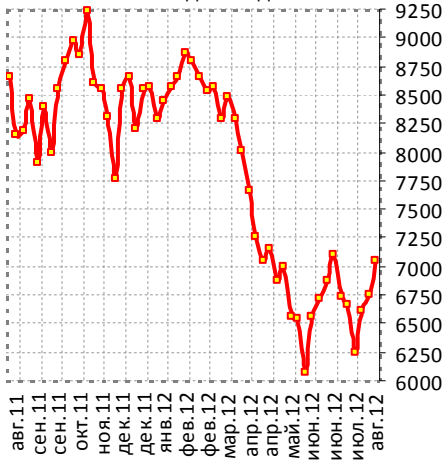
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



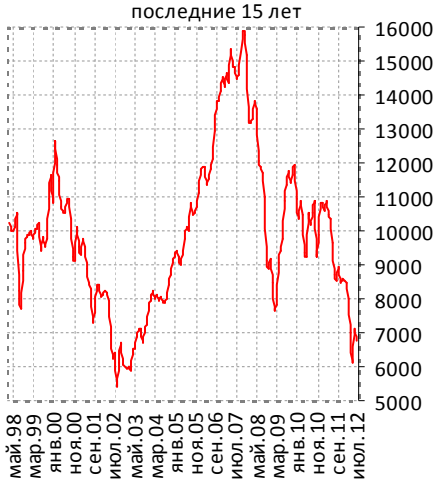
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



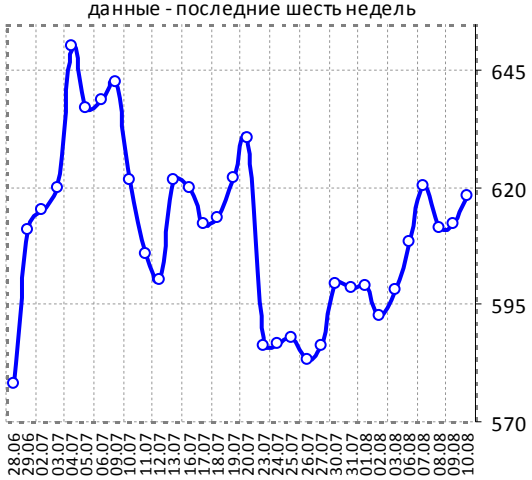
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



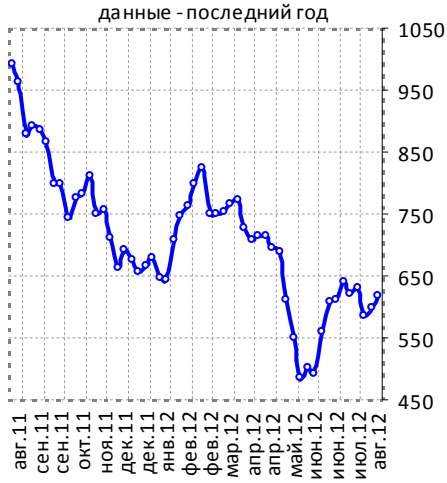
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



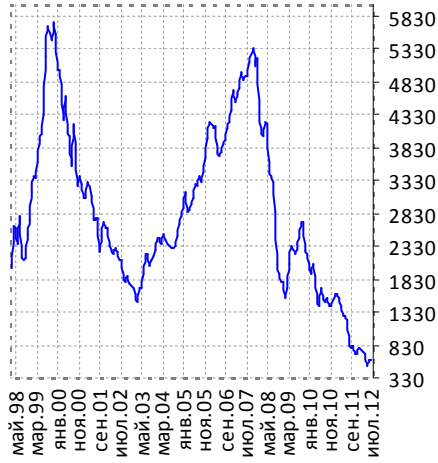
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



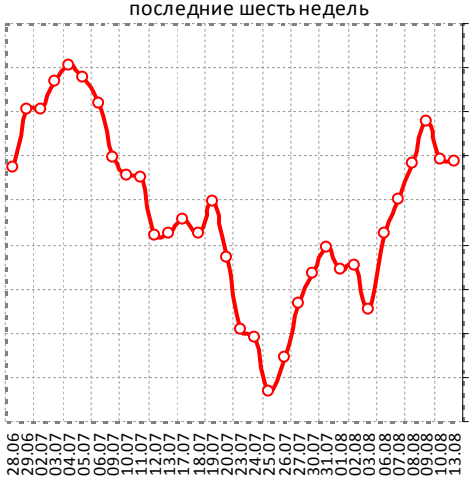
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



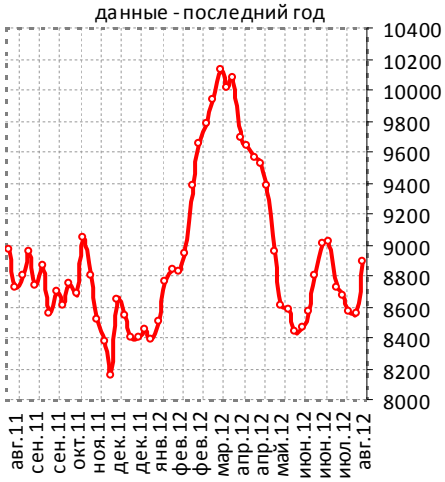
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

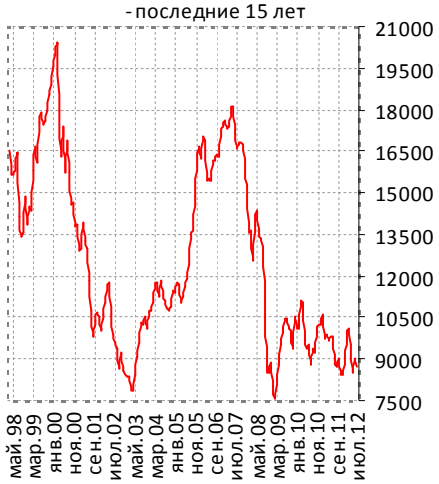
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



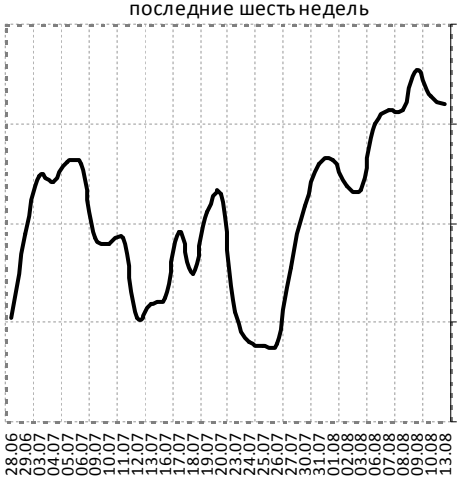
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



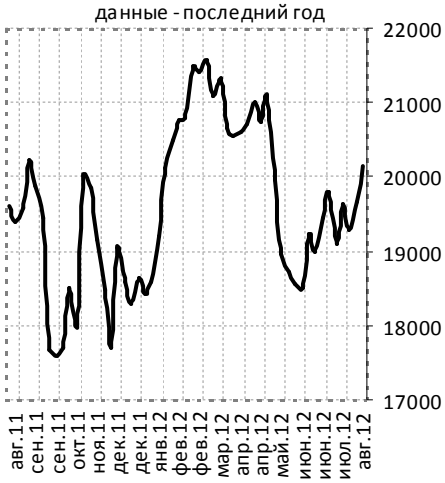
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



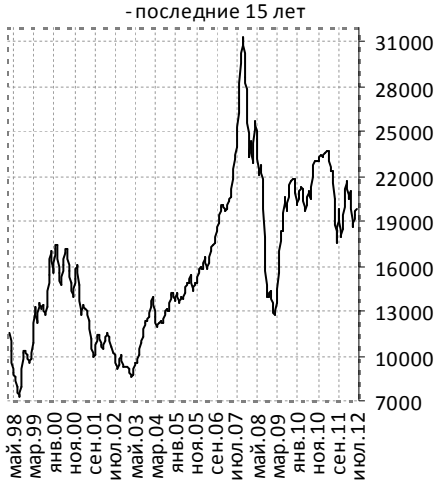
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



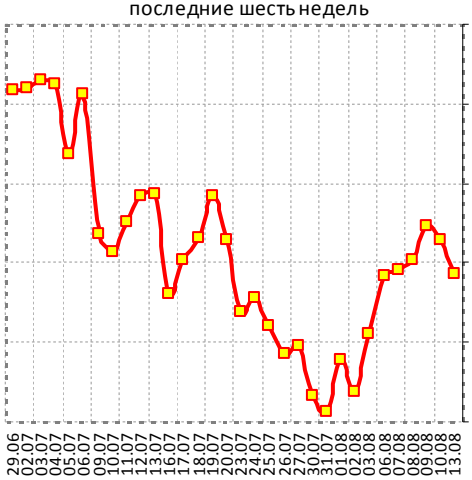
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



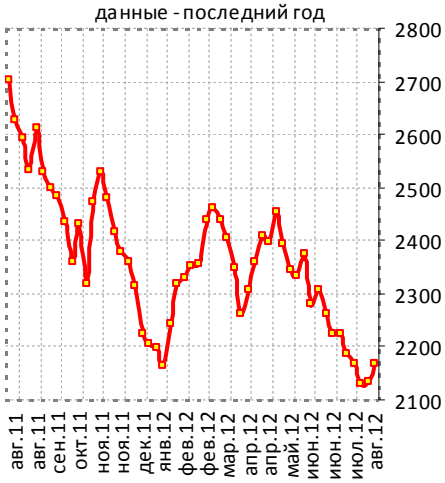
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



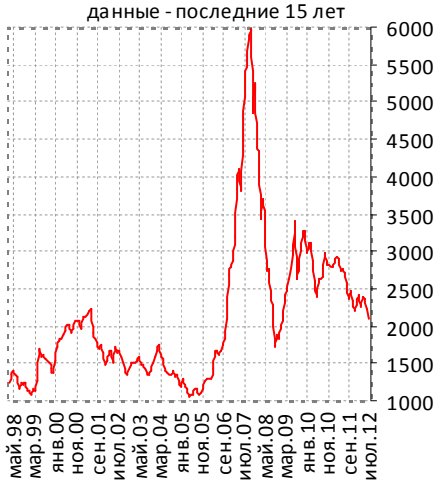
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



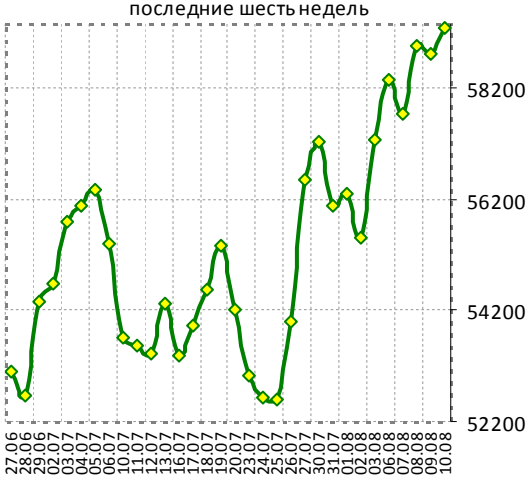
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



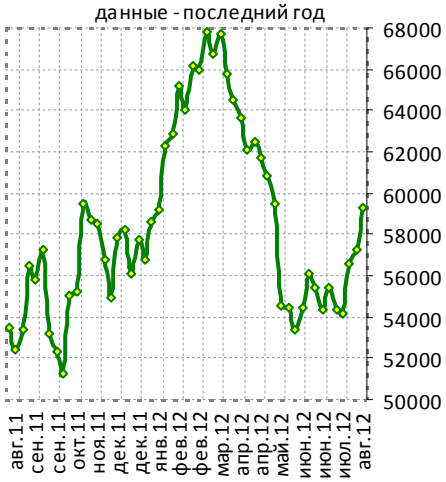
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

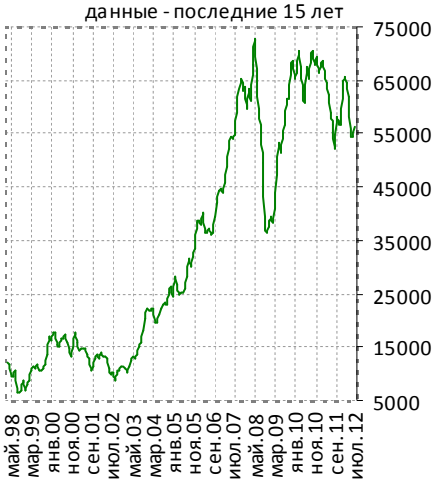
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



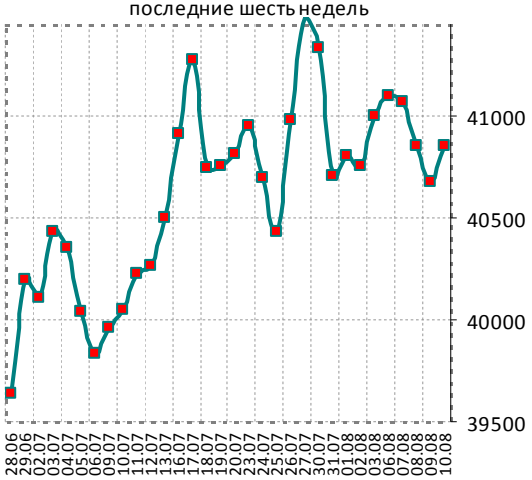
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



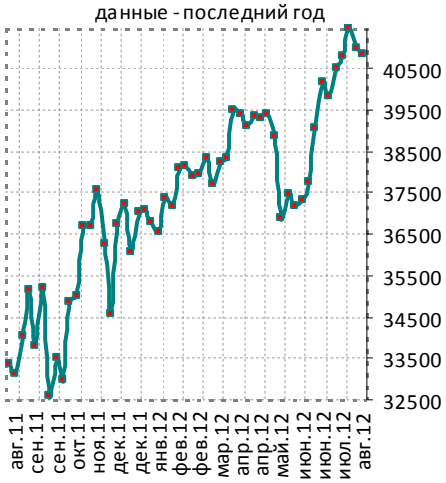
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



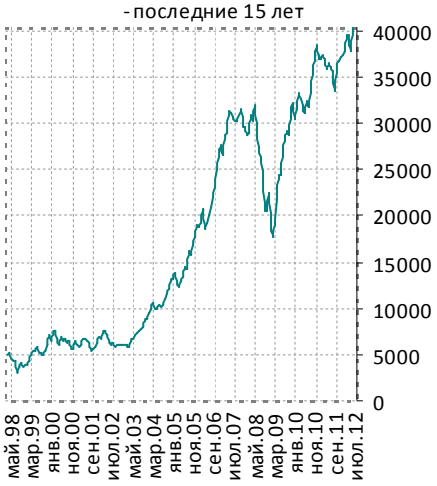
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



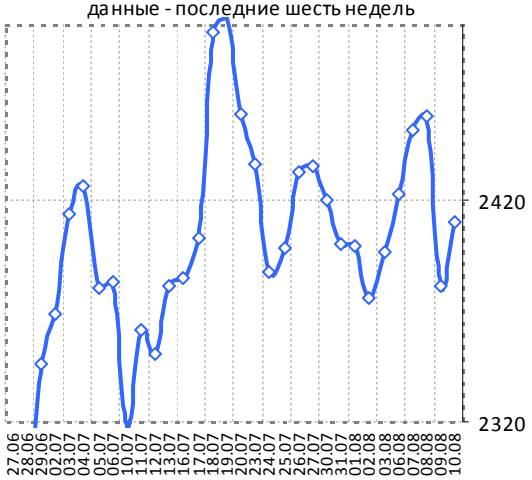
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



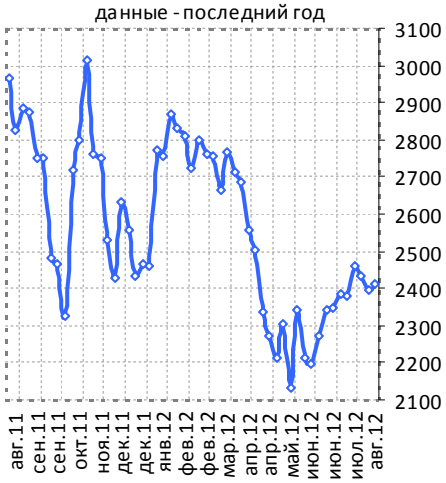
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



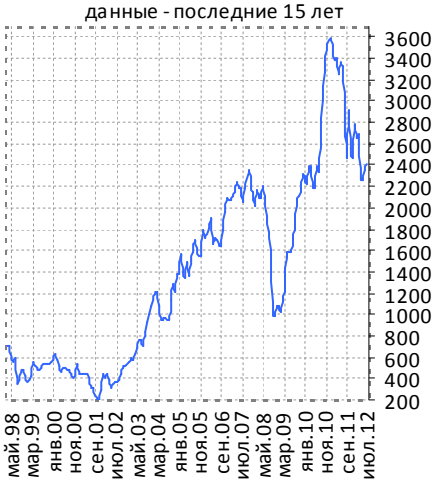
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

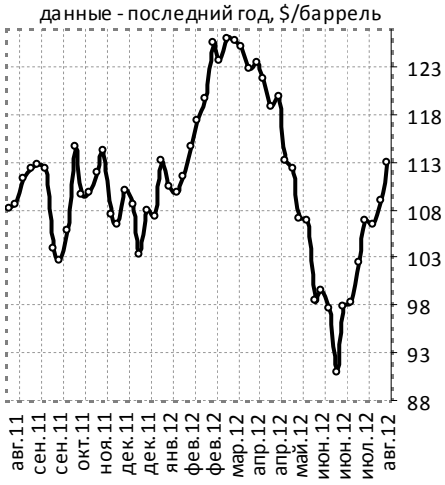
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

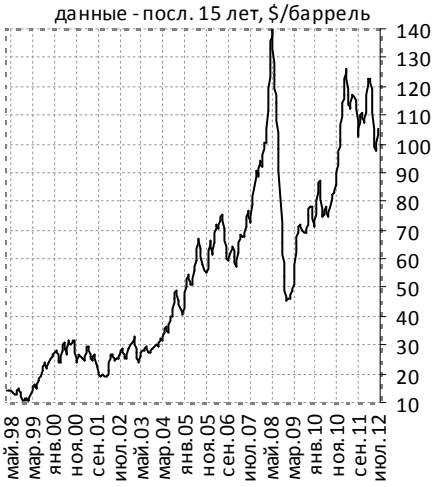
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



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



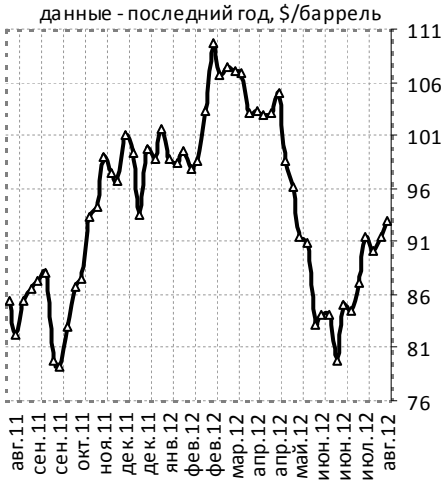
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



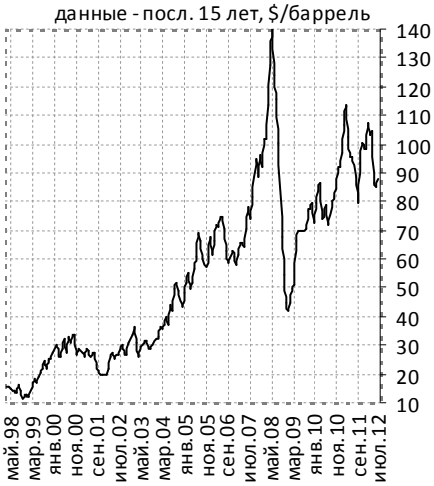
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



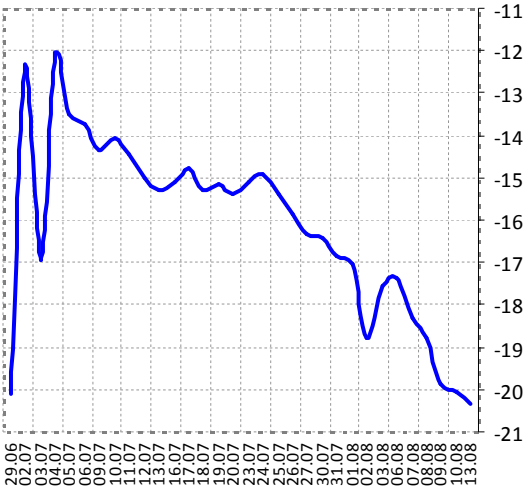
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



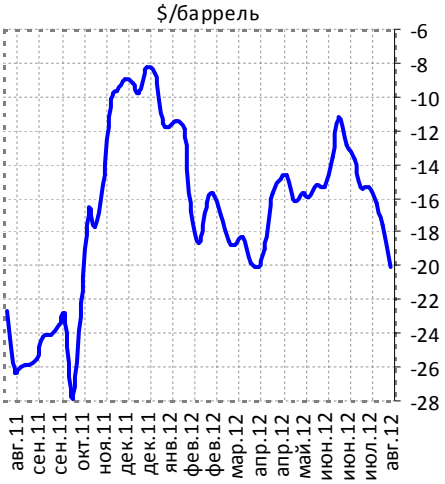
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



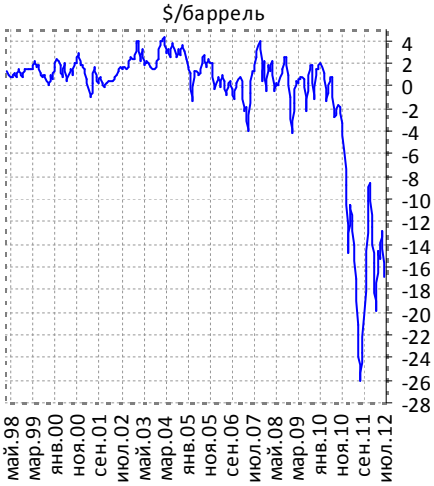
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



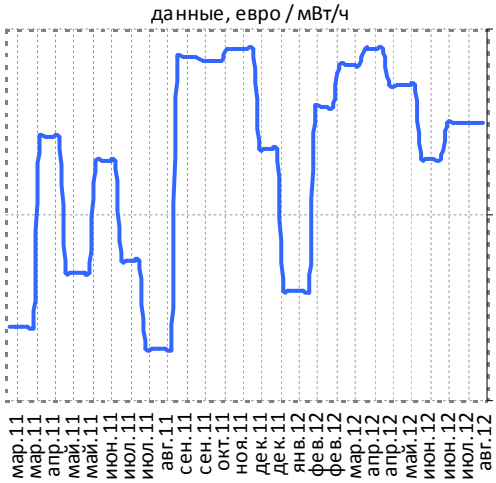
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



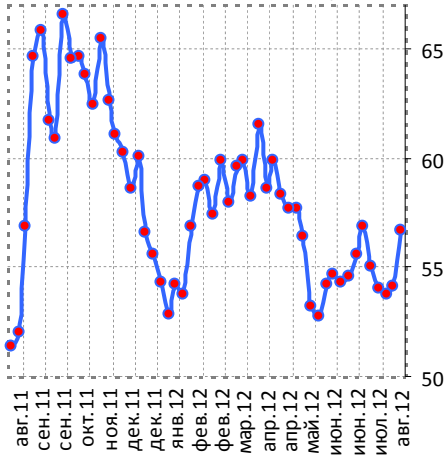
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

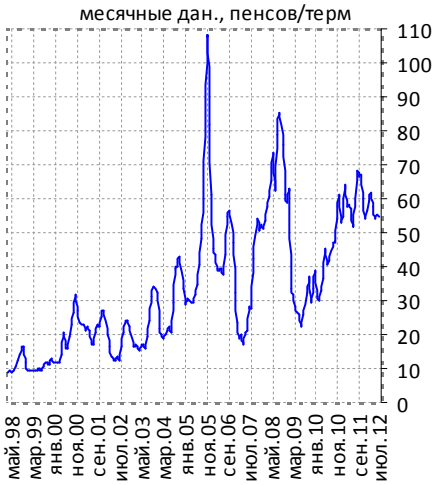
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



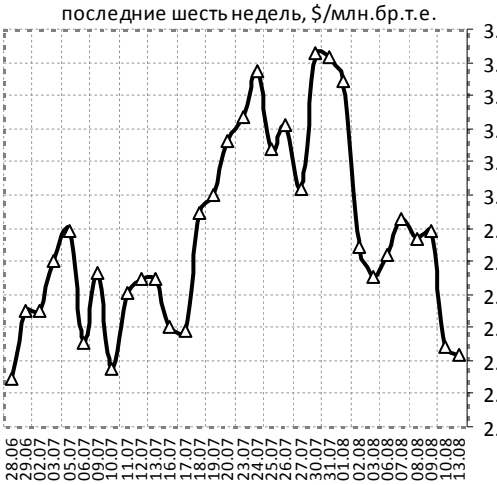
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



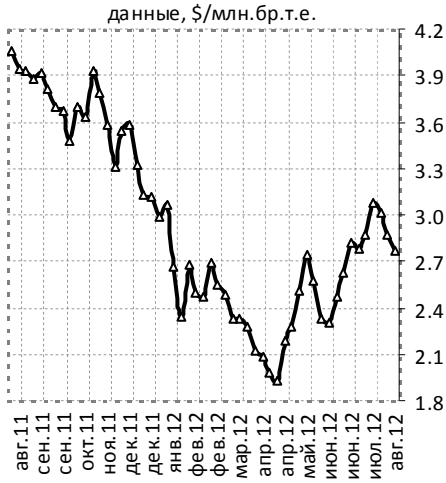
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



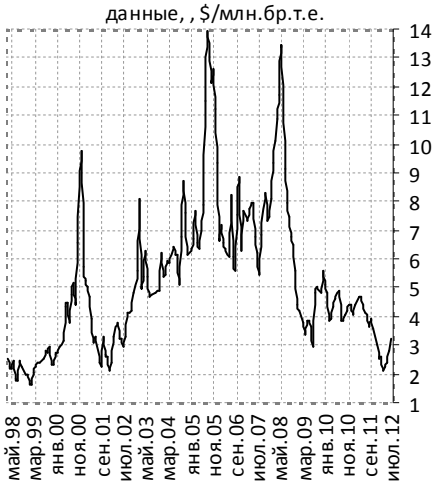
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



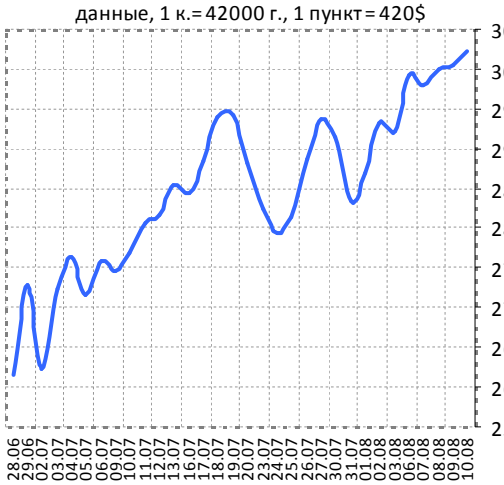
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



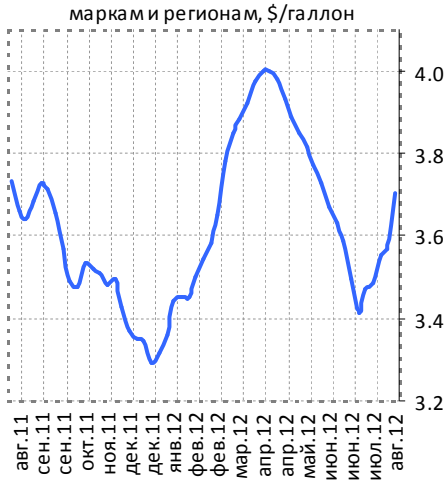
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



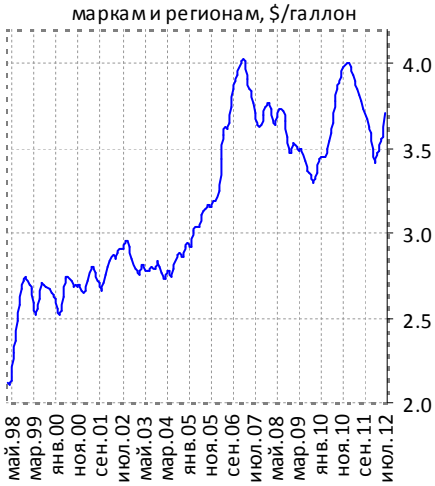
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



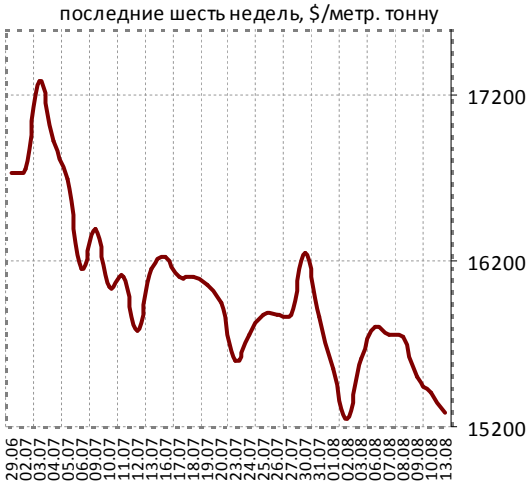
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



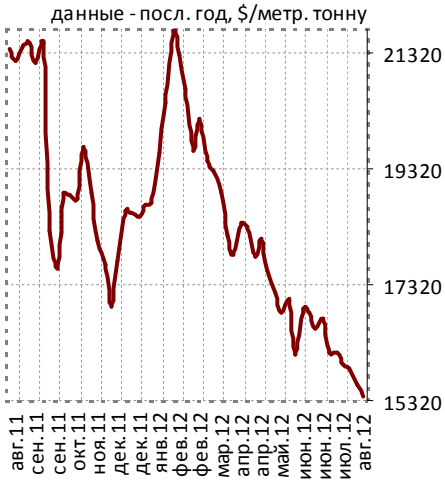
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

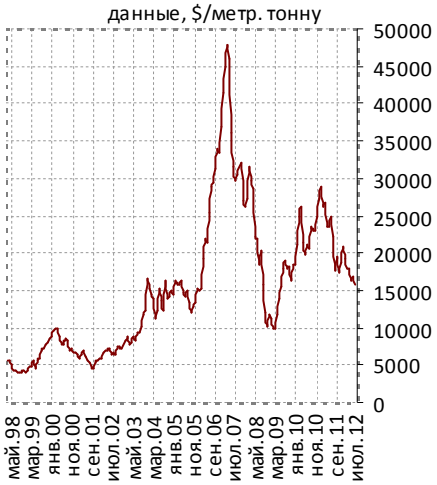
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



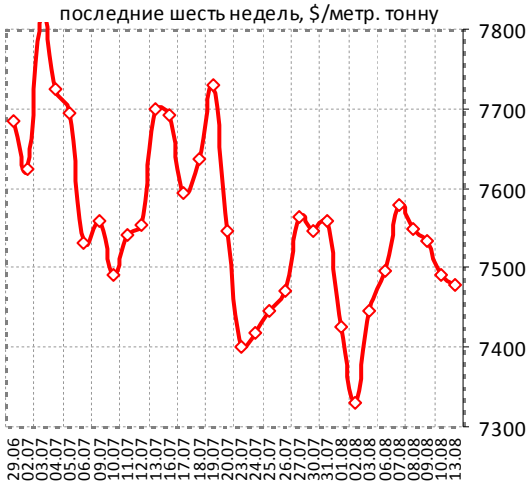
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



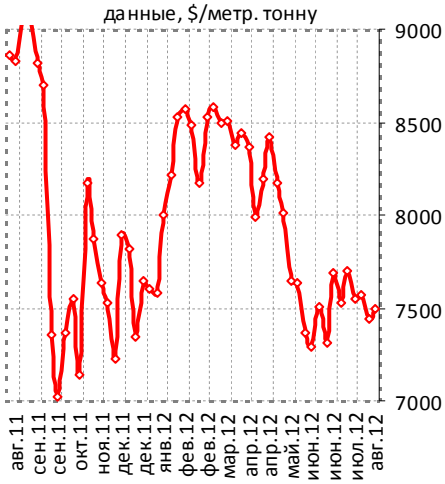
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



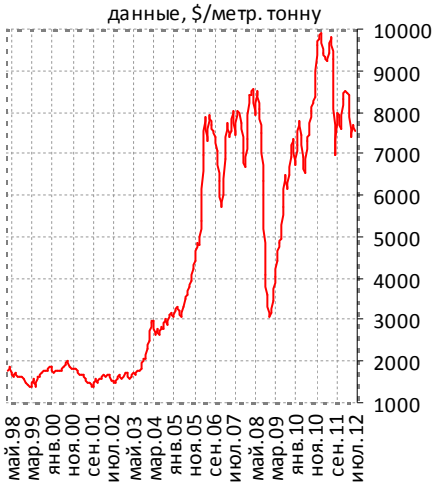
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



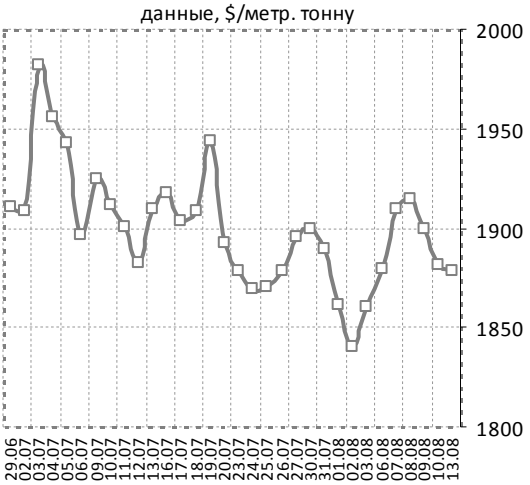
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



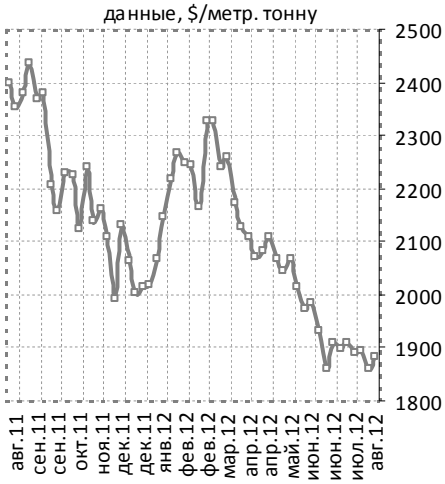
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



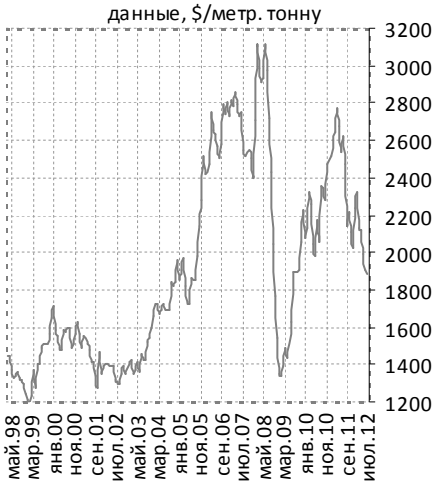
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.