

Срочный рынок: Старт торгов фьючерсом на индекс РТС может характеризоваться преобладанием неопределенных настроений, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Фьючерс на индекс РТС в пятницу преимущественно снижался под воздействием негативного внешнего фона. В результате контракт потерял за дневную сессию торгов 2,22%, однако в вечернюю сессию все же удалось восстановить часть позиций (+0,64%).

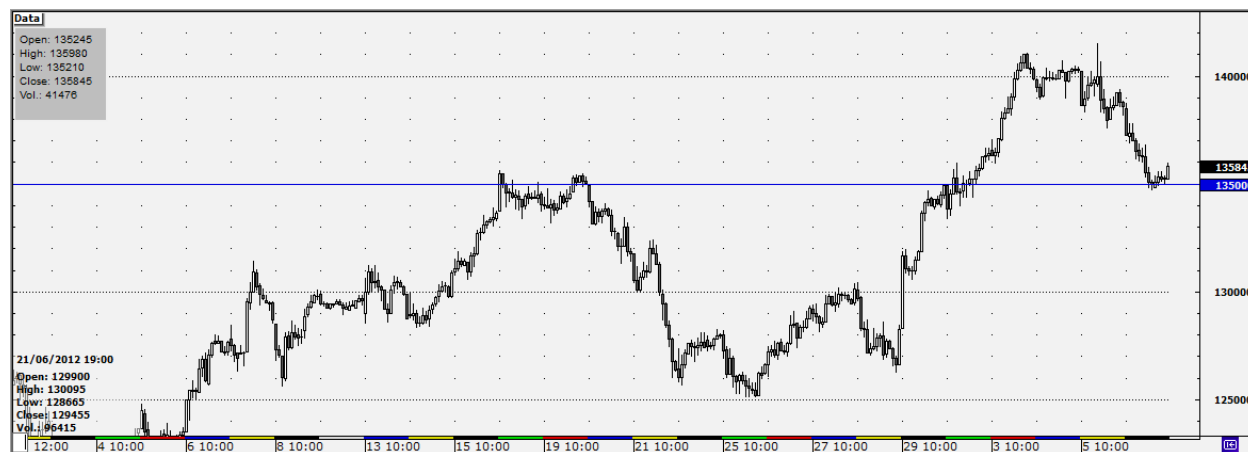
Бэквордация, несмотря на то, что уже два дня происходит снижение, так и не достигла серьезных значений. Разница между индексом и его фьючерсом по-прежнему составляет порядка 0,5%: участники торгов по всей видимости не считают данное снижение долгосрочным.

Самый большой открытый интерес наблюдается в июльских опционах put страйка 135 000. Это может свидетельствовать о серьезной поддержке на этом уровне. Однако уровни сопротивления пока что не просматриваются.

На рынке наблюдается плавное снижение волатильности. Так индекс волатильности в пятницу опустился ниже отметки 30 пунктов, и составил 28,98 пункта, что для данного уровня цены базового актива является малой величиной.

Отметка в 135 000 пунктов для фьючерсов RIU2 может стать серьезным препятствием на пути вниз. Таким образом, начало недели может быть отмечено неопределенностью.

В позициях торговых роботов главным образом преобладают «шорты». При этом точки открытия длинных позиций также довольно близко.



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 RIU2

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.