

Срочный рынок: июньская поддержка опустилась со 135 000 до 120 000 пунктов, и мы вполне можем увидеть трехлетний минимум, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

В понедельник на рынке царствовали «медведи», уверенно подтвердив нисходящую динамику рынка. Так, фьючерс на индекс РТС потерял 4,23% в дневную сессию торгов, и заметного отката не было и вечером – за вечернюю сессию плюс составил всего лишь 0,06%.

До экспирации фьючерсов остается лишь месяц. Уровень бэквордации остается на отметках, превышающих 1,5%, несмотря на столь короткий срок до истечения контрактов и то, что практически все эмитенты закрыли реестры акционеров. Это говорит об очень существенном негативе на рынке.

Важный день сегодня в опционах – экспирация майской серии контрактов, и участники торгов будут перестраивать свои позиции. Это уже стало заметно - уровень опционной поддержки по июньским контрактам переместился со страйка 135 000 на уровень 120 000, это также говорит о серьезном негативе. Уровень сопротивления пока остается на отметке 170 000.

Биржевая волатильность, продолжает расти уже не первый день, причем ее индекс за время торгов в понедельник прибавил почти 10% и в итоге составил 36,97.

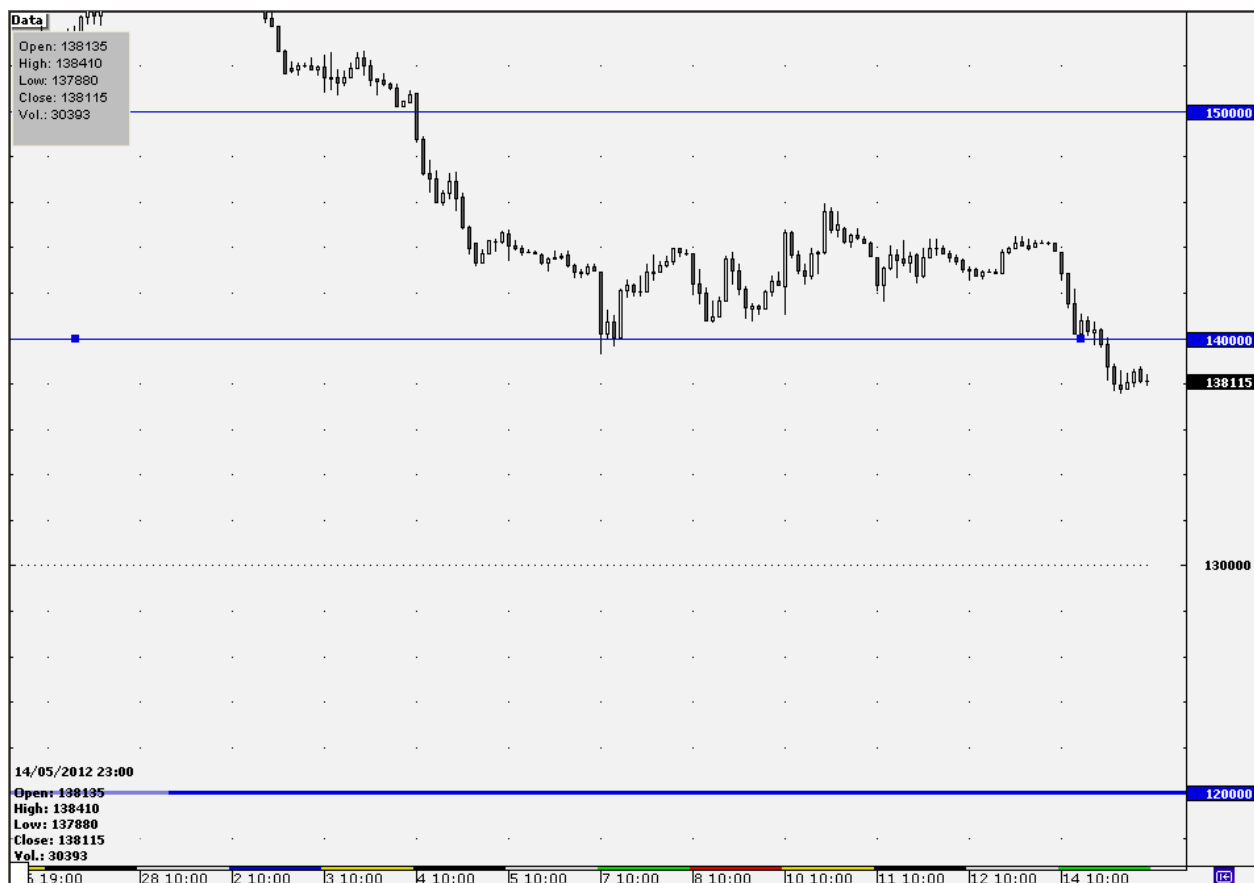
Наш негативный прогноз подтверждается – мы видим на рынке нисходящую тенденцию. О том насколько долгим будет этот понижительный тренд сказать сложно, но имеется вероятность того, что в мае-июне рынок уйдет на минимумы последних трех лет– мы можем увидеть отметку 120 000 пунктов по фьючерсу RIM2.

Торговые роботы находятся в шортах, причем прибыль по этим сделкам весьма существенна. Так, например, первый из линейки торговый робот, предоставляемый клиентам ГК «АЛОР» бесплатно в рамках услуги «АЛОР-Робот», продал фьючерсы вчера утром по цене около 142 800 и таким образом прибыль, если не принимать в расчет «эффект плеча», без которого на рынке FORTS мало кто торгует, составила за день примерно 3,5%.

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.