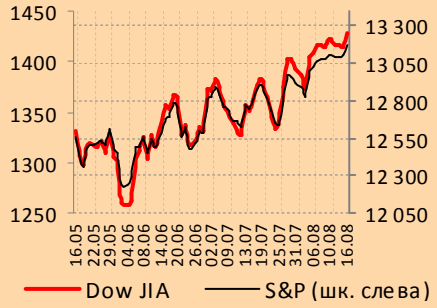
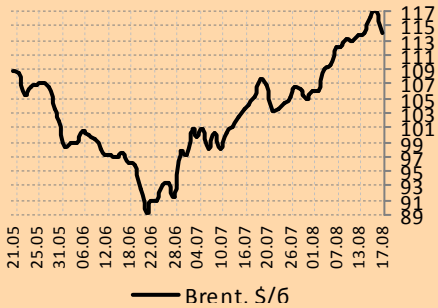
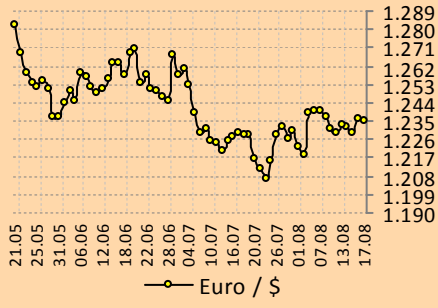
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

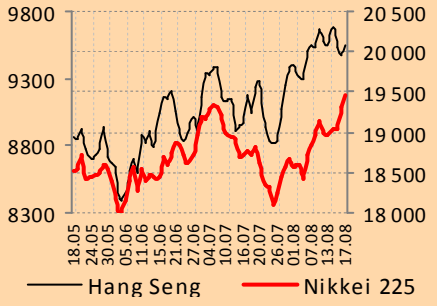
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

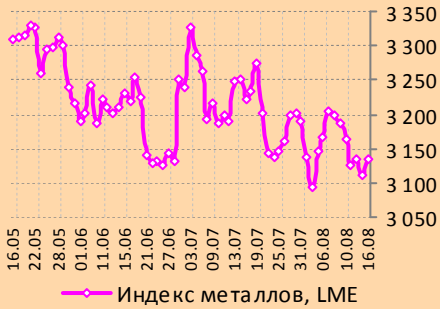
Ежедневный обзор

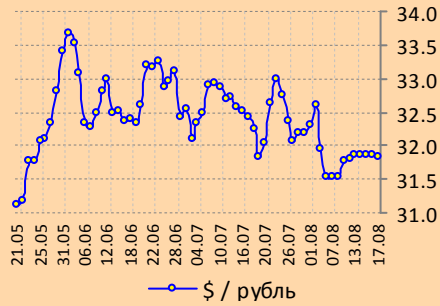






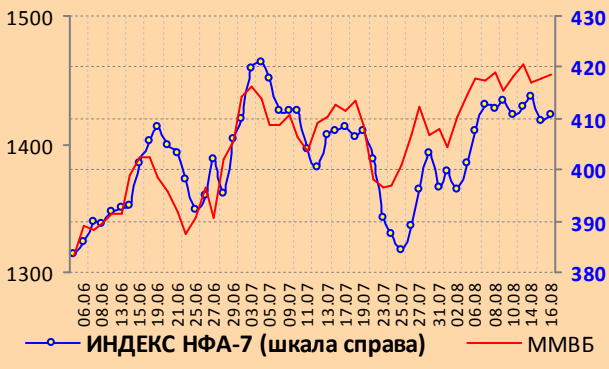






СОДЕРЖАНИЕ

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 2012-08-17

США. Количество первичных обращений за пособиями по безработице за неделю повысилось с 364 до 366 тыс., ожидалось не более 365 тыс. Число начатых строительств домов снизилось с 754 до 746 тыс. при ожиданиях роста до 757 тыс. Рынок жилья и рынок труда являются, как мы знаем, болевыми точками американской экономики, инвесторы реагируют на их динамику довольно остро. Но сейчас ведь все наоборот, чем хуже, тем лучше (ФРС получает повод для QE), Dow Jones =+0,65, S&P 500 =+0,71, NASDAQ =+1,04%. К тому же, корпоративная отчетность обещала хорошие дивиденды.

Из интересной статистики по США отметим рост использования производственных мощностей (за месяц с 78,9 до 79,3%), средняя загруженность мощностей промпредприятий за последние 20 лет составляет 79,5%. На долю производственного сектора приходится порядка 12% ВВП США. Потребительская инфляция в годовом измерении снизилась до 1,4% (в июне 1,7, в марте 2,7%). Снижение цен может быть еще одним поводом для ФРС провести еще один раунд количественного смягчения.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, индексы показали небольшой рост, индекс ММВБ =+0,25, РТС =+0,24%. На дневном аукционе из 10 млрд. руб., предложенных вчера на 1 день банкам со стороны ЦБ, взяли 9,3 млрд. под 5,99% (ставка рынка 5,79%).Казначейство разместило средства федерального бюджета на банковские депозиты, при предложении в 50 спрос составил 88 млрд. руб., в аукционе участвовали 4 банка, средневзвешенная ставка размещения 6,9%, дата возврата средств 16 ноября.

Европа. Котировки росли, в результате FTSE 100 =+0,03, DAX =+0,71, CAC 40 =+0,91%.

Новости, однако, носили разноплановый характер. Так, SandP отметило, что финансирование банков через постоянный европейский стабфонд ESM не скажется на улучшении их рейтинга. Греция провела дополнительное размещение 3-месячных гособлигаций на сумму 0,9 млрд. евро, что вместе с размещёнными днем ранее аналогичными бумагами позволило получить до 5 млрд. евро. Напомним, что 20 августа стране предстоит погасить обязательства в сумме 3,2 млрд. евро.

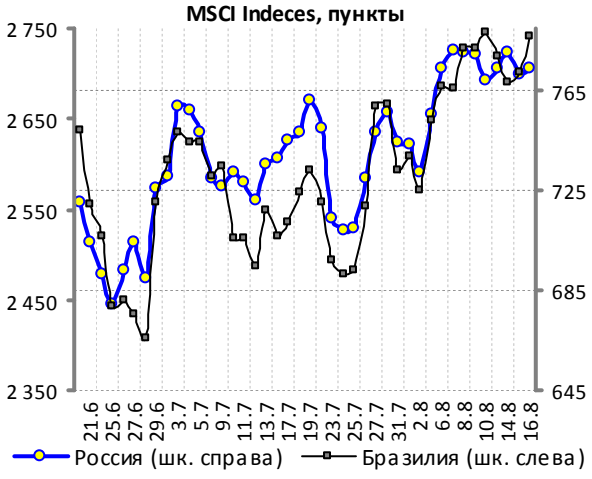
Азия. Премьер-министр Китая заявил о возможности смягчения денежной политики на фоне замедления инфляции, подчеркнув, однако, что хотя правительство имеет все необходимые инструменты для достижения целевых показателей текущего года, тем не менее, понижательные риски для экономики остаются относительно высокими. Именно на это дополнение и отреагировали китайские биржи вчера (SSE -0,32, Hang Seng -0,45%), остальные азиатские рынки завершили сессию в плюсе (Nikkei +1,88, Kospi + 0,05%). Значение Nikkei достигло максимального уровня с начала июля, причина в спекулятивных покупках акций экспортеров при ослаблении иены по отношению к доллару после выхода накануне хорошей макростатистики в США. В Южной Корее позитивным фактором роста котировок стало снижение уровня безработицы с 3,2 месяцем ранее до 3,1%.

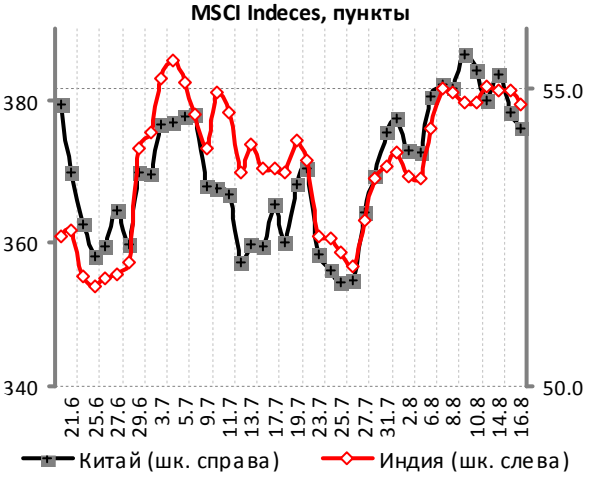
Золото. Доллар дешевеет, цены драгметаллов колеблются вместе с движением фондовых площадок как рядовой актив. Так, утром четверга фьючерсы на золото торговались по 1606,8 долл. за унцию, к 14.00 по 1605,57 долл., сегодня утром золото = 1617,7, серебро = 28,11, платина = 1444,3, палладий = 586,5 долл./унция.

Нефть. Цену нефти удерживают на высоком уровне как геополитические, так и факторы локального характера. Так, усиливается напряжение на Ближнем Востоке, помимо Сирии, представители Израиля заявили, что готовы нанести удар по Ирану. Из текущих моментов отметим понижение запасов нефти в США (оказались на минимальном за 4 месяца уровне), причем, снижение наблюдается третью неделю подряд, что можно было бы расценить как появление тенденции, если бы не возрастание сезонного спроса. Утром четверга Brent и Light шли 114,33 и 96,63 долл. за барр., к 14.00 соответственно по 114,48 и 94,59 долл., сегодня с утра по 114,05 и 95,38 долл./барр.

Статистика, прогноз. Ждем информацию по торговому балансу зоны евро (13.00), а также по США индексы потребительских настроений Мичиганского университета (17.55) и опережающих индикаторов (18.00). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются от -0,06 до +1,08%, Азия от -043 до +0,82%, но цена нефти находится на приличном уровне. У нас продолжается очередной налоговый период, регуляторы оперативно пополняют ликвидность (хотя рубль слабеет вопреки спросу). Наши биржи пытаются использовать комфортные цены акций и нефть в качестве драйверов роста, и, если внешняя статистика не окажется негативной, рост может быть сохранен.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 17.08.2012.

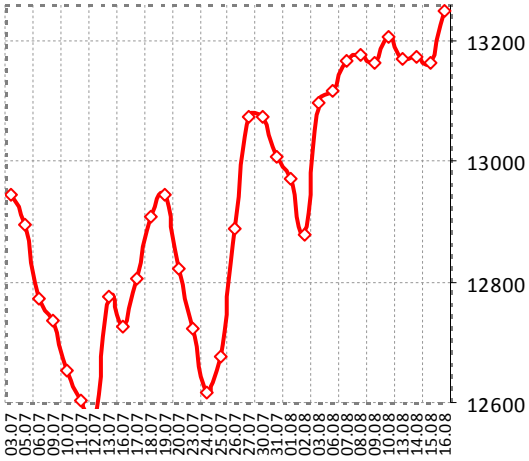




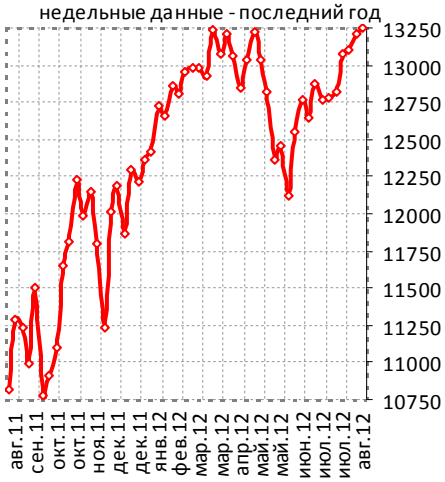
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

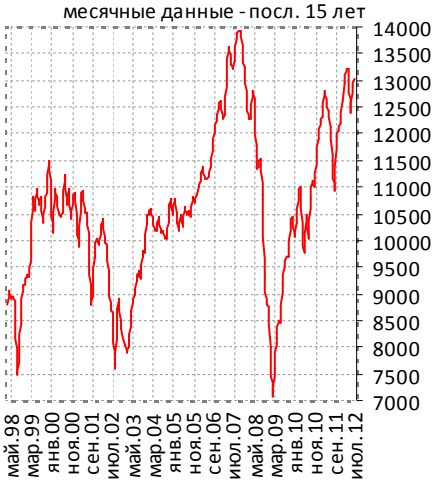
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



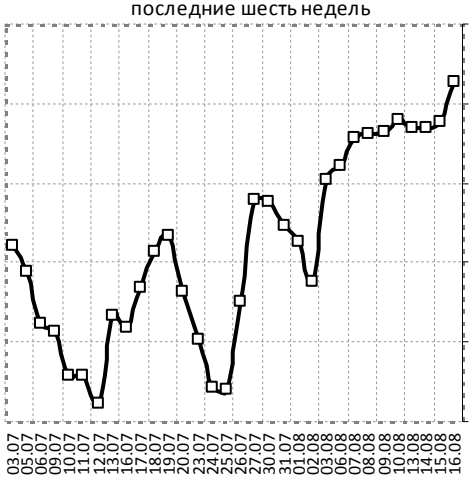
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



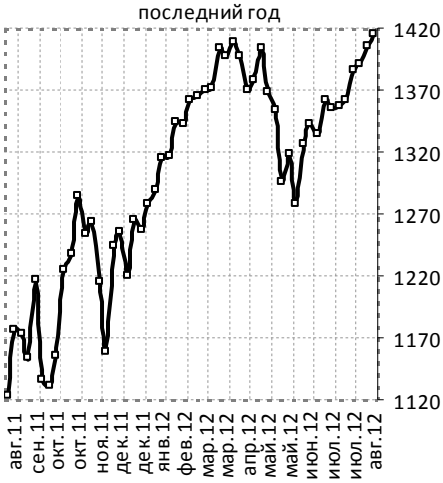
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



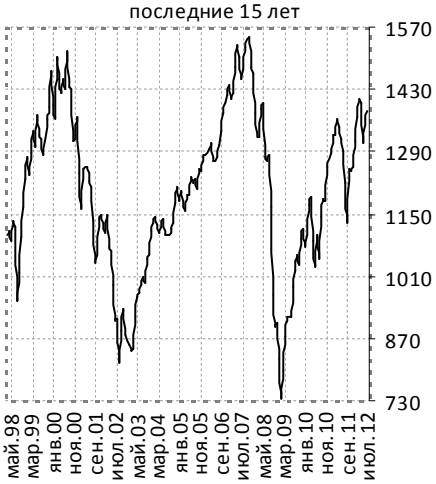
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



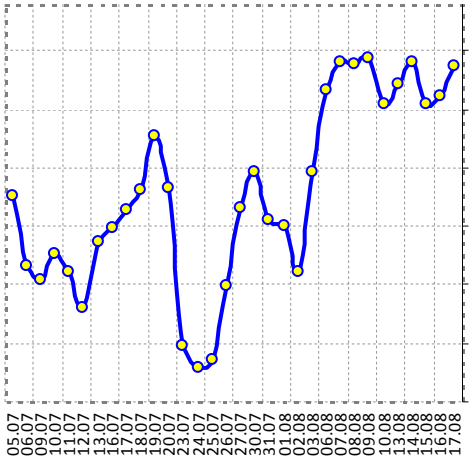
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



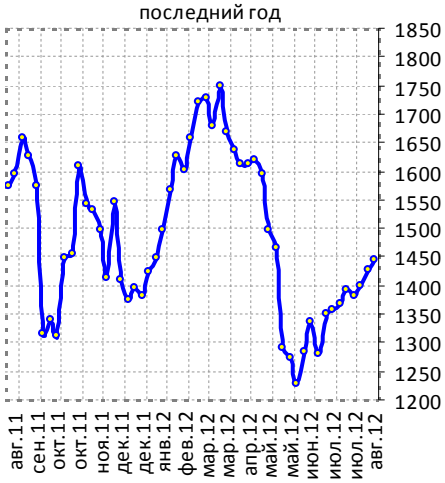
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



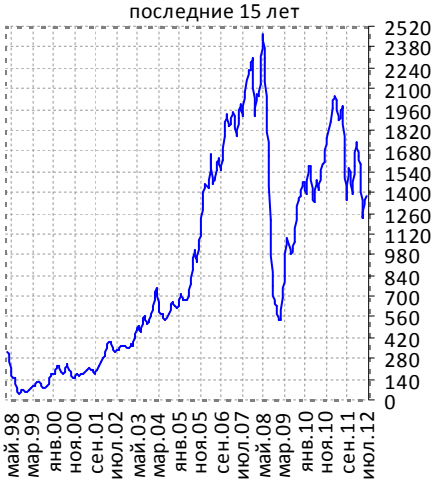
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



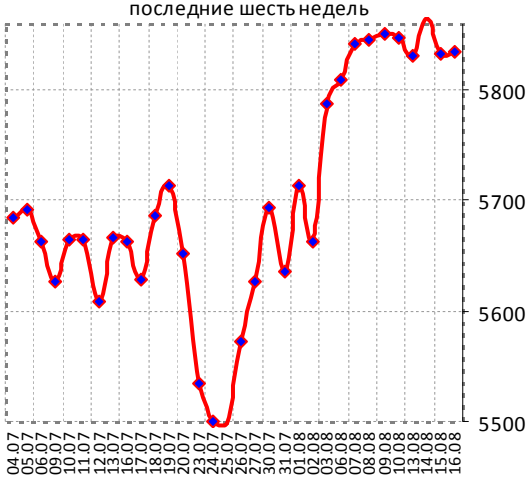
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



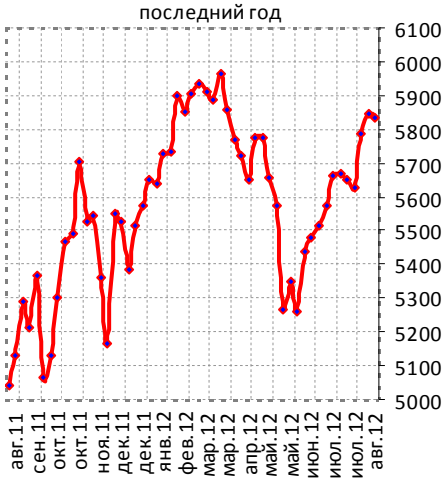
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

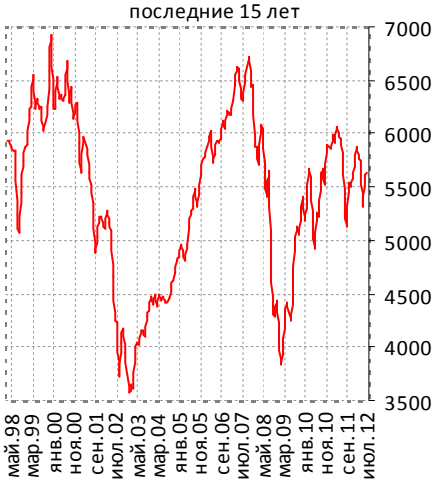
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



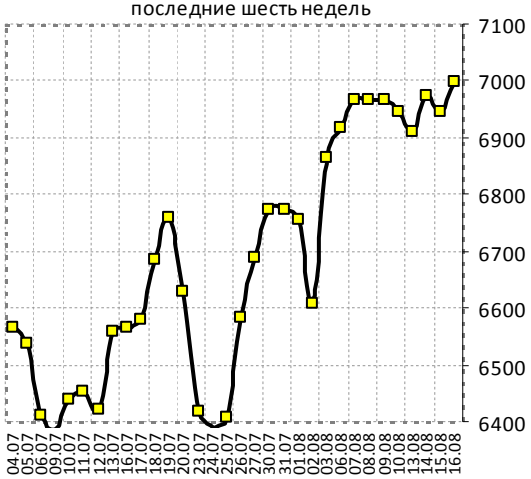
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



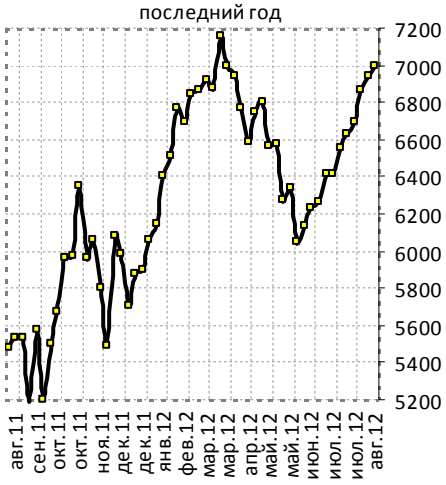
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



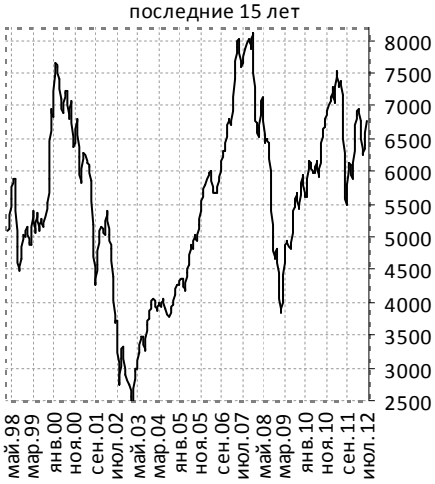
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



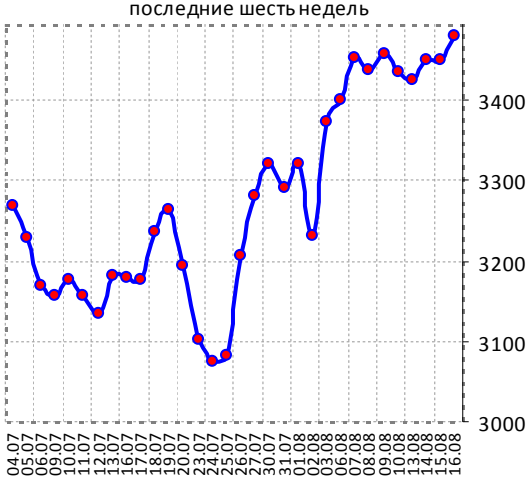
DAX Index: недельные данные - последний год



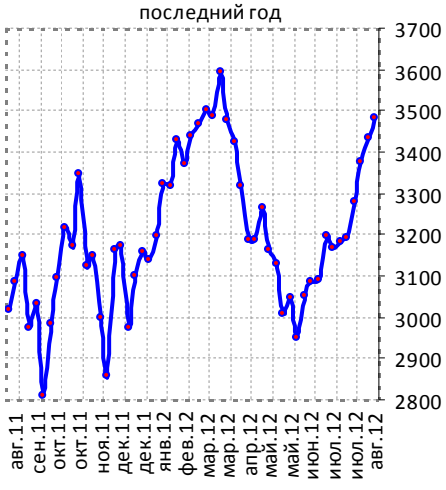
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



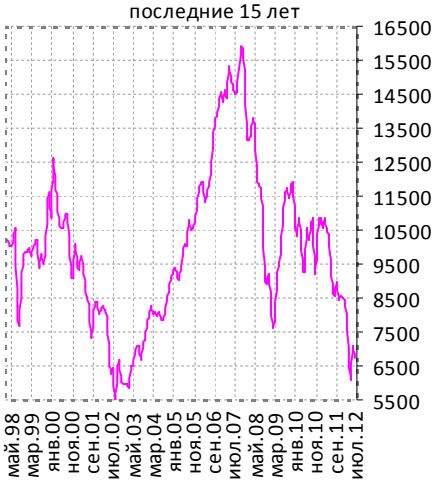
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

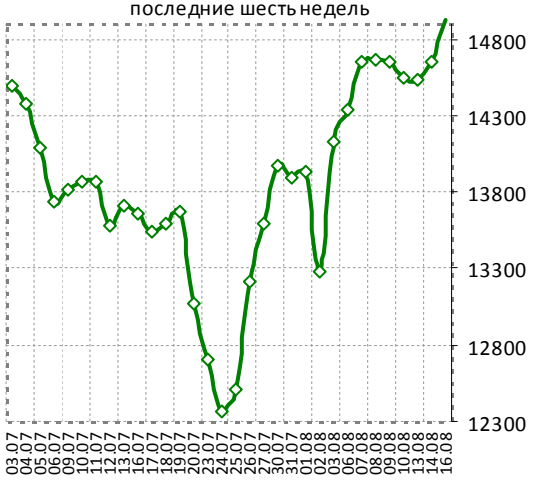


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

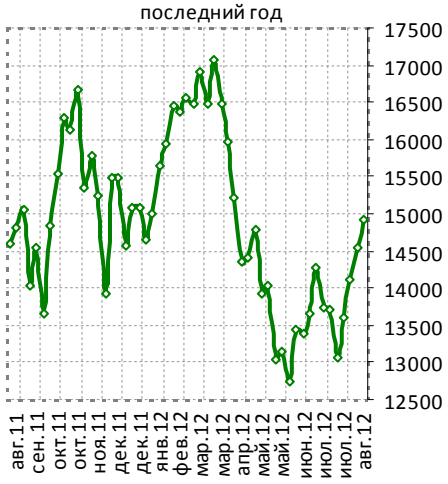


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

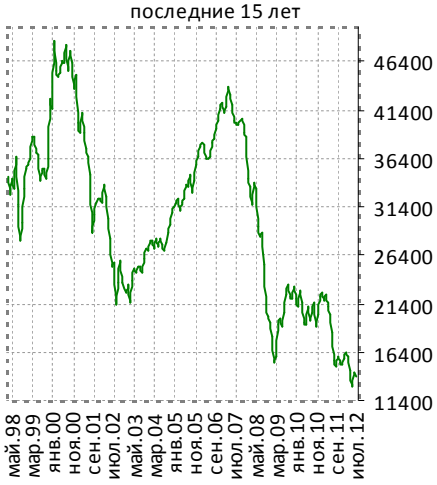
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



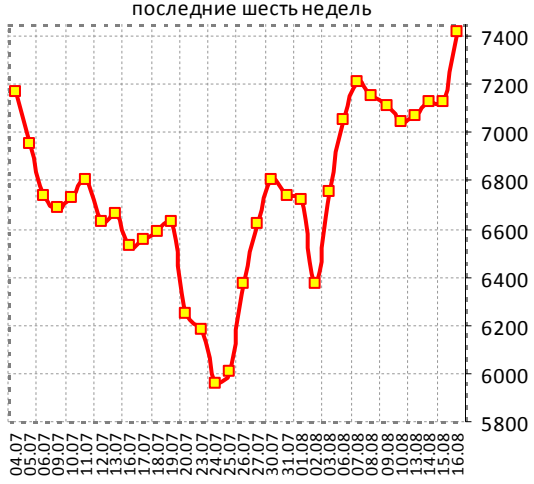
MIB Index: недельные данные - последний год



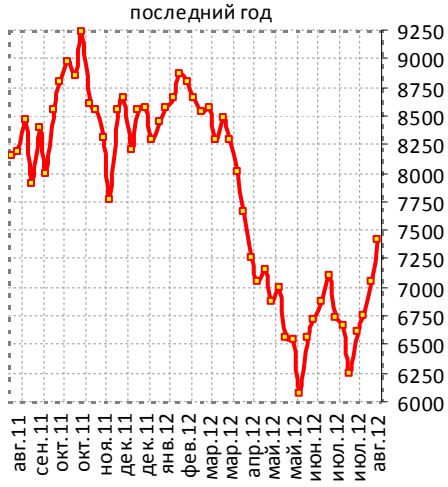
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



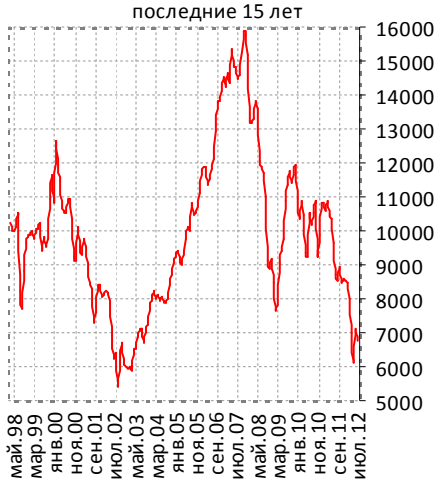
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



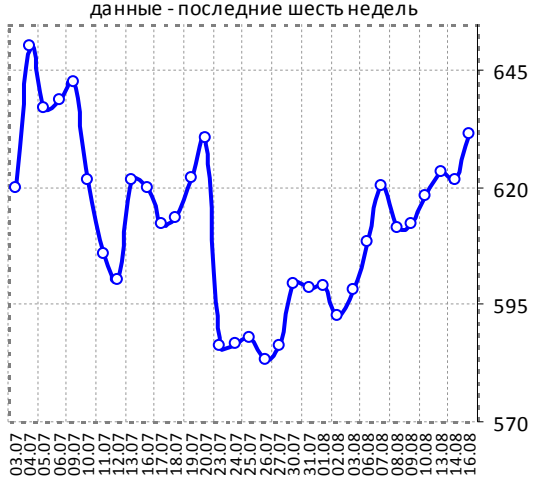
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



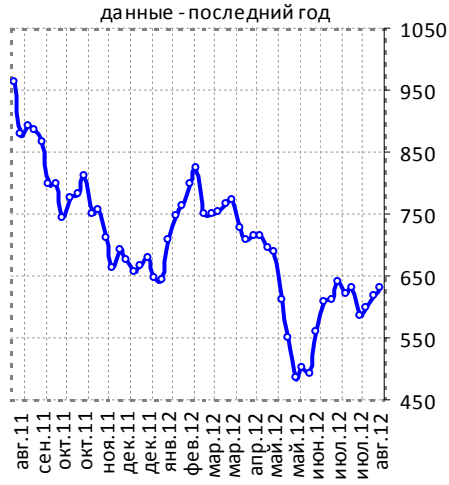
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



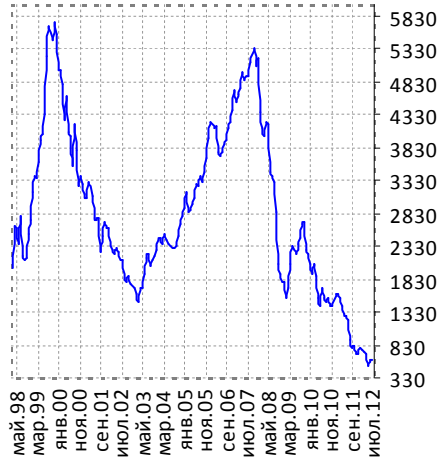
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



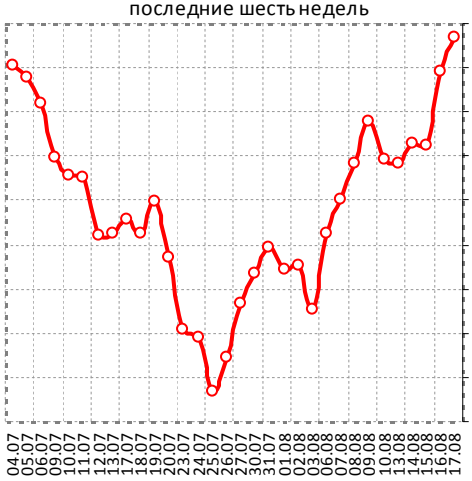
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



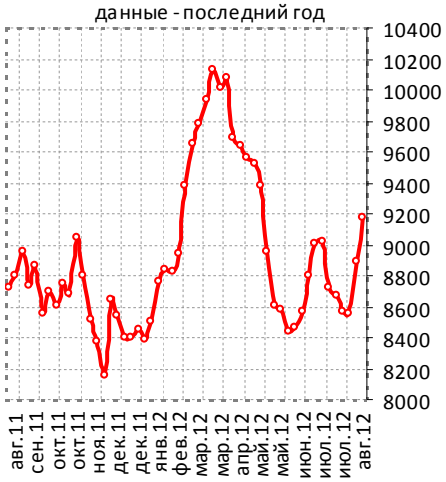
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

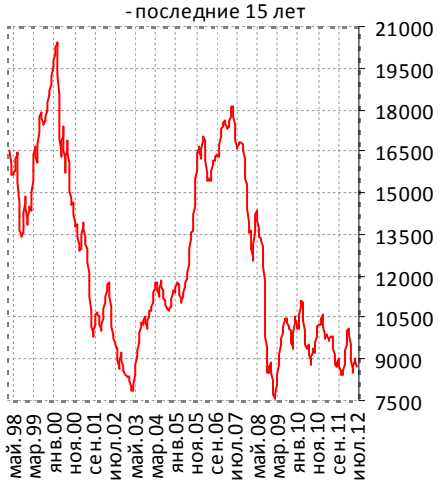
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



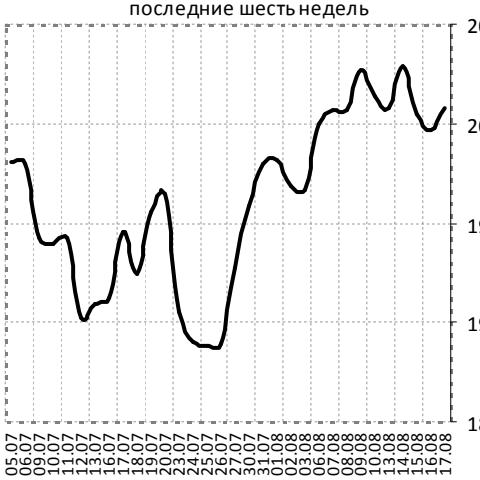
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



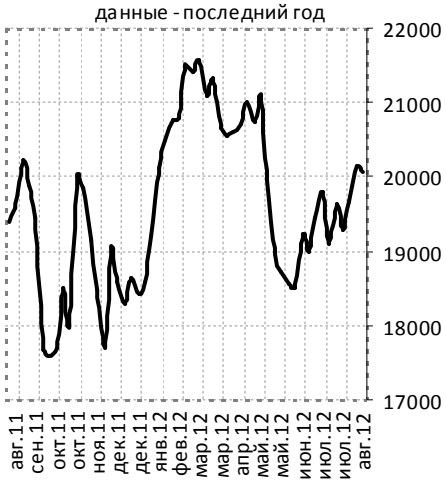
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



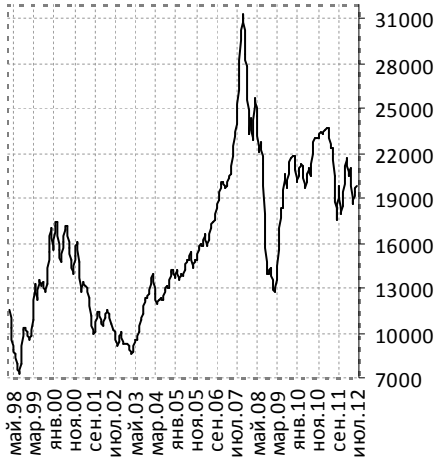
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



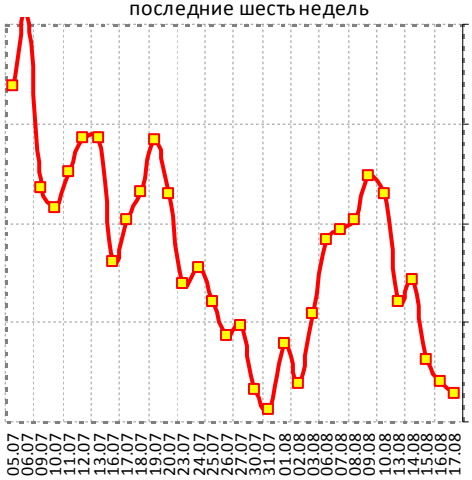
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



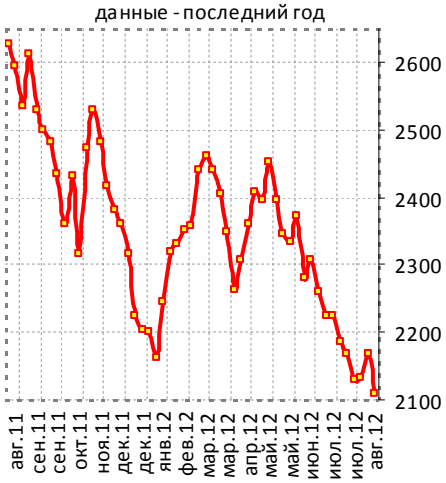
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



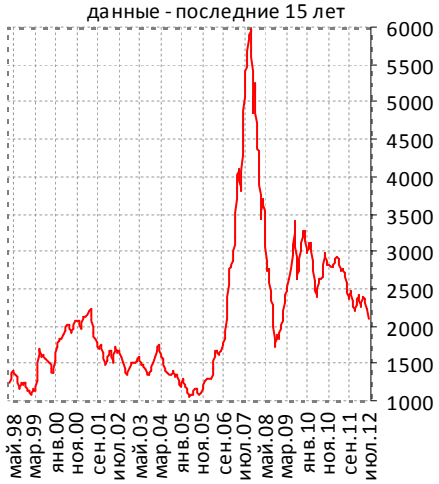
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



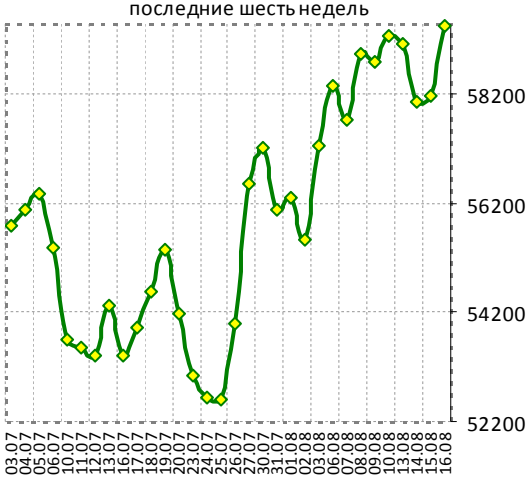
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



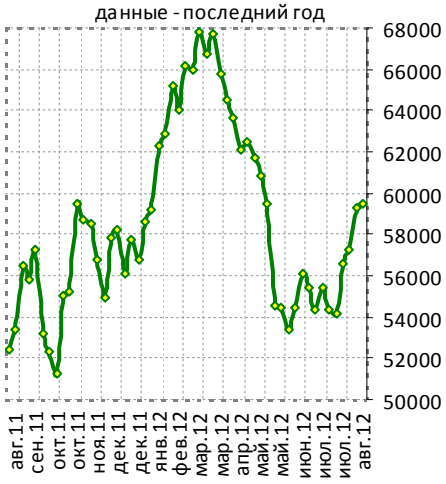
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

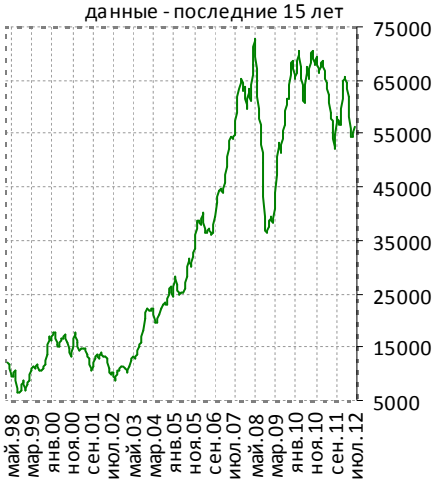
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



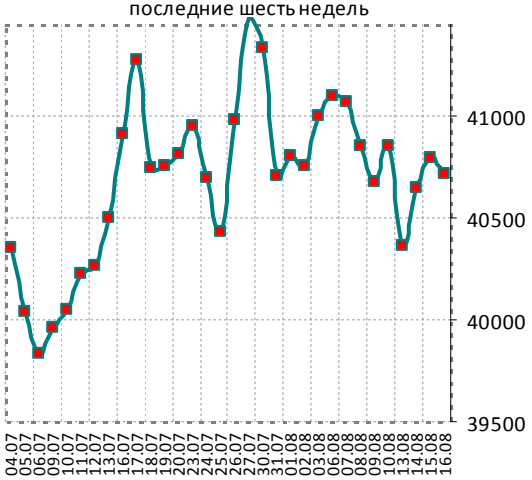
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



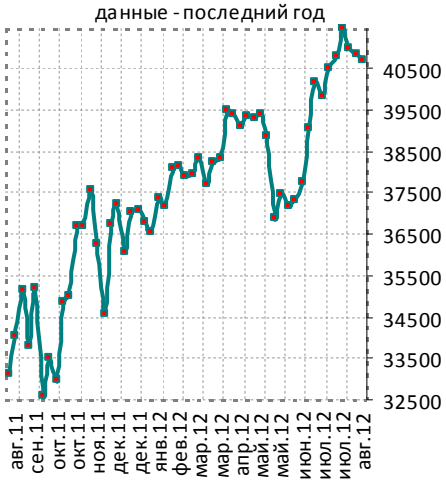
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



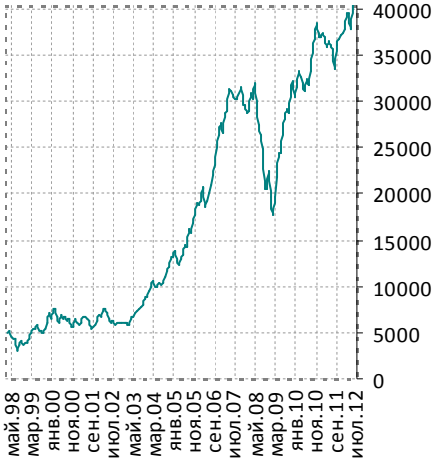
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



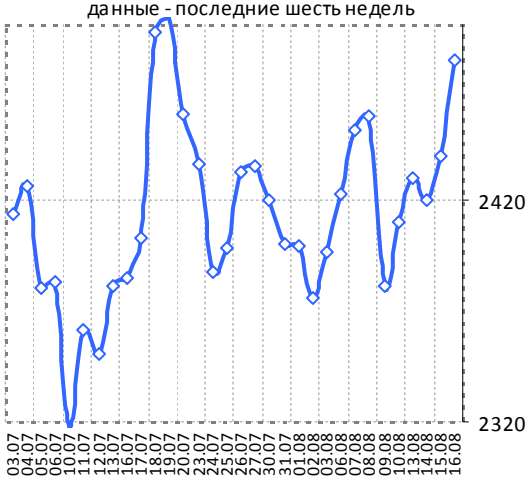
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



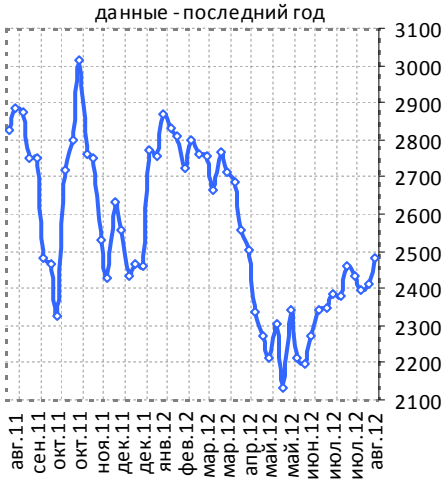
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



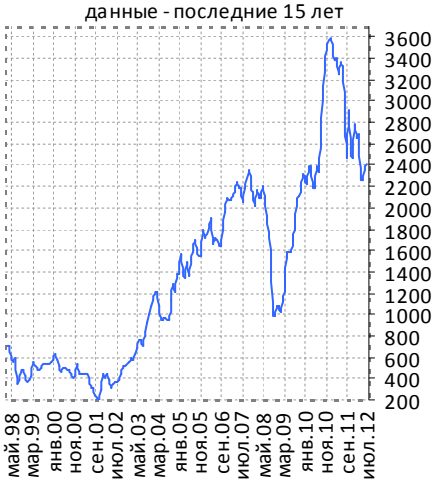
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

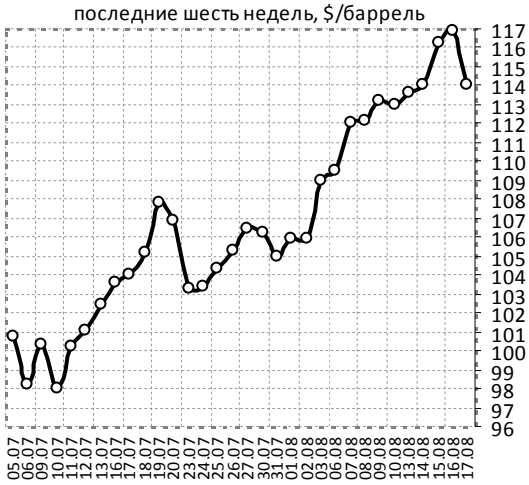


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

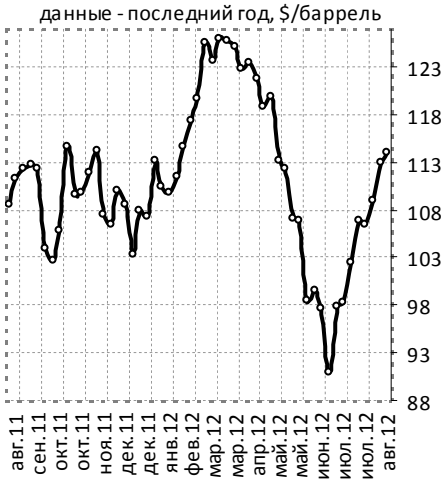
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

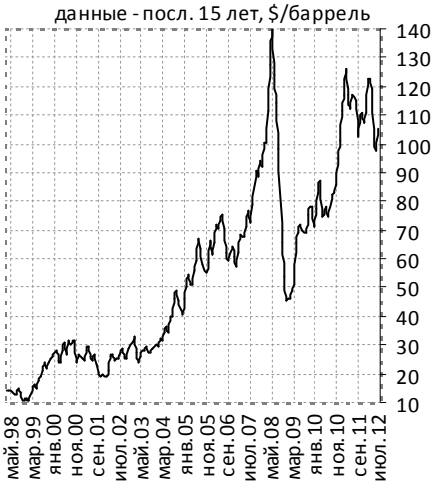
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



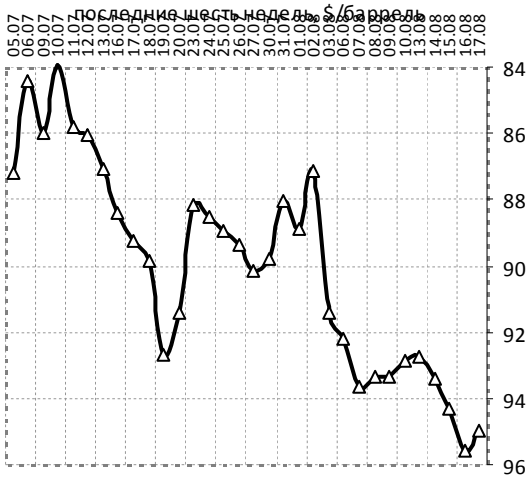
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



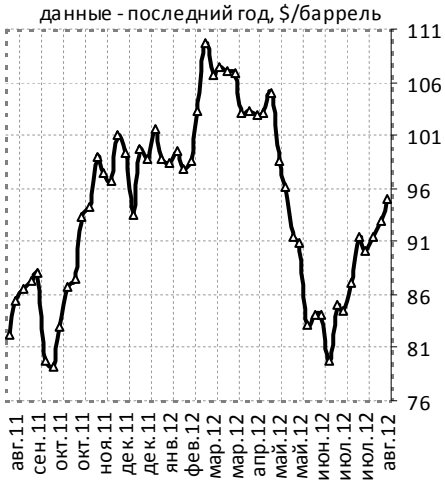
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



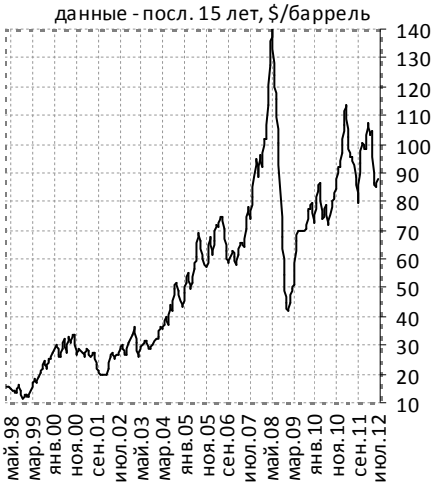
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



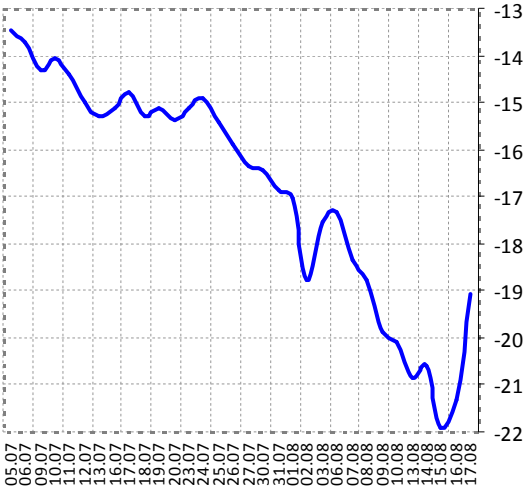
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



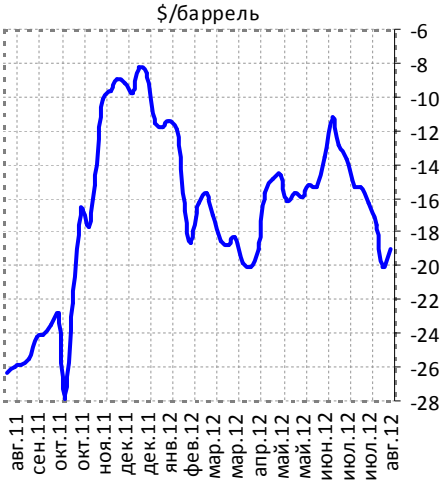
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



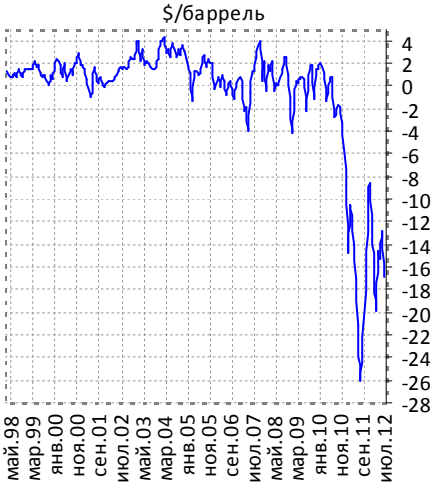
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



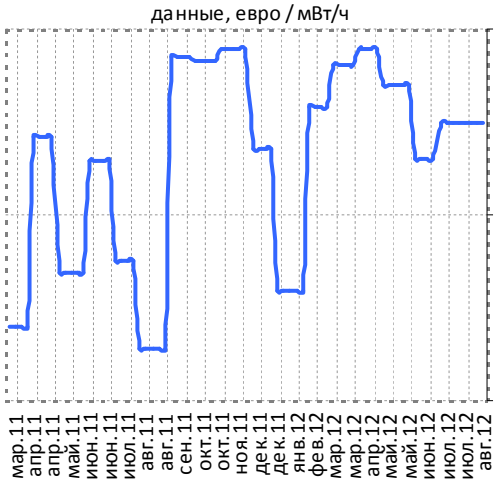
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



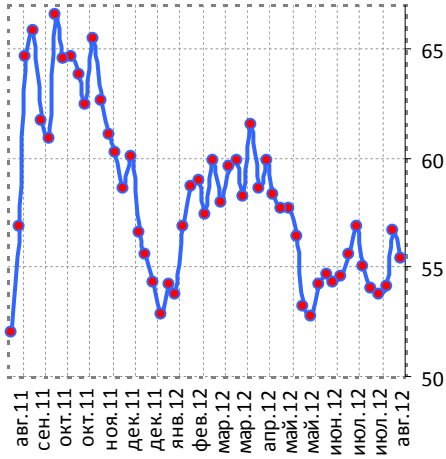
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

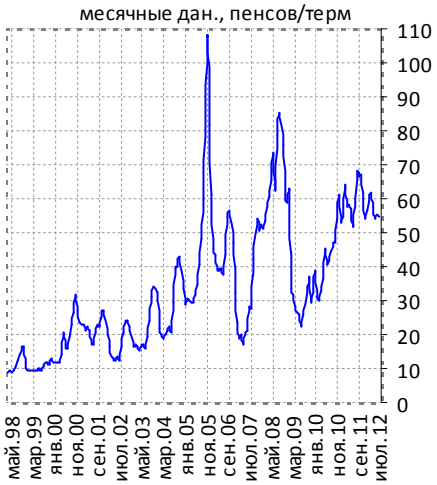
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



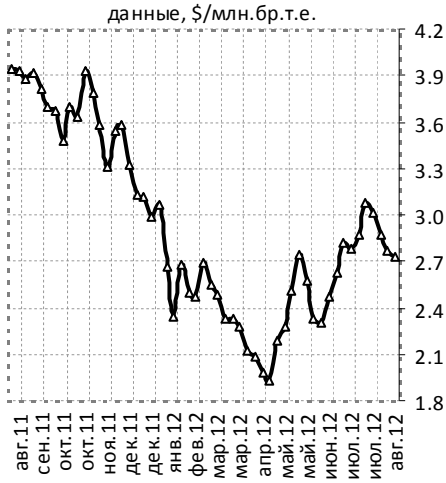
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



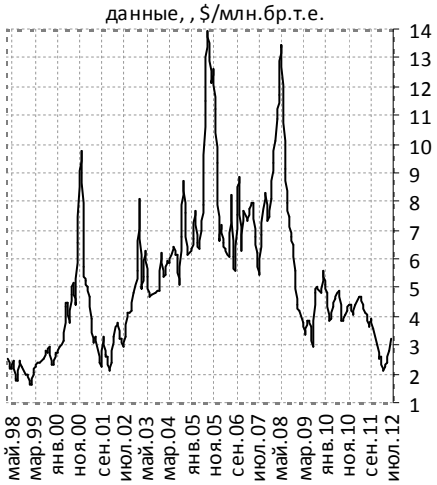
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



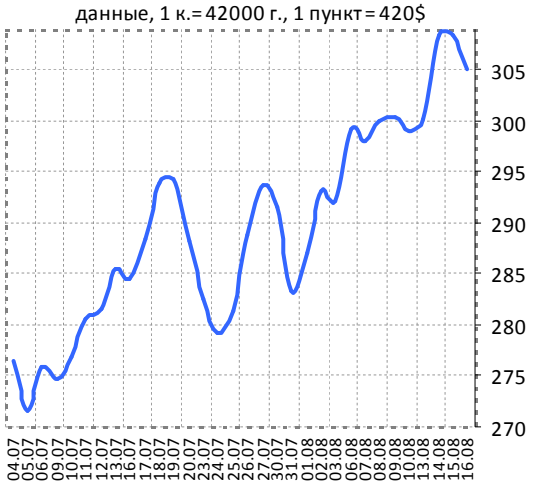
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



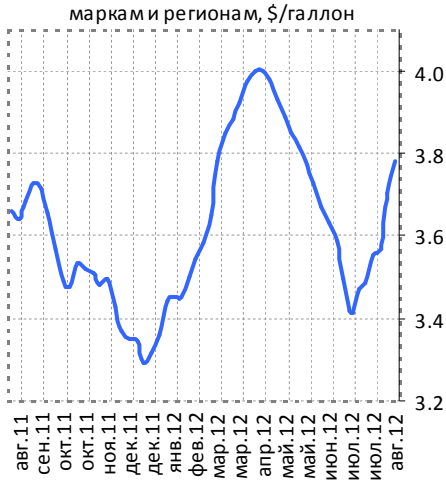
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



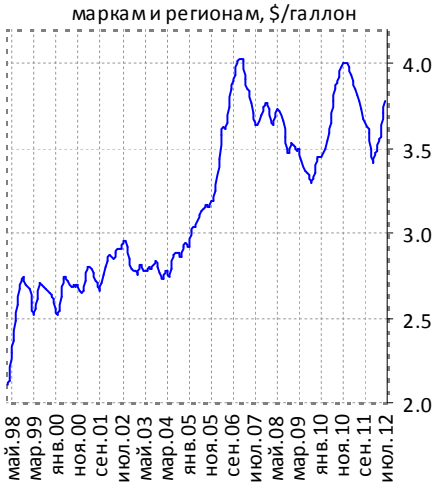
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



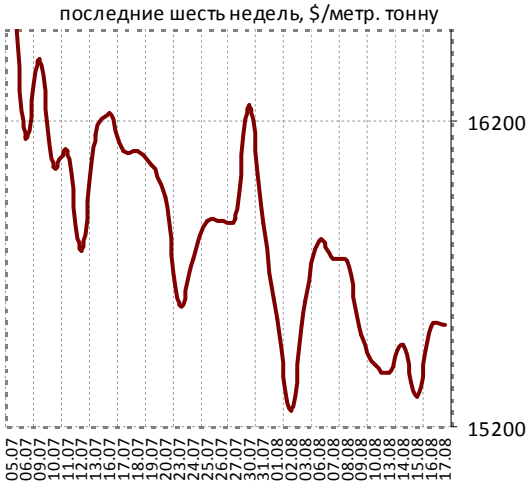
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



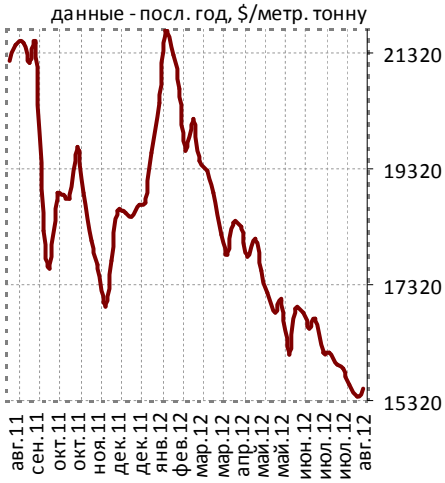
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

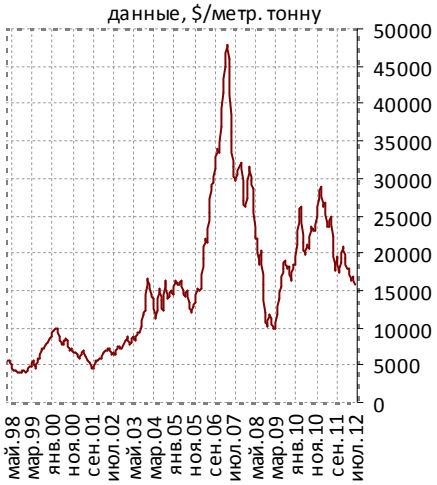
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



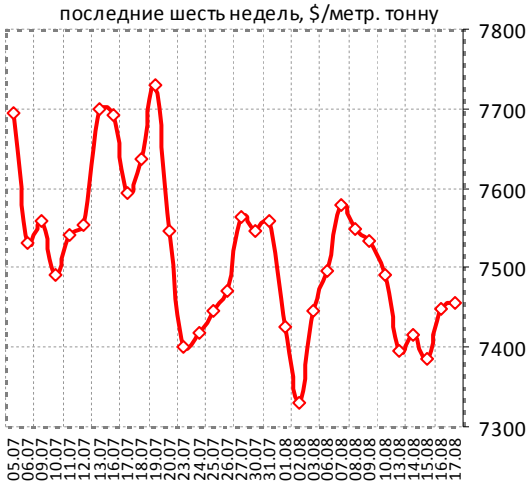
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



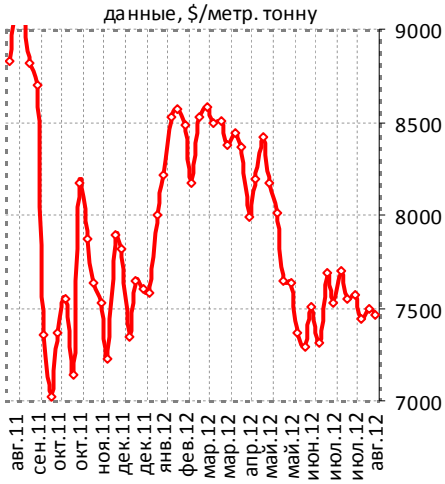
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



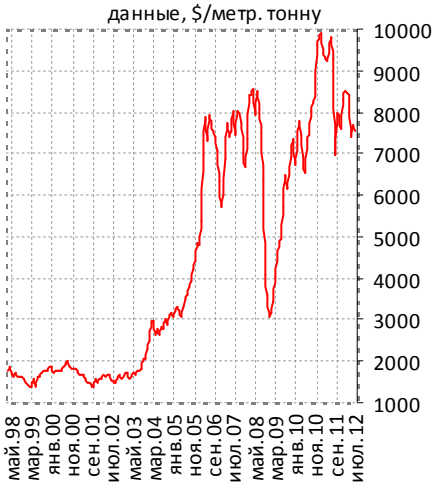
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



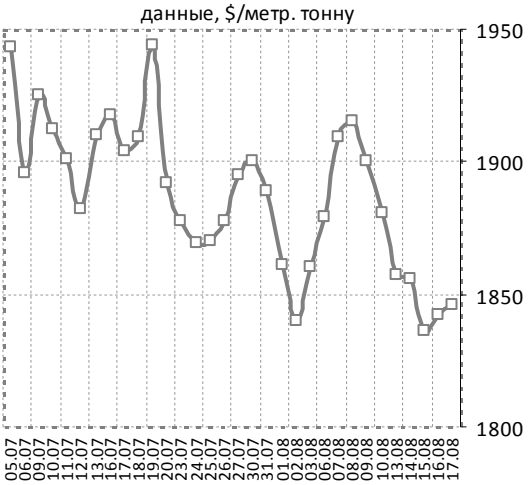
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



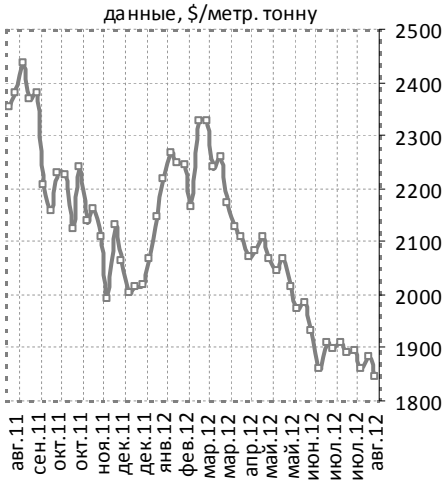
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



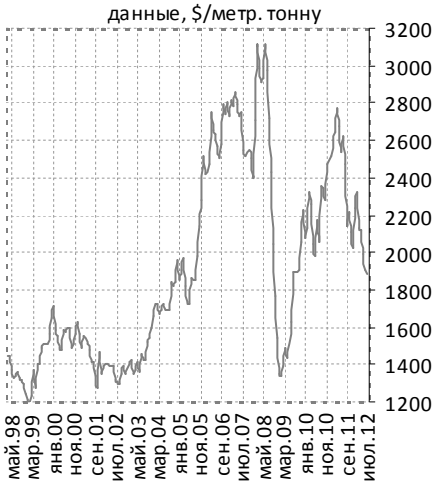
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.