



Swiss Forex Bank & Marketplace

Ежедневная Аналитика

Кратко о главном

Нефтяные контракты резко обвалились после заявлений министра энергетики Саудовской Аравии о возможности нарастить добычу на 2 млн. Несмотря на падение нефти, курс рубля лишь незначительно падает относительно доллара США. В целом на глобальном рынке акций сегодня преобладают продажи, вызванные ростом геополитических рисков.

Обзор макроэкономических событий

Уже через две недели в США состоятся промежуточные выборы в США, в ходе которых будет полностью переизбрана палата представителей США и треть сенаторов. На фоне активизировавшейся политической конкуренции между двумя основными партиями США со стороны Дональда Трампа уже последовали предвыборные обещания, которые насторожили инвесторов. Президент США пообещал, что после выборов в Сенат Республиканская партия подготовит пакет законопроектов, направленных на снижение долговой нагрузки на 10%. Снижение налоговых сборов может еще больше увеличить дефицит федерального бюджета, который увеличился по сравнению с прошлым годом на 18% до \$208 млрд. Новые инициативы Дональда Трампа могут сильно повлиять на размер налоговых сборов, так как в 2017 году 80% из этих сборов приходилось на поступления от прибыли домохозяйств и налогов с заработной платы. Новый план Дональда Трампа может быть объявлен уже через неделю.

Неожиданные действия президента США отразились на динамике индексов акций по всему миру. Индексы азиатских и европейских стран снижаются в среднем на 1-3%. Дополнительное давление оказывает падение котировок бумаг нефтегазовых компаний, снижающихся вслед за ценами на нефть. Нефтяные контракты резко снизились на высказываниях министра энергетики Саудовской Аравии Халида аль-Фалиха, заявившего, что страна готова нарастить объемы суточной добычи на 20% до 12 млн баррелей. Это существенно снижает риски возникновения дефицита на глобальном рынке нефти после вступления в силу американских санкций против иранского нефтегазового сектора. Стоимость барреля нефти марки Brent за последние сутки снизилась 1,9%, обновив минимумы последнего месяца.

Ожидаемая статистика

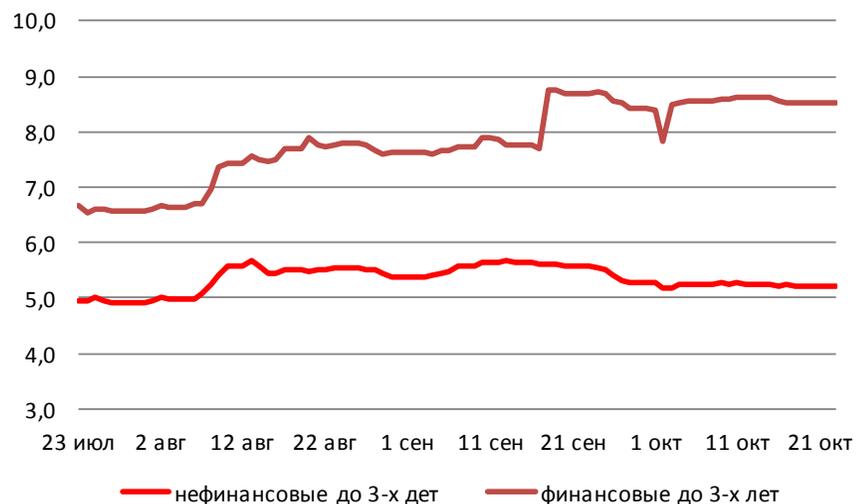
Дата	Время	Событие	Страна/регион	Период	Обз(Мд)	Пред.
23.10.2018	9:00	Заказы станков (г/г)	Япония	сентябрь	--	2.8%
	9:00	ИЦП (м/м)	Германия	сентябрь	0.3%	0.3%
	9:00	ИЦП (г/г)	Германия	сентябрь	3.0%	3.1%
	17:00	Инд. произв. активности ФРБ Ричмонда	США	октябрь	24	29
	17:00	Потребительская уверенность	Еврозона	октябрь	-3.2	-2.9
24.10.2018	9:45	Деловая уверенность	Франция	октябрь	106	106
	9:45	Произв. уверенность	Франция	октябрь	107	107
	10:15	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Франция	октябрь	52.4	52.5
	10:15	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Франция	октябрь	54.7	54.8
	10:15	Композитный индекс PMI	Франция	октябрь	53.9	54.0
	10:30	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Германия	октябрь	53.4	53.7
	10:30	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Германия	октябрь	55.5	55.9
	10:30	Композитный индекс PMI	Германия	октябрь	54.8	55.0
	11:00	Индекс деловой активности PMI в сфере произ-ва	Еврозона	октябрь	53.0	53.2
	11:00	Индекс деловой активности PMI в сфере услуг	Еврозона	октябрь	54.5	54.7
	11:00	Композитный индекс PMI	Еврозона	октябрь	53.9	54.1
	14:00	Заявки на ипотеку от МВА	США	неделя	--	-7.1%
	16:00	ИПЦ (нд/нд)	Россия	неделя	--	0.1%
16:00	ИПЦ, еженед. (с н.г.)	Россия	неделя	--	2.8%	
17:00	Продажи на первич. рынке жилья	США	сентябрь	625k	629k	
17:00	Продажи на первич. рынке жилья (м/м)	США	сентябрь	-0.6%	3.5%	
21:00	Отчет ФРС по экономической активности "Бежевая книга"	США	ноябрь			

Источник: Bloomberg

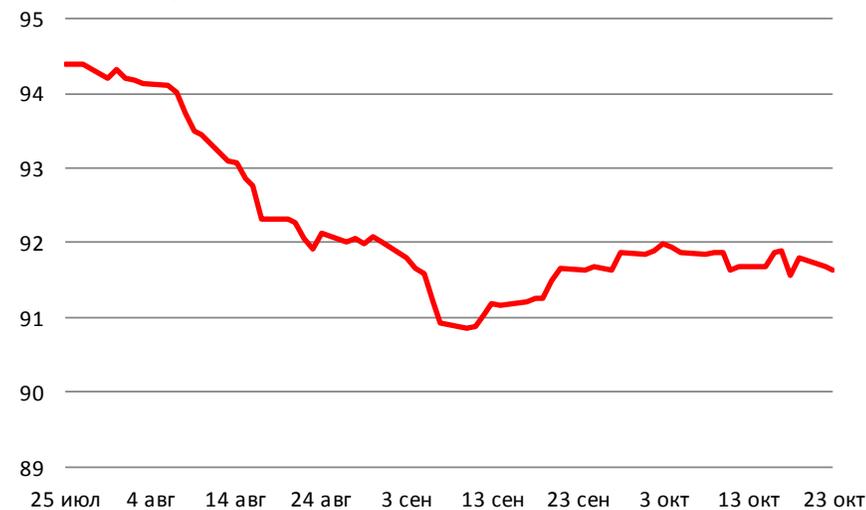
Долговой рынок России

В начале торговой сессии во вторник на рынке облигаций наблюдается резкое падение доходностей на фоне бегства инвесторов из рискованных активов. Доходность 10-летних UST снижается до 3,15%. В лидерах роста оказались госбонды Италии, доходность которых снижается в среднем на 3-6 п.п. Сегодня Еврокомиссия должна обсудить последнюю версию законопроекта госбюджета Италии на следующий год, предусматривающего дефицит бюджета в размере 2,4%. Сегодня Минфин РФ объявит параметры завтрашнего аукциона по размещению ОФЗ.

Доходности корпоративных облигаций



Ценовой индекс корпоративных долгов

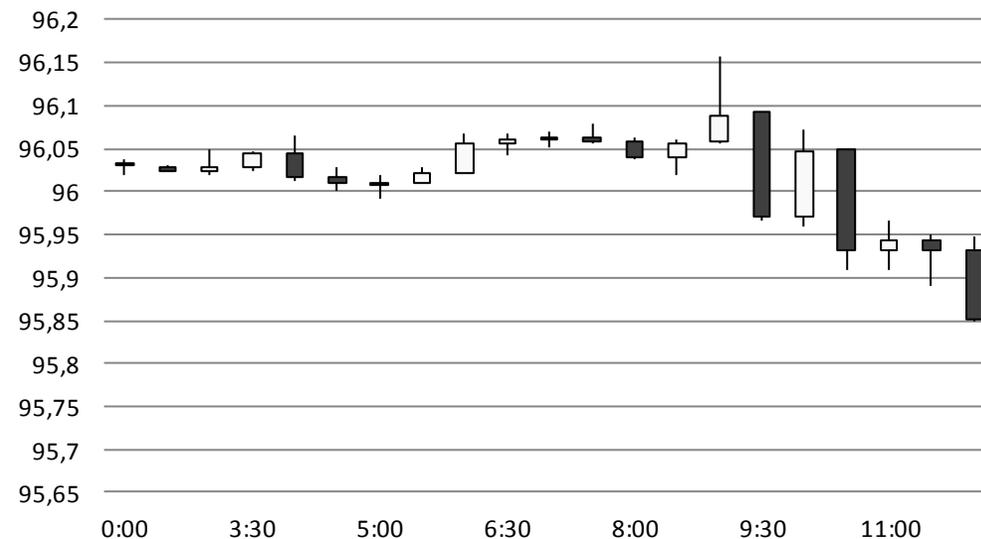


Источник: Bloomberg

Валютный рынок

Несмотря на резкое снижение нефтяных контрактов, курс рубля теряет лишь 11 копеек с начала дня, опустившись против американского доллара до 65,3675 руб./долл. Курс европейской валюты стабилизировался вблизи отметки 1,146 против доллара США. Курс китайского юаня колеблется у двухлетних максимумов против доллара США в преддверии выхода отчёта ФРС по состоянию экономической активности в США, который будет опубликован в среду вечером.

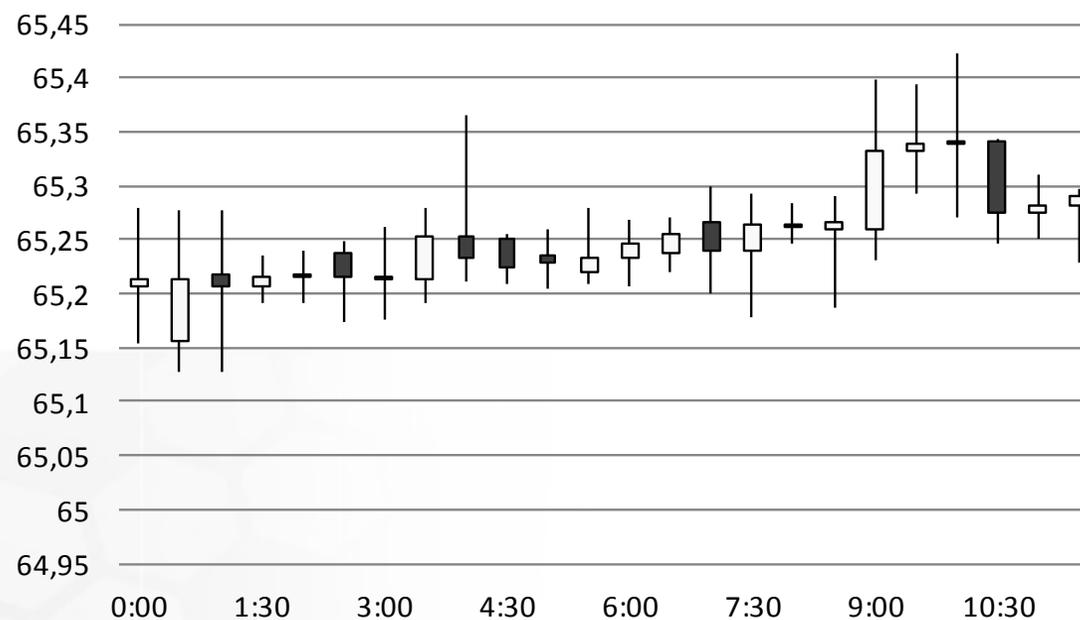
Индекс доллара США



Источник: Bloomberg

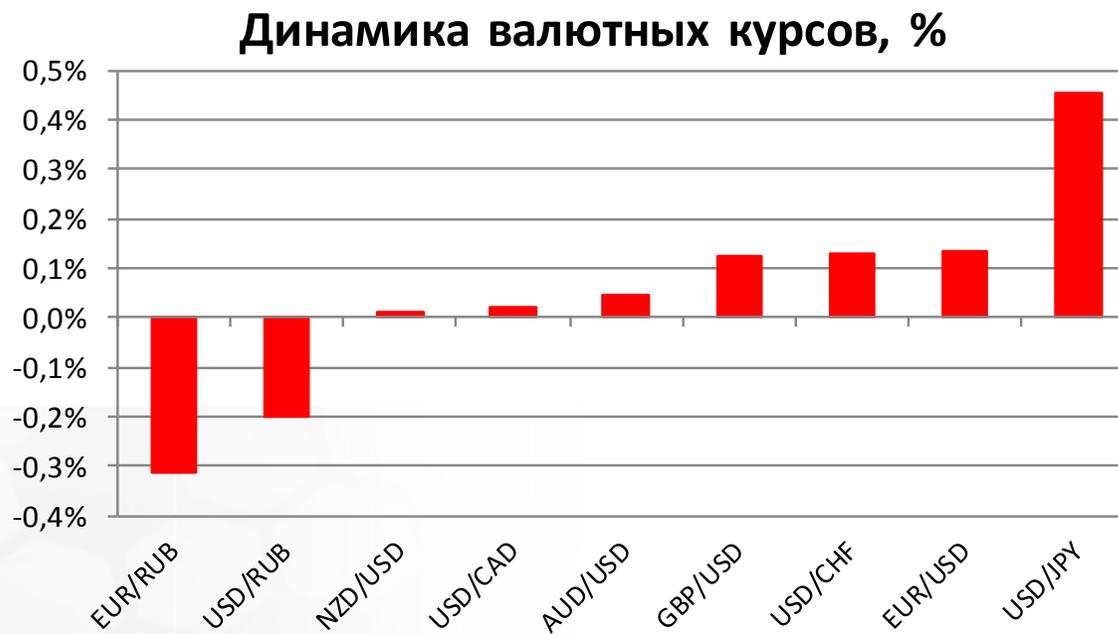
Валютный рынок

USD/RUB



Источник: Bloomberg

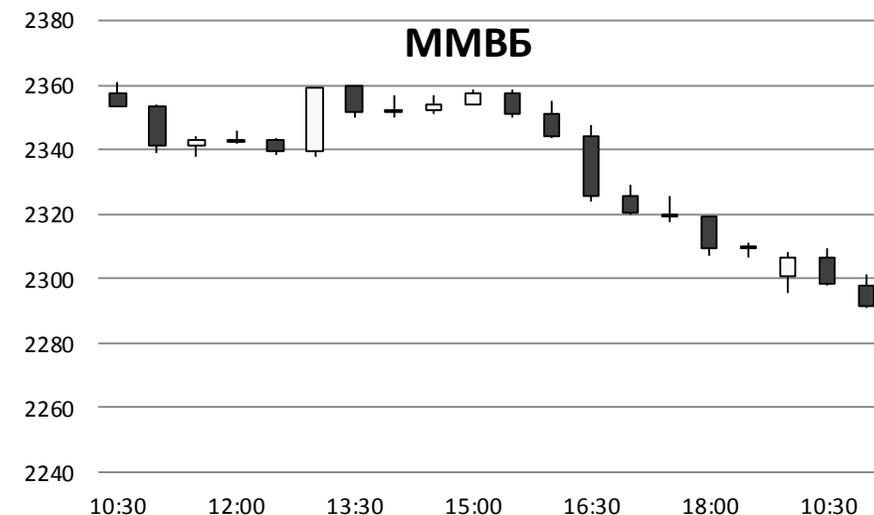
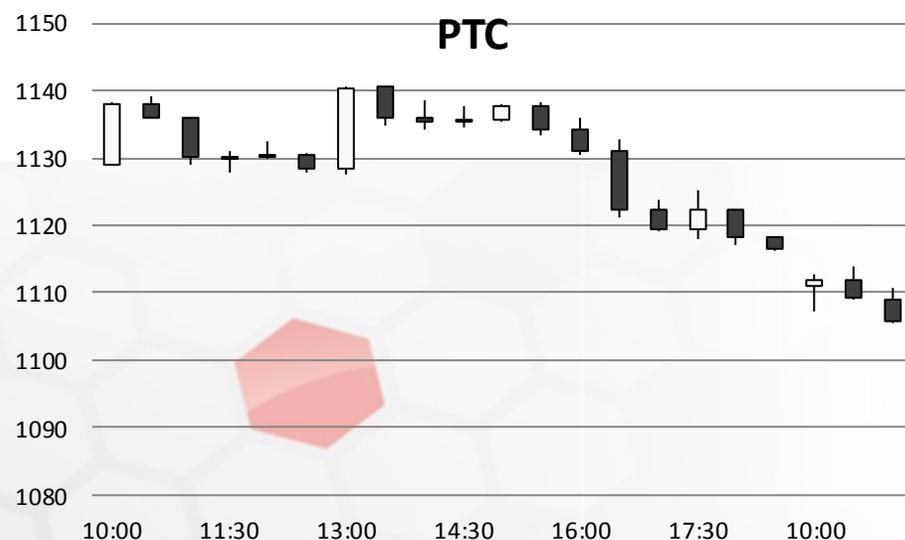
Валютный рынок



Источник: Bloomberg

Фондовый рынок

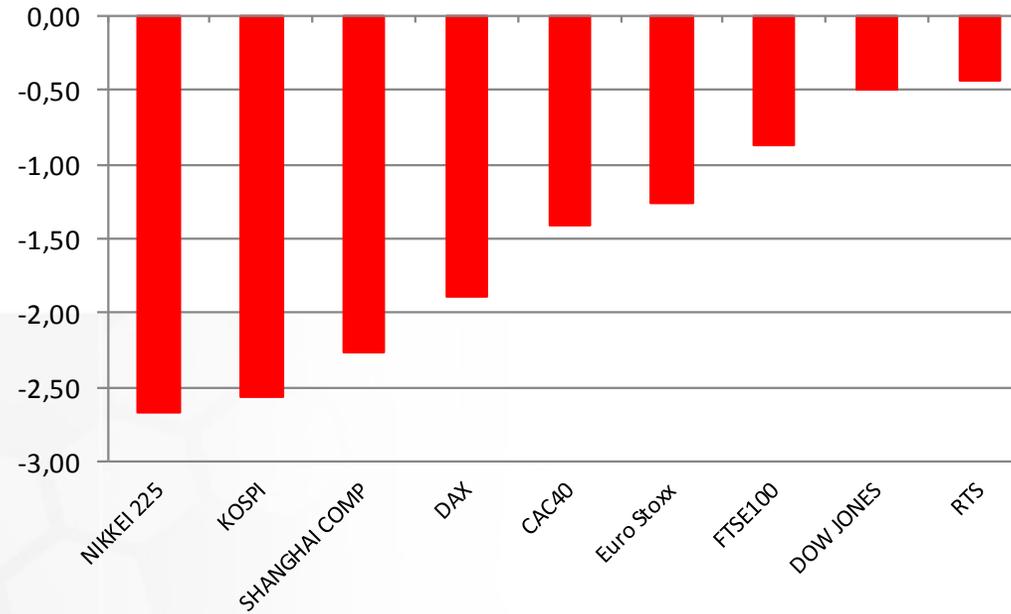
Российские индексы акций с начала дня снизились из-за внешнего негативного фона. Индекс Мосбиржи теряет 0,35% и торгуется вблизи отметки 2300 пунктов. От большего падения индексы сдерживает рост акций ЛУКОЙЛа (+3%) на новостях об увеличении веса акций в расчете индексов MCSI. Также восстанавливаются после обвала и бумаги Yandex.



Источник: ММВБ, Bloomberg

Фондовый рынок

Динамика мировых фондовых индексов, %



Источник: ММББ, 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 согласованы 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, не прямые, косвенные, зависящие, непредвиденные, или любые другие убытки, понесенные в связи с использованием этой статьи.