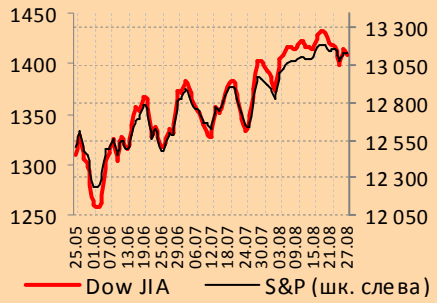
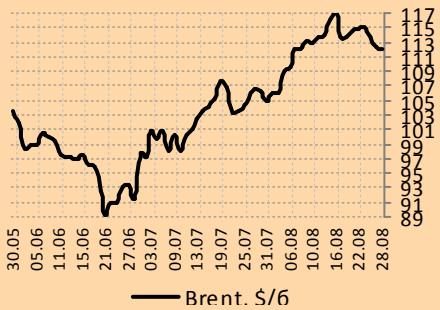
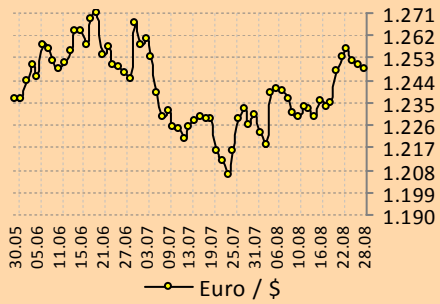
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

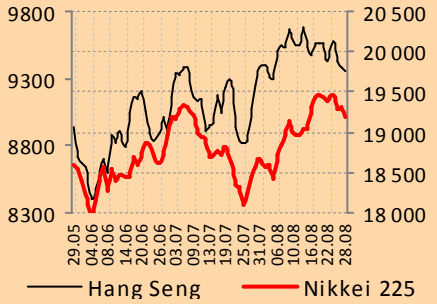
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

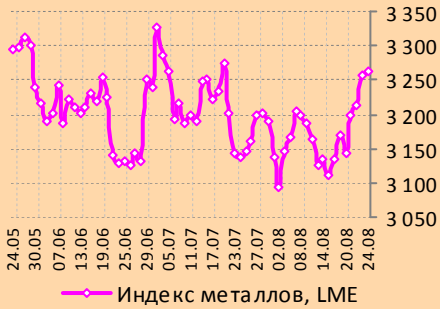
Ежедневный обзор

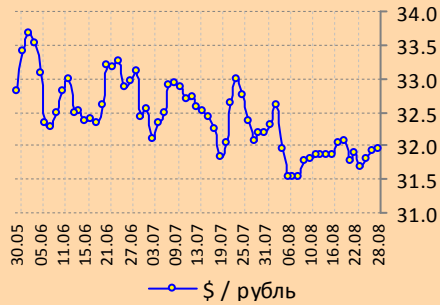












СОДЕРЖАНИЕ

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 2012-08-28

США. Индекс деловой активности в промышленности ФРБ Чикаго возрос за месяц с 93,9 до 95,6 пункта. В дополнение к вчерашней информации по объему заказов на товары длительного пользования (рост на 4,2 при ожиданиях в 2,4%) отметим, что весь рост обеспечили возросшие на 50% заказы на коммерческую авиацию. Если отчистить индикатор от этой компоненты, то окажется, что данные не такие уж и сильные. Результат последних торгов: Dow Jones =-0,25, S&P 500 =-0,05, NASDAQ =+0,11% (на информации о решении суда в пользу Apple, см. ниже).

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, даже при растущей цене нефти внешний фон оказал большее влияние на поведение инвесторов, биржевые индексы снизились, ММВБ =-0,38, РТС =-0,37%.

Из последних новостей укажем, что Казначейство на СПВБ размещает средства федерального бюджета на банковских депозитах в сумме до 38,4 млрд. руб. на срок 91 день. Пополняет ликвидность и ЦБ, на аукционе прямого РЕПО вчера предложил банкам на 1 день кредит в сумме 320 млрд. руб., спрос составил 322 млрд., взяли 318 млрд. руб. под 5,53% (ставка рынка 4,84%). Сегодня ЦБ кредитует комбанки под обеспечение золотом, активами или поручительствами под ставки 6,25-8,0%. Немного статистики. Доля убыточных организаций составила 31%, они получили убыток за полгода в размере 706,2 млрд. руб. Средняя зарплата в аппарате правительства РФ в годовом измерении увеличилась на 31,2% до 110,9 тыс. руб., на втором месте администрация президента с показателем 102,9 тыс. руб. (рост на 16,6%), на третьем месте Рособоронпоставка с 101,9 тыс. (рост на 15%). Количество гражданских служащих федеральных государственных органов составляет 38,1 тыс. человек или 80,6% от общей численности. При этом размер начисленной зарплаты в среднем по стране равен 27 тыс. руб.

Европа. Индекс деловых настроений в Германии снизился за месяц со 103,3 до 102,3 пункта (ожидали 102,7). Индекс является одним из важных индикаторов бизнеса, рассчитывается на основе опроса руководителей 7 тыс. ведущих компаний о текущей и ожидающейся ситуации в экономике страны. Торги в Великобритании не проходили в связи с праздничным днем, остальные индексы показали рост, DAX =+1,10, CAC 40 =+0,86%).

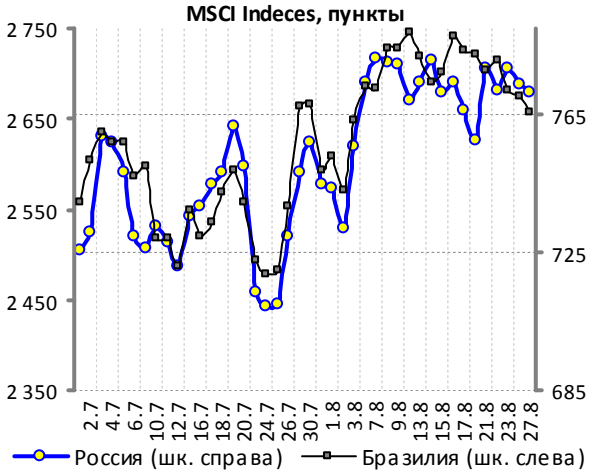
Азия. Рынки закрылись преимущественно минусом, SSE -1,74, Kospi -0,10, Hang Seng -0,41, Nikkei +0,16%. Относительно Китая отметим, что прибыль промышленных компаний в годовом измерении снизилась на 5,4%, отрицательная динамика сохраняется уже третий месяц подряд. На динамику корейской биржи повлияло решение суда штата Калифорния о выплате штрафа в размере более 1 млрд. долл. со стороны Samsung Electronics в адрес Apple за нарушение шести из семи патентов Apple. Накануне суд Южной Кореи принял решение о вине обеих компаний. На решении калифорнийского суда акции Samsung снизились на максимальную за последние четыре года величину, но снижение общего биржевого индекса замедлилось на факте повышения Moodys суверенного рейтинга Южной Кореи и рейтингов шести государственных финансовых учреждений республики. В качестве обоснования своего решения агентство назвало устойчивые финансовые показатели, позволяющие преодолеть риски и внешние угрозы (мировой финансовый кризис практически не повлиял на состояние госбюджета и госдолга), стабильность рынка труда (3,1%), рост производительности. Что касается японских инвесторов, они покупали на ожиданиях, что американские власти могут принять новые меры по стимулированию экономики (см. наш предыдущий обзор), особенно росли котировки крупных экспортеров.

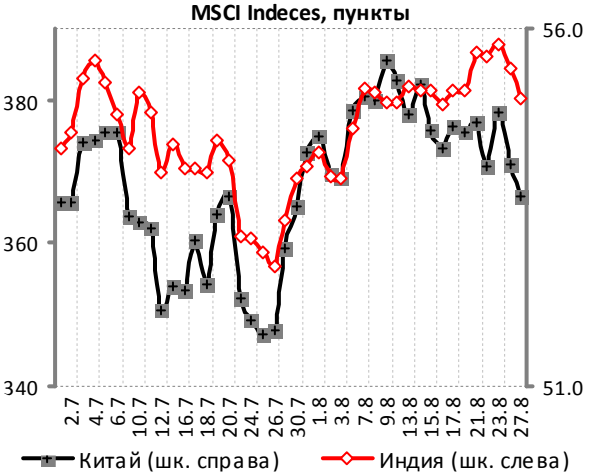
Золото. Ожидания новых мер со стороны центробанков, включая ФРС, удерживает привлекательность драгметаллов, но сегодня утром при укреплении доллара цены немного снизились, фьючерсы на золото = 1663,32, серебро = 30,6, платину = 1535,2, палладий = 645,35 долл./унция. Возможная причина высоких цен драгметаллов - в покупках некоторыми центробанками, в ожидании интервенций ЕЦБ на долговом рынке еврозоны.

Нефть. Текущим фактором поддержки цены нефти в эти несколько дней стал взрыв на НПЗ в Венесуэле (завод является вторым в мире по величине). Кроме того, Light росла из-за тропического шторма в США, там сократилась добыча и приостановлены работы на скважинах в Мексиканском заливе. Сегодня утром обозначилось снижение, Brent и Light торгуются соответственно по 112,18 и 95,42 долл./барр.

Прогноз. Наши компании вносят налог на прибыль, но регуляторы, как мы видим, своевременно пополняют ликвидность в системе. Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются разнонаправлено, Азия тоже, цена нефти снижается, хотя и остается достаточно высокой. Но, при таком неуверенном внешнем фоне, нефть вряд ли сможет стать драйвером роста.

Полная версия ежедневного аналитического обзора, 28.08.2012.

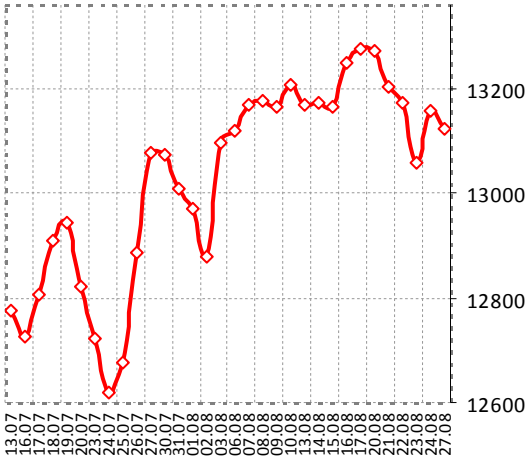




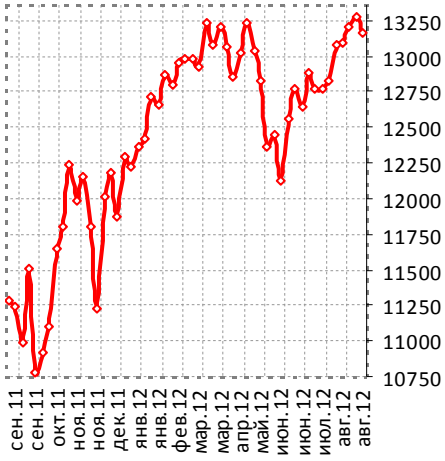
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

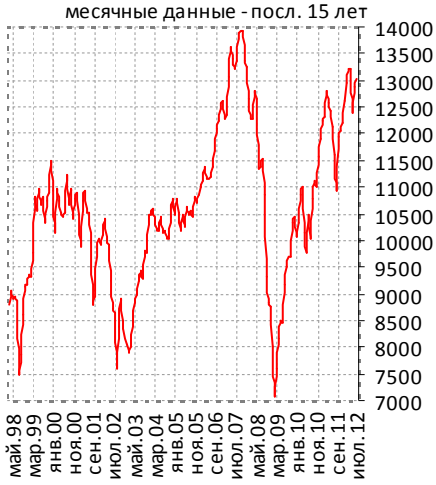
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



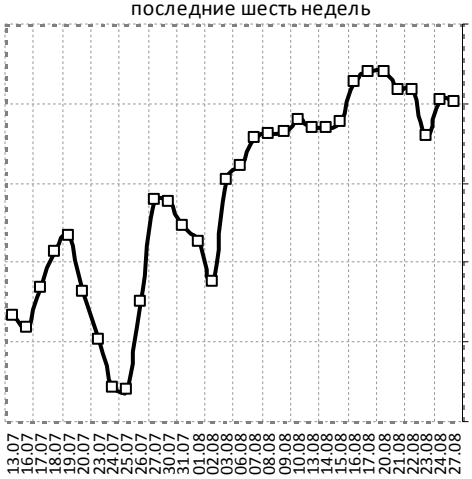
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



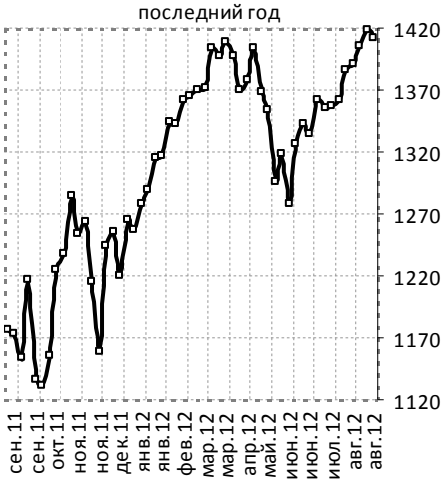
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



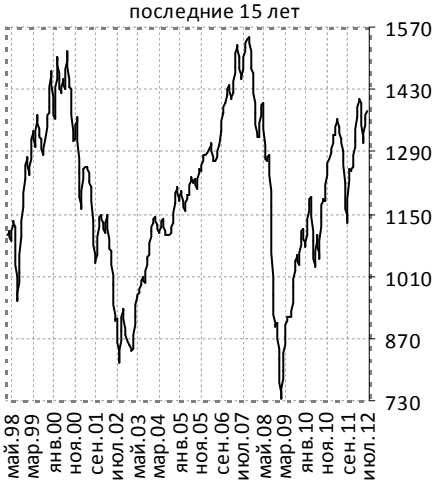
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



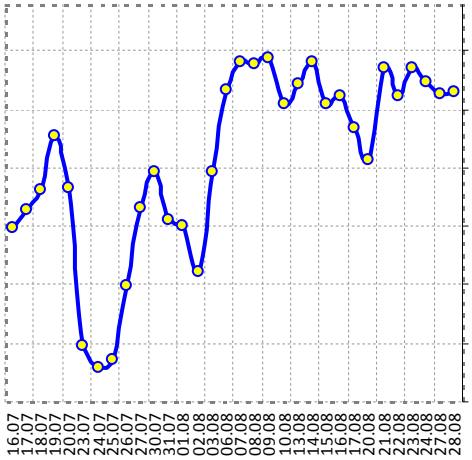
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



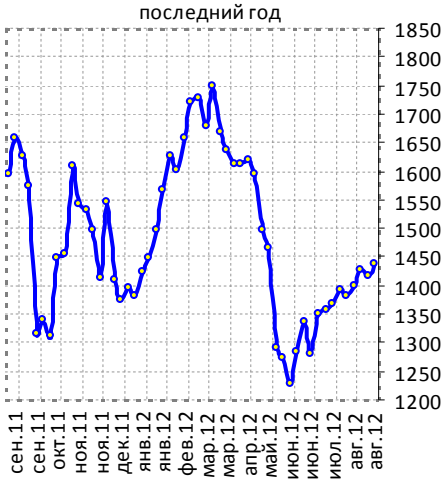
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



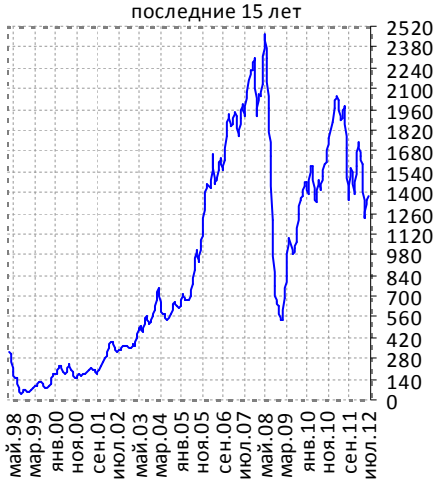
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



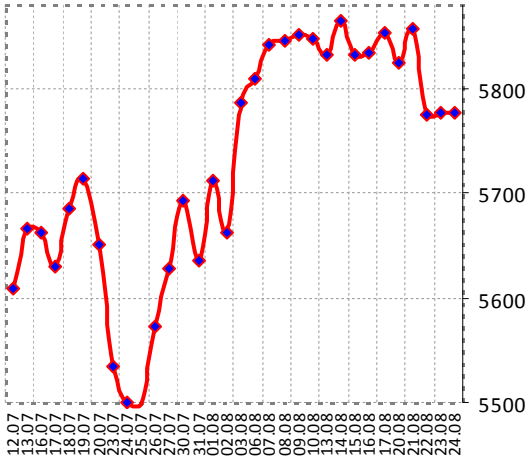
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



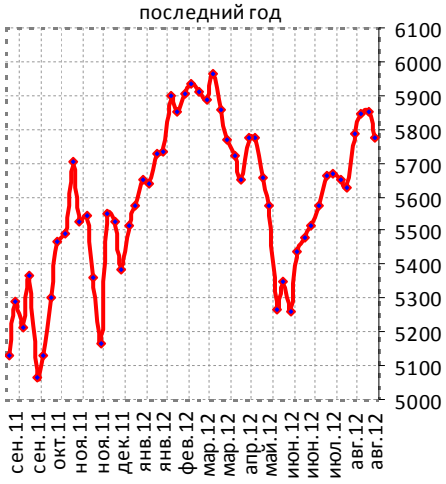
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

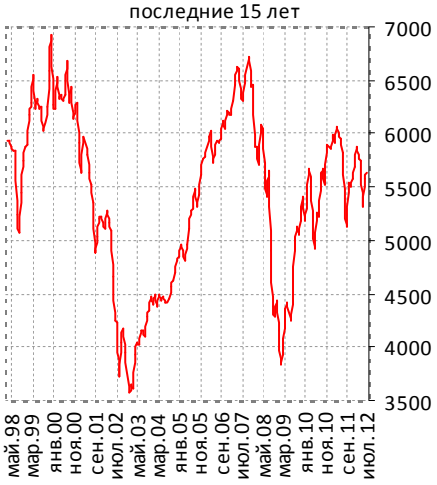
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



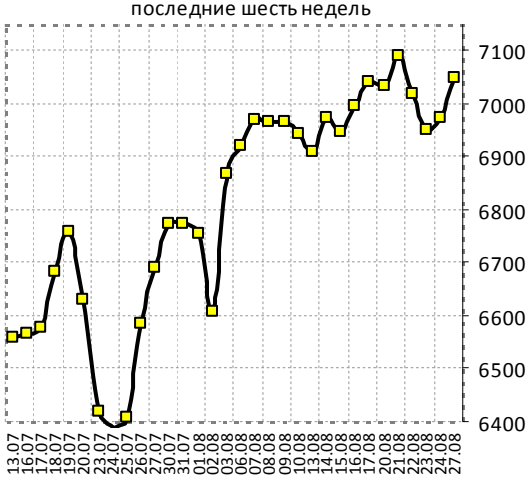
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



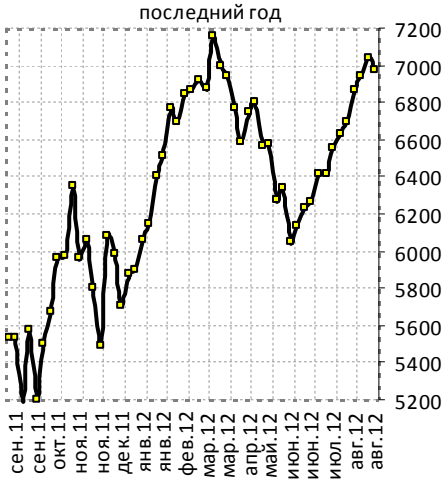
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



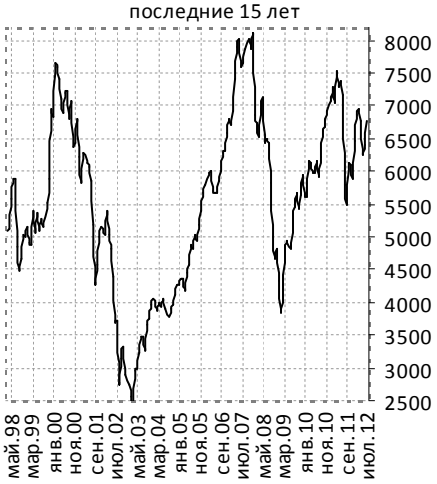
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



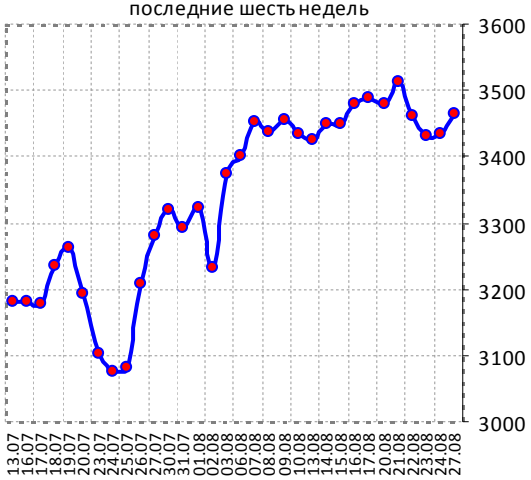
DAX Index: недельные данные - последний год



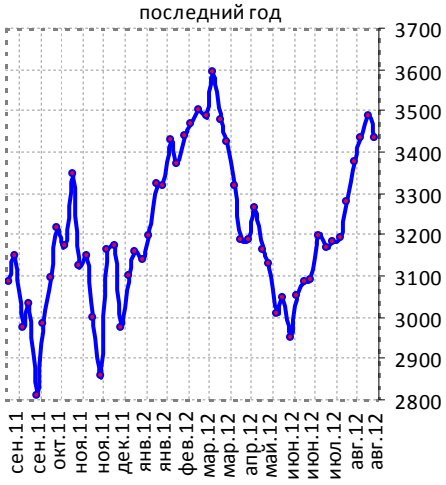
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



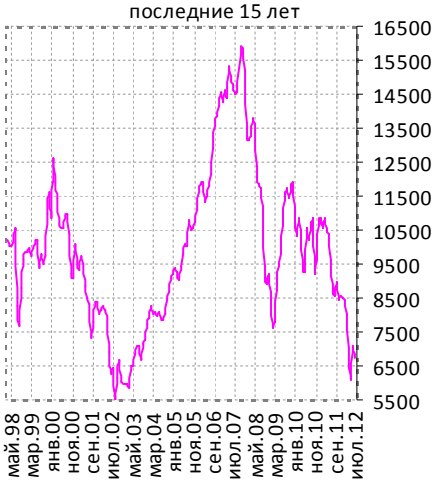
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

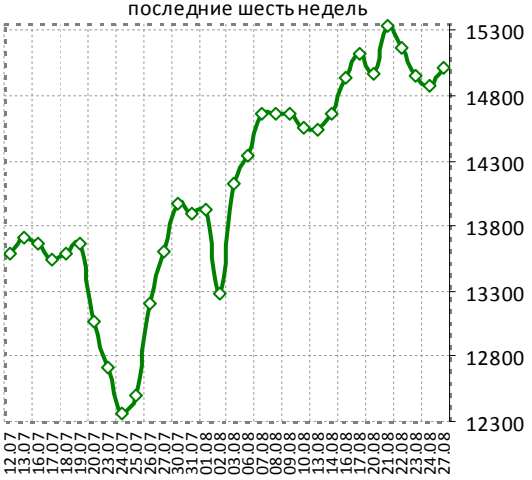


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

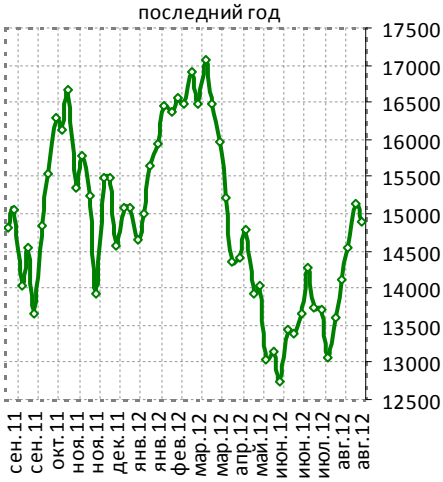


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

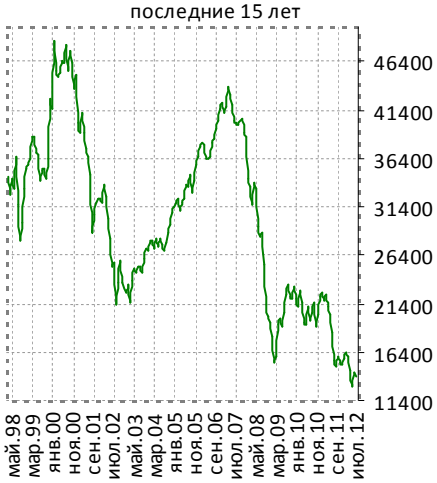
MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



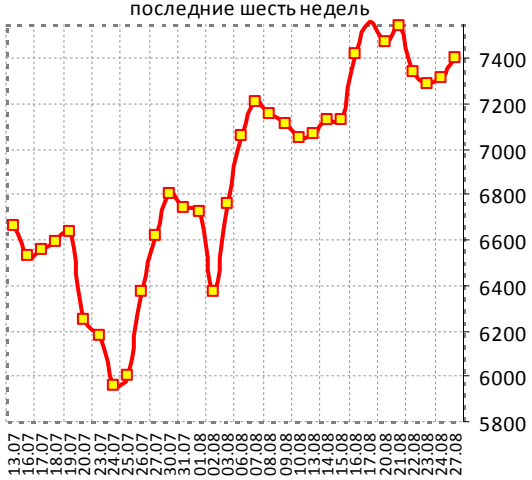
MIB Index: недельные данные - последний год



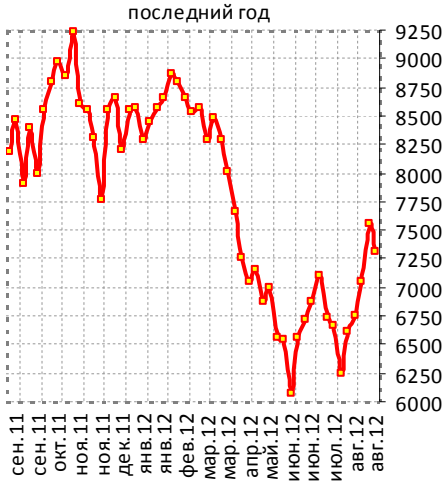
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



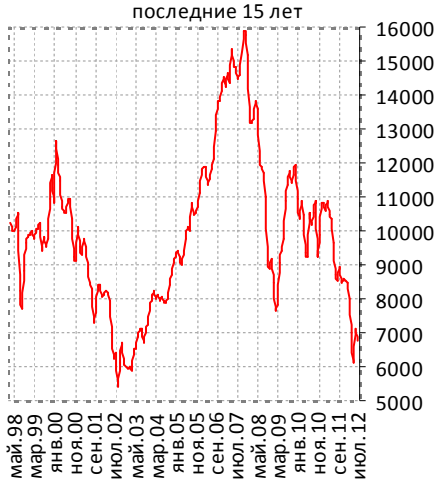
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



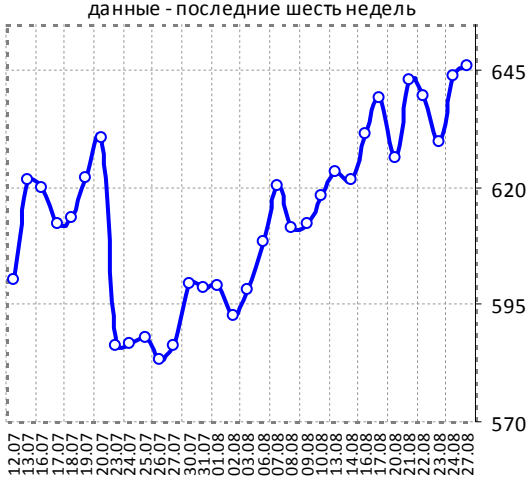
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



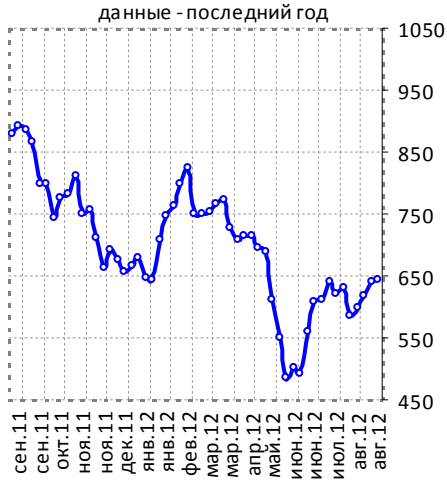
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



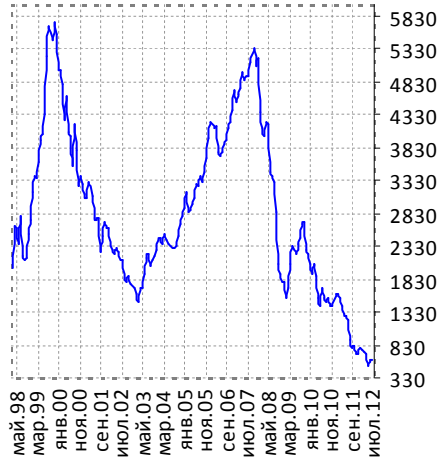
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



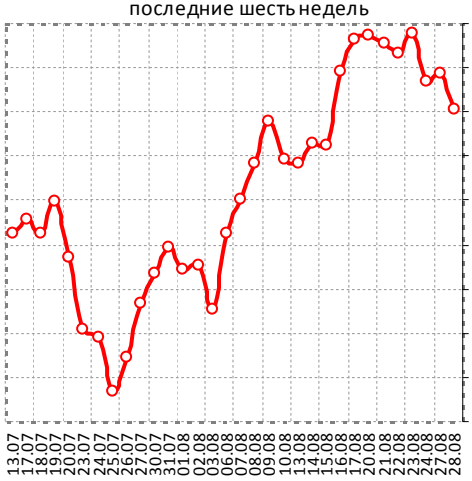
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



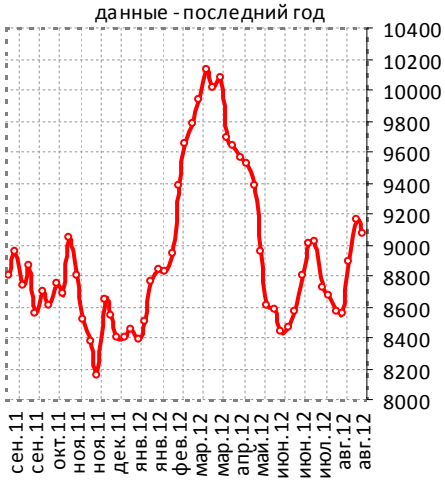
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

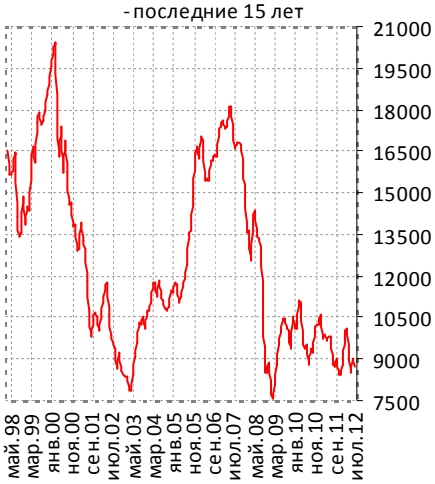
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



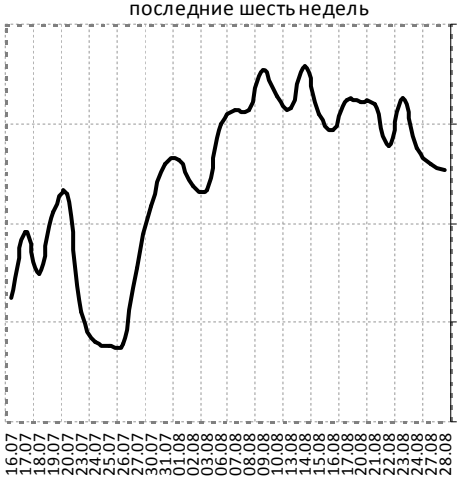
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



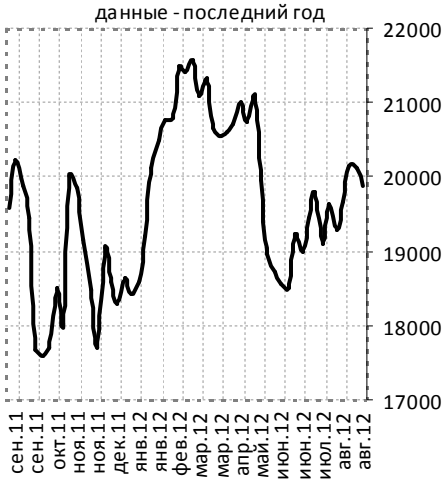
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



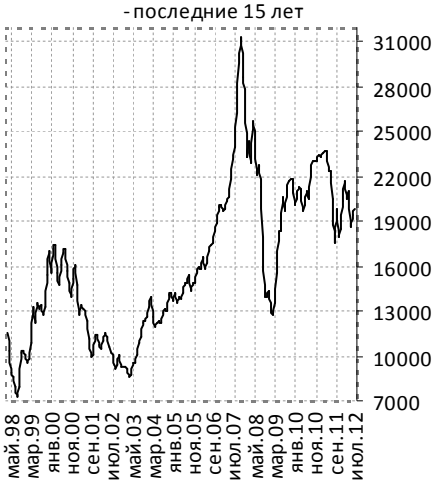
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



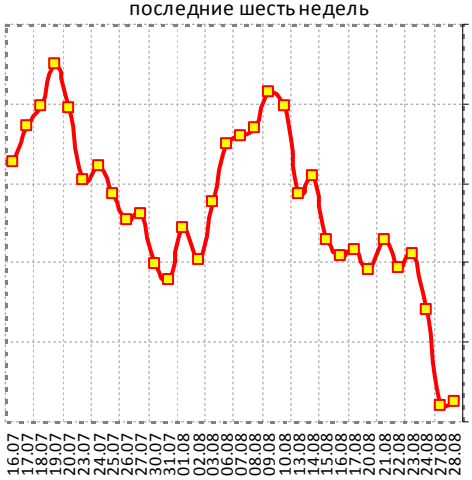
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



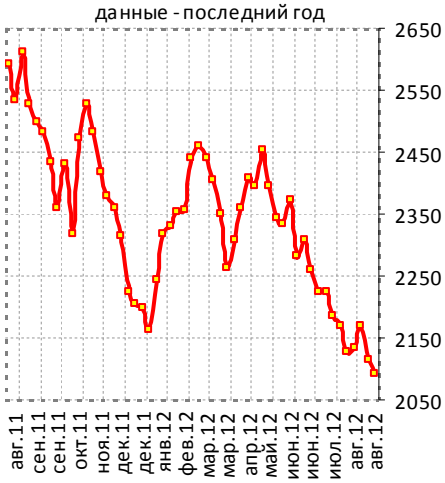
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



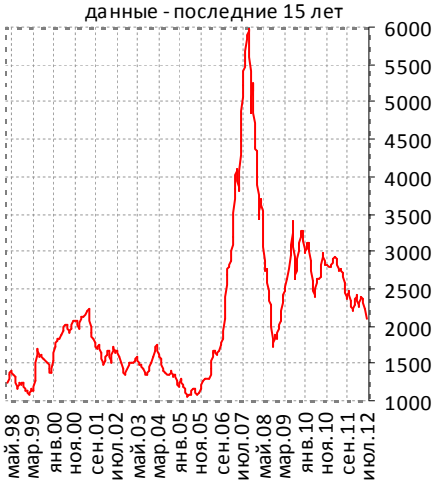
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



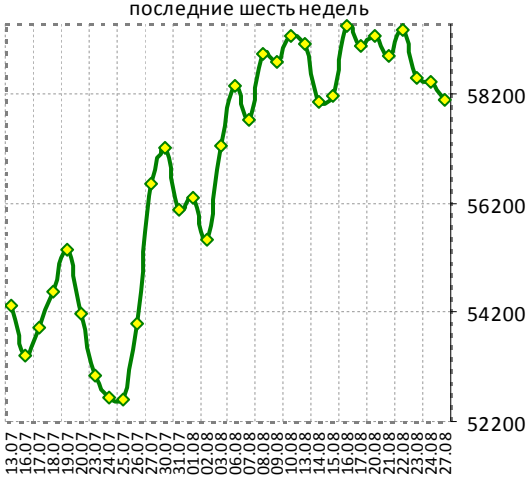
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



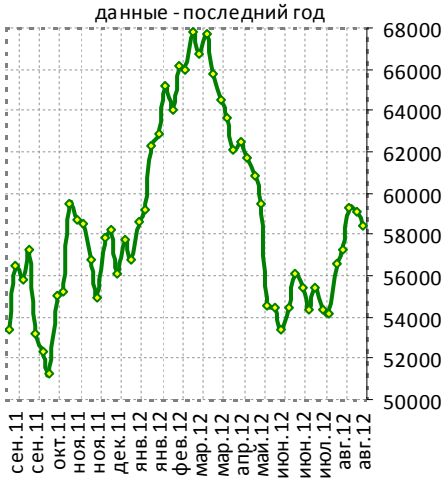
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

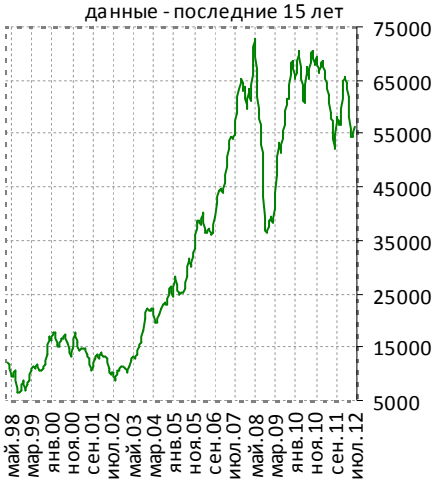
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



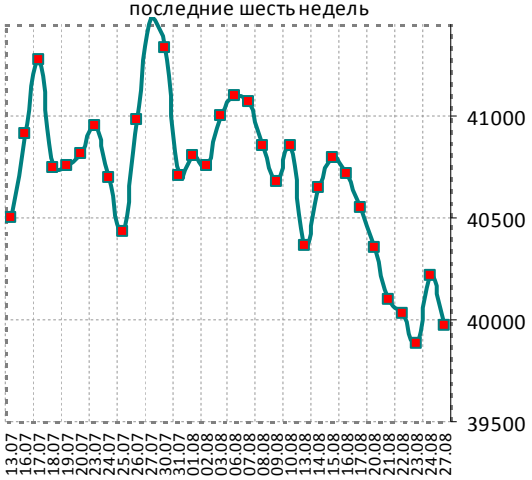
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



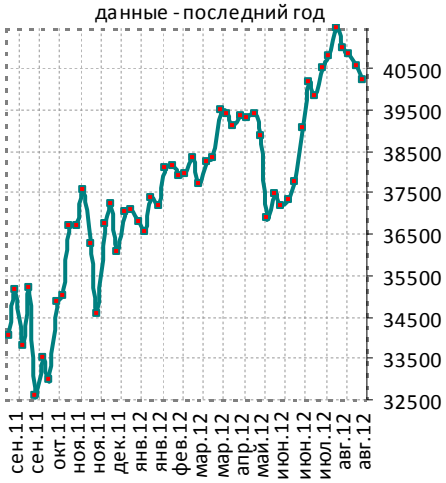
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



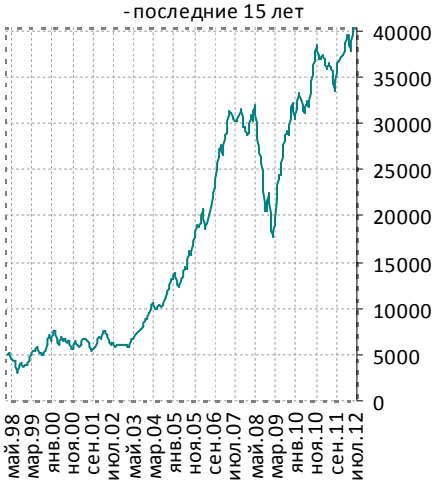
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



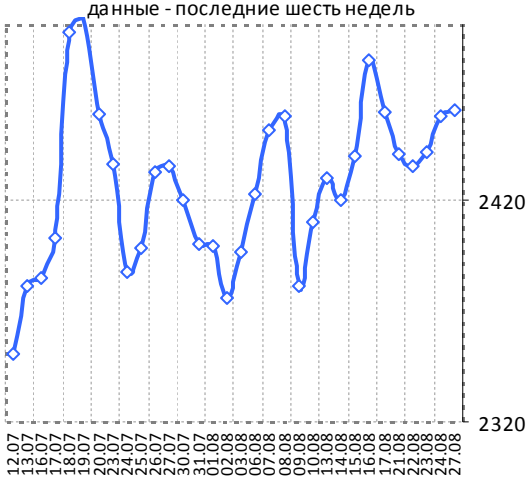
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



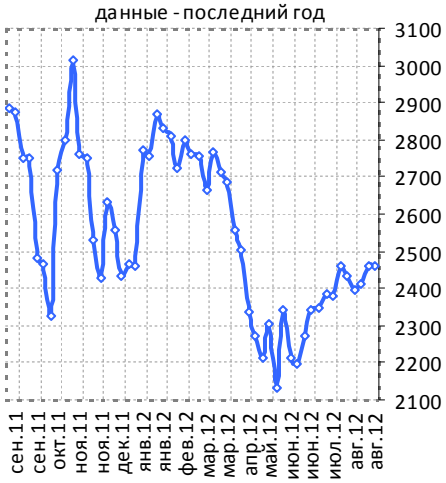
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



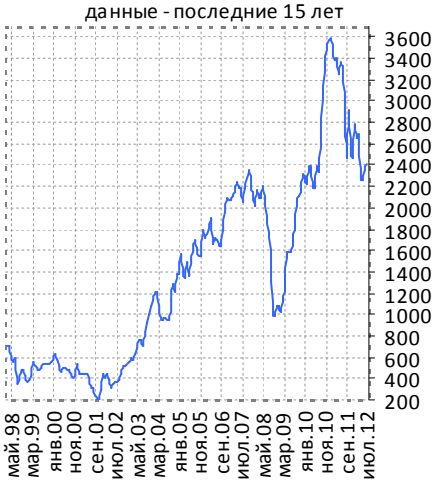
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

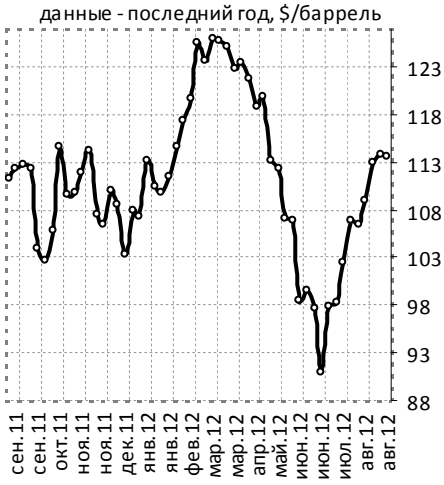
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

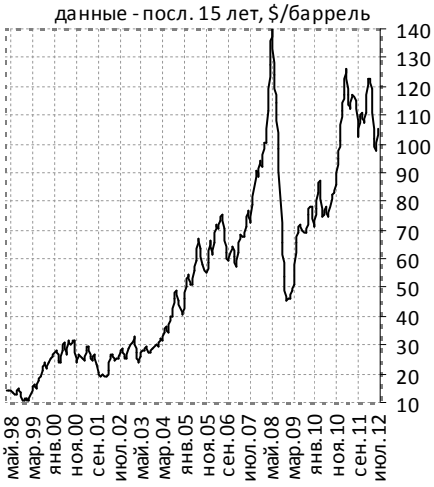
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



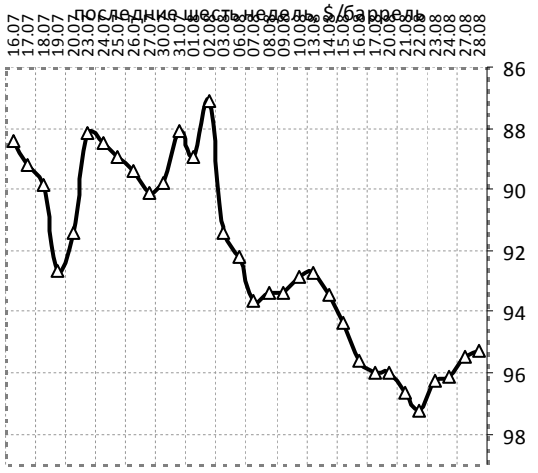
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



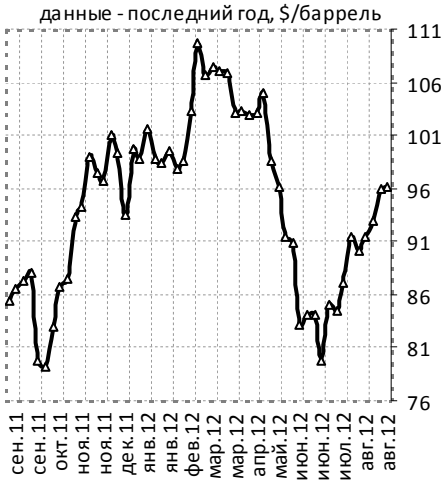
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



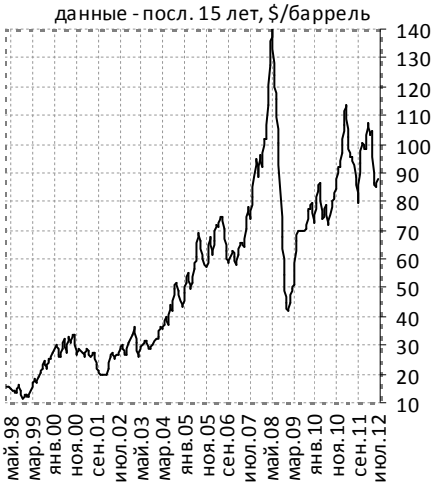
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



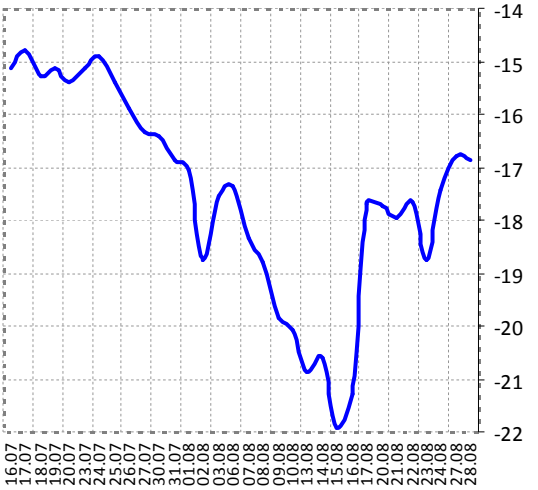
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



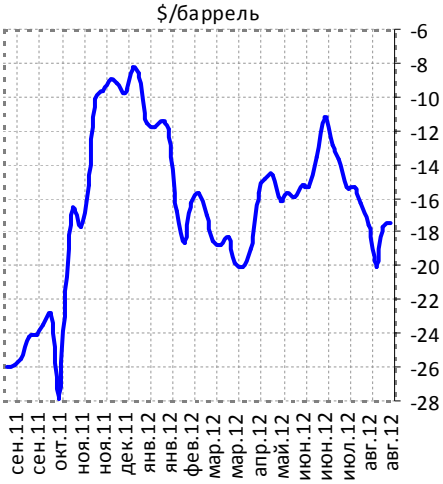
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



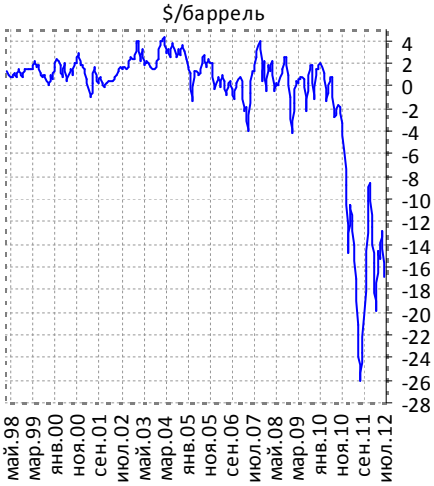
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



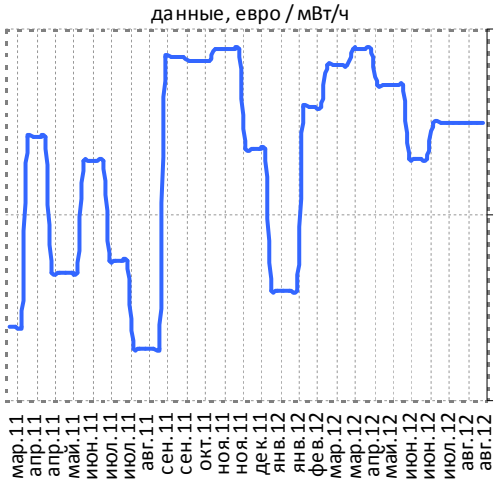
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



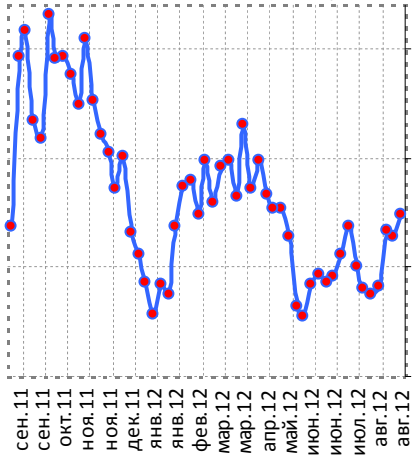
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

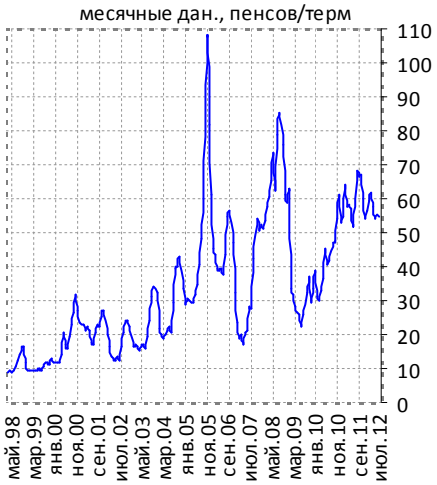
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



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



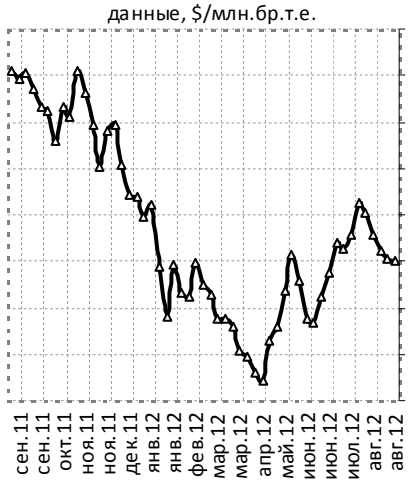
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



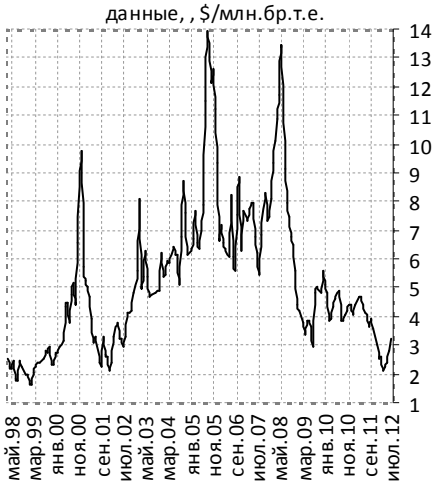
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



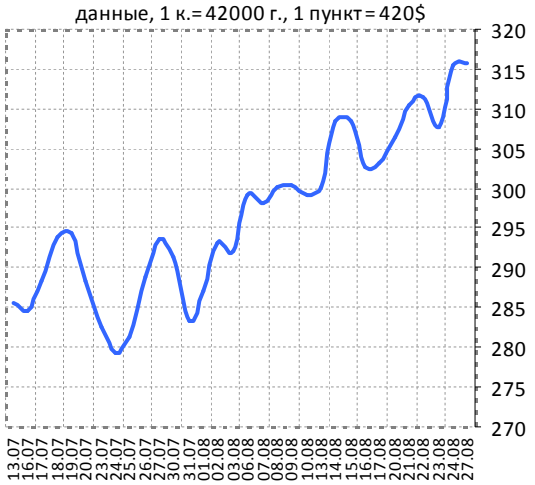
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



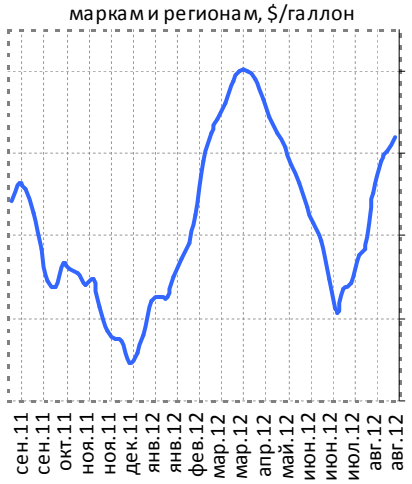
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



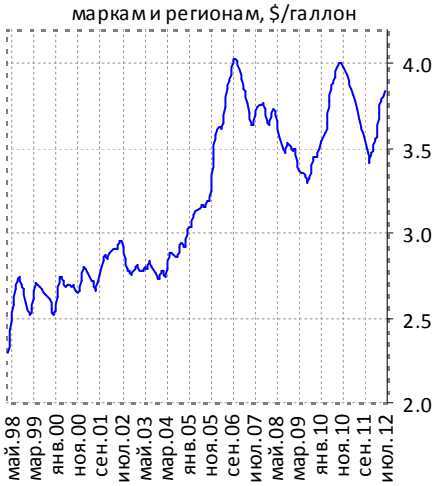
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.=42000 г., 1 пункт=420$



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



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



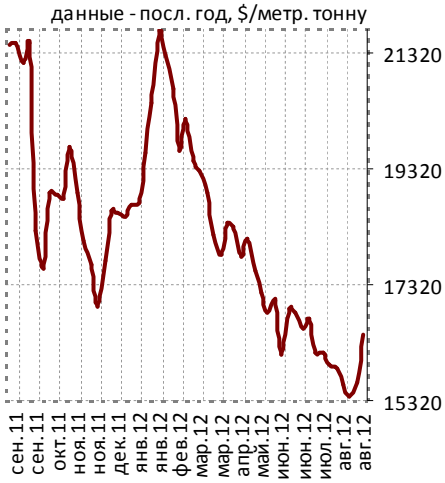
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

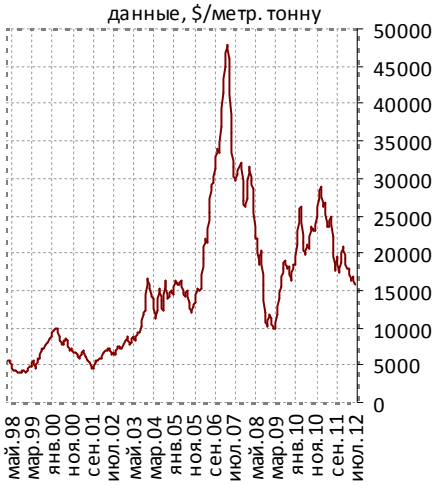
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



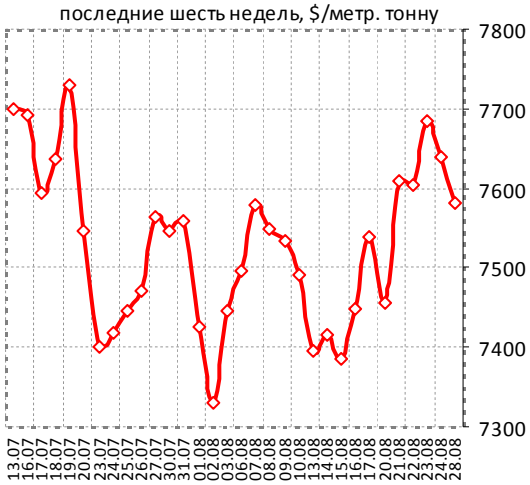
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



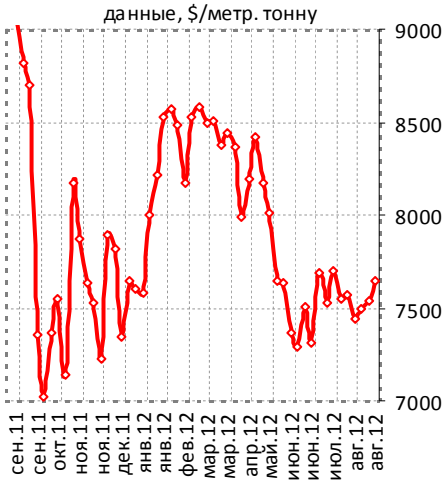
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



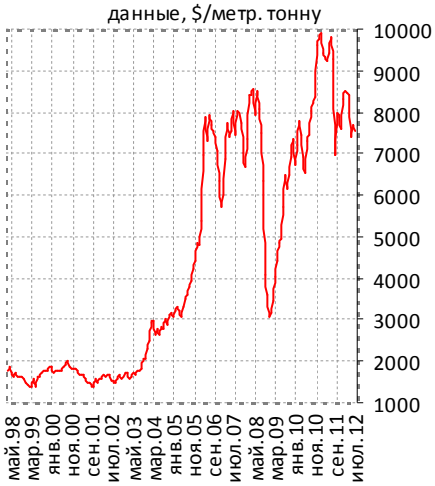
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



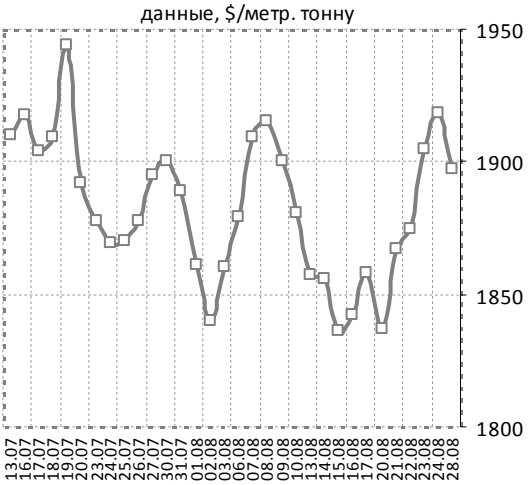
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



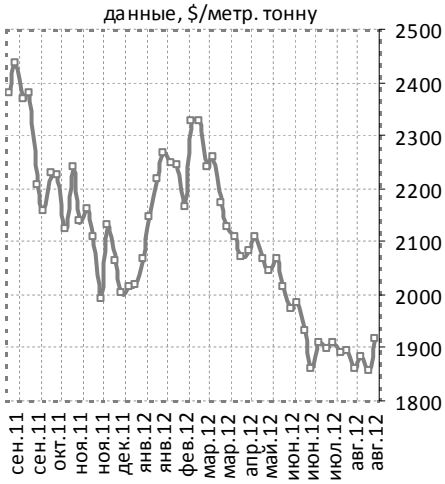
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



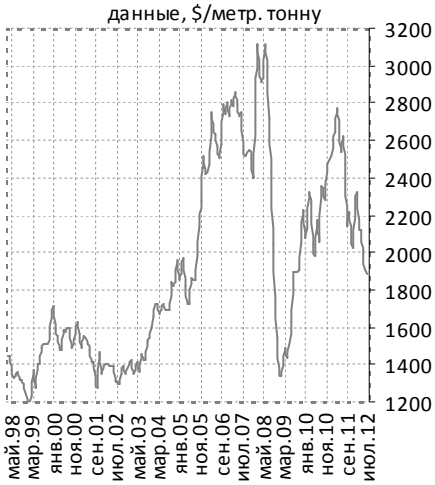
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.