

Срочный рынок: «шторм» волатильности на срочном рынке еще не закончился, - Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

В среду торги на срочном рынке проходили довольно волатильно. Уход фьючерса на индекс РТС выше отметки 155 000 пунктов сменился вечером снижением. В результате фьючерс прибавил 0,64% в дневную сессию и потерял 0,29% в вечернюю сессию торгов.

Ситуация с бэквордацией не изменилась: ее значение не опускается ниже уровня в 5000 пунктов.

Если говорить о количестве открытых позиций по опционным контрактам, то ситуация также остается неизменной. В опционах с экспирацией в апреле ближайшие максимальные количества наблюдаются на страйке 175 000 (опцион call) и страйке 155 000 (опцион put). Эти уровни выступают в роли главных уровней опционного сопротивления и поддержки. В июньской серии поддержка остается на уровне 155 000 пунктов, а сопротивление - на отметке 180 000 пунктов.

Биржевая волатильность по итогам вчерашнего торгового дня показала снижение. На конец торгов индекс волатильности составил 32,41, а майский фьючерс на него остался на уровне 35,00 – ликвидность в эти контракты, к сожалению не приходит.

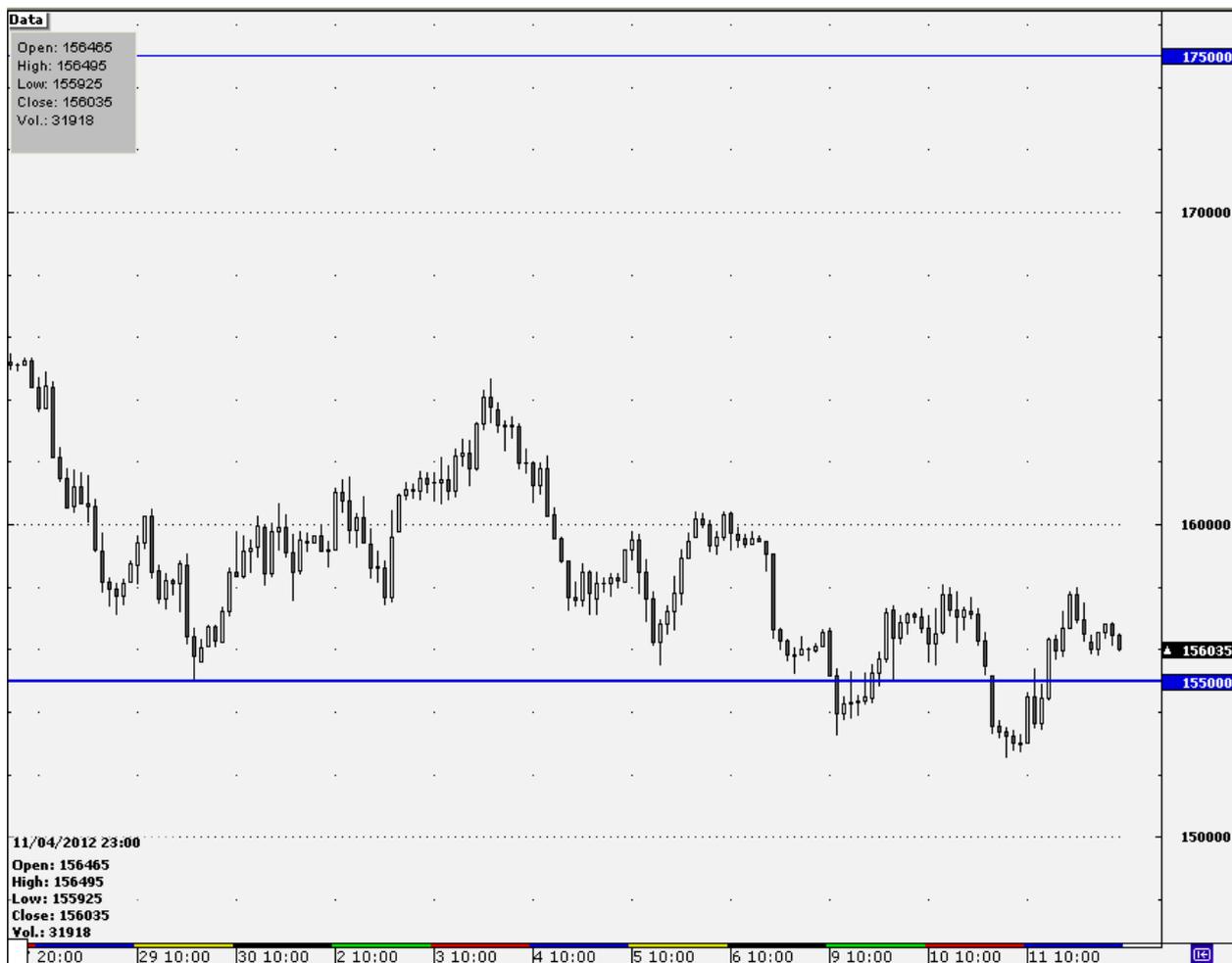
Как было видно вчера, уже вторая попытка закрепления ниже важнейшего уровня 155 000 пунктов не удалась. Таким образом, нисходящий тренд не получил своего развития. Вероятно, сегодня или завтра нам удастся увидеть очередную попытку захода вниз. Однако стоит отметить, что отскок на уровень 160 000 пунктов также вероятен.

Вчерашний день ознаменовался закрытием коротких позиций торговыми роботами. При этом не все механические торговые системы открыли лонги. В свою очередь разнонаправленность позиций торговых стратегий подтверждает высокую степень неопределенности на рынке.

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.