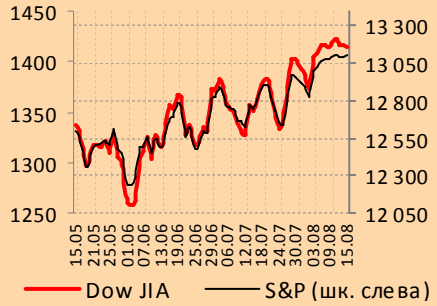
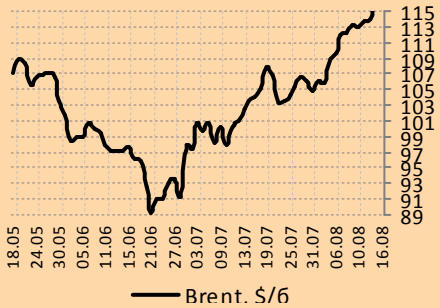
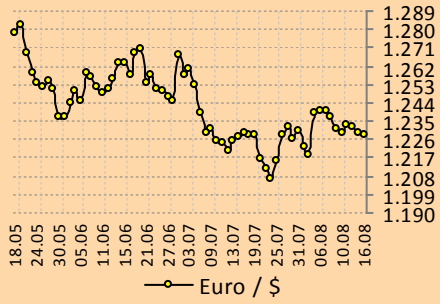
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

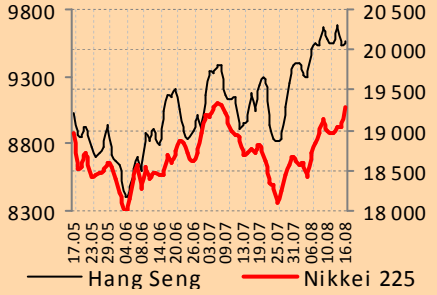
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

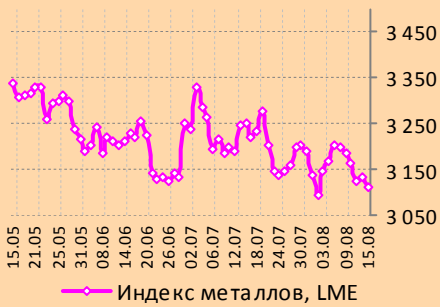
Ежедневный обзор

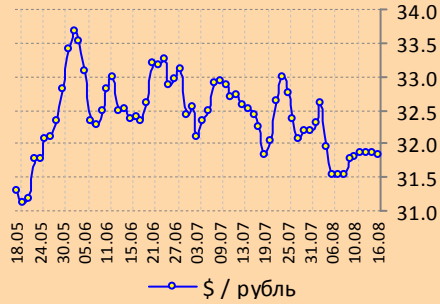






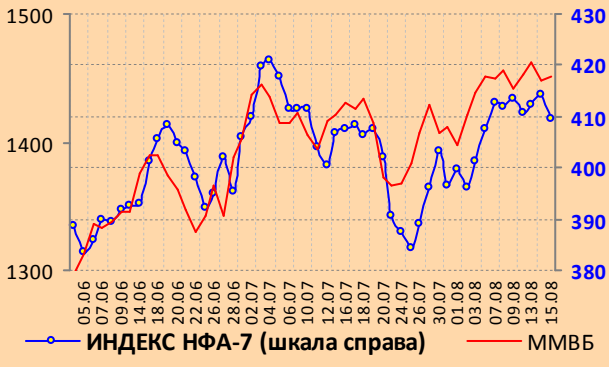






СОДЕРЖАНИЕ

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 2012-08-16

США. Торги завершились ближе к позитиву, Dow Jones =-0,06, S&P 500 =+0,11, NASDAQ =+0,46%. Базовая инфляция (целевой ориентир для ФРС, без учета продуктов питания и энергоносителей) за месяц увеличилась на 0,1%, меньше, чем ожидалось (0,2%), а общая инфляция осталась неизменной. Промпроизводство показало рост на 0,6%, но индекс деловой активности в промышленности ФРБ Нью-Йорка снизился. Из новостей отметим, что по результатам последнего опроса, в президентской гонке лидирует М.Ромни, который уже говорил, что первым делом заменит главу ФРС. И еще, британский Standard Chartered Bank, обвиняемый в сотрудничестве с Ираном, заплатит 304 млн. долл. штрафа правительству штата Нью-Йорк и в течение двух лет будет находиться под наблюдением властей, чтобы не допустить сделок по отмыванию денег, но зато слушания о лишении банка лицензии проводиться не будут.

Интересно: Soros Fund Management вышел из бумаг банков Goldman Sachs, JPMorgan, Citigroup и Wells Fargo, но открыл позиции по акциям Wal-Mart Stores и Facebook (здесь он играет против рынка, но цены действительно очень низкие).

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, сессия завершилась в минусе, индекс ММВБ =-0,97, РТС =-1,22%. Минфин РФ разместил вчера ОФЗ (погашение в апреле 2017 г.) на сумму 15 млрд. руб. По плану этот выпуск бумаг предполагался к размещению в сентябре и в большей сумме (25 млрд.), выбор даты размещения не очень понятен, начало налогового периода в сочетании с сокращением лимитов однодневного рефинансирования в ЦБ. По факту удалось разместить бумаги на 6,5 млрд. руб. с доходностью 7,62%. ЦБ на аукционе однодневного прямого РЕПО в рамках лимита в 10 млрд. руб. выдал 9,9 (при спросе 24) млрд. кредита под 6,09% (ставка рынка 5,86%). Промпроизводство за 7 месяцев по сравнению с аналогичным периодом прошлого года увеличилось на 3,2%, инфляция с начала года 4,6%.

Европа. Кроме негатива статистики, инвесторы вновь возвращаются к греческой теме и возможности выхода страны из евросоюза. Итоги торгов среды в минусе: FTSE 100 =-0,54, DAX =-0,4, CAC 40 =-0,03%. Определенную поддержку европейскому рынку все же оказал аукцион по размещению краткосрочных (13 недель) греческих гособлигаций. Несмотря на рост доходности и снижение спроса, удалось привлечь около 4 млрд. евро (напомним, 20 августа предстоит погашение бумаг на 3,2 млрд.). Общая сумма сокращения расходов бюджета до 2014 г. должна составить 11,5 млрд. евро или 5% ВВП, основная заминка сейчас в том, что правительство намерено просить кредиторов продлить срок экономии до 2016 г.

Из протокола заседания Банка Англии от 1-2 августа следует, что за сохранение процентной ставки на уровне 0,5% и объема выкупа активов на 375 млрд. фунтов стерлингов проголосовали все члены комитета по монетарной политике. При этом комитет планирует оценить необходимость принятия прочих стимулирующих мер, учитывая, что ВВП в текущем году может снизиться примерно на 0,2%.

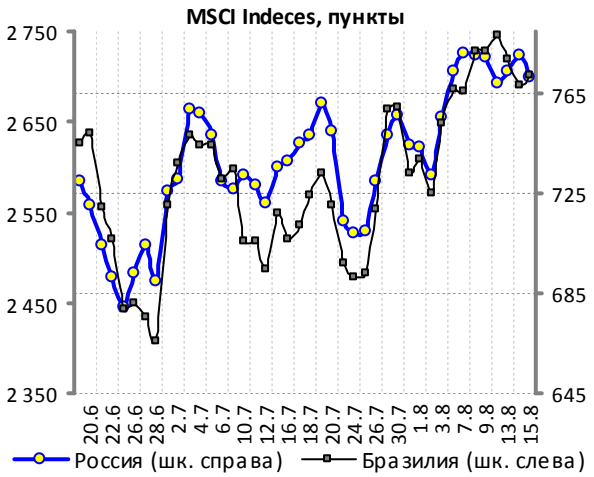
Азия. Банки Китая третий квартал подряд показали рост проблемных кредитов, причем, ситуация характерна для всех типов финансовых организаций (крупных и мелких банков, сельских банков и банков с участием иностранного капитала). Состояние экономики ЕС и хроника проблем китайских банков способствовали закрытию торгов среды в преобладающем минусе, Nikkei -0,05, SSE -1,10, Hang Seng -1,18, Kospi +1,27%.

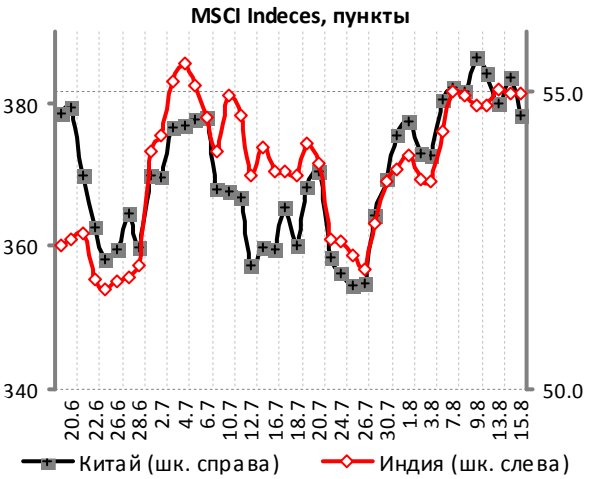
Золото. Цены драгметаллов колеблются вместе с движением фондовых площадок как рядовой актив. Так, утром среды золото торговалось по 1603,45 долл. за унцию, к 14.00 по 1596,87 долл., утром сегодня фьючерсы на золото 1606,8, серебро = 27,83, платину = 1398,6 , палладий = 577,6 долл./унция.

Нефть. Продолжил работу чрезвычайный саммит Организации исламского сотрудничества, главной темой остается Сирия. Иран на саммите представляет президент страны, что, в частности, говорит о достаточно высоком уровне обсуждения проблемы. Вопрос Сирии не уходит с повестки дня Китая и США. Как геополитические, так и повышательные факторы локального характера удерживают цены нефти от сильного снижения. Утром среды Brent и Light шли по 113,73 и 92,99 долл. за барр., к 14.00 по 112,16 и 93,48 долл., утром сегодня 114,33 и 96,63 долл./барр.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем по США данные по рынку труда (16.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются в основном в плюсе, Азия тоже, нефть находится на приличном уровне. У нас начался очередной налоговый период, но регуляторы пополняют ликвидность, хотя рубль слабеет вопреки спросу. Наши биржи попытаются использовать комфортные цены акций после вчерашнего снижения и нефть в качестве драйверов роста.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 16.08.2012.

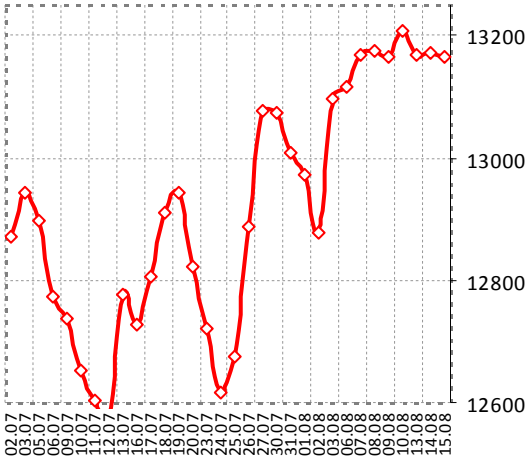




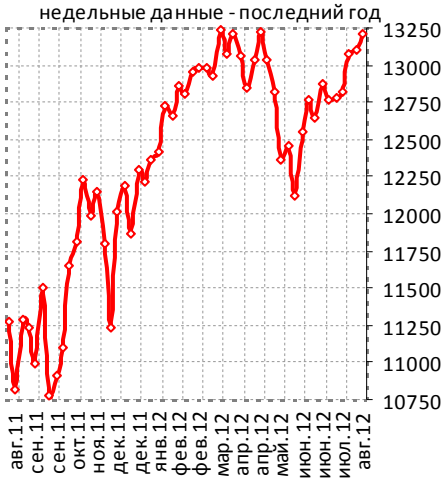
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

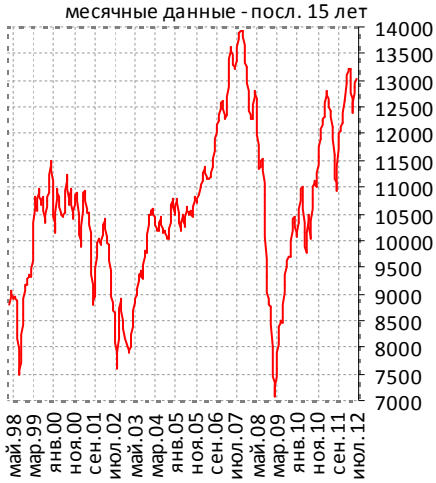
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



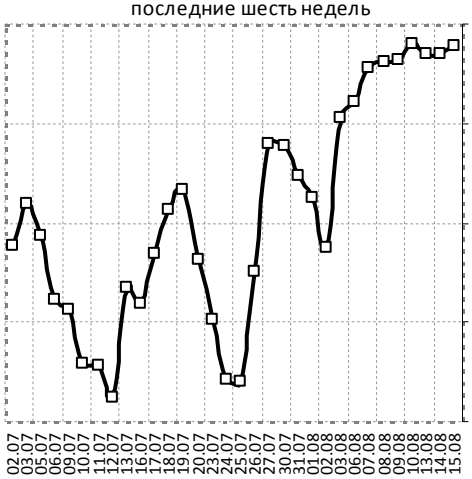
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



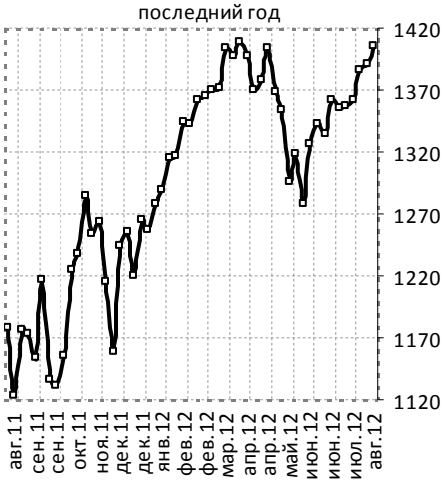
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



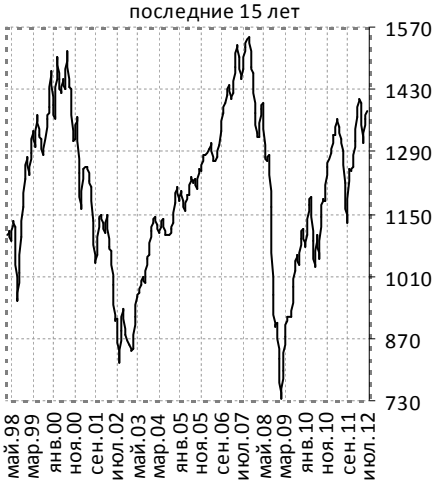
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



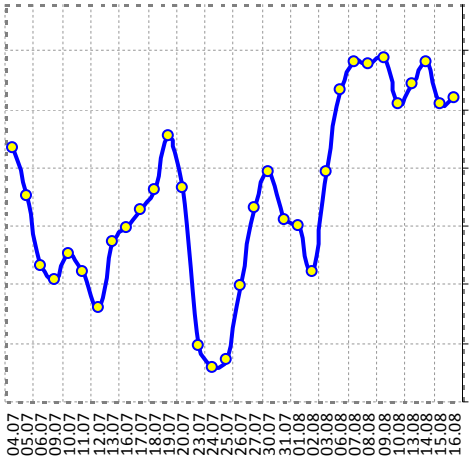
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



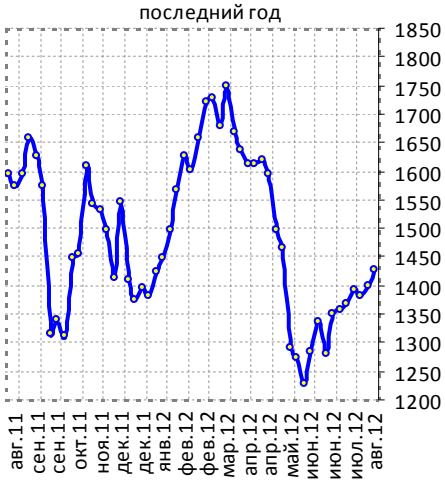
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



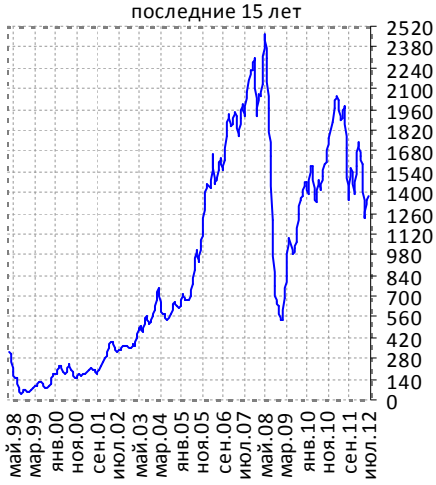
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



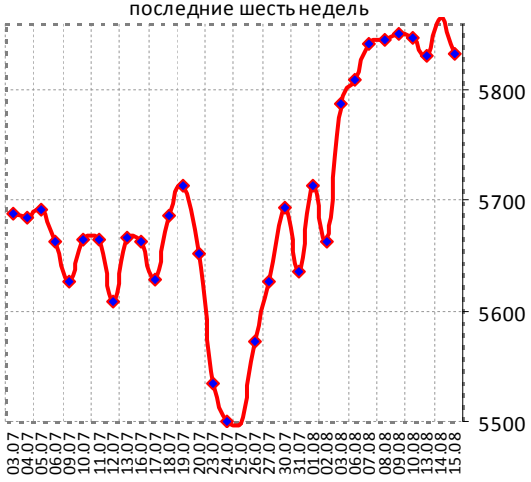
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



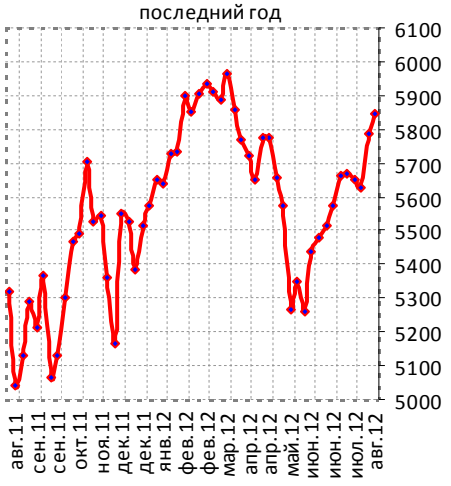
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

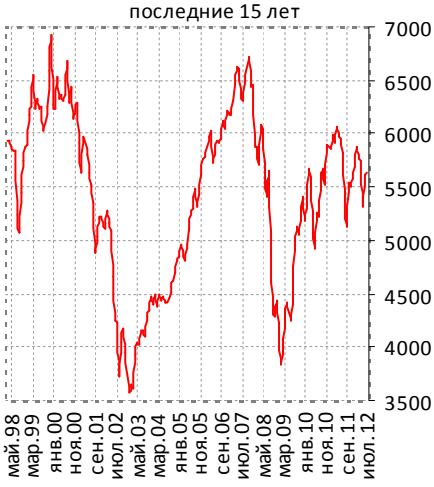
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



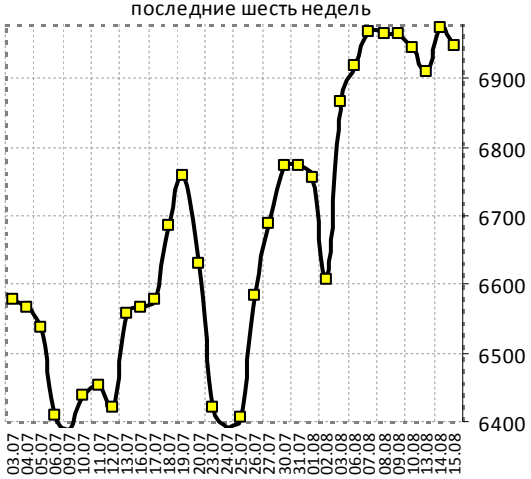
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



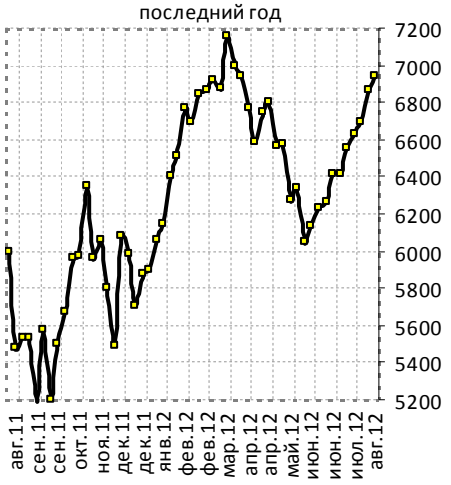
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



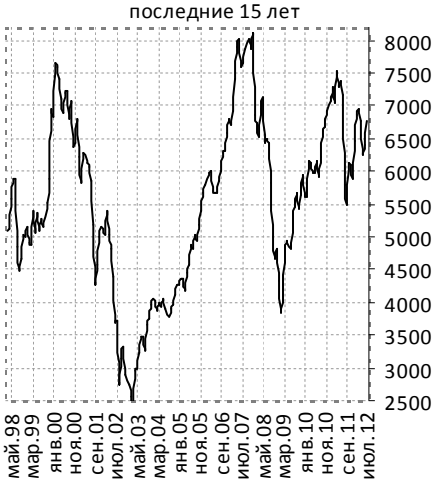
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



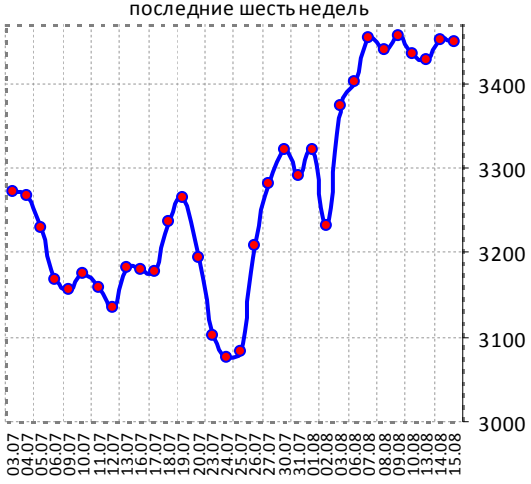
DAX Index: недельные данные - последний год



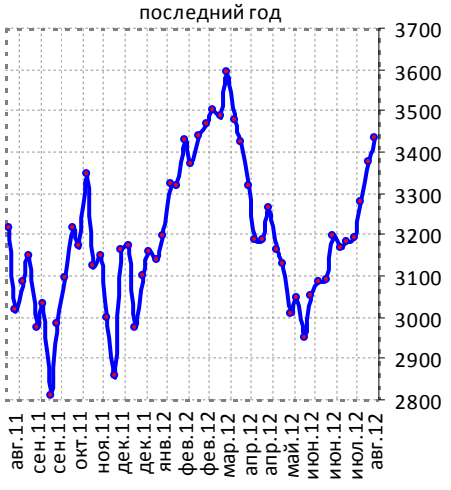
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



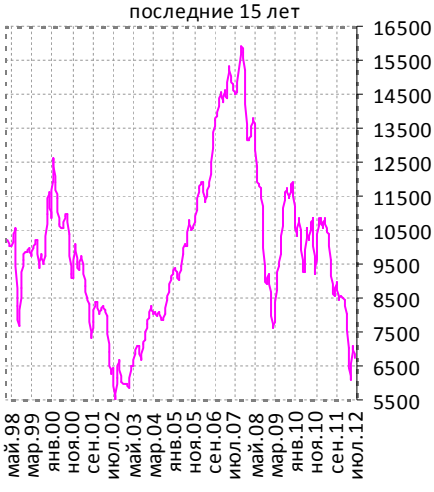
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

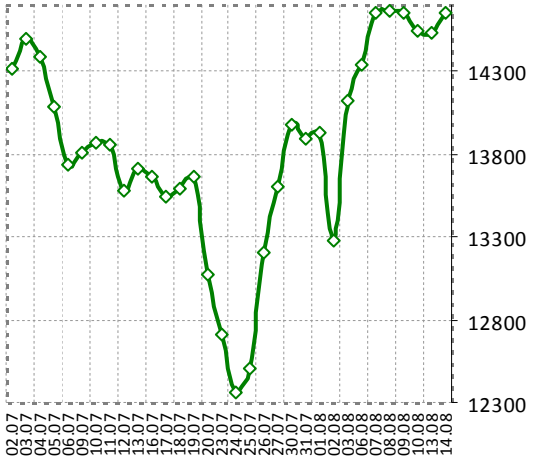


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

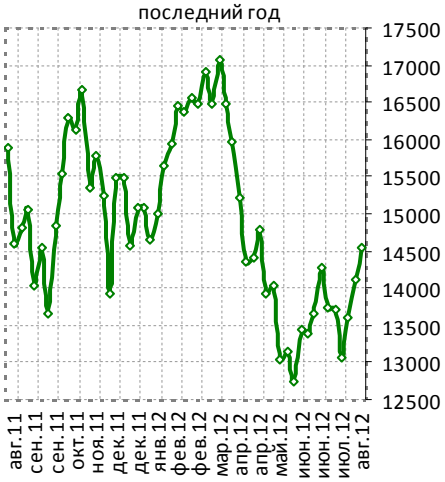


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

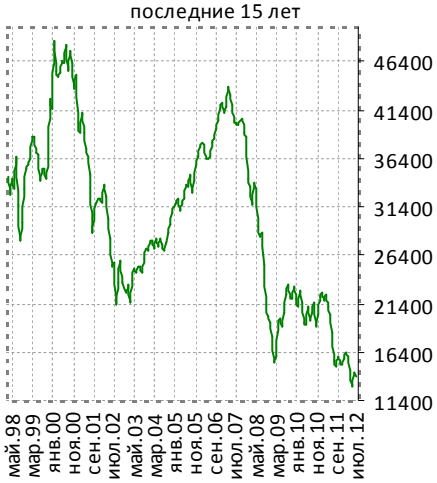
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



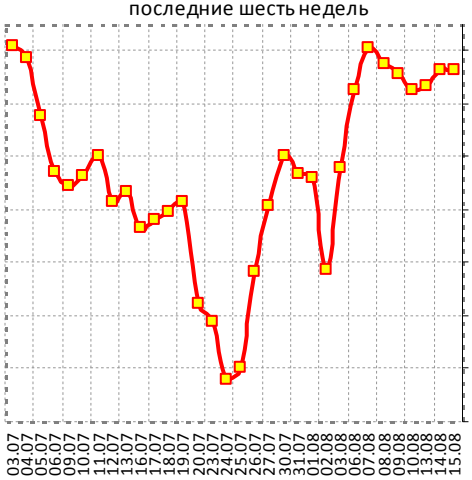
MIB Index: недельные данные - последний год



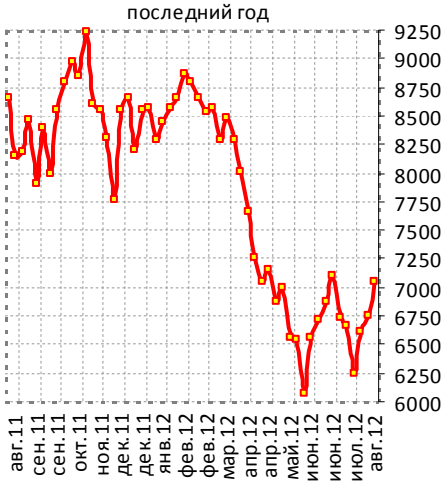
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



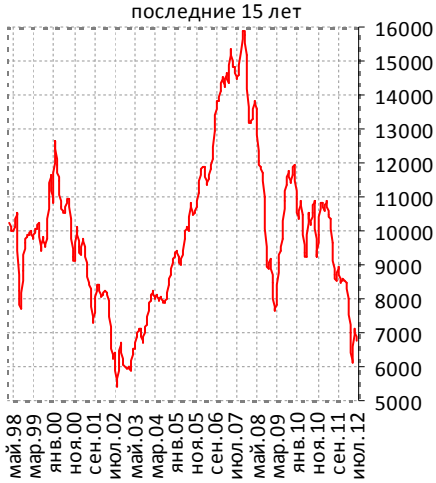
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



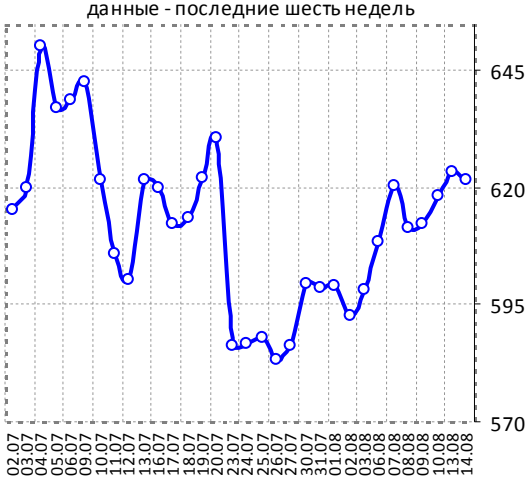
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



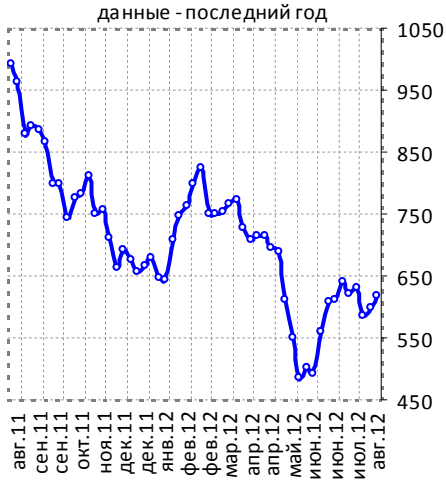
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



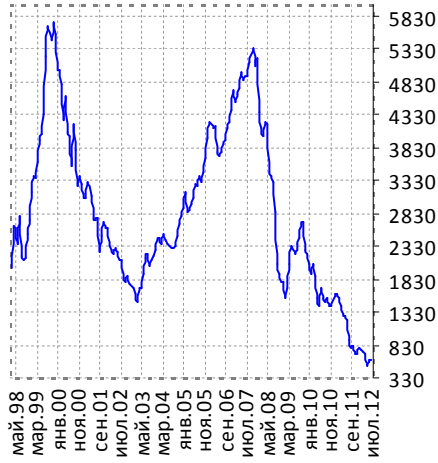
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



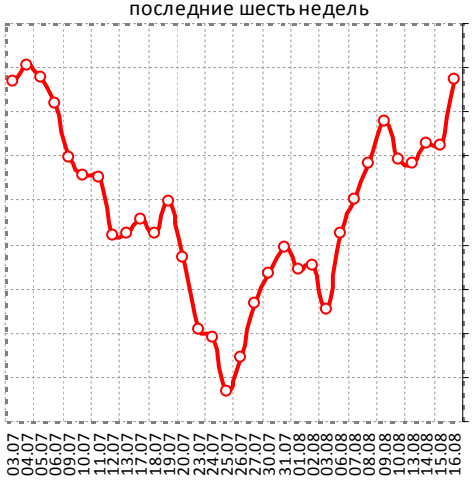
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



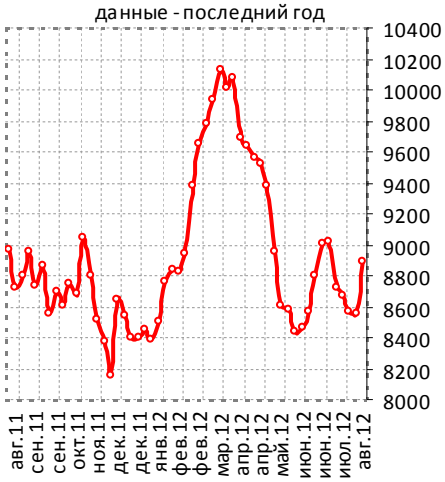
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

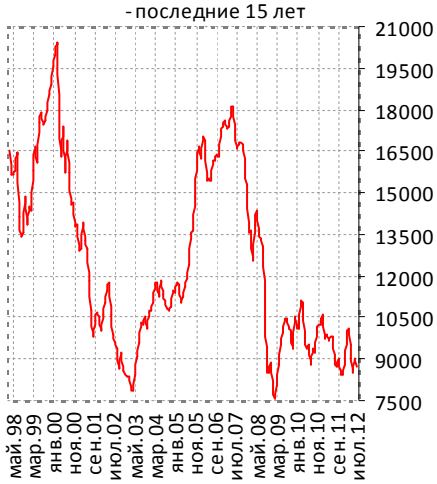
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



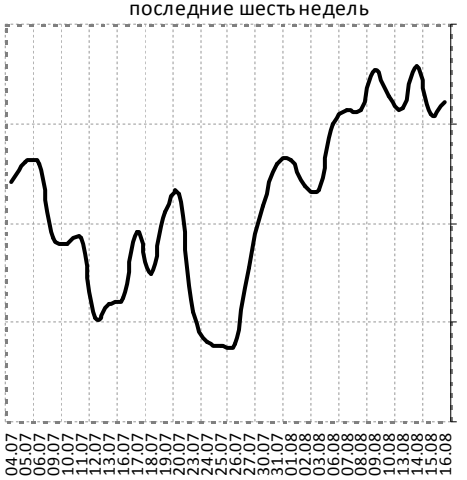
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



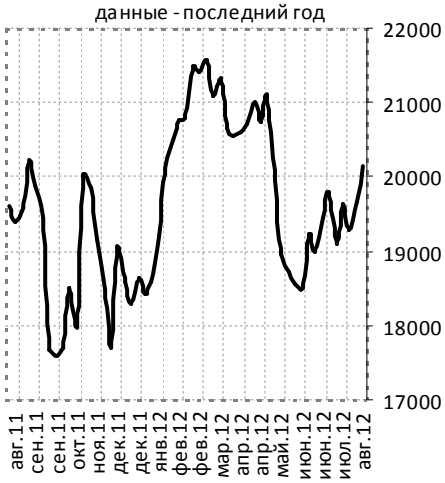
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



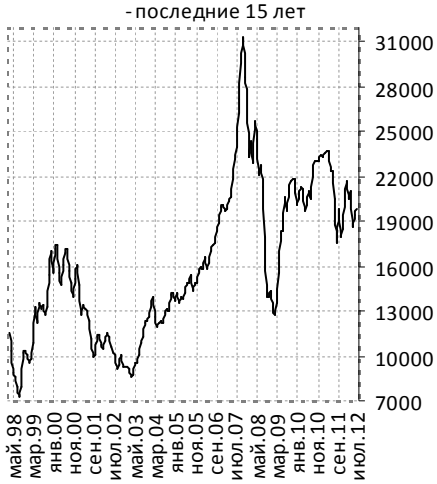
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



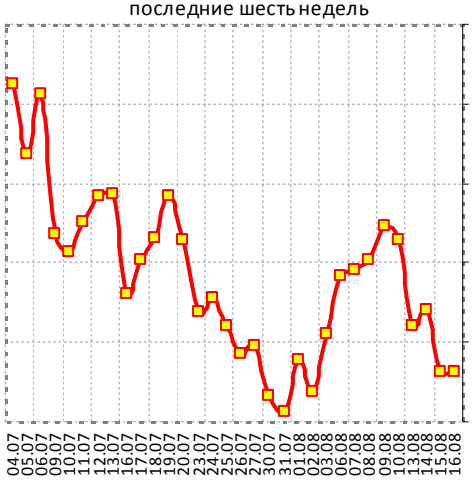
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



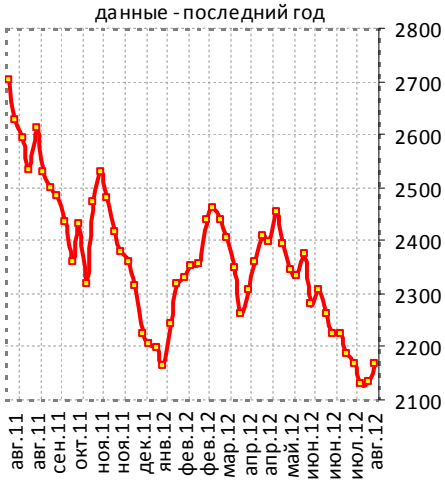
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



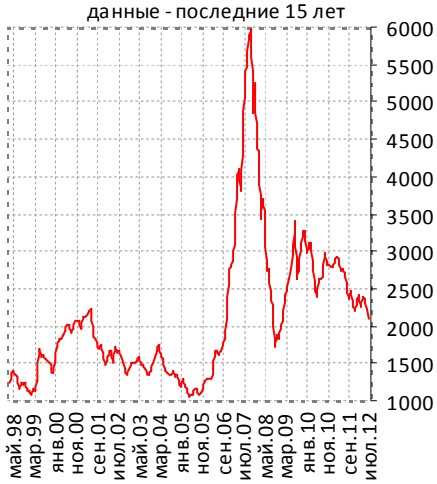
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



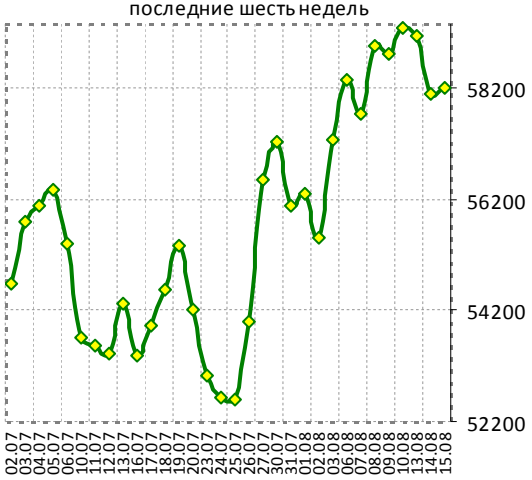
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



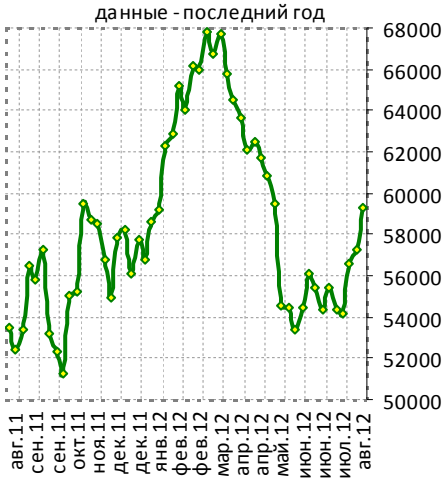
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

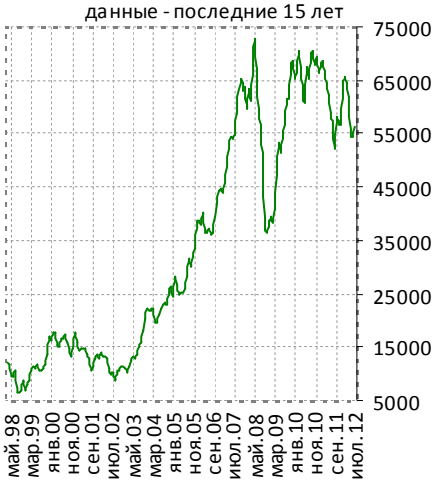
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



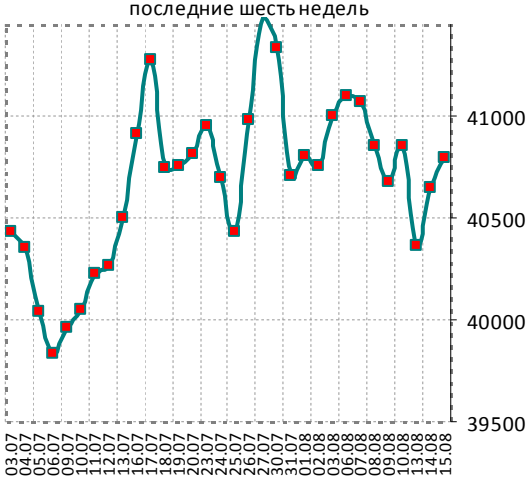
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



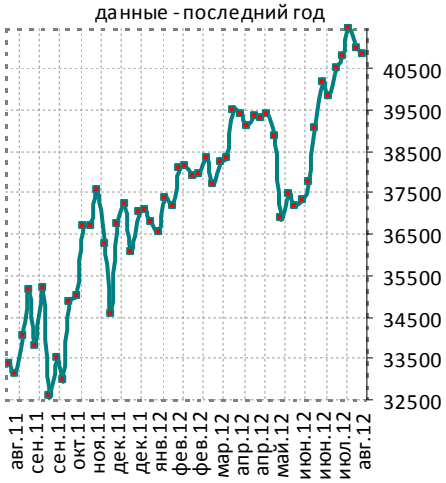
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



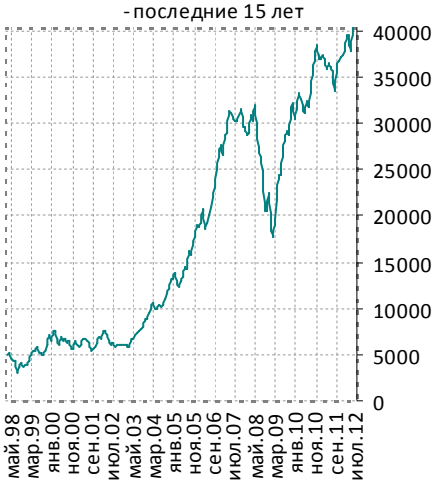
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



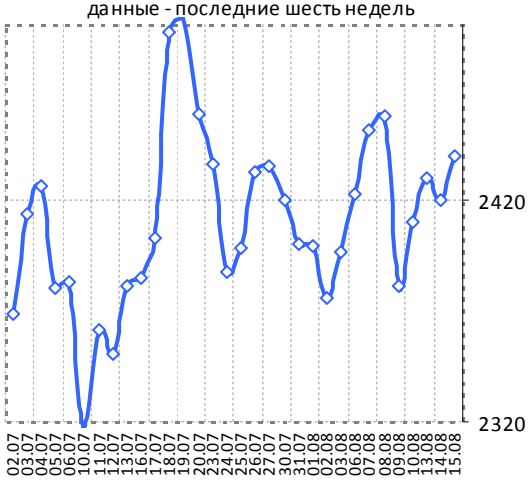
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



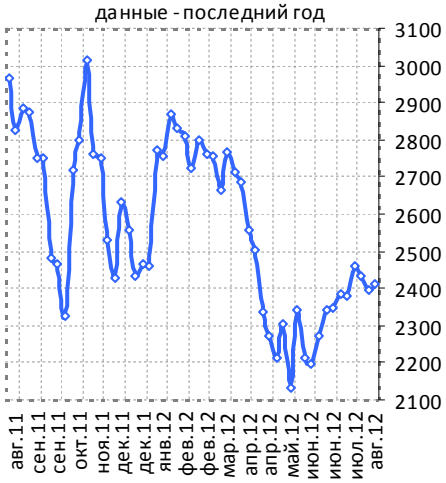
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



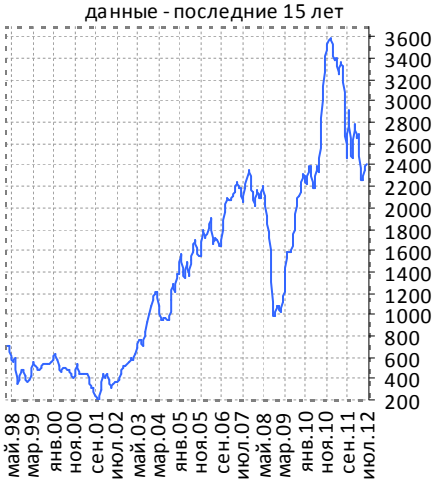
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

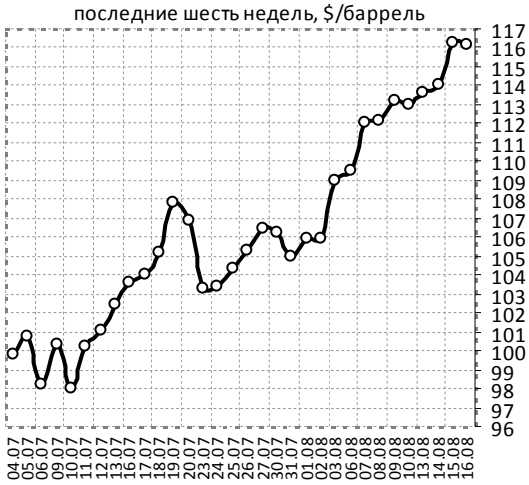


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

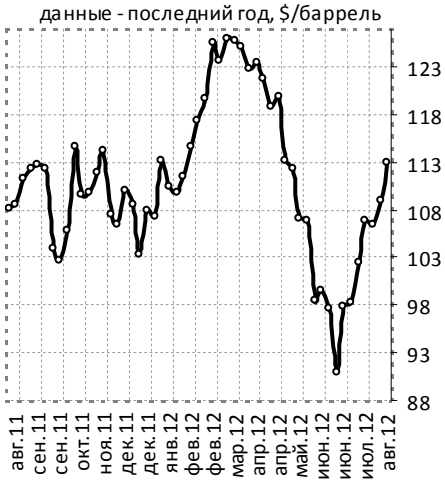
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

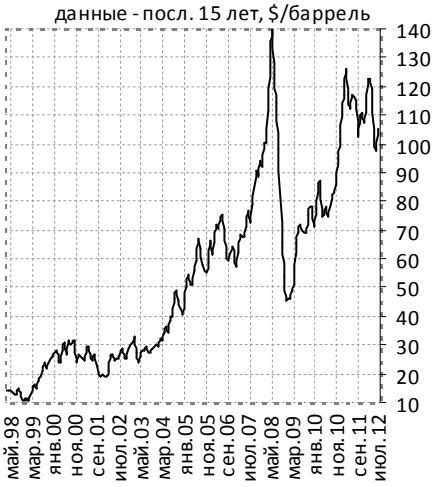
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



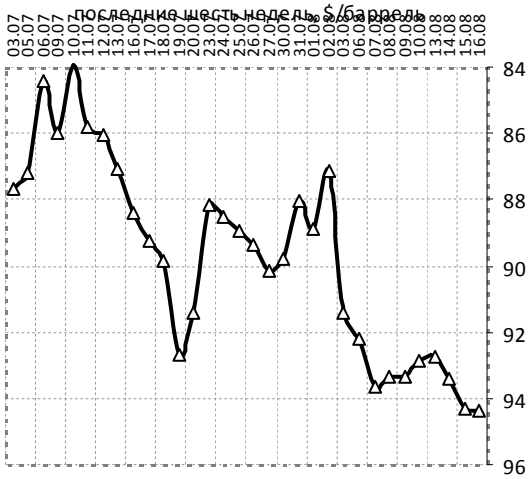
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



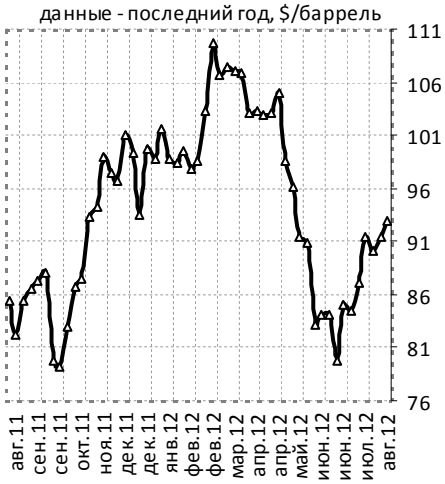
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



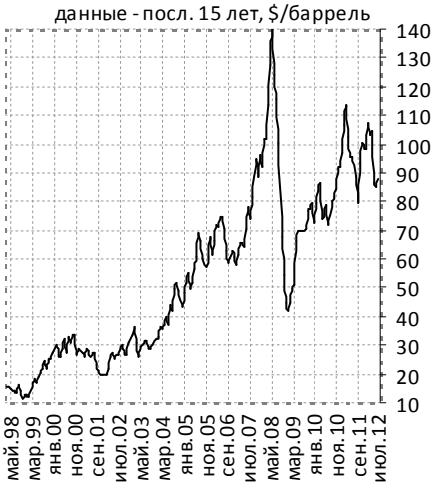
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



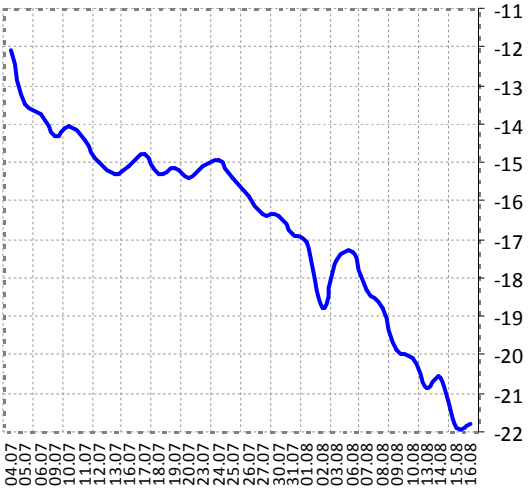
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



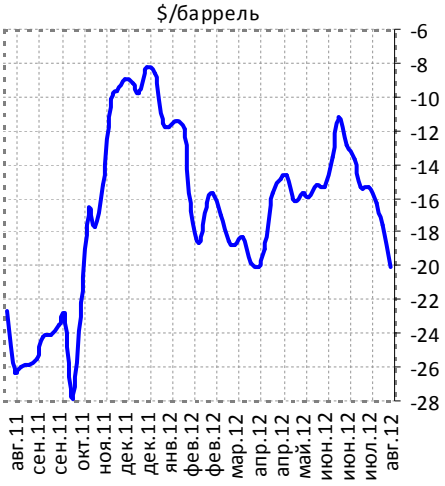
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



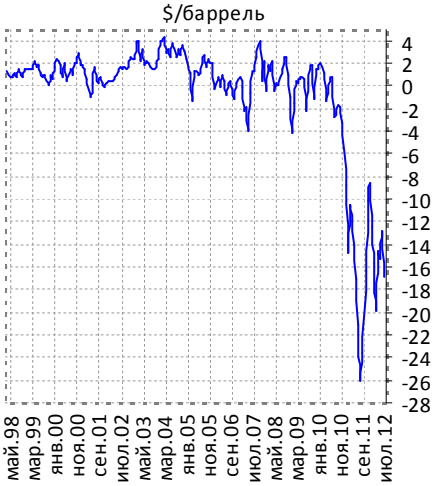
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



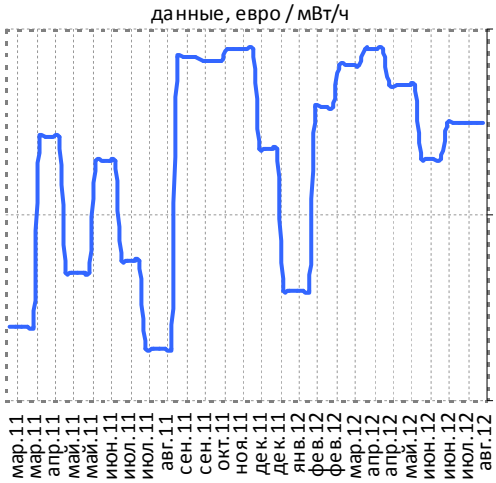
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



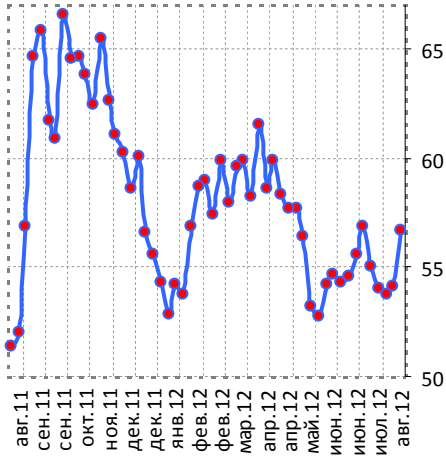
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

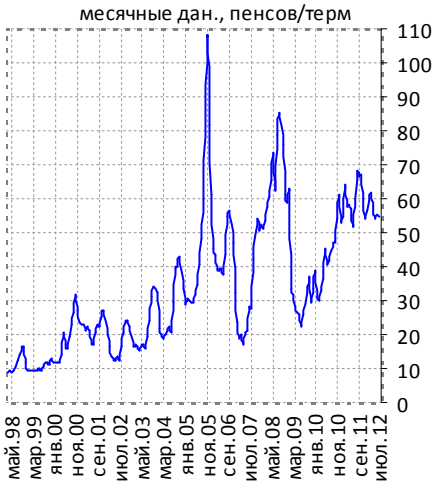
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



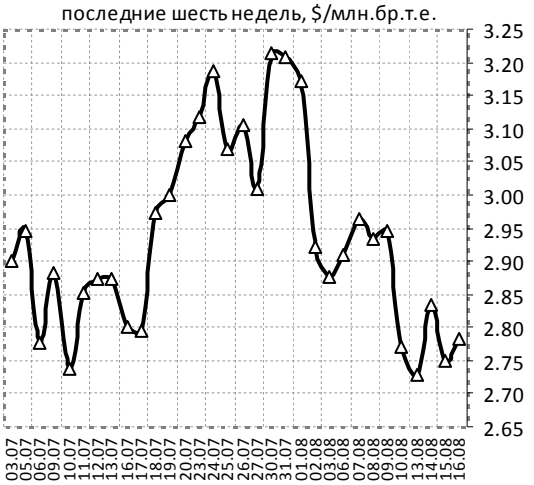
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



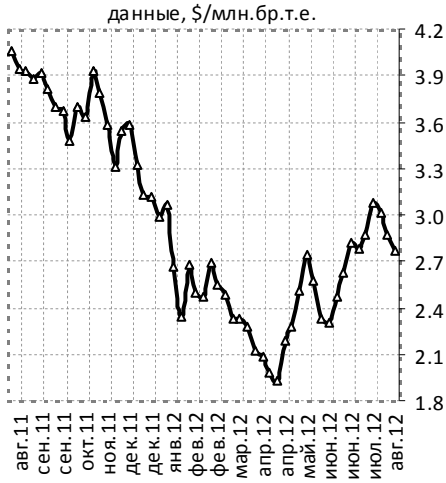
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



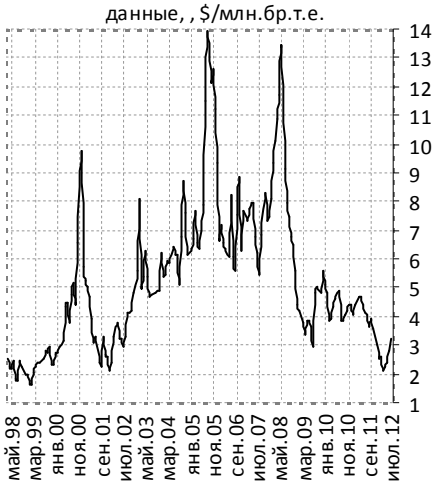
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



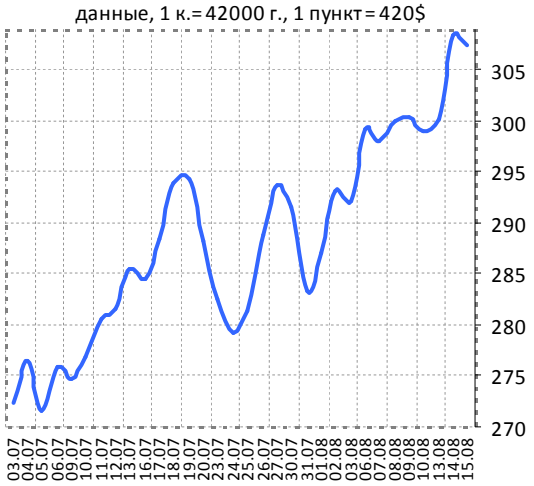
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



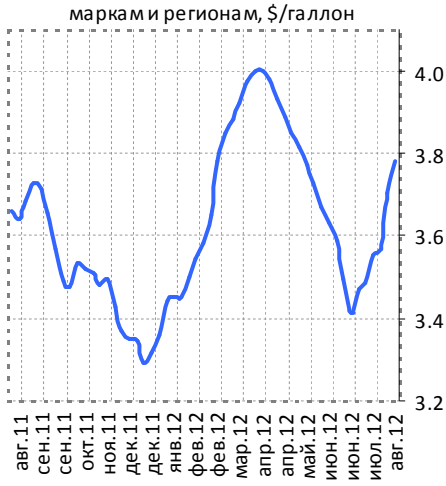
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



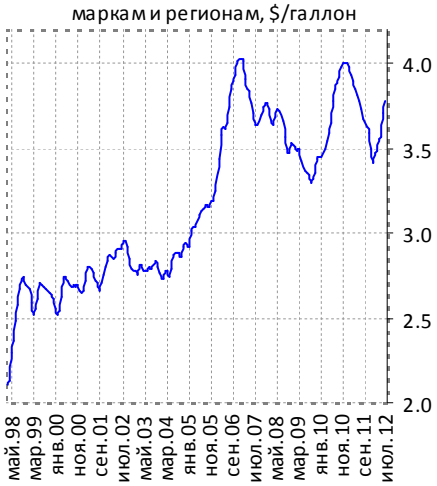
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



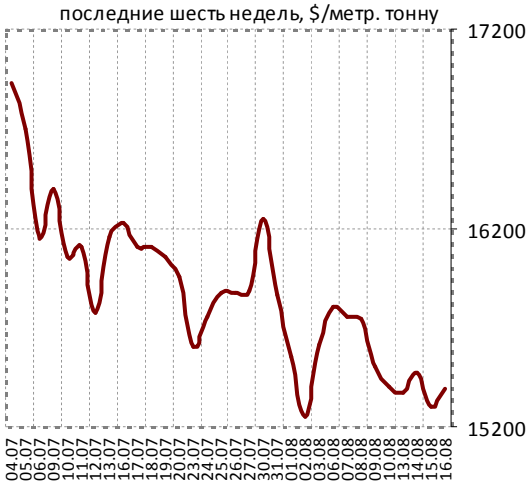
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



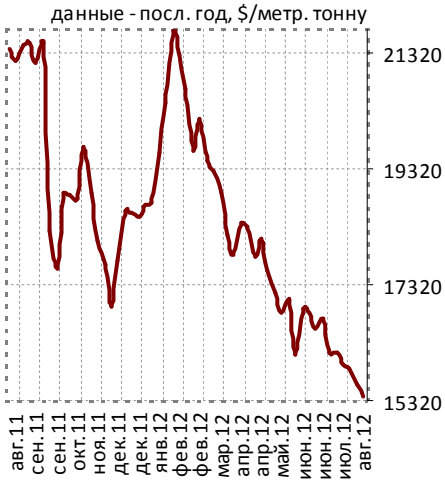
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

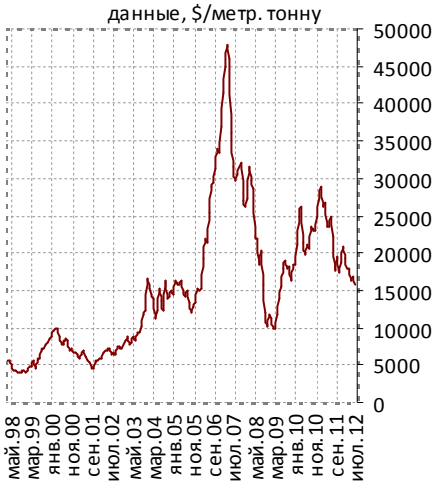
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



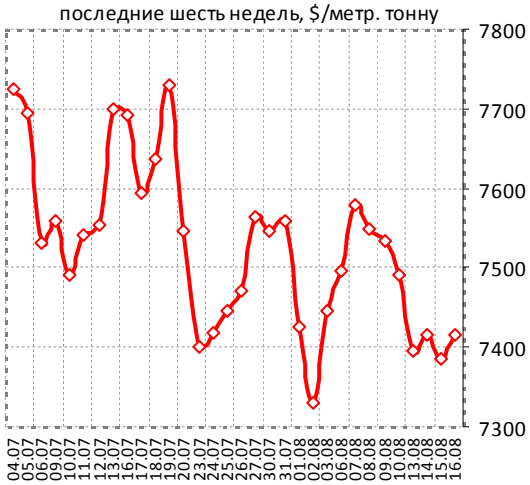
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



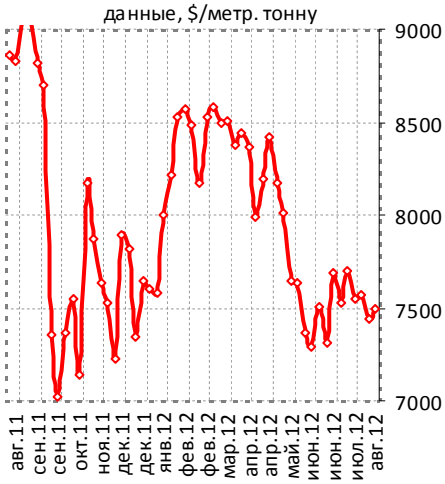
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



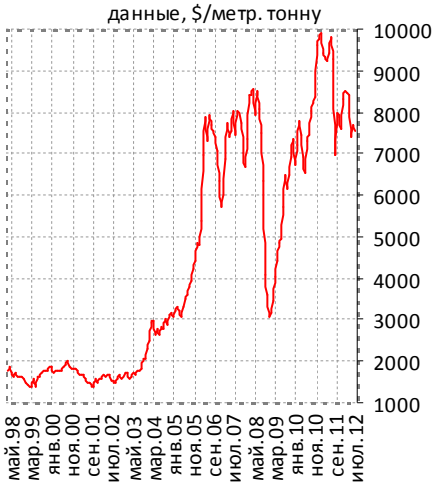
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



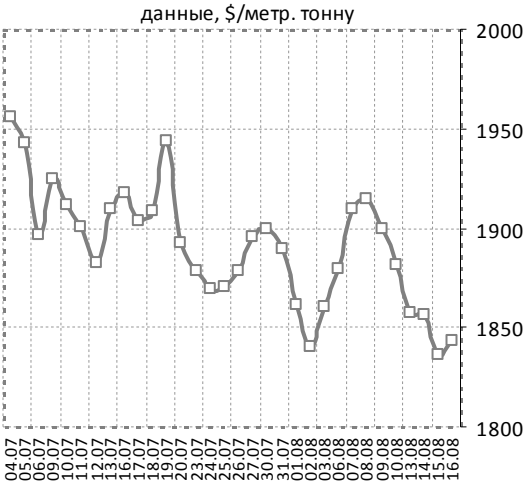
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



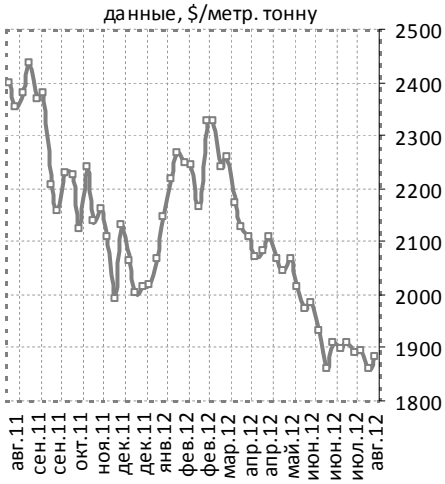
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



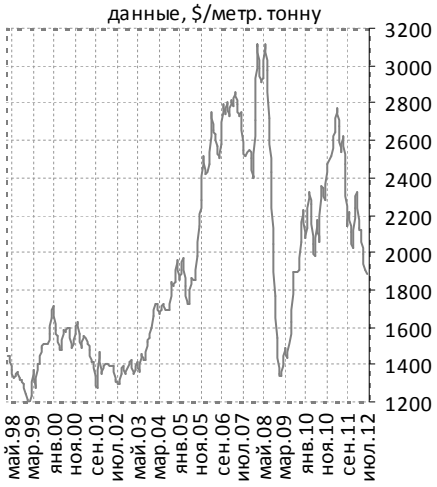
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.