DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Цены на нефть марки Brent снижаются второй день подряд на ожиданиях увеличения добычи сырья в США. Стоимость барреля марки опустилась за последние сутки на 1,5% до $51,2. Падение цен на нефть негативно сказалось на курсе рубля относительно доллара и стоимости акций нефтегазовых компаний.
- Согласно сообщениям СМИ, фонды, ориентированные на инвестиции в акции российских эмитентов, привлекли $80 млн. Это максимальных приток средств в акции с конца марта.
- На российском рынке облигаций царит затишье в ожидании итогов заседания ЦБ РФ, которое завершится сегодня днем.

Обзор макроэкономических событий

- Второй день подряд цены на нефть снижаются на опасениях роста добычи в США, отыгрывая публикацию данных от Минэнерго США в среду о росте добычи впервые за несколько месяцев. На текущий момент инвесторы опасаются, что сегодня нефтесервисная компания Baker Hughes вновь отчитается о росте числа буровых установок по добыче нефти в США за неделю. Напомним, что неделю назад прирост установок по добыче нефти составил 9 шт., увеличившись до 325 шт. В случае роста данного показателя мы ожидаем продолжения падения цен на нефть в начале следующей недели. Вслед за товарными контрактами на текущий момент снижаются акции как металлургических, так и нефтегазовых компаний. Данное снижение мы расцениваем как фиксацию прибыли в активах, которые сильно выросли за последние 2 недели.
- Согласно сообщениям СМИ, фонды, ориентированные на инвестиции в акции российских эмитентов, привлекли $80 млн. Это максимальный приток средств в акции с конца марта. С начала года суммарный отток составил $156 млн. Возвращение инвесторов, на наш взгляд, было обусловлено резким ростом привлекательности высоко рискованных активов на фоне публикации слабых данных по рынку труда США неделю назад. В ближайшие пять торговых дней мы не ожидаем ускорения притока капитала в российские активы, так как участники рынка будут ожидать итогов заседания Комитета по операциям на открытом рынке США, которое завершится в среду.

Ожидаемая статистика

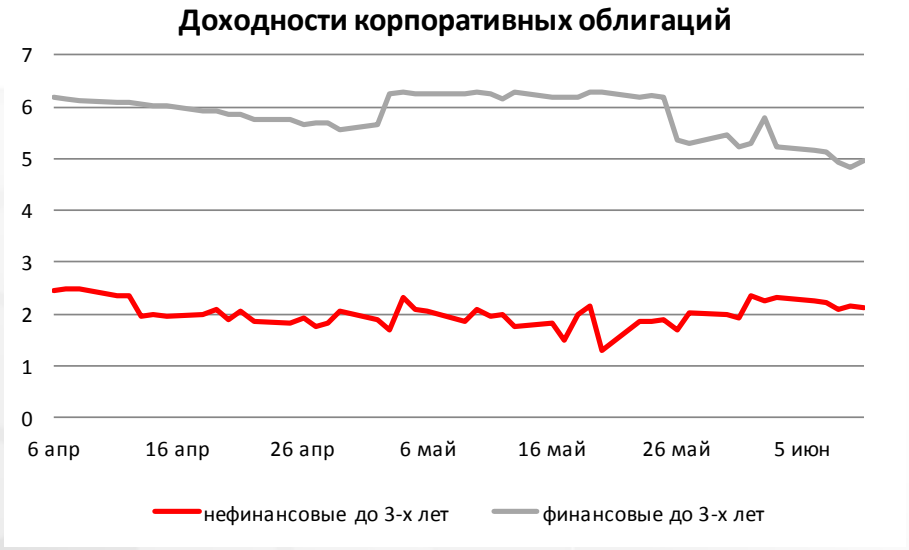
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
10.06.2016	3:00	Денежный агрегат M2	Китай	май	--	12,80%
	3:00	Новые кредиты	Китай	май	--	555,6 млрд
	3:00	Рост кредитов (г/г)	Китай	май	--	14,40%
	2:50	ИЦП (м/м)	Япония	май	--	-0,30%
	2:50	ИЦП (г/г)	Япония	май	--	-4,20%
	9:00	ИЦП (м/м)	Германия	май	--	--
	9:00	ИЦП (г/г)	Германия	май	--	--
	9:45	Промышл. производство (м/м)	Франция	апрель	--	-0,30%
	9:45	Пром. производство (г/г)	Франция	апрель	--	-0,80%
	11:00	Денежный агрегат в узк. опред.	Россия	неделя	--	--
	11:00	Промышл. производство (м/м)	Италия	апрель	--	0,00%
	11:00	Промышленное производство, с уч. раб. дн. (г/г)	Италия	апрель	--	0,50%
	11:30	Объем производства в строит. секторе (м/м)	Великобритания	апрель	--	-3,60%
	13:30	Ключ. ставка	Россия	июнь	10,50%	11,00%
	16:00	Экспорт	Россия	апрель	23.0b	23.0b
	16:00	Импорт	Россия	апрель	15.0b	15.3b
	16:00	Торговый баланс	Россия	апрель	8.1b	7.7b
	17:00	Индекс настроение потребителей от ун-та Мичигана	США	июнь	--	94,7

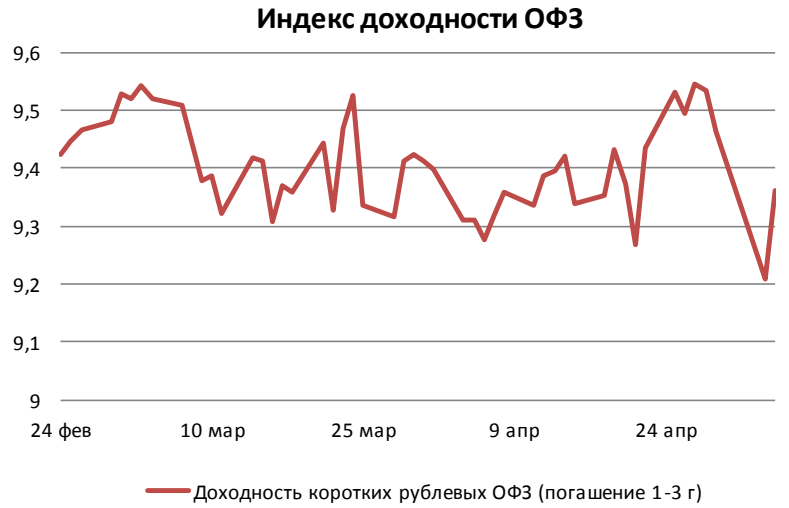
Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

На российском рынке облигаций царит затишье в ожидании итогов заседания ЦБ РФ, которое завершится сегодня днем. Котировки рублевых облигаций колеблются в узком диапазоне значений. ОФЗ торгуются с доходностью 8,5%-9%. Цены на валютные обязательства российских компаний перестали расти на фоне оттока ликвидности с рынка в ходе новых размещений за последнюю неделю на общую сумму $2 млрд.

Ключевым событием дня для рынка облигаций станут итоги заседания ЦБ РФ. Смягчение денежно-кредитной политики по итогам пятничного заседания ЦБ РФ может оказать поддержку акциям российских финансовых компаний. Ожидания дальнейшего снижения ключевой ставки будут приводить к падению доходности рублевых облигаций и способствовать росту спроса на российскую валюту.



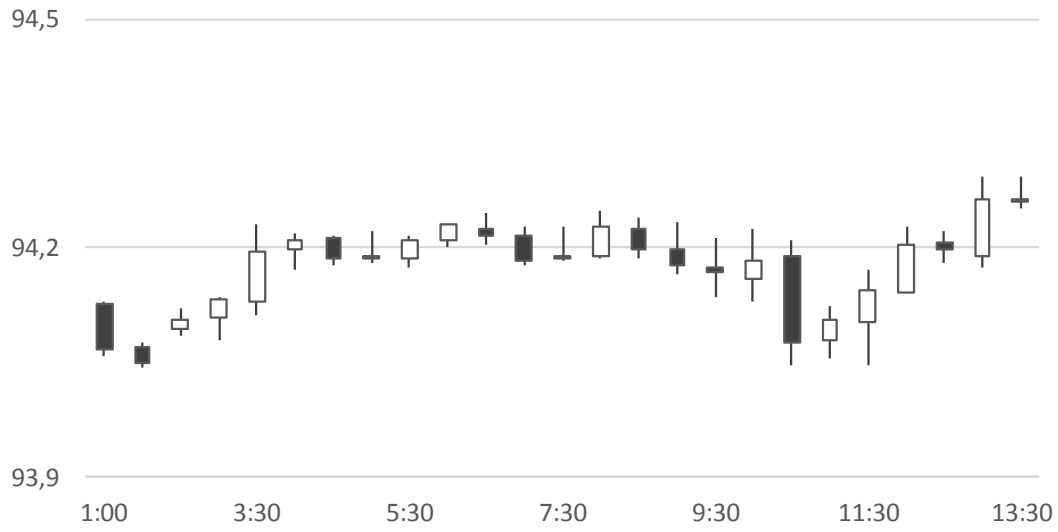


Источник: Bloomberg

Валютный рынок

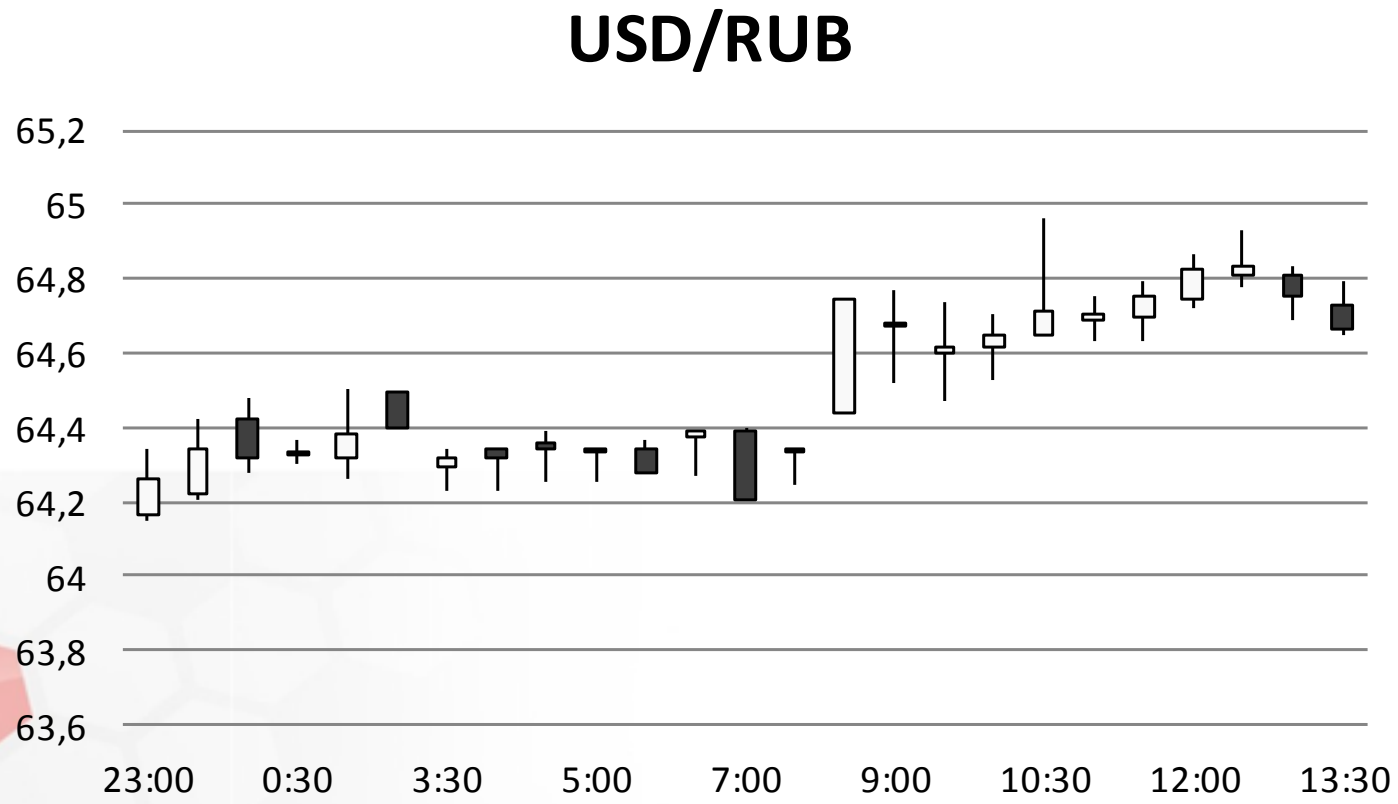
С начала валютных торгов на ММВБ курс рубля относительно доллара снизился на 40 копеек до 64,7325 руб./долл., оказавшись под давлением дешевеющей нефти. Долларовая корзина валют продолжает восстанавливаться второй день подряд на фоне публикации позитивной статистики по количеству обратившихся за пособием по безработице в США, которая оказалась меньше ожиданий рынка.

Индекс доллара США



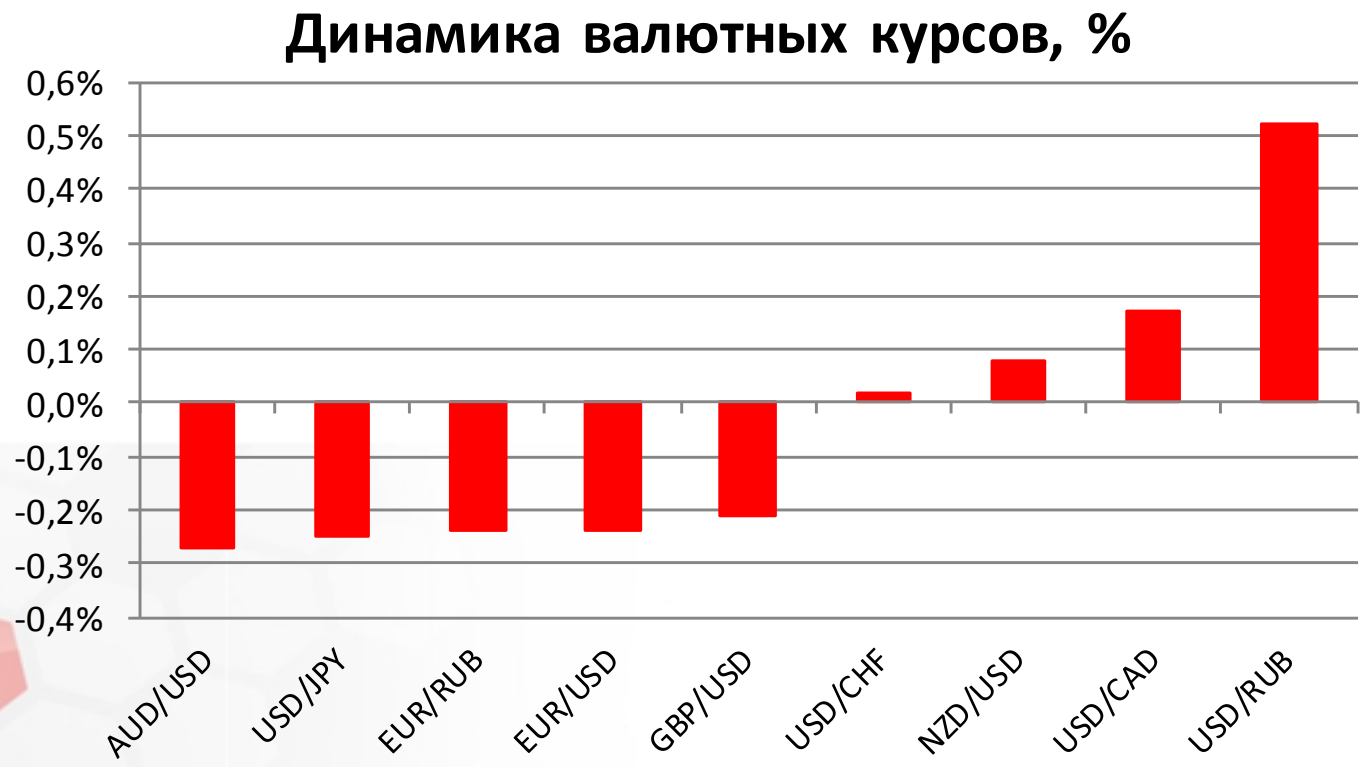
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

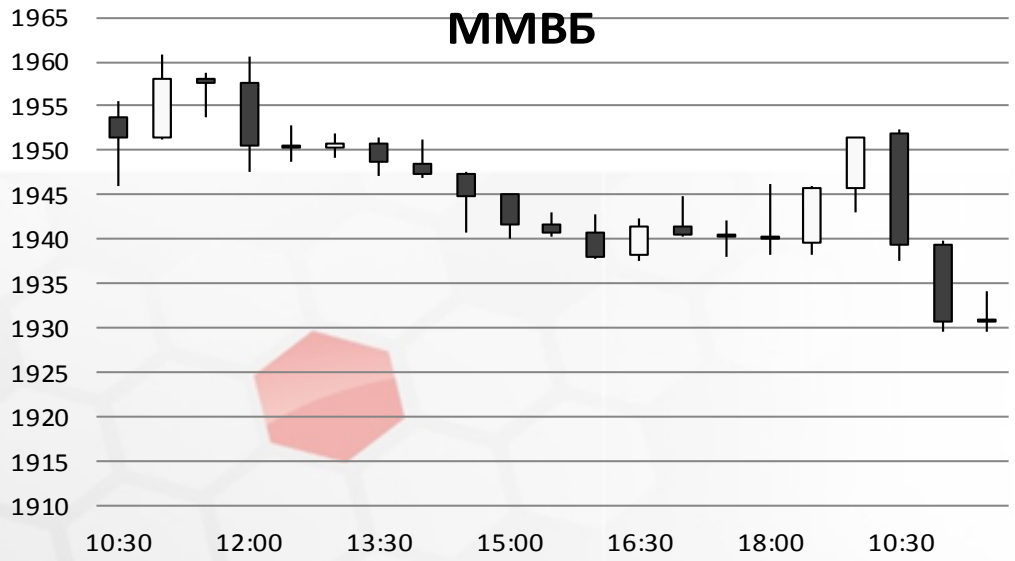
Валютный рынок

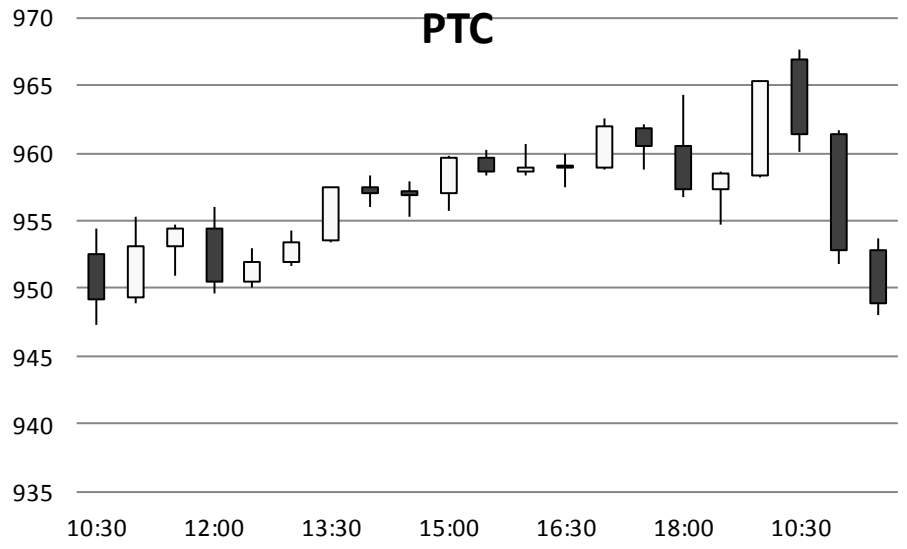


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

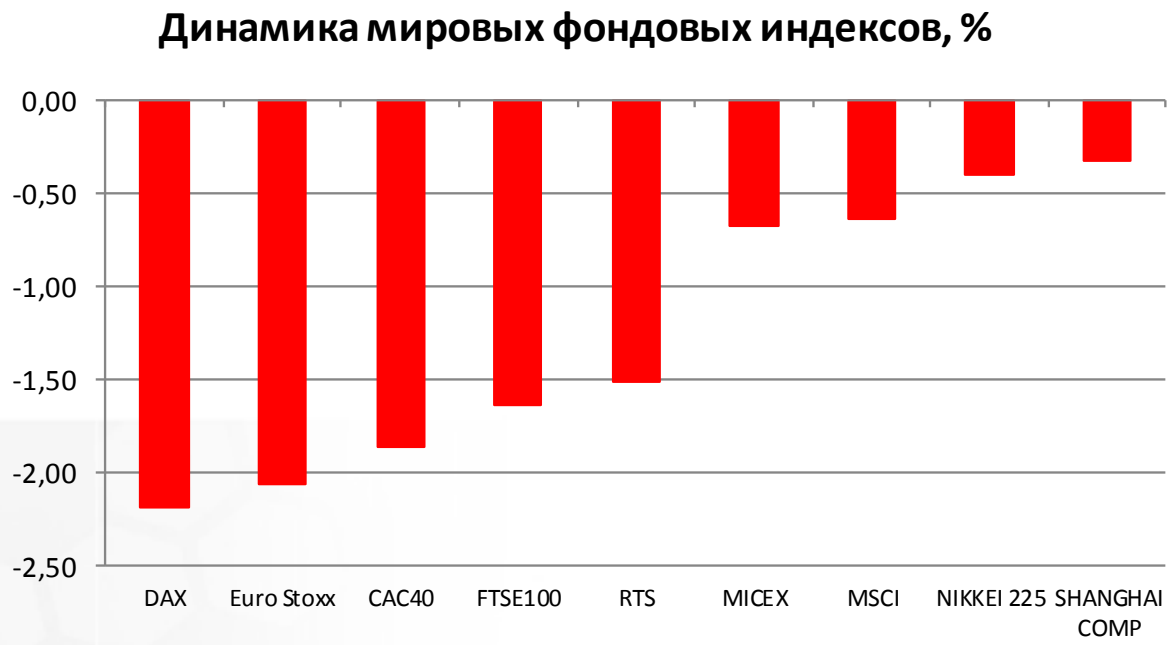
На текущий момент российские индексы акций снижаются вслед за акциями банков и сырьевых компаний. В лидерах падения оказались бумаги «Сбербанка» на фоне предстоящего закрытия реестра акционеров на выплату дивидендов по итогам 2015 года. Сегодня акции банка уже торгуются «без дивидендов». Спрос наблюдается лишь в акциях розничных сетей и электроэнергетических компаний, которые росли с начала года хуже рынка. На текущий момент индекс ММВБ теряет 0,7%, снизившись до 1921 пункта. Индекс РТС опустился на 1,6% до 935 пунктов.





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.