Ежедневная аналитика по срочному рынку от Клуба трейдеров 2trade.ru
Начало года на позитиве

Сегодня начнётся первая торговая сессия 2011 года. За время долгих российских выходных отечественные быки и медведи накопили достаточно сил и энергии, чтобы вступать в бурную схватку на просторах бирж ММВБ и РТС.

Пока в России были традиционные нерабочие дни, во всем остальном мире активно проходила торговля на фондовых, финансовых и сырьевых площадках. Американские индексы незначительно подросли от закрытия 31 декабря 2010 года к вчерашнему закрытию: Dow Jones прибавил 0,52%, Nasdaq увеличился на 2,07% и S&P 500 вырос на 0,96%. Нефть марки Brent на сегодняшнее утро торгуется у отметки 95,5 долларов за баррель, прибавив за длинные выходные порядка трех долларов в цене. Стоит отметить, что в новом году котировки нефти значительно колеблются, превышая свои средние показатели волатильности в несколько раз. Это сильно увеличивает риск сделок в активах значительно зависящих от нефтяных цен, и в том числе на отечественном рынке. На валютном рынке евро по отношению к доллару после закрытия последней сессии прошлого года успело потерять три цента стоимости и перед открытием российских бирж сегодня торгуется в районе 1,295.

В целом сегодня смело можно ожидать открытие фьючерса на индекс РТС с разрывом вверх, однако его величина будет не столь впечатляющей, как возможно надеялись многие быки, перенесшие позиции через праздники. Первую половину дня актуальные фундаментальные новости, влияющие на торги в Европе и Америке, будут игнорироваться на отечественном фондовом рынке из-за расторговки и переформирования портфелей в связи с изменившимся внешним фоном за десять дней.

В Европе всё по старому и в новом году. На сегодня в фокусе Португалия, которую «принуждают» страны-товарищи по Еврозоне к принятию финансовой помощи от Евросоюза и МВФ. Гособлигации этой страны торгуются на вторичном рынке с доходностью выше 7%. Однако это не приносит значимого негатива на фондовые и денежные рынки, кроме как котировкам евро. После заявления Китая в конце прошлого года о помощи Европе, через выкуп всех выпусков облигаций проблемных стран ситуацию никто не драматизирует.

В США начался сезон отчётностей, который традиционно открыла Алкоа с довольно неплохими показанными результатами за 4-й квартал, что поддержит рынки во второй половине дня, во время открытия основных торгов в Америке.

Техническая картина на графике фьючерса на индекс РТС, доставшаяся с прошлого года, позволяет приблизительно оценить ближайшие уровни спроса и предложения на сегодня, при условии умеренного гепа. Район сопротивлений расположен у отметки 179 150. Основная поддержка среднесрочной растущей тенденции проходит на уровне 175 850. Краткосрочные сделки сегодня совершать не рекомендуется из-за повышенной волатильности первого торгового дня 2011 года.



Родин Андрей
Аналитик по Срочному Рынку, Клуб трейдеров 2trade.ru