

Срочный рынок: целью среднесрочного снижения может быть отметка 120 000 пунктов по фьючерсу RIM2, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Вторник на срочном рынке был отмечен повышенной волатильностью на фоне некоторого снижения котировок. Цена фьючерса на индекс РТС в течение дня несколько раз то возрастала до значений почти в 140 000 пунктов, то опускалась почти до отметки 136 000. В итоге закрытие произошло на уровне около 137 000 пунктов, изменения составили рост на 0,72% днем и падение на 1,33% вечером.

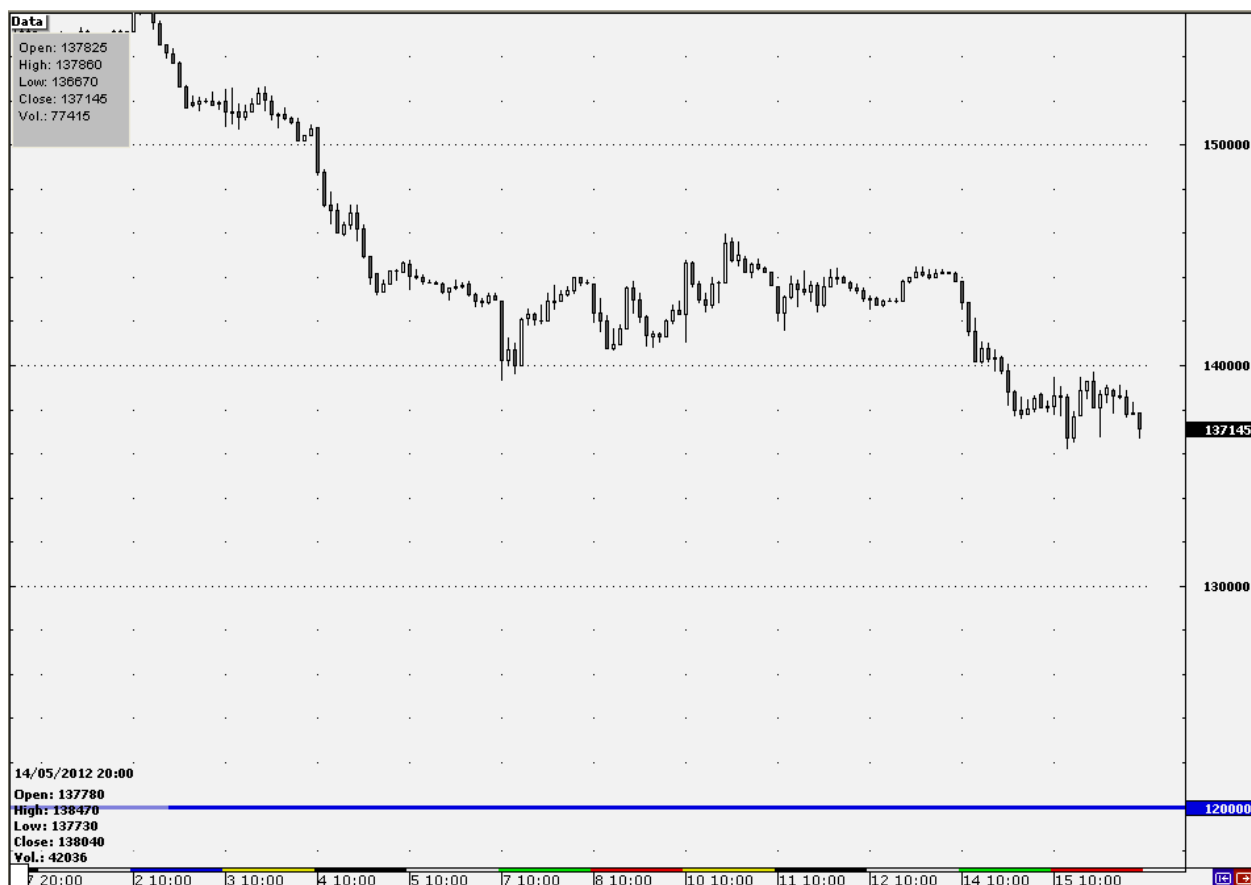
Бэквордация на рынке хоть и снижалась в течение дня, особенно в моменты движений вверх, но все равно сохраняется – ожидания у участников торгов все еще отрицательные.

В опционах ситуация с вчерашнего дня не изменилась. Уровни поддержки и сопротивления наблюдаются на страйках 120 000 и 170 000

Биржевая волатильность вчера продолжила рост. Ее индекс по итогам торгов составил 37,4 а в отдельные моменты он достигал величин почти в 39.

Наши ожидания продолжают быть отрицательными. У рынка сохраняется серьезный потенциал для падения, и с большой вероятностью можно предположить, что нисходящая тенденция продолжится.

Если говорить о торговых роботах, то для некоторых стратегий вчерашний день прошел под знаком фиксации прибыли, полученной от шортов в понедельник. Однако сегодня, в случае продолжения падения, механические торговые системы могут вновь открывать короткие позиции.



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.