
DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace
Ежедневная
Аналитика

Кратко о главном

- Индекс ММВБ обновил максимумы с февраля на фоне роста акций «Сбербанка», ЛУКОЙЛа и «Аэрофлота». Инвесторы игнорируют снижение цен на нефть и ослабление рубля относительно доллара и евро.
- Европейские индексы акций двигаются разнонаправленно в начале торговой сессии во вторник. Сегодня не ожидается публикации значимой макроэкономической статистики в ЕС.
- Курс американского доллара растет относительно евро на фоне комментариев главы ЕЦБ Марио Драги.

Обзор макроэкономических событий

- Европейские индексы акций торгуются вблизи уровня, соответствующего концу предыдущей торговой сессии. Разнонаправленное движение европейских индексов в первую очередь обусловлено неоднозначными корпоративными событиями, связанными с европейскими компаниями. Квартальные результаты UBS, BMW, опубликованные сегодня, оказались лучше ожиданий рынка. При этом акции Volkswagen (-3%) оказались в лидерах падения на фоне опасений, что американские власти могут наложить штрафы на автомобили дочерней компании Porsche из-за несоблюдения экологических норм. Также в лидерах падения оказались акции банка Standard Chartered после публикации слабой финансовой отчётности по итогам 3К15.

Ожидаемая статистика

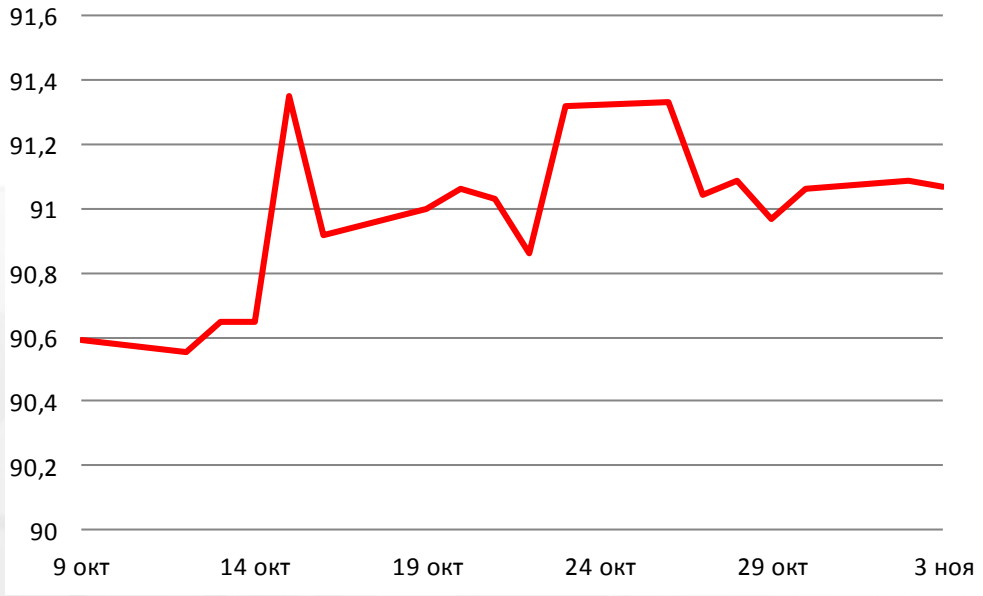
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
03.11.2015	17:45	ISM Нью-Йорк	США	октябрь	46	44,5
	18:00	Пром. заказы	США	сентябрь	-0.9%	-1.7%
	18:00	Производств. заказы (искл. транс.)	США	сентябрь	--	-0.8%
04.11.2015	11:50	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Франция	октябрь	52,3	52,3
	11:50	Составной индекс PMI	Франция	октябрь	52,3	52,3
	11:55	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Германия	октябрь	55,2	55,2
	11:55	Составной индекс PMI	Германия	октябрь	54,5	54,5
	12:00	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Еврозона	октябрь	54,2	54,2
	12:00	Составной индекс PMI	Еврозона	октябрь	54	54
	12:30	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Великобритания	октябрь	54,5	53,3
	12:30	Составной индекс PMI	Великобритания	октябрь	53,6	53,3
	13:00	ИЦП (м/м)	Еврозона	сентябрь	-0.5%	-0.8%
	13:00	ИЦП (г/г)	Еврозона	сентябрь	-3.3%	-2.6%
	15:00	Заявки на ипотеку от MBA	США	неделя	--	-3.5%
	16:15	Изменение числа занятых от ADP	США	октябрь	180k	200k
	16:30	Торговый баланс	США	сентябрь	-$41.00b	-$48.33b
	17:45	Составной индекс PMI	США	октябрь	--	54,5
	17:45	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	США	октябрь	54,5	54,4
	18:00	Композитный индекс ISM для непроизв. сферы	США	октябрь	56,5	56,9
05.11.2015	10:00	Промышленные заказы (м/м)	Германия	сентябрь	1.0%	-1.8%
	10:00	Промышленные заказы, с уч. раб. дн. (г/г)	Германия	сентябрь	1.9%	1.9%
	11:30	Markit: Индекс деловой активности PMI в строит-ве в Германии	Германия	октябрь	--	52,4
	13:00	Розничные продажи (м/м)	Еврозона	сентябрь	0.2%	0.0%
	13:00	Розничные продажи (г/г)	Еврозона	сентябрь	3.0%	2.3%
	15:00	Золото и международные резервы	Россия	неделя	--	374.6b
	15:30	Сокращение рабочих мест (г/г)	США	октябрь	--	93.2%
	16:00	ИПЦ (нд/нд)	Россия	ноябрь	--	0.2%
	16:00	ИПЦ, еженед. (с н.г.)	Россия	ноябрь	--	11.2%
	16:30	Первичные заявки на пособие по безработице	США	неделя	260k	260k
	16:30	Повторные заявки на пособие по безработице	США	неделя	2140k	2144k
	16:30	Производительность в несельскохоз. секторе	США	3К15	-0.3%	3.3%
	16:30	Затраты на рабочую силу	США	3К15	2.3%	-1.4%

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Несмотря на внешний негативный фон, доходность ОФЗ снижается. Впервые за последний месяц доходность к погашению ОФЗ серии 26214 опустилась ниже отметки 10%. Долларовые облигации RUS-30 торгуются с доходностью 3,25%. Впервые за последний год стоимость страховки от дефолта по долларовым облигациям снизилась до 271 б.п., что говорит о растущем спросе на инструменты с фиксированной доходностью со стороны иностранных инвесторов.

Ценовой индекс корпоративных долгов



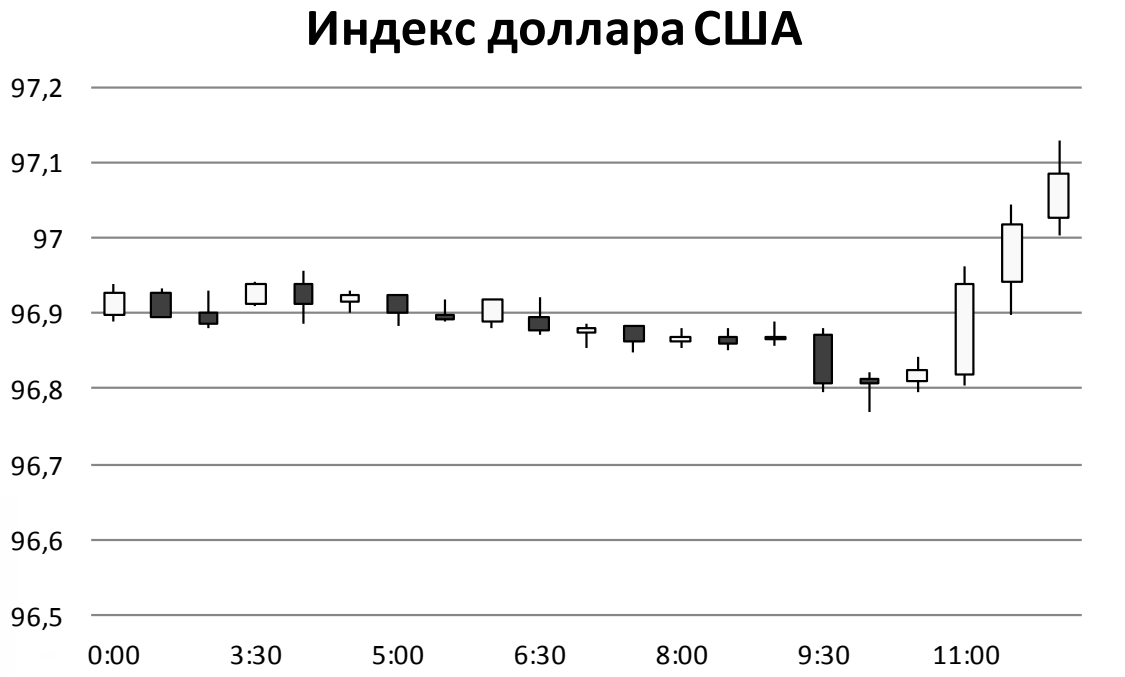
Индекс доходности ОФЗ



Источник: Bloomberg

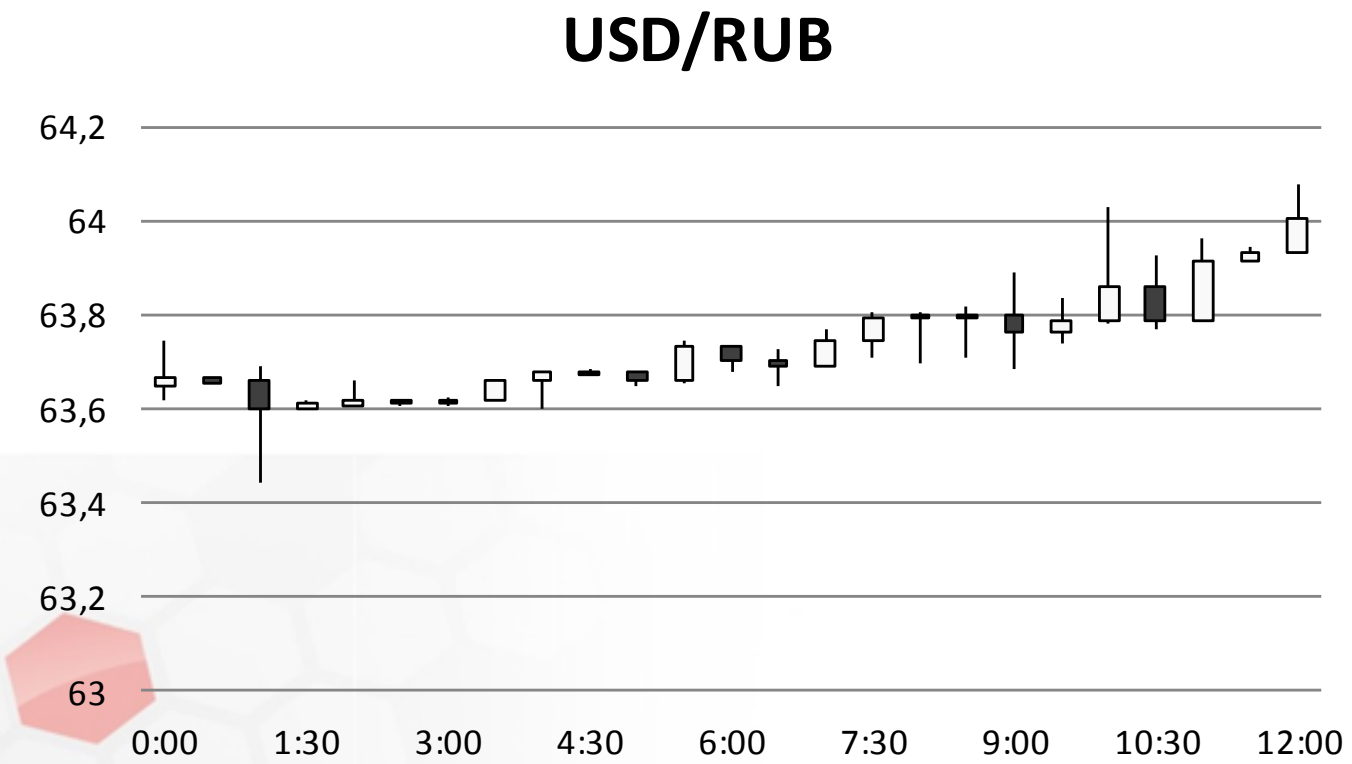
Валютный рынок

Курс евро к доллару резко снизился перед сегодняшним выступлением главы ЕЦБ Марио Драги. Инвесторы надеются, что глава ЕЦБ может в ходе своего выступления подчеркнуть готовность ЕЦБ расширить размеры и сроки действия программы по выкупу активов. Курс рубля относительно доллара снижается на 21 копейку, двигаясь вслед за ценами на нефть. Стоимость барреля марки Brent с момента завершения валютных торгов на ММВБ снизилась на 0,3% до $48,6 на опасениях роста запасов сырой нефти в США. Напомним, что сегодня Американский институт нефти опубликует свой еженедельный отчёт по изменению запасов сырой нефти в США. В целом мы не ожидаем высокой волатильности на валютном рынке в ближайшие два дня. В центре внимания участников торгов будут итоги выступления главы ФРС Джанет Йеллен перед банковским комитетов сената, которое состоится завтра вечером.



Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

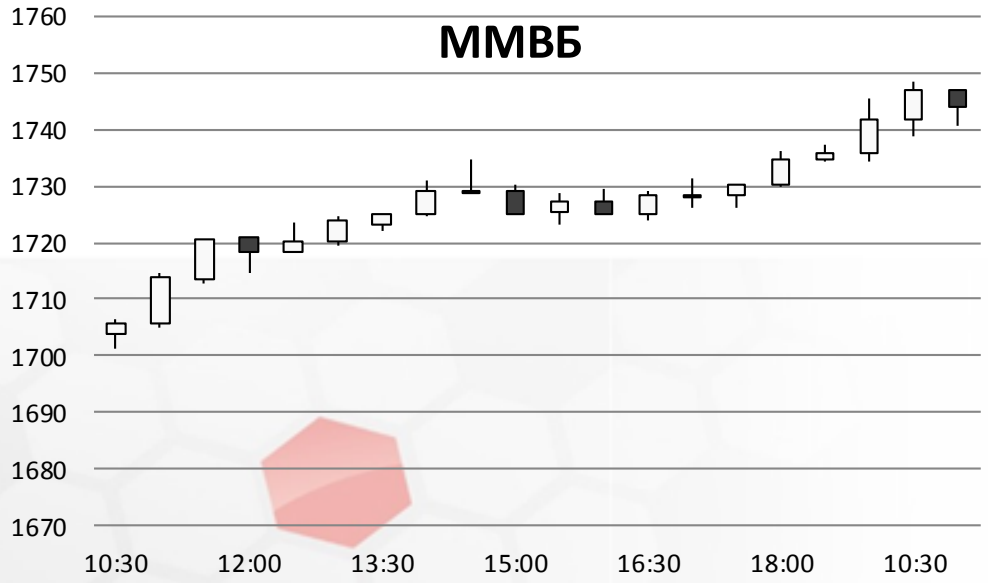
Валютный рынок

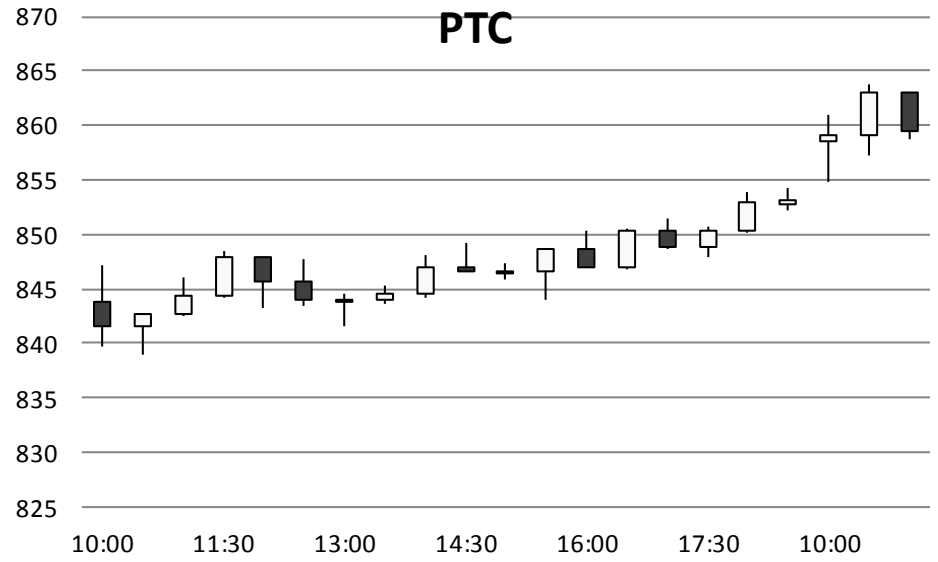


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

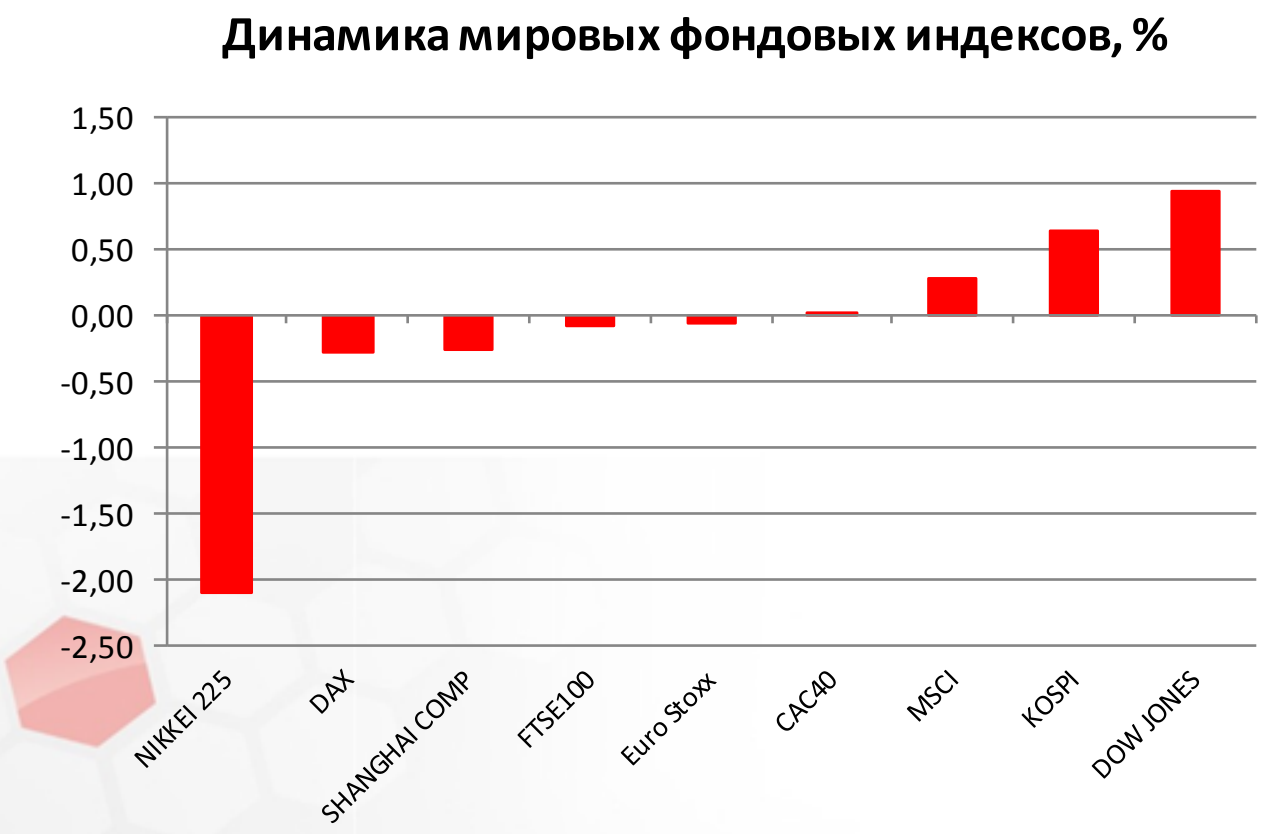
Индекс ММВБ сегодня обновил максимумы с февраля текущего года, двигаясь вслед за акциями российских банков и нефтегазовых компаний. Индекс РТС также растет на 1,8% до 868 пунктов, несмотря на ослабление курса рубля против доллара. Акции «Аэрофлота» взлетели на 8% до 53,4 руб. Хуже рынка выглядят акции металлургических компаний, котировки которых выросли с начала года значительно больше, чем индекс ММВБ.





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.