DUKASCOPY
Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика



Кратко о главном

- Пятый день подряд европейские индексы акций снижаются на фоне возросших опасений выхода Великобритании из состава ЕС. На текущий момент европейские индексы снижаются в среднем на 1%. В лидерах падения оказались акции сырьевых компаний, двигаясь вниз вслед за товарными контрактами. Цены на нефть марки Brent с конца прошлой торговой недели опустились на 2,5%, несмотря на снижение прогнозов со стороны Международного энергетического агентства. Доходности европейских гособлигаций снижаются на фоне бегства инвесторов в низкорискованные активы.

Обзор макроэкономических событий

- На глобальном рынке акций продолжается бегство инвесторов из высоко рискованных активов на фоне возросших опасений выхода Великобритании из ЕС. Напомним, что 23 июня должен состояться референдум, на котором британцы проголосуют либо за выход из ЕС, либо за сохранение страны в составе Союза. На текущий момент вероятность выхода Великобритании из ЕС оценивается рынком на уровне 32%. Причем данный показатель резко вырос за последние три дня на фоне итогов телефонных опросов британцев, проведенных рядом информационных агентств, по итогам которых можно сделать вывод, что около 50% жителей страны собирается голосовать за выход из состава ЕС. Доля сторонников сохранения Великобритании в составе ЕС оценивается на уровне 40%.
- Цены на нефть в период длительных выходных в РФ снизились с конца прошлой торговой недели на 2,5% из-за закрытия длинных позиций и фиксации прибыли перед референдумом. Также давление на нефть оказала статистика от Baker Hughes, согласно которой вторую неделю подряд наблюдается увеличение количества буровых установок в США по разработке нефтяных месторождений, число которых увеличилось на 3 шт до 328. Поддержку контрактам не оказал выход нового прогноза потребления от Международного энергетического агентства, согласно которому баланс спроса и предложения на глобальном рынке нефти наступит уже в 2017 году.

Ожидаемая статистика

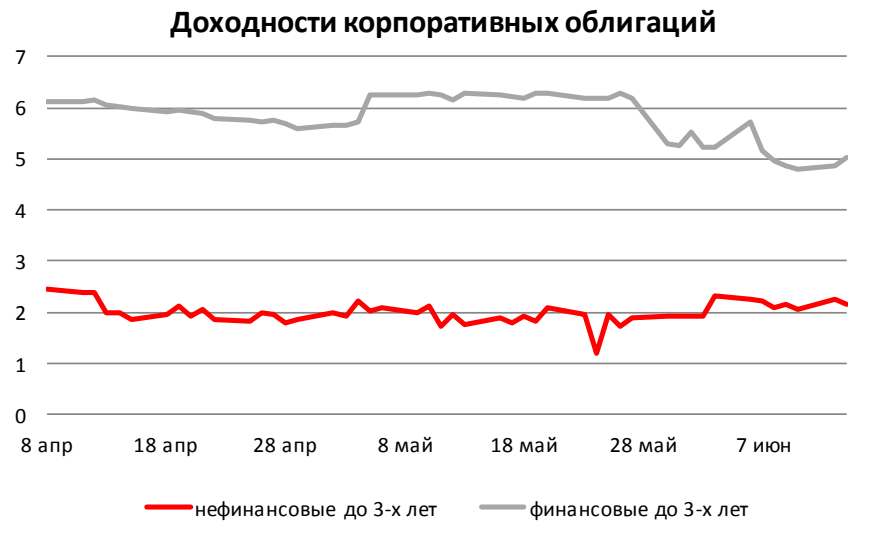
Дата	Время	Событие	Страна	Период	Прогноз	Пред.
14.06.2016	7:30	Промышл. производство (м/м)	Япония	апрель	--	0,30%
	7:30	Промышл. производство (г/г)	Япония	апрель	--	-3,50%
	7:30	Загрузка мощностей (м/м)	Япония	апрель	--	3,20%
	11:30	ИПЦ (м/м)	Великобритания	май	0,30%	0,10%
	11:30	ИПЦ (г/г)	Великобритания	май	0,40%	0,30%
	12:00	Промышленное производство, с уч. сез. (м/м)	Еврозона	апрель	0,80%	-0,80%
	12:00	Промышленное производство, с уч. раб. дн. (г/г)	Еврозона	апрель	1,40%	0,20%
	12:00	Занятость (кв/кв)	Еврозона	1К16	--	0,30%
	12:00	Занятость (г/г)	Еврозона	1Q	--	1,20%
	15:30	Индекс цен на импорт (м/м)	США	май	0,70%	0,30%
	15:30	Индекс цен на импорт (г/г)	США	май	-5,90%	-5,70%
	15:30	Розничные продажи, изм. (м/м)	США	май	0,30%	1,30%
	15:30	Розничные продажи, искл. автомоб. (м/м)	США	май	0,40%	0,80%
	15:30	Розничные продажи, искл. автомоб. и бенз.	США	май	0,30%	0,60%
	17:00	Товарные запасы	США	апрель	0,20%	0,40%

Источник: Bloomberg

Долговой рынок России

Внешний негативный фон, сложившийся из снижающихся цен на нефть и дешевеющего рубля, оказывает давление на стоимость рублевых ОФЗ. Также инвесторы закрывают длинные позиции в рублевых облигациях по итогам заседания ЦБ РФ. Участники торгов не ожидают в среднесрочной перспективе смягчения денежно-кредитной политики в РФ. Стоимость CDS по 5-летним корпоративным облигациям российских эмитентов растет и достигла 264 б.п. поднявшись за последнюю неделю на 11%.

Доходность 10-летних гособлигаций Германии впервые в истории опустилась ниже 0%, что означает, что инвесторы готовы платить премию за сохранность средств в низкорискованных активах на фоне возрастающих опасений выхода Великобритании из состава ЕС.

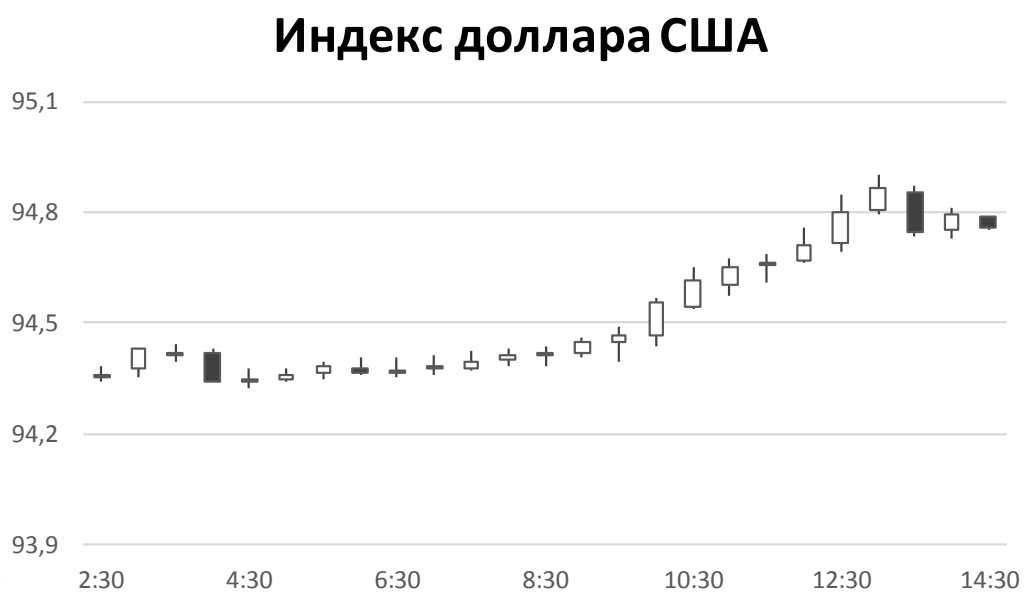




Источник: Bloomberg

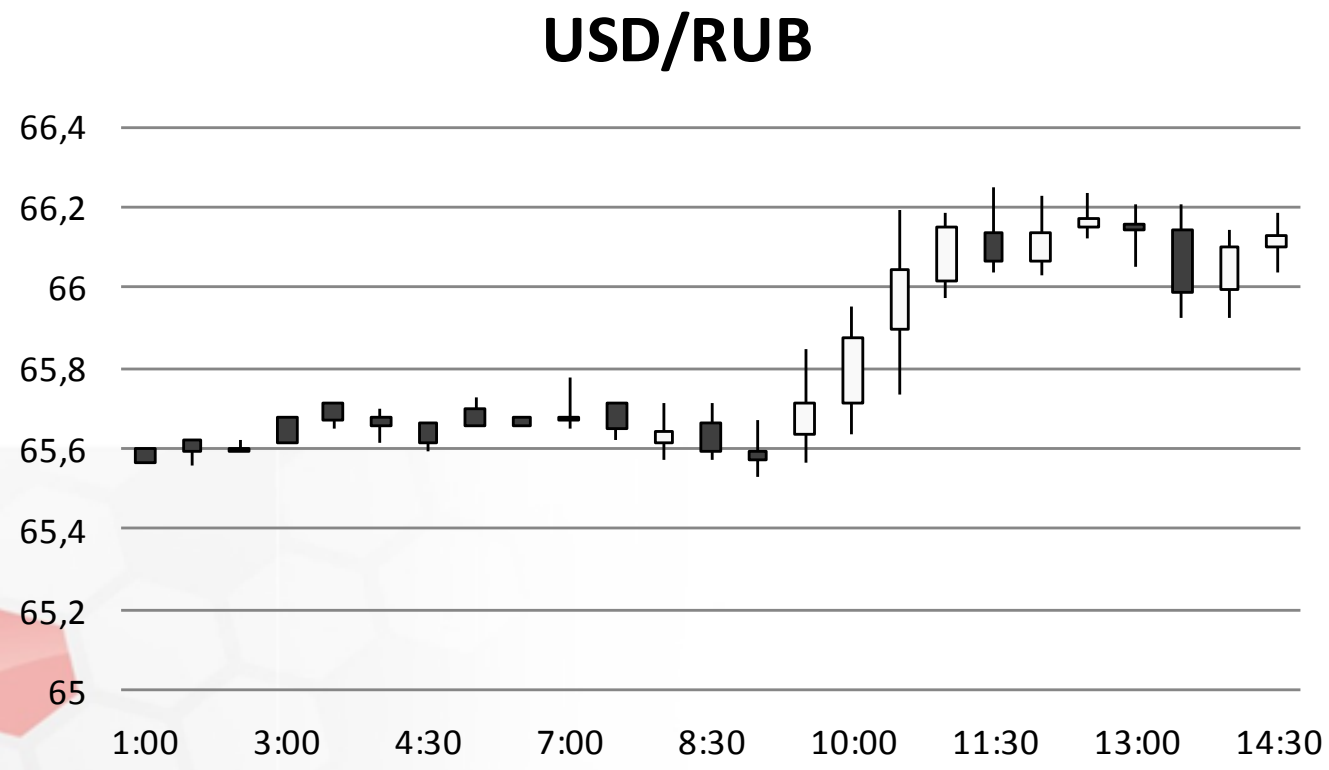
Валютный рынок

Вслед за ценами на нефть курс рубля снижается, опустившись с начала валютных торгов на ММВБ на 77 копеек до 66,05 руб./долл. Долларовая корзина валют DXY продолжает восстанавливаться после обвала в начале месяца, достигнув отметки 94,85 пунктов. В целом волатильность на валютном рынке низкая из-за ожиданий итогов двухдневного заседания Комитета по операциям на открытом рынке США, которое стартует сегодня. Завтра завершатся заседания трех Центробанков, которые могут оказать сильное влияние на валютные пары.



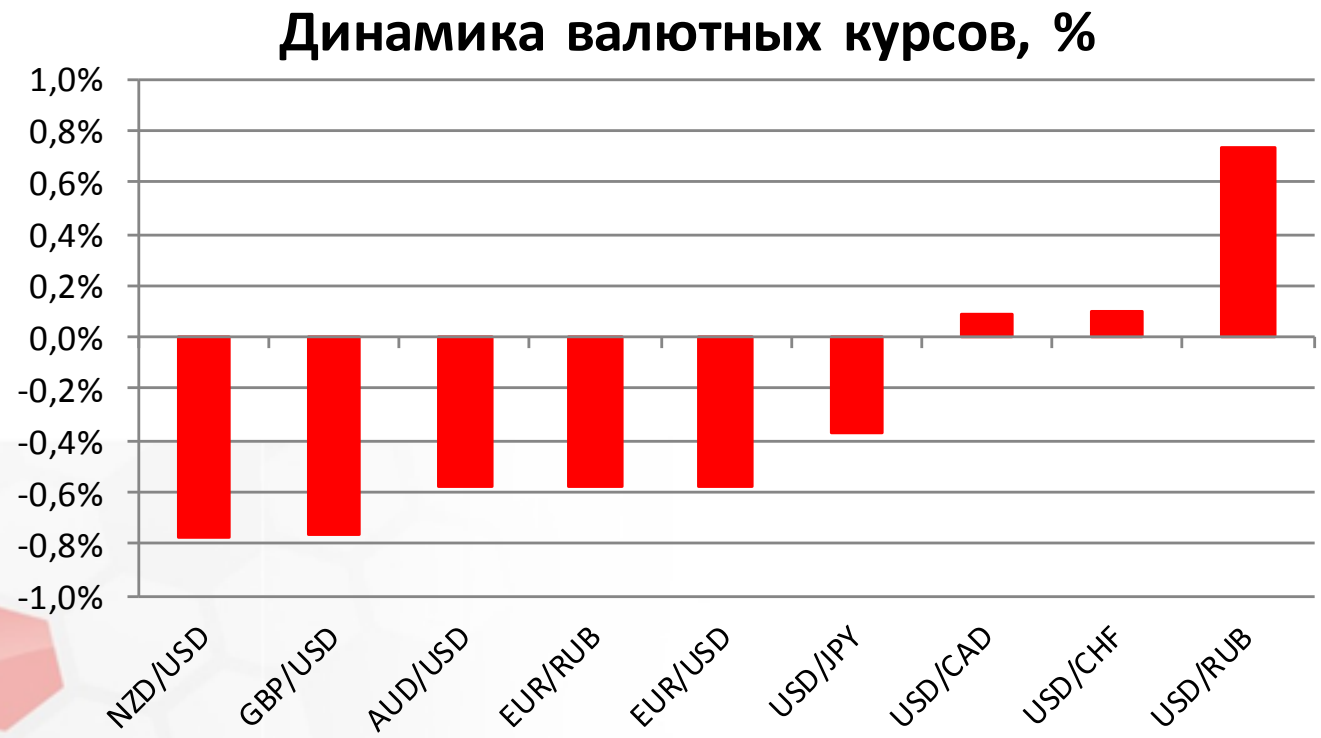
Источник: Bloomberg

Валютный рынок



Источник: Bloomberg

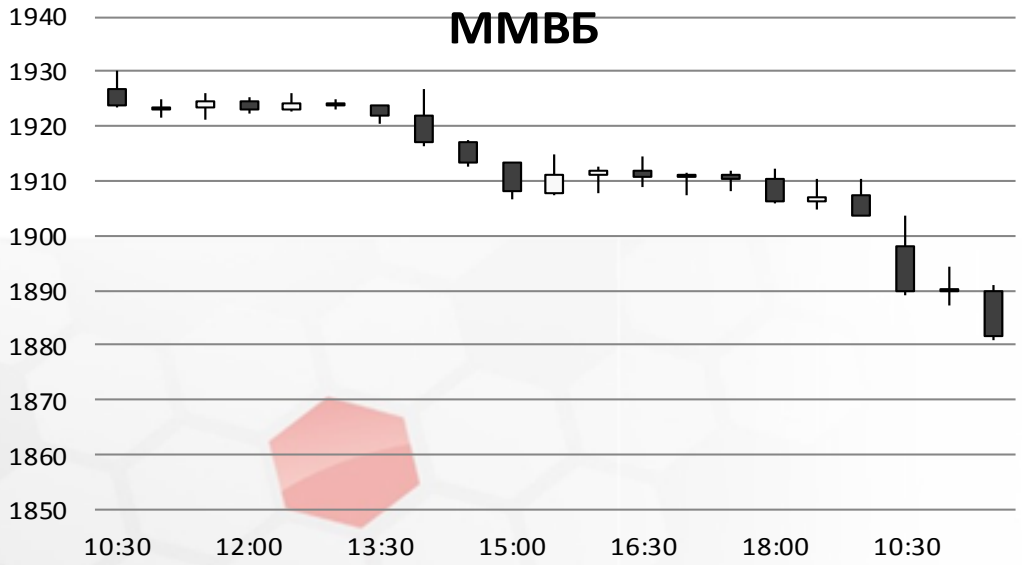
Валютный рынок

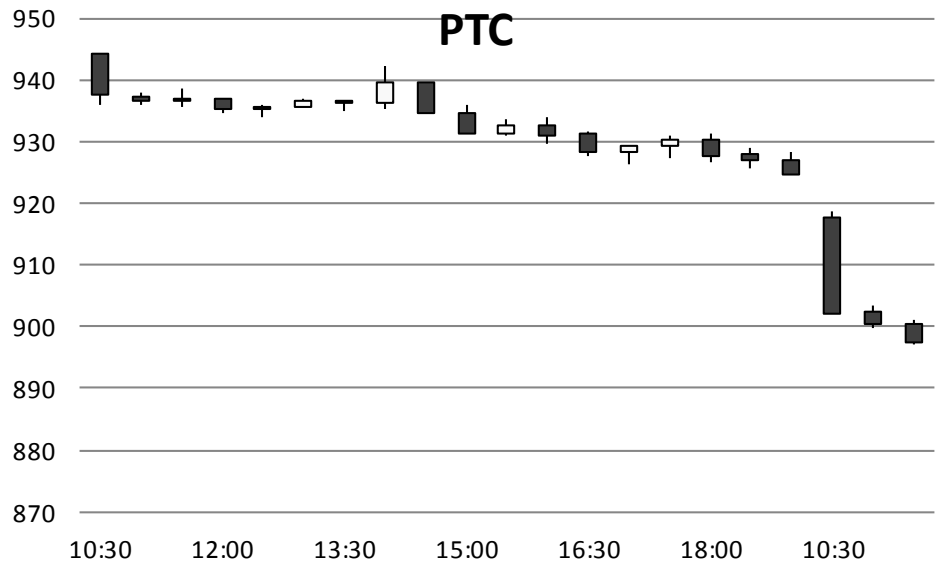


Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

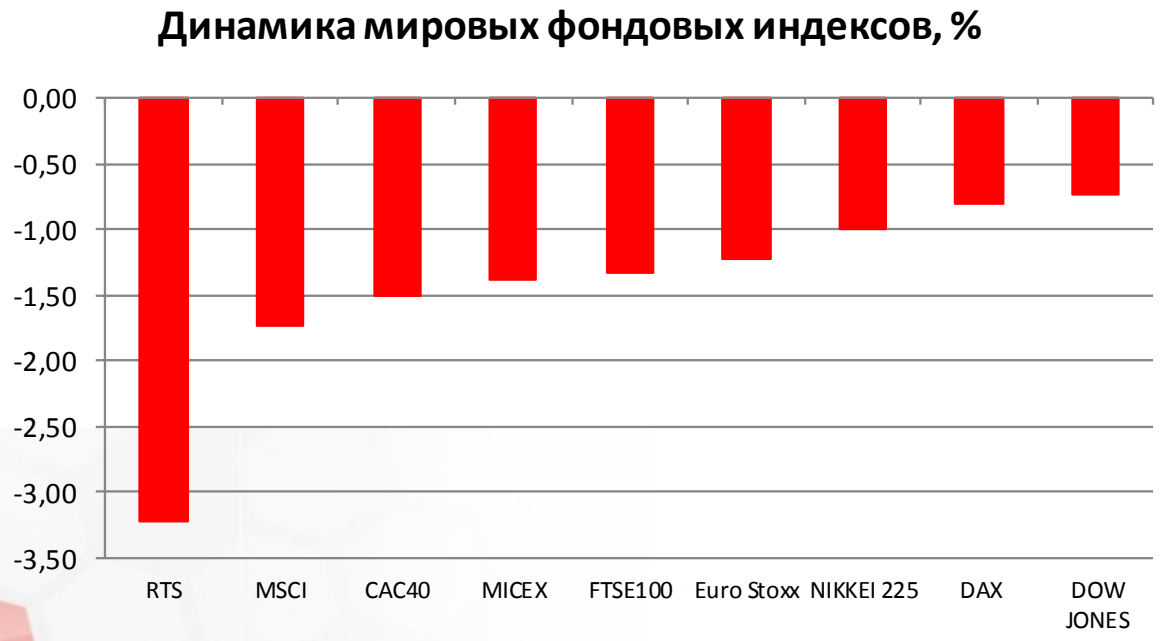
Индекс ММВБ снижается на 1,3%, опустившись до отметки 1878 пунктов на фоне распродаж в акциях крупных российских банков и нефтегазовых компаний. Индекс РТС снизился ниже отметки 900 пунктов, теряя на текущий момент 3.3%.





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.