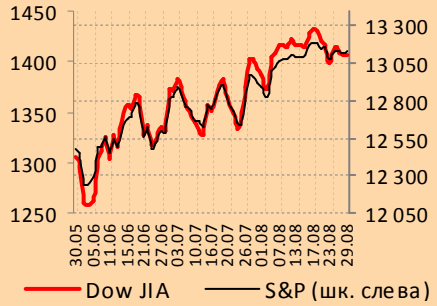
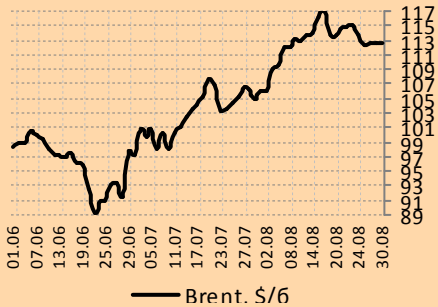
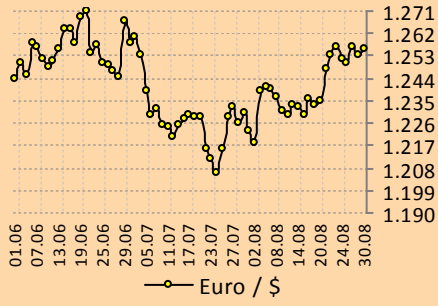
Открытое Акционерное Общество
"Инвестиционная компания "Еврофинансы"
119049 г. Москва, Шаболовка, д.10, корп.2
Телефон: (495) 545-35-35 (многоканальный)
Факс: (495) 644-43-13
www.eufn.ru
e-mail: info@eufn.ru

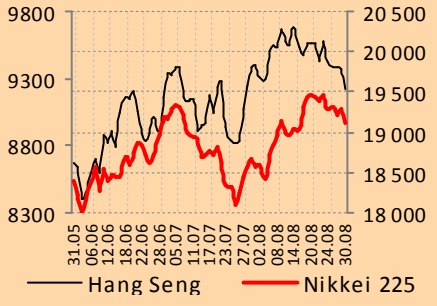
ИНВЕСТИЦИОННАЯ КОМПАНИЯ
ЕВРОФИНАНСЫ

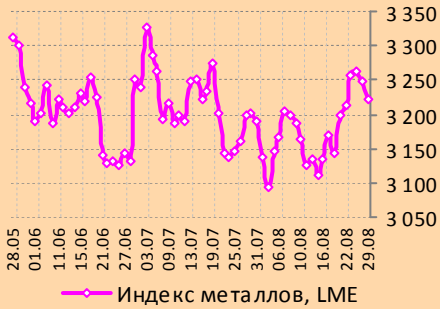
Ежедневный обзор

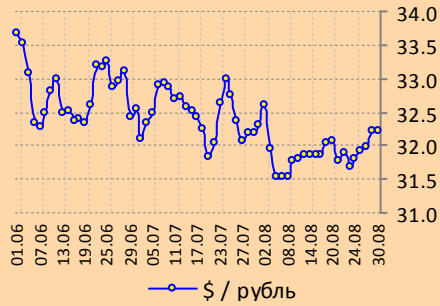






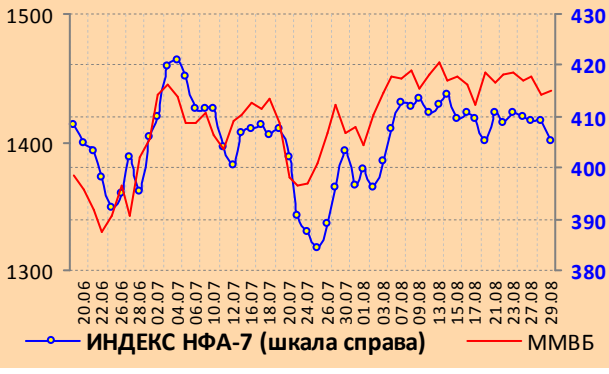






СОДЕРЖАНИЕ

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. Индекс цен на жилье вырос впервые за последние 2 года, но инвесторы предпочли перед началом торгов обращать внимание исключительно на негативные новости. Так, существенно снизился за месяц индекс потребительского доверия (с 65,4 до 60,6 пункта, ожидали небольшой рост до 65,8), что удерживало фьючерсы на биржевые индексы в минусе. К вечеру вышла информация по уточненному ВВП: рост во втором квартале составил 1,7% относительно первого квартала, как и ожидалось (предварительные данные показывали рост на 1,5%). Кроме того, в Бежевой книге (отчет ФРС об экономическом состоянии по 12 округам) показатели, хотя и показали умеренный рост, но занятость не снижается и требуются более решительные меры для поддержания экономики. На этом позитиве фьючерсы изменили динамику, итоги торгов положительные.

Россия. Как и прогнозировали Еврофинансы, наши биржи торговали с оглядкой на другие мировые площадки. К тому же, МЭР изменил (в основном в худшую сторону) прогноз социально-экономического развития России до 2015 года. Так, если относительно ВВП в этом году ожидается увеличится не на 3,4, а на 3,5%, то инфляция вырастет до 7% (ранее предполагался рост в интервале от 5 до 6%), среднегодовой курс доллара с 29,2 до 31,3 руб., отток капитала возрастет более, чем в два раза, до 60 млрд. долл. Уточненный прогноз будет внесен в правительство в пятницу.

Мы писали, что размещение госбумаг в период налоговых платежей может быть не очень удачным. Действительно, вчера на аукционе Минфина по размещению пятилетних ОФЗ в сумме 10 млрд. руб. спрос составил всего 3,3 млрд., размещено и того меньше, 2,6 млрд., но зато при доходности в 7,57% (верхняя граница объявленного Минфином диапазона). Внешэкономбанк размещает сегодня средства пенсионных накоплений в сумме до 40 млрд. руб. под проценты на депозиты в банках, возврат средств 23 августа 2013 г., минимальная ставка размещения 8,15%.

Ослабление рубля при достаточно высоких ценах на нефть вызывает вопросы, но может быть связано с целенаправленным поддержанием конкурентоспособности отечественных экспортеров в ситуации вступления России в ВТО.Инфляция с начала года равна 4,7%.

Европа. Решающее влияние на итоги сессии оказало интервью главы ЕЦБ, в частности, заявление о том, что монетарная политика может временами требовать принятия исключительных мер. В Италии потребительское доверие практически сохраняется, несмотря на проблемы в экономике, за месяц произошло лишь незначительное снижение индекса с 86,5 до 86,0 пункта, именно так и ожидалось. Страна удачно разместила 6-месячные гособлигации, объем заявок существенно превышал предложение, а доходность снизилась в сравнении с аналогичным размещением месяцем ранее.

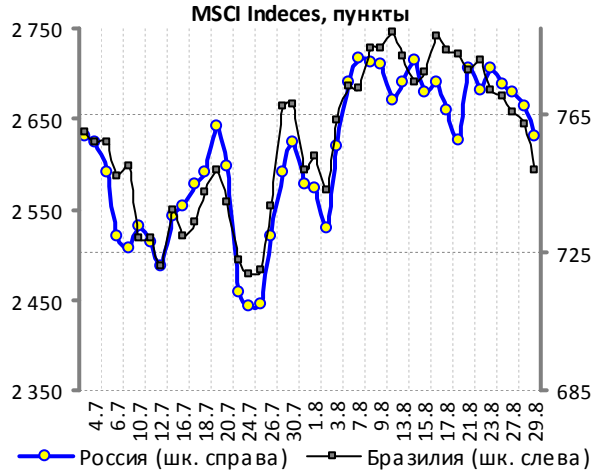
В Греции началась двухдневная забастовка муниципальных работников против сокращения персонала и зарплат. Профсоюз, защищающий интересы бортпроводников немецкой авиакомпании Lufthansa, также намерен начать бессрочную забастовку, требуя повышения зарплат бортового персонала на 5%. Каталония попросила у правительства помощь в размере 4 млрд. евро, премьер-министр страны поспешил успокоить инвесторов, сообщив, что сформирован специальный фонд в размере 18 млрд. евро, который позволит без обращения к ЕЦБ предоставить необходимые ресурсы. Поэтому негатив практически не отразился на аукционах по размещению госбумаг, наблюдался не только рост спроса, но и снижение доходности.

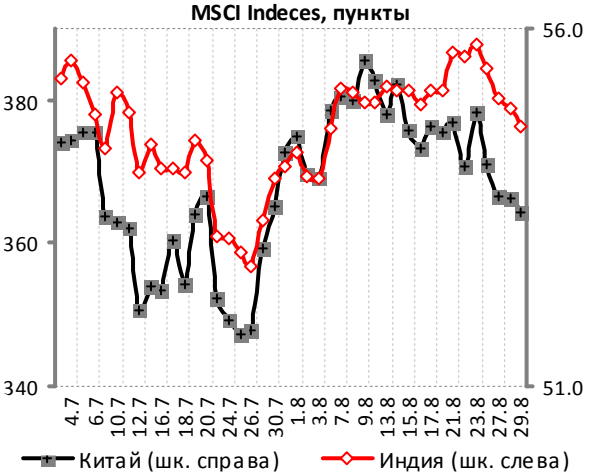
Азия. Последние торги закрылись разнонаправлено, Nikkei +0,40, SSE -0,96, Kospi +0,64, Hang Seng -0,12%. Рост котировок в Японии вызван хорошими результатами автокомпаний. Так, за месяц производство Toyota Motor внутри страны увеличилось на 30,1% (за рубежом на 27,5%), Nissan на 5,1%, Honda на 67,0% Suzuki на 0,1%, Mitsubishi на 0,8%. Производство Mazda сократилось на 1,8%. Отрицательное влияние на результаты сессии оказали полугодовые результаты сразу нескольких китайских компаний.

Золото. На текущие значения цен повлияла забастовка рабочих платиновой шахты Марикана в ЮАР и угроза распространения волнений среди рабочих. Ожидания новых мер со стороны центробанков, включая ФРС, также удерживает привлекательность драгметаллов, утром среды золото торговалось по 1669,49, к 14.00 по 1667,08, с утра сегодня, на укреплении доллара, цены немного снизились.

Нефть. Стало известно, что G7 намеревается призвать нефтедобывающие государства увеличить добычу нефти, чтобы понизить цены. 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 тропических штормов в США, эвакуированы все добывающие установки в Мексиканском заливе (а там находится 44% нефтеперерабатывающих мощностей США и 23% всей добываемой нефти). В среду, на укреплении доллара и ожиданиях информации по запасам нефти в США, цены консолидировались, а сегодня утром, на информации об их увеличении, наблюдается незначительное понижение.

Статистика, прогноз. Из наиболее важной статистики ждем по США данные по рынку труда и потребительским доходам и расходам (16.30). Фьючерсы на американские биржевые индексы сейчас торгуются в минусе, Азия тоже, цена нефти не растет, хотя и остается достаточно высокой, поддерживая российские биржи. При улучшении внешнего фона нефть может стать драйвером роста, но мировые биржи, скорее всего, будут ждать конференцию ФРС в Джексон Хоуле (начало завтра).

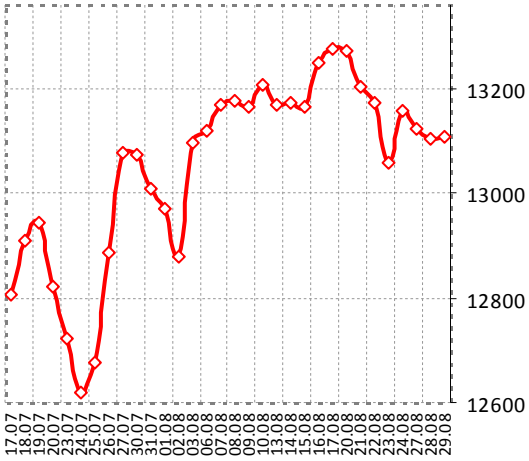




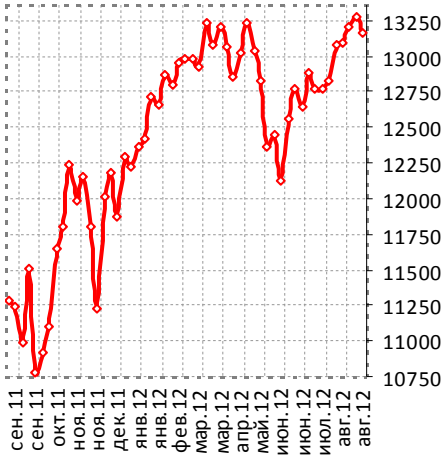
II. Фондовые рынки

2.1. Америка & Россия

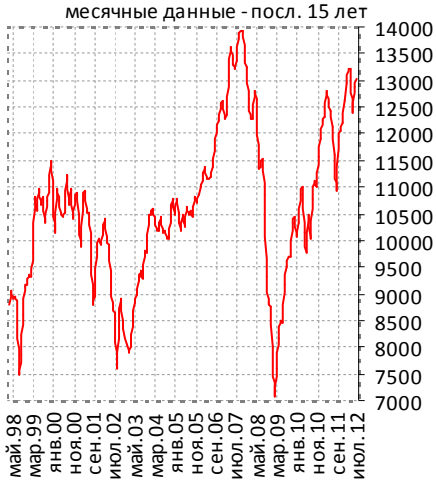
Dow Jones Industrial Average: ежедневные данные - последние шесть недель



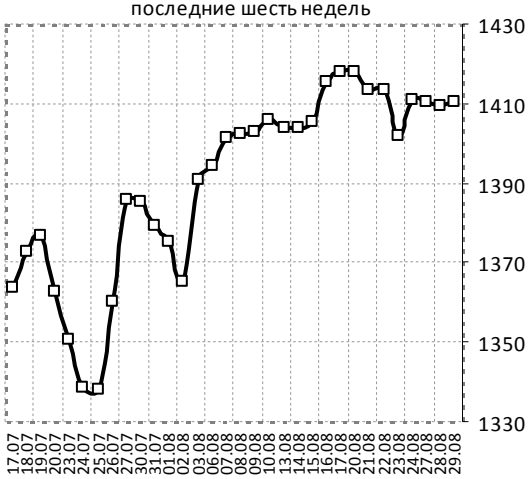
Dow Jones Industrial Average: недельные данные - последний год



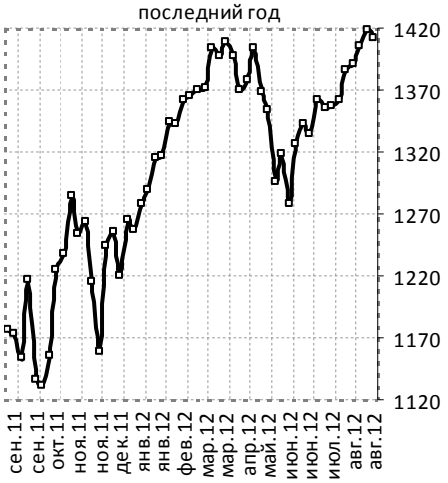
Dow Jones Industrial Average: месячные данные - посл. 15 лет



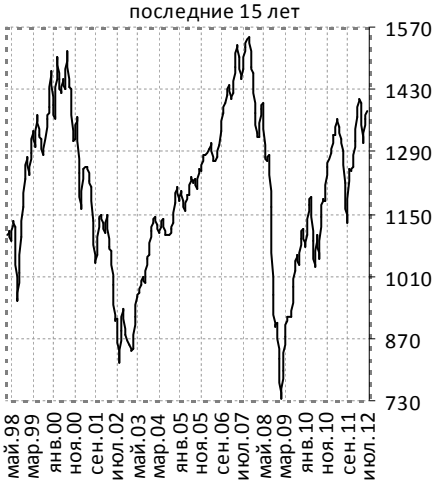
S&P 500 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



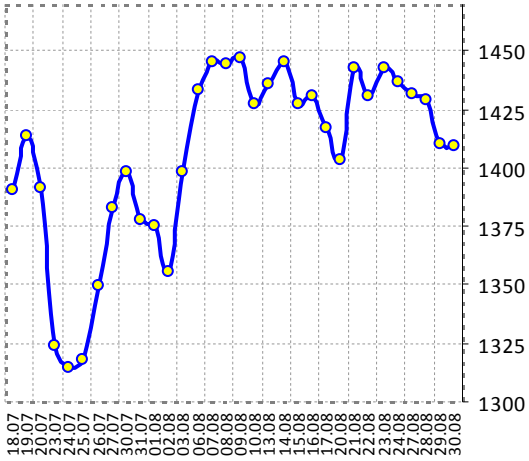
S&P 500 Index: недельные данные - последний год



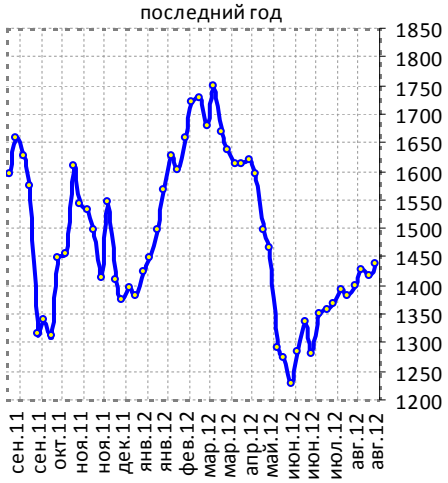
S&P 500 Index: месячные данные - последние 15 лет



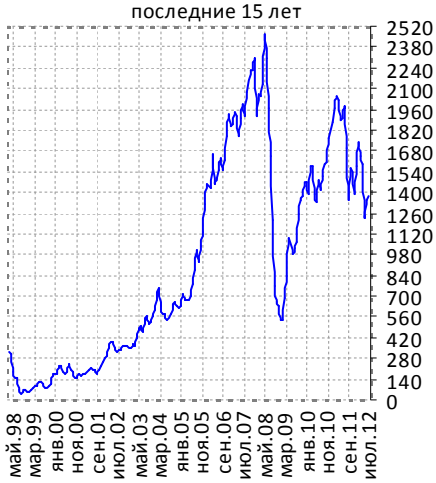
Индекс РТС: ежедневные данные - последние шесть недель



Индекс РТС: недельные данные - последний год



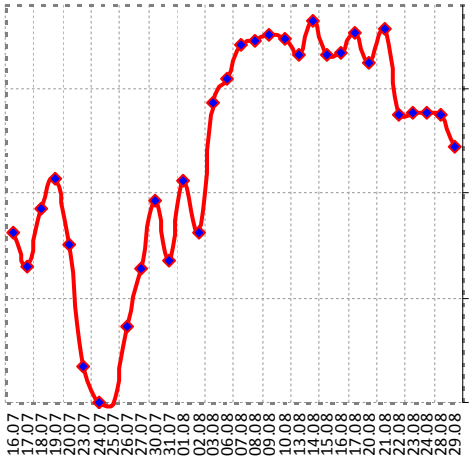
Индекс РТС: месячные данные - последние 15 лет



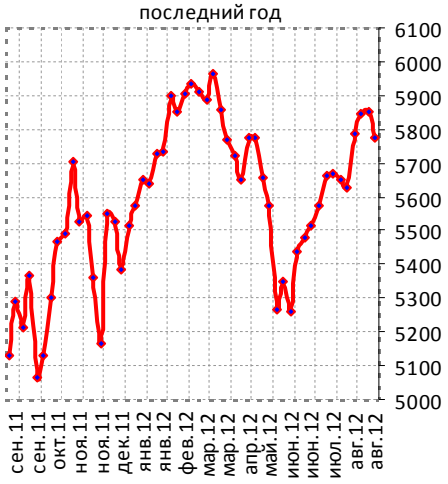
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.2. Европа

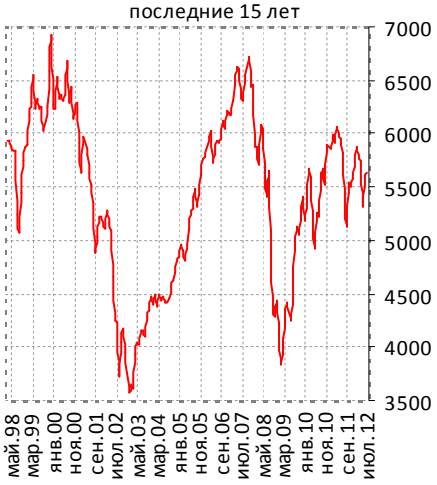
FTSE 100 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



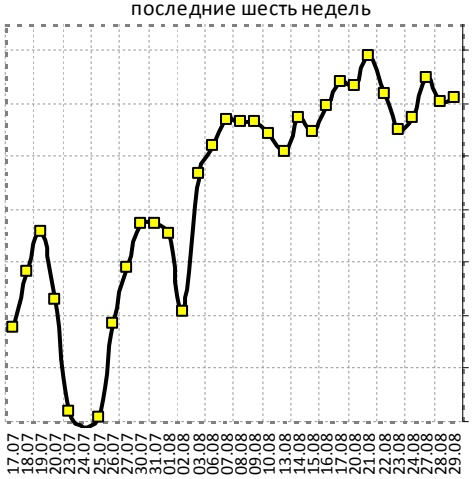
FTSE 100 Index: недельные данные - последний год



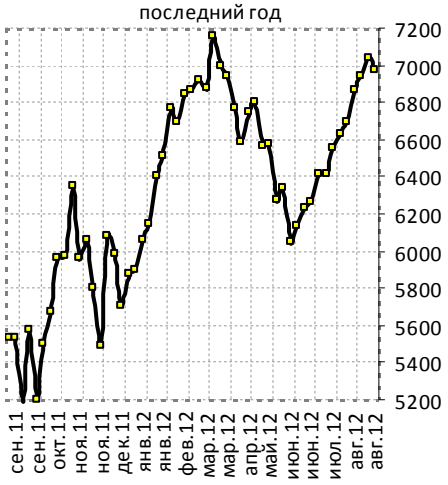
FTSE 100 Index: месячные данные - последние 15 лет



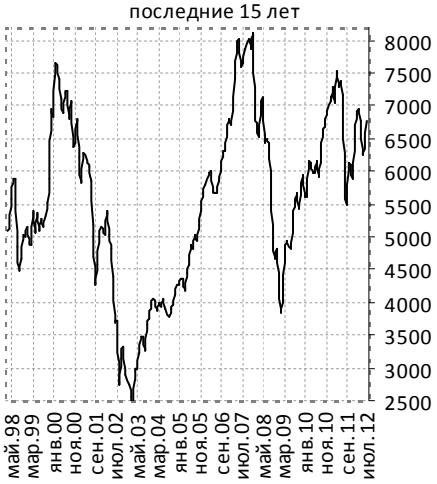
DAX Index: ежедневные данные - последние шесть недель



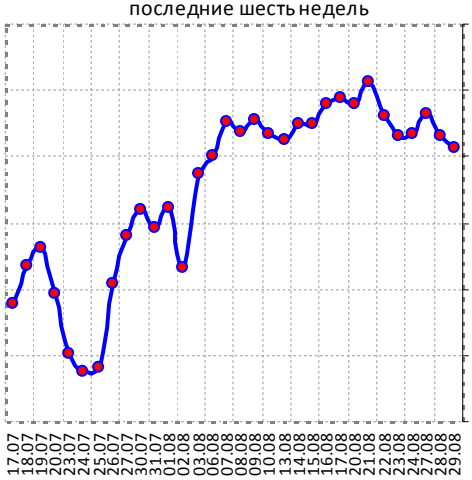
DAX Index: недельные данные - последний год



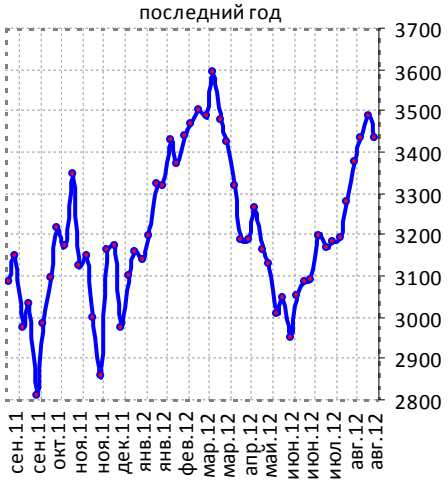
DAX Index: месячные данные - последние 15 лет



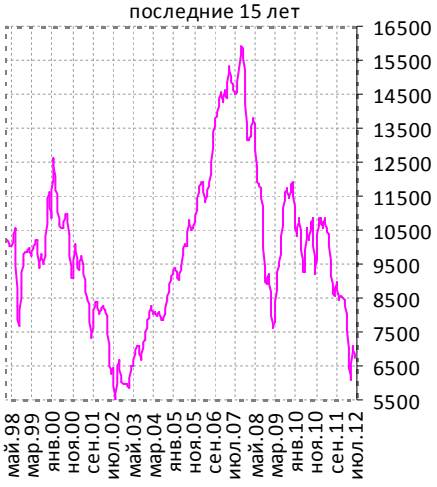
CAC 40 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



CAC 40 Index: недельные данные - последний год

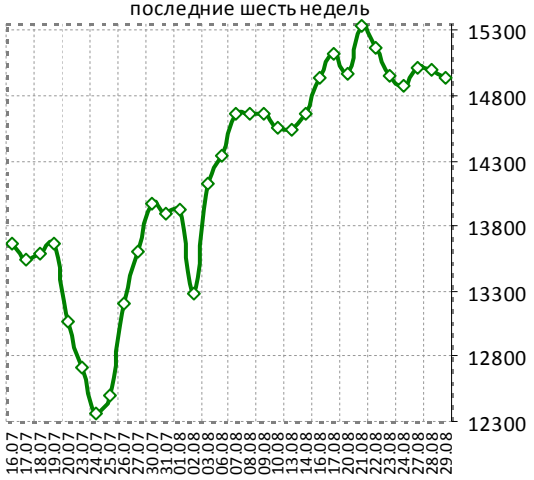


CAC 40 Index: месячные данные - последние 15 лет

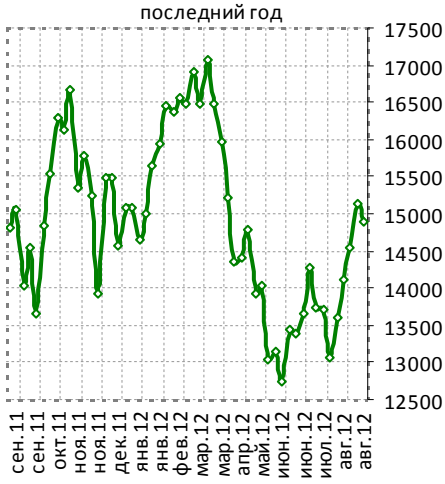


Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

MIB Index: ежедневные данные - последние шесть недель



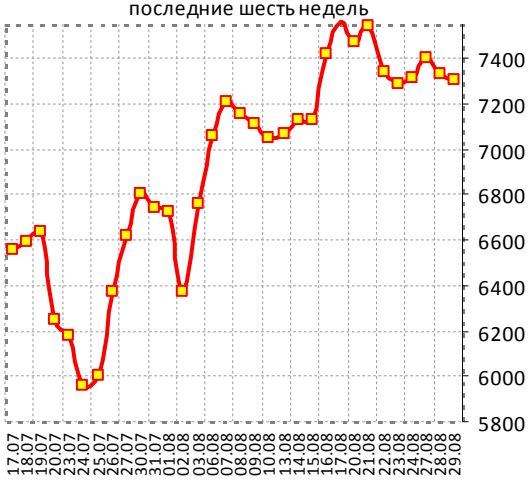
MIB Index: недельные данные - последний год



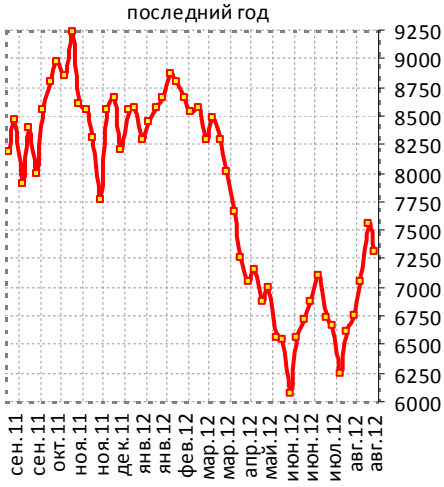
MIB Index: месячные данные - последние 15 лет



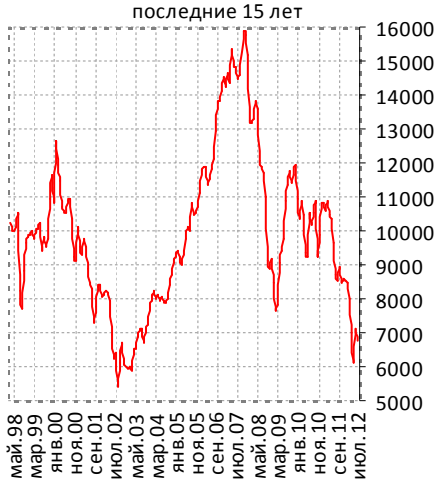
IBEX 35 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



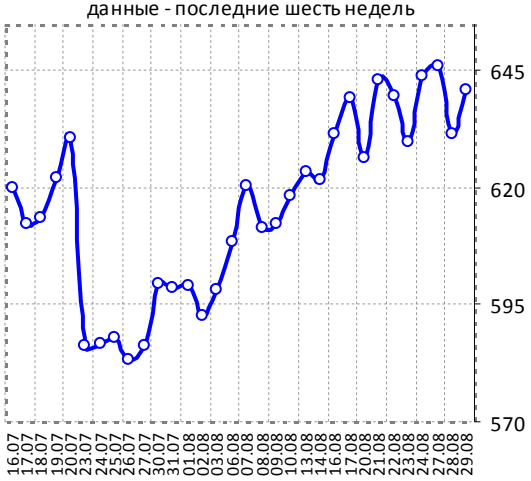
IBEX 35 Index: недельные данные - последний год



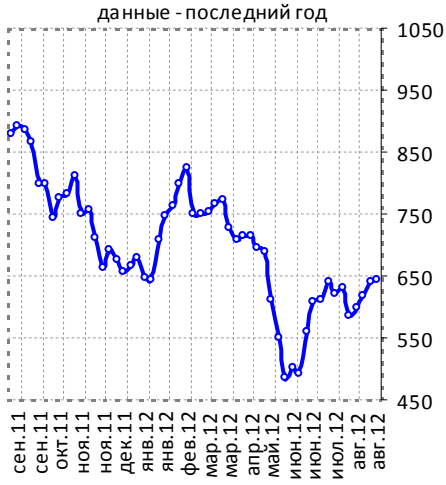
IBEX 35 Index: месячные данные - последние 15 лет



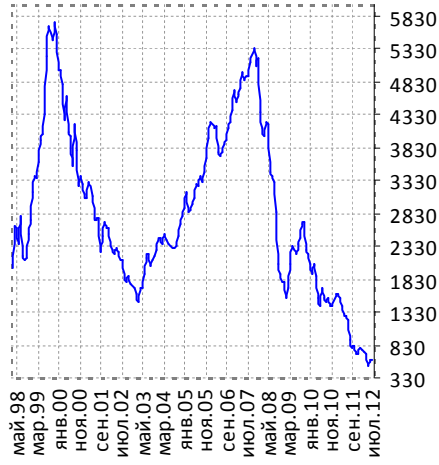
AthexComposite Index: ежедневные данные - последние шесть недель



AthexComposite Index: недельные данные - последний год



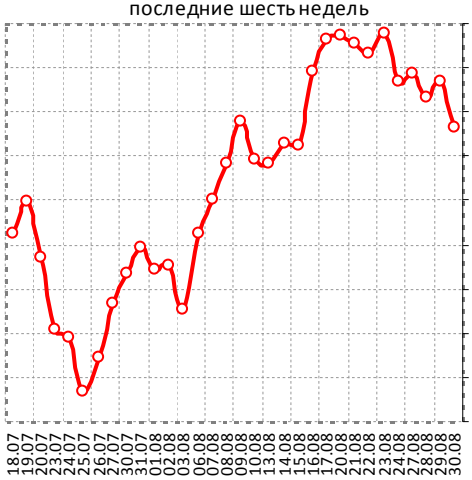
AthexComposite Index: месячные данные - последние 15 лет



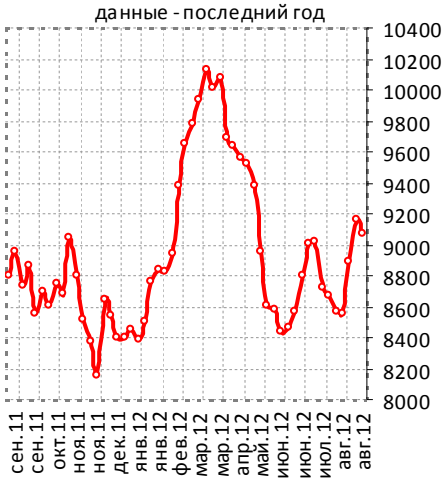
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.3. Азия

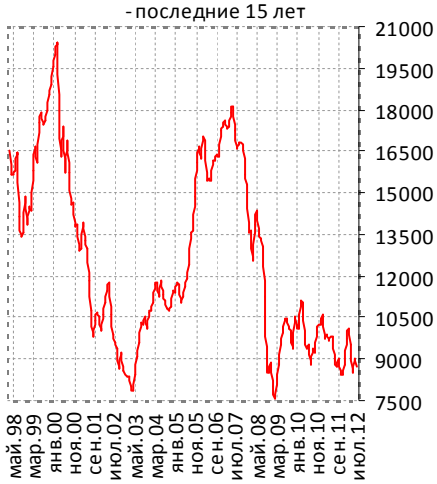
NIKKEI 225 Index: ежедневные данные - последние шесть недель



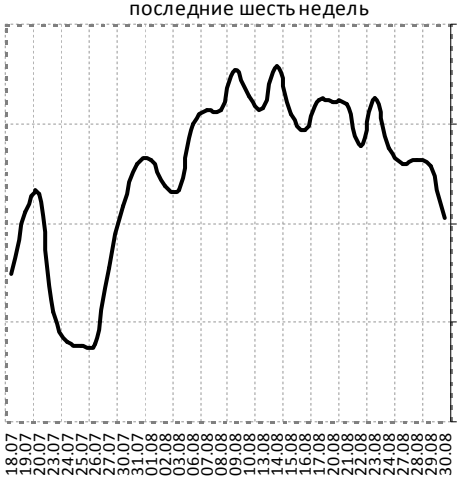
NIKKEI 225 Index: недельные данные - последний год



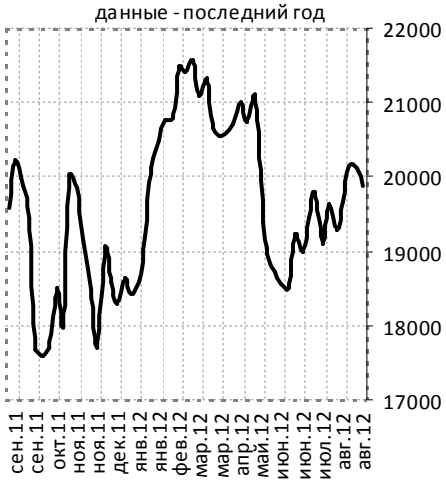
NIKKEI 225 Index: месячные данные - последние 15 лет



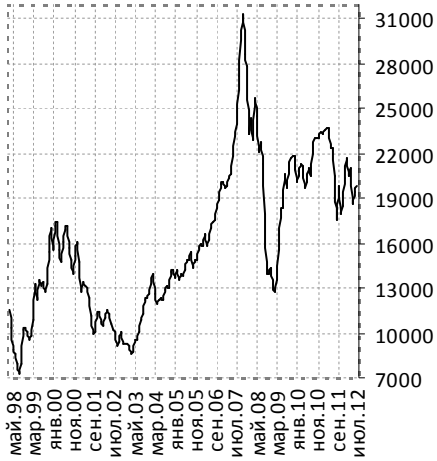
Hang Seng Index: ежедневные данные - последние шесть недель



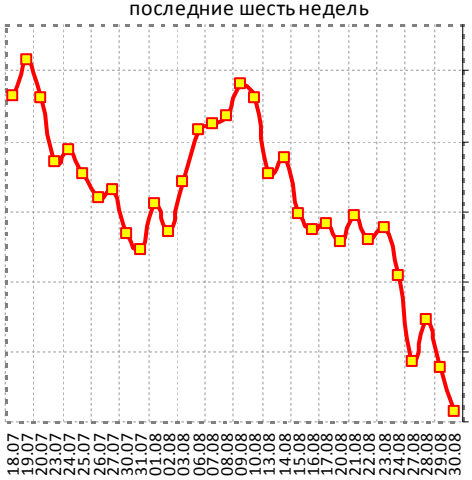
Hang Seng Index: недельные данные - последний год



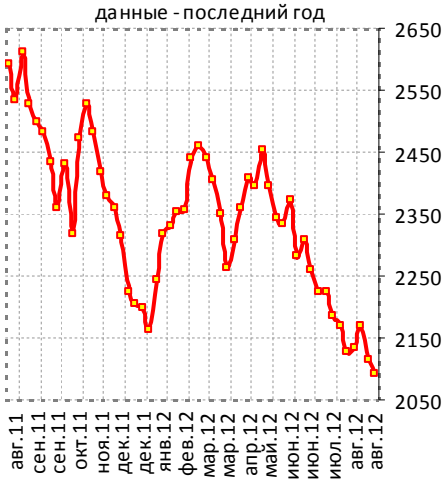
Hang Seng Index: месячные данные - последние 15 лет



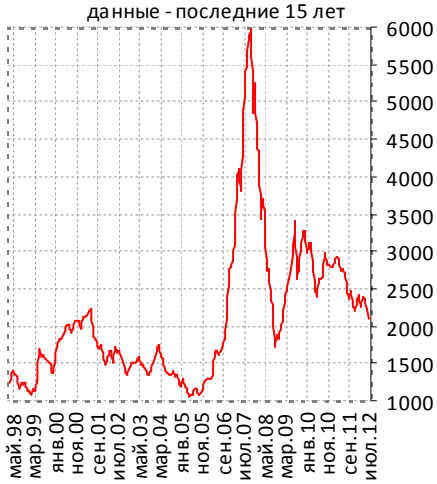
Shanghai Composite: ежедневные данные - последние шесть недель



Shanghai Composite: недельные данные - последний год



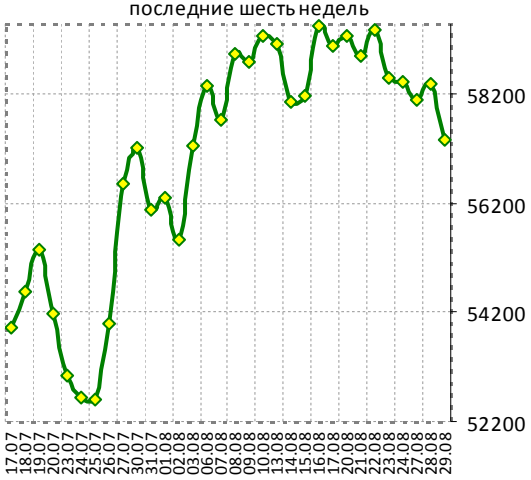
Shanghai Composite: месячные данные - последние 15 лет



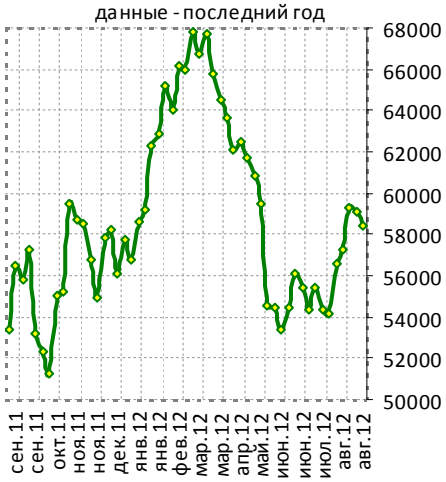
Источники данных: Bloomberg.
Расчеты: ИК «Еврофинансы».

2.4. Латинская Америка

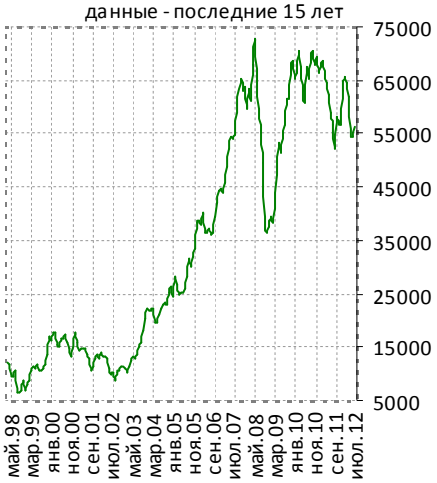
Brazil Bovespa Index: ежедневные данные - последние шесть недель



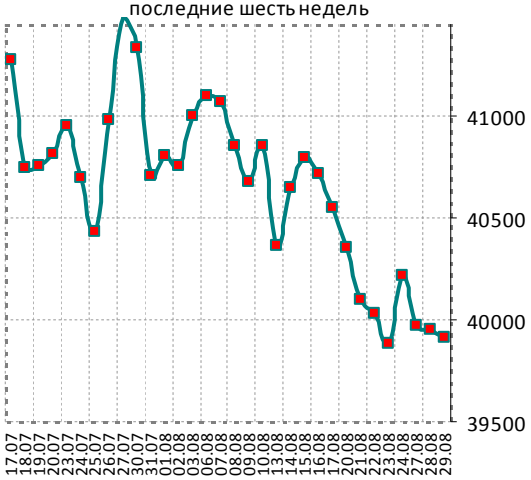
Brazil Bovespa Index: недельные данные - последний год



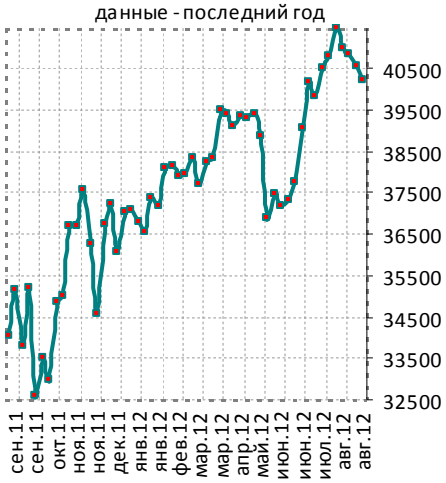
Brazil Bovespa Index: месячные данные - последние 15 лет



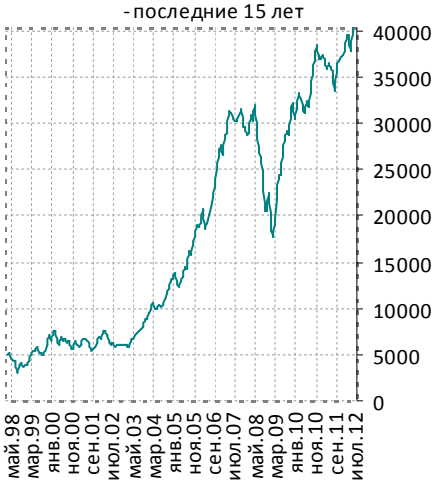
Mexico IPC Index: ежедневные данные - последние шесть недель



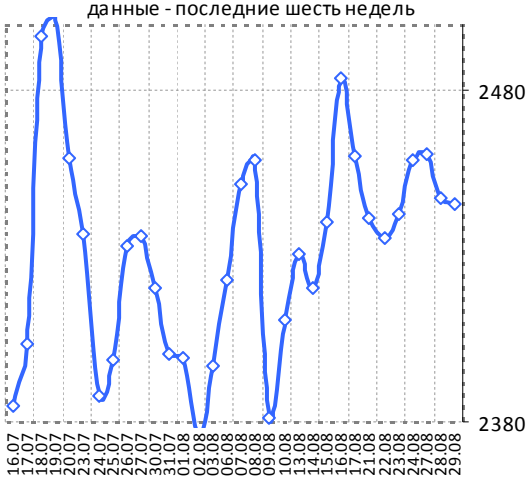
Mexico IPC Index: недельные данные - последний год



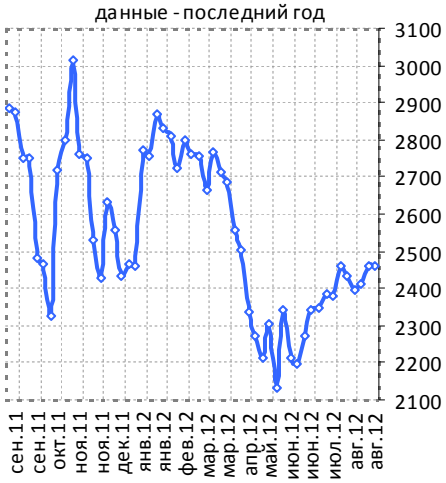
Mexico IPC Index: месячные данные - последние 15 лет



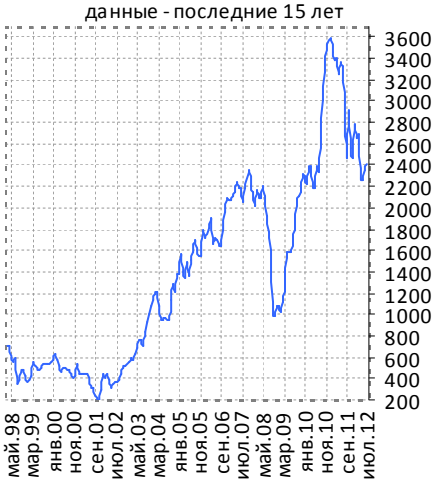
Argentina Merval Index: ежедневные данные - последние шесть недель



Argentina Merval Index: недельные данные - последний год



Argentina Merval Index: месячные данные - последние 15 лет



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

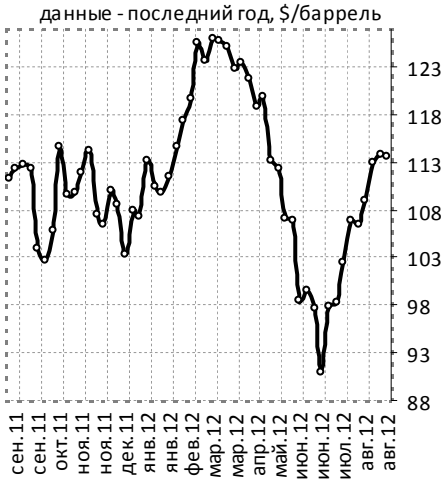
III. Сырьевые рынки

3.1. Динамика нефтяного рынка

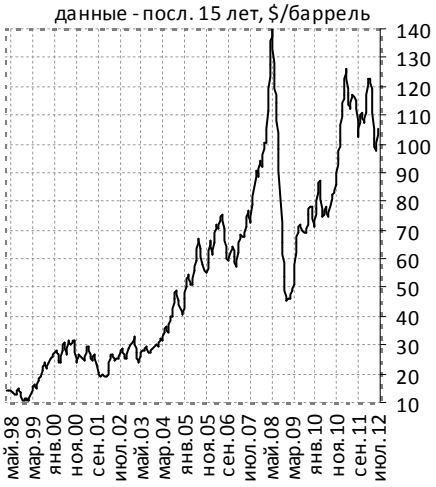
Нефть марки Brent: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



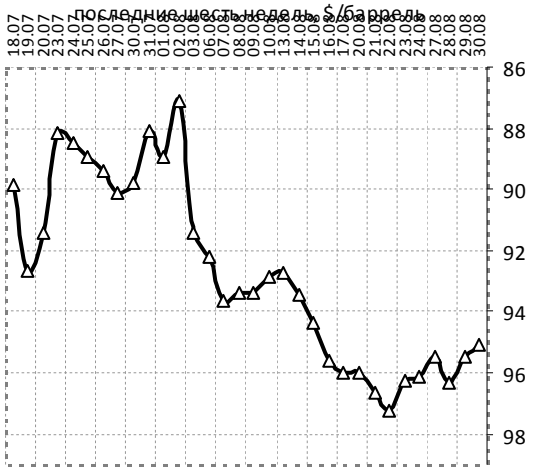
Нефть марки Brent: недельные данные - последний год, $/баррель



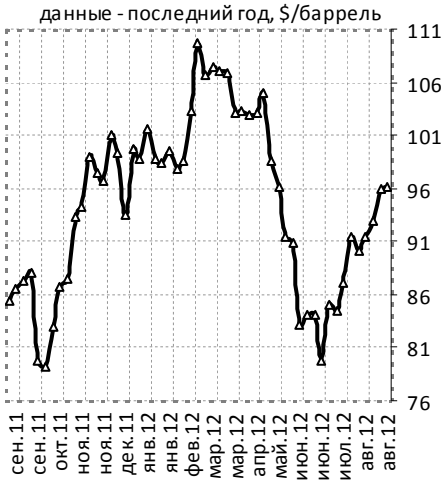
Нефть марки Brent: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



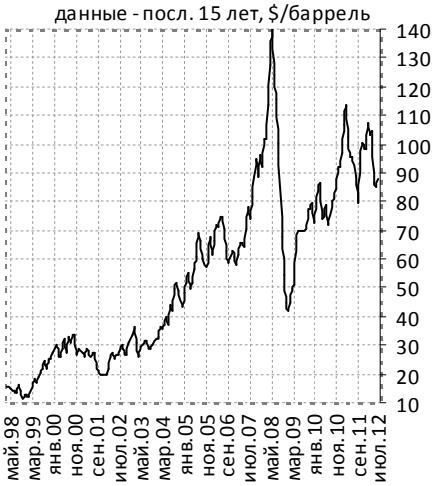
Нефть марки WTI: ежедневные данные - последние шесть недель, $/баррель



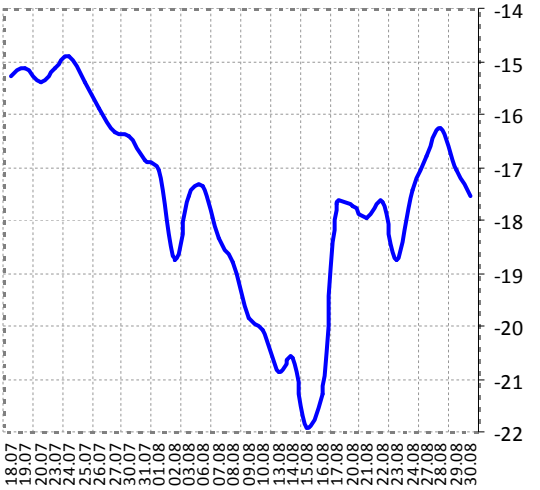
Нефть марки WTI: недельные данные - последний год, $/баррель



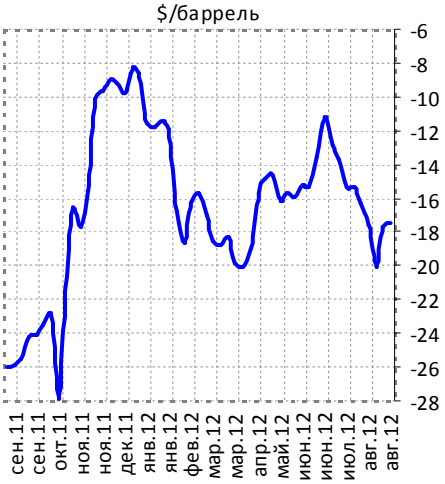
Нефть марки WTI: месячные данные - посл. 15 лет, $/баррель



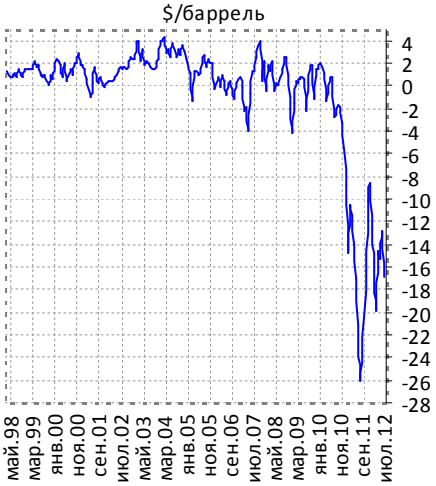
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



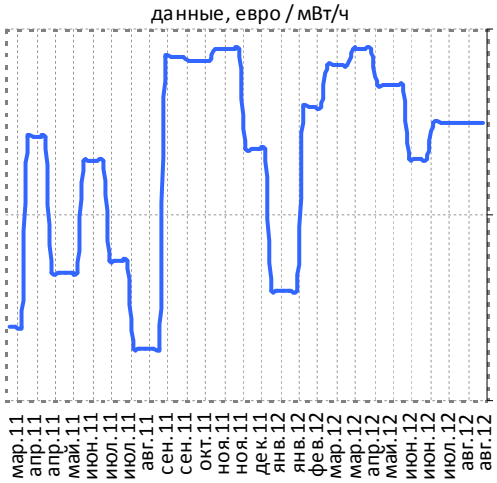
Трансконтинентальный спрэд, $/баррель



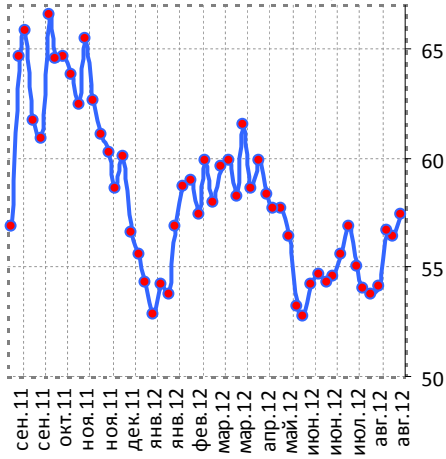
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.2. Цены на газ и бензин

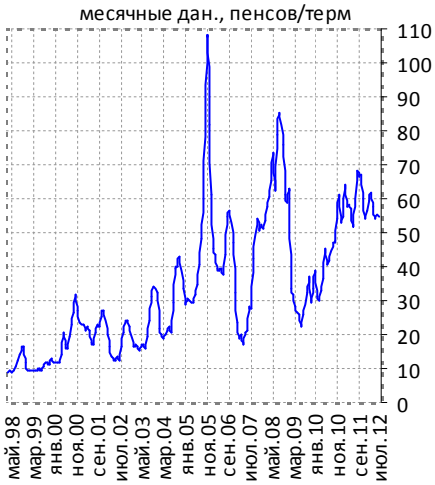
Природный газ - Европа: еженедельные данные, евро / мВт/ч



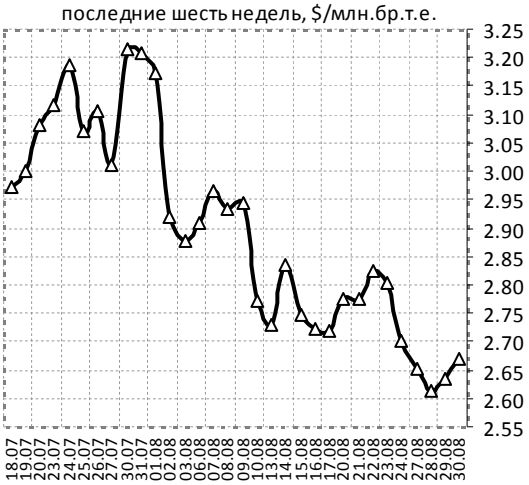
Природный газ - Великобритания: недельные дан., пенсов/терм



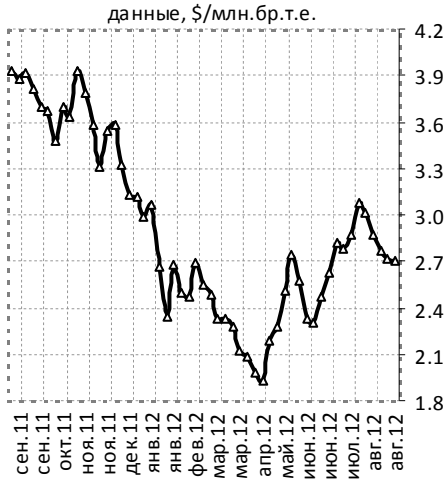
Природный газ - Великобритания: месячные дан., пенсов/терм



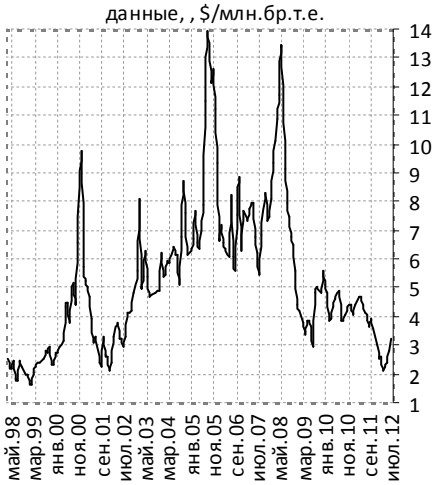
Природный газ США: ежедневные данные - последние шесть недель, $/млн.бр.т.е.



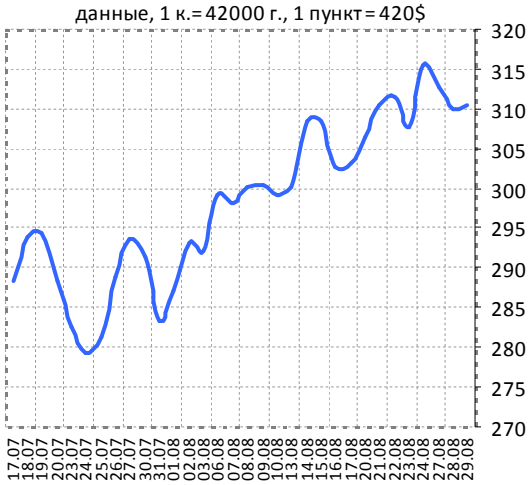
Природный газ США: недельные данные, $/млн.бр.т.е.



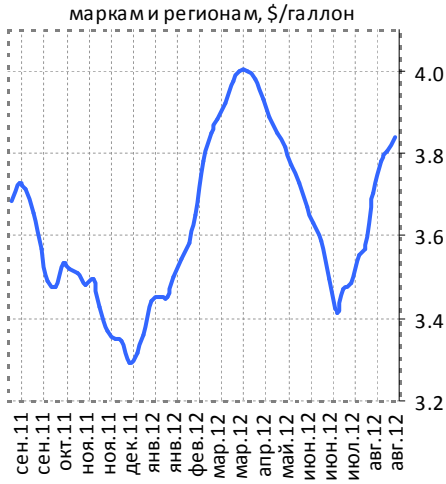
Природный газ США: месячные данные, , $/млн.бр.т.е.



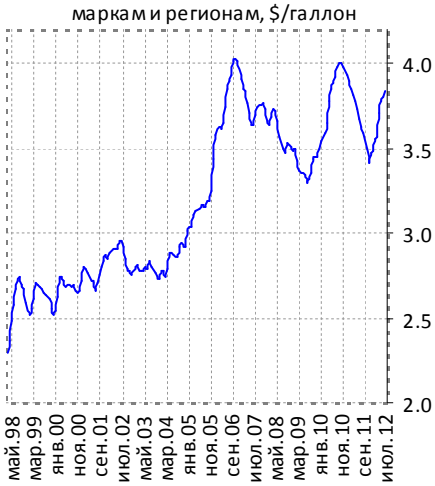
Фьючерс на бензин США: ежедневные данные, 1 к.= 42000 г., 1 пункт = 420$



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



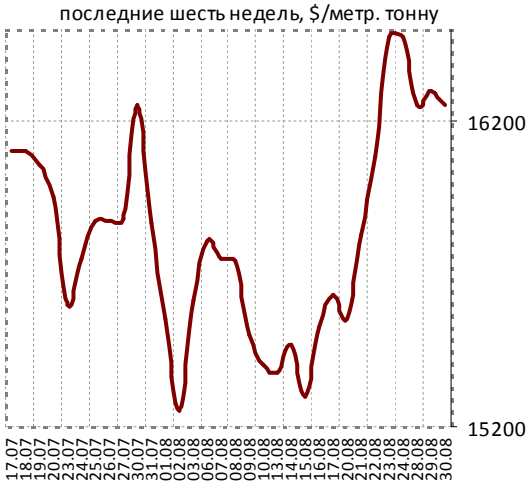
Цена на бензин в США: средняя по маркам и регионам, $/галлон



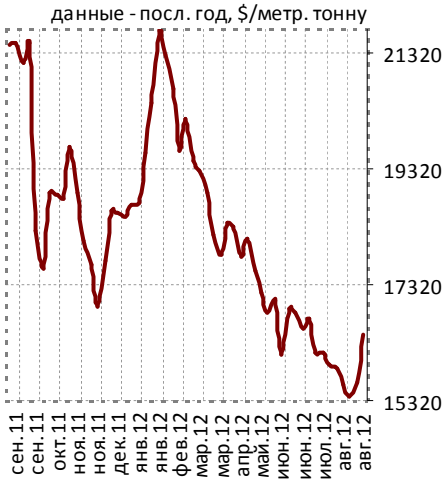
Источники данных: Bloomberg (ICE, NYMEX, DOE).
Расчеты: ИК «Еврофинансы»

3.3. Рынок металлов

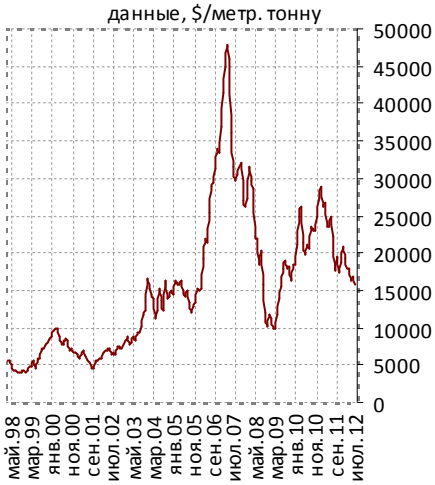
Фьючерс на никель: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



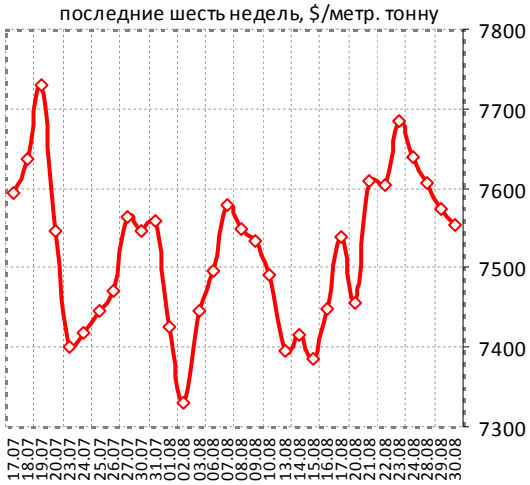
Фьючерс на никель: недельные данные - посл. год, $/метр. тонну



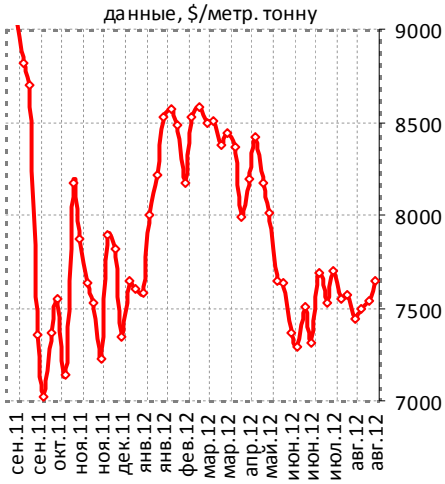
Фьючерс на никель: месячные данные, $/метр. тонну



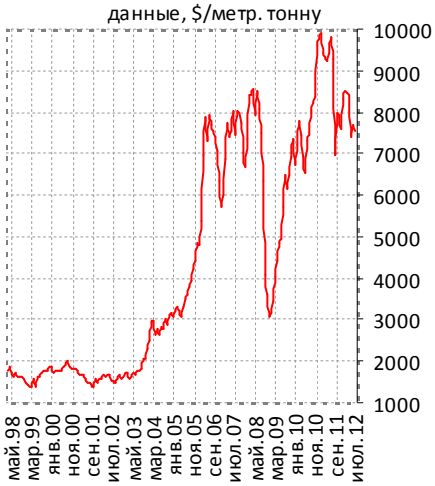
Фьючерс на медь: ежедневные данные - последние шесть недель, $/метр. тонну



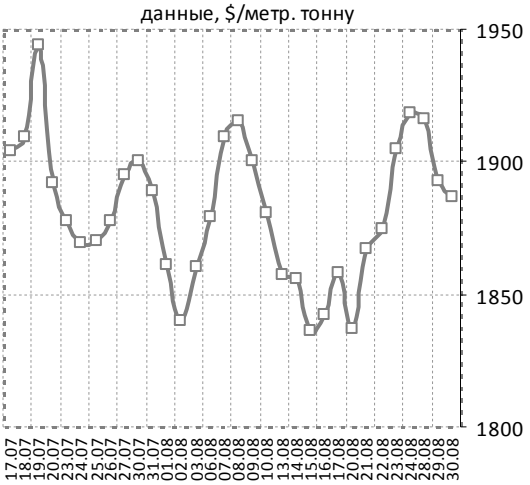
Фьючерс на медь: недельные данные, $/метр. тонну



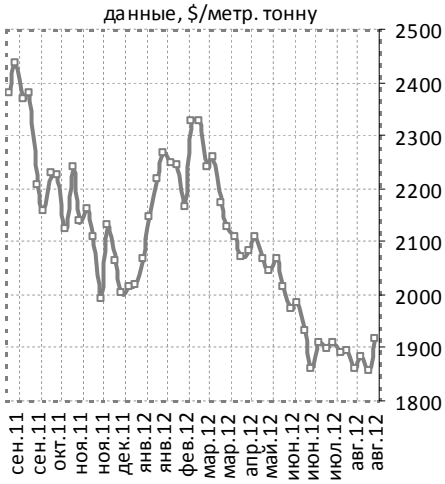
Фьючерс на медь: месячные данные, $/метр. тонну



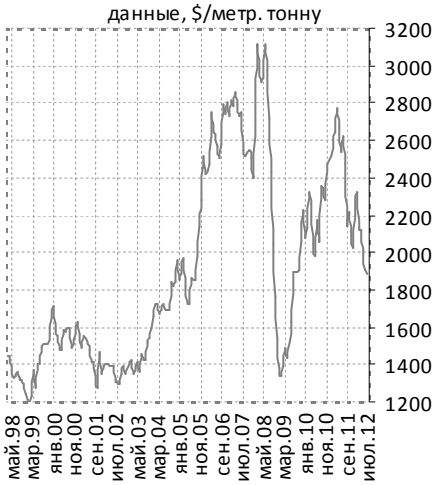
Фьючерс на алюминий: ежедневные данные, $/метр. тонну



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.