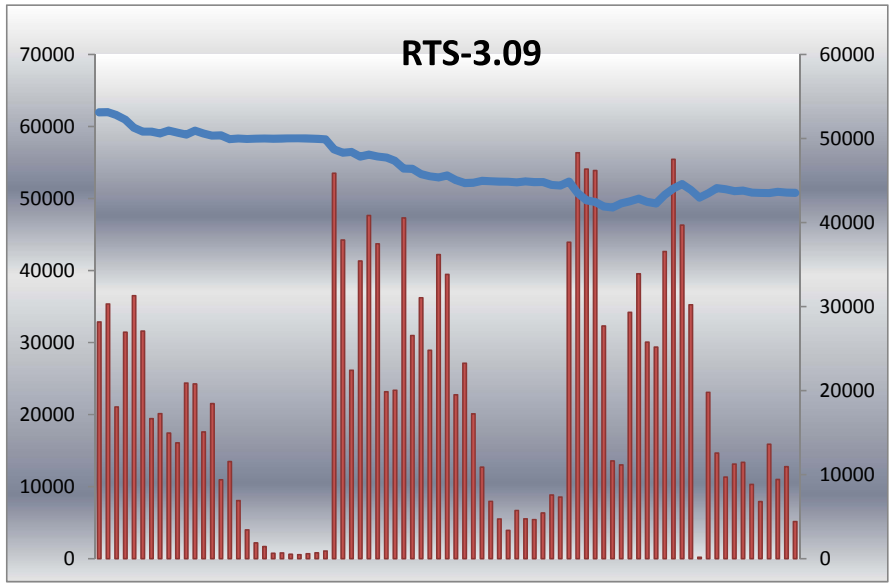
Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

Зимняя распродажа

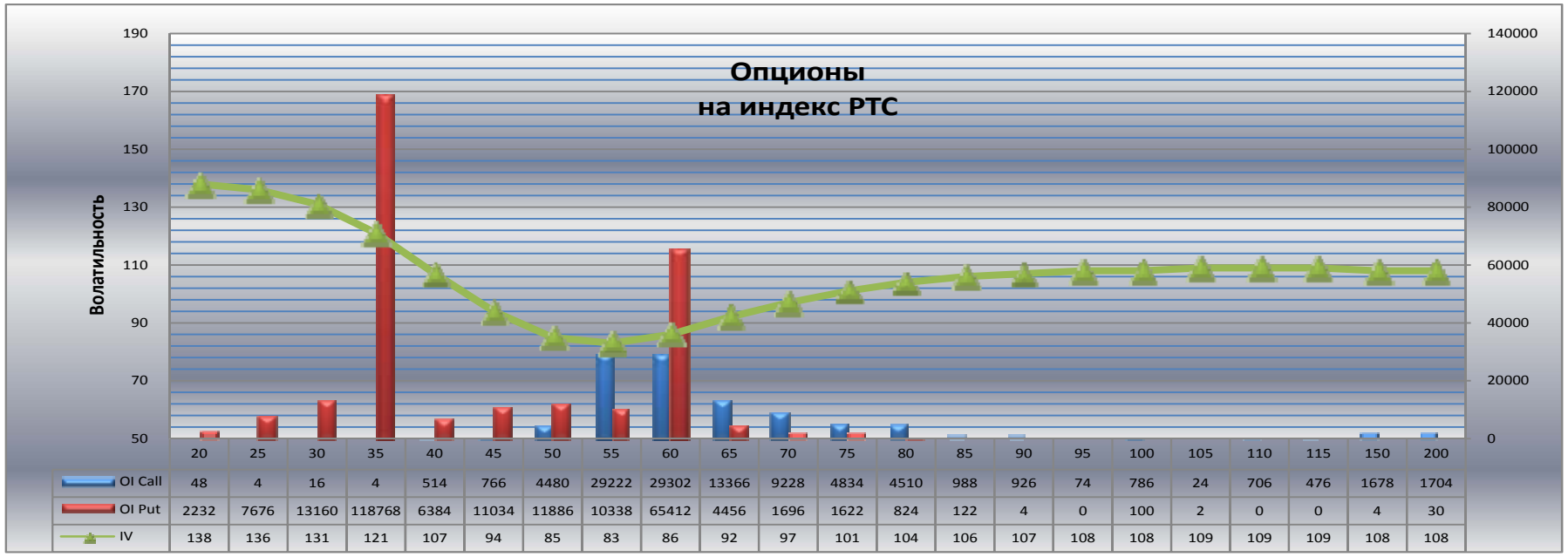
Очередной день распродаж на российском рынке. Вернее сказать, полдня, поскольку после остановки торгов в обед утреннее падение было немного отыграно. Тем не менее, индексы закрылись в отрицательной зоне.
Особое волнение у инвесторов вызывает динамика курса рубля к доллару, а также снижение индексов в США, которые, однако, на сегодняшней сессии показали разнонаправленную динамику, закрывшись примерно в нуле.
Во время вечерней сессии большинство фьючерсных контрактов подешевели, открытый интерес изменился не сильно.
Завтра можно ожидать положительного открытия торгов на фоне нейтральной сессии в США и корректирующихся вверх цен на нефть.



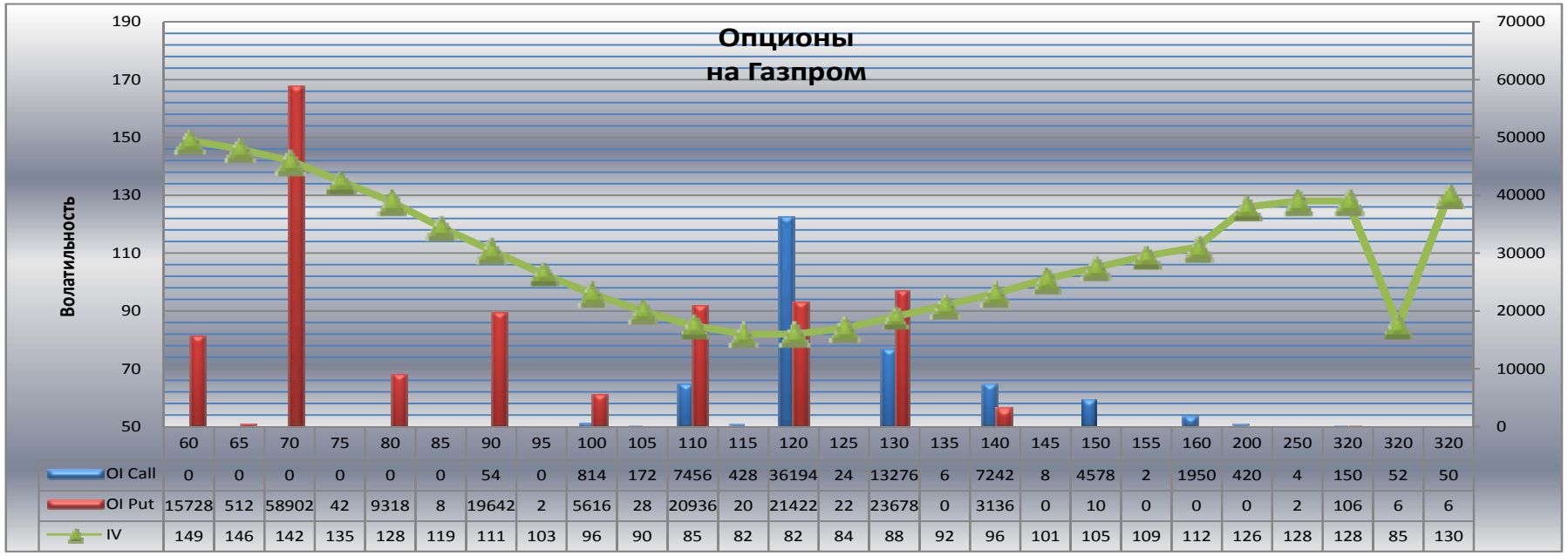
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 17:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-3.09	50695	506,95	-0,96	331016	-0,29%	1 880 185 162	127,87%
ROSN-3.09	11269	112,69	2,63	22482	-0,12%	10 477 899	102,60%
LKOH-3.09	10890	1089,00	-0,94	154412	-0,50%	133 560 962	116,72%
GAZR-3.09	11154	111,54	-0,8	250910	-0,23%	246 305 718	116,84%
GMKR-3.09	15811	1581,10	-2,47	7380	0,03%	28 173 294	105,07%
SBRF-3.09	1473	14,73	-0,61	389432	0,30%	56 739 425	110,04%
SNGR-3.09	17000	17,00	-0,29	11188	0,67%	5 850 813	132,02%
VTBR-3.09	2001	0,0200	-1,14	171416	0,01%	2 888 013	101,78%
BR-3.09	40,07	40,07	-0,82	13254	-4,85%	41 773 315	132,70%
UR-3.09	41,22	41,22	-3	150	0,00%	425 380	100,00%
GOLD-3.09	973	973,20	-0,13	86660	0,31%	33 219 941	178,52%
Si-3.09	36841	36,84	0,29	342996	0,09%	208 655 550	128,81%
Eu-3.09	46120	46,12	0	392	0,00%	738 759	100,00%
ED-3.09	1,2520	1,25	-0,36	21884	23,28%	558 288 768	209,61%

	Закрытие	Изменение %	Время
DJ Industrial	7555,63	0,04%	00:02:33
S&P 500	788,41	-0,10%	00:03:42
DAX 30	4204,96	-0,28%	20:30:43
CAC 40	2874,07	-0,04%	21:19:39
FTSE 100	4006,83	-0,68%	19:35:32
Hang Seng	13016	0,55%	11:16:01
Nikkei 225	7534,44	-1,45%	10:00:21
BOVESPA Brazil	39560,78	-0,72%	23:55:30
Gold	983,7	1,42%	00:04:19
Silver	14,31	1,47%	00:03:15
Palladium	217,5	0,46%	23:48:01
Platinum	1097	0,83%	00:04:13
Brent Crude Oil 0209	44,69	0,00%	06:06:15
RTSI	524,26	-5,03%	18:00:00
RTSI DEREX	518,46	-2,49%	18:45:00

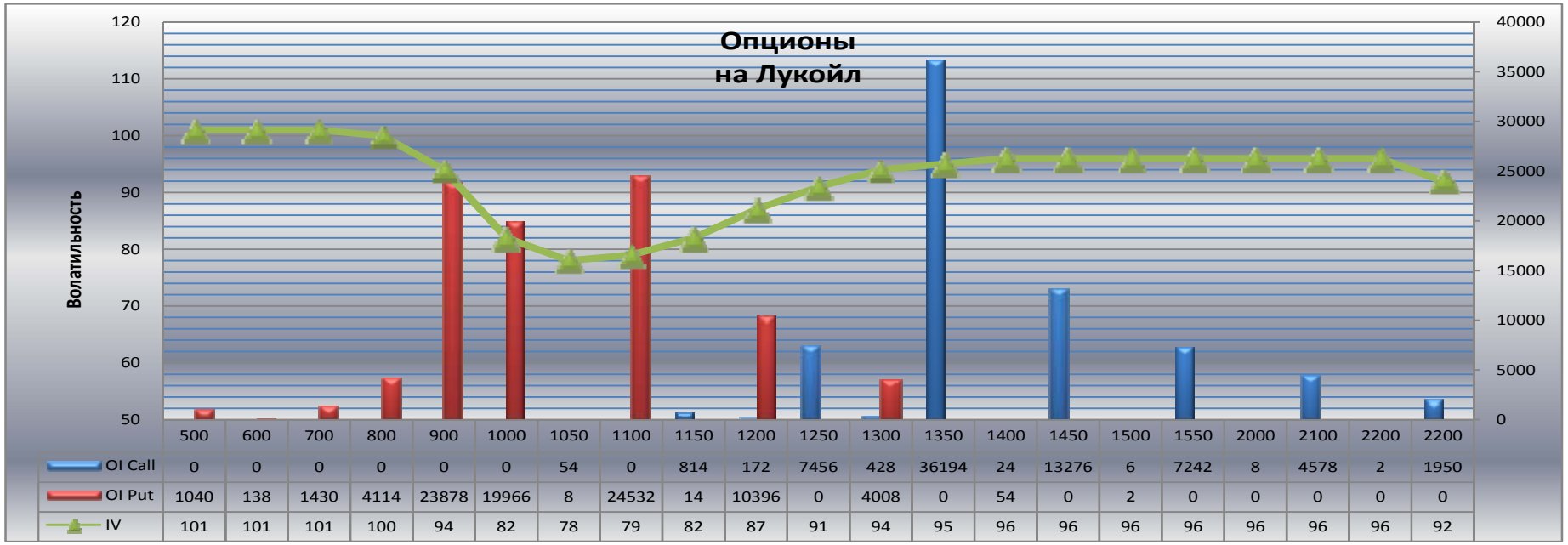
Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



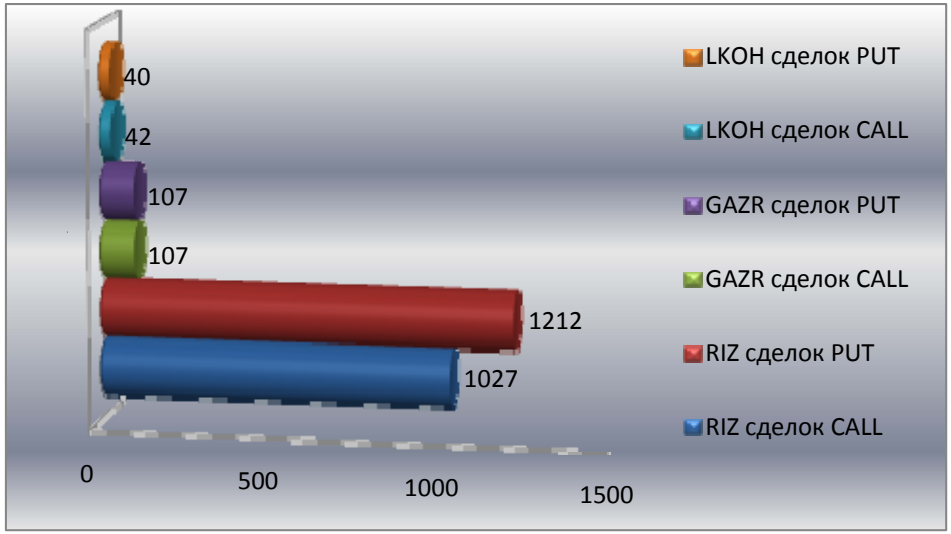
	20	25	30	35	40	45	50	55	60	65	70	75	80	85	90	95	100	105	110	115	150	200
OI Call	48	4	16	4	514	766	4480	29222	29302	13366	9228	4834	4510	988	926	74	786	24	706	476	1678	1704
OI Put	2232	7676	13160	118768	6384	11034	11886	10338	65412	4456	1696	1622	824	122	4	0	100	2	0	0	4	30
IV	138	136	131	121	107	94	85	83	86	92	97	101	104	106	107	108	108	109	109	109	108	108



	60	65	70	75	80	85	90	95	100	105	110	115	120	125	130	135	140	145	150	155	160	200	250	320	320	320
OI Call	0	0	0	0	0	0	54	0	814	172	7456	428	36194	24	13276	6	7242	8	4578	2	1950	420	4	150	52	50
OI Put	15728	512	58902	42	9318	8	19642	2	5616	28	20936	20	21422	22	23678	0	3136	0	10	0	0	0	2	106	6	6
IV	149	146	142	135	128	119	111	103	96	90	85	82	82	84	88	92	96	101	105	109	112	126	128	128	85	130



	500	600	700	800	900	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	2000	2100	2200	2200
OI Call	0	0	0	0	0	0	54	0	814	172	7456	428	36194	24	13276	6	7242	8	4578	2	1950
OI Put	1040	138	1430	4114	23878	19966	8	24532	14	10396	0	4008	0	54	0	2	0	0	0	0	0
IV	101	101	101	100	94	82	78	79	82	87	91	94	95	96	96	96	96	96	96	96	92



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

