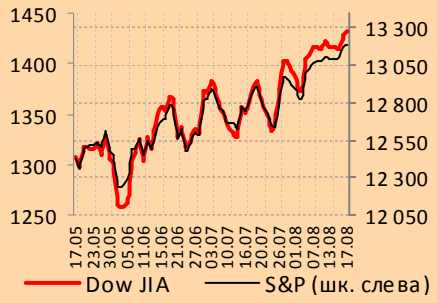
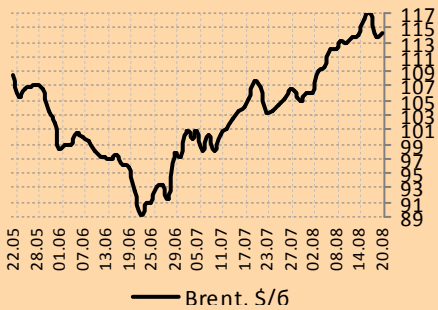
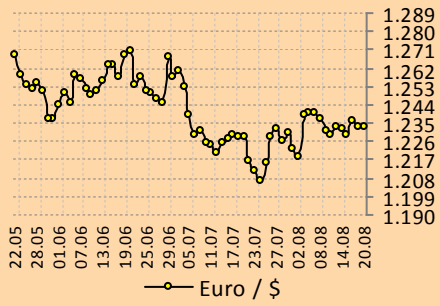
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

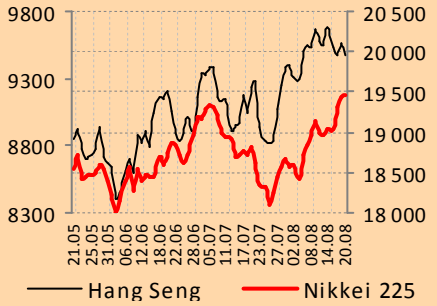
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

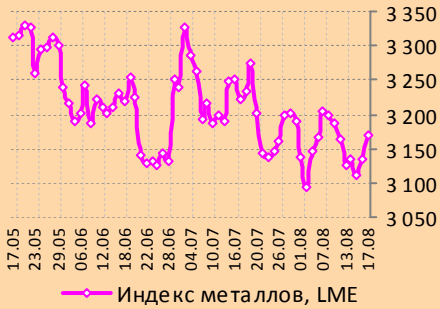
Ежедневный обзор

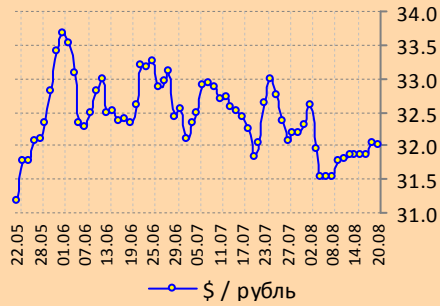






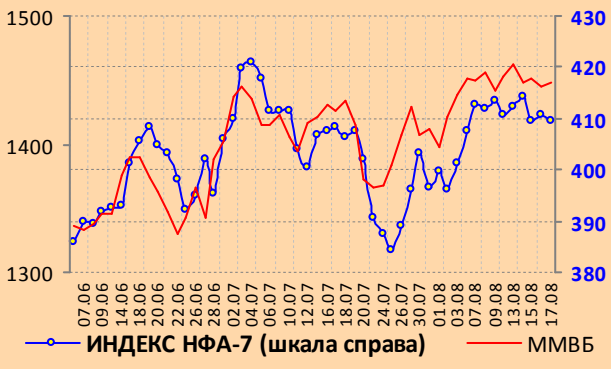






СОДЕРЖАНИЕ

I. Ежедневный комментарий 2
II. Фондовые рынки 3
2.1. Америка & Россия 3
2.2. Европа 4
2.3. Азия 6
2.4. Латинская Америка 7
III. Сырьевые рынки 8
3.1. Нефть 8
3.2. Металлы 10



США. Вышла информация сразу по нескольким индексам. Так, индекс потребительского доверия Мичиганского университета за месяц увеличился с 72,3 до 73,6 пункта, ожидали, что значение индекса не изменится. Индекс текущих экономических условий также повысился на 4,9 до 87,6 пункта, а индекс ожиданий потребителей сократился на 1,1 до 64,5 пункта. Наиболее важным все же считается «Мичиган», он рассчитывается ежемесячно по результатам опроса 500 семей и отражает состояние и ближайшие перспективы потребительского спроса (ключевого компонента американской экономики). По итогам торгов пятницы Dow Jones =+0,19, S&P =+0,19, NASDAQ =+0,46%..

Инвесторы сокращают позиции в госбумагах США на фоне их растущей доходности и вполне могут переключиться на акции, что создает позитивные ожидания на мировых фондовых площадках.

Россия и Brics. Как и прогнозировали Еврофинансы, биржи в пятницу росли, пока цена нефти не стала снижаться на информации из США о возможности использовать стратегический запас в целях снижения цен. Итоги торгов последнего дня недели: индекс ММВБ понизился на 0,52, РТС на 1,03%

Что касается новостей, отметим, что Fitch Ratings подтвердило долгосрочные рейтинги эмитента страны в иностранной и национальной валюте на уровне BBB со стабильным прогнозом. Неустойчивость цен на нефть заставила российское правительство вернуться к так называемому бюджетному правилу, согласно которому бюджетные расходы теперь будут увязываться со средневзвешенной исторической ценой на нефть.

С 20 августа Московская биржа дополняет линейку инструментов свопами на 9 и на 12 месяцев.

Бразилия начинает программу стимулирования экономики на сумму 65,6 млрд. долл. с целью повышения инвестиций в инфраструктуру и укрепления доверия к стране. В первую очередь частным компаниям будут переданы права на автомагистрали и железные дороги, а затем на другие инфраструктурные объекты, включая аэропорты и морские порты. Компаниям, участвующим в развитии инфраструктуры, будут предоставляться кредиты на льготных условиях.

Европа. Биржи пятницы завершили торги в плюсе, CAC =+0,23, DAX =+0,64, Futsee 100 =0,0%. Положительное влияние на все рынки оказало заявления канцлера Германии о поддержке программы ЕЦБ по приобретению гособлигаций проблемных стран еврозоны с целью снижения их доходностей (ранее подобная мера встречала критику со стороны Германии). Последняя статистика также способствовала росту котировок, так, возрос профицит торгового баланса еврозона, за месяц с 7,1 до 14,9 млрд. евро, более чем в два раза. Инфляция в еврозоне составила в годовом измерении 2,4%, как и ожидалось, а в 27 странах ЕС уровень инфляции равен 2,5% (при этом наиболее низкая инфляция в Швеции 0,7%, Греции 0,9% и Германии 1,9%, наиболее высокая в Венгрии 5,7%, Эстонии 4,1% и Мальте 4,2%). Не очень хорошая информация по Испании: объём плохих долгов в банках возрос за месяц с 8,95 до 9,42% и достиг 164,4 млрд. евро.

Азия. Сессию пятницы биржи, вслед за американскими, завершили в преобладающем плюсе, Nikkei +0,77, SSE +0,13, Kospi -0,58, Hang Seng +0,77%. Кроме политического потепления в Германии и смещению предпочтений в сторону более рисковых активов, дополнительным плюсом для экспортеров Японии стало ослабление иены. И еще одна хорошая новость: правительство Японии ожидает рост экономики страны в текущем финансовом году (по март 2013г.) на уровне 2,2%, в следующем (начнется в апреле 2013г.) 1,7%. Ожидается постепенный выход Японии из дефляции, инфляция в текущем финансовом году впервые за последние четыре года составит, по прогнозу, +0,2%, а в следующем уже + 0,5%. Продажам отчасти способствовали опасения относительно слабой отчетности компаний Китая.

Золото. Доллар дешевеет, цены драгметаллов колеблются вместе с движением фондовых площадок как рядовой актив. Утром пятницы фьючерсы на золото торговались по 1617,7 долл. за унцию, к 14.00 по 1619,23, на закрытии 1619,4 долл.

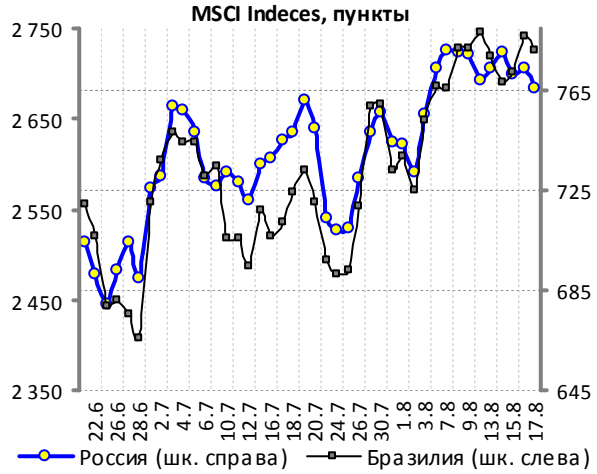
Нефть. Геополитические факторы удерживают цену нефти на достаточно высоком уровне. Совет безопасности ООН принял решение не продлевать мандат миссии миротворцев в Сирии (истек 19 августа). Россия выразила сожаление в связи с завершением миссии и предложила провести встречу по Сирии в составе России, Китая, США, Франции и Великобритании, а также ключевых стран региона. США подчеркивают, что они оказывают оппозиции в Сирии только невоенную помощь, но координируют действия с другими странами, принявшими иные решения.

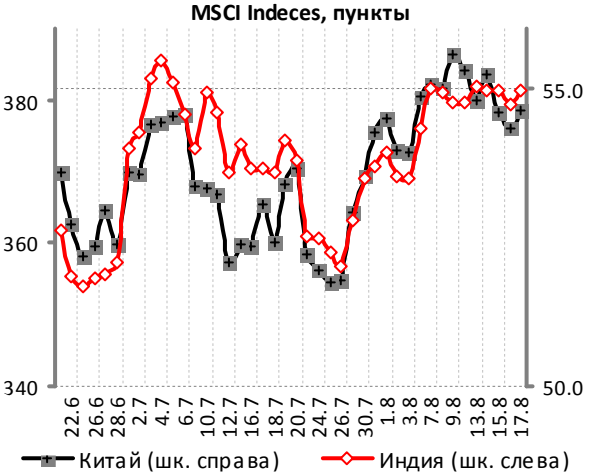
Итоги конференции Организации исламского сотрудничества таковы, что сценарий внешнего военного вмешательства в сирийский конфликт не нашел достаточной поддержки среди лидеров исламских стран. Но главным решением встречи стало согласие ее участников на приостановку членства Сирии в этой организации. Сирия начала переговоры с Китаем по политическому урегулированию ситуации в стране.

В пятницу нефть обозначила волатильность, отыгрывая заявления из США о неприемлемости столь высоких цен на нефть и готовности распечатать стратегические резервы для замедления роста цен. Утром пятницы Brent и Light шли по 114,05 и 95,38 долл. за барр., к 14.00 соответственно по 113,87 и 95,43, на закрытии по 113,76 и 96,01 долл.

Прогноз. Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются от -0,01 до +0,61%, Азия от -0,87 до +0,19%, цена нефти растет. Наши биржи попытаются 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, 20.08.2012.

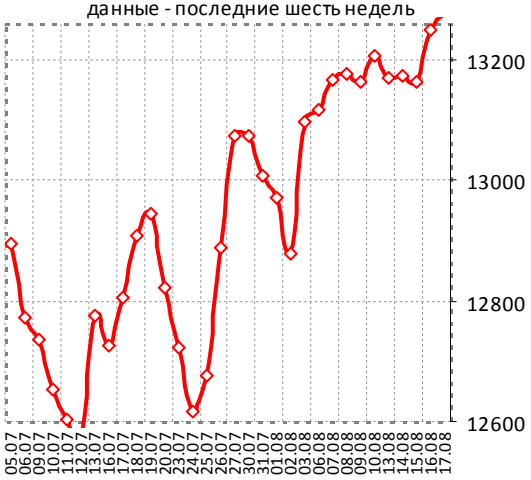




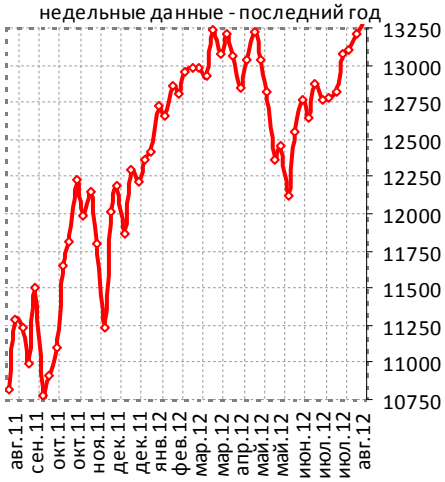
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

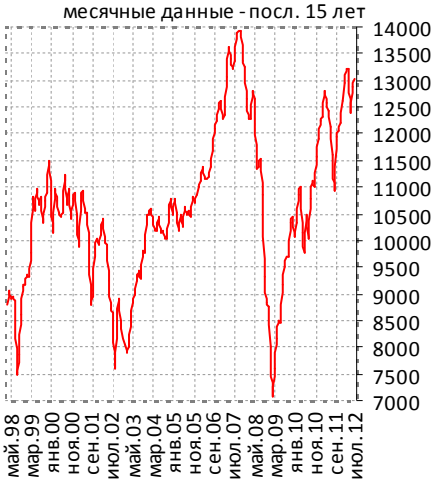
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



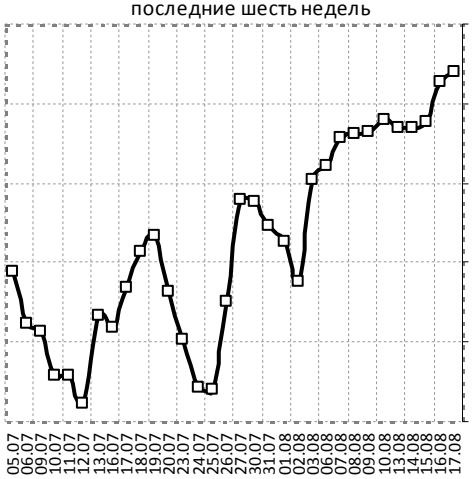
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



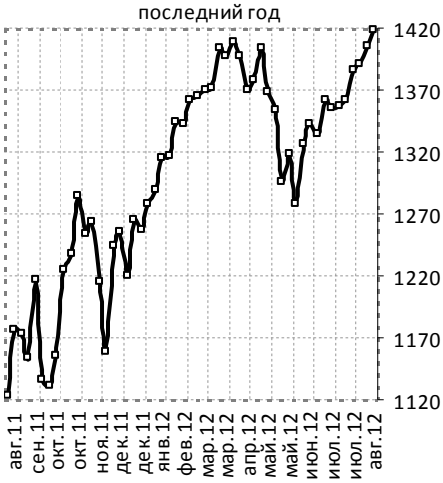
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



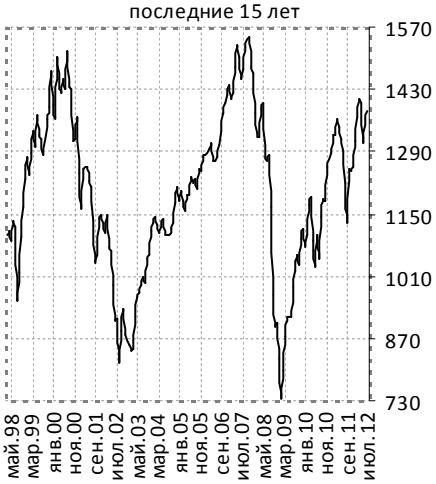
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



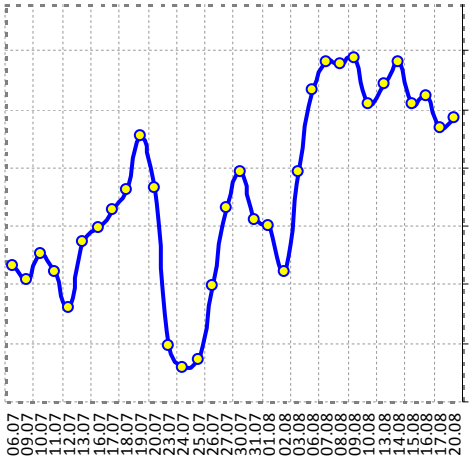
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



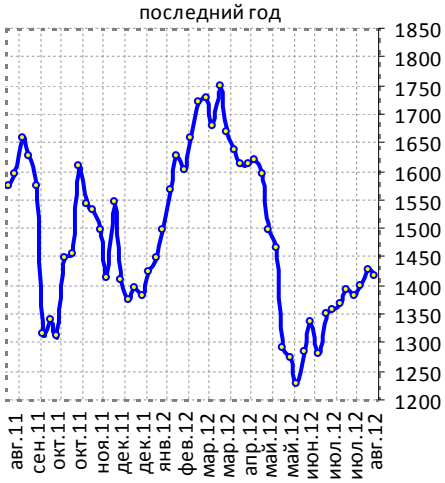
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



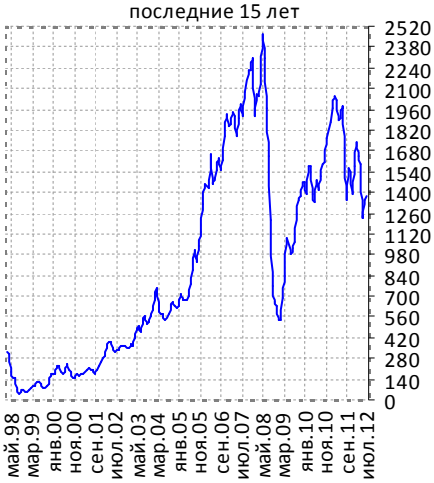
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



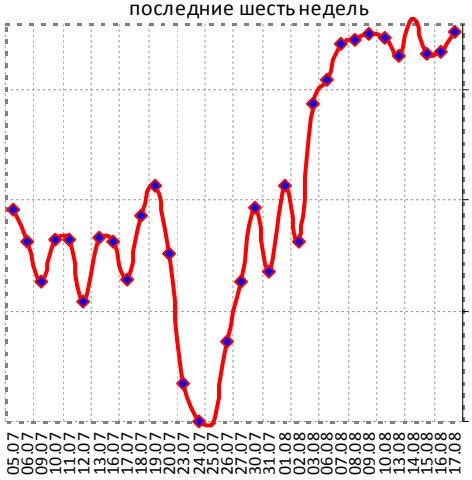
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



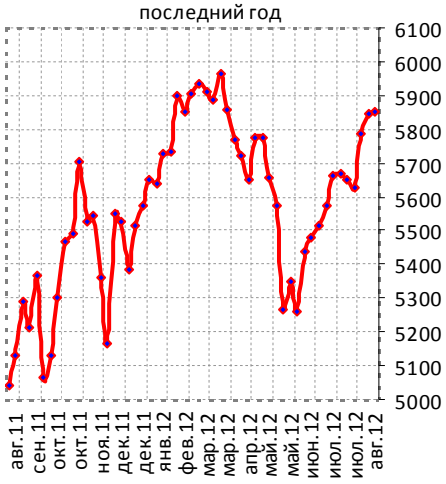
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

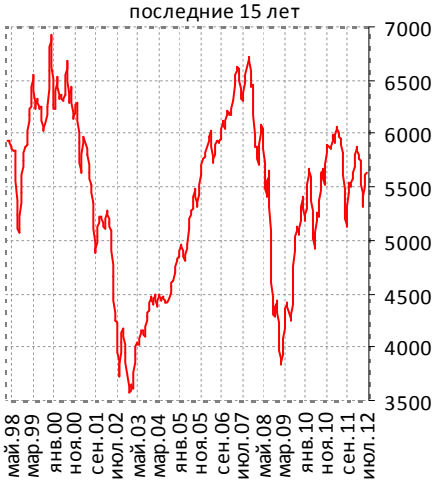
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



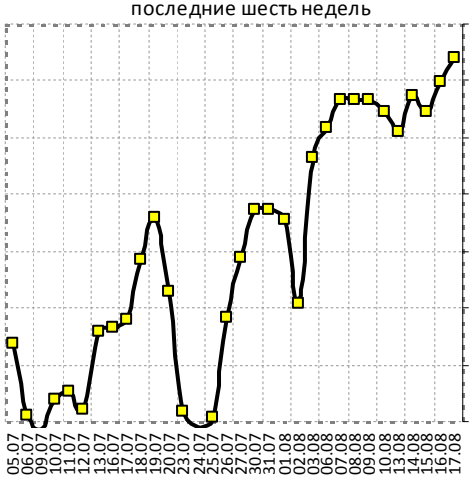
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



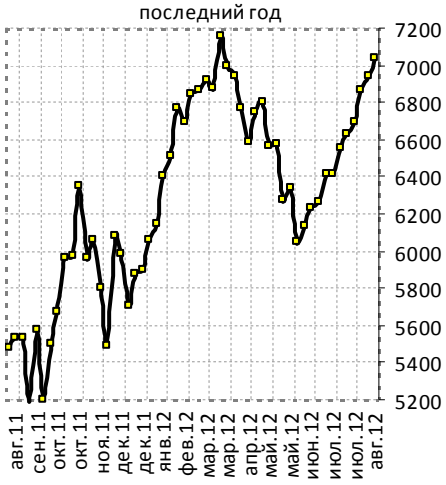
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



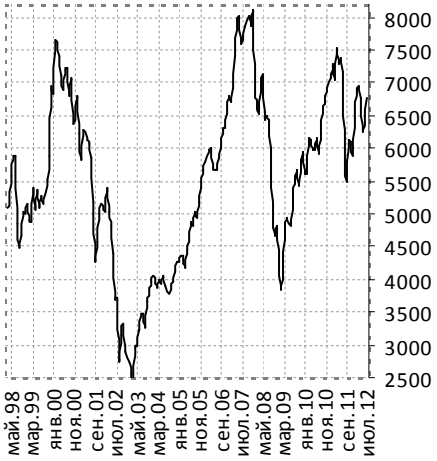
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



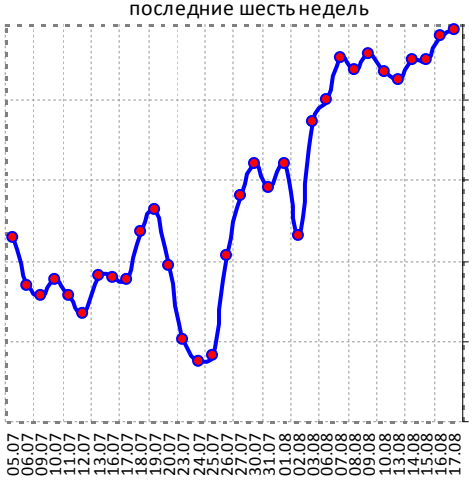
DAX Index: недельные данные - последний год



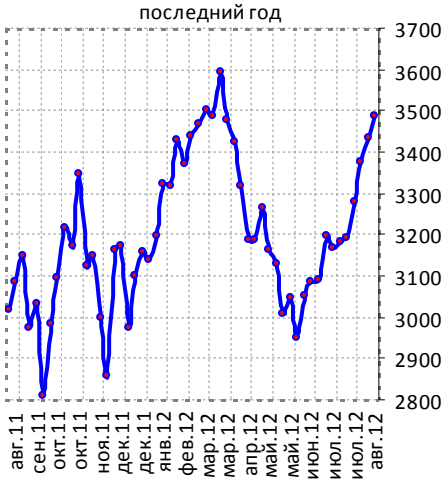
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



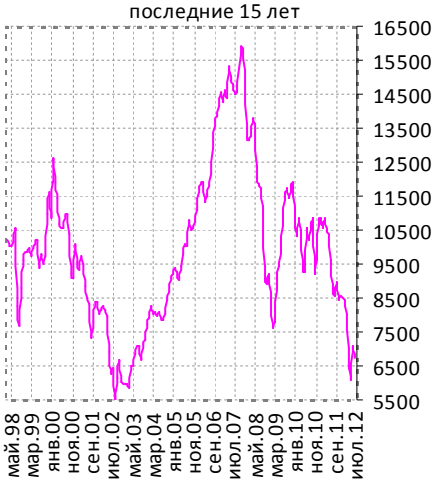
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

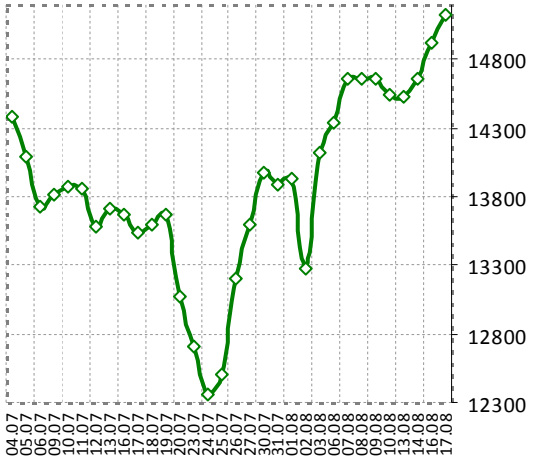


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

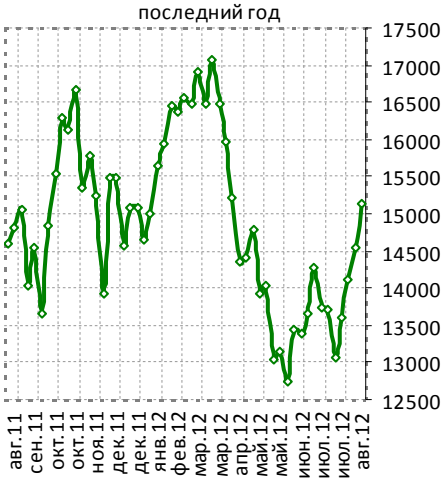


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



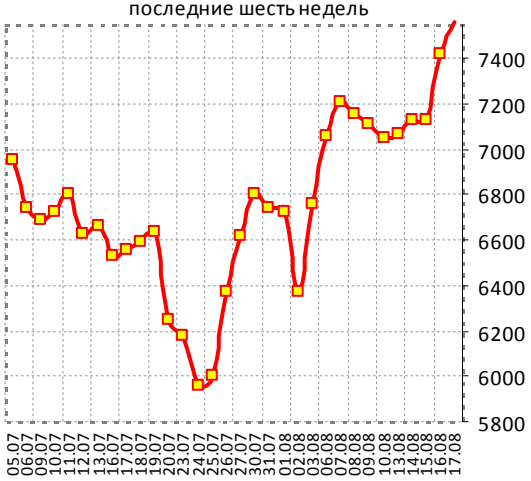
MIB Index: недельные данные - последний год



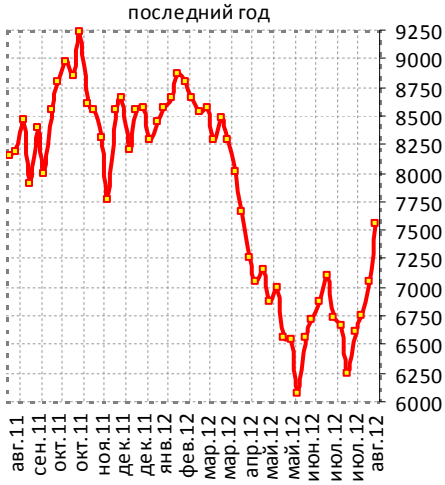
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



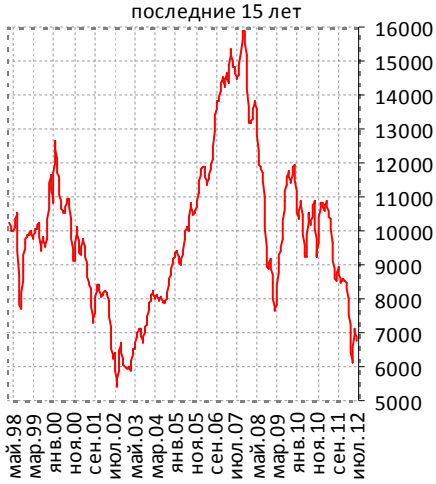
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



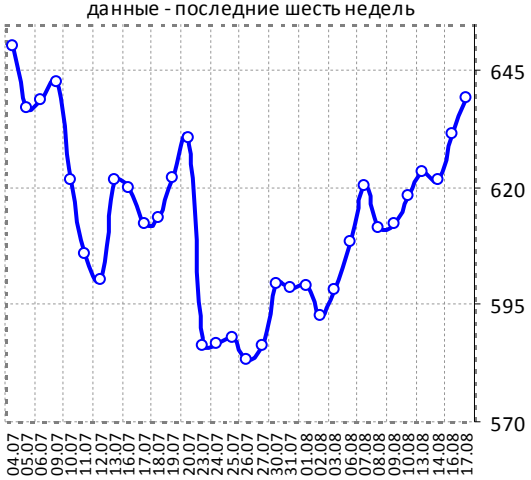
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



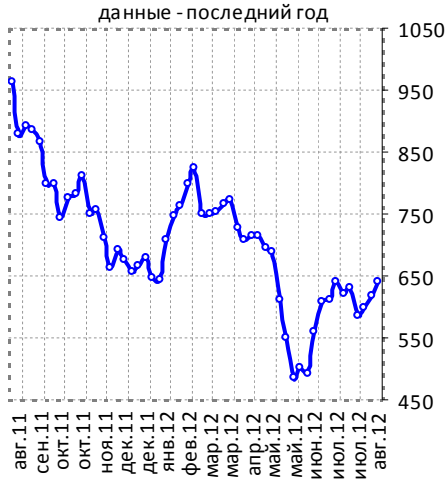
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



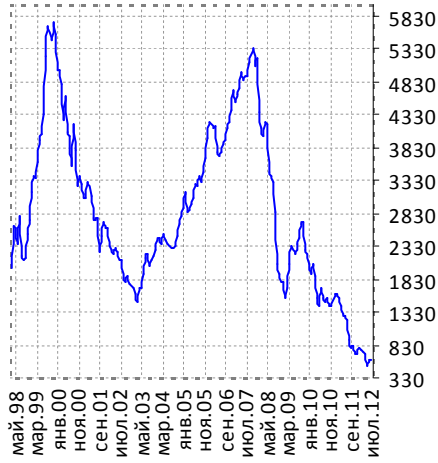
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



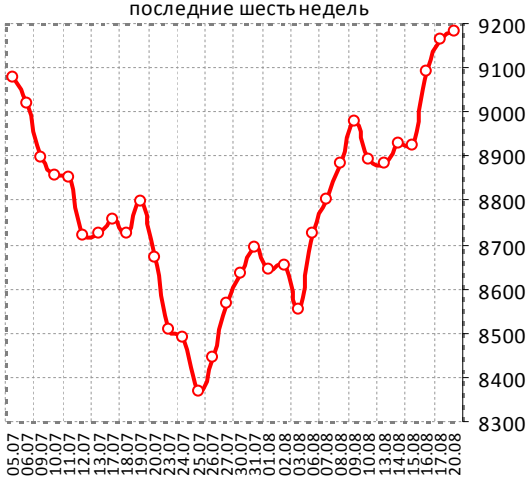
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



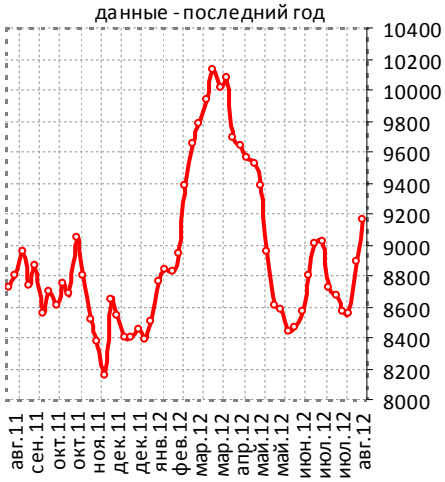
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

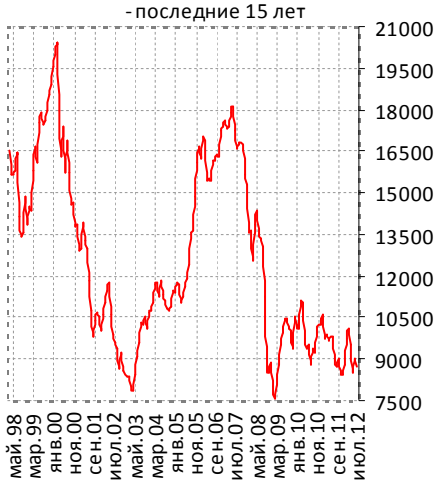
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



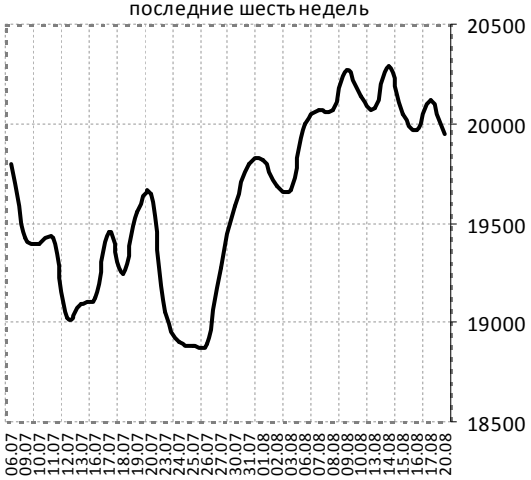
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



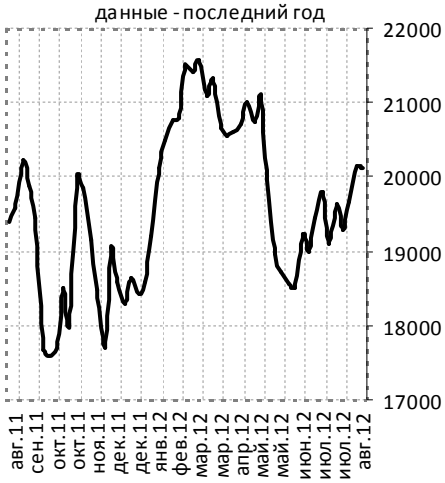
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



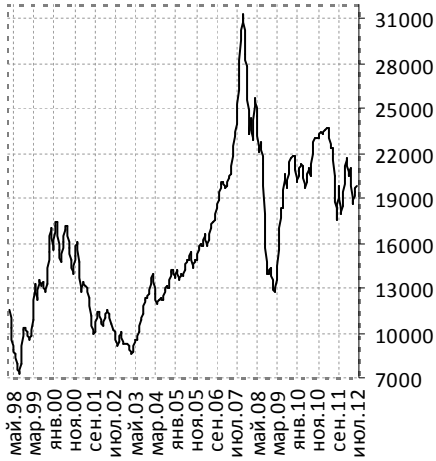
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



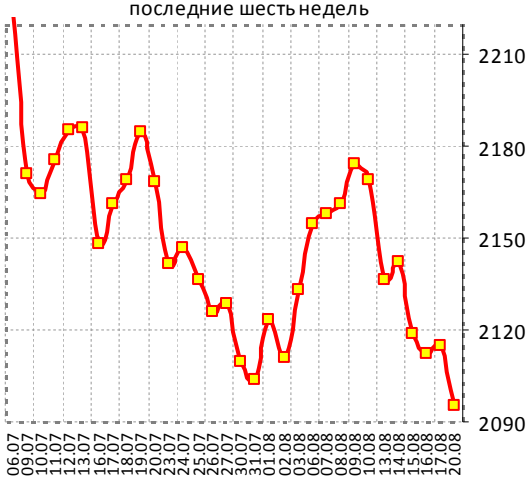
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



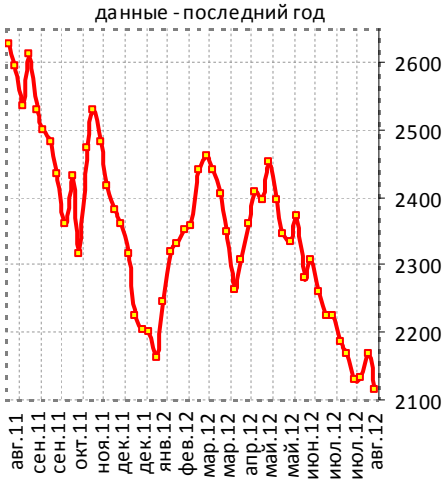
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



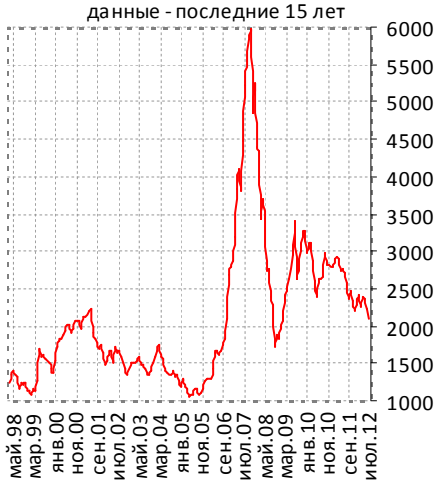
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



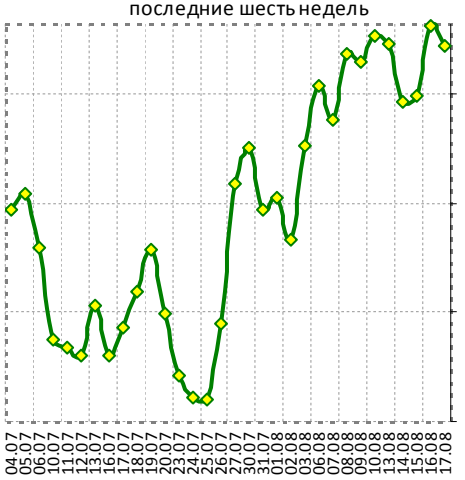
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



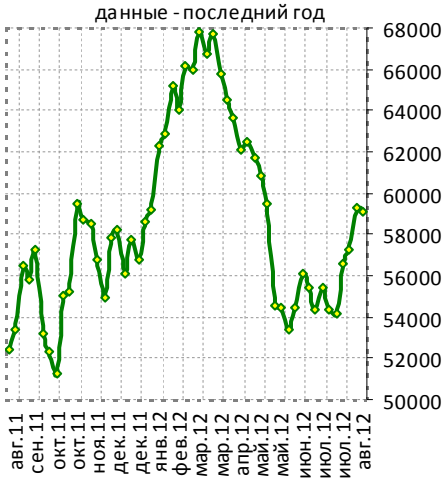
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

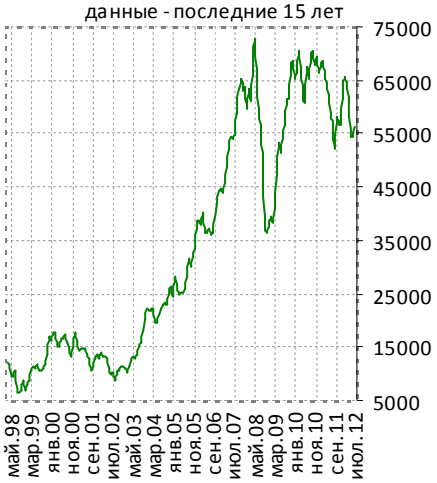
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



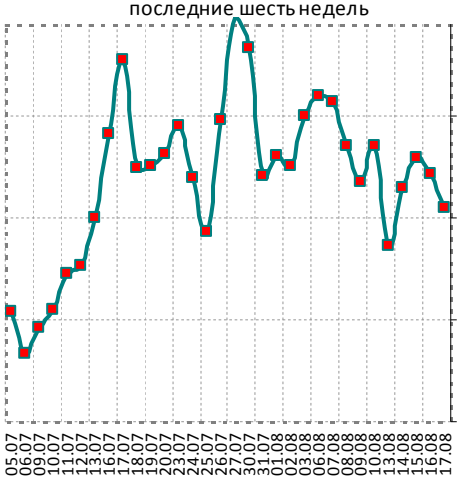
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



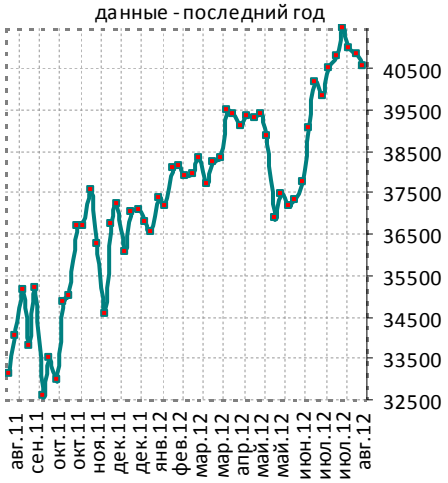
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



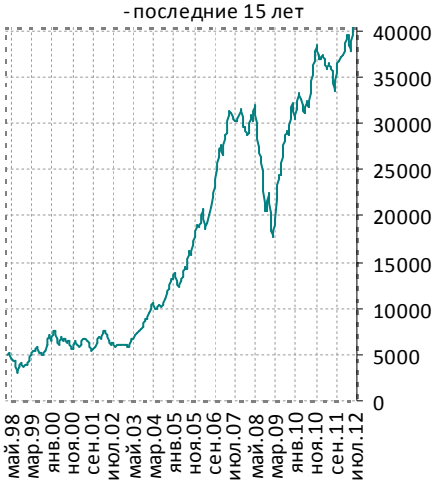
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



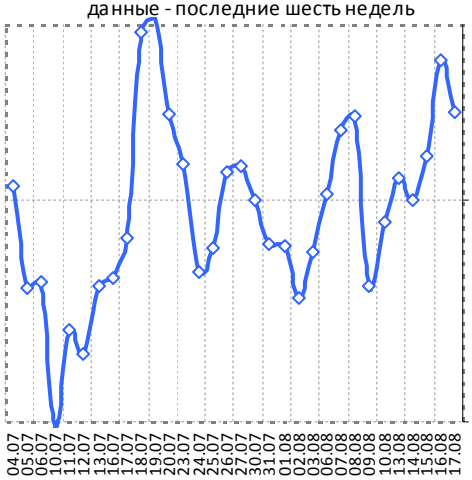
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



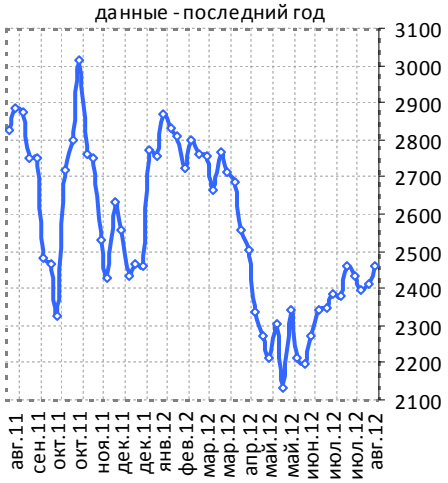
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



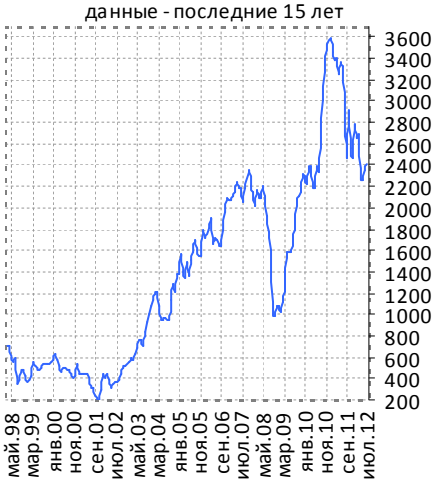
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет

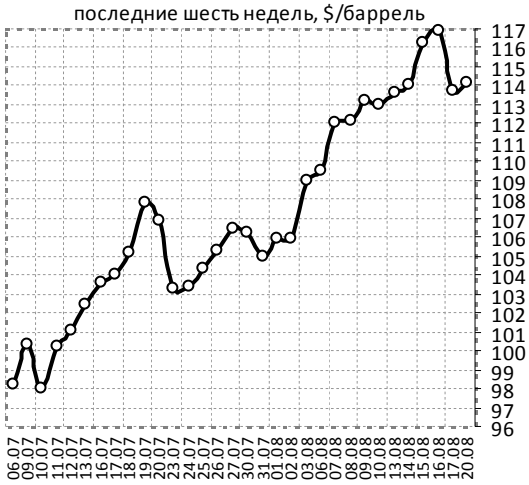


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

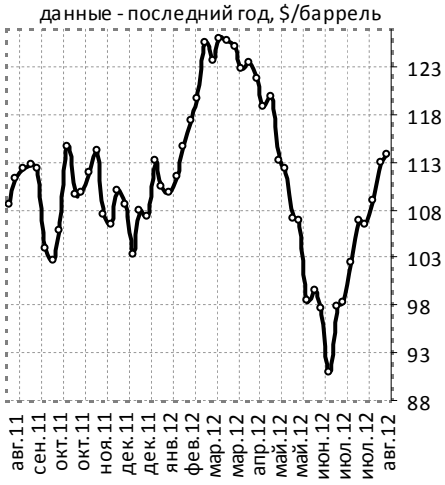
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

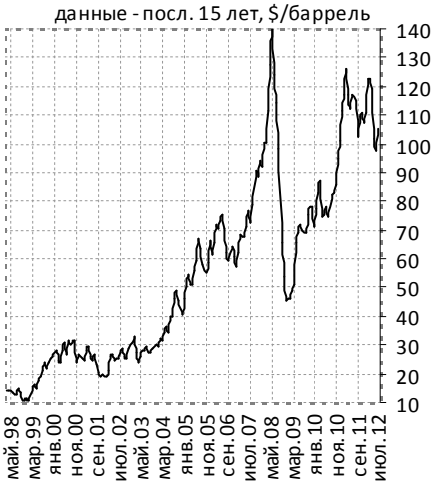
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



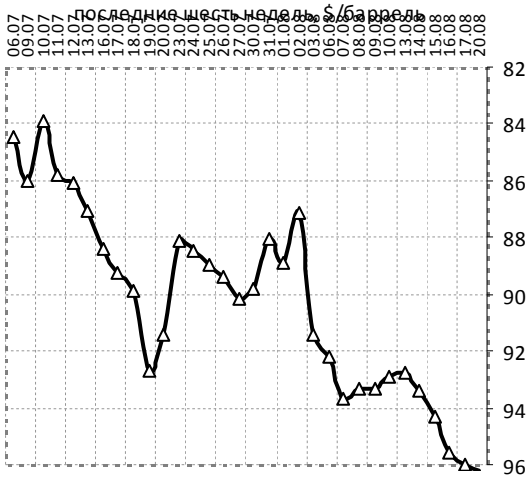
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



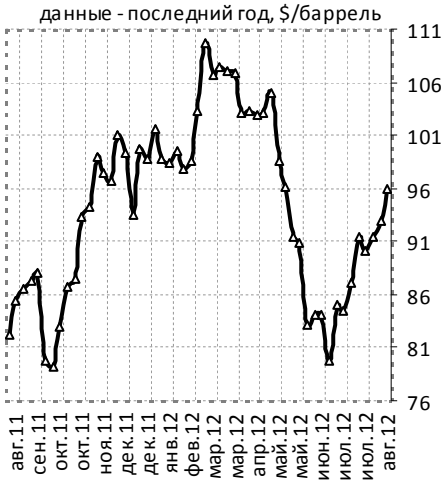
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



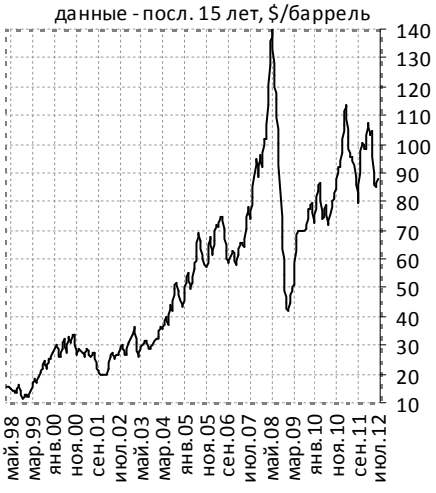
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



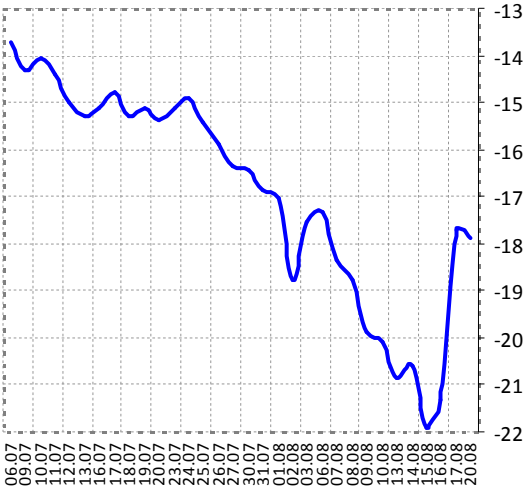
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



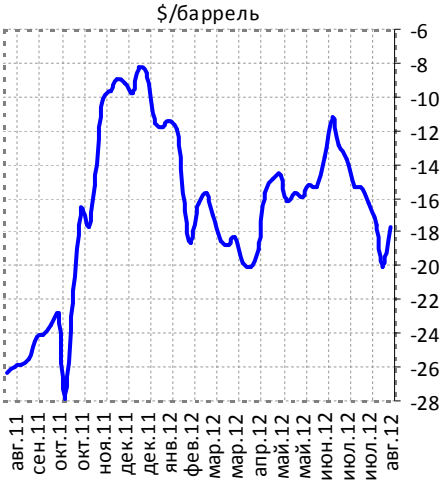
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



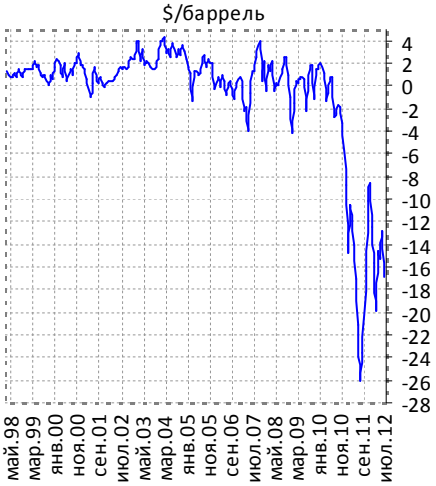
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



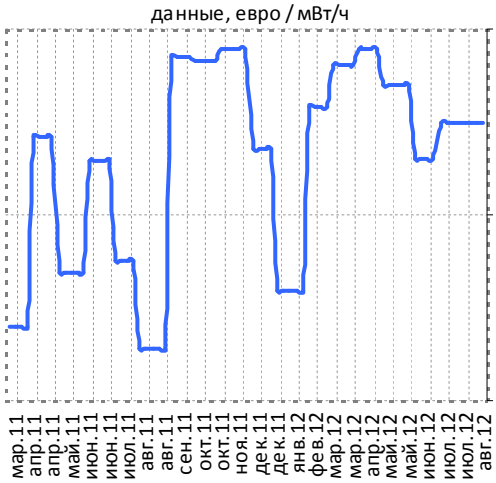
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



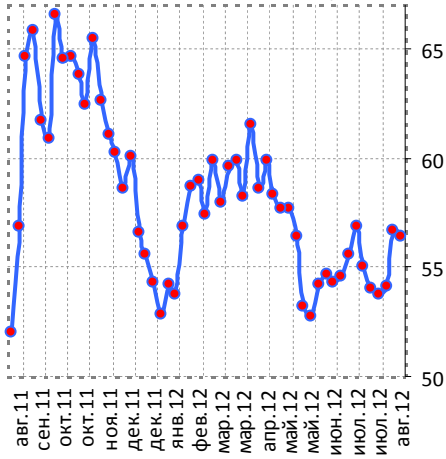
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

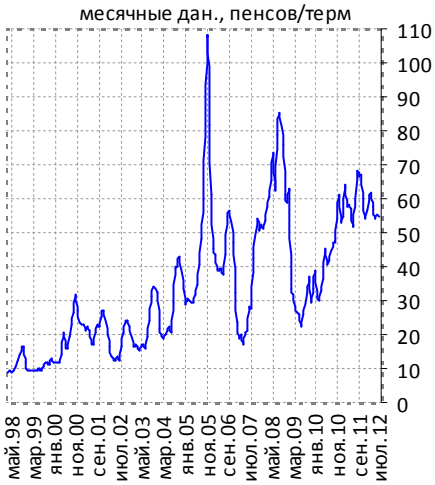
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



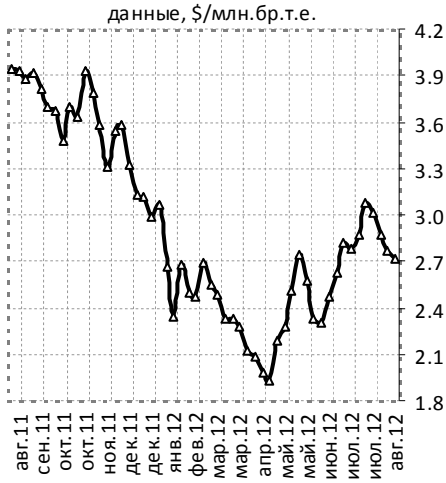
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



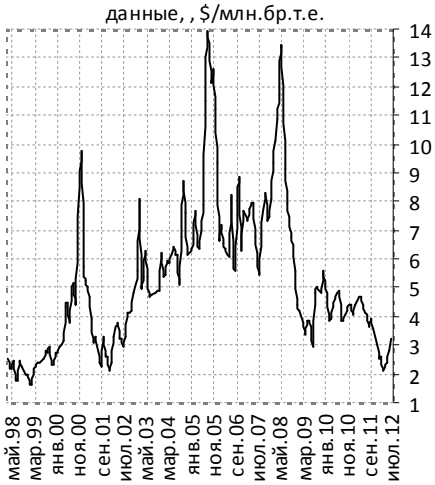
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



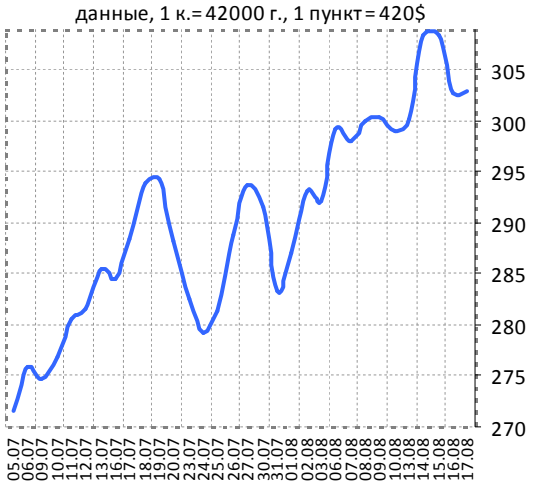
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



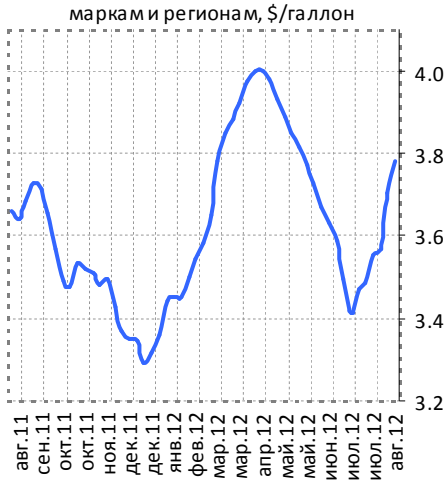
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



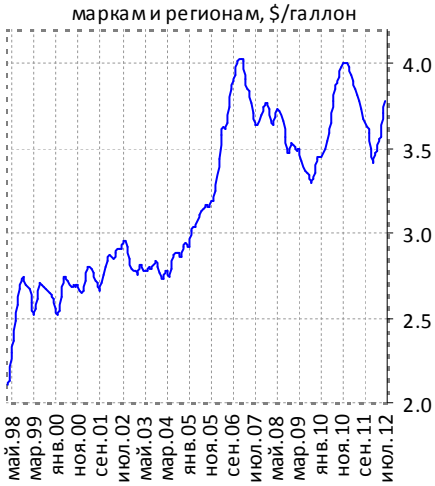
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



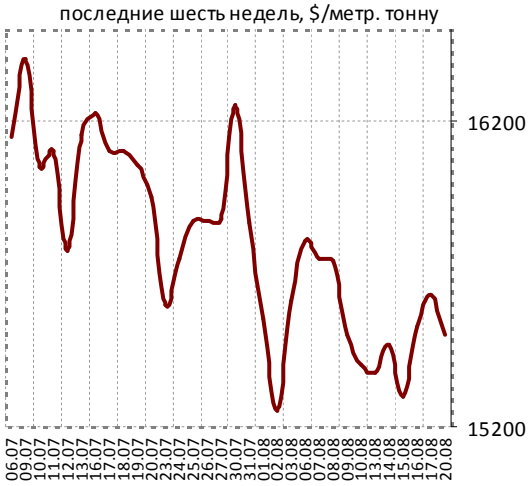
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



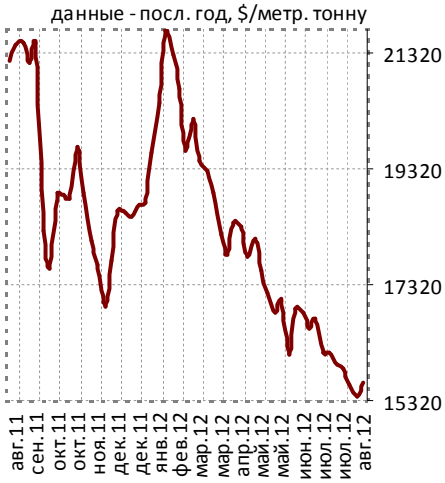
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

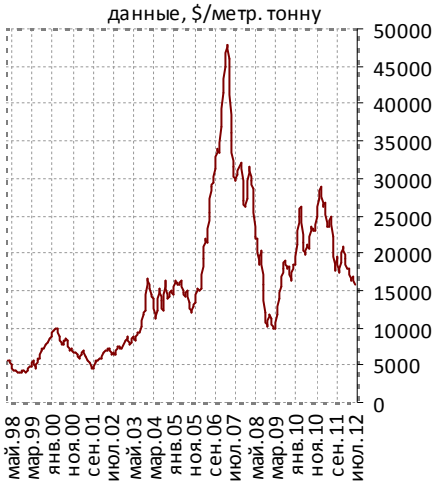
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



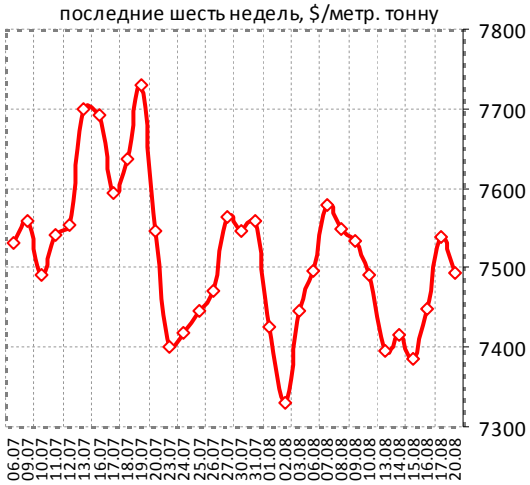
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



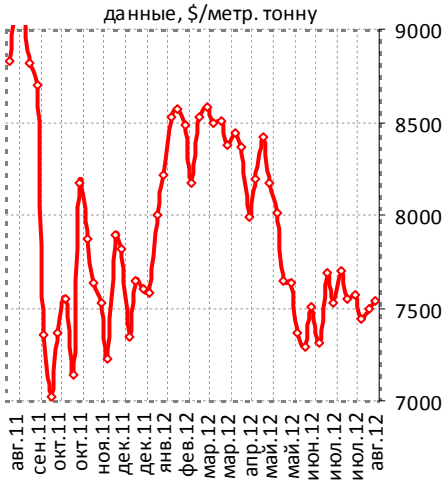
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



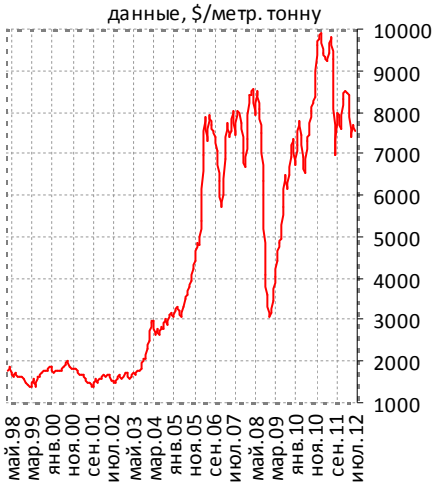
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



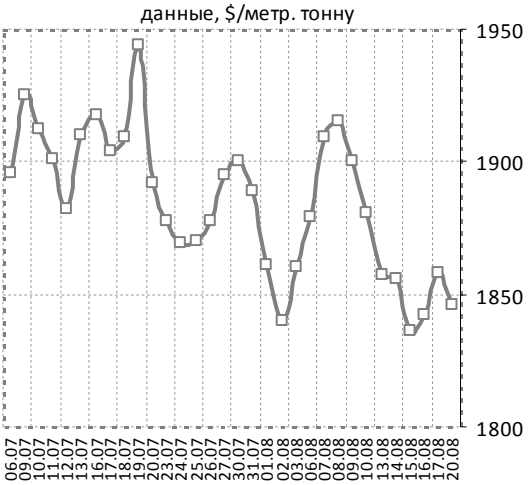
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



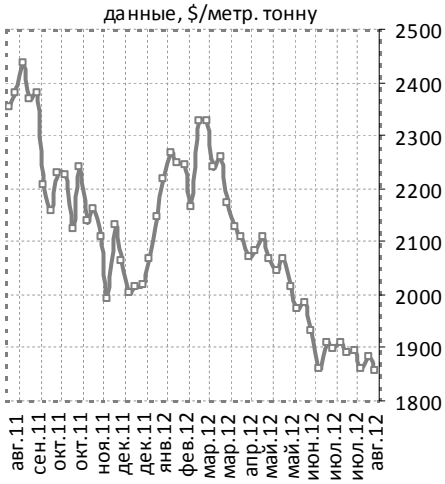
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



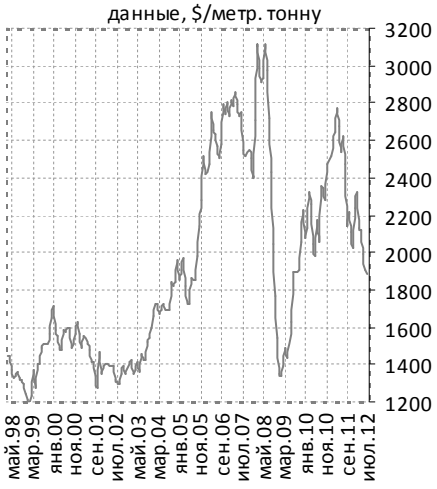
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.