Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

Рост российских индексов продолжился

Во вторник ралли на российском рынке продолжилось, несмотря на поступающий с западных площадок негатив. В частности швейцарский банк UBS еще до открытия российских площадок сообщил о росте чистых убытков по итогам 2008г. в 3,8 раза - до 13,09 млрд. евро.

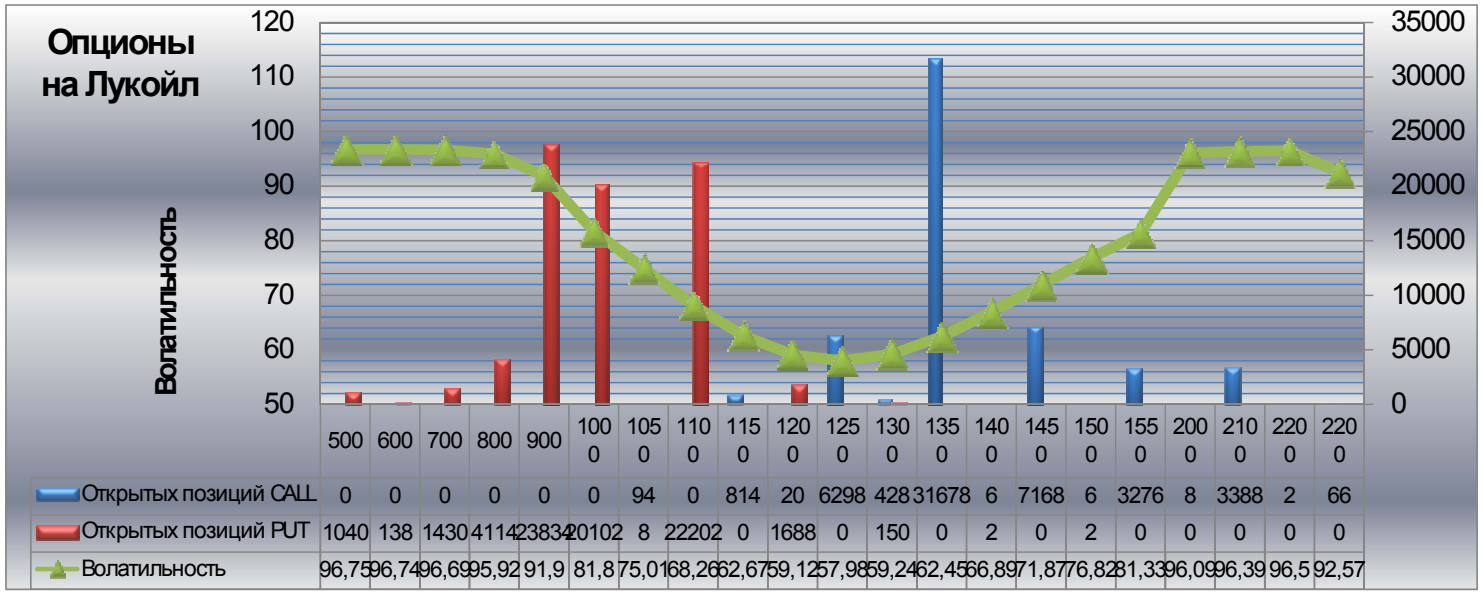
Нефтяные фьючерсы Light Sweet и Brent во вторник торговались в положительной зоне, а максимальный рост цен превысил 4%. Это и сыграло решающую роль в направлении движения российских индексов, несмотря на негатив с Запада.

На срочном рынке вечером нависли хмурые тучи. В вечернюю сессию только товарные и валютные фьючерсы завершили на положительной территории, остальные ушли в глубокий минус. Определяющим фактором, оказавшим влияние на движение котировок фьючерсов, стало поведение американских индексов, которые завершили негативно торги. Наибольшее падение отмечается в контрактах на акции банковского сектора. Фьючерс на акции Сбербанка и ВТБ потеряли 4,42% и 5,31%.

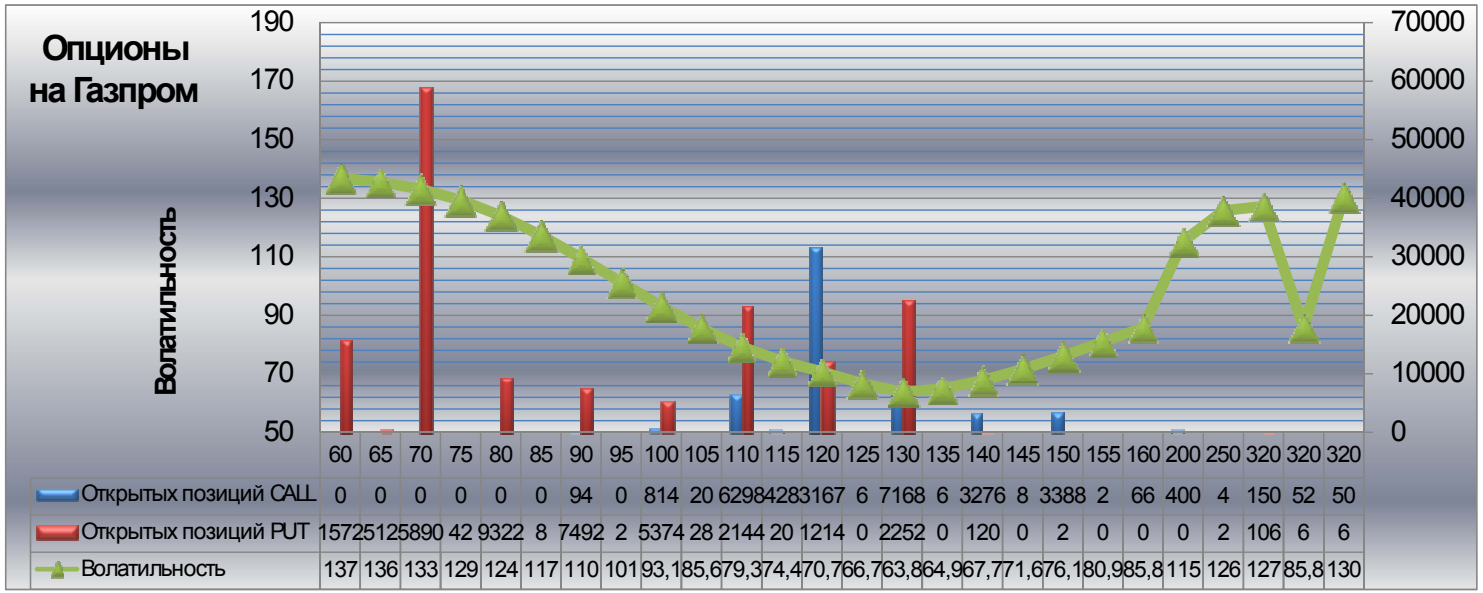
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 17:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-3.09	58005	580,05	-4,42	242150	-0,34%	6 128 440 303	33,10%
ROSN-3.09	12356	123,56	-1,91	37906	1,59%	24 742 635	22,73%
LKOH-3.09	12428	1242,80	-4,11	169314	-0,38%	192 695 130	19,07%
GAZR-3.09	12527	125,27	-3,87	339546	-0,14%	784 239 125	23,17%
GMKR-3.09	17750	1775,00	-2,21	10606	-3,70%	140 005 368	82,41%
SBRF-3.09	1711	17,11	-4,42	484572	9,64%	166 369 395	25,25%
SNGR-3.09	19858	19,86	-3,38	10610	0,04%	8 803 783	2,86%
VTBR-3.09	2410	0,0241	-5,31	143884	-0,12%	6 226 987	10,74%
BR-2.09	45,61	45,61	-4,73	5266	17,34%	66 673 506	24,41%
UR-2.09	46,30	46,30	0,43	30	-76,56%	953 004	198,32%
GOLD-3.09	920	919,90	0,6	69252	-2,85%	239 315 678	55,68%
Si-3.09	36335	36,34	0,53	369164	0,64%	425 137 555	32,13%

	Закрытие	Изменение %	Время
DJ Industrial	7884,1	-4,68%	00:00:15
S&P 500	826,96	-4,94%	00:00:13
DAX 30	4505,54	-3,46%	23:41:51
CAC 40	3020,75	-3,64%	21:26:28
FTSE 100	4213,08	-2,19%	20:03:39
Hang Seng	13880,64	0,81%	20:03:39
Nikkei 225	7945,94	-0,29%	20:03:39
BOVESPA Brazil	41207,43	-2,12%	23:22:35
Gold	916,97	2,62%	00:00:16
Silver	13,132	2,34%	00:00:17
Palladium	210	2,44%	23:50:50
Platinum	1034	4,66%	23:59:17
Brent Crude Oil 0209	44,69	0,00%	06:06:15
RTSI	539,38	8,27%	18:00:00
RTSI_DEREX	553,08	10,54%	18:45:00

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

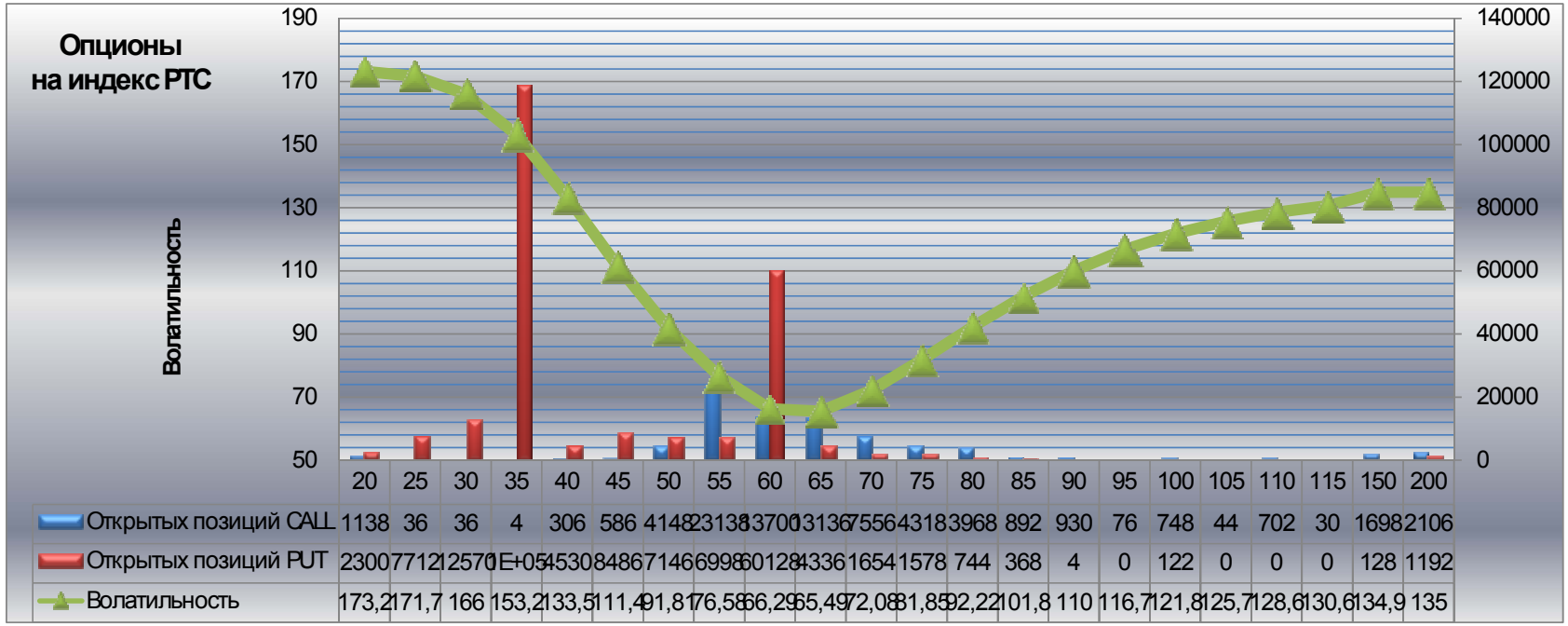


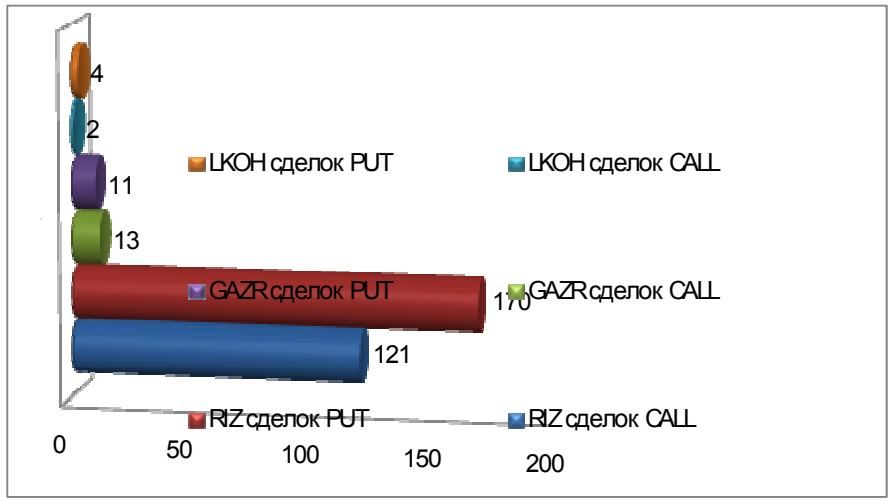
	500	600	700	800	900	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	2000	2100	2200	2200
Открытых позиций CALL	0	0	0	0	0	0	94	0	814	20	6298	428	31678	6	7168	6	3276	8	3388	2	66
Открытых позиций PUT	1040	138	1430	4114	23834	20102	8	22202	0	1688	0	150	0	2	0	2	0	0	0	0	0
Волатильность	96,75	96,74	96,69	95,92	91,9	81,8	75,01	68,26	62,67	59,12	57,98	59,24	62,45	66,89	71,87	76,82	81,33	96,09	96,39	96,5	92,57

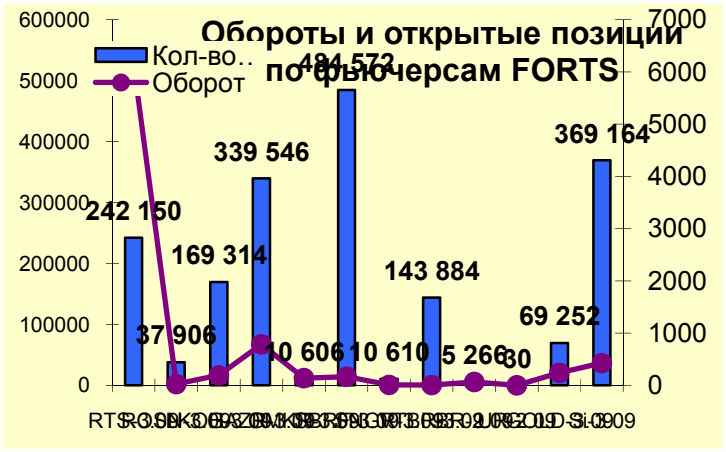


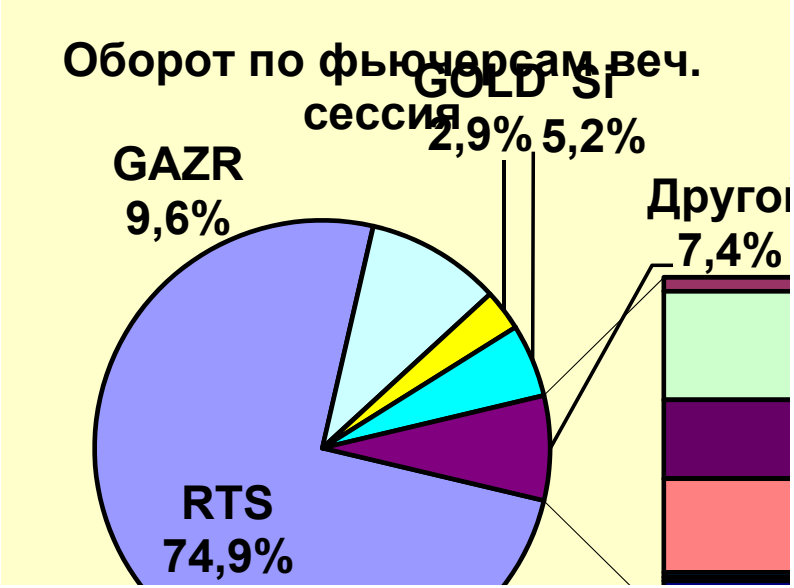
	60	65	70	75	80	85	90	95	100	105	110	115	120	125	130	135	140	145	150	155	160	200	250	320	320	320
Открытых позиций CALL	0	0	0	0	0	0	94	0	814	20	6298	428	3167	6	7168	6	3276	8	3388	2	66	400	4	150	52	50
Открытых позиций PUT	1572	5125	8904	2	9322	8	7492	2	5374	28	2144	20	1214	0	2252	0	120	0	2	0	0	0	2	106	6	6
Волатильность	137	136	133	129	124	117	110	101	93,1	85,6	79,3	74,4	70,7	66,7	63,8	64,9	67,7	71,6	76,1	80,9	85,8	115	126	127	85,8	130

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert






Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
Кол-во..
Оборот
600000
50000
400000
300000
200000
100000
0
7000
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
242 150
37 906
169 314
339 546
10 606
484 572
10 610
143 884
5 266
30
69 252
369 164


Оборот по фьючерсам веч. сессия
GAZR
9,6%
GOLD SI
2,9%
5,2%
Другие
7,4%
RTS
74,9%