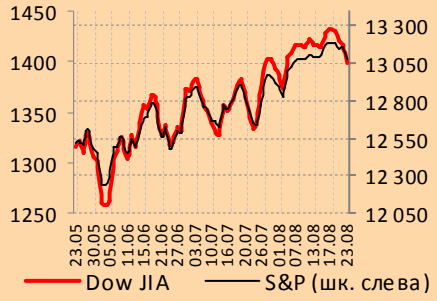
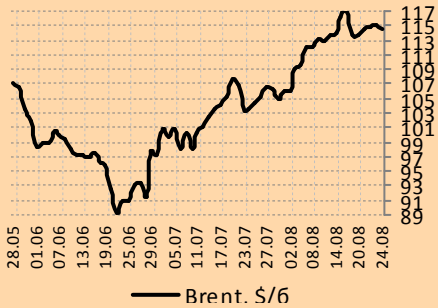
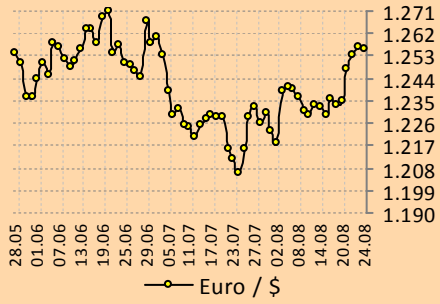
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

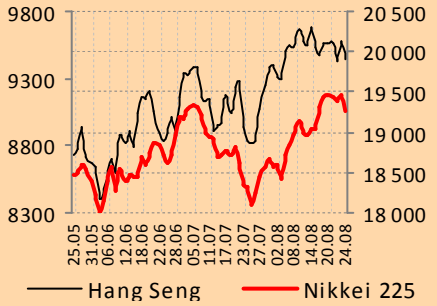
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

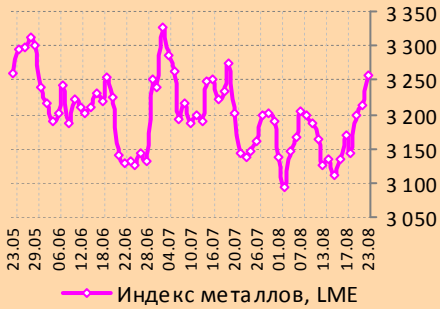
Ежедневный обзор

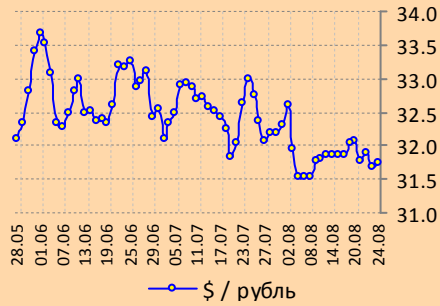












СОДЕРЖАНИЕ

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. При том, что 11 из 12 членов комитета ФРС по открытым рынкам на последнем заседании (проходило 31 июля и 1 августа) согласились оставить все, как есть, в опубликованном протоколе этого заседания инвесторы увидели возможность нового количественного смягчения в случае замедления темпов роста американской экономики. Мнения членов комитета основывались на информации трехнедельной давности и, казалось бы, не могли рассматриваться как актуальные по степени влияния на рынки, но котировки мировых бирж сразу на открытии четверга обозначили рост. К вечеру появились данные по рынку труда: количество первичных обращений за пособиями по безработице за неделю возросло с 366 до 372 тыс. (ожидалось снижение до 365 тыс.). Эта информация сразу изменила положительную динамику биржевых фьючерсов, результат торгов в минусе, Dow Jones =-0,88, S&P =-0,81, NASDAQ =-0,66%.

Россия. Итоги торгов в плюсе, как мы и прогнозировали (индекс ММВБ =+0,46, РТС =+0,87%). В течение сессии биржи росли больше других мировых площадок, к примеру, рост в 14.00 был от 1,42 до 1,98% (Европа от 0,17 до 0,48%, американские фьючерсы от 0,25 до 0,28%). Между тем, в России сокращается положительное сальдо торгового баланса, основная причина в опережающем росте импорта, но эта новость не оказала влияния на поведение инвесторов.

Интересно. Добыча нефти, включая газовый конденсат, за полгода выросла на 1,4% относительно прошлого года и составила 256,1 млн. т, на переработку поступило 131,7 млн. (на 3,9% больше, чем за аналогичный период прошлого года). Экспорт нефти равен 118,7 млн. т (сокращение по сравнению с 1-м полугодием 2011 года на 2,5%), доля экспорта в добыче - 46,3 %, в общем объеме российского экспорта - 35,1%, в экспорте топливно-энергетических товаров - 49,3% (в прошлом году соответственно 36,3 и 51,1%).

Европа. Глава Еврогруппы г-н Юнкер по итогам переговоров с премьером Греции отметил, что вопрос получения страной очередного транша помощи целиком зависит от прогресса самой Греции в проведении намеченных реформ, и это – последний шанс. Относительно основной просьбы Греции (продления на 2 года срока сжатия бюджетных расходов) было сказано, что этот вопрос может быть рассмотрен только после доклада тройки, намеченного на сентябрь.

Новая европейская статистика имела разнонаправленный характер. Так, с одной стороны, продолжили снижение доходности по обязательствам Испании и Италии, снизилась безработица в Швеции (с 8,8 до 7,0%), ВВП Германии во 2-м квартале по сравнению с первым повысился на 0,3%, как и ожидали. С другой стороны, индекс деловой активности в промышленности еврозоны в целом за месяц снизился с 44,0 до 43,5 пункта (ожидалось 44,1), в Германии увеличился с 43,0 до 45,1 пункта (ожидалось 43,4). В секторе услуг и по еврозоне, и по Германии индексы снизились, соответственно с 47,9 до 47,5 (47,6) и с 50,3 до 48,3 (50). По итогам дня DAX =-0,97, CAC 40 =-0,84, FTSE 100 =+0,04% (на росте индексов деловой активности).

Азия. Торги четверга завершились ростом индексов, Nikkei 0,51, SSE 0,25, Kospi 0,38, Hang Seng 1,23%. Из последних новостей отметим снижение индекса экономической активности в Китае с 49,3 до 47,8 пунктов (ожидали 49,3), что усилило ожидания инвесторов новых стимулирующих мер со стороны правительства страны, а также приобретение фондовой биржей Токио 80% акций биржи Осаки с целью создания третьей по величине в мире биржи.

Золото. Ожидания новых мер со стороны центральных банков, включая ФРС, и ослабление доллара повышает привлекательность драгметаллов. Утром четверга фьючерсы на золото торговались по 1666,48 долл. за унцию, к 14.00 по 1665,64 долл., сегодня с утра золото = 1667,7, серебро = 30,32, платина = 1542, палладий = 651,15 долл./унция. Ещё одна возможная причина роста драгметаллов - возобновление их скупки некоторыми центробанками в ожидании интервенций на долговом рынке еврозоны со стороны ЕЦБ.

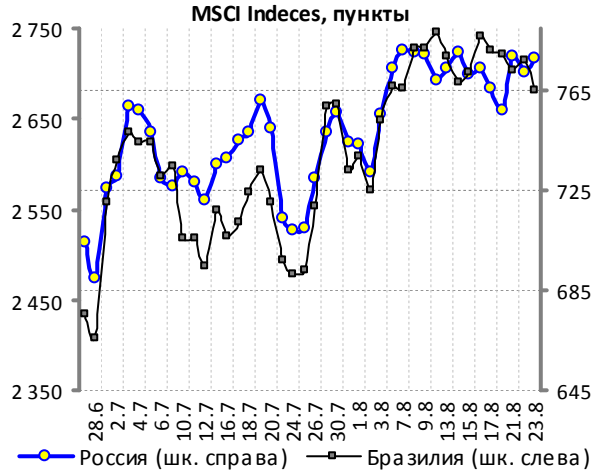
Нефть. Цена нефти пока еще находилась под определяющим воздействием сокращения запасов в США. Brent и Light утром четверга шли по 115,95 и 98,12 долл. за барр., к 14.00 по 116,23 и 98,01 долл., сегодня утром обозначилось снижение до 114,52 и 95,77 долл./барр.

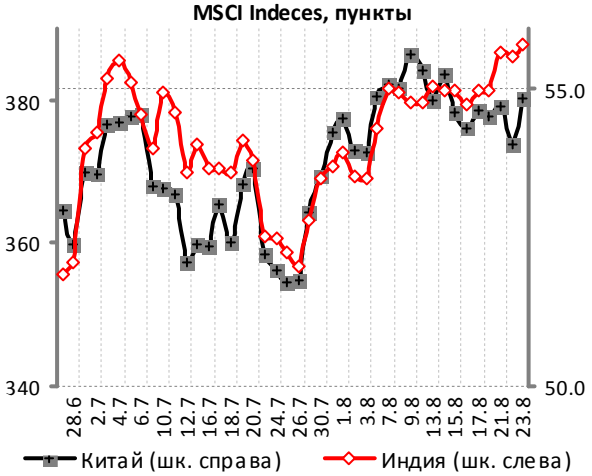
События, статистика, прогноз. Сегодня на 13.45 мск в Берлине намечены переговоры канцлера Германии с греческим премьер-министром. Ожидаем конкретизации позиции Германии в отношении оказания помощи Греции. Подчеркнем: г-жа Меркель в ходе визита в Молдову в среду отметила, что на встрече с греческим премьером никаких решений приниматься не будет, основанием для принятия решений может быть только доклад тройки в сентябре.

Из наиболее важной статистики ждем данные по заказам на товары длительного пользования по США (16.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются в преобладающем минимуме, Азия тоже, цена нефти не растет. Инвесторы на наших биржах не имеют сегодня драйверов роста.

Опечатка. В предыдущем обзоре сравнение уровней зарплат по Москве и России равно не 77, а 177%. Приносим свои извинения.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 24.08.2012.

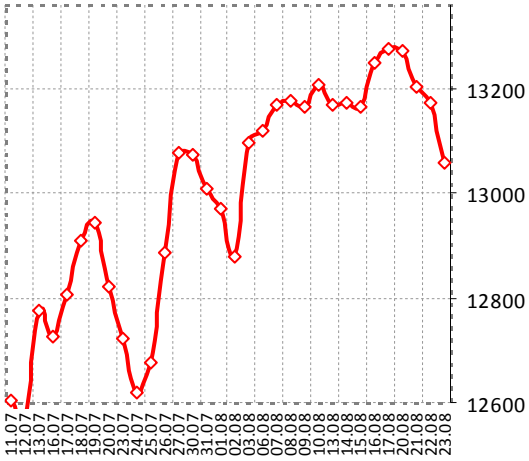




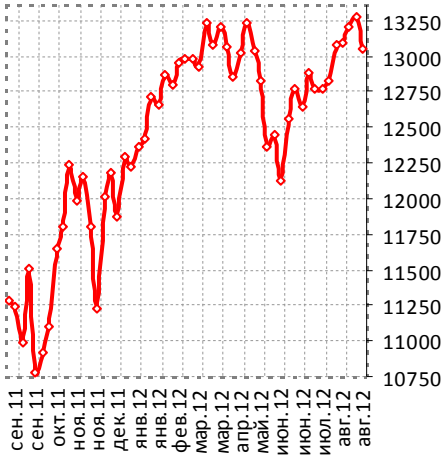
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

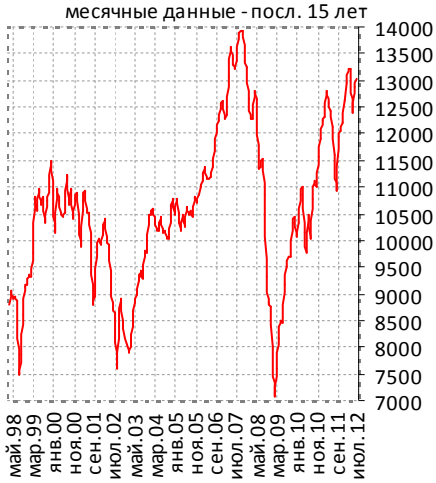
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



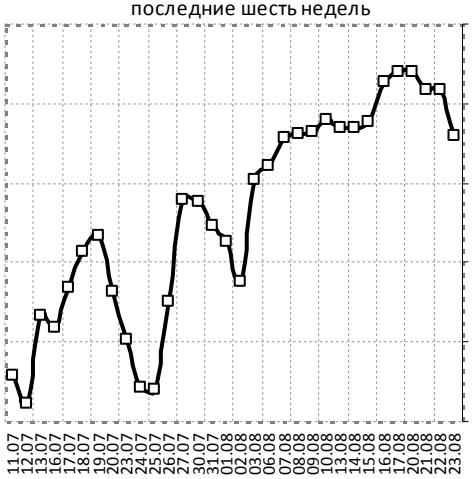
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



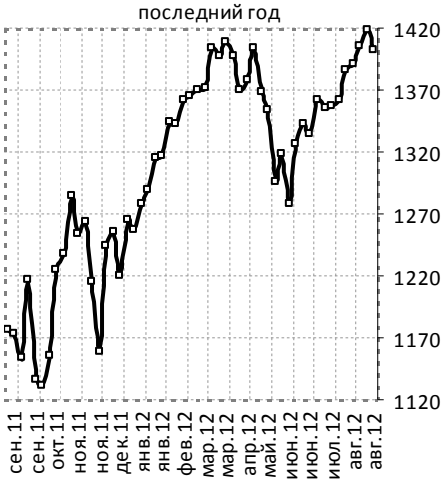
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



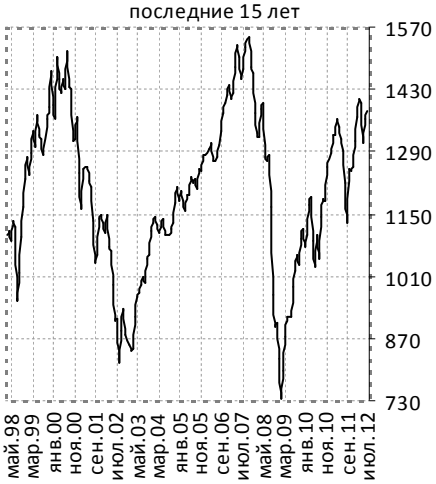
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



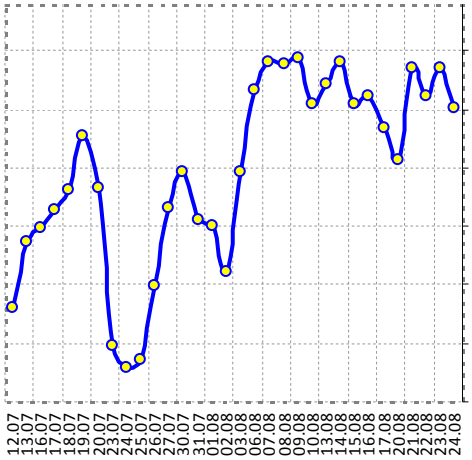
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



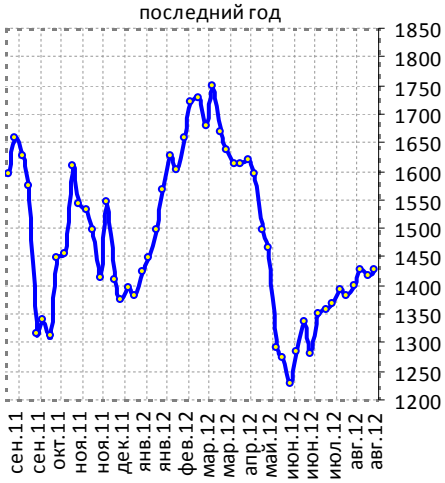
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



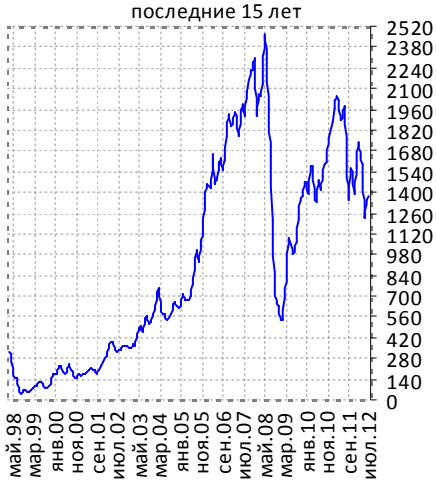
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



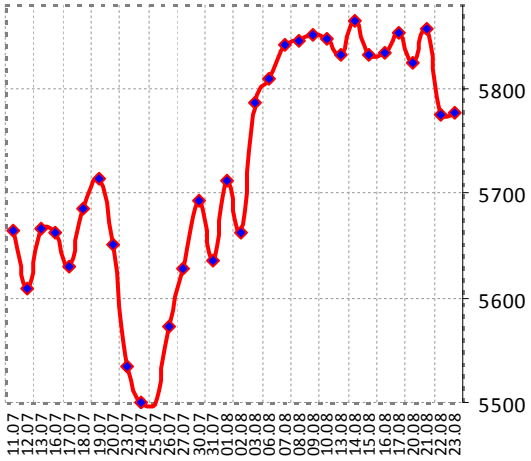
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



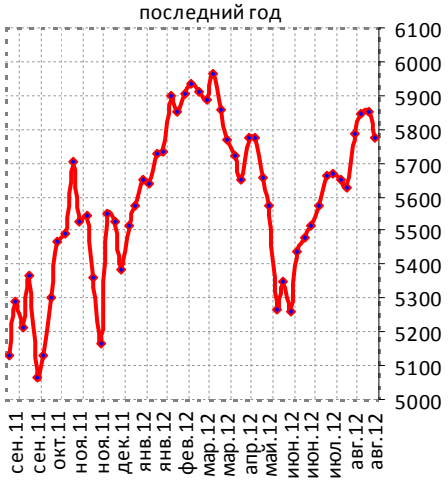
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

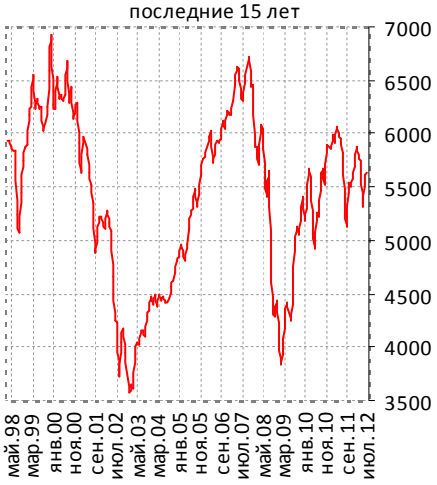
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



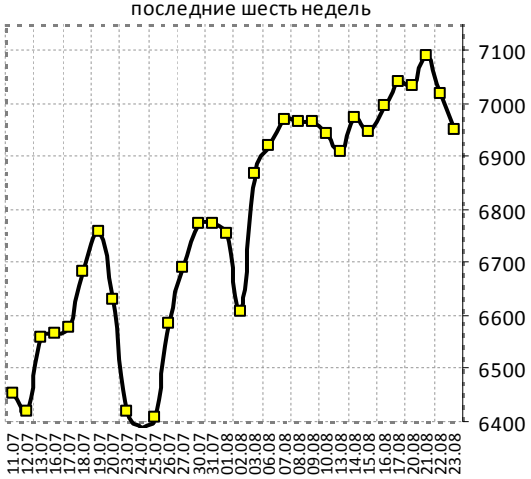
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



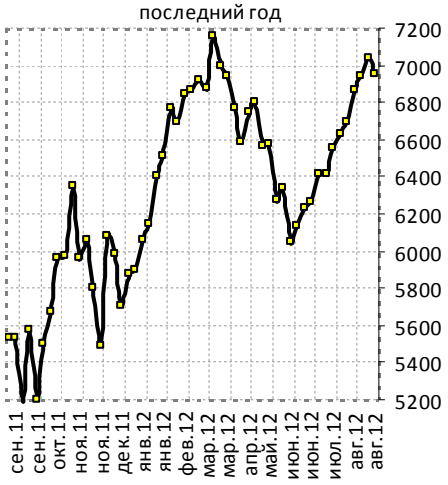
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



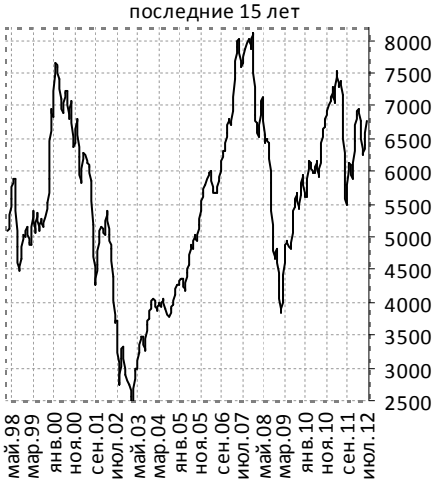
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



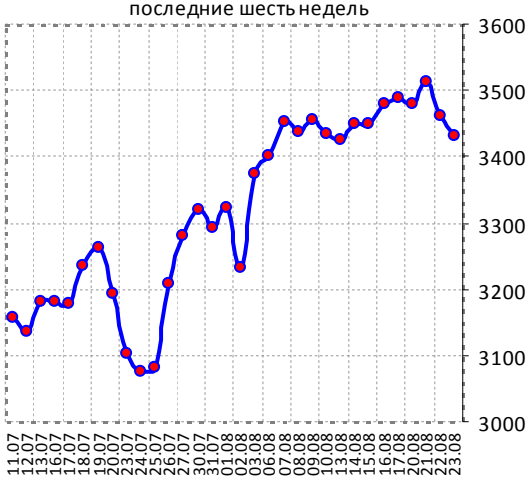
DAX Index: недельные данные - последний год



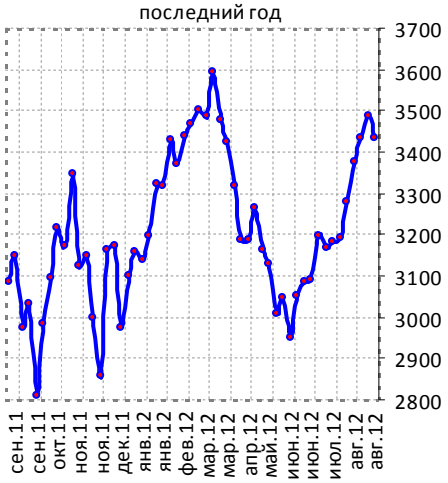
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



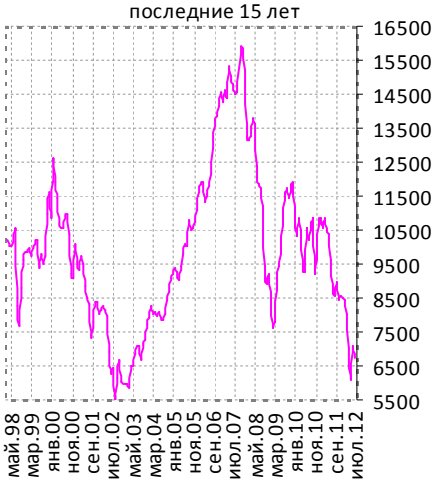
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

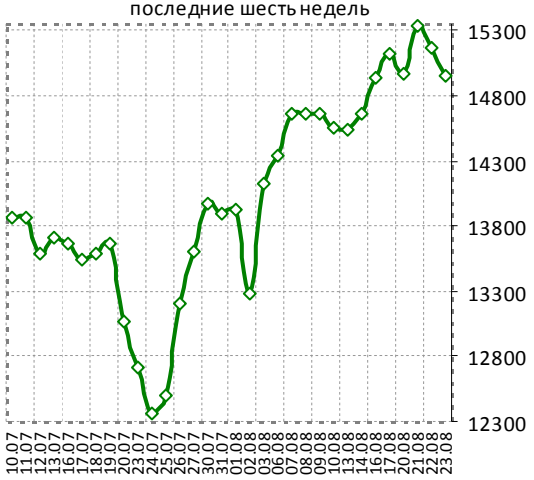


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

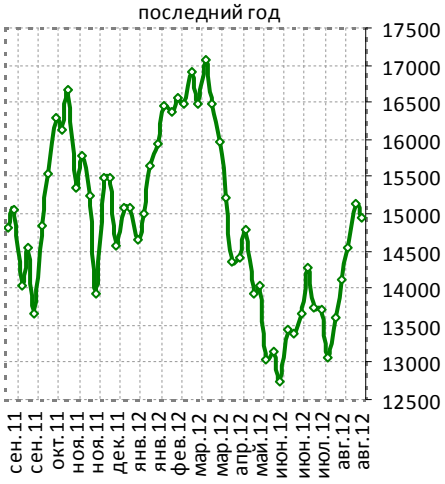


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

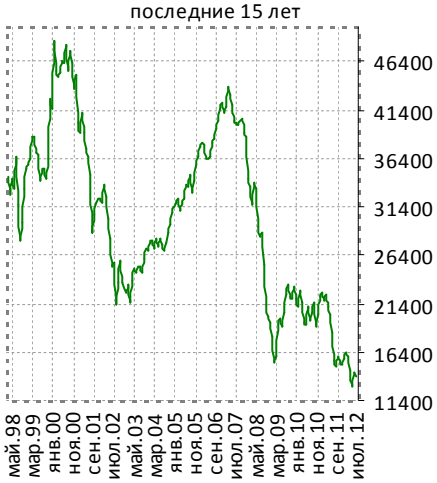
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



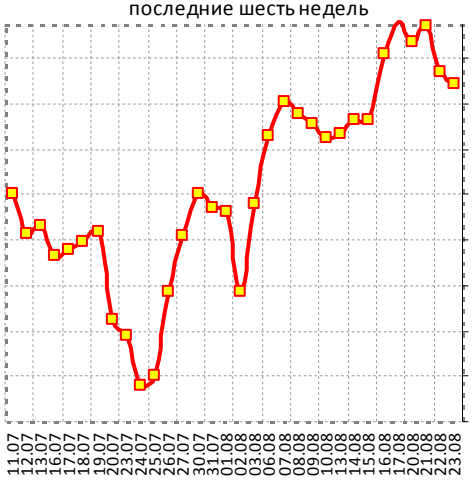
MIB Index: недельные данные - последний год



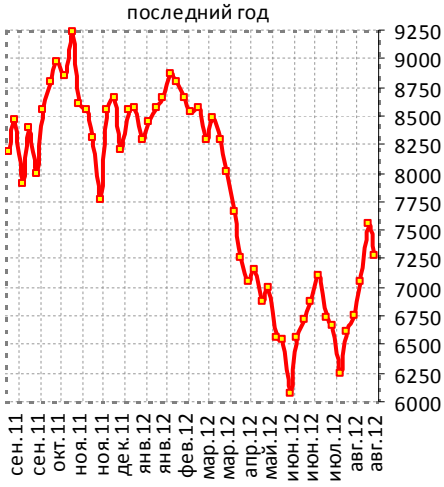
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



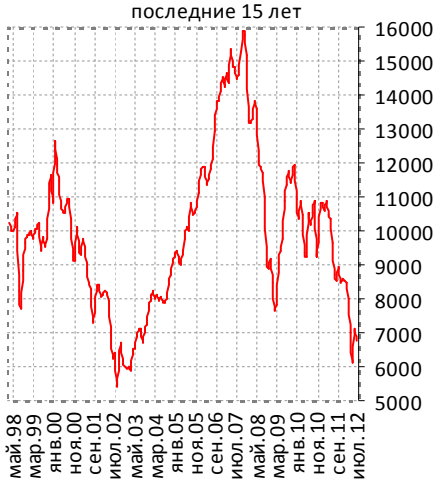
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



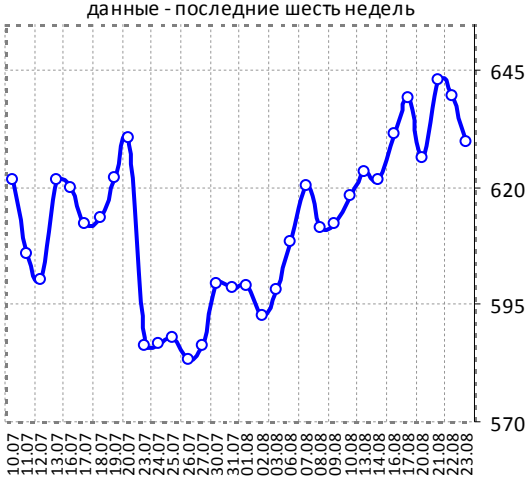
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



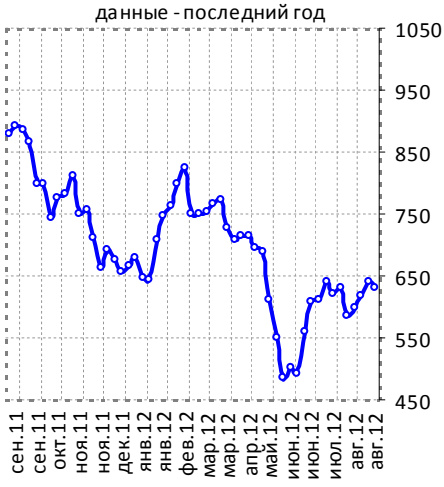
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



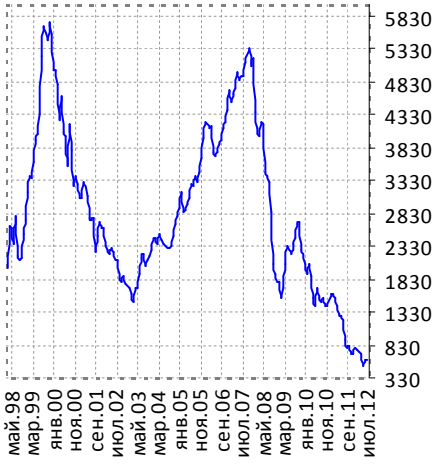
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



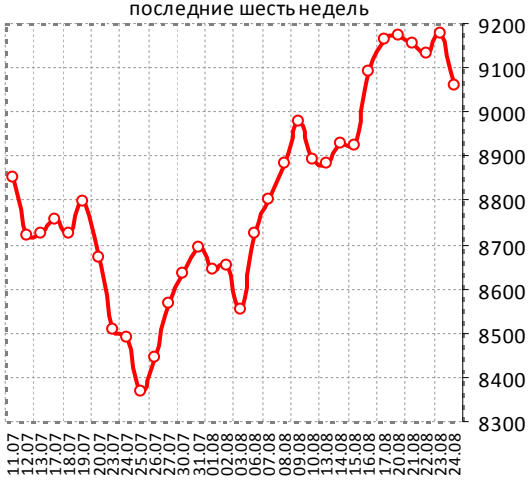
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



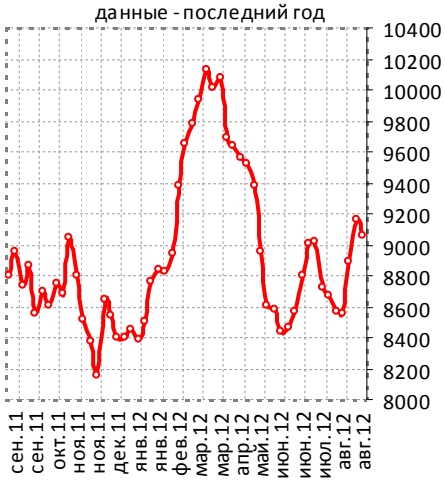
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

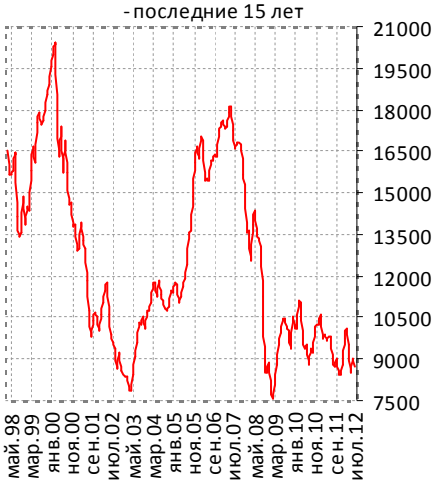
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



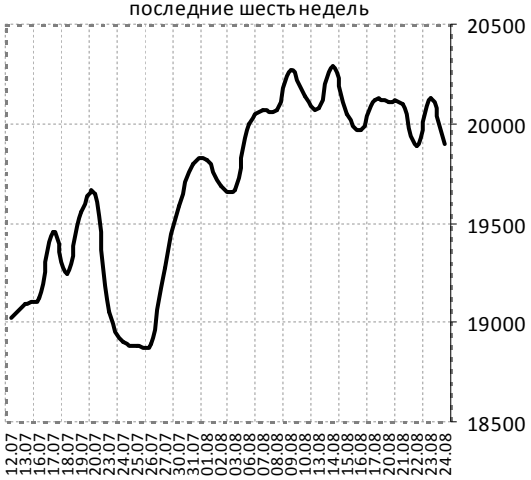
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



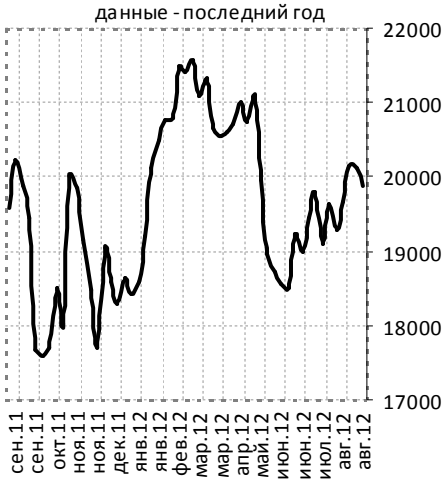
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



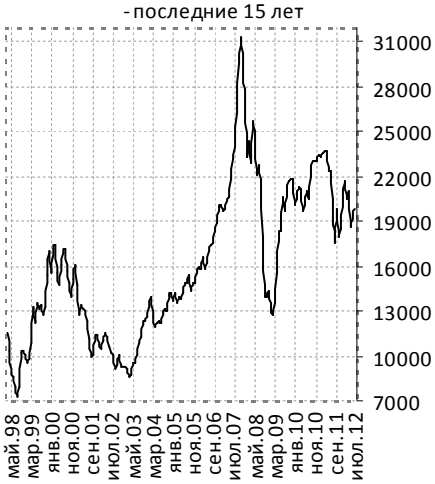
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



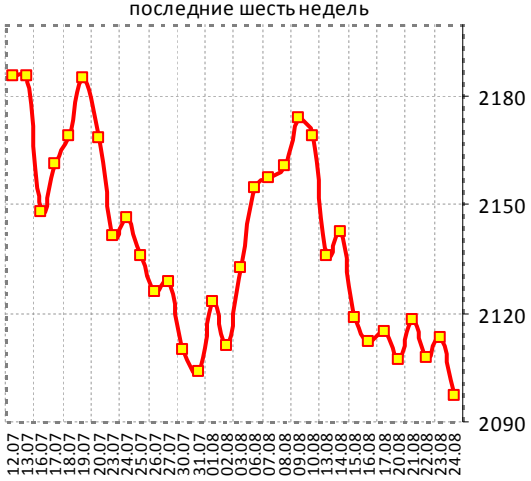
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



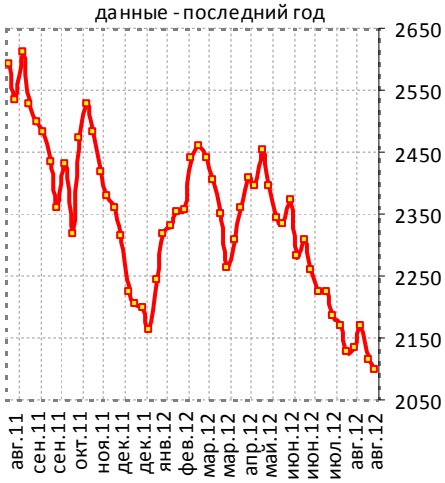
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



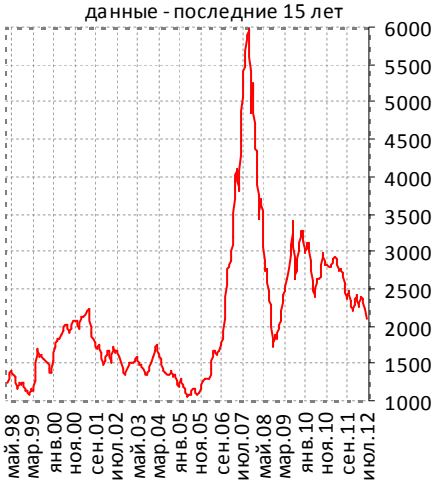
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



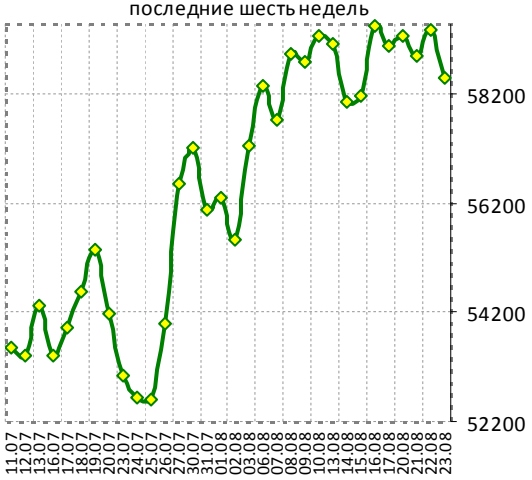
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



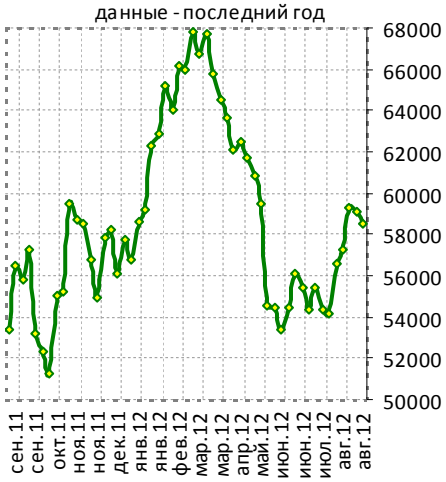
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

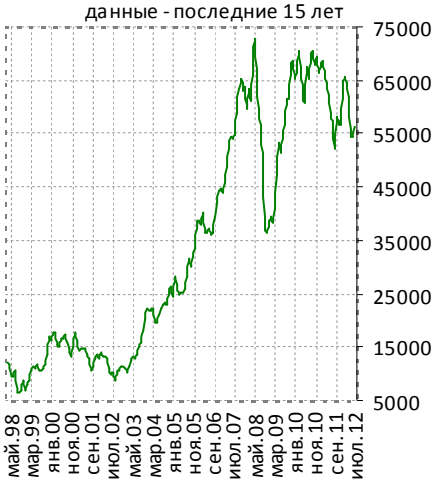
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



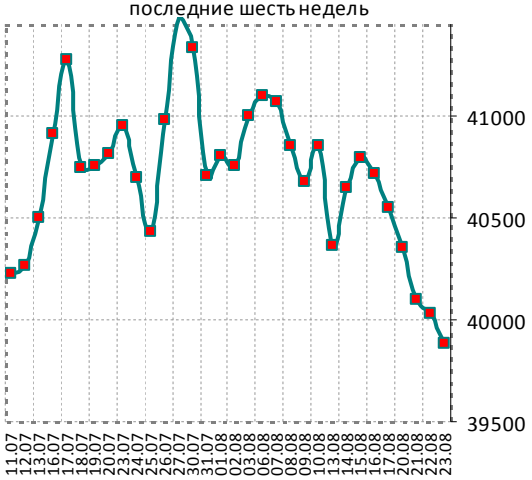
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



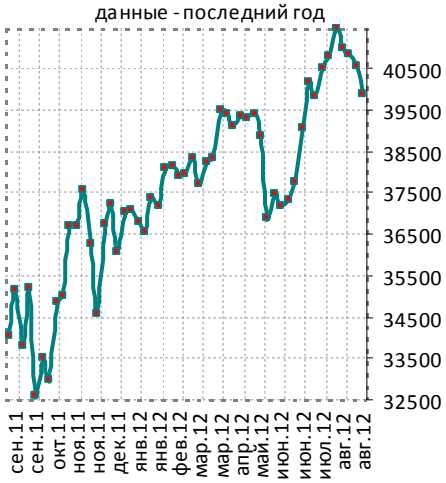
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



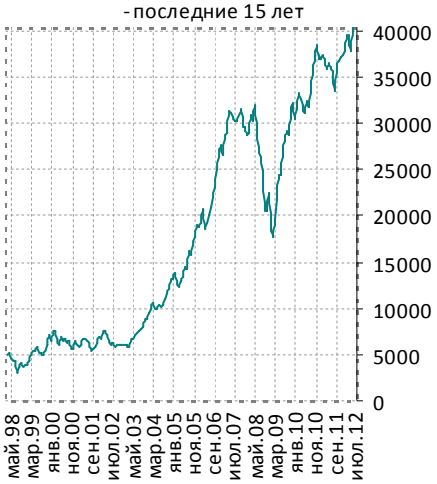
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



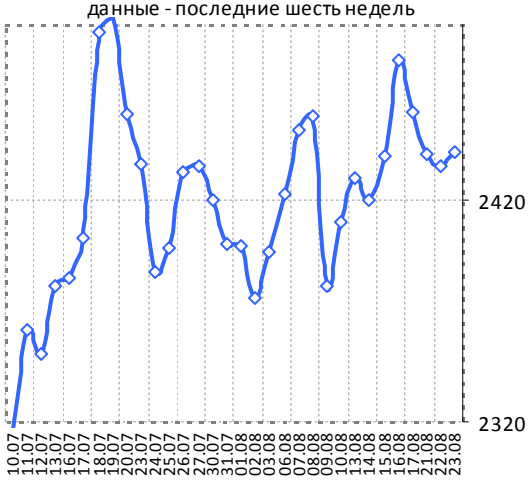
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



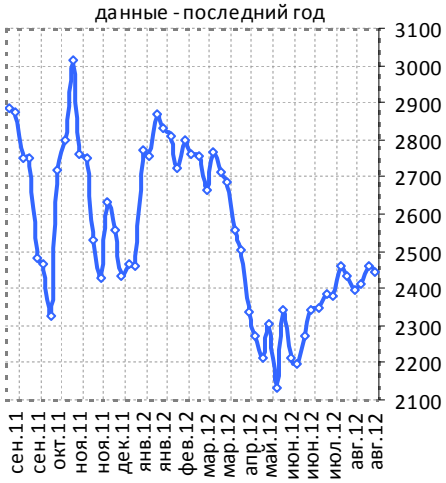
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



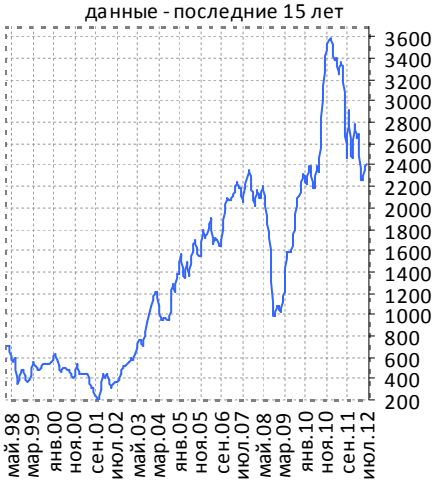
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

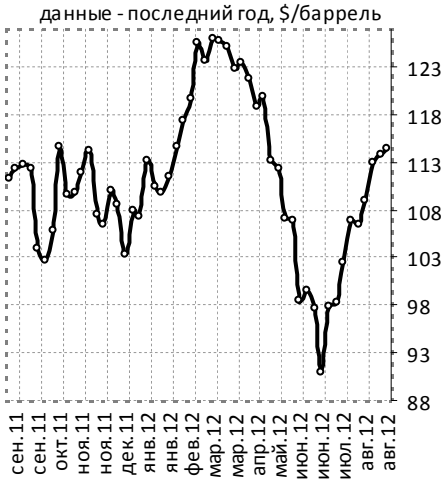
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

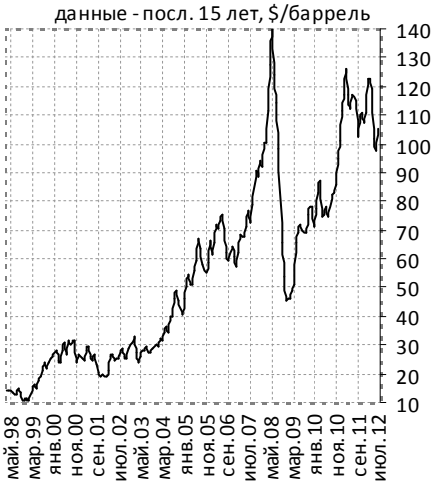
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



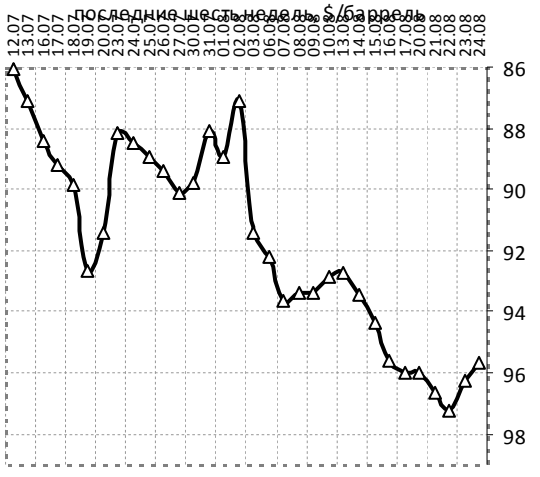
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



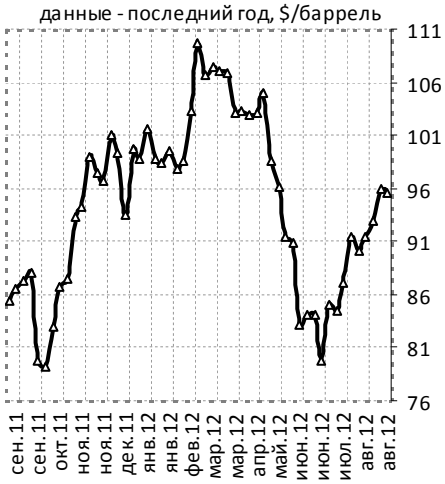
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



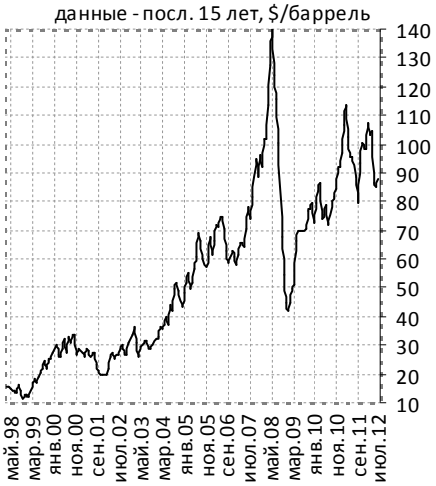
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



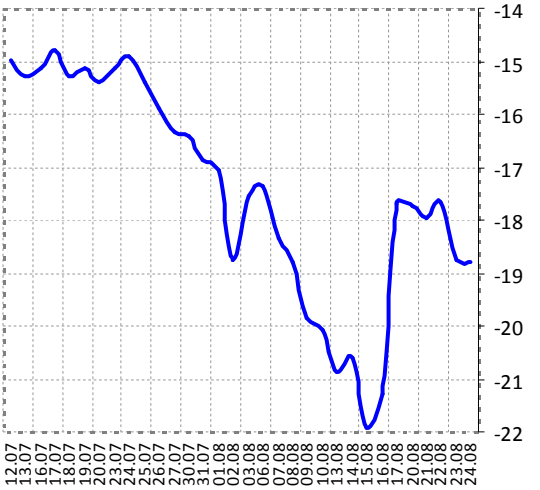
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



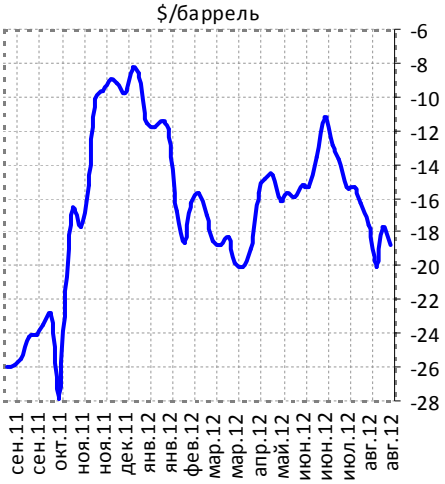
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



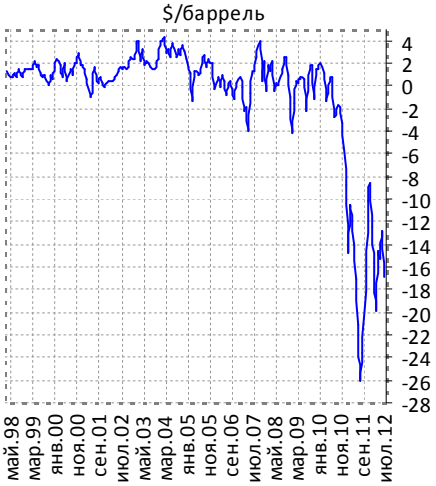
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



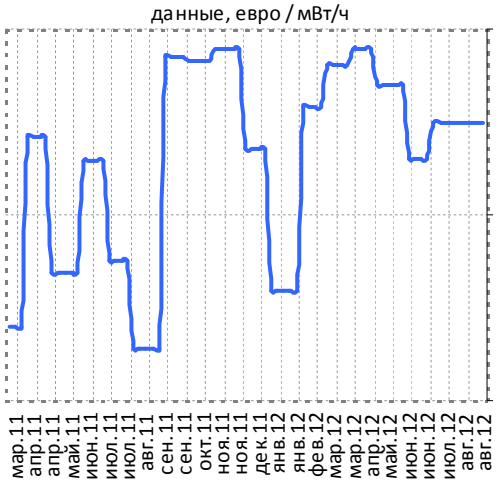
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



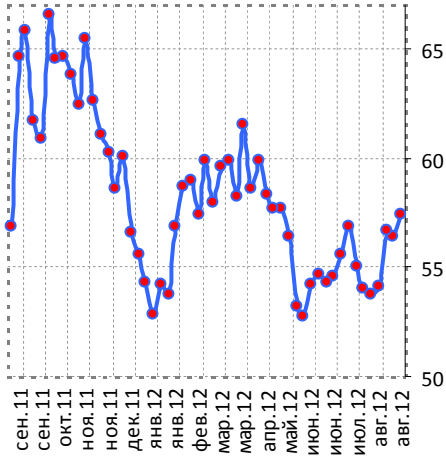
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

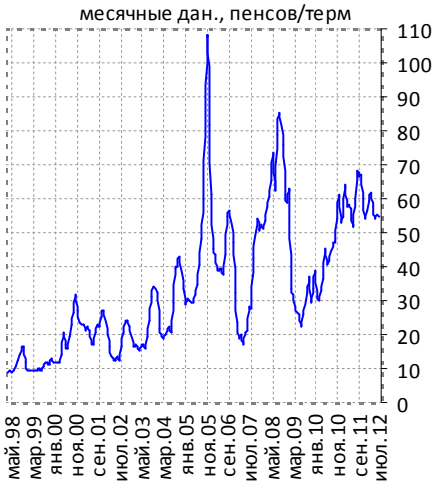
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



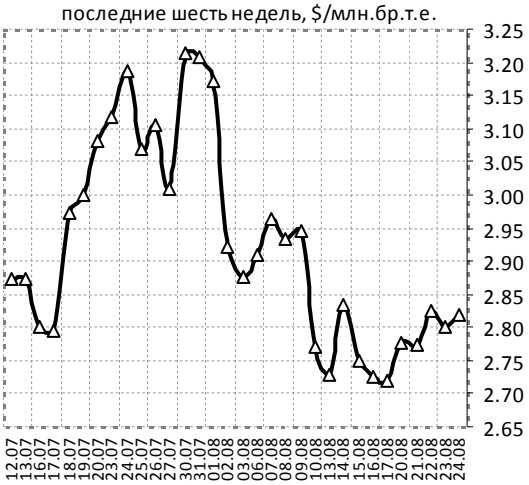
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



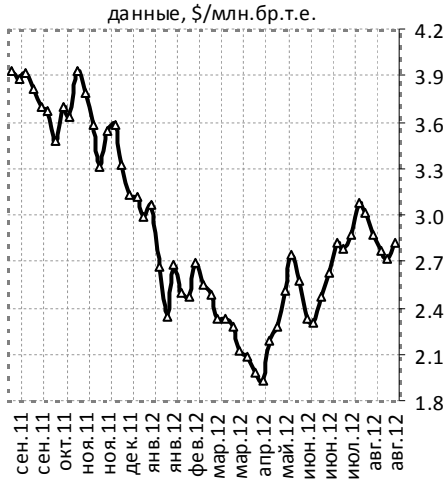
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



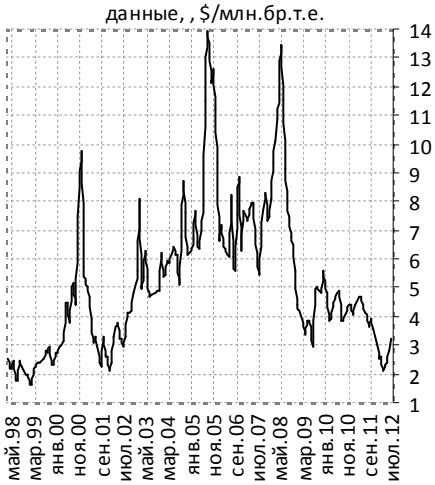
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



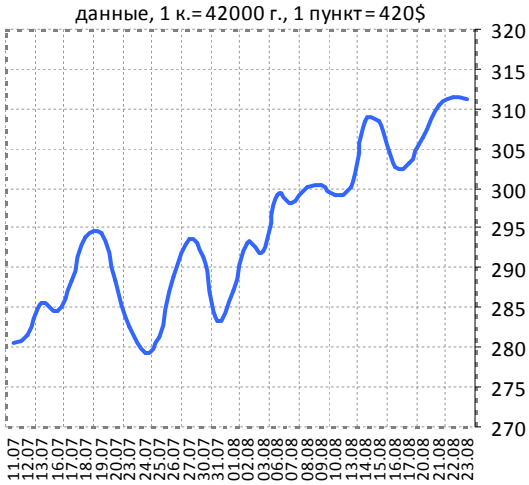
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



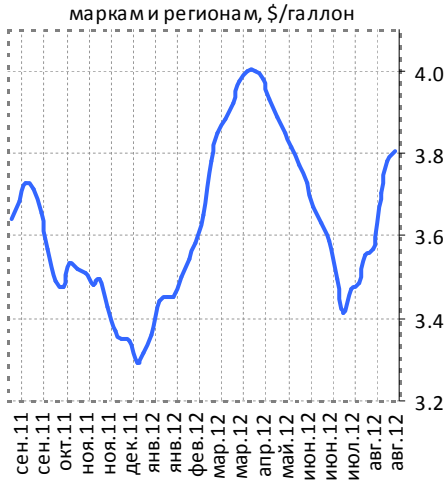
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



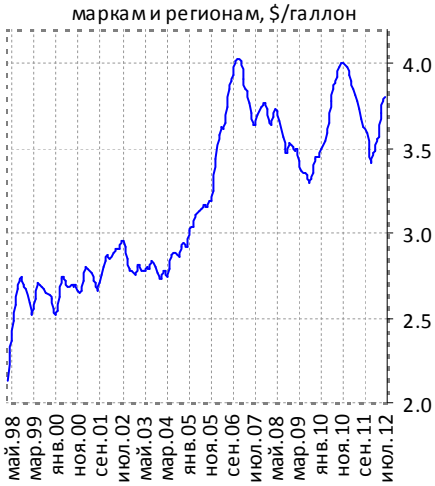
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



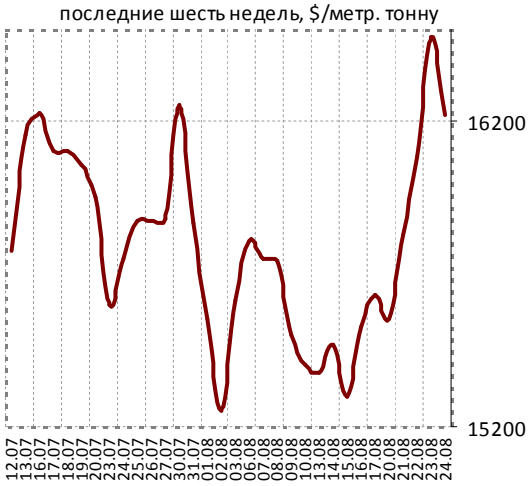
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



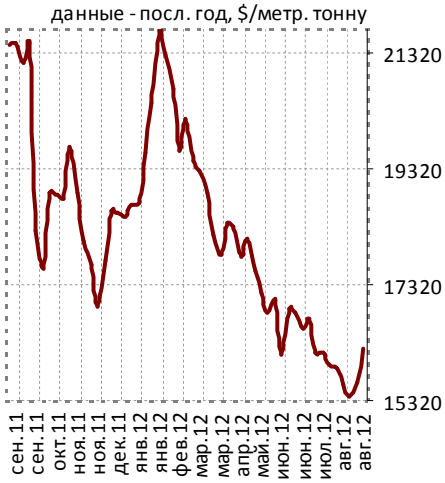
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

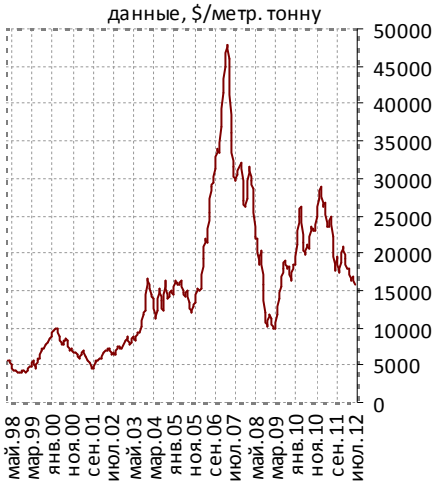
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



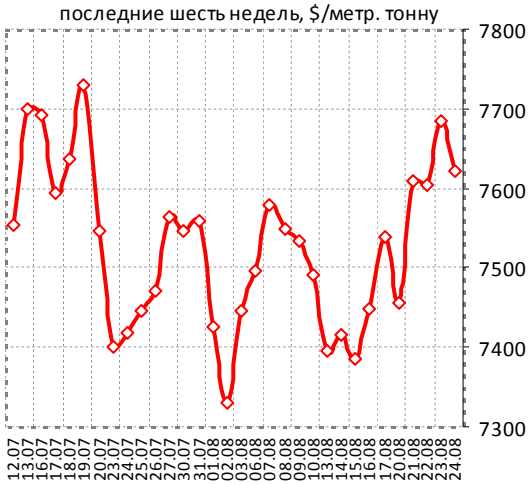
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



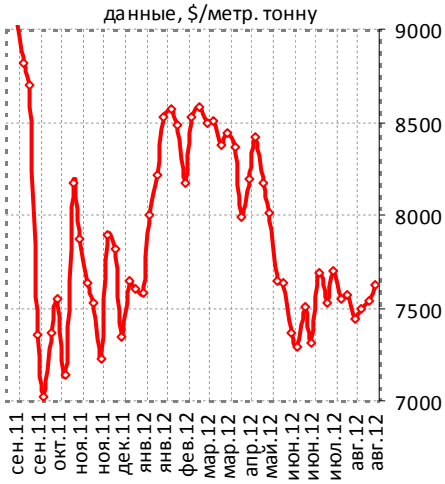
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



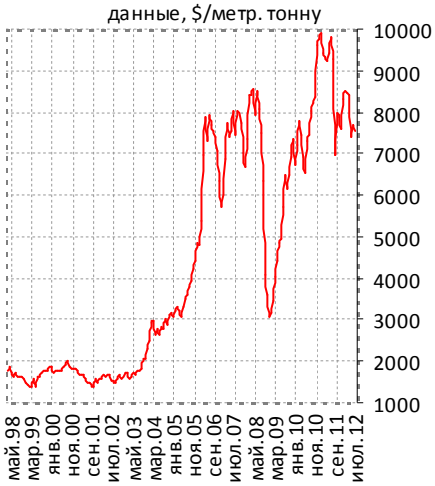
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



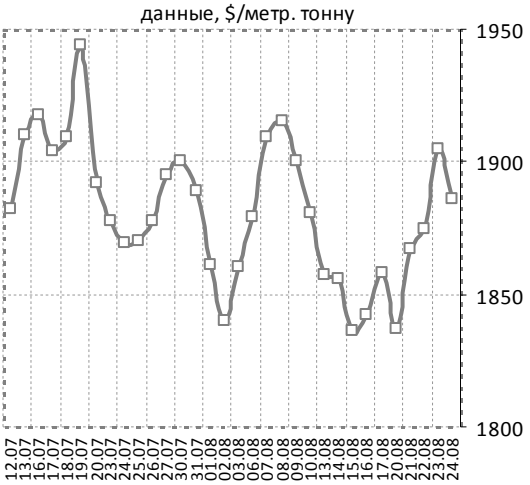
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



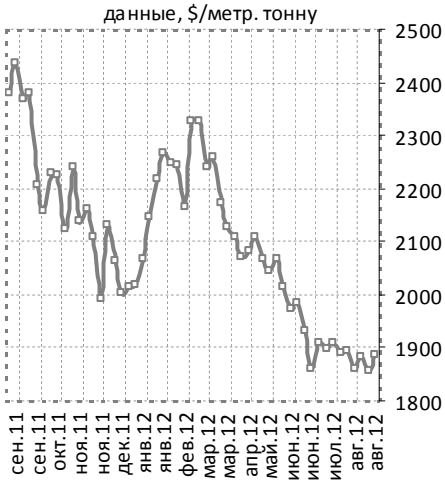
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



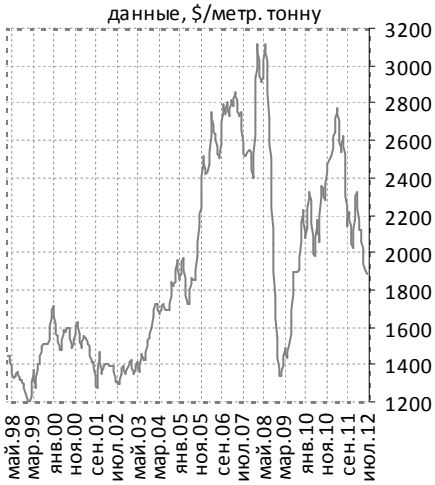
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.