

11 января 2016 | Технический анализ валютной пары Eur/Rub

Краткосрочный прогноз | Покупка

Рубль по-прежнему уступает свои позиции. Краткосрочный отскок на фоне привычной уже геополитики, на этот раз в лице Ирана и Саудовской Аравии, себя не оправдал. Проблемы экономики слишком серьезные. Серьезные настолько, что краткосрочное позитивное эхо геополитики не может в корне изменить ситуацию. Нефть не оказывает поддержки рублю. Цены на нефть в среду рухнули до минимума более чем 11 лет на фоне кризиса в отношениях членов ОПЕК Ирана и Саудовской Аравии, который снижает шанс на достижение договоренности о снижении добычи картелем. Фондовые индексы развивающихся стран несут серьезные потери, торги в Китае и вовсе были остановлены после падения индекса CSI 300 на 7%. Инвесторы напуганные охлаждением китайской экономики и девальвацией юаня инвесторы кинулись продавать рискованные активы прямо в первый день после новогодних праздников. Динамика рынков подчеркивает появление такого относительно нового явления, как чувствительность рискованных активов к китайской политике.

По графикам и цифрам, картинка не меняется. Цена идет вверх (рис.1). Скользящие средние на стороне быков. Кривая RSI явных сигналов не дает. Кривая MACD пока в положительной зоне (рис.2). Держим длинные позиции. Стоп лоссдвигаем на уровень 78,65. Цель при игре на повышение по-прежнему уровень 84.

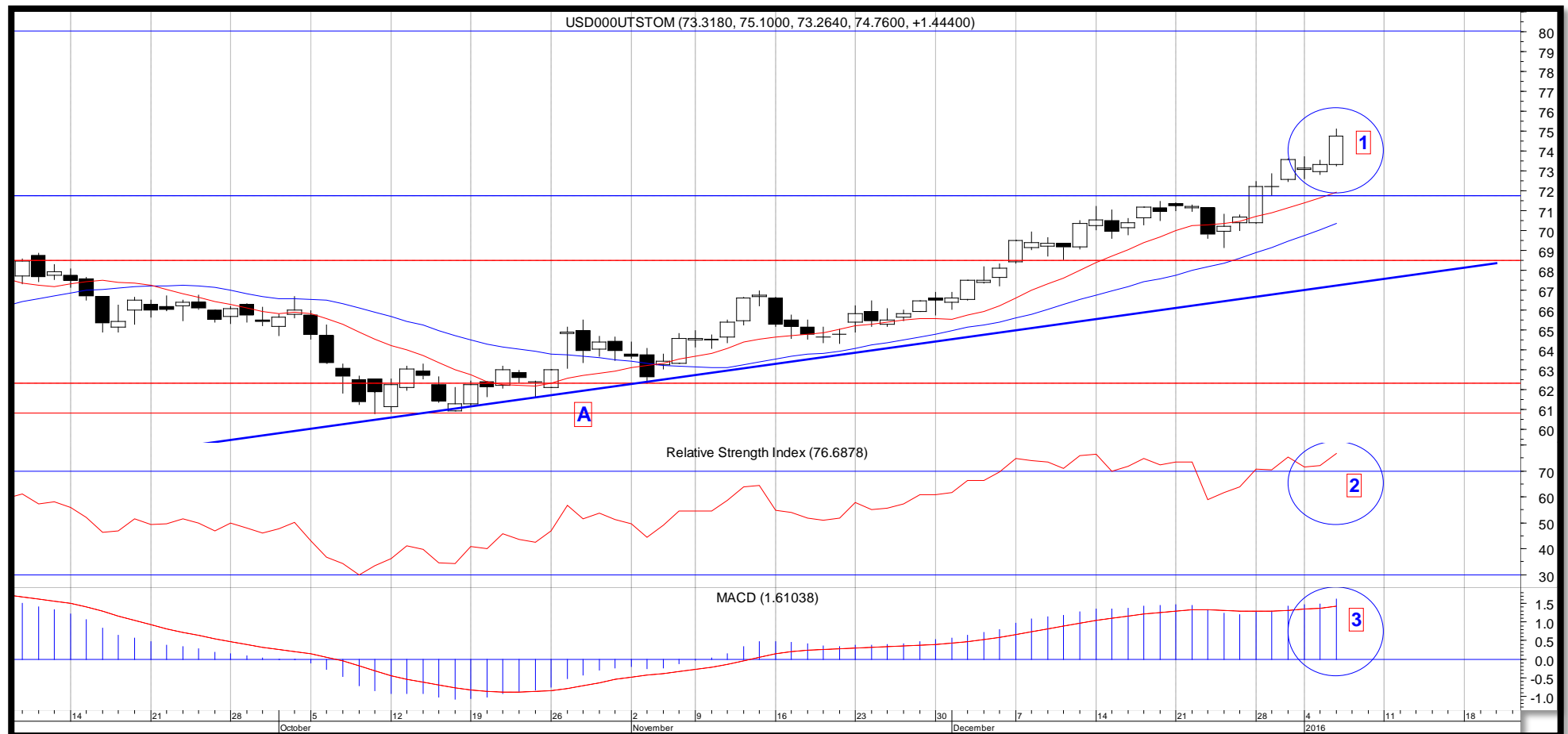


11 января 2016 | Технический анализ валютной пары Usd/Rub

Краткосрочный прогноз | Покупка

Рубль остается под сильным давлением. По отношению к доллару США рубль торгуется сейчас чуть выше уровня в 74, на фоне падения цен на нефть до нижней отметки за 11 лет и всплеска геополитической напряженности в мире. Все это вызвало очередную волну ухода от риска, что выразилось в падении глобальных фондовых рынков. Российская валюта дешевеет вслед за нефтью. Цены на нефть в среду рухнули до минимума более чем 11 лет на фоне кризиса в отношениях членов ОПЕК Ирана и Саудовской Аравии, который снижает шанс на достижение договоренности о снижении добычи картелем. Нефть упала и на сигналах замедления экономики КНР. Нельзя не отметить о решении государственной компании Саудовской Аравии Saudi Aramco увеличить скидки на основные сорта своей нефти для потребителей из Европы, что также бьет косвенно по российской валюте. Торги в Китае и вовсе были остановлены после падения индекса CSI 300 на 7%. Отчет по рынку труда в США, показавший рост занятости на 292 тыс. рабочих мест в декабре внес долю стабильности относительно экономического роста в Штатах, однако на фоне общего пессимизма на финансовых рынках этого не достаточно.

По графикам и цифрам, цена, преодолев уровень 72, идет вверх (рис.1). Скользящие средние на стороне быков. Кривая RSI в зоне перекупленности (рис.2). Кривая индикатора MACD в положительной зоне (рис.3). Цель при игре на повышение уровень 80. Стоп лосс, при игре на повышение, можем выставить на уровне 72,6.



11 января 2016 | Технический анализ нефтяной смеси марки Brent

Краткосрочный прогноз | Продажа

Цены на нефть в среду рухнули до минимума более чем 11 лет на фоне кризиса в отношениях членов ОПЕК Ирана и Саудовской Аравии, который снижает шанс на достижение договоренности о снижении добычи картелем. Нефть упала и на сигналах замедления экономики КНР. Фьючерс на нефть Brent на февраль опустился до \$35 за баррель. Решение ОПЕК отстаивать свою долю на рынке и бум сланцевой нефти в США будут поддерживать предложение на мировых рынках нефти на устойчиво высоком уровне. Саудовская Аравия продолжит продавать этот энергоресурс по цене ниже себестоимости, чтобы вернуть расположение азиатских покупателей. В значительной степени однообразный процесс бурения скважин в сланцевых месторождениях позволяет производителям быстро адаптироваться к меняющимся условиям и оптимизировать свои затраты. Аналитики все больше и больше склоняются к тому, что цены могут упасть ниже 30 долларов за баррель на фоне серьезного переизбытка предложения. С середины прошлого года стоимость нефти снизилась на 70%, несмотря на относительно уверенный рост спроса. Сырая нефть марки Brent закончила неделю с понижением на 10.6% на отметке 33.30 после падения к 32.16 в четверг — это минимальный уровень с 2004 года. Цены все еще нащупывают дно. Ситуация остается стабильно негативной, и дальнейшее падение выглядит весьма вероятным, поскольку участники рынка пока не видят, чтобы падение цен сказалось на уровне добычи ключевых игроков.

По цифрам и графикам, цена идет вниз (рис.1) по более пологому коридору цен (C-D), изображенные на графике в виде штрих линий. Скользящие средние на стороне медведей. Кривая RSI вновь вошла в зону перепроданности (рис.2) что является сигналом к продаже. Кривая индикатора MACD пока в отрицательной зоне (рис.3). Держим короткие позиции. Стоп лосс двигаем ближе к цене. В плюс можем играть при пробое линии нисходящего тренда (C) и положительных скользящих средних.



11 января 2016 | Технический анализ драгоценного металла Золото

Краткосрочный прогноз | Покупка

Драгоценные металлы чувствуют себя неплохо на фоне остального сырьевого комплекса. Золото отыграло около 11% потерь, понесенных в 2015 году на фоне укрепления доллара. Цены на этот металл достигли 9-недельного максимума на уровне 1112 долларов за тройскую унцию, поскольку паника на китайских фондовых рынках и ослабление юаня заставили инвесторов обратить внимание на традиционно безопасные активы. Эта динамика привела к девальвации рискованных валют и валют стран-экспортеров сырья. Следует отметить, сомнения, связанные с ростом мировой экономики, и обострение геополитической обстановки, по-прежнему тревожат инвесторов и не исключены новые волны бегства в безопасные активы. На рынок золота вернулся положительный импульс, цены начинают отвоевывать утраченные позиции. Активы крупнейшего ETF по золоту — SPDR Gold Shares — выросли на 4.2% в четверг после сокращения более чем на 2 млрд долларов в прошлом году. Тем не менее, следует проявить осторожность и не принять импульсное движение за тренд.

Цена, преодолев уровень 1095, идет вверх (рис.1). Скользящие средние на стороне быков. Кривая индикатора RSI вышла из зоны перепроданности (рис.2), что является бычьим сигналом. Кривая индикатора MACD пересекла сигнальную линию снизу вверх (рис.3) что является сигналом к покупке. Стоп лосс можем выставить под уровнем пробоя. Цель при игре на повышение уровень 1140.



11 января 2016 | Технический анализ нефтяной смеси марки Light

Краткосрочный прогноз | Продажа

Американский сорт нефти — WTI — потерял в цене 13% и обновил 12-летний минимум на уровне 32.10 долларов за баррель. По мнению ряда аналитиков, цены еще не нащупали дно, и если с концепцией длительного периода низких цен все ясно, то вот вопросы о том, насколько низких, и насколько длительно пока ясности нет. Решение ОПЕК отстаивать свою долю на рынке и бум сланцевой нефти в США будут поддерживать предложение на мировых рынках нефти на устойчиво высоком уровне. В значительной степени стандартизированный и однообразный процесс бурения скважин в сланцевых месторождениях позволяет производителям быстро адаптироваться к меняющимся условиям и оптимизировать свои затраты. Саудовская Аравия во вторник объявила об увеличении скидок на основные сорта своей нефти для европейских потребителей. Стоимость Arab Light с поставкой в феврале была понижена на 60 центов для Западной Европы и на 20 центов для средиземноморских стран. Цены все еще нащупывают дно. Ситуация остается стабильно негативной, и дальнейшее падение выглядит весьма вероятным, поскольку участники рынка пока не видят, чтобы падение цен сказалось на уровне добычи ключевых игроков.

По цифрам и графикам, цена пробила уровень поддержки 38 вниз (рис.1). Скользящие средние на стороне медведей. Кривая RSI явного сигнала не дает (рис.2). Кривая индикатора MACD пока в отрицательной зоне (рис.3). Держим короткие позиции. Стоп лосс можем выставить на уровне 34,3.

