
DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace
Ежедневная
Аналитика

Кратко о главном

- Торговую сессию во вторник азиатские индексы акций завершили ростом основных индикаторов, несмотря на публикацию слабой макроэкономической статистики в Китае за ноябрь. На наш взгляд, причиной роста стало закрытие коротких позиций в акциях азиатских компаний.
- Цены на нефть продолжают испытывать высокую волатильность перед началом заседания представителей стран ОПЕК, встреча которых намечена на конец текущей недели.
- Сегодня долларовая корзина валют снизилась ниже отметки 100 пунктов на укреплении европейской валюты относительно доллара и публикации сильной макроэкономической статистики в Европе по рынку труда.

Обзор макроэкономических событий

- Сегодня в Китае была опубликована статистика по изменению индекса деловой активности в производственной сфере. Согласно официальным итоговым данным за ноябрь, индекс деловой активности снизился до минимума за последние 3 года и составил 49,6 пунктов, не оправдав ожиданий рынка. Согласно данным китайского информагентства Caixin, аналогичный показатель вырос относительно значений октября и составил 48,6 пунктов. Азиатские инвесторы проигнорировали официальную статистику, свидетельствующую о продолжающемся возможном торможении промышленного производства в Китае. На наш взгляд, основной причиной роста азиатских индексов стало сокращение коротких спекулятивных позиций по акциям китайских эмитентов, размер которых по различным расчетам может достигать до 30% в американских хедж-фондах, ориентированных на инвестиции в китайские акции.
- Второй день подряд цены на нефть испытывают существенные колебания на фоне неопределенности вокруг итогов предстоящей встречи представителей стран-членов нефтяного картеля ОПЕК. На наш взгляд, на стоимость нефти в ближайшее время будет влиять выход данных как от Американского института нефти, так и Минэнерго США. По нашим прогнозам, ОПЕК проголосует за сохранение добычи нефти на текущих уровнях, что может привести к падению цен на нефть марки Brent до отметки $42 уже на следующей неделе.

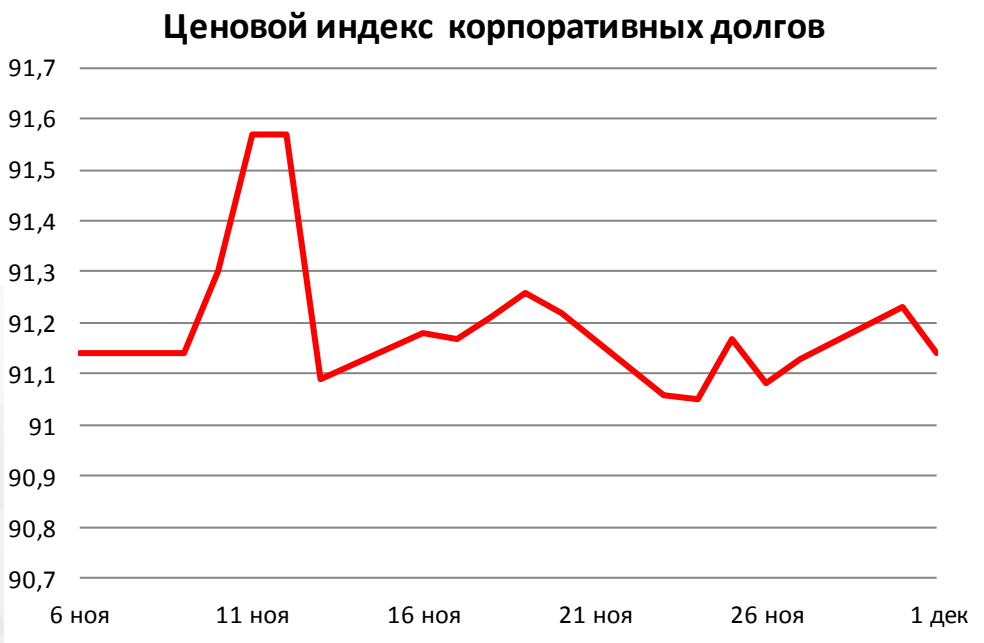
Ожидаемая статистика

Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
01.12.2015	4:00	Производственный инд. PMI	Китай	ноябрь	49,8	49,8
	4:00	Непроизводственный инд. PMI	Китай	ноябрь	--	53,1
	4:45	Производственный инд. PMI	Китай	ноябрь	48,3	48,3
	4:45	Непроизводственный инд. PMI от Caixin	Китай	ноябрь	--	52
	9:00	Производственный инд. PMI	Россия	ноябрь	50.0	50.2
	11:55	Изменения уровня безработицы, тыс	Германия	ноябрь	-5k	-5k
	11:55	Заявки по безработице	Германия	ноябрь	6.4%	6.4%
	12:00	Производственный инд. PMI	Еврозона	ноябрь	52.8	52.8
	12:00	Уровень безработицы	Италия	октябрь	11.7%	11.8%
	13:00	Уровень безработицы	Еврозона	октябрь	10.8%	10.8%
	17:45	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва от Markit	США	ноябрь	52.6	52.6
	18:00	Объем расходов в строит. секторе (м/м)	США	октябрь	0.6%	0.6%
	18:00	ISM: Инд. дел. активности в произв. Секторе	США	ноябрь	50.5	50.1
	18:00	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва от ISM	США	ноябрь	40.0	39.0
02.12.2015	13:00	ИЦП (м/м)	Еврозона	октябрь	-0.4%	-0.3%
	13:00	ИЦП (г/г)	Еврозона	октябрь	-3.2%	-3.1%
	15:00	Заявки на ипотеку от MBA	США	неделя	--	-3.2%
	16:00	ИПЦ (нд/нд)	Россия	неделя	--	0.1%
	16:00	ИПЦ, еженед. (с н.г.)	Россия	неделя	--	11.8%
	16:15	Изменение числа занятых от ADP	США	ноябрь	190k	182k
	17:45	ISM Нью-Йорк	США	ноябрь	--	65.8
	22:00	Отчет ФРС "Бежевая книга"	США	ноябрь		

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Спрос на российские облигации и активность инвесторов продолжает снижаться второй день подряд на фоне предстоящих событий, которые состоятся во второй половине неделе. Незначительное укрепление рубля и рост цен на нефть способствуют падению доходности рублевых облигаций. Доходность к погашению ОФЗ 26214 снизилась до 10%. Сегодня Минфин РФ опубликует параметры завтрашнего аукциона ОФЗ.



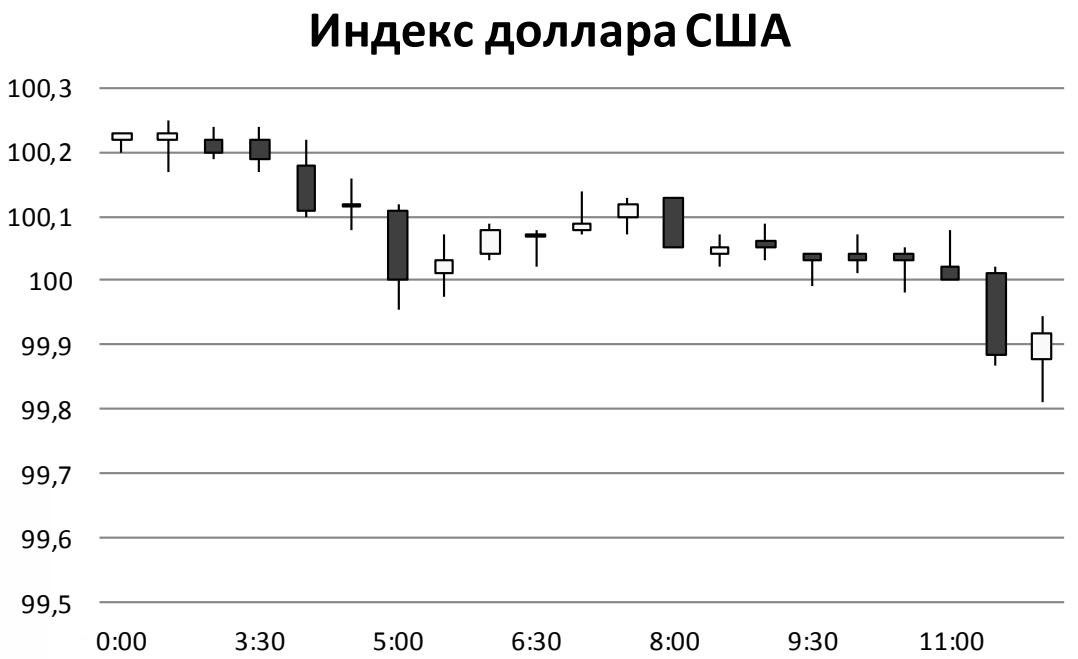


Источник: Bloomberg

Валютный рынок

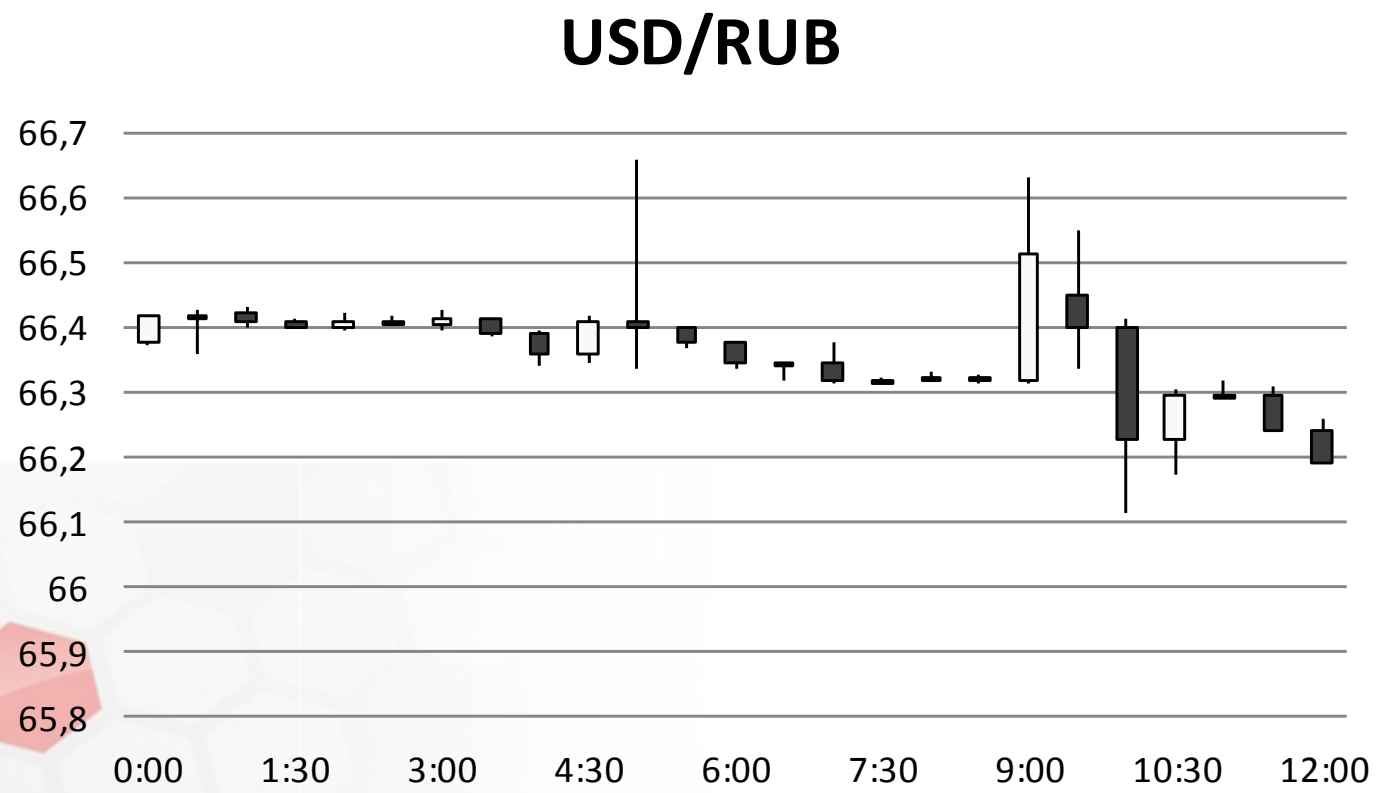
Курс доллара относительно корзины валют DXY снизился ниже отметки 100 пунктов на фоне укрепления европейской валюты. Опубликованные данные по европейскому рынку труда оказались лучше ожиданий рынка. Уровень безработицы в ЕС в прошлом месяце опустился до 10,7%, минимального уровня с 2012 года.

Курс рубля укрепляется относительно доллара в первую половину торговой сессию во вторник на 19 копеек до 66,2940 руб/долл.



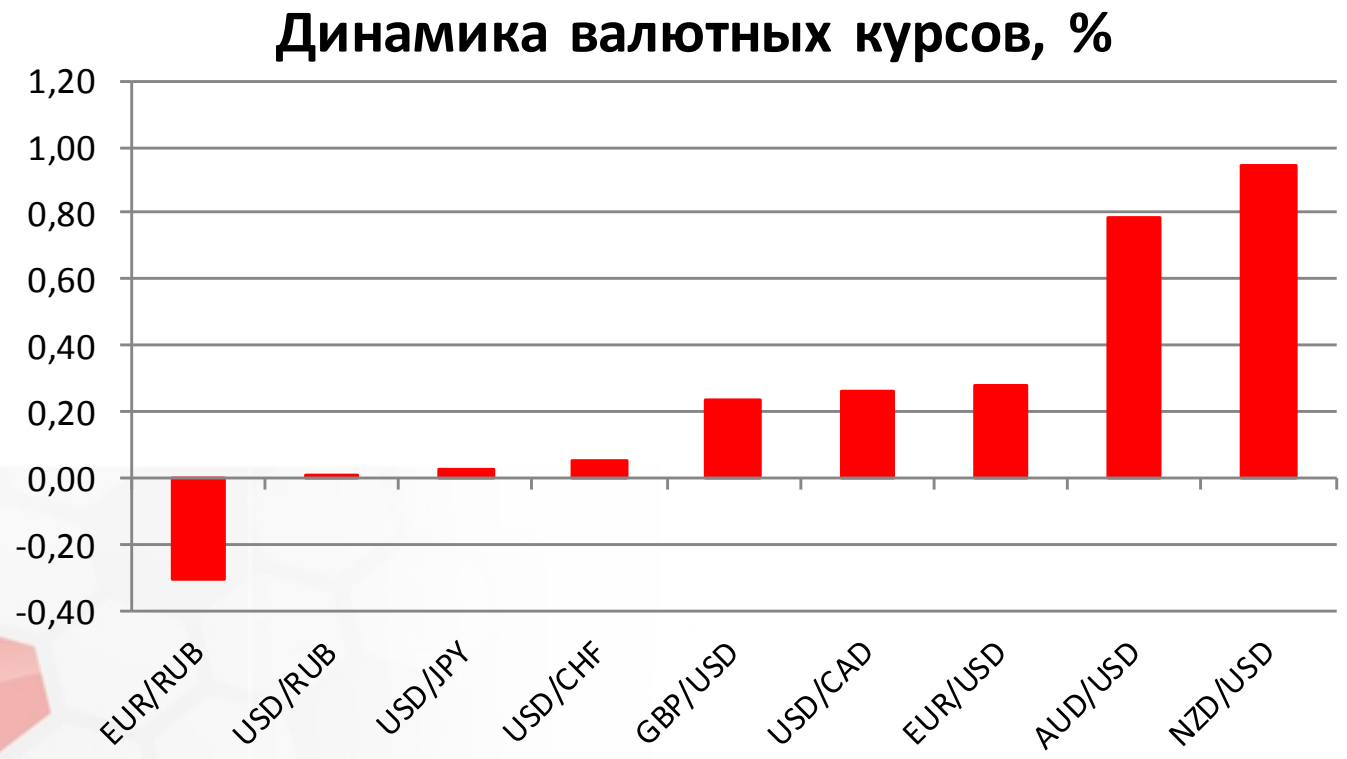
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

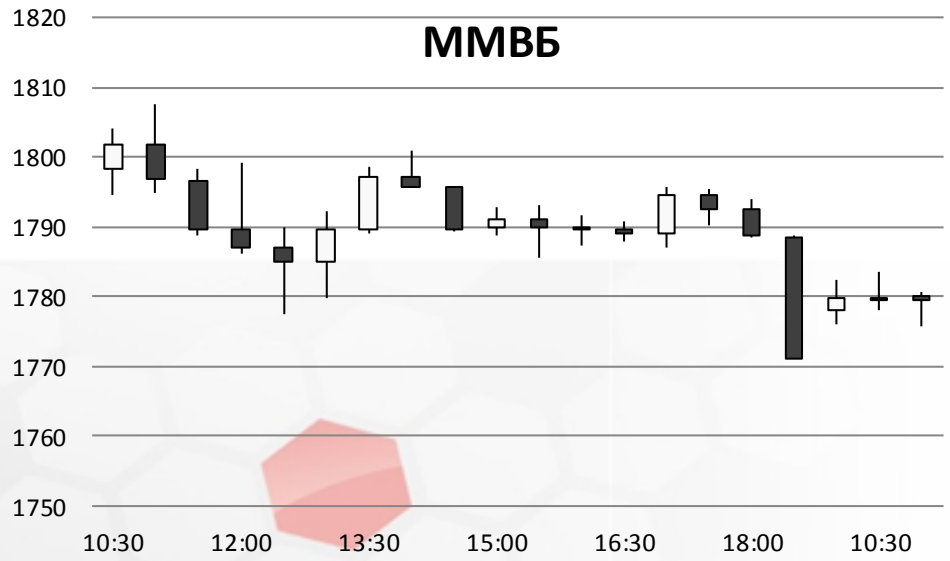
Валютный рынок

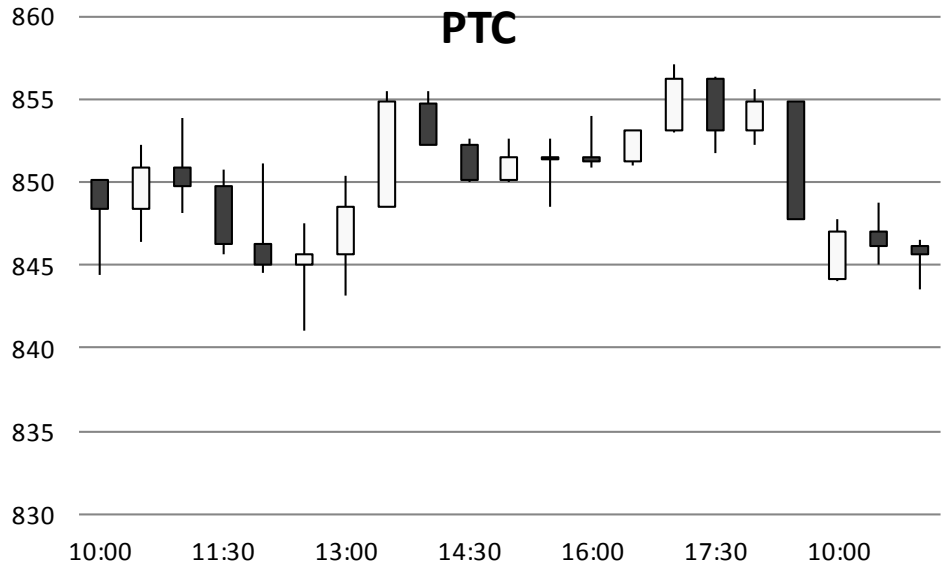


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

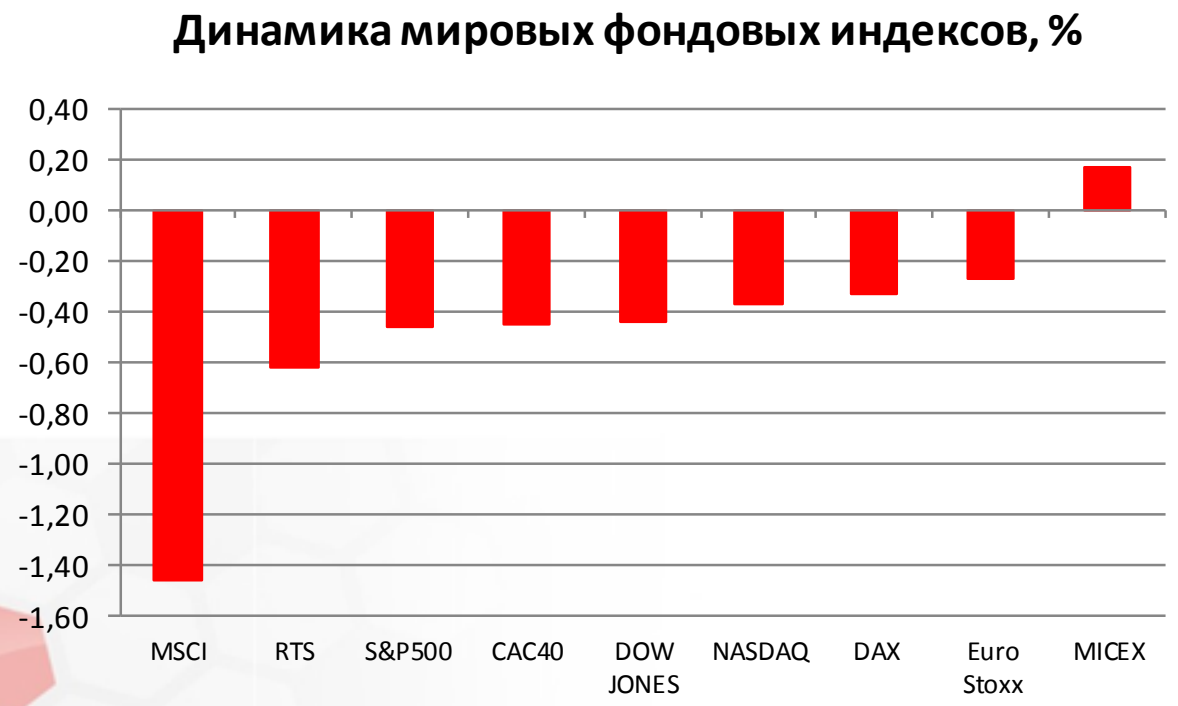
По итогам первой половины торговой сессии российские индексы акций двигаются разнонаправленно. Индекс ММВБ растет на 0,2% до 1775 пунктов. Индекс РТС теряет 0,62%, снизившись до отметки 841 пункта. Второй день подряд лучше рынка выглядят акции «Аэрофлота» (+4,5%), отыгрывая публикацию финансовых результатов за 9М15. Также лучше рынка выглядят акции «ЛУКОЙЛа», который отчитался за минувший квартал.





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.