
DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace
Ежедневная
Аналитика

Кратко о главном

- Сегодня цена барреля марки Brent снизилась до минимальных значений с 2004 года, достигнув отметки $30,5. Падение цен на нефть оказало давление на курс рубля в начале валютных торгов на ММВБ.
- Китайские индексы акций завершили торговую сессию ростом после трех дней непрерывного падения на фоне действий народного банка Китая, направленных на стабилизацию курса юаня.
- Сегодня американская компания Alcoa опубликовала свои финансовые результаты за минувший квартал, тем самым дав старт сезону корпоративной отчетности в США.

Обзор макроэкономических событий

- Сегодня цена барреля марки Brent снизилась до минимальных значений с 2004 года, достигнув отметки $30,5 на опасениях, что в запасы сырой нефти в США увеличились на прошлой неделе. Напомним, что сегодня Американский институт нефти традиционно опубликует еженедельный отчет по изменению коммерческих запасов нефти и нефтепродуктов в США. Консенсус аналитиков Bloomberg ожидает, что запасы сырой нефти увеличится за первую неделю года на 1,9 млн. барр. Также давление на нефтяные контракты оказывают ожидания роста добычи со стороны Ирана после заявлений представителей Национальной нефтяной компании, занимающейся добычей сырья на территории Ирана.
- Китайский индекс Shanghai composite по итогам сегодняшнего дня вырос на 0,2% на новостях об валютных интервенциях народного банка Китая, который сегодня начал скупать валюту на бирже Гонконга. Действия монетарных властей привели к резкому росту стоимости заимствований в юанях на Гонконгской бирже. Ставки на рынке межбанковского кредитования взлетели с 13% до 66,8%. Курс юаня относительно доллара стабилизировался на отметке 6,584, отступив от своих многолетних минимумов. Остальные азиатские индексы снижались на опасениях, что завтра будет опубликована слабая макроэкономическая статисткам в Китае за декабрь. В лидерах падения оказались акции японских компаний, так как инвесторы после длительных выходных отыгрывали ожидания торможения темпов роста китайской экономики.

Обзор макроэкономических событий

- После окончания основной торговой сессии на американском рынке акций компания Alcoa, отчиталась за 4К2015, тем самым дав старт сезону корпоративной отчетности в США. Прибыль на акцию Alcoa без учета единовременных убытков составила 40 центов, что оказалось существенно выше ожиданий рынка. Котировки акций алюминиевой компании в ходе внебиржевых торгов росли. На этой неделе свои финансовые результаты опубликуют крупные финансовые компании JP Morgan, BlackRock, Citigroup.

Ожидаемая статистика

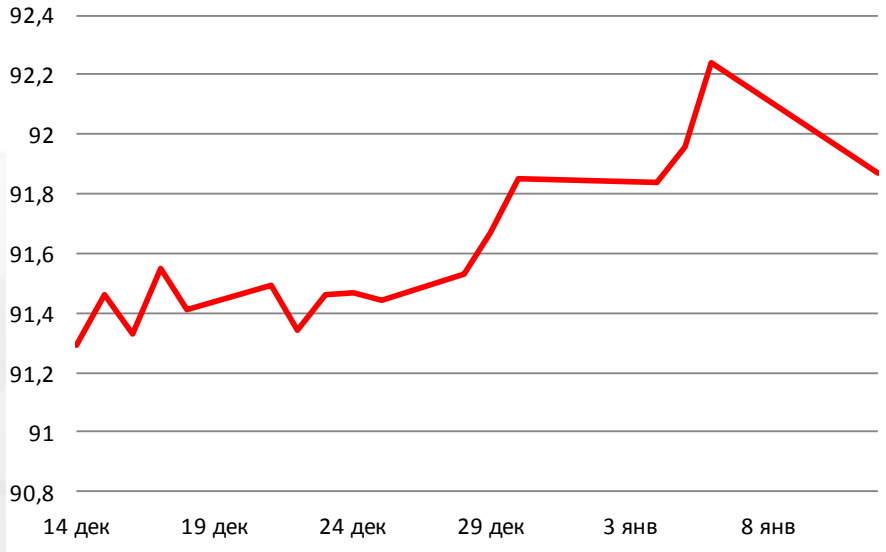
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
12.01.2016	12:30	Промышл. производство (м/м)	Великобритания	ноябрь	0.0%	0.1%
	12:30	Пром. производство (г/г)	Великобритания	ноябрь	1.7%	1.7%
	16:00	ИПЦ (м/м)	Россия	декабрь	--	0.8%
	16:00	ИПЦ (г/г)	Россия	декабрь	--	12.9%
13.01.2016	10:45	ИПЦ (м/м)	Франция	декабрь	0.1%	-0.2%
	10:45	ИПЦ (г/г)	Франция	декабрь	0.1%	0.0%
	13:00	Промышленное производство (м/м)	Еврозона	ноябрь	-0.3%	0.6%
	13:00	Промышленное производство (г/г)	Еврозона	ноябрь	1.3%	1.9%
	15:00	Заявки на ипотеку от MBA	США	неделя	--	-11.6%
	16:00	ИПЦ, еженед. (с н.г.)	Россия	неделя	--	12.7%
	16:00	ИПЦ (нд/нд)	Россия	неделя	--	0.2%
	22:00	Ежемесячный отчет об исполнении бюджета	США	декабрь	-$7.1b	$1.9b
	22:00	Бежевая книга	США	декабрь		
14.01.2016	2:50	ИЦП (м/м)	Япония	декабрь	-0.4%	-0.1%
	2:50	ИЦП (г/г)	Япония	декабрь	-3.5%	-3.6%
	12:00	Промышл. производство (м/м)	Италия	ноябрь	0.3%	0.5%
	12:00	Промышленное производство, с уч. раб. дн. (г/г)	Италия	ноябрь	2.5%	2.9%
	15:00	Учетная ставка Банка Англии	Великобритания	январь	0.50%	0.50%
	15:00	Золото и международные резервы	Россия	неделя	--	370.2b
	16:30	Индекс цен на импорт (м/м)	США	декабрь	-1.4%	-0.4%
	16:30	Индекс цен на импорт (г/г)	США	декабрь	-8.4%	-9.4%
	16:30	Первичные заявки на пособие по безработице	США	неделя	275k	277k
	16:30	Повторные заявки на пособие по безработице	США	неделя	2210k	2230k

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

После вчерашней распродажи доходности рублевых гособлигаций сегодня перестали расти. Доходность к погашению ОФЗ серии 26207 составляет на текущий момент 10,01%. Также стоит отметить низкую активность инвесторов на долговом рынке. На наш взгляд, это связано с ожиданиями публикации данных по изменению розничных цен в декабре от Росстата. Ускорение инфляции существенно снижается вероятность смягчения денежно-кредитной политики со стороны ЦБ РФ. Сегодня Минфин РФ впервые в этом году объявит о параметрах аукциона по размещению новых выпусков ОФЗ, которые состоится 13 января.

Ценовой индекс корпоративных долгов



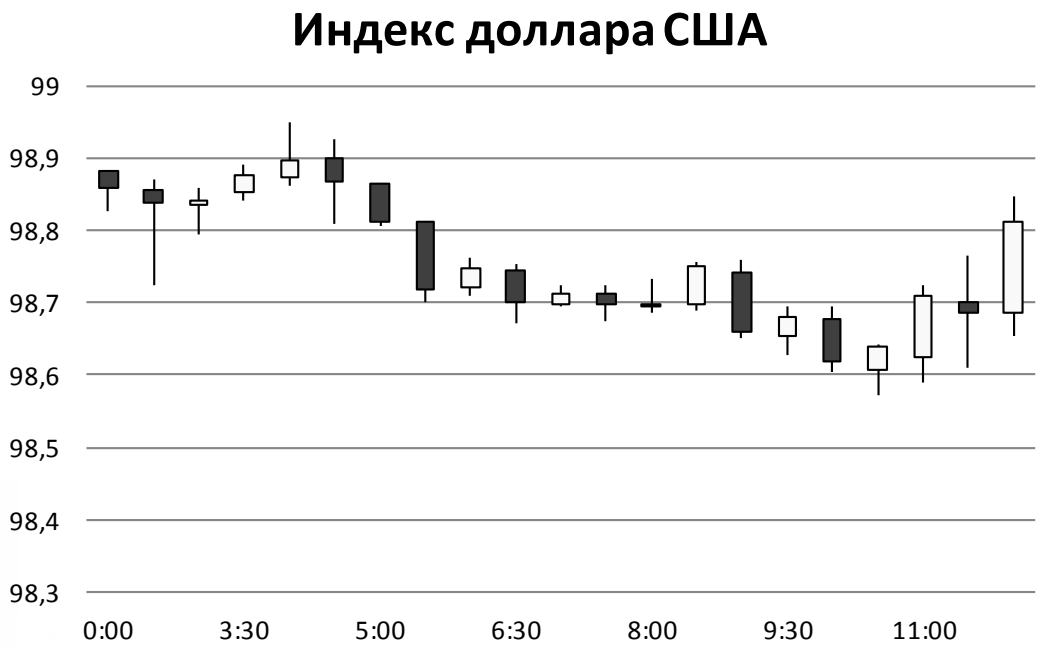
Индекс доходности ОФЗ



Источник: Bloomberg

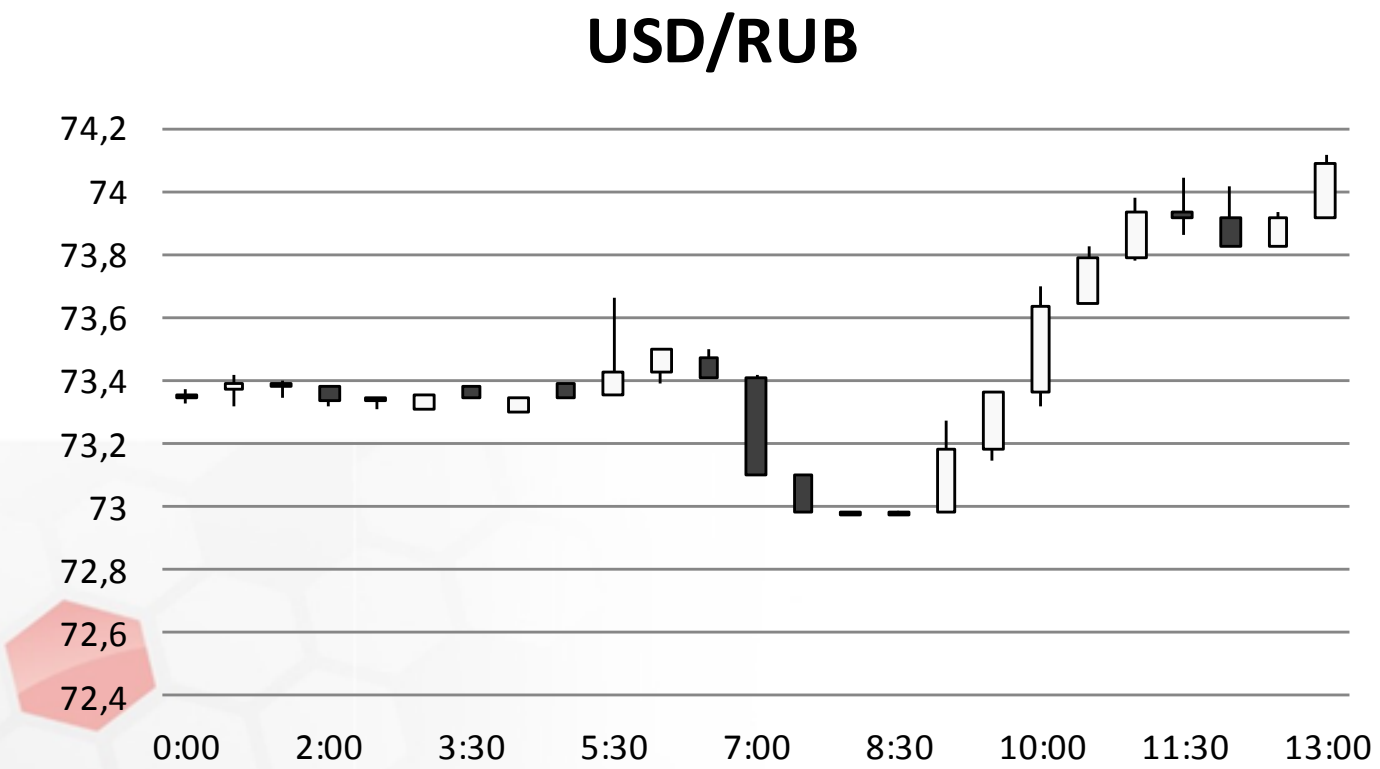
Валютный рынок

Курс рубля против доллара практически не изменился с начала валютных торгов на ММВБ, несмотря на падение цен на нефть до минимумов 2004 года. Курс доллара относительно корзины валют DXY стабилизировался у отметки 99 пунктов на фоне высказываний представителей ФРС о слабом влиянии рисков торможения китайской экономики на экономику США.



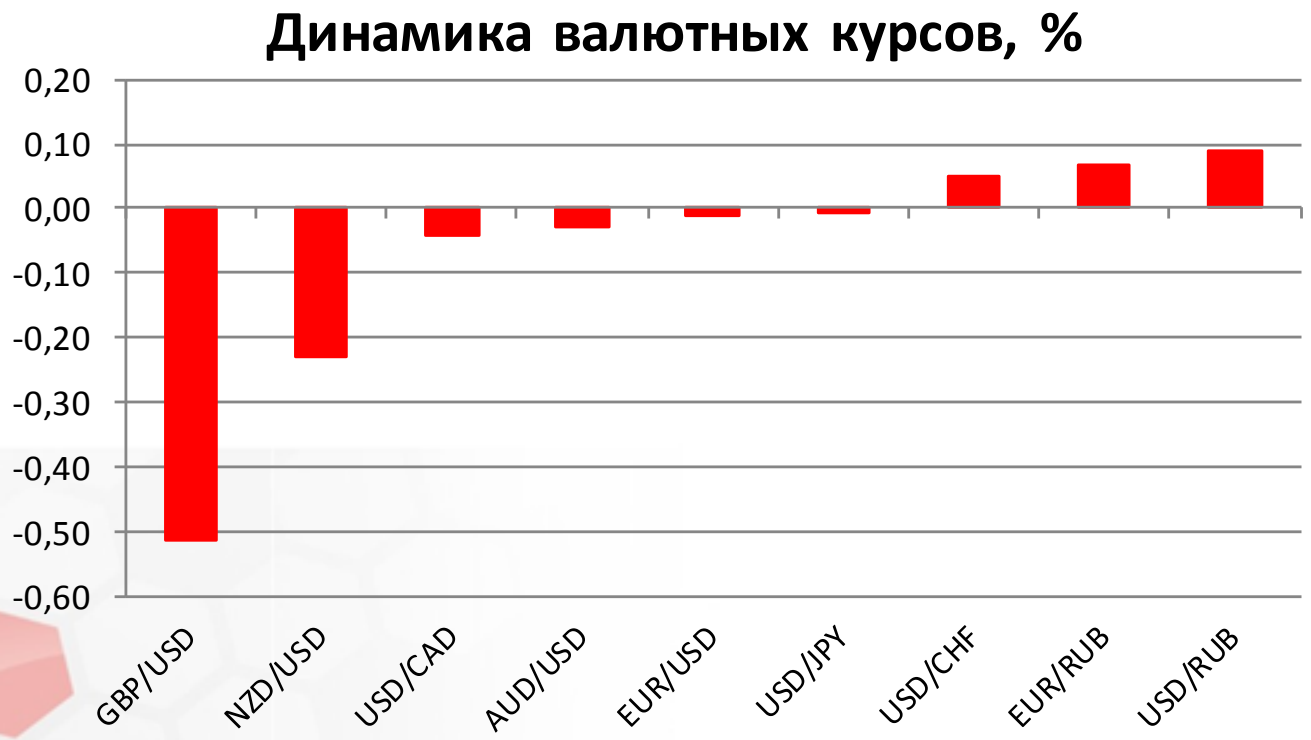
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

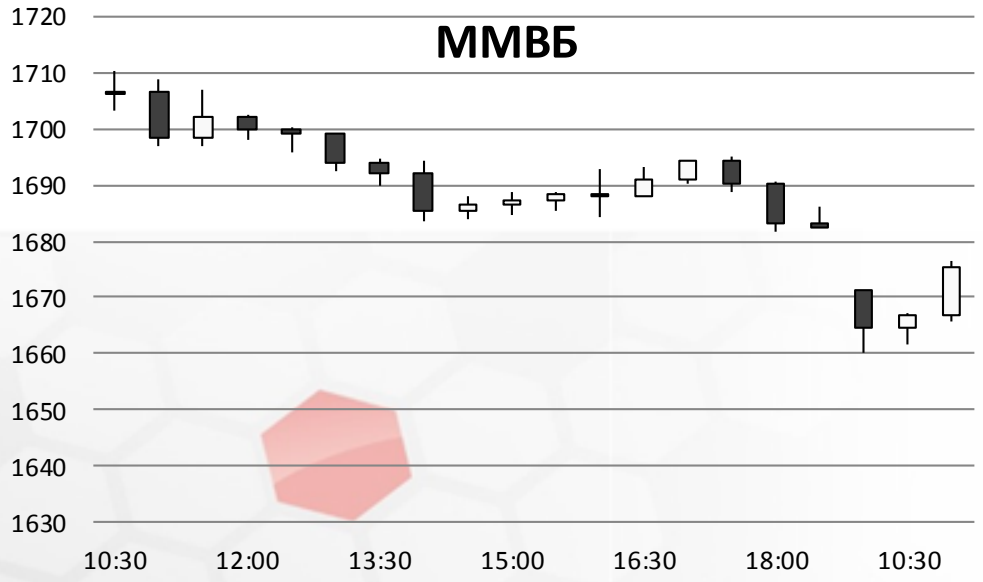
Валютный рынок

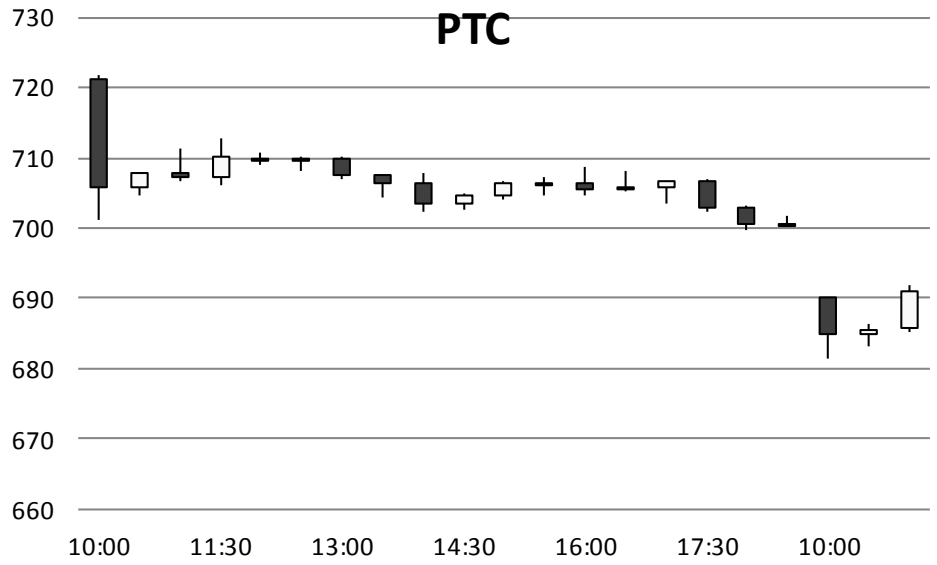


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

После падения индексов в первые минуты торгов индекс ММВБ растет в середине дня на 0,2% до 1686 пунктов. Индекс РТС снижается, отыгрывая ослабление рубля относительно доллара в ходе вечерних валютных торгов на ММВБ. Хуже рынка выглядят акции «Магнита» (-2,5%) на фоне публикации слабых операционных результатов за декабрь. Акции нефтегазовых компаний растут в среднем на 0,4%, поднимаясь вслед за ценами на нефть, которые оттолкнулись от своих многолетних минимумов.

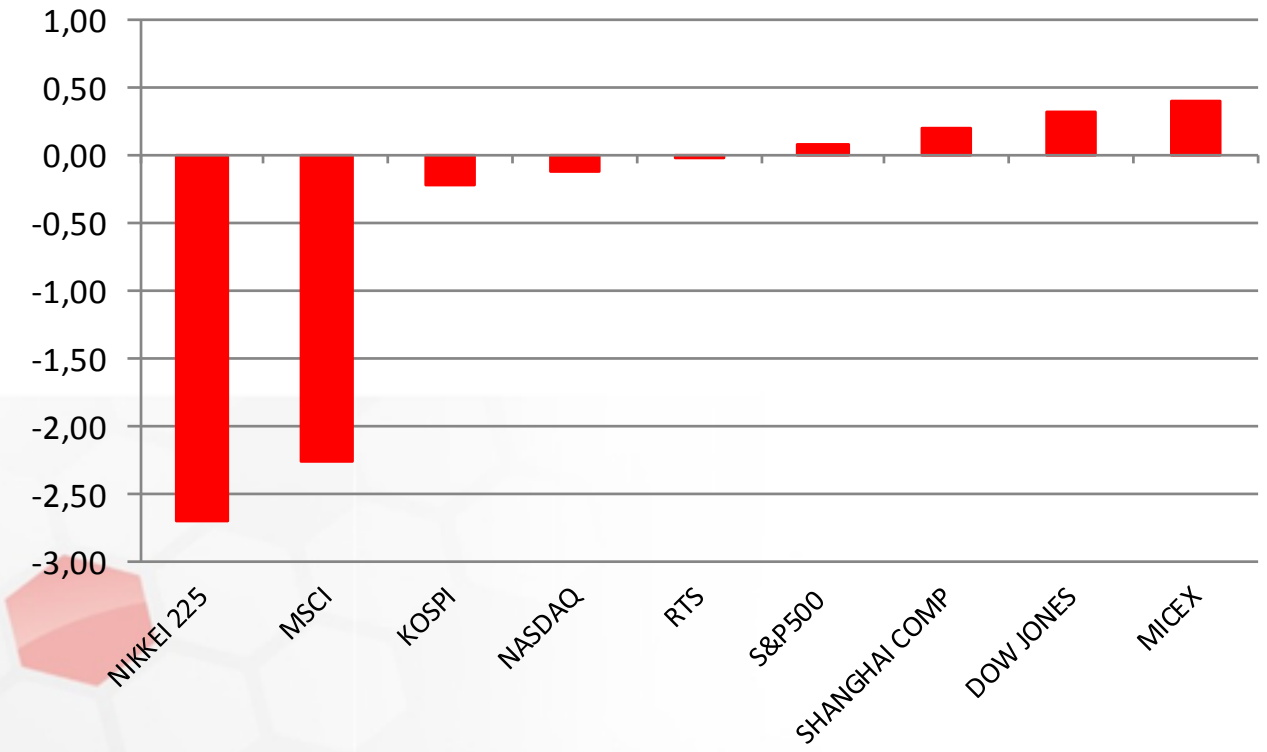




Источник: ММВБ, Bloomberg

Фондовый рынок

Динамика мировых фондовых индексов, %



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.