

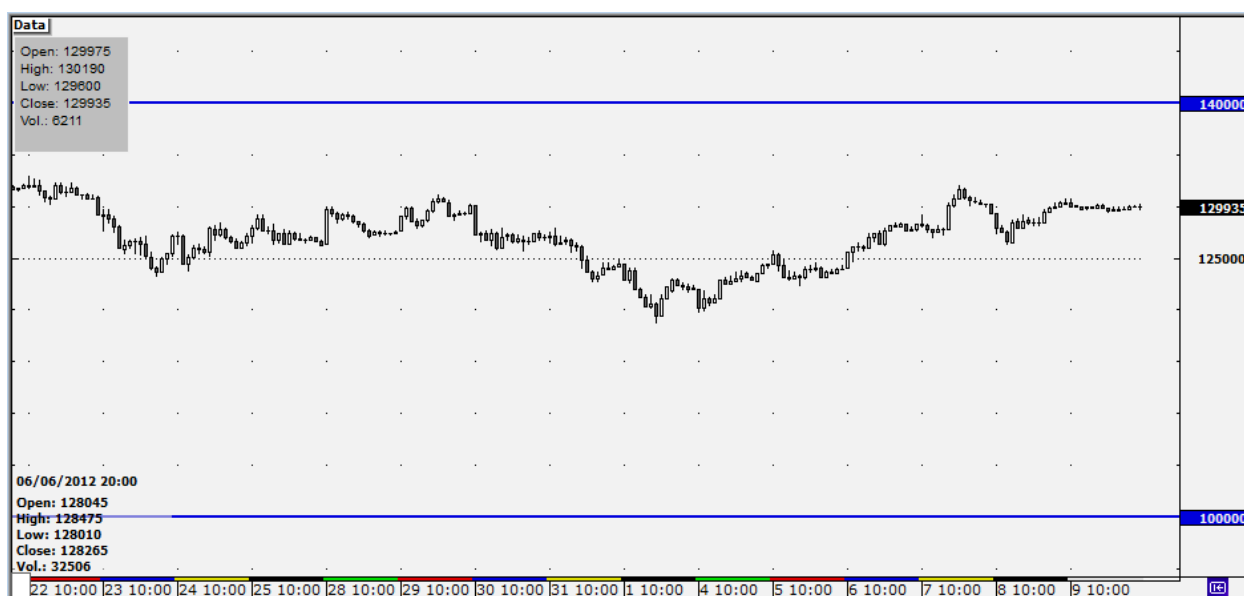
Движение во фьючерсе на индекс РТС до экспирации маловероятно, - Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Субботняя торговая сессия, как и ожидалось, не отметилась серьезным движением на рынке. В отсутствие внешних факторов фьючерс на индекс РТС весь день торговался около отметки в 130 000 пунктов.

До экспирации июньских контрактов остается всего лишь два полных торговых дня, в связи с этим учитывать значения бэквордации при прогнозировании не стоит. Также малозначимыми становятся уровни опционных сопротивления и поддержки: похоже, что до исполнения июньской серии они останутся на тех же отметках, а в следующих сериях они еще не сформировались.

Индекс волатильности на конец субботы составлял 43,05. Это высокие значения для предпраздничного дня: судя по всему, рост волатильности произошел в связи с близящейся экспирацией.

Сегодня торги должны задать направление для дальнейшего движения рынка. Хотя и можно сделать предположение, что в текущей серии опционных и фьючерсных контрактов серьезного движения мы уже не увидим, развитие тенденции будет происходить уже в сентябрьской серии.



Часовой график RIM2