DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Азиатские индексы акций завершили торги в понедельник ростом, несмотря на публикацию слабой макроэкономической статистики в Китае. Индекс Shanghai composite по итогам дня вырос на 1,7%. Европейские индексы акций растут в начале торговой сессии в понедельник вслед за акциями банков.
- Согласно данным от Backer Hughes, количество действующих буровых установок в США снизилось до уровней декабря 2009 года. Выход этой статистики не оказал поддержки нефтяным контрактам, так как инвесторы опасаются роста добычи нефти в Иране.

Обзор макроэкономических событий

- Согласно еженедельному отчету от Baker Hughes, число буровых установок по добыче сырой нефти в США сократилось двенадцатый раз подряд на прошлой неделе на 6 шт. до 386, что является минимальным значением с декабря 2009 года. Количество горизонтальных скважин сократилось на 24 шт. Несмотря на продолжающееся снижение буровых в США цены на нефть марки Brent не изменились с конца прошлой торговой недели и колеблются у отметки $40. Давление на нефтяные контракты оказывали опасения, что встреча членов ОПЕК с представителями основных нефтедобывающих стран, которая состоится 21 марта, пройдет без участия Ирана. В выходные министр нефти Ирана заявил, что страна не будет замораживать добычу до тех пор, пока не восстановиться добыча нефти до предсанкционных уровней - 4 млн. барр. в сут. На текущий момент Иран добывает 3 млн. барр. По нашим расчетам, сланцевые нефтедобытчики в США по итогам года сократят добычу на 500-600 тыс. барр. Это значит, что рост добычи со стороны Ирана приведет лишь к росту переизбытка предложения сырья на мировом рынке. Мы ожидаем, что цены на нефть будут снижаться к концу текущей недели на фоне укрепления доллара и роста опасений, что меры по заморозке добычи нефти различными странами не приведут к стабилизации цен.

Обзор макроэкономических событий

- Азиатские индексы акций завершили торговую сессию в понедельник уверенным ростом, несмотря на публикацию слабой макроэкономической статистики в Китае. По данным Национального Бюро Статистики, темпы роста промышленного производства в январе замедлились до 5,4% г/г, что оказалось хуже ожиданий рынка. Текущие темпы промышленного производства соответствуют уровням ноября 2008 года. Также ниже ожиданий рынка оказались данные по розничным продажам и составили лишь 10,2% г/г. Причиной роста азиатских индексов стали высказывания представителей финансовых регуляторов, в которых было указано о поддержке китайских банков с плохими кредитными портфелями.

Ожидаемая статистика

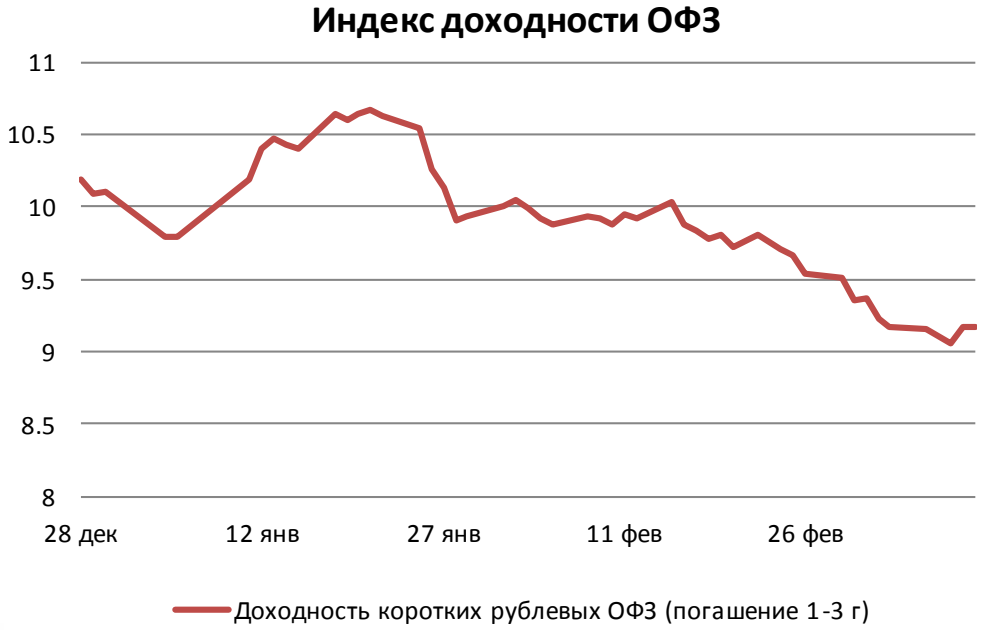
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
14.03.2016	13:00	Промышленное производство, с уч. сез. (м/м)	Еврозона	январь	--	-1,00%
	13:00	Промышленное производство, с уч. раб. дн. (г/г)	Еврозона	январь	--	-1,30%
15.03.2016	7:30	Промышл. производство (м/м)	Япония	январь	--	3,70%
	7:30	Пром. производство (г/г)	Япония	январь	--	-3,80%
	7:30	Загрузка мощностей (м/м)	Япония	январь	--	-1,00%
	8:30	Заседание банка Японии	Япония	март	-0,10%	-0,10%
	10:45	ИПЦ (мм)	Франция	февраль	--	0,20%
	10:45	ИПЦ (г/г)	Франция	февраль	--	-0,20%
	10:45	ИПЦ, искл. табачные изделия	Франция	февраль	--	99,07
	13:00	Занятость (кв/кв)	Еврозона	4К2015	--	0,30%
	13:00	Занятость (г/г)	Еврозона	4К2015	--	1,10%
	15:30	Розничные продажи, изм. (м/м)	США	февраль	0,10%	0,20%
	15:30	Розничные продажи, искл. автомоб. (м/м)	США	февраль	-0,10%	0,10%
	15:30	Розничные продажи, искл. автомоб. и бенз.	США	февраль	0,20%	0,40%
	15:30	ИЦП, искл. пищ. и энерг. пром (г/г)	США	февраль	1,10%	0,60%
	15:30	ИЦП, искл. питание, энерг. (гг)	США	февраль	--	0,80%
	15:30	Производственный инд. Empire Manufacturing	США	март	-10	-16,64
	17:00	Товарные запасы	США	январь	0,00%	0,10%
	23:00	Чистый об. покупок долгосрочных ЦБ США	США	январь	--	-$114.0b

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

На российском рынке облигаций продолжает наблюдаться спрос, несмотря на падающий курс рубля против доллара. Страховка от риска банкротства облигаций CDS 5y снизилась до минимальных значений текущего года и составила 272,87 пункта. Суверенные еврооблигации с погашением в 2042 году не изменились в цене и торгуются с доходностью 5,625%.



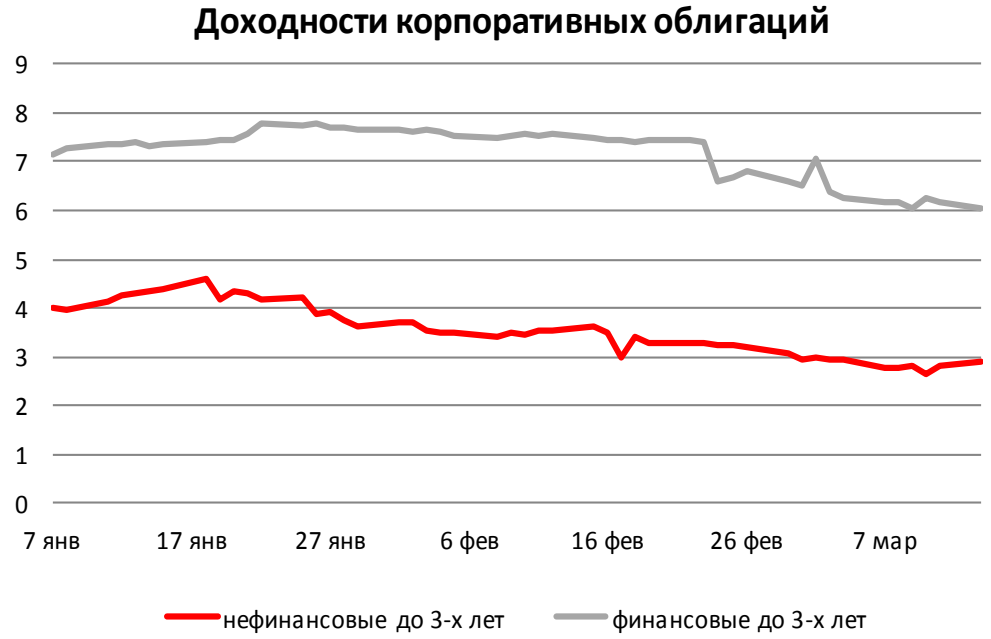


Источник: Bloomberg

Валютный рынок

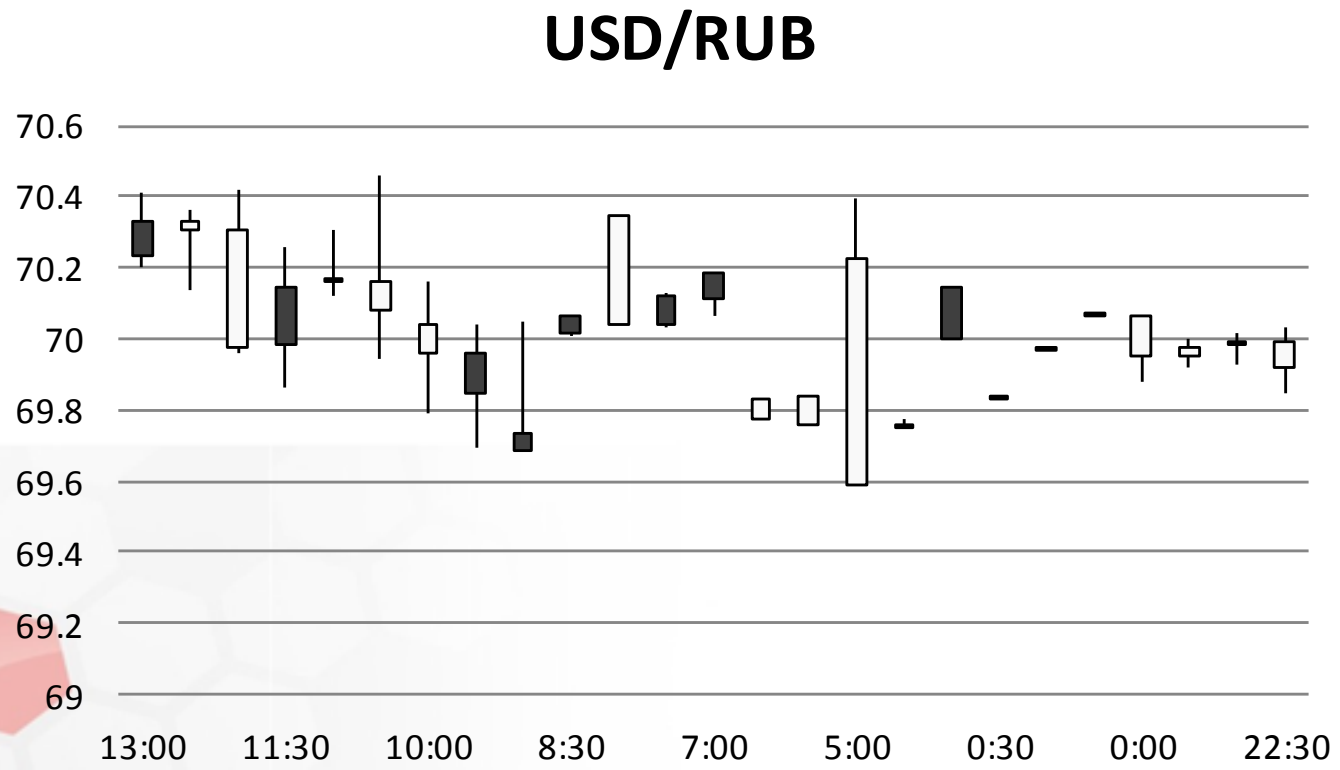
Курс рубля относительно доллара с начала валютных торгов на ММВБ снизился на 43 копейки до 70,3160 руб./долл., не удержавшись у своих максимумов текущего года. На фоне падения цен на нефть марки Brent ниже отметки $40.

Долларовая корзина валют DXY незначительно растет на ожиданиях ужесточения денежно-кредитной политики в США. Курс японской иены колеблется относительно доллара на отметке 113,5 перед заседанием Банка Японии, которое состоится во вторник .



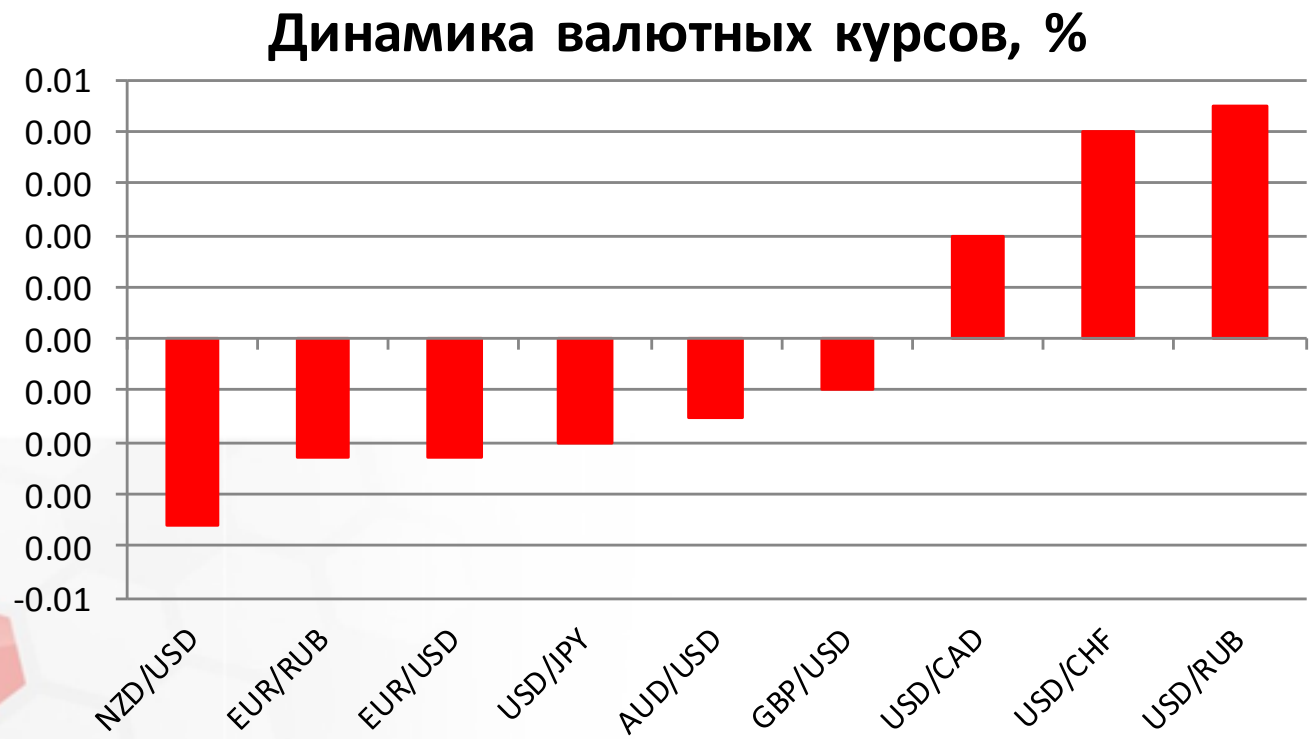
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

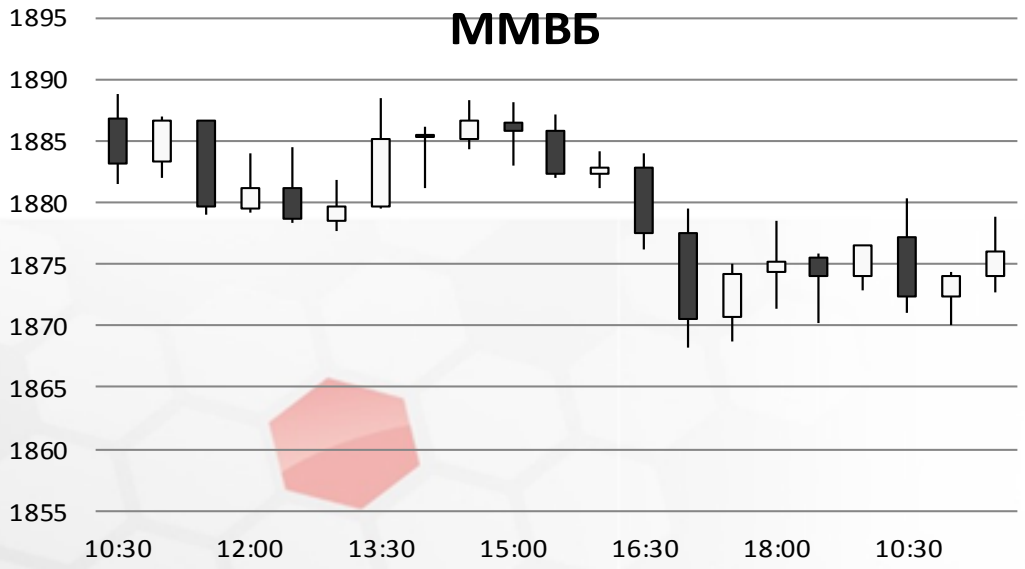
Валютный рынок

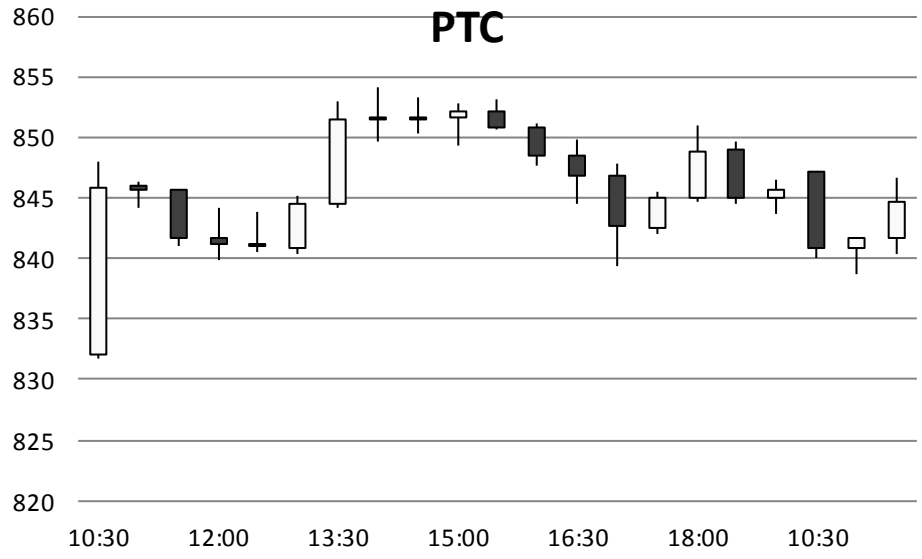


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

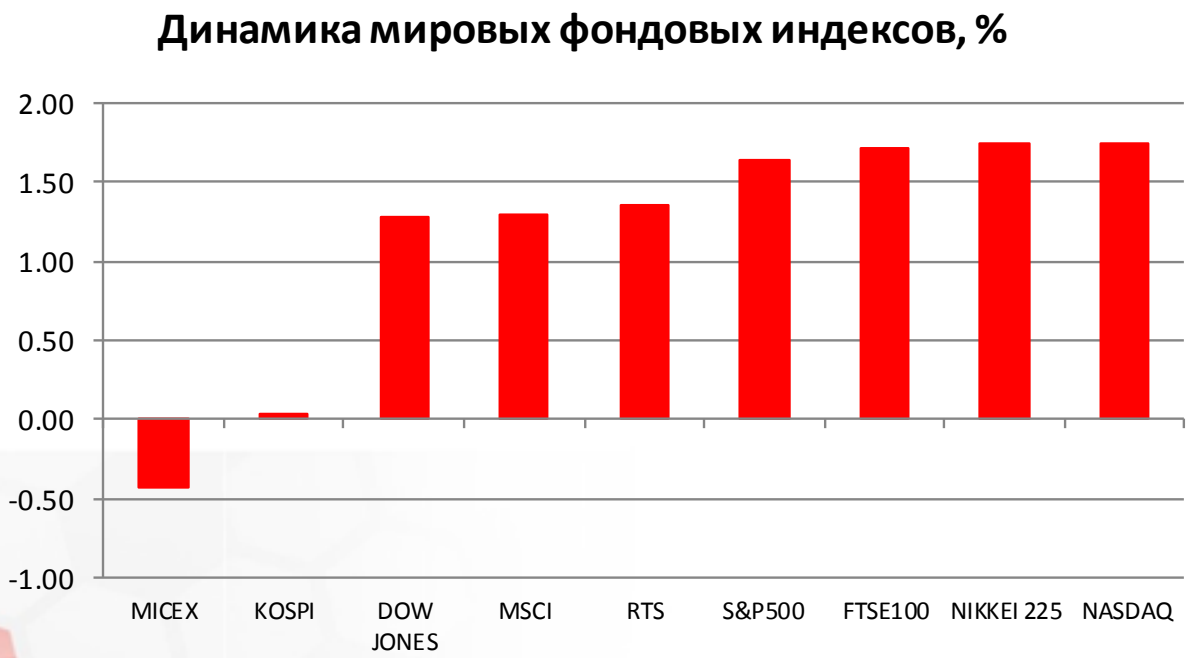
Российские индексы акций снижаются по итогам первой половины торговой сессии в понедельник на фоне падения цен на нефть и ослабления российской валюты. Индекс ММВБ теряет 0,8%, опустившись до отметки 1862 пункта. Индекс РТС снизился на 1,3% до 835 пунктов. Ослабление рубля оказывает поддержку акциям металлургических компаний. Также в лидерах роста оказались акции «Башнефти» после публикации финансовых результатов за 2015 год. Чистая прибыль компании выросла на 35% г/г за отчётный период.





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.