Торговый план по паре EURUSD на 14.03.2011

Начало недели ознаменовалось событием которое иначе как форс-мажор назвать нельзя. Это последствия землятресения в Японии и авария на АЭС Фукусима. Ко всем прочим плановым событиям с ролловерами недели, эта новость явно не добавит рынку предсказуемости. То , что событие найдет свою рыночную оценку и будет отыгрываться рынками сомнения не вызывает т.к. оно однозначно внесет коррективы в инвестиционные стратегии ведущих инвестдомов на текущий год. Возможно те кто испугался в не достаточной мере 11.03 во время землятресения, сегодня уже призадумаются о реальных перспективах японской экономики на ближайшие годы. В данной ситуации как всегда инвесторы будут искать защитный актив и вот тут уже на первое место выходит , чего инвесторы боятся больше нестабильности в экономике или нестабильности земной коры в период солнечной активности. Если подумать то с той же вероятностью под воду может уйти и Калифорния.

Тем не менее инвесторы ставят пока на ослабление доллара. Традиционный COT чарт по данным CME на фьючерсные и опционные контракты по евро. Организации +11500 (Fut+Opt) LONG позиций. Открытый интерес (Open Interest) +25 000 контрактов. Сегодня вновь опубликован план РОМО на март-апрель на сумму 102 млрд. долл., т.е в среднем по 5-8 млрд. долл практически каждый торговый день. Играть против ФЕДа, дурных нема. Всем октября хватило.

Вообще торговать в такой день как сегодня себе дороже. Техника и статистика перестают работать , когда фонды начинают перетряхивать свои активы в срочном порядке. Все таки не каждый день «Чернобыль»…

Торговый план на сегодня-завтра ВНЕ РЫНКА. Смотрим, во что все это выльется.



Across all operations in the schedule listed below, the Desk plans to purchase approximately **$102 billion**. This represents $80 billion in purchases of the announced $600 billion purchase program and $22 billion in purchases associated with principal payments from agency debt and agency MBS expected to be received between mid-March and mid-April.

OPERATION DATE[1]	SETTLEMENT DATE	OPERATION TYPE[2]	MATURITY RANGE	EXPECTED PURCHASE SIZE
March 14, 2011	March 15, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	05/15/2018 – 02/15/2021	$6.5 - $8.5 billion
March 16, 2011	March 17, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	03/31/2015 – 08/31/2016	$5.5 - $7.5 billion
March 17, 2011	March 18, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	09/30/2013 – 02/28/2015	$5.5 - $7.5 billion
March 18, 2011	March 21, 2011	Outright TIPS Purchase	04/15/2013 – 02/15/2041	$1 - $2 billion
March 21, 2011	March 22, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	08/15/2028 – 02/15/2041	$1.5 - $2.5 billion
March 22, 2011	March 23, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	09/30/2016 – 02/28/2018	$6.5 - $8.5 billion
March 23, 2011	March 24, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	05/15/2018 – 02/15/2021	$6.5 - $8.5 billion
March 24, 2011	March 25, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	09/30/2013 – 02/28/2015	$5.5 - $7.5 billion
March 25, 2011	March 28, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	09/30/2012 – 09/15/2013	$4 - $6 billion
March 28, 2011	March 29, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	03/31/2015 – 08/31/2016	$5.5 - $7.5 billion
March 29, 2011	March 30, 2011	Outright TIPS Purchase	04/15/2013 – 02/15/2041	$1 - $2 billion
March 30, 2011	March 31, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	10/15/2013 – 02/28/2015	$5.5 - $7.5 billion
March 31, 2011	April 1, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	05/15/2021 – 11/15/2027	$1.5 - $2.5 billion
April 4, 2011	April 5, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	10/31/2016 – 03/31/2018	$6.5 - $8.5 billion
April 5, 2011	April 6, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	05/15/2018 – 02/15/2021	$6.5 - $8.5 billion
April 6, 2011	April 7, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	08/15/2028 – 02/15/2041	$1.5 - $2.5 billion
April 7, 2011	April 8, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	04/30/2015 – 09/30/2016	$5.5 - $7.5 billion
April 11, 2011	April 12, 2011	Outright Treasury Coupon Purchase	10/31/2016 – 03/31/2018	$6.5 - $8.5 billion

---

Фьючерсы на золото - Еженедельный обзор: 7-11 марта

Futures Pros - На прошлой неделе фьючерсы на золото упали до двухнедельного минимума в четверг, после худшего землетрясения за сто лет в Японию, что повысило привлекательность драгоценных металлов.

Нам товарной бирже Comex, фьючерсы на золото на поставку в апреле торговались на уровне $1,417,85 за тройскую унцию, просев на 0,95% за неделю.

Фьючерсы на золото снизились до $1,403,05 за тройскую унцию в четверг (самая низкая цена с 25 февраля), в то время как долларовый индекс подскочил на 1,2% после того как Moody's сократило долговой рейтинг Испании на одну ступень, а Китай опубликовал данные о крупнейшем торговом дефиците за семь лет.

Цены на золото часто движутся обратно пропорционально к доллару США, так как золото становится более дорогим для держателей других валют.

Тем не менее, цены на золото подскочили в пятницу после землетрясения магнитудой 8,9 баллов возле северного побережья Японии, вызывая огромные цунами и приостановку работы АЭС.

Золото считается "убежищем активов", потому что оно не так связанно с производственными циклами, как другие промышленные товары или акции.

Между тем, мировой провайдер финансовых услуг - Commerzbank заявил в докладе в пятницу, что в дополнение к глобальному воздействию землетрясения, есть еще множество проблем, которые должны поддерживать более высокие цены золота, в том числе и кризис задолженности в периферической зоны евро а также ситуация в Северной Африке и арабском мире.

Ранее на этой неделе, цены на золото достигли исторического максимума на уровне USD1,445,25 за тройскую унцию в понедельник, на фоне насилия в Северной Африке и на Ближнем Востоке.

Серебро с поставкой в мае торговалось на рубеже USD35.92 за тройскую унцию под закрытие торговли в пятницу, прибавив 0,85 в течение недели, а медь с поставкой в мае торговалась на отметке USD4.233 за фунт, упав на 2.8% за неделю.

Ранее на этой неделе, правительственные данные показали, что импорта меди Китая в феврале упал до двухлетнего минимума, погружаясь на 35% до 235 469 метрических тонн, по сравнению с 364 240 тоннами импортированными в январе.

Недельный прогноз: 14-18 марта

Forex Pros - Иена выросла против доллара США в пятницу, после 8,9-бального землетрясения с последующим цунами, которые опустошили северное побережье Японии. Это вызвало опасения, что компании будут скупать иену, чтобы помочь оплатить восстановительные работы.

Курс йены повысился на 1,37% против доллара. Однако, неопределенность остается в более долгосрочной перспективе, так как еще рано оценивать масштабы ущерба и не ясно сколько денег может потребоваться для восстановления тех частей страны, которые были уничтожены.

Евро в свою очередь отыграло потери по отношению к доллару в пятницу, после того как лидеры 17 стран зоны евро заявили, что они достигли соглашения, которое приведет к далеко идущим реформам. Лидеры Европейского Союза заявили, что они хотят расширить фонд европейской финансовой стабильности к концу месяца.

Тем временем, фунт упал до трехнедельного минимума по отношению к доллару в пятницу на фоне

опасения, что неопределенные перспективы мировой экономики могут снизить вероятность ближайшего повышения ставок Банком Англии. В четверг Банк Англии сохранил процентную ставку, как и ожидалось.

На следующей неделе, Банк Японии, который заявлял, что близок к тому, чтобы обеспечить адекватную ликвидность на денежном рынке, проведет собрание в понедельник. Следующим наиболее ожидаемым событием будет заседание Федеральной резервной системы во вторник.

Также на следующей неделе, геополитическая напряженность на Ближнем Востоке и в Северной Африке, вероятно, продолжит оказывать давление на настроения участников рынка.

Forex Pros был составлен список этих и других значимых событий, способных повлиять на рынки.

Понедельник, 14 марта

Банк Японии планирует обеспечить предложение в размере нескольких триллионов иен на денежном рынке в рамках чрезвычайной операции, направленной на обеспечение стабильности рынка, после землетрясения в пятницу.

Также в понедельник, в евро зоны будет опубликовано официальные данные о промышленном производстве и опережающим индикатором экономического здоровья.

Между тем, Канада обнародует отчет правительства по скорости загрузки мощностей, что является важным показателем потребительской инфляции.

Вторником, 15 марта

Резервный банк Австралии опубликует результаты своего последнего совещания. Этот отчет дает возможность провести глубокий анализ экономических условий, которые повлияли на решение об установлении процентной ставки. Страна также обнародует официальные данные по продажам новых автомобилей, что является признаком доверия потребителей, а также индекс экономических показателей, предназначенный для прогнозирования будущего направления экономики.

В зоне евро, Центр экономических исследований ZEW опубликует доклад по экономическим настроениям в Германии, а также опережающим индикаторам экономического здоровья.

США обнародует официальные данные о производственной деятельности в штате Нью-Йорк, а также государственные доклады о ценах на импорт и баланс внутренних и иностранных инвестиций. Кроме того, Федеральная резервная система проведет заседание после объявления ставки по федеральным фондам.

Также во вторник, Канада обнародует официальные данные по производительности труда и продаже новых автомобилей, в то время как Япония планирует публиковать индекс производственных настроения.

Среда, 16 марта

Австралия опубликует официальные данные о секторе строительства нового жилья, что является важным показателем экономического здоровья. Между тем, Банк Японии, как ожидается, опубликует свой ежемесячный отчет, в котором рассматриваются данные, которые использовались при принятии

решения о процентной ставке. Позже в тот же день, Япония опубликует свой индекс третичной активности промышленности, который является ведущим индикатором экономического здоровья.

Также в среду, губернатор Банка Англии, Мервин Кинг выступит на собрании в Пекине, за его комментариями будут внимательно наблюдать, так как в них будут ключи к возможным будущим направлениям денежно-кредитной политики. Великобритания опубликует официальные данные по трудоустройству. Страна также обнародует правительственные данные о средних заработках по стране.

Центр экономических исследований ZEW в Швейцарии опубликует доклад по экономическим ожиданиям, что является ведущим индикатором экономического здоровья. В других странах зоны евро обнародуют официальные данные по инфляции потребительских цен, на которую приходится большая часть общего уровня инфляции.

США опубликует шквал правительственных данных, отчеты о количестве разрешений на строительство, а также данные по инфляции цен производителей, строительства нового жилья и запасов нефти. Между тем, Канада выпустить официальные данные по производственным продажам.

Четверг, 17 марта

RBA опубликует ежеквартальный бюллетень, в котором приводится подробный анализ текущих и будущих экономических условий с точки зрения банка.

Государственный секретариат по экономическим делам Швейцарии, опубликует ежеквартальный экономический прогноз, в котором рассматриваются основные компоненты, такие как ВВП на потребление и инвестиции, а также уровень занятости и инфляции. Позже в тот же день, Швейцарский Национальный Банк объявит о трехмесячной ставке ЛИБОР и опубликует заявление, в котором предлагаются подсказки о возможных будущих результатах изменения ставки. Также в четверг, страна обнародует официальные данные по промышленному производству.

Банк Англии опубликует доклад по инфляции потребительских ожиданий.
США для опубликует официальные данные по уровню безработицы и занятости. Страна также обнародует правительственные данные по инфляции потребительских цен, промышленному производству и уровню использования производственных мощностей. Между тем, Федеральный резервный банк Филадельфии опубликует индекс производственной активности.
Кроме того, Канада опубликует официальные данные по покупке иностранной ценных бумаг и оптовых продажах.
Между тем, Банк Японии, как ожидается, опубликует отчет по своему последнему собранию.

Пятница, 18 Марта

Великобритания опубликует данные промышленности по доверию потребителей. Позже в тот же день Банк Англии обнародует предварительные данные по ипотеке, что является ведущим индикатором спроса на жилье.
В зоне евро, Германия обнародует доклад по инфляции цен производителей, в то время как Италия выпустит официальные данные по торговому балансу.
Швейцария опубликует официальные данные по инфляции цен производителей, в то время как Канада обнародует данные по инфляции потребительских цен, на который приходится большая часть общего уровня инфляции.