Срочный рынок: Высока вероятность коррекции по фьючерсу на индекс РТС в начале сессии, – Дмитрий Верховых, ГК «АЛОР»

Фьючерс на индекс РТС прибавил вчера 0,98% за дневную сессию торгов и потерял 0,24% за вечернюю. При этом по контракту начиная с середины дня можно было наблюдать консолидацию около уровня 144 000 пунктов.

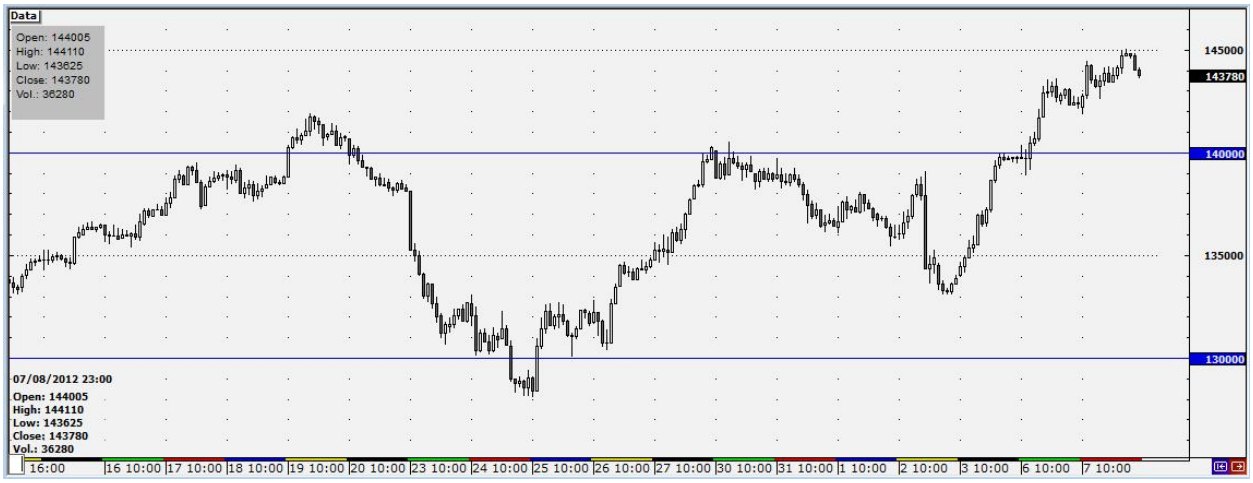
Бэквордация снизилась до минимальных за последнее время значений – она составляет менее 400 пунктов.

Если говорить о максимальных открытых интересах по страйкам, то опционная поддержка разделена между страйками 125 000, 130 000 и 135 000 пунктов, а сопротивление не сдвигается вверх и сохраняется на уровне 140 000 пунктов. Стоит отметить, что вероятно возвращение котировок в прежний коридор: на уровни ниже 140000 пунктов.

Можно предположить, что сегодня утром торги начнутся с понижательной динамики. Насколько сильна будет коррекция сказать сложно, но вероятность того, что мы вновь увидим в ближайшее время фьючерсы RIU2 ниже отметки 140 000 пунктов, сохраняется.

Торговые роботы на протяжении двух прошедших рабочих дней находились в длинных позициях, что позволило получить приличную прибыль. Сегодня, в случае отката вниз вероятна фиксация этого дохода.

Торговые роботы занимают 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.