Срочный рынок: Фьючерс на индекс РТС может вернуться в район ниже уровня 140000 пунктов, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Как и ожидалось, в ходе вчерашней сессии фьючерс на индекс РТС после тестирования отметки 140 000 пунктов не смог уйти значительно выше данного уровня. В результате итоговые изменения по контракту составили плюс 1,79% за дневную сессию и символические плюс 0,03% за вечернюю.

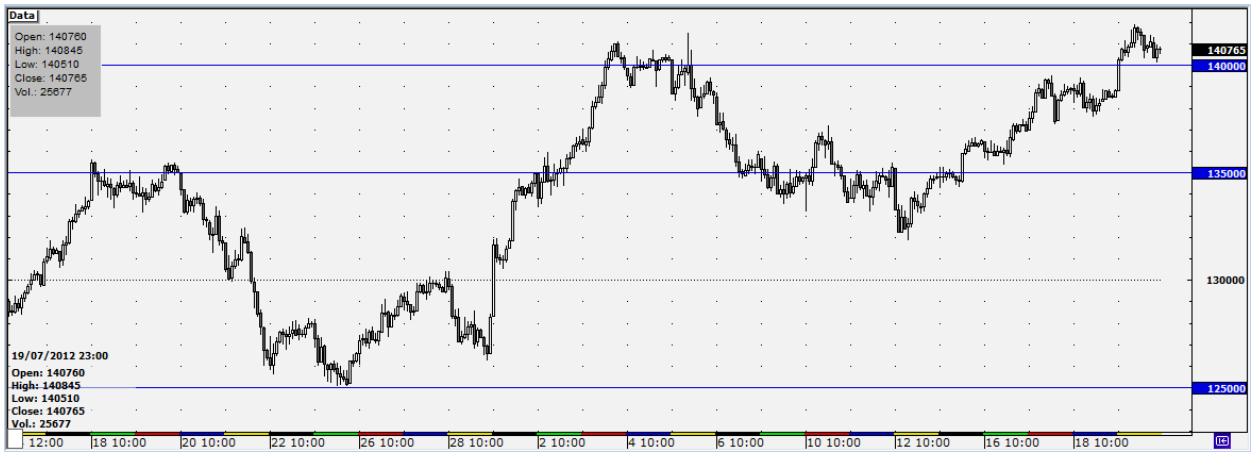
В ближайших, августовских опционах максимальный интерес по контрактам put можно увидеть на уровне 125 000 пунктов. Также растет и число открытых позиций по страйку 135 000 пунктов. В контрактах call, опционное сопротивление просматривается на страйке 140 000 пунктов.

Этим летом характерной особенностью является то, что торги проходят с константной волатильностью. Значение индекса волатильности вновь не опустилось ниже отметки в 30 пунктов, хотя этого вполне можно было бы ожидать на росте котировок и на снижении амплитуды их колебаний.

Ожидаем, что поход фьючерсов RIU2 выше отметки 140 000 пунктов был относительно кратковременным. Скорее всего, сегодня котировки на открытии торгов будут снижаться.

Торговые роботы продолжают занимать разнонаправленные позиции.

.



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.