

Срочный рынок: бэвордация на уровне 6000 пунктов говорит о серьезных ожиданиях снижения рынка, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

В понедельник и вторник на российском срочном рынке ситуация практически не изменилась. Так, котировки фьючерса на индекс РТС остались на уровне закрытия прошлой недели, т.е. около отметки в 142 000 пунктов, хотя в понедельник с утра можно было увидеть попытку пробить вниз важный уровень в 140 000 пунктов.

Бэвордация, несмотря на закрытие реестра по большинству эмитентов и то, что до экспирации остается всего лишь немногим больше месяца, достигает очень больших значений – более 6000 пунктов. Это является серьезным знаком негативных ожиданий у участников торгов.

Уровень опционной поддержки по июньским контрактам остается на страйке 135 000, и сопротивление - на отметке 170 000. В опционах же с экспирацией в мае поддержка остается на уровне 140 000 пунктов, сопротивление сместилось вниз, к отметке 150 000 пунктов.

Повысилась биржевая волатильность, после вторника значение ее индекса достигло 31,26, а в отдельные моменты превышало отметку 35.

Мы продолжаем ожидать, что нисходящий тренд получит свое дальнейшее развитие – май ознаменуется существенным снижением котировок. Для этого фьючерсу на индекс в первую очередь необходимо преодолеть важный уровень 140 000 пунктов.

Торговые роботы на текущий момент по большей части находятся в шортах – ожидаем дальнейшего снижения.



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.