
DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace
Ежедневная
Аналитика

Кратко о главном

- Опубликованная сегодня макроэкономическая статистика в Китае оказалась хуже ожиданий рынка, что стало причиной сильного снижения основных индексов акций в Азии и Европе на фоне усилившихся опасений, что на следующей неделе будут опубликованы слабые данные по промышленному производству и темпам роста экономики Китая. Фьючерсы на американские индексы также снижаются.
- Цены на нефть марки Brent вновь опустились ниже отметки $30, оказав давление на российский рубль и основные индексы акций.
- По данным EPFR, за период с 7 по 13 января отток денежных средств из фондов составил $70 млн.

Обзор макроэкономических событий

- Сегодня в Китае была опубликована слабая макроэкономическая статистика за декабрь. Согласно данным Народного банка Китая, в декабре было выдано новых кредитов на сумму 600 млрд. юаней, что оказалось меньше ожиданий рынка. Также хуже ожиданий аналитиков оказались показатели ликвидности в банковской системе. Выход слабой статистики усилил опасения, что экономика Китая продолжает замедляться. Индекс Shanghai composite снизился на 3%, за последнюю торговую неделю индекс потерял 9%. Вслед за европейскими и азиатскими индексами акциями снижаются и нефтяные контракты. Стоимость барреля марки Brent сегодня опустилась на новые минимумы с 2004 года, достигнув отметки $29,8.
- Согласно данным EPFR, за последние 5 торговых дней отток средств из фондов, ориентированных на инвестиции в акции российских эмитентов, составил $70 млн. Отток был обусловлен как ослаблением рубля, так и падением цен на нефть. По нашим прогнозам, в ближайшее время мы будем видеть продолжение оттока капиталов из развивающихся стран на фоне роста опасений торможения экономики Китая. Поводом для этого может послужить публикация слабой макрокосмической статистики в Китае на следующей неделе. Предпосылками выхода слабой статистики может стать падение индекса деловой активности в производственной сфере от Caixin до 48,2 пунктов в прошлом месяце.

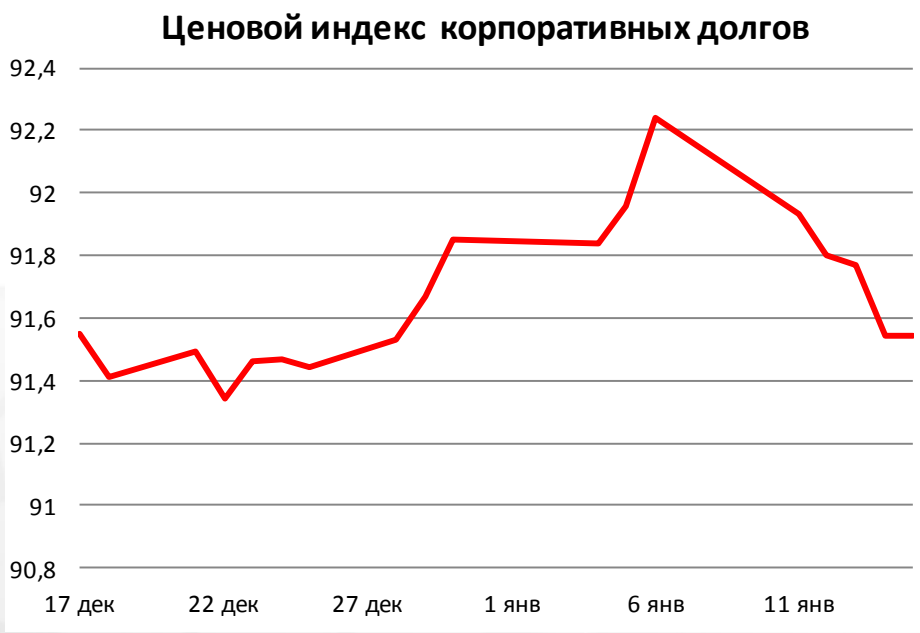
Ожидаемая статистика

Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
15.01.2016	10:00	Регистрация новых автомобилей в ЕС	Еврозона	декабрь	--	13.7%
	12:30	Объем производства в строит. секторе (м/м)	Великобритания	ноябрь	0.5%	0.2%
	12:30	Объем производства в строит. секторе (г/г)	Великобритания	ноябрь	-0.1%	1.0%
	13:00	Торговый баланс, с уч. сез.	Еврозона	ноябрь	21.0b	19.9b
	16:00	Экспорт	Россия	ноябрь	25.7b	27.2b
	16:00	Импорт	Россия	ноябрь	16.1b	17.2b
	16:00	Торговый баланс	Россия	ноябрь	9.9b	10.1b
	16:00	Официальные международные резервы	Россия	декабрь	370.0b	364.7b
	16:30	Розничные продажи, изм. (м/м)	США	декабрь	-0.1%	0.2%
	16:30	Розничные продажи, искл. автомоб. (м/м)	США	декабрь	0.2%	0.4%
	16:30	Производственный инд. Empire Manufacturing	США	январь	-4.00	-4.59
	17:15	Промышленное производство,(г/г)	США	декабрь	-0.2%	-0.6%
	17:15	Загрузка мощностей	США	декабрь	76.8%	77.0%
	18:00	Товарные запасы	США	ноябрь	-0.1%	0.0%
	18:00	Индекс настроений потребителей от Ун-та Мичигана	США	январь	93.0	92.6
18.01.2016	16:00	Сальдо платежного баланса	Россия	4К2015	--	7509m

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Доходность рублевых гособлигаций 26214 вновь растет, достигнув максимумов за 3 месяца и составив 10,68%. Валютные обязательства РФ, несмотря на негативный фон, не изменились в цене. Доходность бумаг Rus-30 на текущий момент составляет 2,92%.

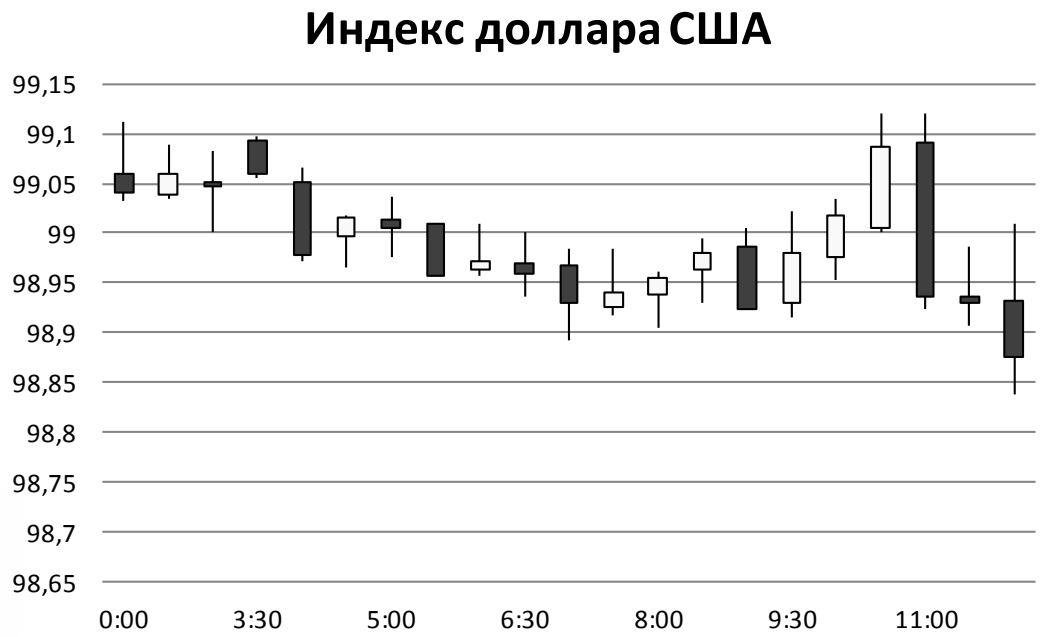




Источник: Bloomberg

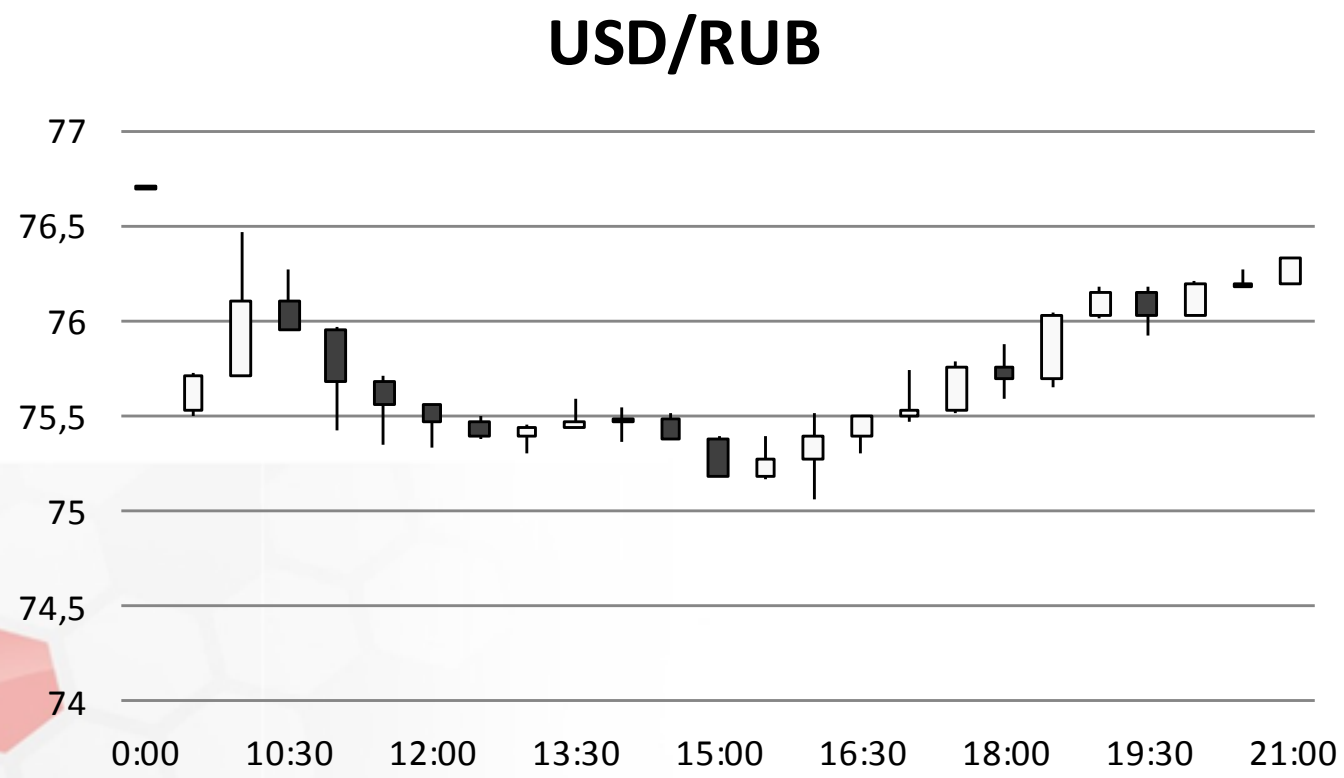
Валютный рынок

Курс рубля относительно доллара теряет 85 копеек, опустившись до 76,90 руб/долл на фоне падения цен на товарных биржах. Курс европейской валюты поднялся на 1,4 руб до 84 руб./евро. Курс американского доллара стабилен относительно корзины валют DXY в ожидании публикации статистики в США во второй половине дня.



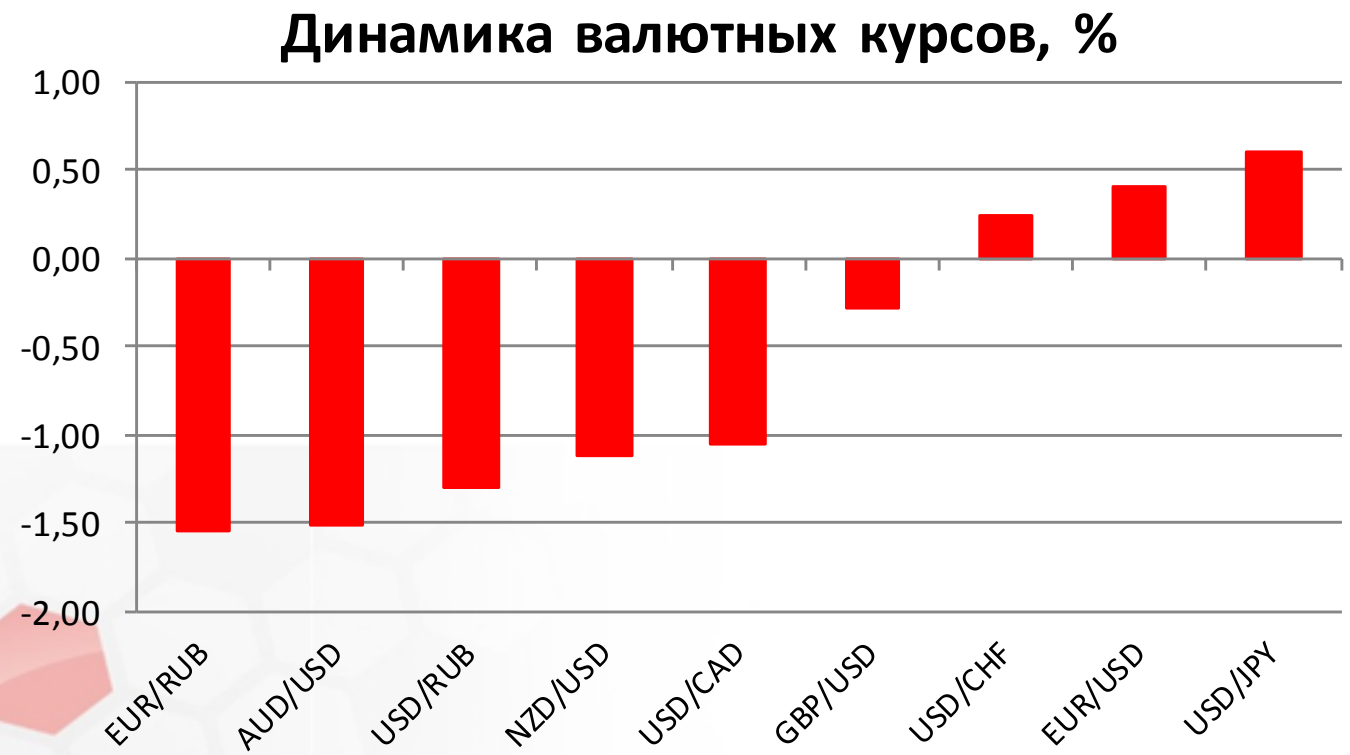
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

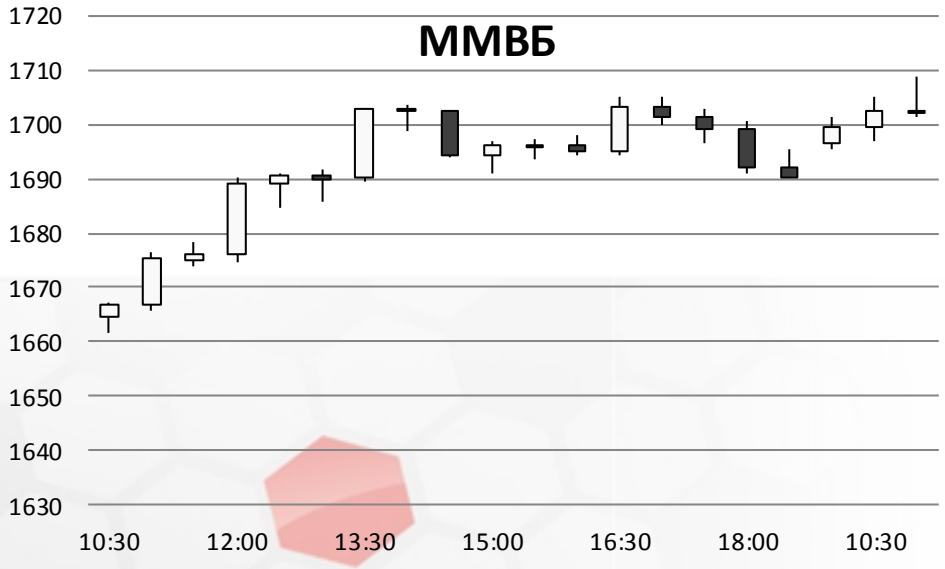
Валютный рынок

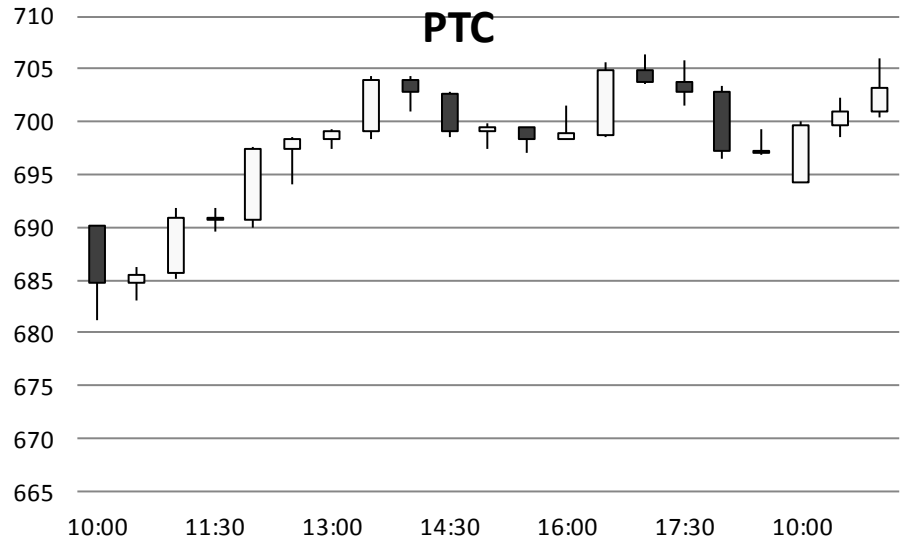


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

Сегодня российские индексы акций снижаются вслед за акциями сырьевых компаний. Индекс ММВБ теряет 1%, обновив минимумы с начала октября прошлого года. В лидерах падения оказались акции металлургических и нефтегазовых компаний: ЛУКОЙЛ (-1,3%), «Новатэк» (-1,1%), «Мечел» (-3,4%), ММК (-3%). Индекс РТС снижается на 1,5% на фоне падения курса рубля против 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.