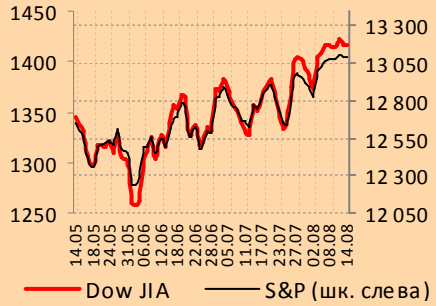
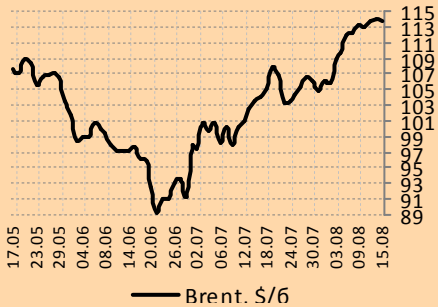
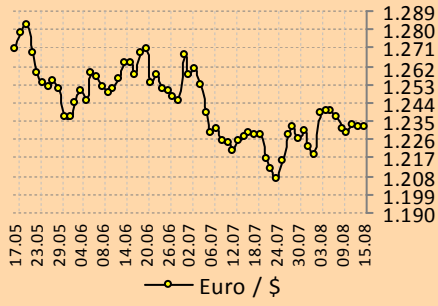
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

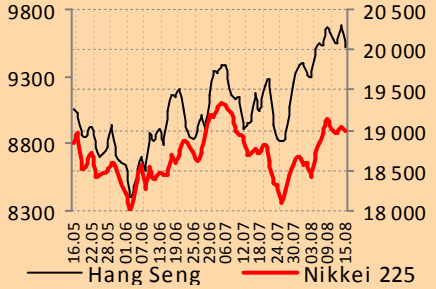
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

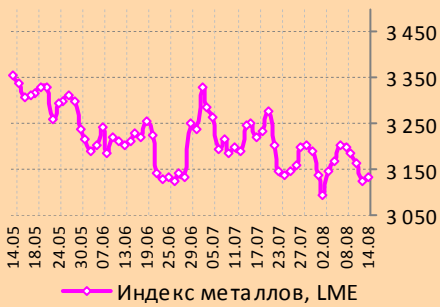
Ежедневный обзор

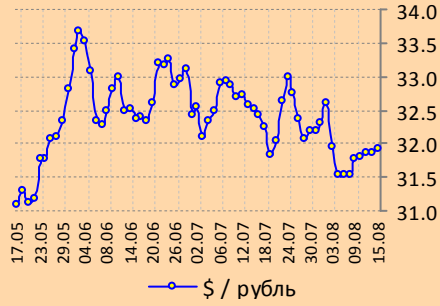






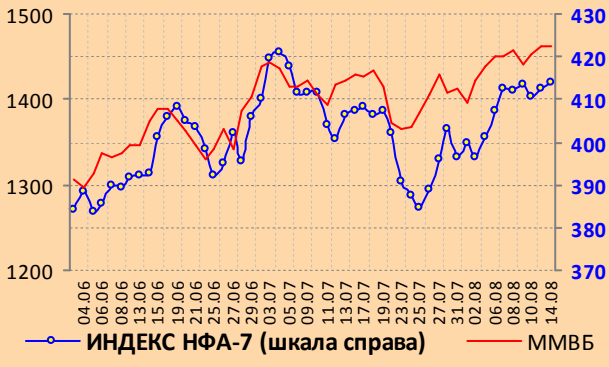






СОДЕРЖАНИЕ

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



Версия 2012-08-15

США. Розничные продажи за месяц выросли на 0,8% при ожиданиях 0,3%, что тем более значимо после предыдущего снижения в 0,7%. Итоги торгов, тем не менее, разные (индекс Dow Jones =+0,02, S&P 500 =-0,01, NASDAQ =-0,18%), инвесторы негативно реагировали на европейские новости (см. ниже).

Россия. При поддержке нефтяных цен биржевые индексы завершили сессию вторника в плюсе, ММВБ =+0,7, РТС =+0,64%. Из последних новостей отметим, что профицит федерального бюджета за семь месяцев составил 282 млрд. руб. или 0,9% ВВП, план по доходам выполнен на 57,2%, по расходам на 54,6% (расходы традиционно придерживаются). ЦБ сохраняет переориентацию кредитования на более длительный (недельный) срок и предложил вчера прямое РЕПО на 1 день в сумме 10 млрд. руб. и на 7 дней в сумме 1200 млрд. руб. На 1 день банки на утреннем и вечернем аукционах взяли 6,8 млрд. (при спросе в 50,6 млрд.) примерно под 6%, ставка рынка 5,4%. На 7 дней было взято 1 198 млрд. руб. (при спросе 1 253 млрд.) под 5,31% (ставка рынка 5,75%). Казначейство разместило средства федерального бюджета на банковские депозиты, предложение составило 50, а спрос 93 млрд. руб., в аукционе приняли участие 5 банков, средневзвешенная ставка размещения 6,84%, возврат 14 ноября.

Европа. ЕЦБ пересмотрел в негативную сторону прогноз по ВВП еврозоны на этот год, с - 0,2 до - 0,3%, безработицы с 11 до 11,2% (на 2013 г. с 10,9 до 11,4%). Как ни странно, но индексы выросли (FTSE 100 =+0,56, DAX =+0,94, CAC 40 =+0,7%. И новый прогноз ЕЦБ, и новая статистика по Европе вызывали бы тревогу, если бы при этом не усиливались надежды, что замедление экономики уже в ближайшее время позволит ЕЦБ вновь понизить процентную ставку. Относительно статистики отметим, что ВВП ЕС во втором квартале относительно первого снизился на 0,2%, предыдущее изменение было нулевым, а по сравнению с прошлым годом ВВП показал снижение на 0,4%. Промпроизводство за месяц снизилось на 0,6% (предыдущее изменение +0,6%), в годовом измерении снизилось на 2,1%. По Германии индекс экономических ожиданий инвесторов не только остался отрицательным, но и показал ухудшение за месяц с -19,6 до -25,5 пункта, зато ВВП увеличился во втором квартале относительно первого квартала на 0,3%, и это больше, чем ожидалось (0,2%), предыдущее изменение +0,5%. ВВП Франции не изменился, при том, что ожидалось снижение на 0,1%, предыдущие два изменения также были нулевыми, экономика стагнирует уже три квартала подряд. Инфляция во Франции в годовом измерении составила 2,2% (прогноз 2,3%), в Великобритании 2,6% (ожидалось 2,3%), предыдущее изменение 2,4%. Наибольшее снижение ВВП: Португалия 1,2%, Кипр 0,8% и Италия 0,7%.

Появились слухи, что в конституционный суд Германии был подан новый иск против европейского стабфонда, на который рассчитывают проблемные страны еврозоны.

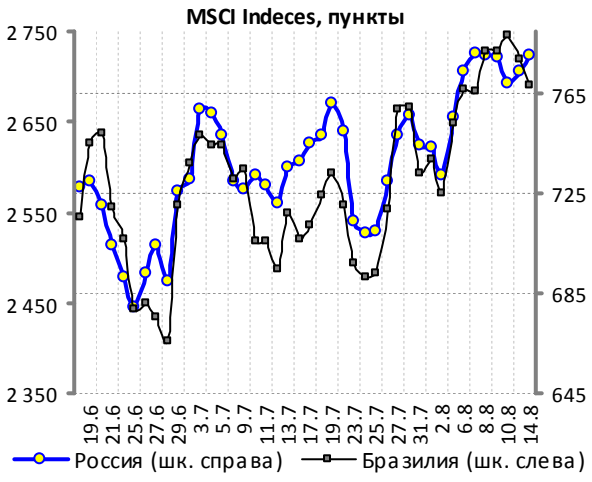
Азия. Торги вторника закрылись ростом индексов, Nikkei на 0,5, KOSPI на 1,27, HANG SENG на 1,05, Shanghai Composite на 0,3%. Опубликованы протоколы последнего заседания Банка Японии, отмечено снижение рисков существенного ухудшения ситуации в еврозоне под влиянием действий ЕЦБ. Регулятор не исключает возможности введения дополнительных мер стимулирования экономики, что и оказывает поддержку рынкам.

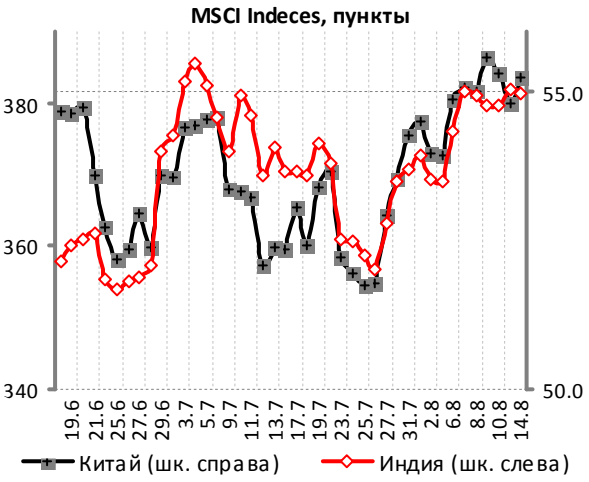
Золото. Переключение на более рисковые (но и более доходные) активы привело к снижению цен драгметаллов. Утром вторника золото торговалось по 1614,53 долл. за унцию, сегодня с утра фьючерсы на золото = 1603,45, серебро = 27,77, платину = 1403,7, палладий = 580 долл./унция.

Нефть. В ближайшее время как геополитические факторы, так и повышательные факторы локального характера, вероятно, удержат цены от снижения. Во вторник утром Brent и Light шли по 113,26 и 92,75 долл. за барр., утром сегодня по 113,73 и 92,99 долл.

Статистика, прогноз. Будут опубликованы протоколы августовского заседания Банка Англии и данные по безработице (12.30), по США: инфляция (16.30), объем промпроизводства (17.15), запасы нефти и нефтепродуктов (18.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются от -0,25 до +0,68%, Азия до -0,84% до +1,27%, нефть марки Brent пока не снижается, но в ожидании данных по запасам нефти в США может обозначить снижение. Как драйвер роста для наших бирж, цена нефти поддержит котировки, но не надолго: у нас начинается очередной налоговый период, сегодня уплата авансовых платежей по акцизам и страховых взносов.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 15.08.2012.

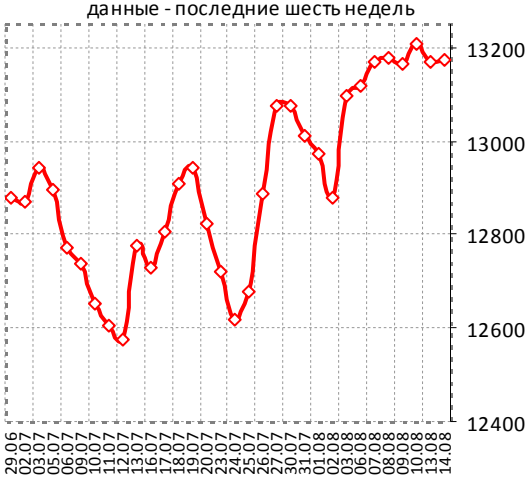




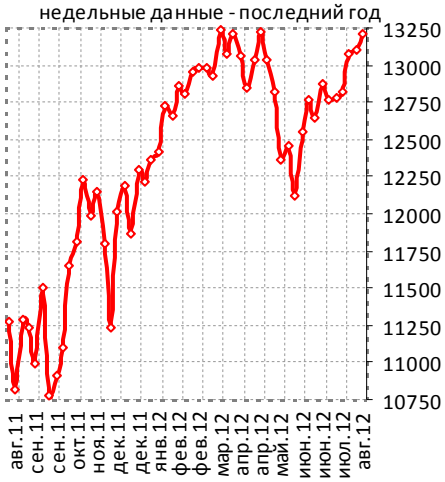
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

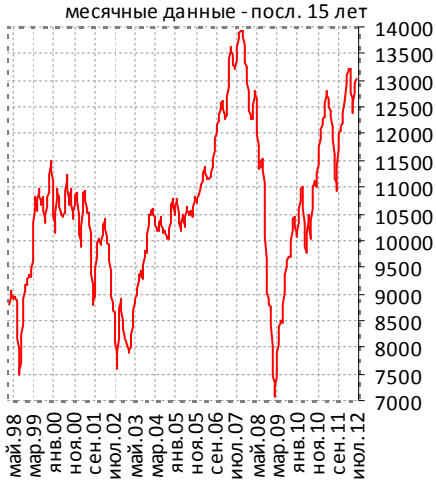
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



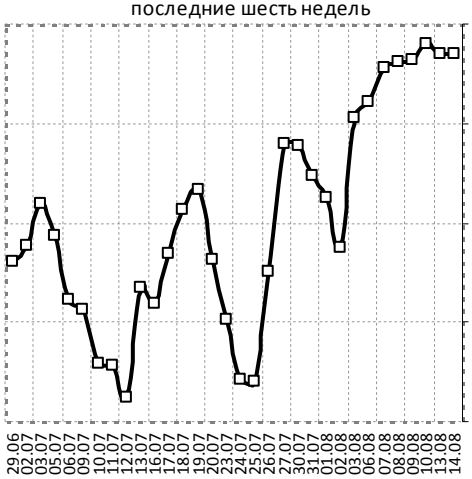
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



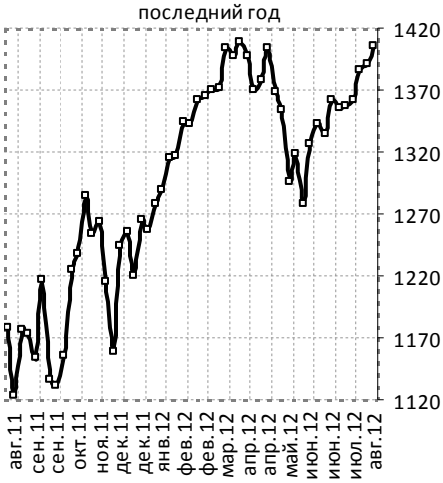
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



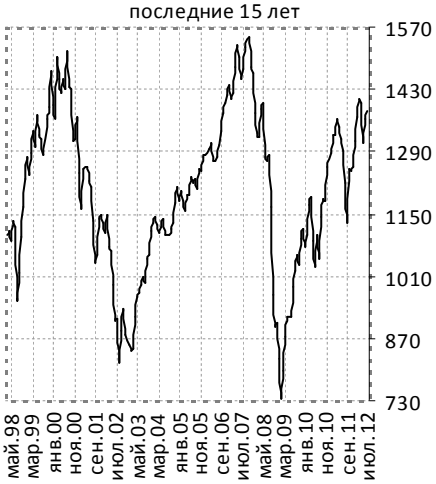
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



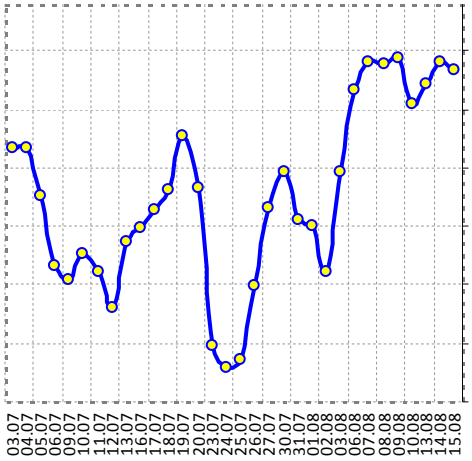
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



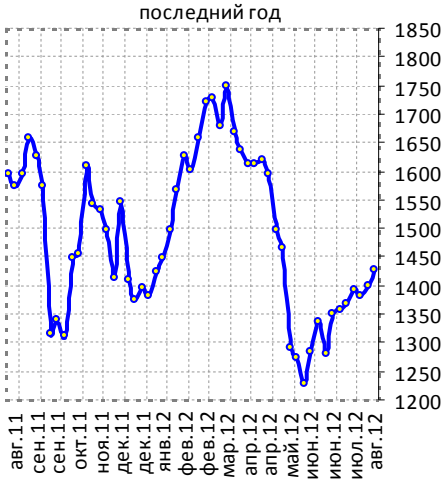
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



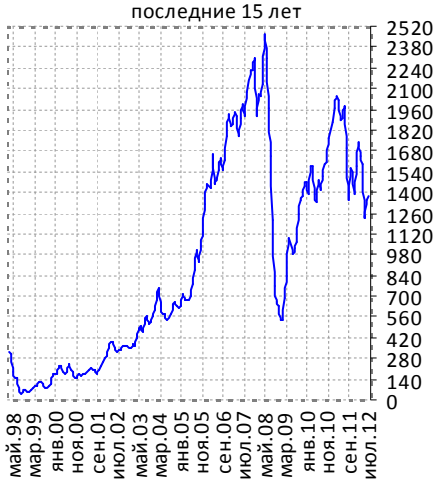
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



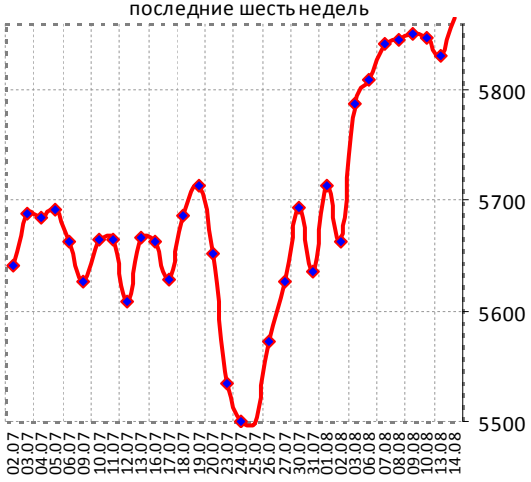
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



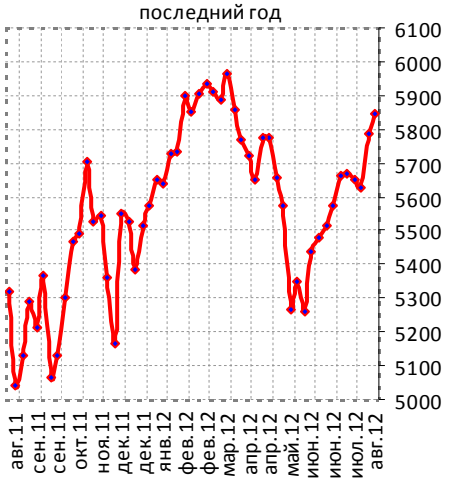
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

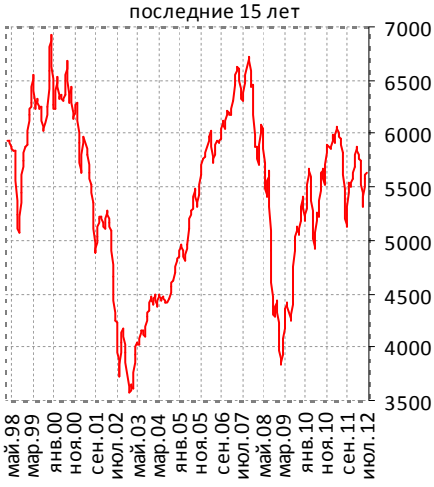
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



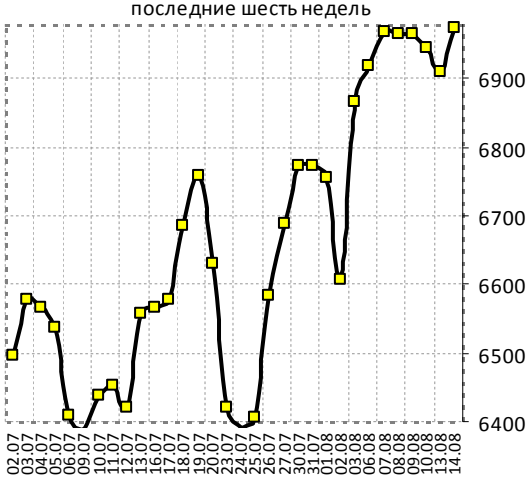
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



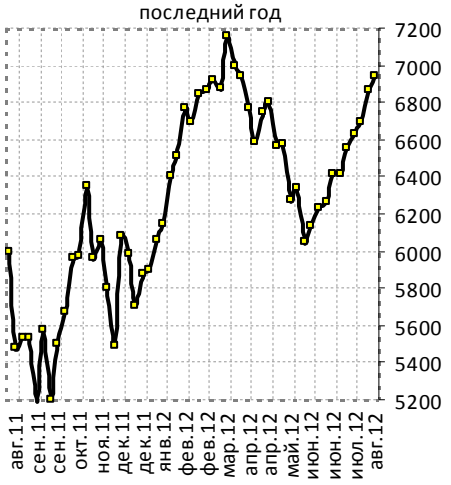
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



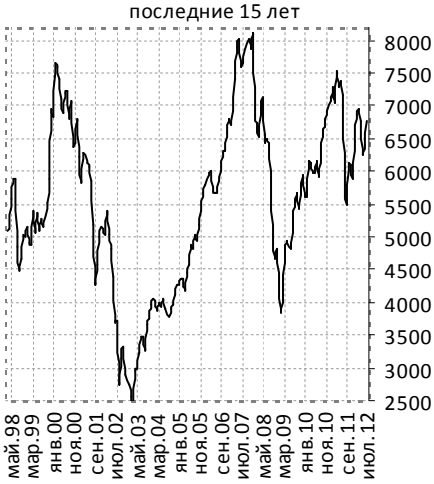
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



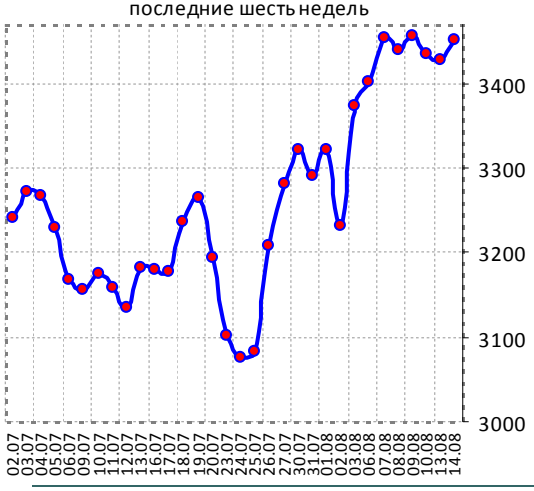
DAX Index: недельные данные - последний год



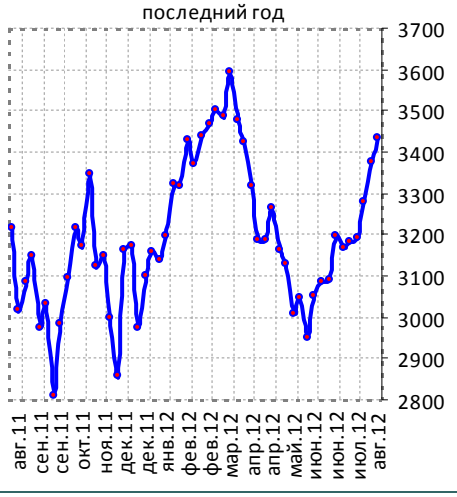
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



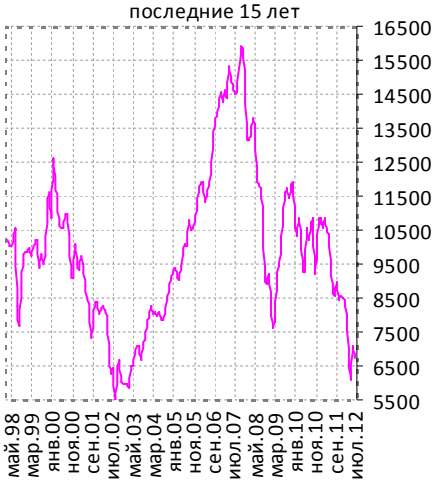
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

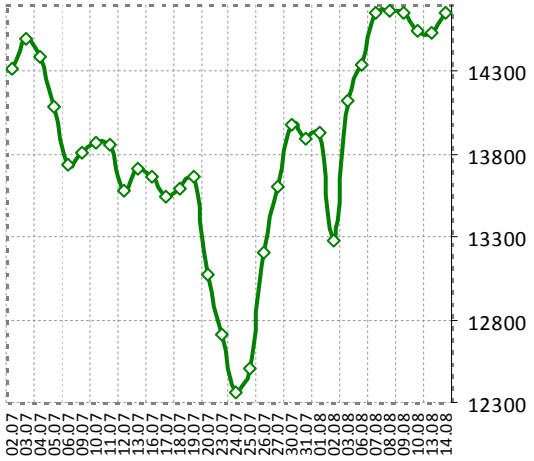


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

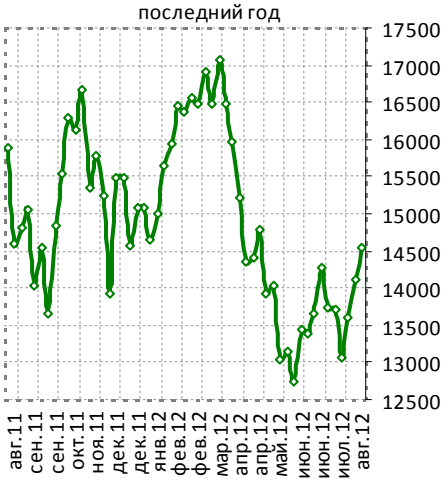


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

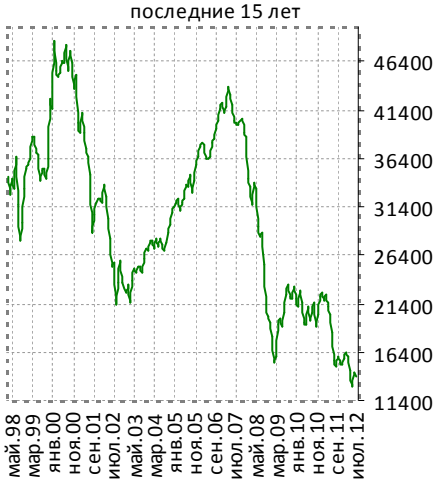
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



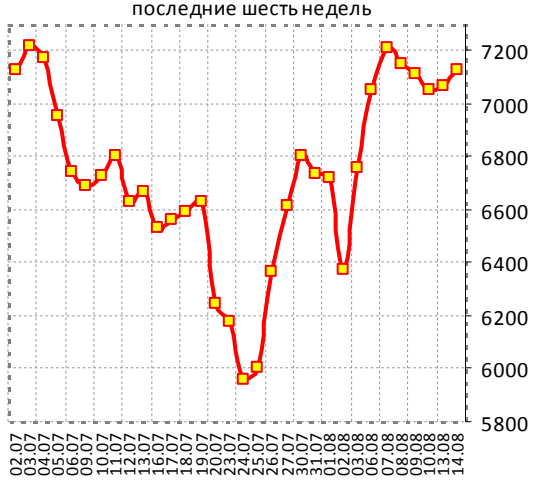
MIB Index: недельные данные - последний год



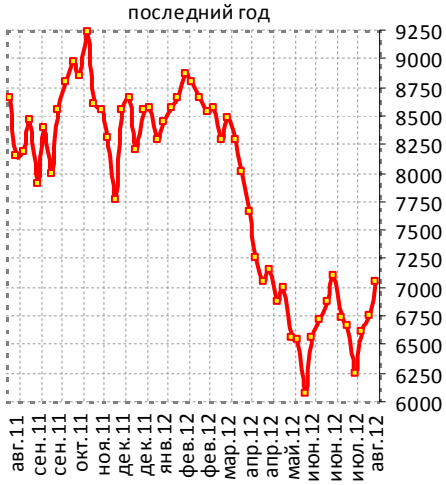
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



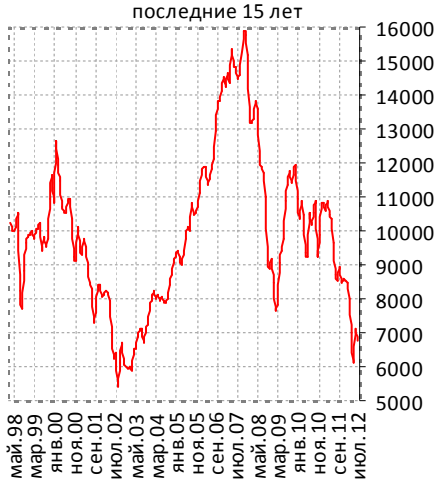
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



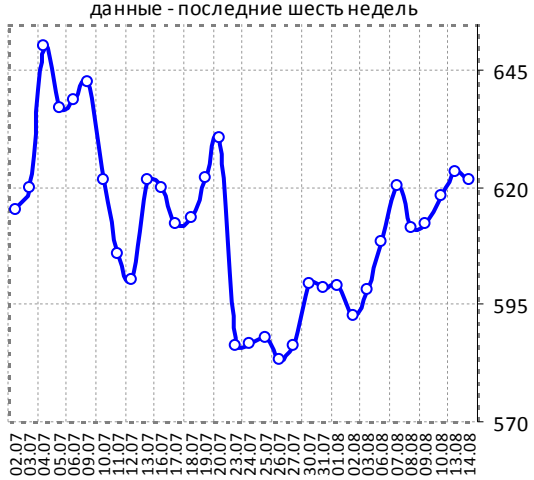
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



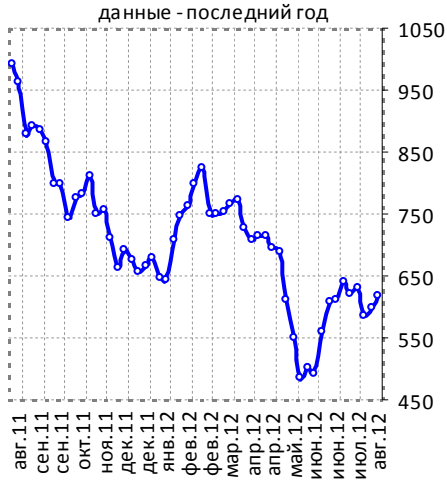
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



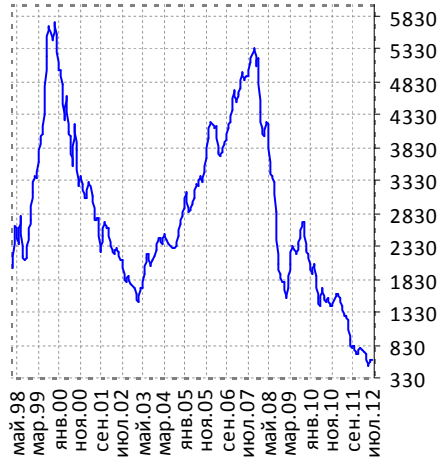
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



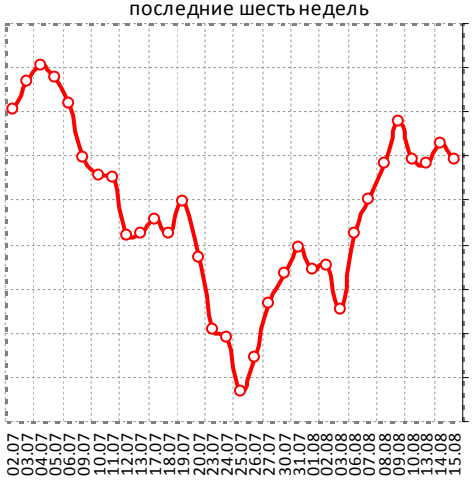
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



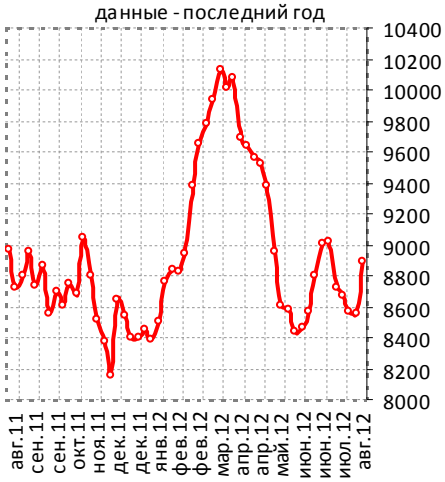
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

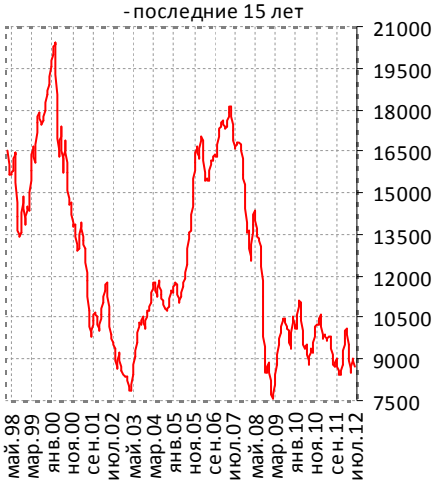
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



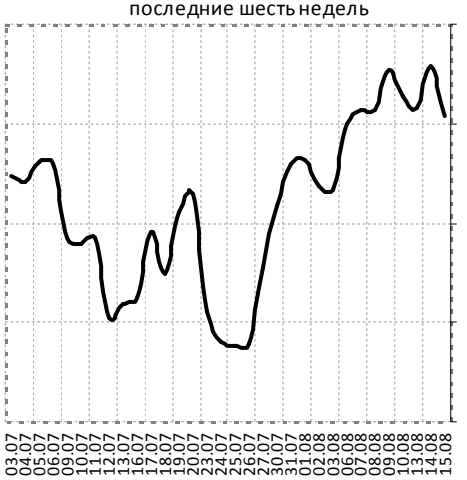
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



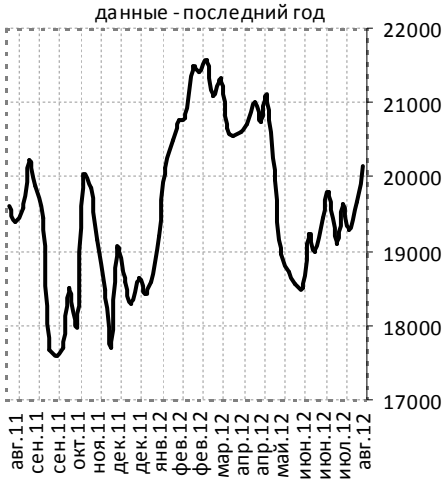
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



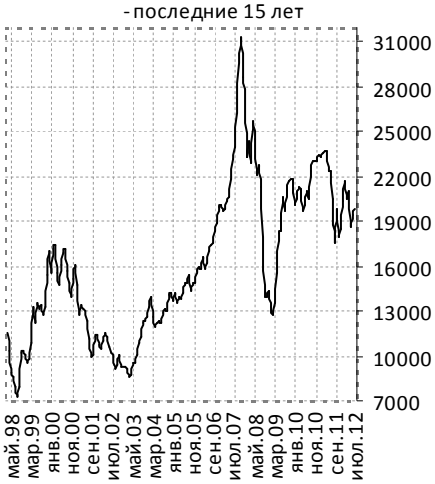
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



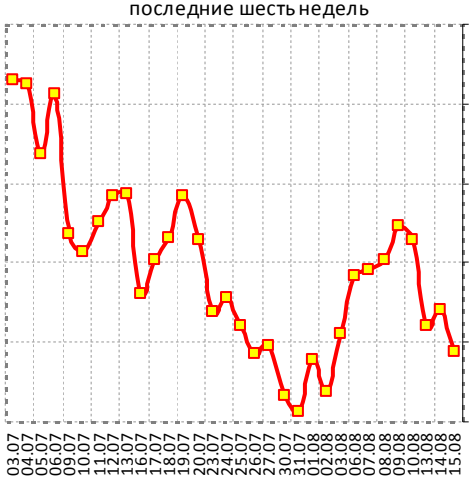
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



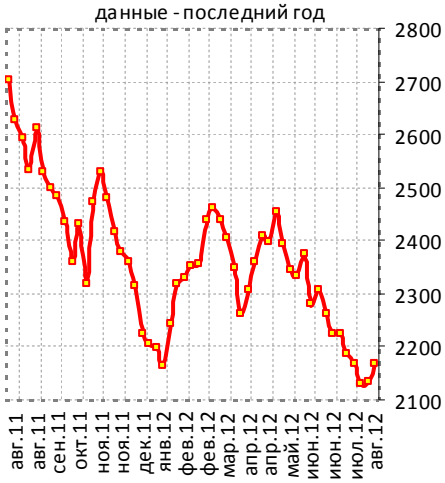
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



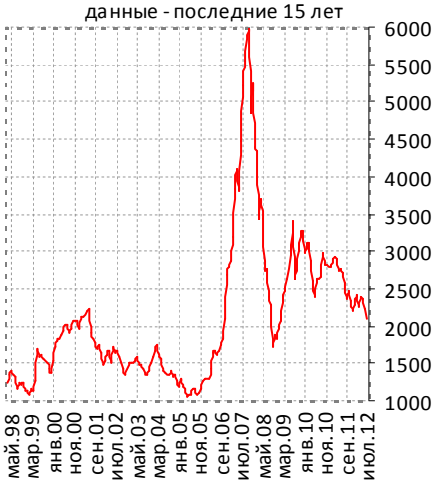
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



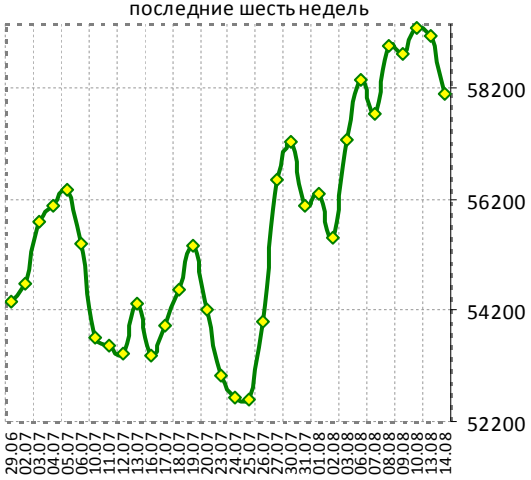
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



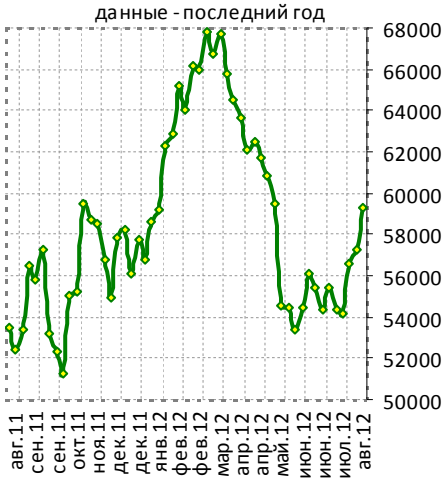
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

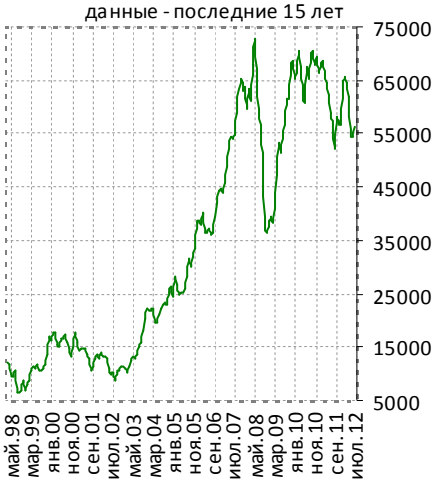
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



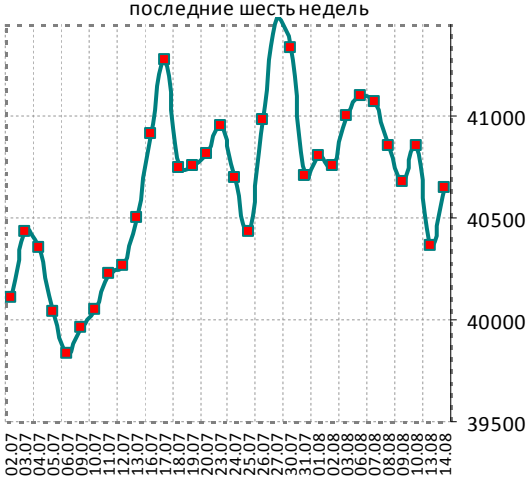
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



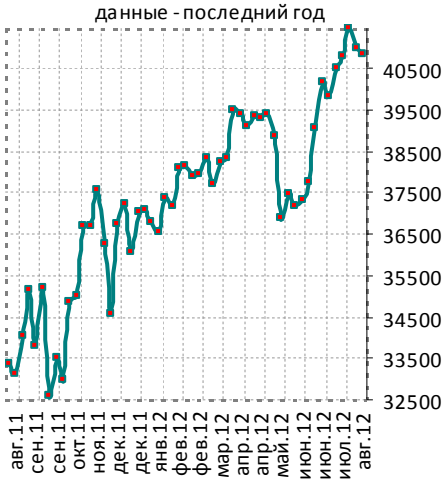
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



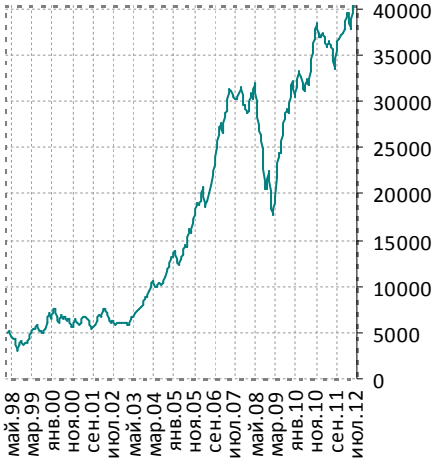
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



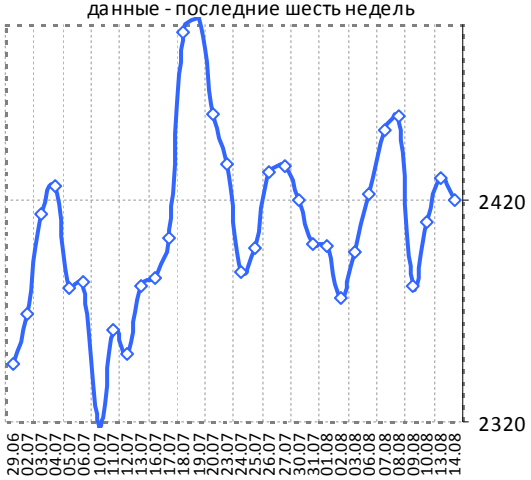
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



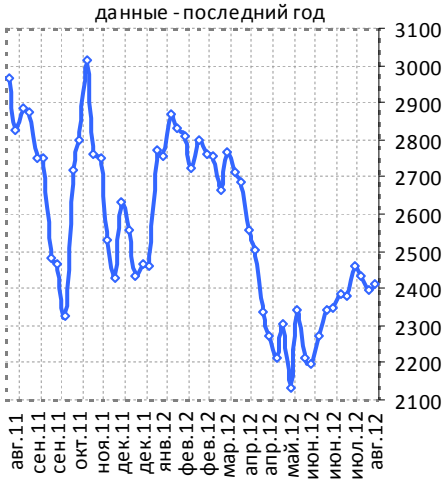
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



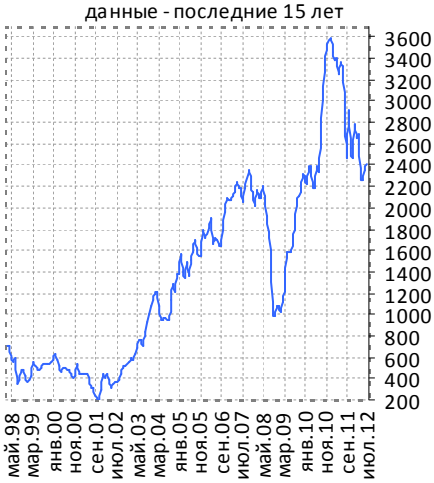
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

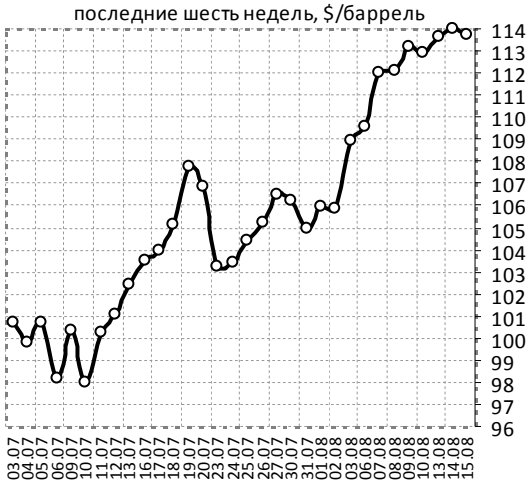


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

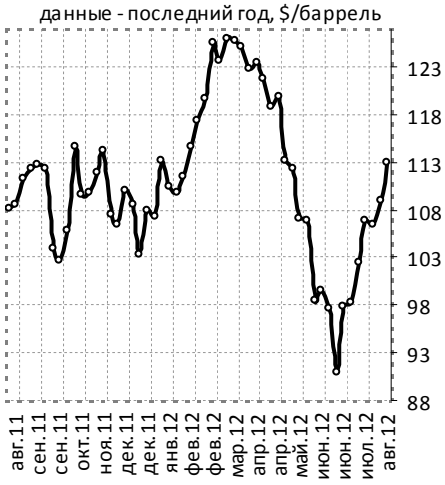
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

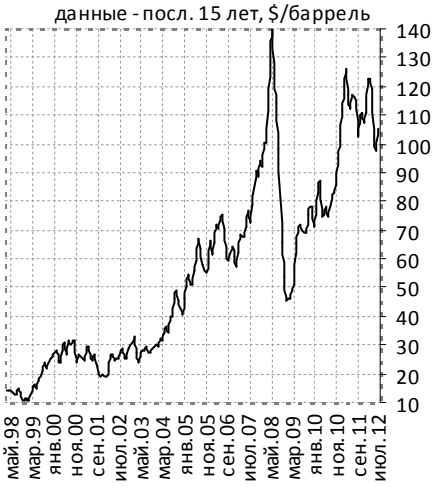
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



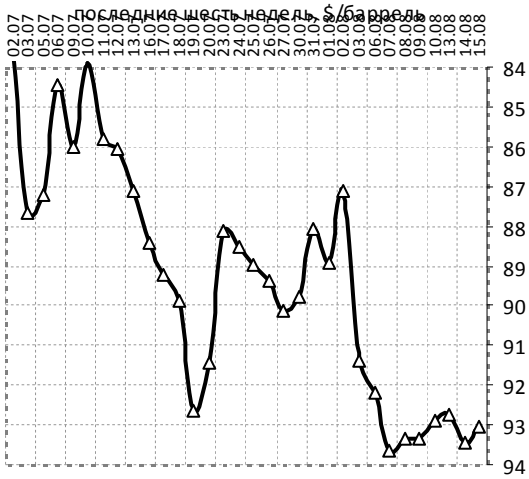
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



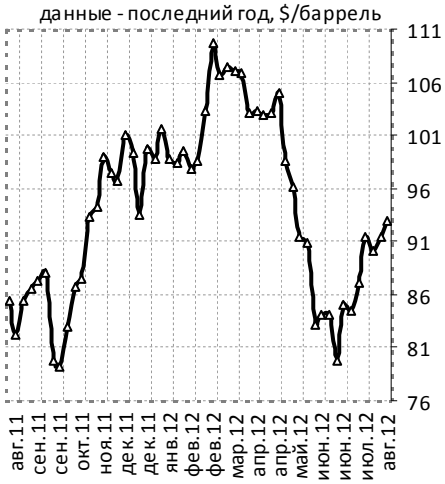
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



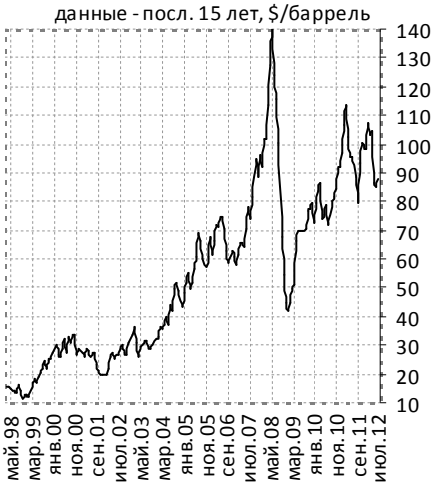
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



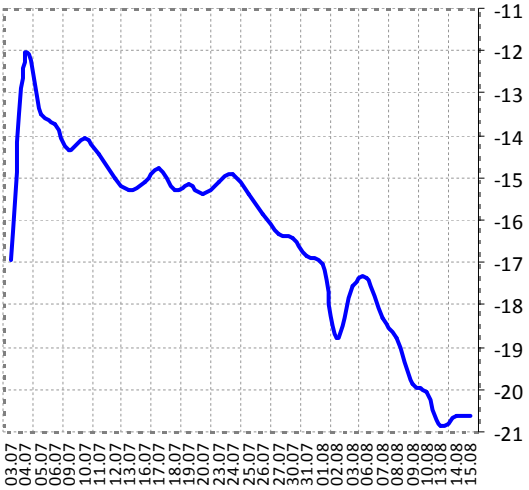
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



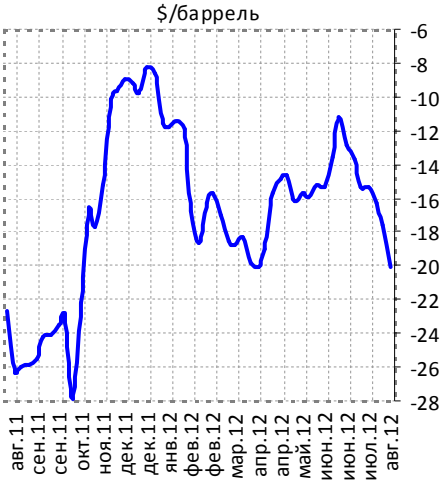
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



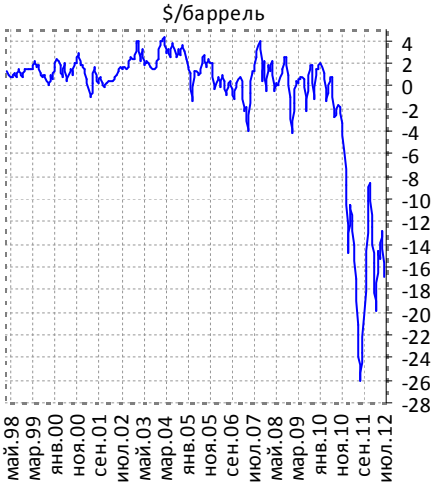
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



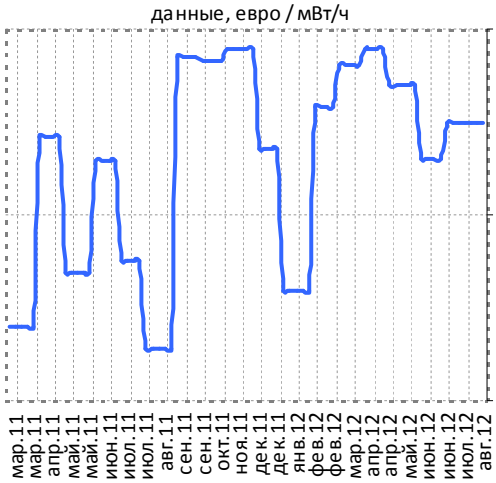
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



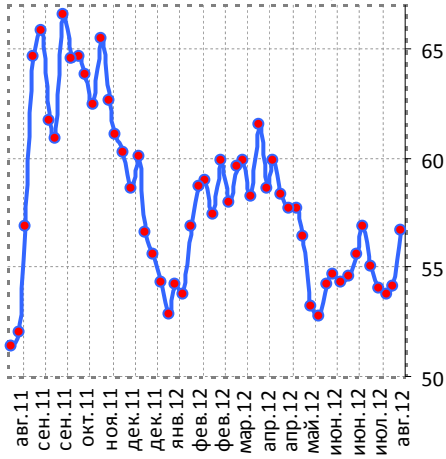
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

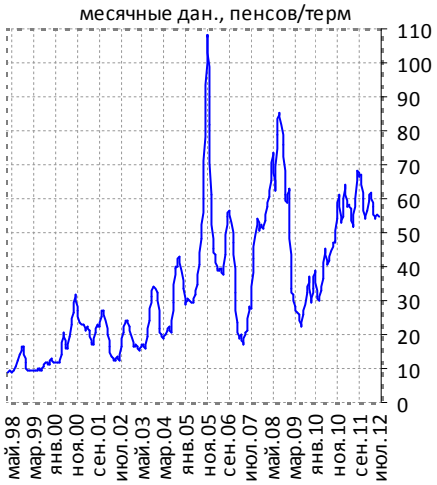
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



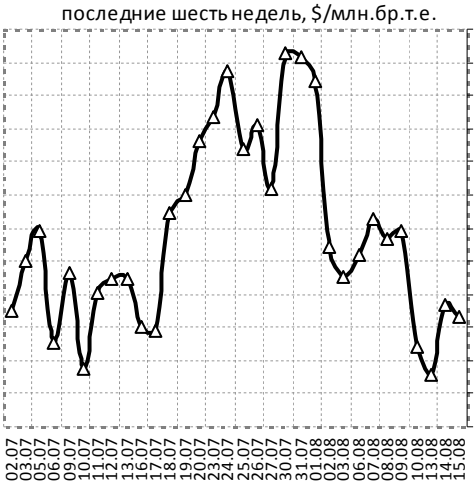
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



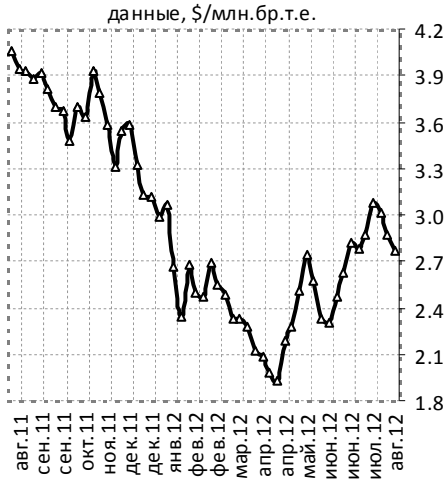
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



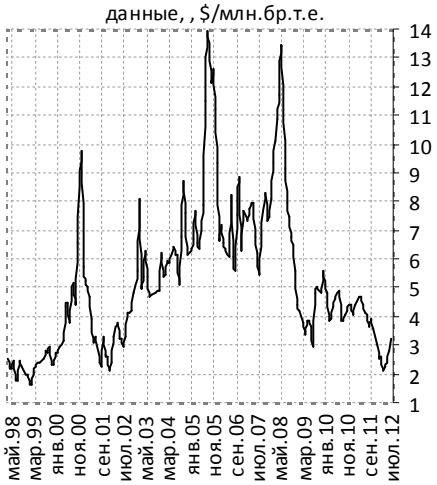
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



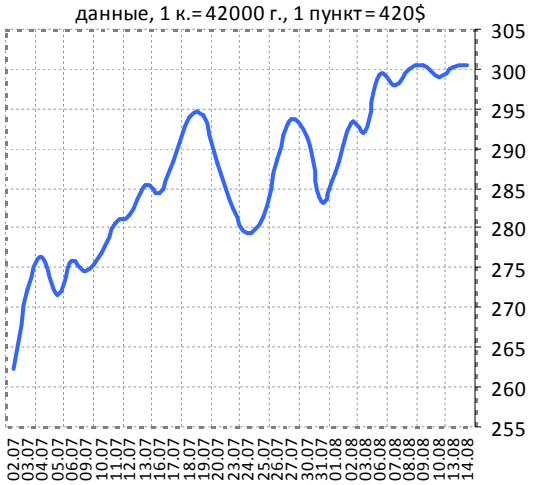
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



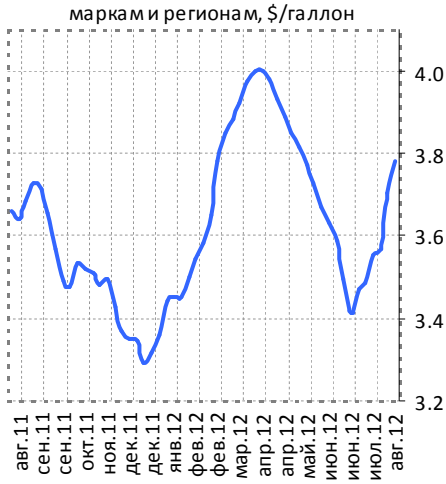
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



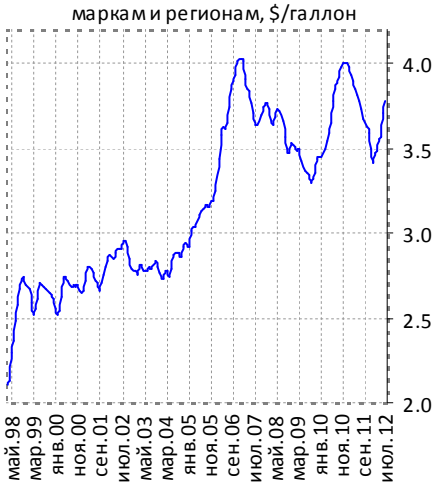
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



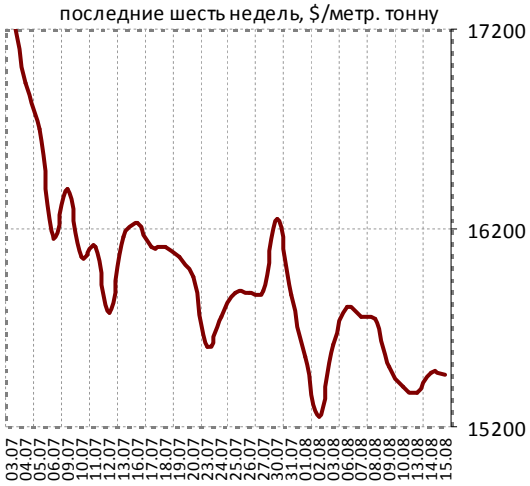
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



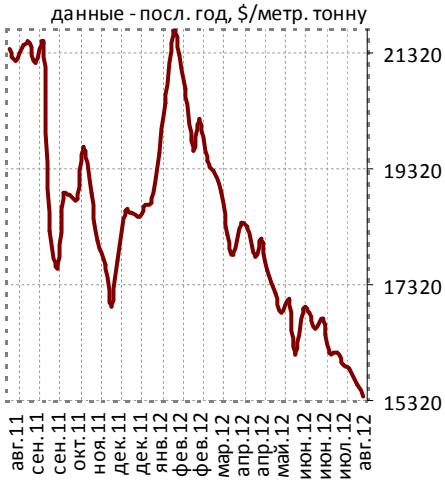
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

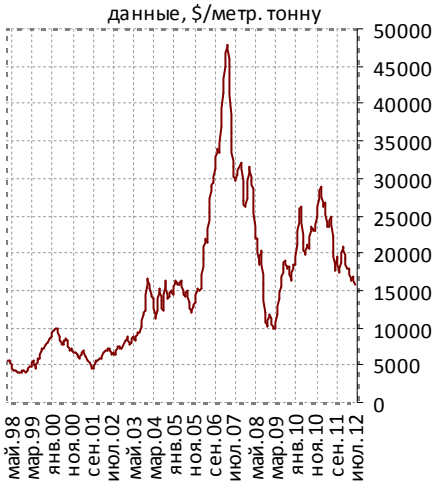
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



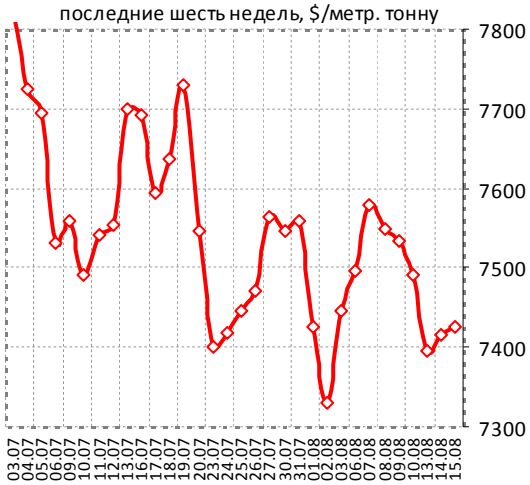
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



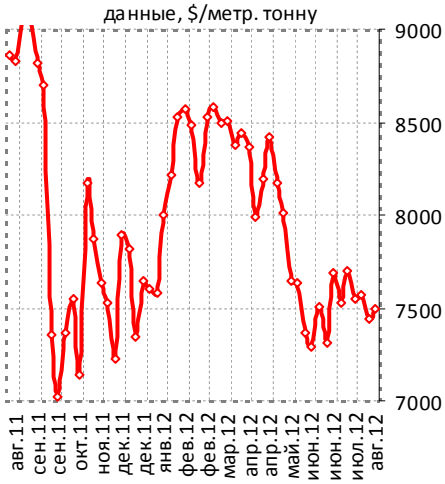
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



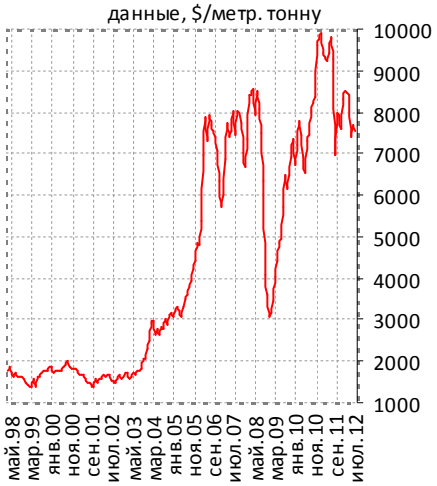
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



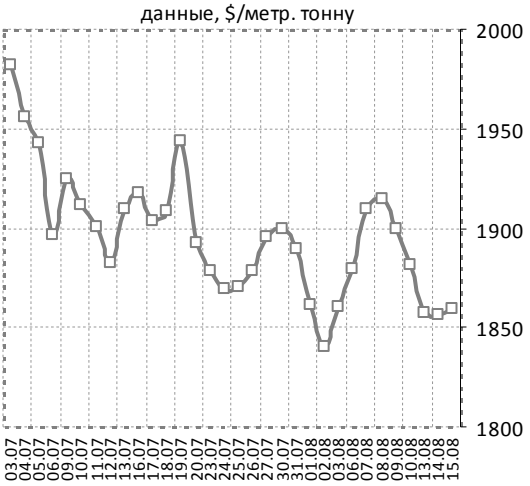
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



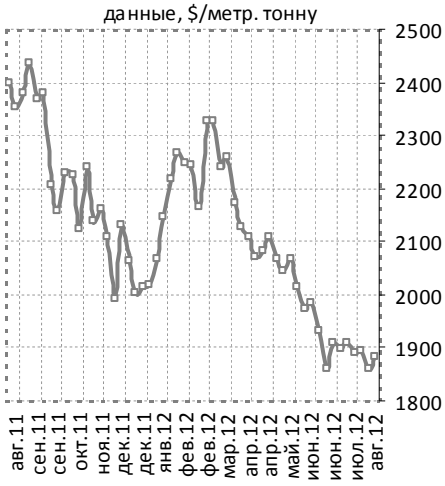
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



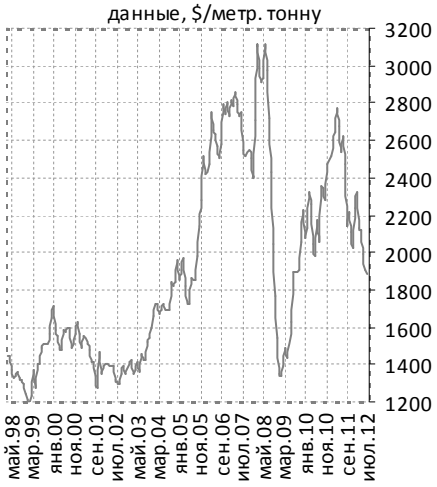
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.