

Срочный рынок: удастся ли фьючерсу на индекс РТС закрепиться ниже значимой отметки 160 000 пунктов? – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Среда на рынке срочных контрактов ознаменовалась существенным снижением котировок. Так, цена фьючерса на индекс РТС падала практически с самого утра и почти до самого закрытия торгов - небольшой откат вверх можно было заметить, только начиная с десяти часов вечера. В итоге можно констатировать для фьючерса RIM2 снижение на 3,62% и пересечение вниз важного уровня 160 000 пунктов в дневную сессию, и продолжения этого снижения (минус 0,28%) в вечернюю.

Вновь необходимо отметить, что бэквордация на рынке достигает максимальных значений. Сейчас она составила 5500 пунктов – ожидания дальнейшего снижения весьма сильны.

В опционных контрактах ситуация такая же как и вчера. Исходя из объемов открытого интереса по страйкам, можно сказать, что в апрельской серии контрактов поддержка наблюдается на уровне 160 000, сопротивление – 175 000. В июньской серии уровни поддержки и сопротивления остаются на отметках 155 000 и 165 000 соответственно.

Как это всегда бывает на резких движениях вниз, существенно росла в среду волатильность. Ее уровень возрос до значений 34,62, апрельский фьючерс на него – до 34,30.

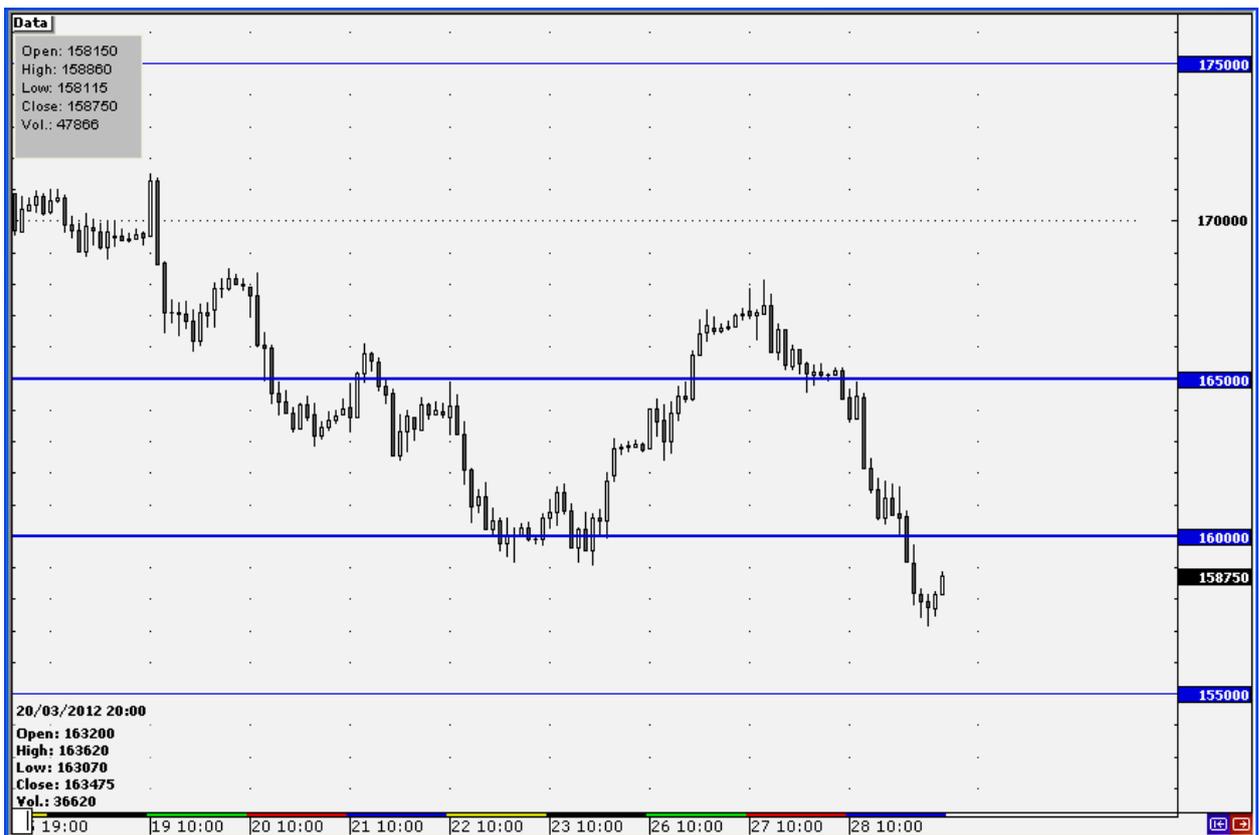
Рынок в прошедшие два дня был «медвежьим». Ожидавшееся нами пробитие важного уровня 160 000 вчера совершилось, и если цене фьючерса удастся закрепиться ниже этих отметок, можно будет ожидать продолжения этого нисходящего движения.

Торговые роботы находятся в коротких позициях, подтверждая тем самым тренд вниз. Причем большую часть этих шортов механические торговые системы открывали еще во вторник по ценам выше 165 000 и прибыль в настоящее время от этих сделок весьма существенна. Другая часть МТС осуществляла свои продажи вчера в начале дня также по довольно высоким ценам.

Настоящий документ предоставлен исключительно в порядке информации и не является рекламой или предложением о проведении операций на рынке ценных бумаг и, в частности, предложением об их покупке или продаже, со стороны аналитиков, авторов статей и компаний, входящих в ГК "АЛОР".

Настоящий документ является мнением и содержит оценки, основанные исключительно на заключениях аналитиков в отношении рассматриваемых ценных бумаг и эмитентов.

Не следует полагаться исключительно на содержание данного сообщения в ущерб проведению независимого анализа. Инвестиции в ценные бумаги сопряжены с риском. Исходя из этого, инвесторам рекомендуется проводить тщательное и всестороннее исследование финансово-экономического состояния эмитентов и соответствующих рынков перед принятием инвестиционного решения.



Часовой график RIM2.

Настоящий документ предоставлен исключительно в порядке информации и не является рекламой или предложением о проведении операций на рынке ценных бумаг и, в частности, предложением об их покупке или продаже, со стороны аналитиков, авторов статей и компаний, входящих в ГК "АЛОР".

Настоящий документ является мнением и содержит оценки, основанные исключительно на заключениях аналитиков в отношении рассматриваемых ценных бумаг и эмитентов.

Не следует полагаться исключительно на содержание данного сообщения в ущерб проведению независимого анализа. Инвестиции в ценные бумаги сопряжены с риском. Исходя из этого, инвесторам рекомендуется проводить тщательное и всестороннее исследование финансово-экономического состояния эмитентов и соответствующих рынков перед принятием инвестиционного решения.