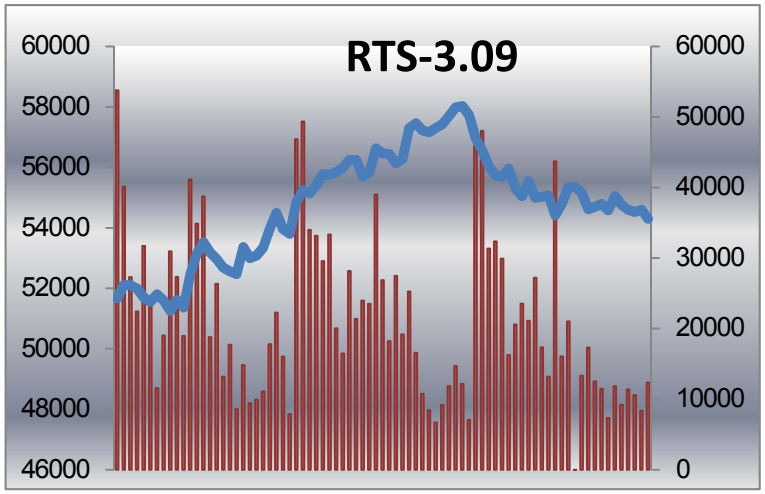
Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

Фиксинг

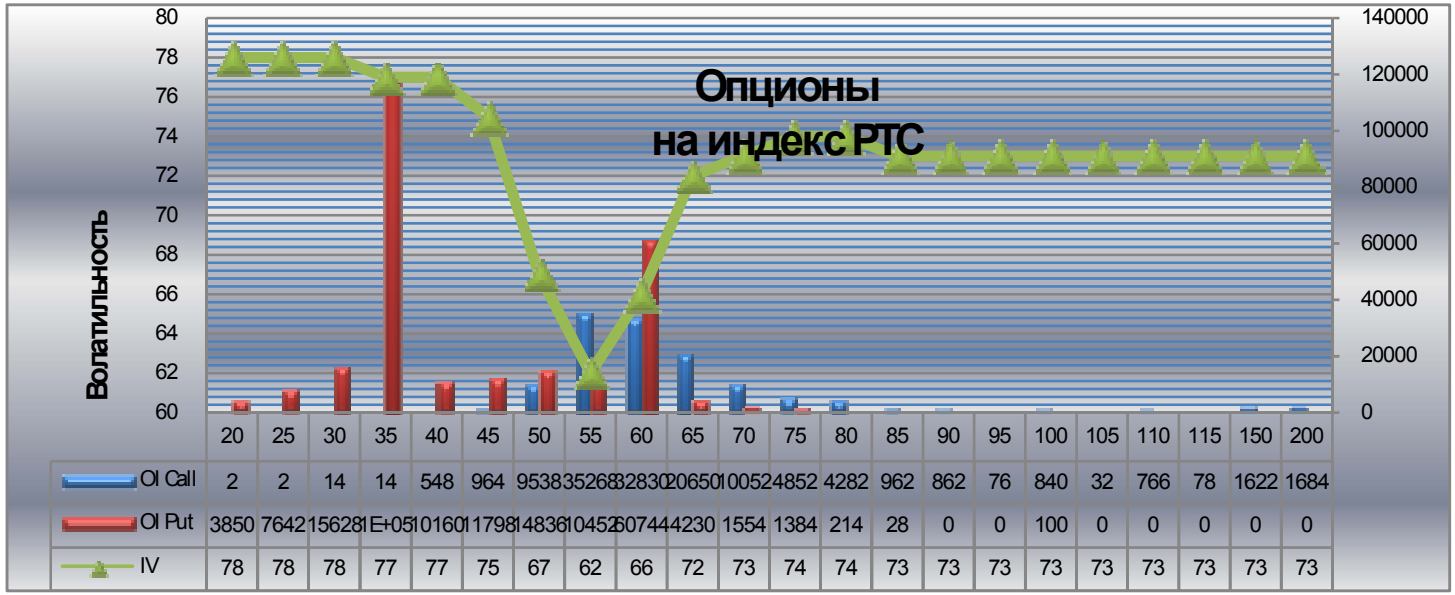
Четверг закончился на негативной ноте. Индексы под конец торговой сессии спустились вниз. В течение дня выходило много данных макроэкономической статистики, однако сломить тенденцию на понижение они не смогли. Несколько оживило ход торгов открытие сессии в США. По сравнению с предыдущим кварталом ВВП снизился на 1,5%, как и ожидали аналитики

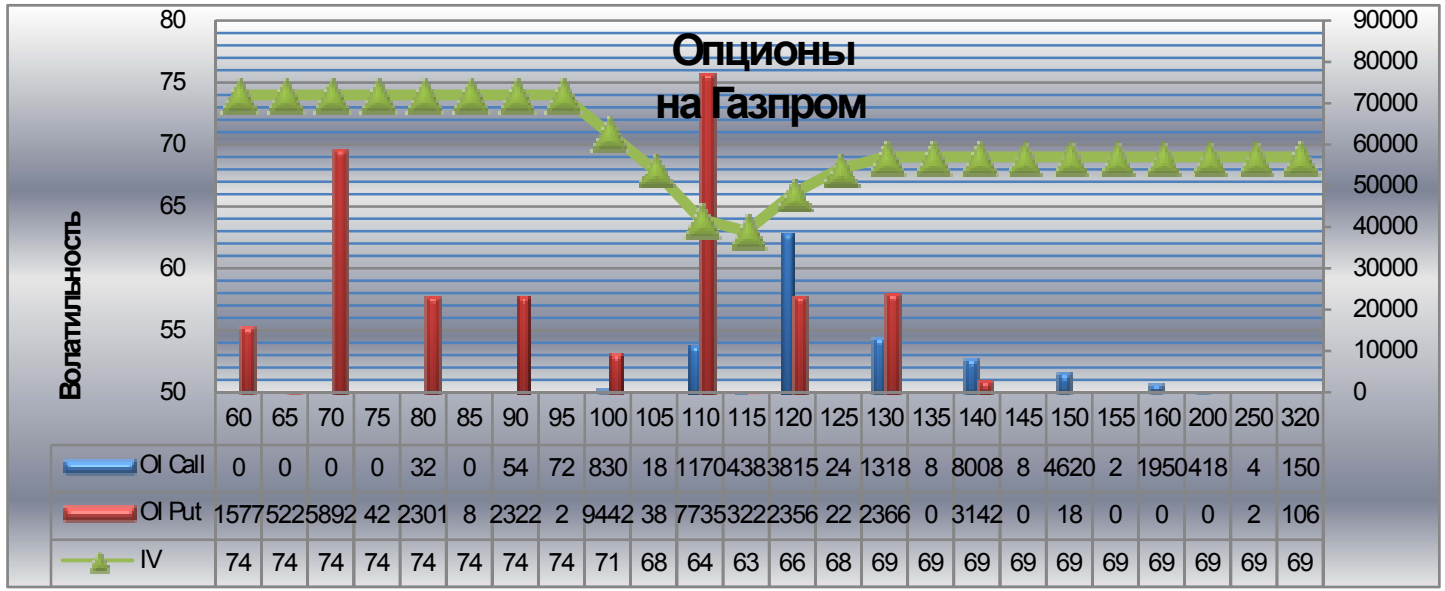
Индекс ММВБ снизился на 2,0% - до 671,91 пункта, классический индекс РТС - на 0,67% - до 559,09 пункта.

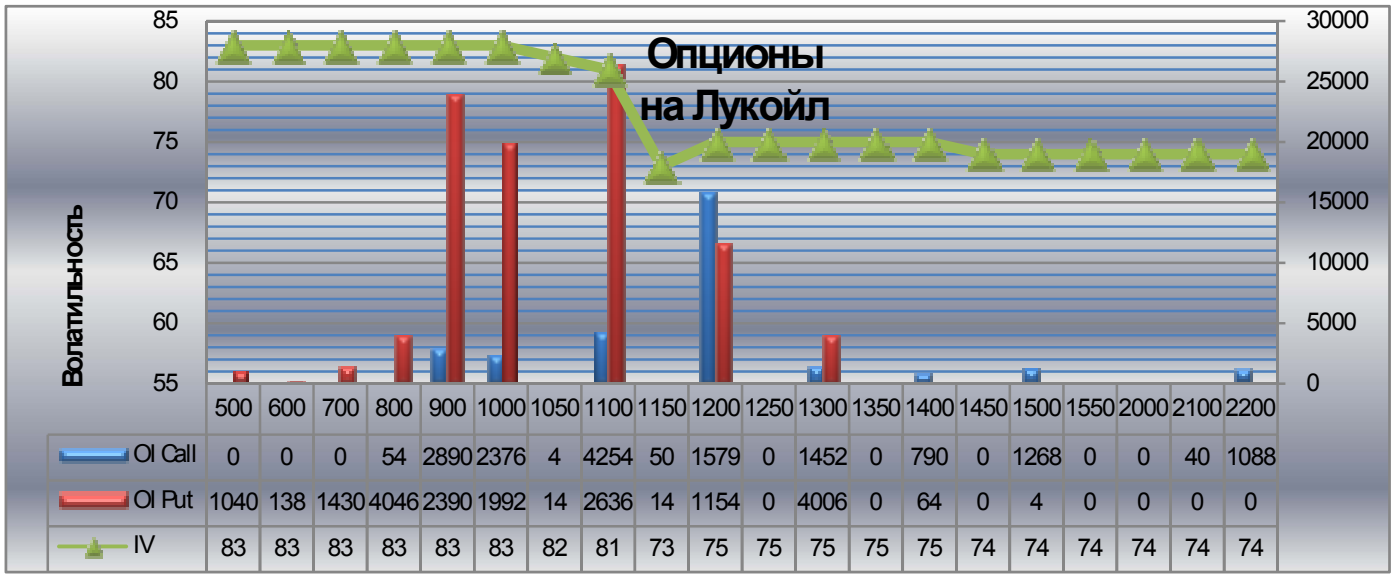


	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 17:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-3.09	54305	543,05	-1,88	315146	1,13%	5 998 155 573	25,47%
ROSN-3.09	12315	123,15	-2,23	23778	-0,35%	5 216 973	3,17%
LKOH-3.09	11415	1141,50	-1,81	141780	0,47%	126 378 556	13,34%
GAZR-3.09	11066	110,66	-1,23	238114	1,76%	271 776 558	13,98%
GMKR-3.09	16535	1653,50	-2,58	8342	-1,23%	4 315 126	4,44%
SBRF-3.09	1543	15,43	-2,28	408114	-2,87%	46 965 557	11,51%
SNGR-3.09	21600	21,60	-1,88	7654	0,92%	4 573 644	4,70%
VTBR-3.09	2099	0,0210	-3,63	268614	0,34%	11 915 771	23,46%
BR-3.09	43,65	43,65	-3,2	27830	9,95%	113 519 360	15,61%
UR-3.09	43,95	43,95	-0,12	114	0,00%	1 019 783	100,00%
GOLD-3.09	934	934,20	2,26	36442	11,38%	269 258 252	21,04%
Si-3.09	36050	36,05	-0,03	298014	-1,05%	118 074 981	10,44%
Eu-3.09	45229	45,23	0,43	5230	-0,83%	1 716 920	4,21%
ED-3.09	1,2550	1,26	0,18	56238	-3,61%	897 360 560	19,09%

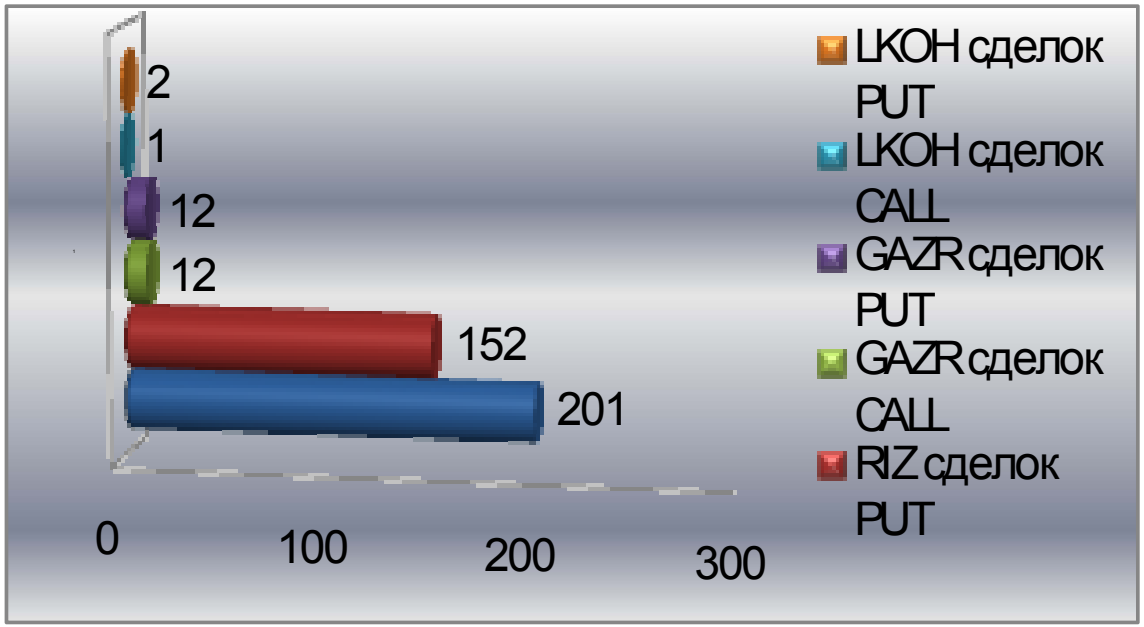
	Закрытие	Изменение %	Время
DJ Industrial	6594,44	-4,09%	00:02:45
S&P 500	682,55	-4,25%	00:07:12
DAX 30	3695,49	-5,02%	23:35:14
CAC 40	2569,63	-3,96%	20:32:23
FTSE 100	3529,86	-3,18%	19:35:33
Hang Seng	12211,24	-0,97%	11:16:01
Nikkei 225	7433,49	1,95%	10:00:15
BOVESPA Brazil	37368,93	-2,69%	00:12:01
Gold	932,4	2,88%	00:22:48
Silver	13,21	2,15%	00:20:05
Palladium	196	-0,25%	00:13:53
Platinum	1060	1,44%	00:22:14
Brent Crude Oil 0409	43,85	-4,92%	00:22:48
RTSI	559,09	-0,67%	18:00:00
	561,2 Конец		


Опционы
на индекс РТС
Волатильность
80
78
76
74
72
70
68
66
64
62
60
140000
120000
100000
80000
60000
40000
20000
0
20 25 30 35 40 45 50 55 60 65 70 75 80 85 90 95 100 105 110 115 150 200
OI Call 2 2 14 14 548 964 95383526832830206501005248524282 962 862 76 840 32 766 78 1622 1684
OI Put 3850 7642 15628 1E+05 10160 11798 14836 10452 607444230 1554 1384 214 28 0 0 100 0 0 0 0 0
IV 78 78 78 77 77 75 67 62 66 72 73 74 74 73 73 73 73 73 73 73 73 73


Опционы
на Газпром
Волатильность
80
75
70
65
60
55
50
90000
80000
70000
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
60 65 70 75 80 85 90 95 100 105 110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 200 250 320
OI Call 0 0 0 0 32 0 54 72 830 18 1170438 3815 24 1318 8 8008 8 4620 2 1950 418 4 150
OI Put 1577 5225 8924 2301 8 2322 2 9442 38 77353222356 22 2366 0 3142 0 18 0 0 0 2 106
IV 74 74 74 74 74 74 74 74 71 68 64 63 66 68 69 69 69 69 69 69 69 69 69



	500	600	700	800	900	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	2000	2100	2200
OI Call	0	0	0	54	2890	2376	4	4254	50	1579	0	1452	0	790	0	1268	0	0	40	1088
OI Put	1040	138	1430	4046	2390	1992	14	2636	14	1154	0	4006	0	64	0	4	0	0	0	0
IV	83	83	83	83	83	83	82	81	73	75	75	75	75	75	74	74	74	74	74	74



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



