DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Количество впервые обратившихся за пособием по безработице в США составило лишь 255 тыс. чел, что являет минимальным значением за последние 10 лет. Снижение количества безработных говорит о плавном восстановлении американского рынка труда и повышает вероятность ужесточения денежно-кредитной политики в США на сентябрьском заседании ФРС.
- По данным EPFR, совокупный отток денежных средств из фондов, ориентированных на инвестиции в акции российских эмитентов, составил $26 млн. долл.
- Цены на нефть опустились до минимальных значений с января текущего года на опасениях торможения экономики Китая. Согласно предварительным данном от HSBC, индекс деловой активности PMI в производственной сфере снизился до 48,2 пунктов.

Обзор макроэкономических событий

- Количество впервые обратившихся за пособием по безработице составило лишь 255 тыс. человек, оказавшись значительно меньше ожиданий рынка. Число повторно обратившихся за пособием также оказалось лучше ожиданий рынка, приблизившись к минимальным значениям за последние 10 лет. Публикация статистики по количеству обратившихся за пособием по безработице в США привела к росту ожидания повышения ставок на сентябрьском заседании ФРС. На текущий момент более 56% опрошенных аналитиков Bloomberg ожидает повышения ставки на 0,25% уже на следующем заседании Комитета по операциям на открытом рынке США. Даже если регулятор не повысит ставки, глава ФРС может прибегнуть к словесным интервенциям, в которых может отметить, что рынок труда начал вновь восстанавливаться, и это создает предпосылки для повышения ставок.

Обзор макроэкономических событий

- Сегодня HSBC опубликовало предварительные расчеты индекса деловой активности PMI в производственной сфере Китая за июль, который снизился до минимальных значений за последний год и составил 48,2 пунктов. Консенсус-прогноз аналитиков Bloomberg ожидал роста индекса деловой активности с 49,4 до 49,7 пункта. Напомним, что снижение индекса ниже отметки 50 пунктов, говорит о преобладании негативных ожиданий менеджеров по закупкам в производственной сфере. Опубликованные данные усилили опасения торможения экономики Китая, что стало основной причиной снижения азиатских фондовых индексов в пятницу. По итогам дня индекс Shanghai composite снизился на 1,3%, за неделю китайский индекс вырос на 3,3%. Слабые данные от HSBC привели к падению цен на нефть и промышленные металлы в первую половину пятницы.
- Восьмую неделю подряд наблюдается отток средств из фондов, ориентированных на инвестиции в акции РФ. По данным EPFR, с 16 по 22 июля отток составил $26 млн., замедлившись с $35 млн на предыдущей неделе. Отток средств продолжает коррелировать с ценами на энергоносители. С начала лета стоимость нефти марки Brent снизилась на 18%.

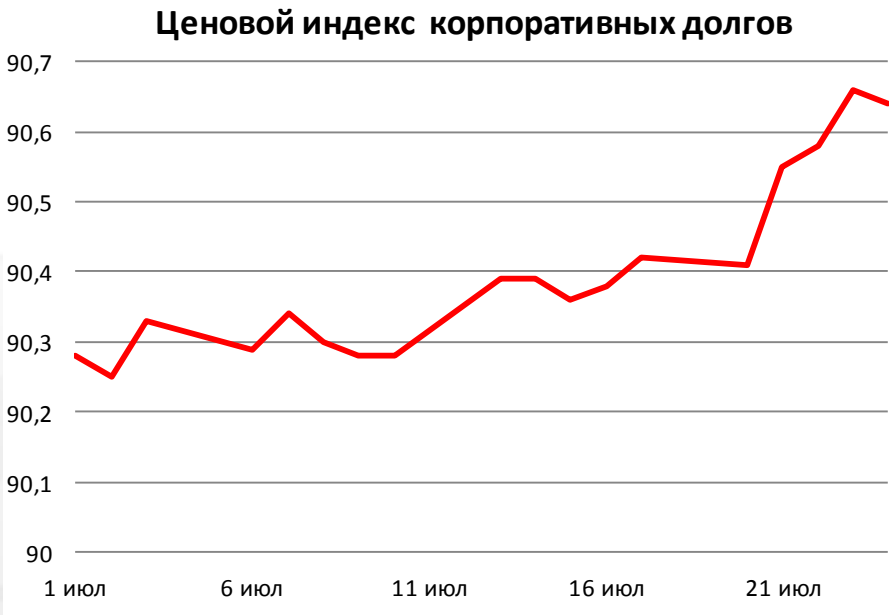
Ожидаемая статистика

Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
24.07.2015	10:00	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Франция	июль	50,8	50,7
	10:00	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Франция	июль	53,8	54,1
	10:00	Составной индекс PMI	Франция	июль	53,3	53,3
	10:30	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Германия	июль	51,9	51,9
	10:30	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Германия	июль	54	53,8
	10:30	Составной индекс PMI	Германия	июль	53,9	53,7
	11:00	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Еврозона	июль	52,5	52,5
	11:00	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Еврозона	июль	54,2	54,4
	11:00	Составной индекс PMI	Еврозона	июль	54	54,2
	17:00	Продажи на первич. рынке жилья	США	июнь	546K	546K
	17:00	Продажи на первич. рынке жилья (м/м)	США	июнь	-0.1%	2.2%
27.07.2015	11:00	Индекс делового климата от IFO	Германия	июль	--	107,4
	11:00	Индикатор текущей деловой активности от IFO	Германия	июль	--	113,1
	11:00	Индикатор ожиданий от IFO	Германия	июль	--	102
	15:30	Заказы на товары длит. пользования	США	июнь	2.7%	-1.8%
	15:30	Товары длит. пользования, без транспорта	США	июнь	0.6%	0.5%
	17:30	Инд. произв. активности ФРБ Далласа	США	июль	-4	-7
	19:00	Общее число безработных	Франция	июнь	--	3552.2k

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Доходности рублевых и долларовых гособлигаций продолжают расти на фоне падения цен на нефть и укрепления курса рубля относительно доллара. Доходность долларовых облигаций Rus-30 выросла до 3,7%, обновив максимумы за последний месяц. ОФЗ серии 26212 также дешевеют из-за негативного внешнего фона. Ослабление рубля в дальнейшем может привести к ускорению инфляции. Это сузит пространство для маневров ЦБ РФ при дальнейшем снижении ключевой ставки.

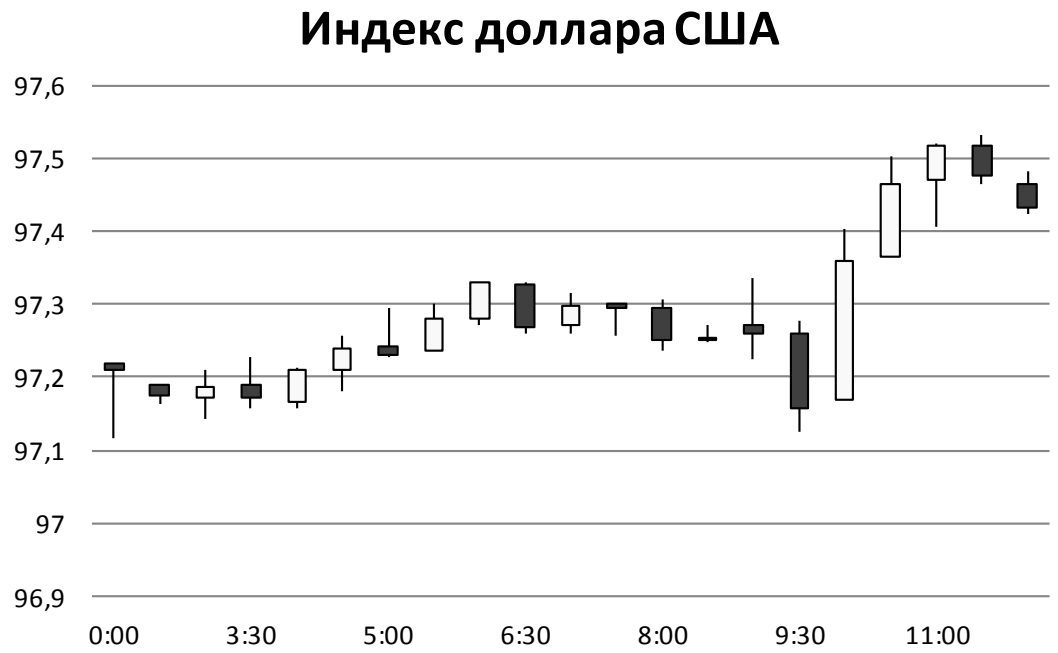




Источник: Bloomberg

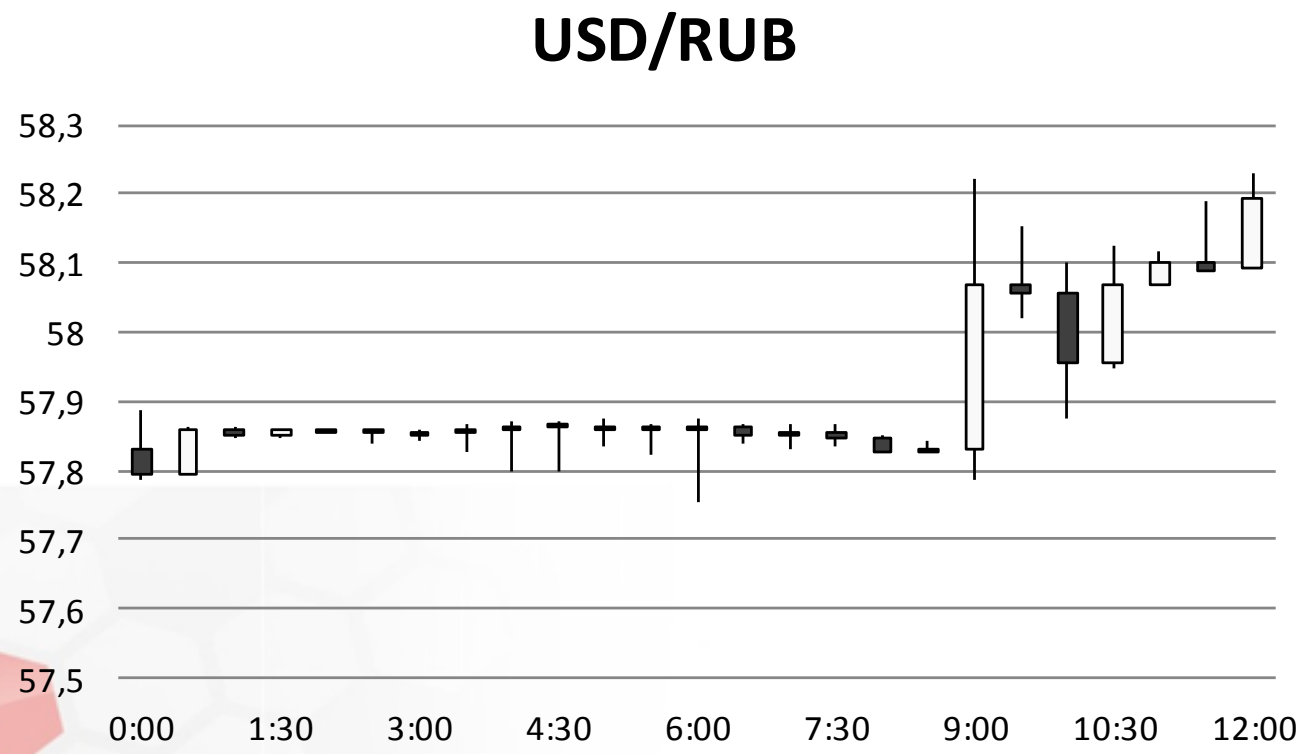
Валютный рынок

В начале валютных торгов на ММВБ курс рубля к доллару опустился на минимальные значения с начала апреля, преодолев отметку 58 руб/долл. Курс рубля следует за ценами на нефть, которые сегодня дешевеют на ожиданиях падения спроса со стороны Китая и повышения ставок в США. Долларовая корзина валют DXY выросла за минувшие сутки на 0,4% до 97,4 пунктов, отыгрывая публикацию сильных данных по рынку труда в США. На наш взгляд, публикация позитивной статистики по рынку недвижимости США сегодня во второй половине дня может оказать поддержку курсу американского доллара.



Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

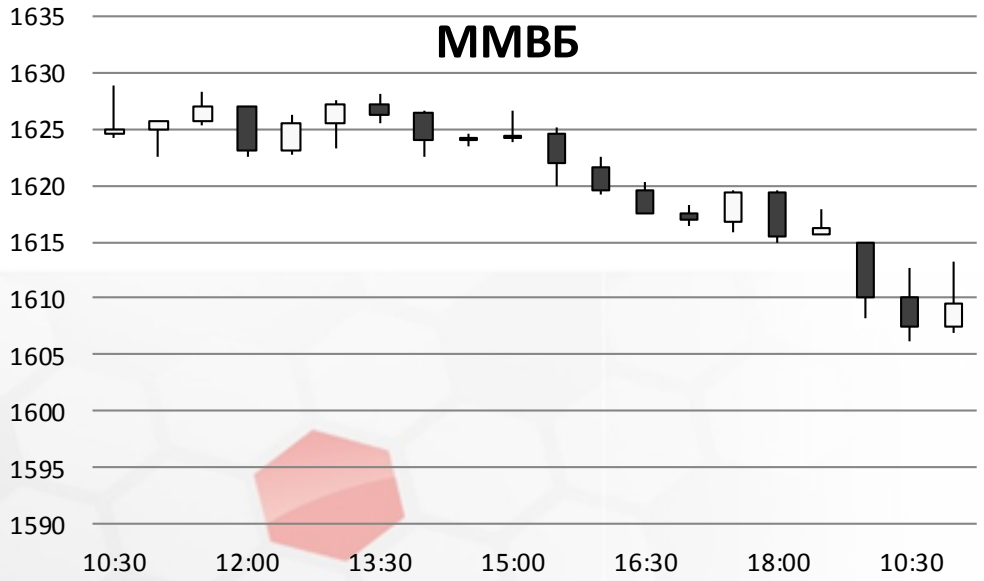
Валютный рынок

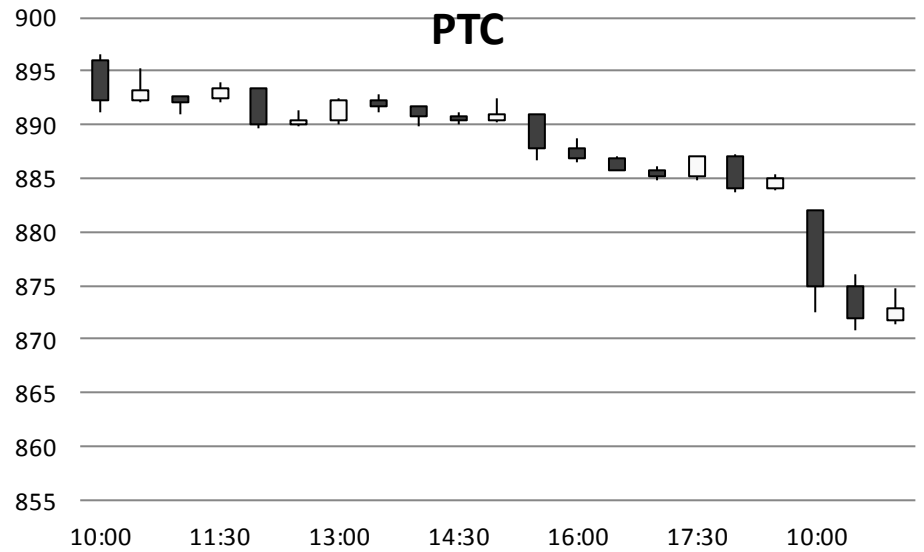


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

Снижение цен на промышленные металлы и нефть продолжает негативно сказываться на акциях российских сырьевых компаний. Индекс ММВБ теряет 0,5%, приблизившись к отметке 1608 пунктов. Индекс РТС теряет 1,6%, двигаясь вслед за курсом рубля относительно доллара.





Источник: ММВБ, Bloomberg

Фондовый рынок



Источник: ММВБ, Bloomberg

Максим Гесин
maksims.gesins@dukascopy.com

Ярослав Смирнов
jaroslavs.smirnovs@dukascopy.com

Евгения Григорчук
yevgeniya.grygorchuk@dukascopy.com

Наша аналитика:
Технический анализ
Короткие новости
Торговые идеи по фигурам
Квартальный отчёт
Прогнозы сообщества

Полезные ссылки:
FXSpider онлайн новости
ТВ
Вебинары
Графики
Индекс валют
CoT отчёты
Пивот уровни
Сентимент рынка
Экономический календарь
Сигналы

Оговорка
Вся информация в этой статье, включая мнения, показатели и графики, предоставлена только в целях ознакомления, и не может быть интерпретирована как финансовый совет. Dukascopy не несет ответственности за полноту или правильность любой информации, содержащейся в этой статье. Финансовые показатели, указанные в этой статье не были проверены компанией Dukascopy. Взгляды, мнения и анализы принадлежат авторам статьи, и не были согласованны с Dukascopy.

Dukascopy отказывается от любых гарантий, выраженных или подразумевающихся, но, не ограничиваясь этим, касательно пригодности для торговли или пригодности для определенной цели, в отношении всей информации в этой статье. Dukascopy не при каких обстоятельствах не несет ответственность за любые прямые, непрямые, косвенные, зависящие, непредвиденные, или любые другие убытки, понесенные в связи с использованием этой статьи.