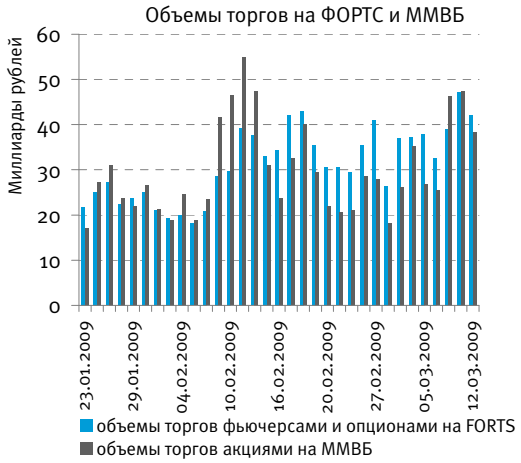
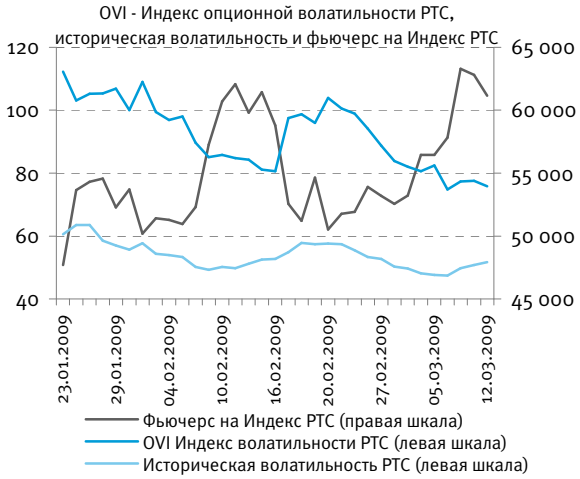
ФИНАНСОВАЯ КОРПОРАЦИЯ Открытие

ЕЖЕДНЕВНЫЙ ОБЗОР РЫНКА ДЕРИВАТИВОВ

13 МАРТА 2009 Г.





ВОССТАНОВЛЕНИЕ ОПТИМИЗМА НА СРОЧНОМ РЫНКЕ В ВЕЧЕРНЮЮ СЕССИЮ

В четверг на срочном рынке в основную торговую сессию участники рынка фиксировали прибыль после бурного роста. В вечернюю сессию ситуация изменилась и фьючерсы вновь продемонстрировали бурный рост на фоне уверенной динамики американских площадок. В вечернюю сессию фьючерс на индекс РТС вырос на 4,6%.

С приближением даты экспирации по мартовским фьючерсам участники рынка начали активно роллировать позиции в июньские контракты.

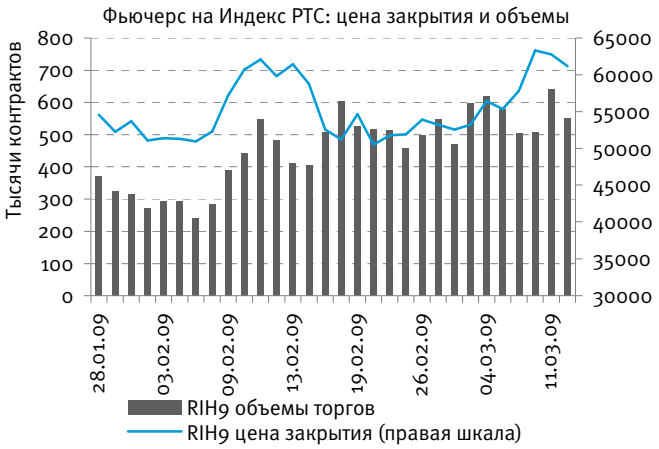
После бурного роста в вечернюю сессию на срочном рынке можно ожидать вялых торгов с фиксацией прибыли. Цены на нефть WTI, вернувшиеся к уровню $46,6 за баррель, удержат игроков от активных продаж.

Павел Зайцев

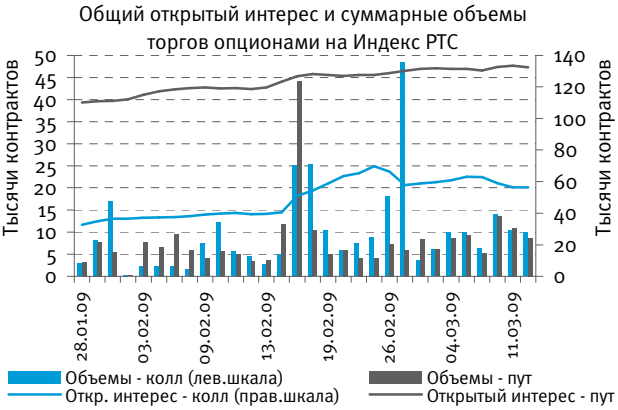
Ночные торги			
Контракт	Цена закрытия	Измен-е цены к дневному закрытию %	объем торгов в % к дневному обороту
RTS-3.09	64 005	4.64	22.23
GAZR-3.09	12 614	4.06	7.87
LKOH-3.09	13 029	3.89	10.06
GMKR-3.09	18 900	3.28	19.47
SBER-3.09	1 709	3.39	20.03
VTBR-3.09	2 608	2.23	2.16
SNGR-3.09	24 500	4.40	4.53
GOLD-3.09	926	-0.24	105.19

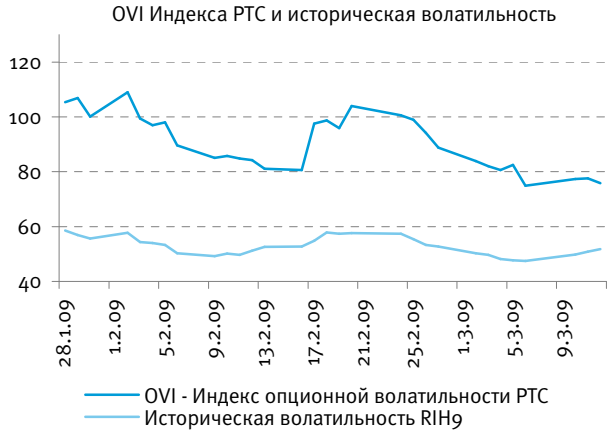
Контракт	Дата	Дней до погашения	Цена закрытия	Измен-е цены %	Объем торгов (контрактов)	Изменение объема торгов %	Открытый интерес по всем фьючерсам	Изм-е откр-го интереса по всем фьючерсам	Открытый интерес по текущему фьючерсу	Прир-е открытого интереса	Спрэд, пунктов
RTS-3.09	12.03.2009	1	61 165	-2.60	550 523	-14.0	173 050	-1.7	134 926	-7.1	-7.3
GAZR-3.09	12.03.2009	1	12 122	-3.14	145 634	-39.3	156 087	-0.5	66 210	-27.1	-1.2
LKOH-3.09	12.03.2009	1	12 541	-2.40	55 712	-46.8	71 809	-7.2	47 002	-28.8	-10.9
GMKR-3.09	12.03.2009	1	18 300	5.17	5 351	3.3	12 223	73.0	2 435	-36.1	-1.3
SBER-3.09	12.03.2009	1	1 653	-4.45	134 190	-39.1	301 977	3.0	164 909	-10.1	-0.1
VTBR-3.09	12.03.2009	1	2 551	-2.26	19 029	-75.0	110 064	-10.6	94 180	-12.8	0.0
SNGR-3.09	12.03.2009	1	23 468	-3.74	4 190	228.1	4 709	31.8	2 630	-17.5	-0.2
GOLD-3.09	12.03.2009	1	928	2.76	7 883	-46.6	18 683	-0.9	5 867	-24.3	

ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС

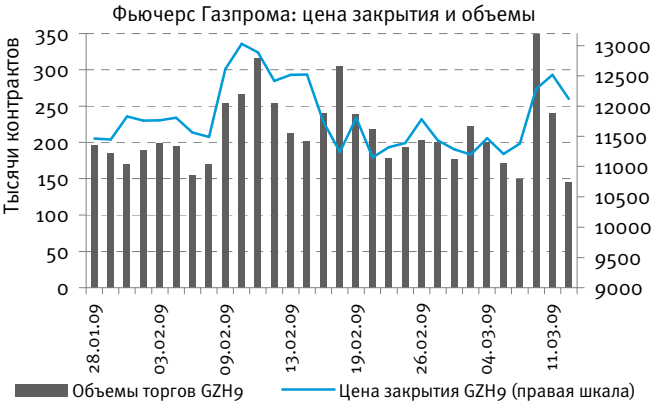




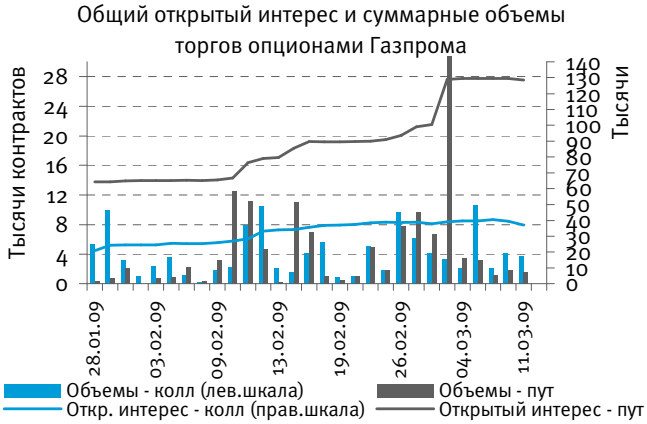


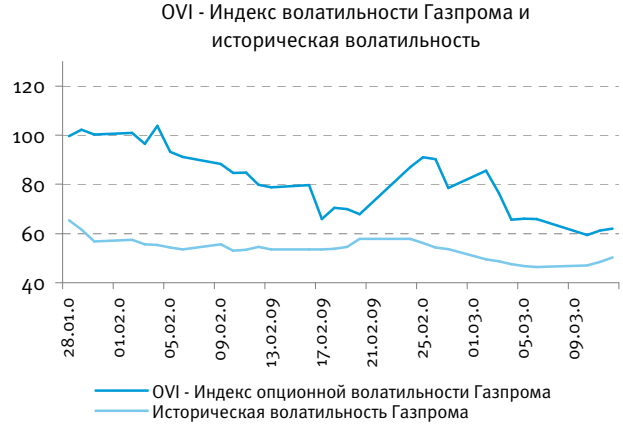


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



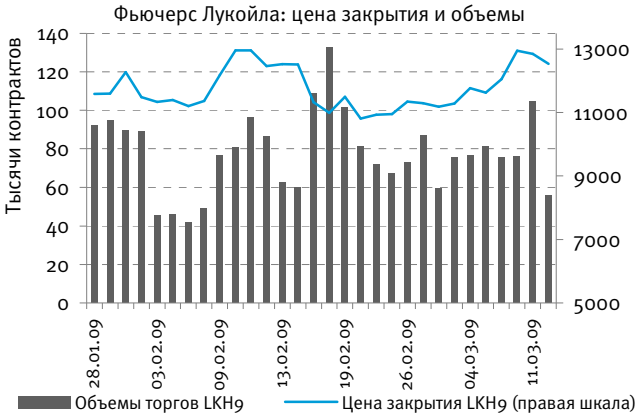






ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА

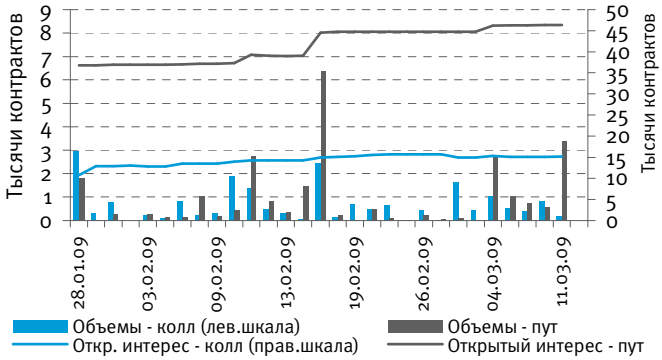
Фьючерс Лукойла: цена закрытия и объемы



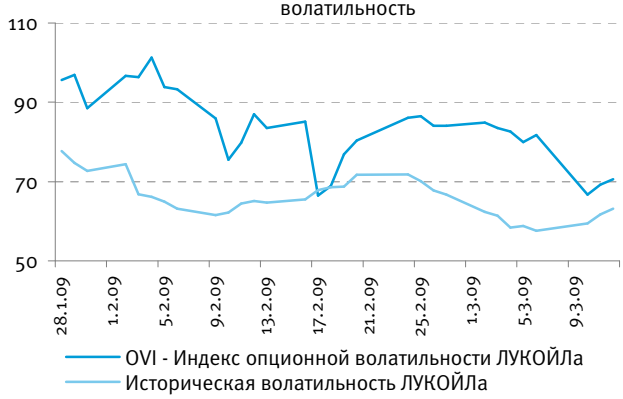
Открытый интерес во фьючерсах Лукойла



Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами Лукойла

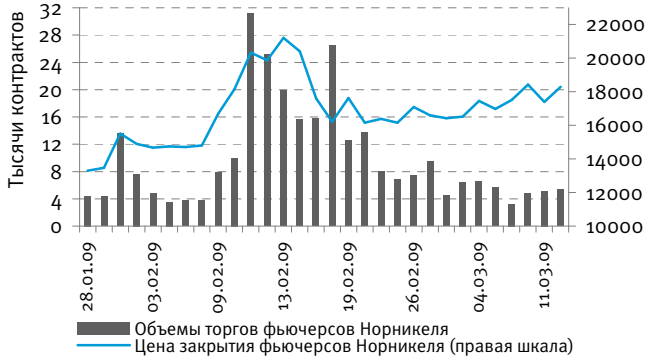


OVI - Индекс волатильности Лукойла и историческая волатильность



ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК «НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ»

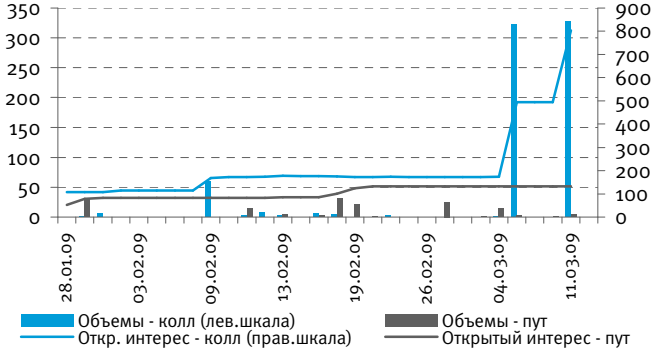
Фьючерс Норникеля: цена закрытия и объемы торгов



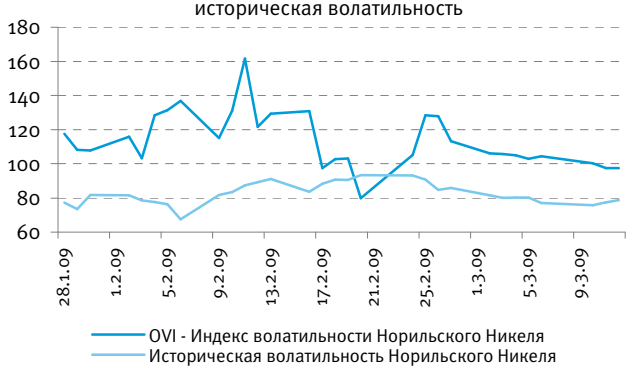
Открытый интерес во фьючерсах Норникеля



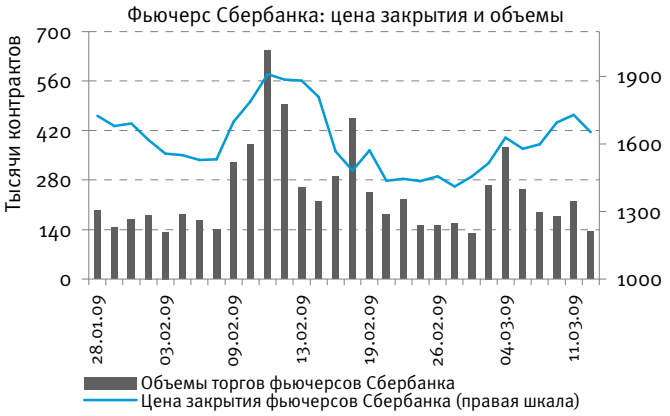
Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами Норникеля

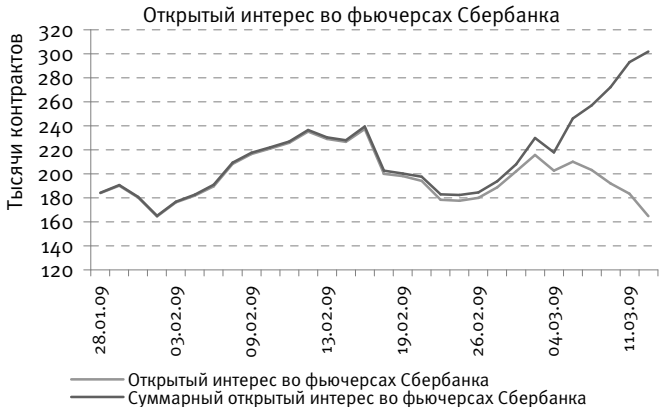


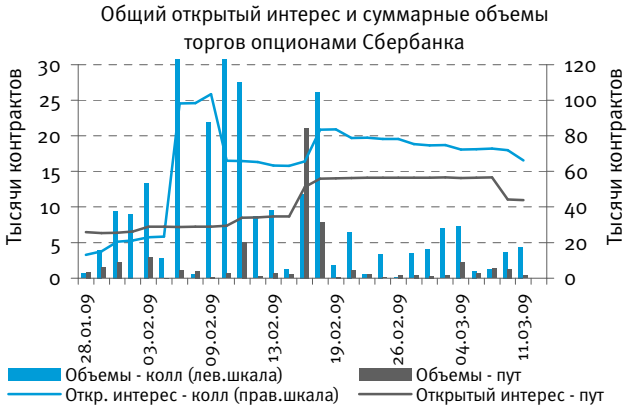
OVI - Индекс волатильности Норникеля и историческая волатильность

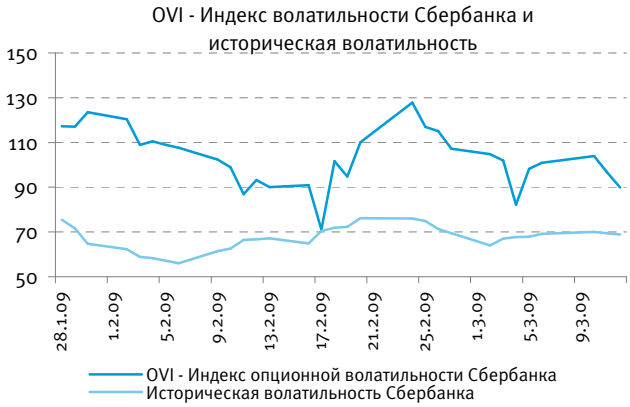


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА

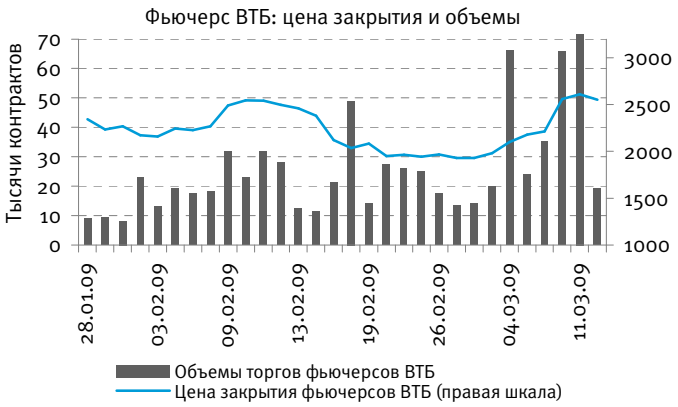




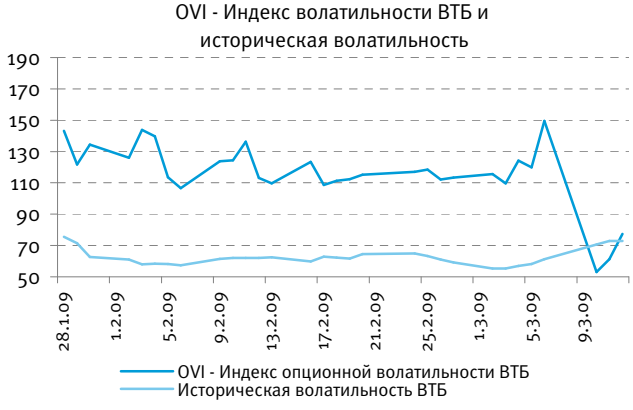




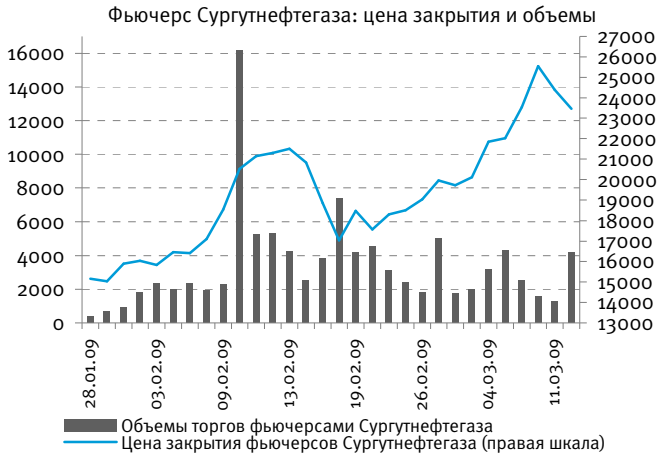
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ

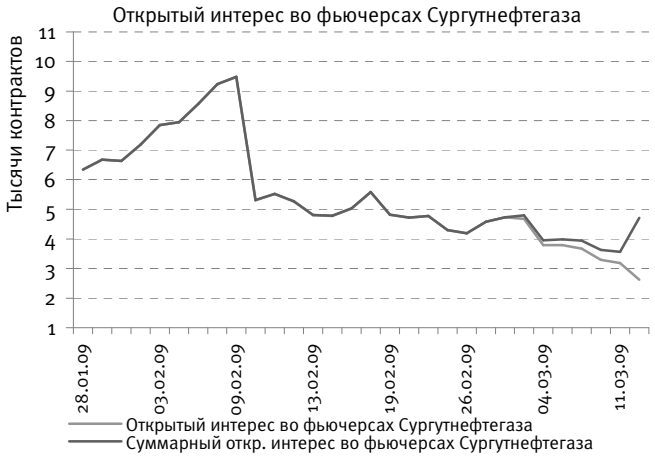




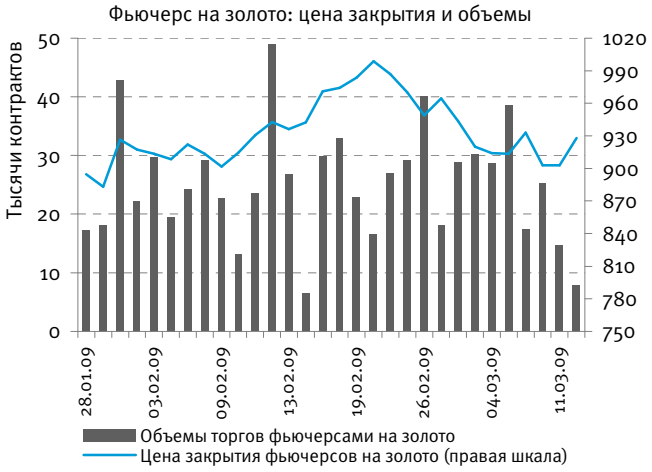


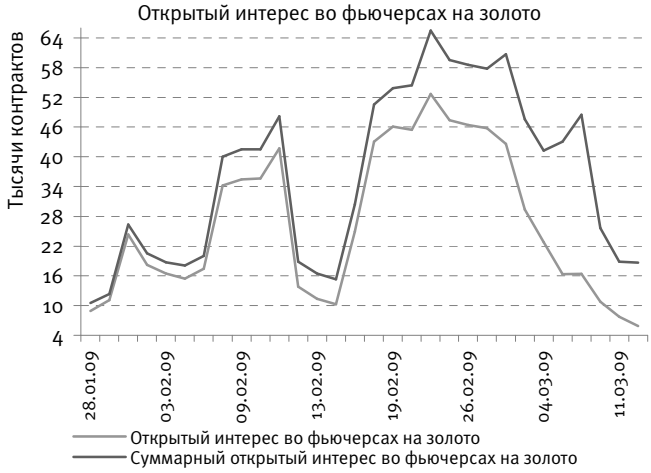
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СУРГУТНЕФТЕГАЗА

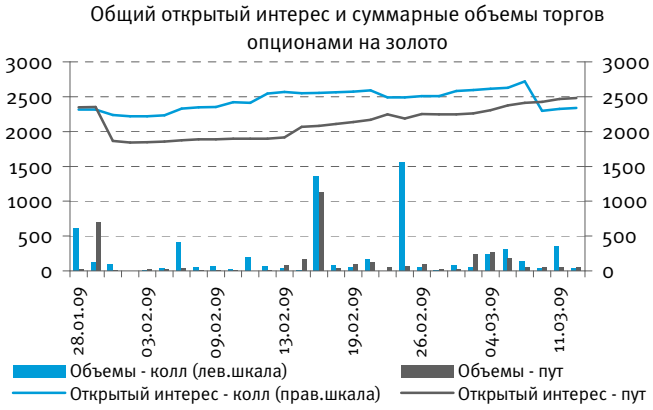




ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



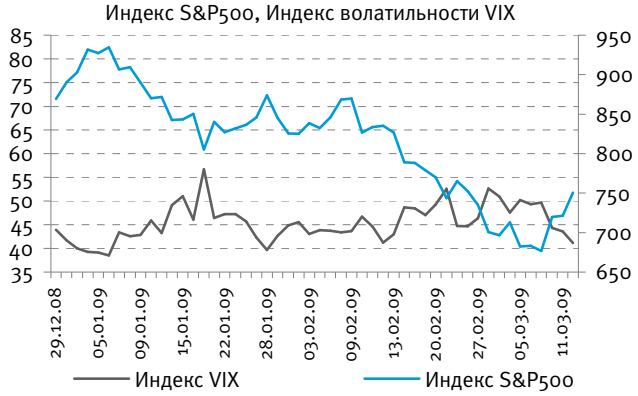




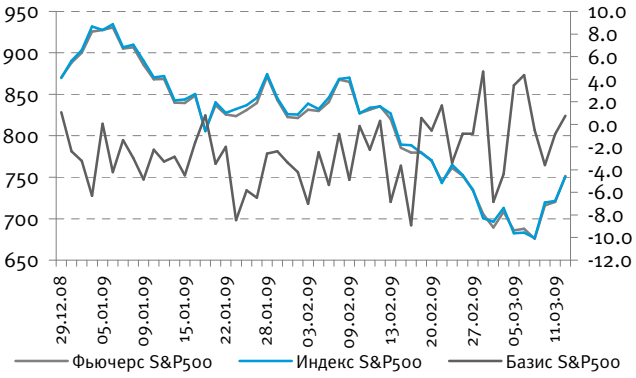
МЕЖДУНАРОДНЫЕ СРОЧНЫЕ РЫНКИ

ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС S&P500

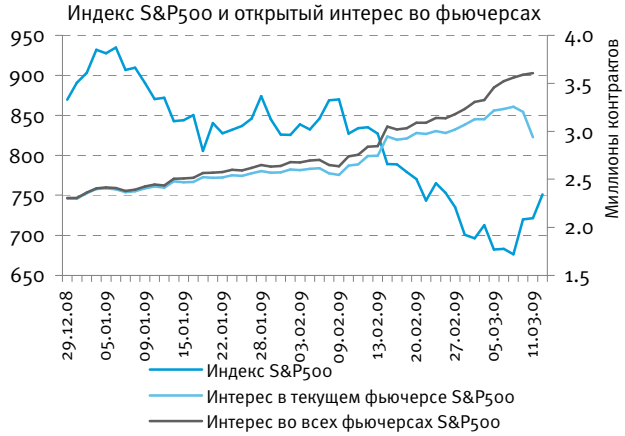
Индекс S&P500, Индекс волатильности VIX



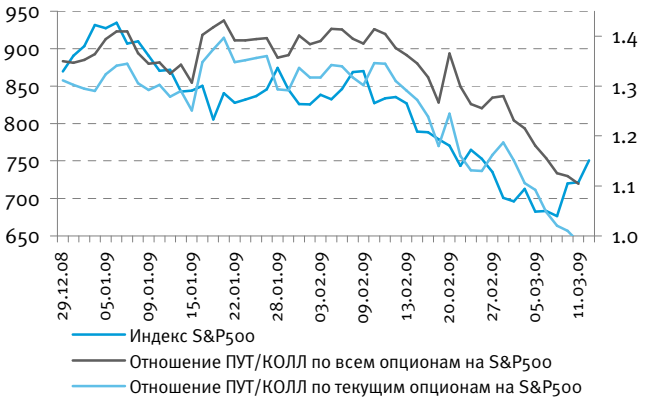
Индекс S&P500, фьючерс, базис S&P500



Индекс S&P500 и открытый интерес во фьючерсах

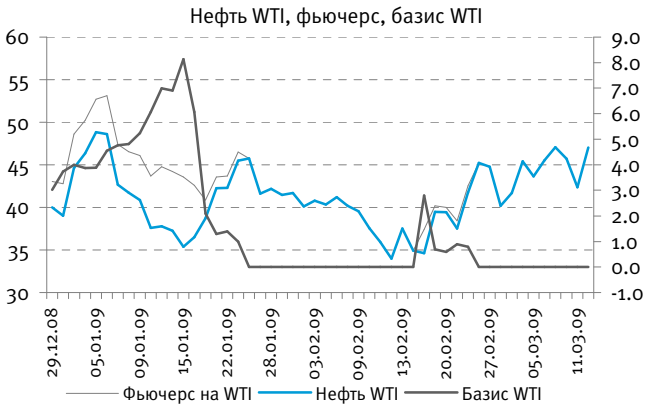


Индекс S&P500 и отношение ПУТ/КОЛЛ по опционам



ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ МАРКИ WTI

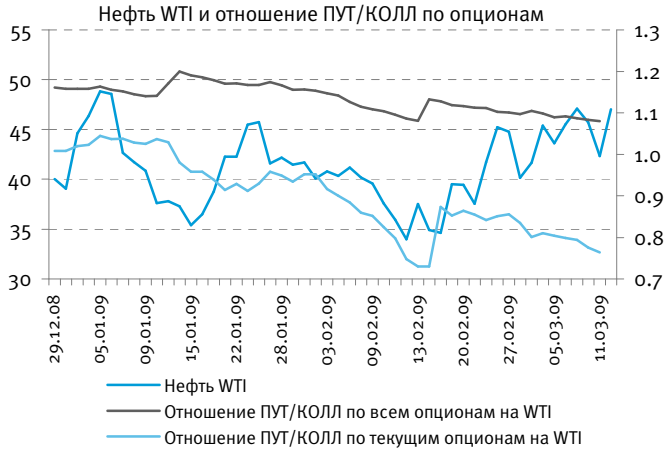
Нефть WTI, фьючерс, базис WTI



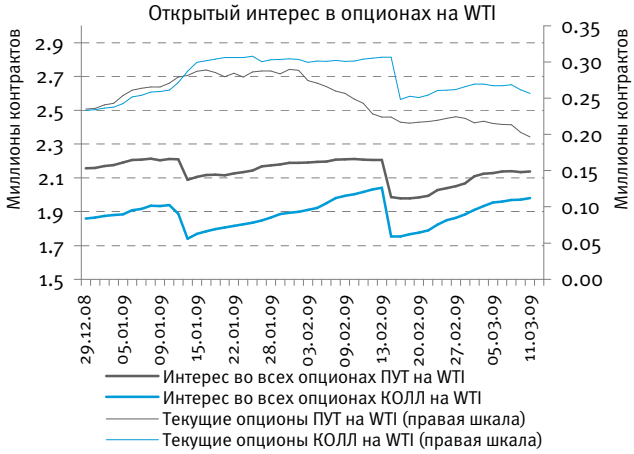
Нефть WTI и открытый интерес во фьючерсах



Нефть WTI и отношение ПУТ/КОЛЛ по опционам

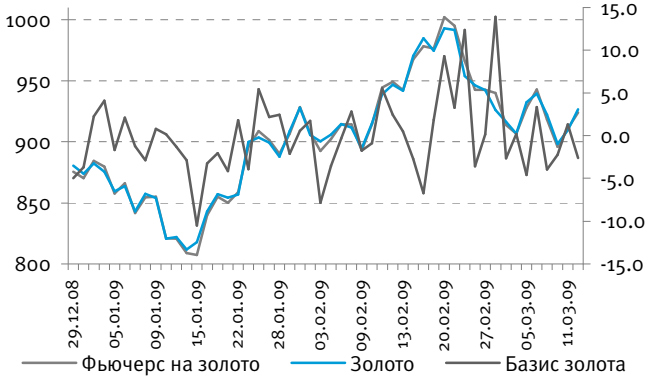


Открытый интерес в опционах на WTI

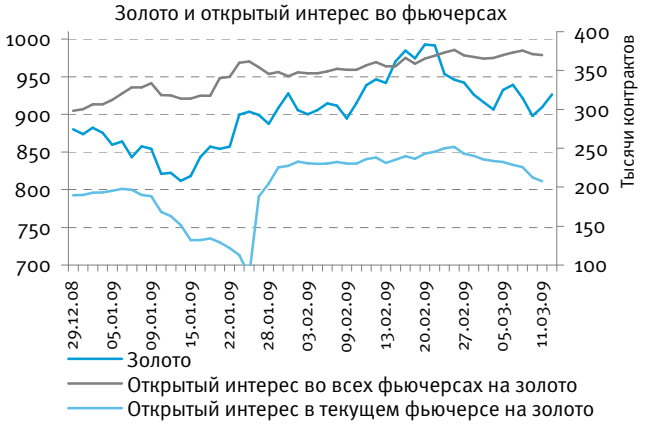


ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО

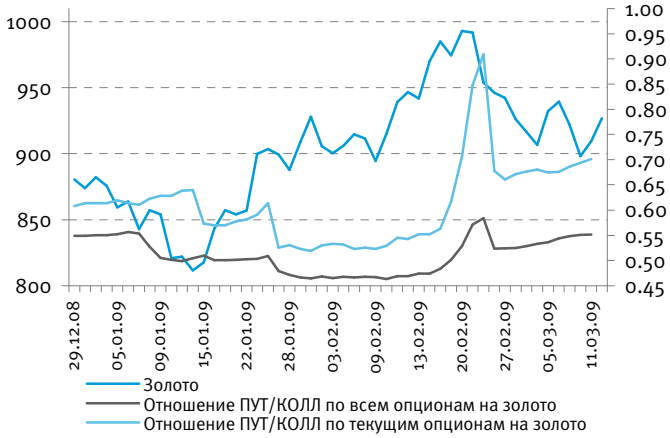
Золото, текущий фьючерс, базис по золоту



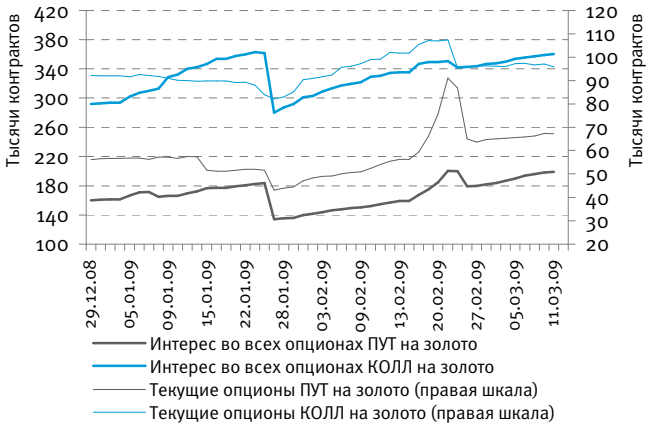
Золото и открытый интерес во фьючерсах



Золото и отношение ПУТ/КОЛЛ по опционам

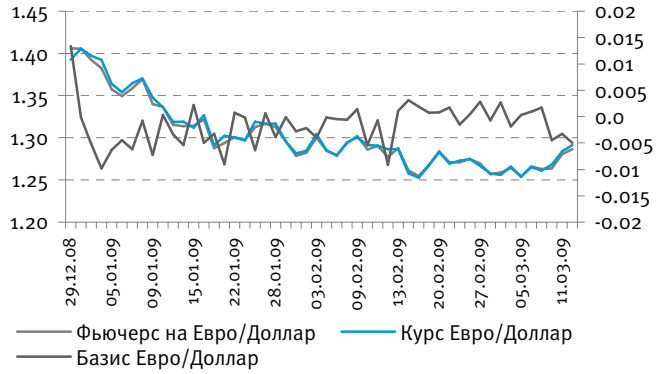


Открытый интерес в опционах на Золото

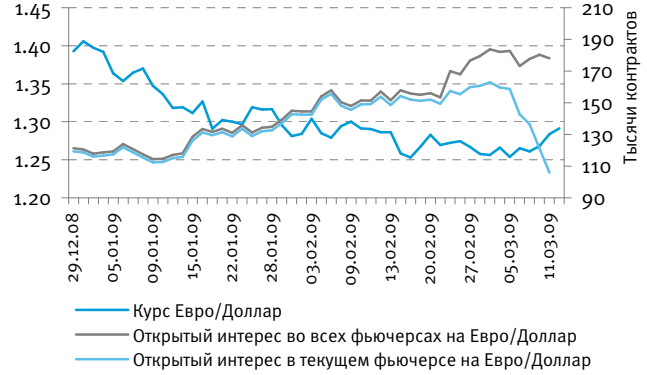


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО/ДОЛЛАР

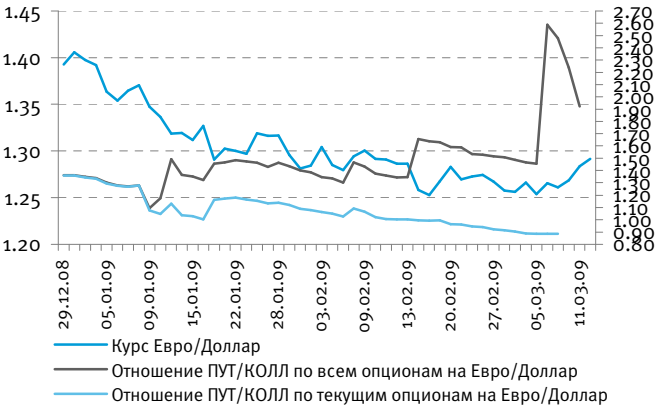
Евро/Доллар, текущий фьючерс, базис Евро/Доллар



Евро/Доллар и открытый интерес во фьючерсах



Евро/Доллар и отношение ПУТ/КОЛЛ по опционам



Открытый интерес в опционах на Евро/Доллар

