DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Цены на нефть марки Brent отступили от своих максимумов текущего года на опасениях роста запасов сырья в США. Вслед за ценами на нефть снижается курс рубля и основные индексы акций в начале торговой сессии в среду.
- Азиатские индексы акций завершили торговую сессию в среду падением, отыгрывая публикацию слабой макроэкономической статистики в Китае вчера.

Обзор макроэкономических событий

- Азиатские индексы акций завершили торговую сессию в среду снижением, продолжая отыгрывать публикацию слабой макроэкономической статистики в Китае. Согласно данным Центральной таможенной администрации Китая, экспорт китайских товаров снизился в феврале больше ожиданий рынка, опустившись на максимальную величину с 2009 года на 25,4% г/г, что оказалось в два раза хуже прогнозов аналитиков. Цифры по импорту также разочаровали инвесторов, данный показатель в прошлом месяце снизился на 13,8% г/г, в то время как консенсус аналитиков Bloomberg ожидал снижения лишь на 10% г/г. В целом на азиатских рынках наблюдается коррекция после роста на прошлой неделе, вызванного ожиданиями реформ в Китае. Начавшийся пленум Всекитайского собрания народных представителей ознаменовался выступлением премьера Госсовета КНР Ли Кэцян, в ходе которого были озвучены важные для глобальной экономики прогнозы. Согласно ожиданиям правительства Китая, темпы роста ВВП в текущем году составят 6,5%, что выше прогнозов аналитиков, дефицит бюджета составит 2,2 трлн. юаней, что совпадет с ожиданиями рынка. Озвученные прогнозы стали причиной резкого роста цен на металлы и нефть в понедельник.

Обзор макроэкономических событий

- Цены на нефть марки Brent скорректировались вниз за последние 24 часа на 2,64%, не удержавшись на максимумах текущего года. Поводом для снижения котировок нефтяных контрактов стал рост опасений увеличения запасов сырой нефти в США. Согласно данным Американского института нефти, запасы сырой нефти увеличились за первую неделю марта на 4,4 млн барр, что оказалось выше прогнозов аналитиков. Сегодня Минэнерго США опубликует данные по изменению запасов во второй половине дня. Консенсус аналитиков Bloomberg ожидает увеличения на 4 млн барр за последнюю неделю. В целом на прошлой неделе количество буровых установок по добыче нефти в США снизилось на 8 шт. до 392, опустившись до минимальных значений с конца 2009 года.

Ожидаемая статистика

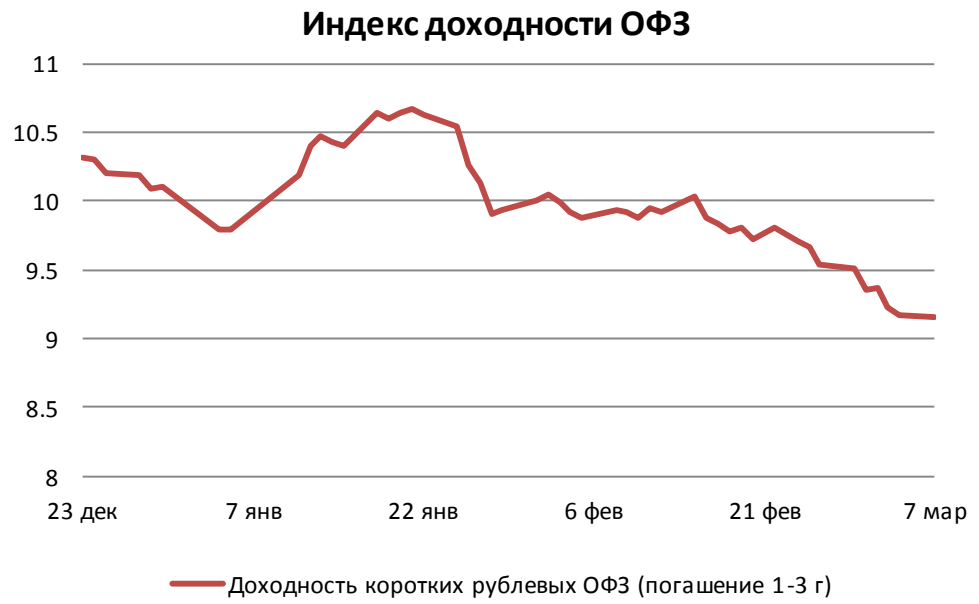
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
09.03.2016	15:00	Заявки на ипотеку от MBA	США	неделя	--	-4,30%
	18:30	Данные от Минэнерго США по изменению запасов	США	неделя	--	4 млн

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Укрепление рубля в понедельник и рост цен на нефть способствовали падению доходностей рублевых гособлигаций до минимальных значений с 2014 года. Доходность ОФЗ серии 26214 с погашением в 2020 году снизилась до 9,35%.



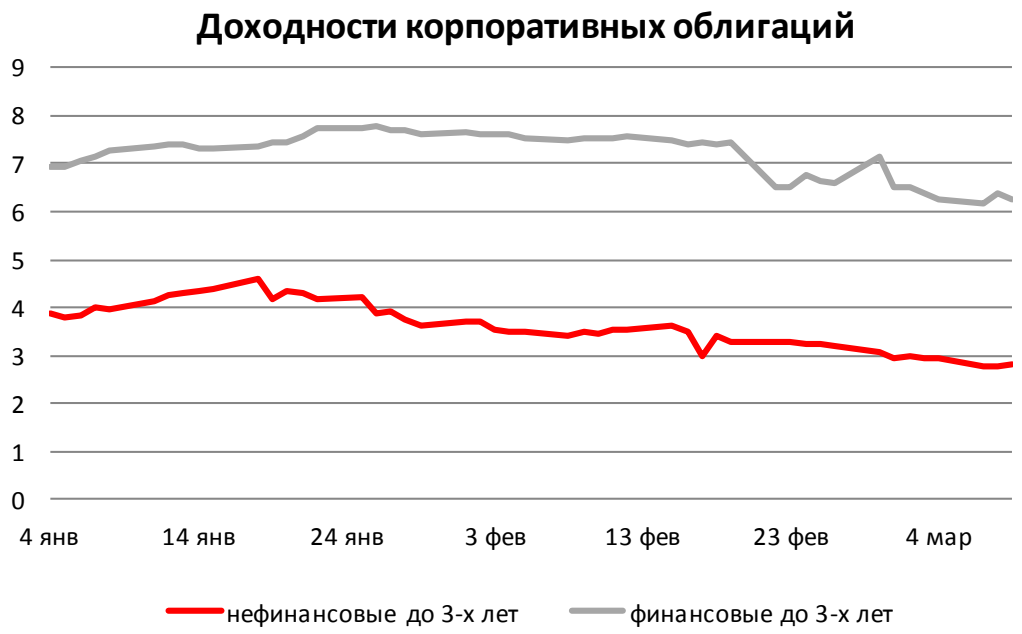


Источник: Bloomberg

Валютный рынок

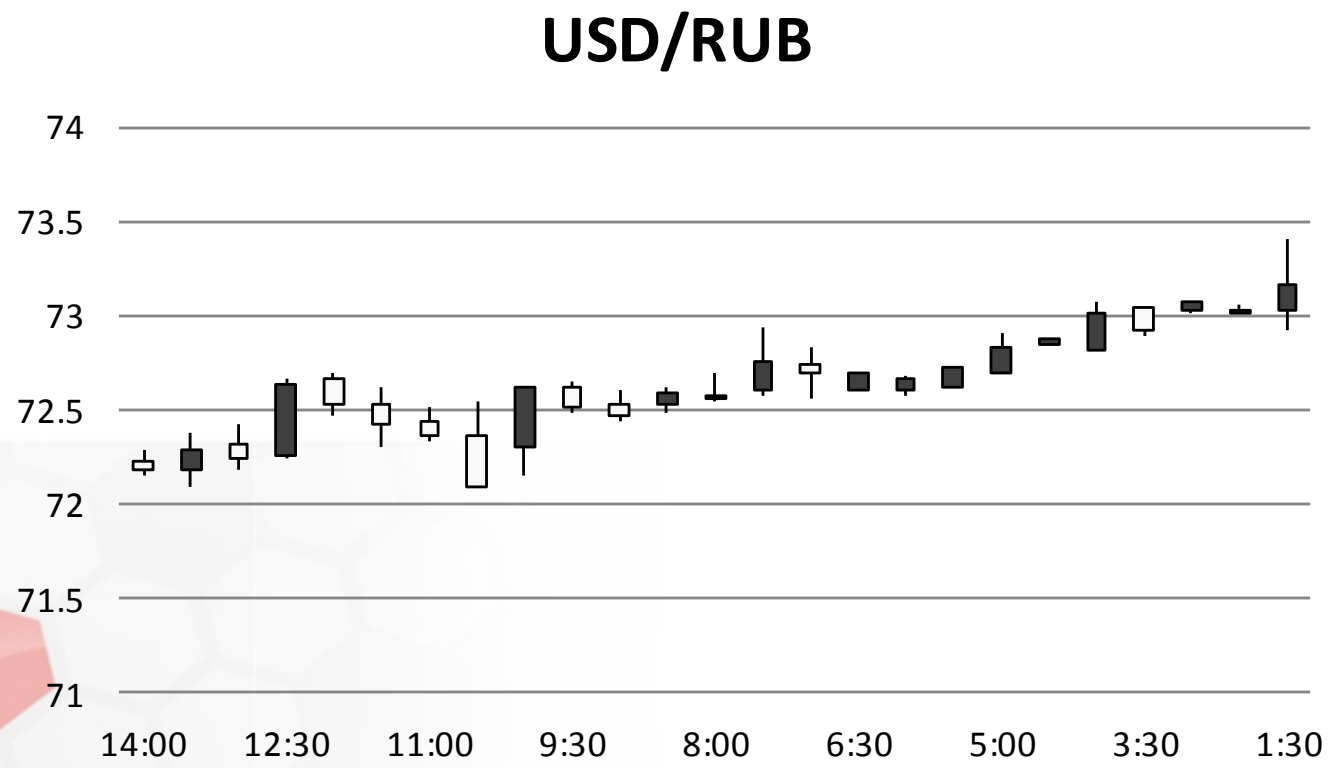
Долларовый индекс DXY снизился с конца прошлой торговой недели на фоне роста спроса на рискованные активы и сокращения позиций в американской валюте. В первую неделю марта доллар рос относительно корзины валют на ожиданиях выхода сильных данных по рынку труда в США за февраль. После публикации статистики, которая оказалась лучше ожиданий рынка, мы наблюдали закрытие данных позиций.

Курс рубля против доллара отступил от своих максимумов текущего года, снижаясь вслед за ценами на нефть на 72 копейки до 72,2 руб/долл.



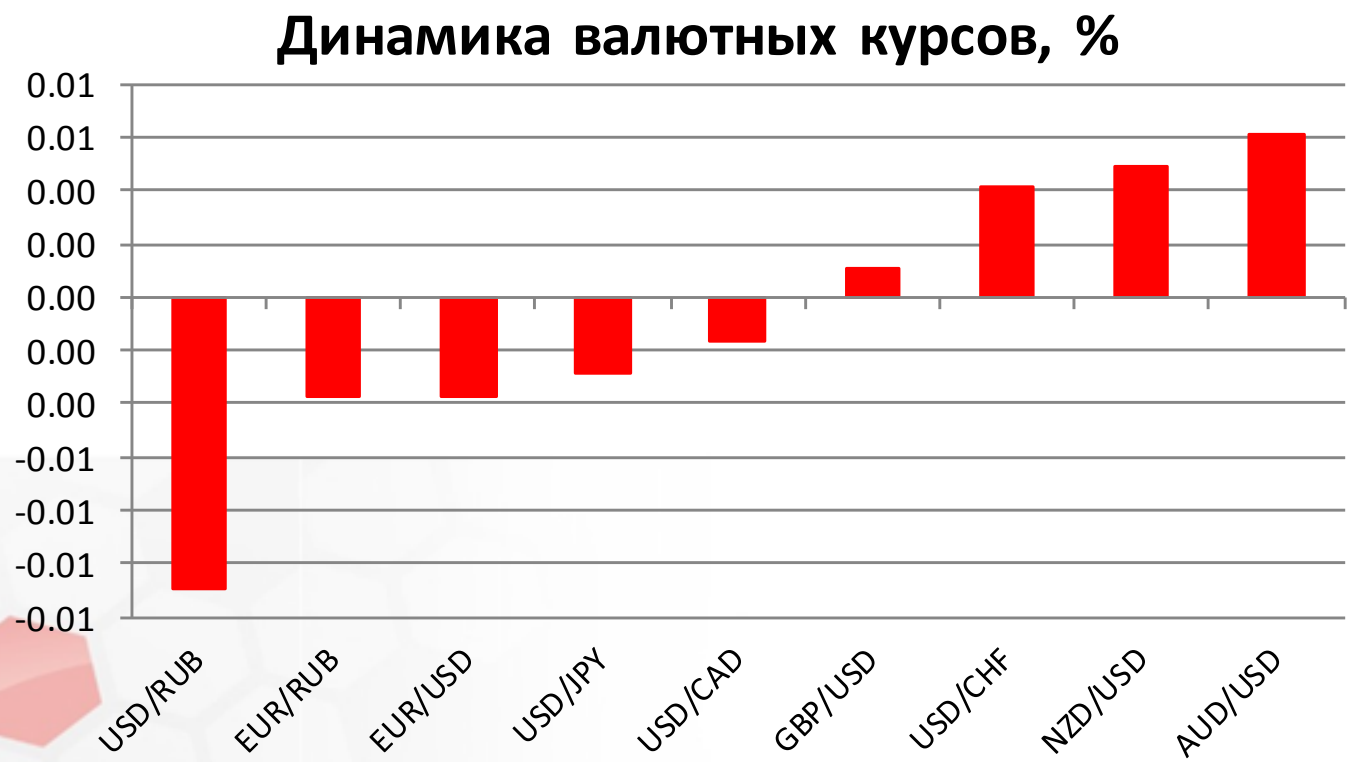
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

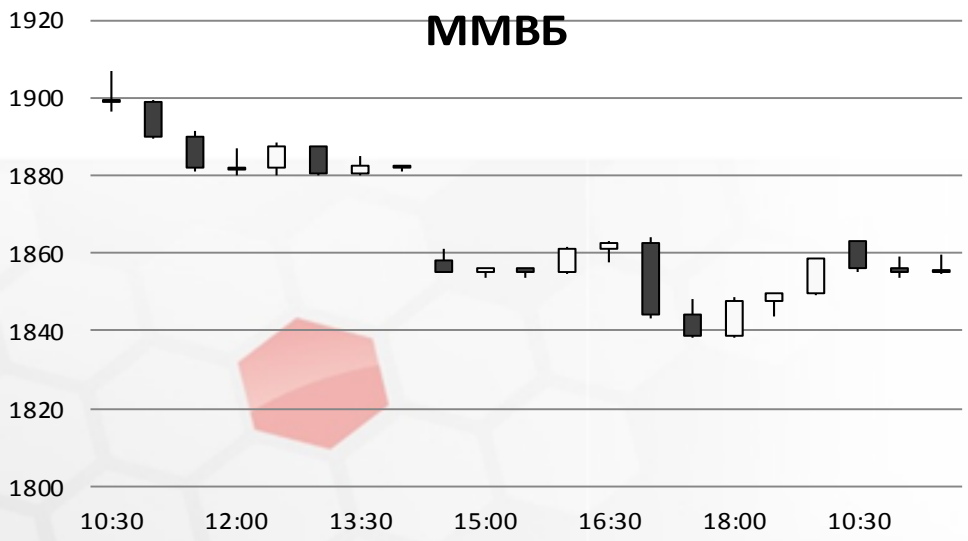
Валютный рынок

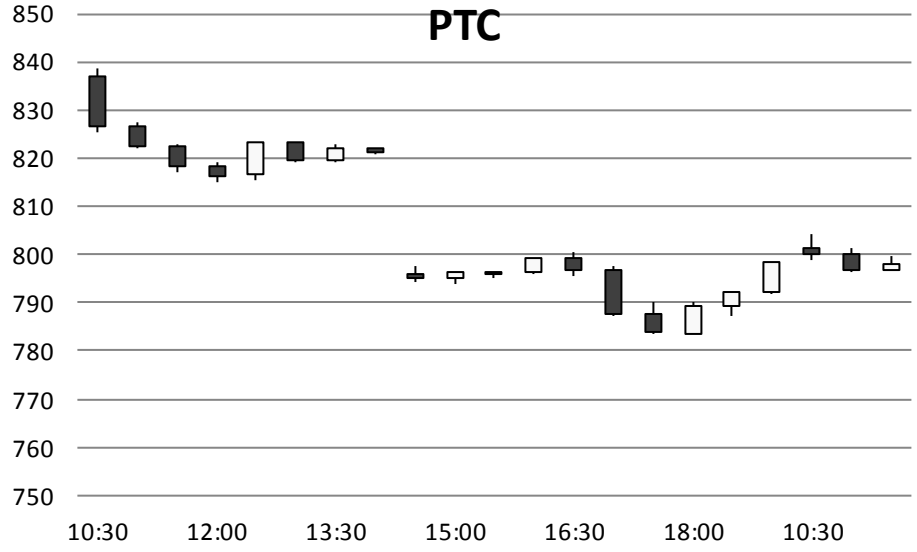


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

Дешевеющие акции российских сырьевых компаний оказывают давление на основные индексы. Индекс ММВБ теряет 1,5%, снижаясь до 1880 пунктов. Индекс РТС опустился на 2,2% до 821 пункта. Хуже рынка выглядят акции металлургических компаний на фоне коррекции цен в промышленных металлах. Напомним, что в понедельник наблюдался рост цен на сталь в Китае на 20% на фоне ожиданий новых мер по стимулированию строительства в стране. Падение цен на нефть оказывает давление на котировки акций нефтегазовых компаний. Индекс ММВБ Нефти и Газа снижается на 1,3%.





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.