DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Цены на нефть марки Brent в понедельник опустились до новых локальных минимумов на фоне публикации слабых данных в Китае и росте числа буровых установок в США за минувшую неделю.
- Несмотря на сокращение экспорта и импорта в Китае больше ожиданий рынка в июле, торговую сессию в понедельник индексы завершили резким ростом на новостях о создании государственного фонда, который может оказать поддержку рынку акций.
- Курс американского доллара скорректировался вниз после резкого роста в пятницу на фоне публикации сильных данных по рынку труда.

Обзор макроэкономических событий

- Китайский индекс Shanghai composite завершил торговую сессию в понедельник ростом практически на 5% на фоне появления новостей о создании государственного фонда, который будет специализироваться на выкупе акций государственных китайских компаний. Эта новость повысила ожидания притока новой ликвидности на китайский рынок акций, что поддержит падающие котировки бумаг. Опубликованная слабая статистика по торговому балансу в выходные, не оказала значимого влияния на настроения азиатских инверторов. Экспорт снизился на 8,3% г/г в июле, а импорт сократился на 8,1% г/г. Торговых баланс снизился до $43 млрд., что оказалось на 20% меньше ожиданий рынка. Также в июле ускорилась инфляция, которая составила 1,6% г/г. На наш взгляд, текущий рост индексов носит краткосрочный характер, так как в дальнейшем инвесторы будут отыгрывать опасения торможения экономики Китая.
- На фоне публикации слабой макроэкономической статистики в Китае и роста количества действующих буровых установок в США цены на нефть марки Brent снизились до минимальных значений с конца января, опустившись ниже отметки $49 за баррель. Согласно данным Baker Huges, число буровых нефтяных установок в США вторую неделю подряд увеличилось с 664 до 670 шт. Росло количество как горизонтальных сланцевых установок (+8 шт), так и традиционных вертикальных (+3 шт). Вслед за ценами на нефть новую торговую неделю европейские индексы акций начали со снижения на фоне падения котировок акций нефтегазовых компаний: BP (-1,3%), Royal Dutch Shell (-1,6%).

Ожидаемая статистика

Дата	Время	Событие	Страна	Период	Обз(Мд)	Пред.
10.08.2015	11:30	Инд. доверия инвесторов от Sentix	Еврозона	август	--	18,5
	17:00	Изменение индекса условий на рынке труда	США	июль	--	0,8
11.08.2015	9:00	Заказы станков (г/г)	Япония	июль	--	6.6%
	12:00	Опрос текущей ситуации от ZEW	Германия	август	--	63,9
	12:00	Опрос ZEW (ожидания)	Германия	август	--	29,7
	12:00	Опрос ZEW (ожидания)	Еврозона	август	--	42,7
	13:00	NFIB Оптимизм мал. предприним.	США	июль	--	94,1
	15:30	Производительность в несельскохоз. секторе	США	2К15	1.1%	-3.1%
	15:30	Затраты на рабочую силу	США	2К15	-0.2%	6.7%
	17:00	Оптовые запасы (м/м)	США	июнь	0.1%	0.8%
	17:00	Оптовая торговля - Продажи (г/г)	США	июнь	--	0.3%
12.08.2015	7:30	Промышл. производство (м/м)	Япония	июль	--	0.8%
	8:30	Розничные продажи (г/г)	Китай	июль	10,60%	10,60%
	8:30	Пром. производство (г/г)	Китай	июль	6,60%	6,80%
	11:30	Уровень заявок на пособие по безработице	Великобритания	июль	2.3%	2.3%
	11:30	Изм. числа безработных	Великобритания	июль	1.0K	7.0K
	12:00	Промышл. производство (м/м)	Еврозона	июнь	-0.1%	-0.4%
	12:00	Промышл. производство (г/г)	Еврозона	июнь	1.7%	1.6%
	14:00	Заявки на ипотеку от MBA	США	неделя	--	4.7%
	16:00	ИПЦ (нд/нд)	Россия	неделя	--	0.0%
	16:00	ИПЦ, еженед. (с н.г.)	Россия	неделя	--	9.4%

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Доходности рублёвых ОФЗ с погашением в 2028 году растут до 10,9% на фоне падения цен на нефть и ослабления курса рубля относительно доллара. Цены на долларовые Rus-30 не изменились с конца прошлой торговой недели. Стоимость страховки на российские 5-ти летние облигации растёт до 363 б.п. из-за внешнего негативного фона.

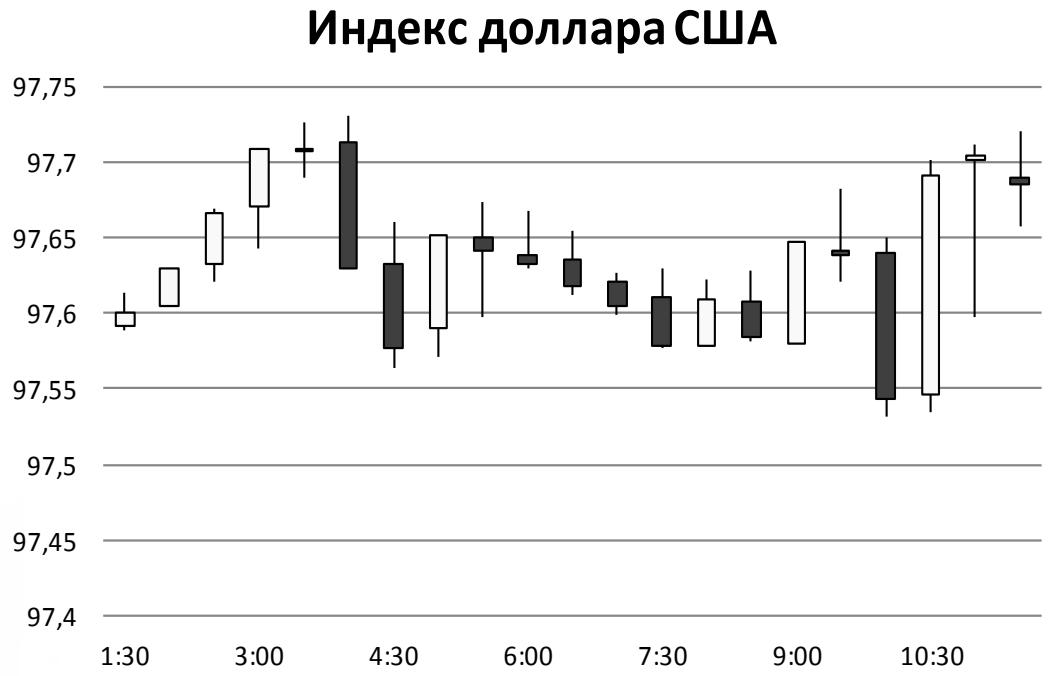




Источник: Bloomberg

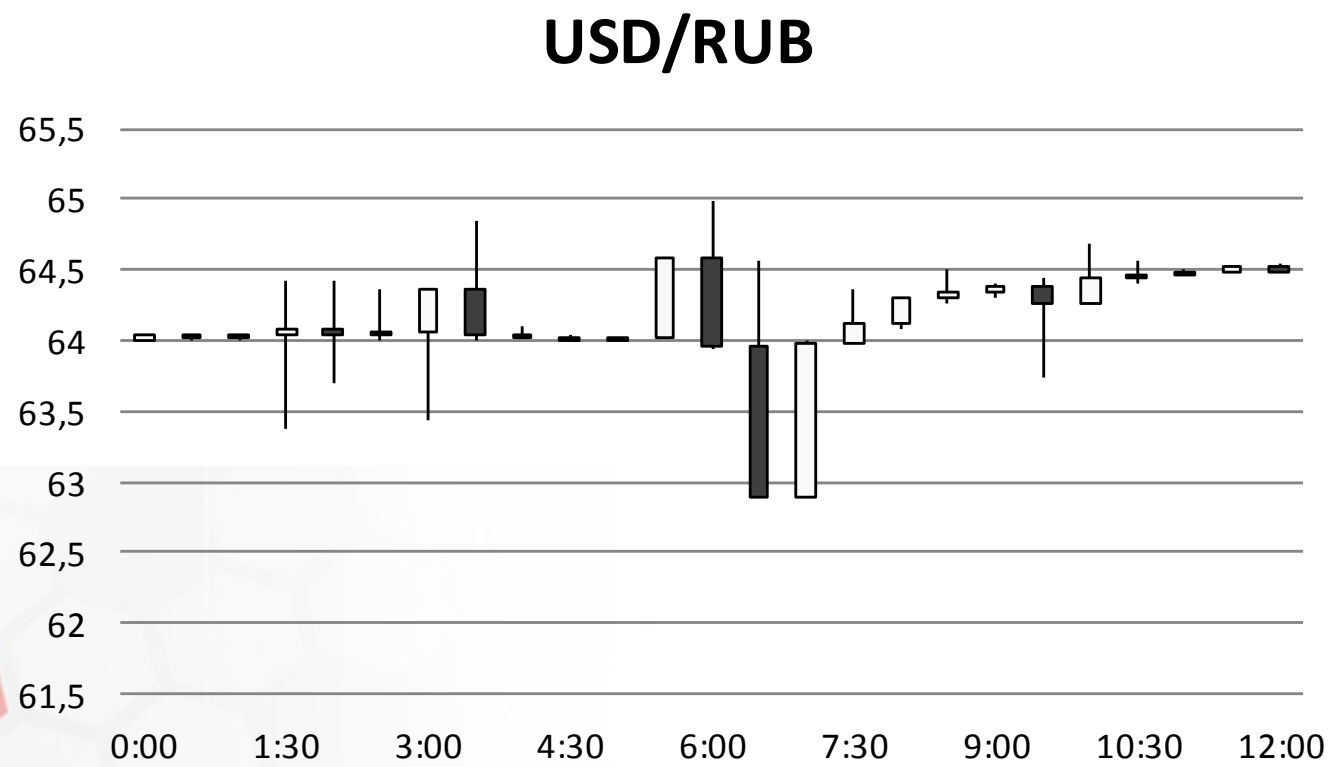
Валютный рынок

После публикации сильных данных по американскому рынку труда курс американского доллара рос относительно корзины валют выше отметки 98 пунктов. Согласно официальной статистике, прирост новых рабочих мест в американской экономике в июле составил 215 тыс. чел. В сторону повышения были пересмотрены цифры предыдущего месяца. Это усилило ожидания повышения ставок в США в ближайшее время. Согласно консенсус-прогнозу аналитиков Bloomberg, с вероятностью 56% на следующем заседании ФРС поднимет ставку до 0,375%. На фоне падения цен на нефть курс рубля относительно доллара снижается на 44 копейки до 64,50 руб/ долл.



Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

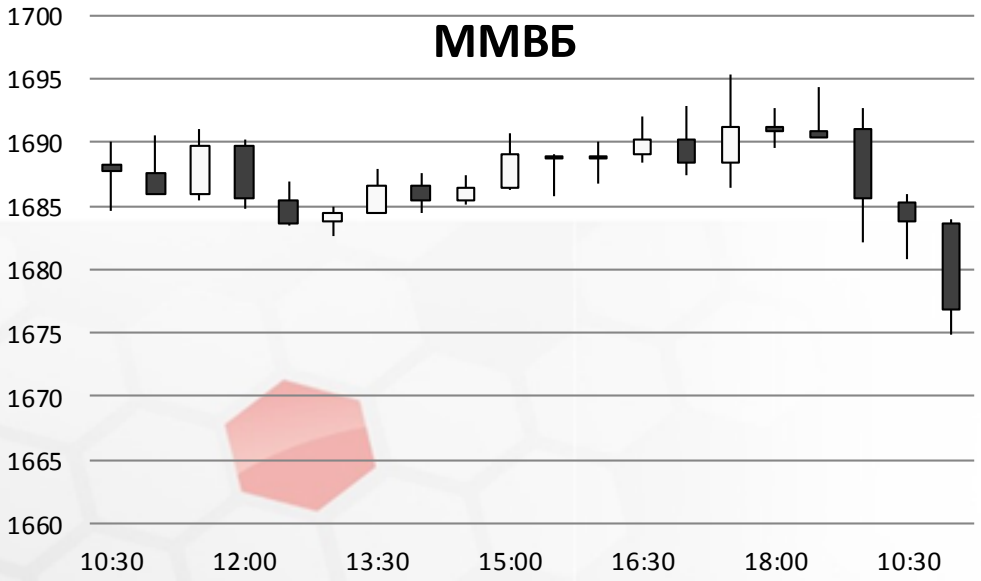
Валютный рынок

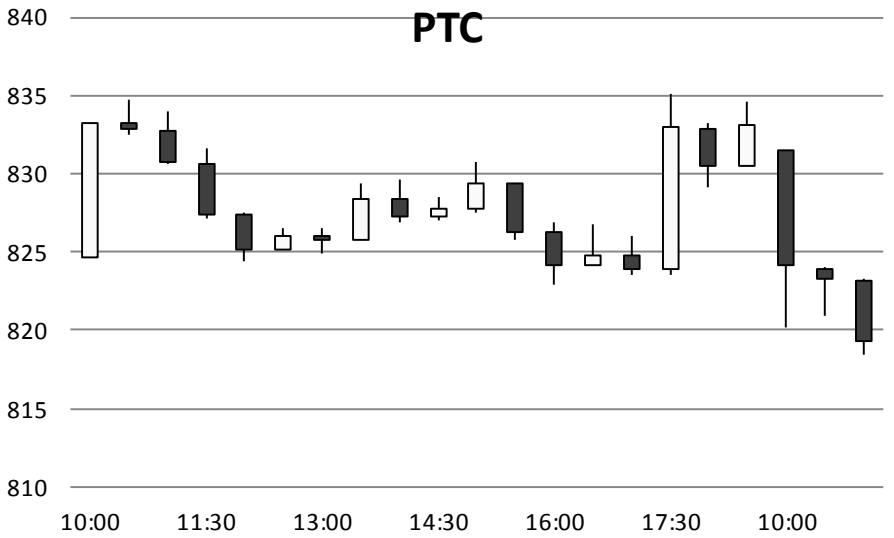


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

Новую торговую неделю российские индексы акций начали со снижения вслед за акциями нефтегазовых компаний: «Газпром» (-2%), НОВАТЭК (-0,7%), ЛУКОЙЛ (-0,6%). Также в лидерах падения оказались акции «Магнита» после публикации операционных результатов за июль, согласно которым выручка компании замедлилась до 24,3% г/г. Индекс ММВБ снижается на 0,3% до 1684,9 пунктов. Индекс РТС теряет 1%, опустившись до 824 пунктов. На наш взгляд, российские индексы акции будут консолидироваться на текущих уровнях до начала конца дня.





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.