Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

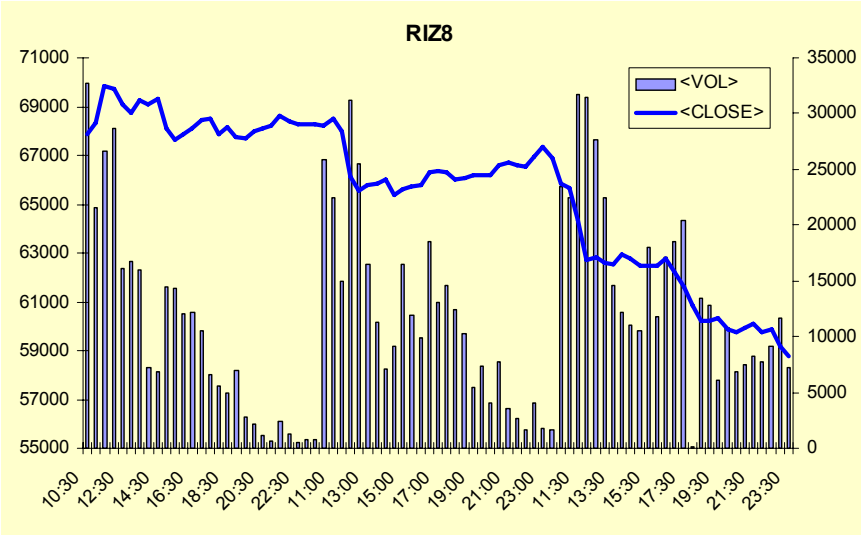
Завтрашнее открытие будет резко негативным

После прощ\шедших прездников в Америке начались мастабные распродажи. Все сильнее начали циркулировать слухи о вероятности объявления дефолта по долгам правительства. Все это плюс вышедшая отрицательная статистика спровоцировало чрезвычайно сильные распродажи.

Открытие торгов во вторник мы ожидаем резко негативным, вероятна потеря с открытия около 5%, затем скорее всего, начиная с 11 часов торги остановят на час, не исключено, что впоследствии тех. Индекс может опуститься и на 10% в связи с чем торги закроют до конца дня.

Что касается срочного рынка, то стоит отметить снижение IV на основных контрактах, что можно считать позитивным сигналом к оживлению рынка.

Крупные открытые позиции сконцентрированы в опционах Put на индекс РТС с исполнением по цене 500000 пунктов. Вероятно что крупные игроки не ожидают снижения фьючерса к экспирации ниже этого уровня.

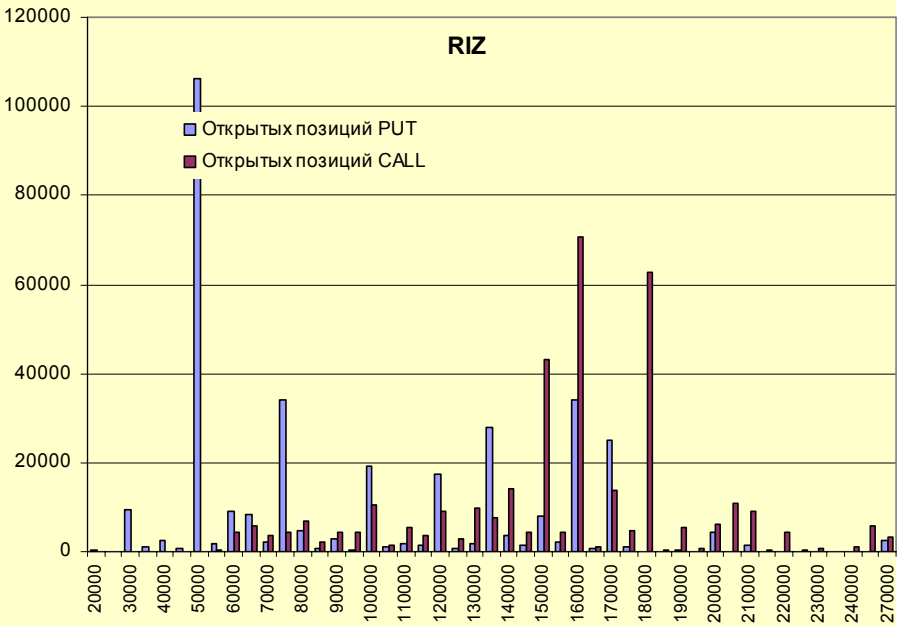


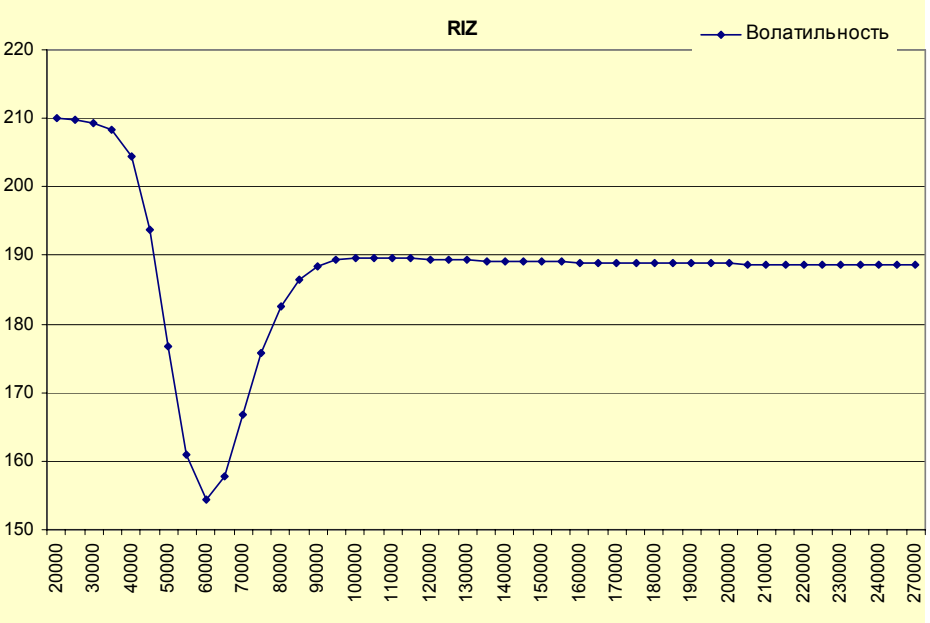
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед БА	% изм. закр.	Кол-во отк.поз.	Изм. OI	Оборот	В % к дневному
RTS-12.08	58790	587,90	-4,54	137846	-14,05%	4 224 862 115	33,64%
ROSN-12.08	9805	98,05	-5,4	23348	0,19%	2 734 919	9,99%
LKOH-12.08	7713	771,30	-5,96	107042	0,88%	25 783 667	13,19%
GAZR-12.08	10805	108,05	-4,13	198944	0,32%	235 779 876	15,62%
GMKR-12.08	17655	1765,50	-7,04	20302	0,82%	6 323 849	11,68%
SBRF-12.08	2146	21,46	-3,56	265326	-0,66%	24 876 749	13,22%
SNGR-12.08	15312	15,31	-3,7	22722	-0,14%	2 004 027	5,83%
VTBR-12.08	2882	0,03	-4,57	179088	0,34%	2 737 636	16,70%
BR-12.08	48,17	48,17	-4,35	4244	36,46%	93 488 692	85,41%
UR-12.08	46,99	46,99	-1,15	708	60,18%	4 330 823	49,62%
GOLD-12.08	773	772,70	-1,45	21162	-3,23%	213 525 044	60,29%
Si-12.08	28326	28,33	-0,19	365018	0,02%	92 041 155	10,35%

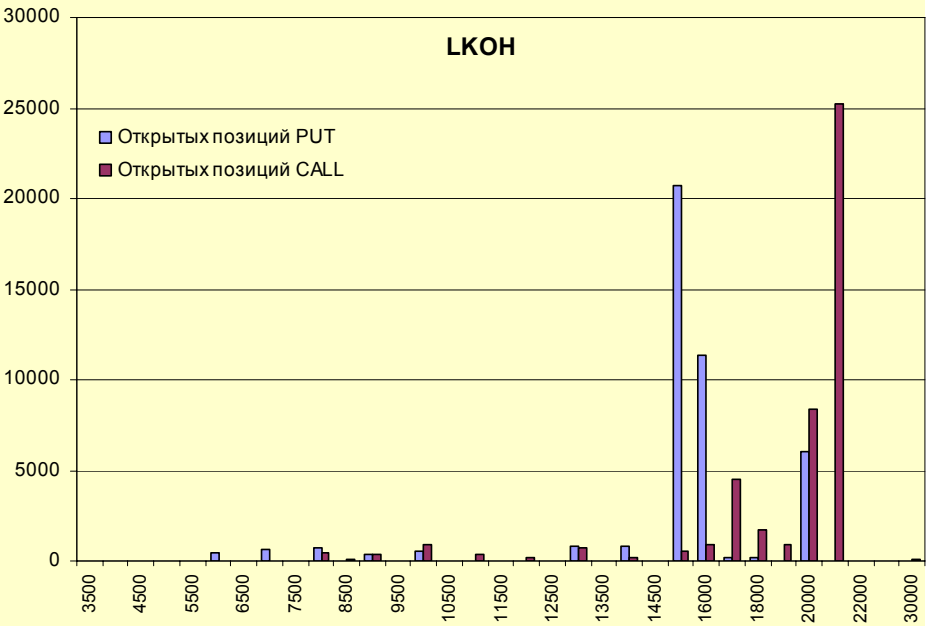
	Закр.	Изм. %	Время посл. изм.
RTSI	631.84	-4,01	18:00
RTSI_Derex	604.04	-8,02	18:35
DJIA	8149	-7,7	21:31
S&P 500	816,21	-8,93	23:58
NASDAQ	1398	-8,95	22:15
Brent	47,93	-10,39	00:15
EUR/USD	1,2628	0,01	2:00
Gold	770,6	-0,64	00:15

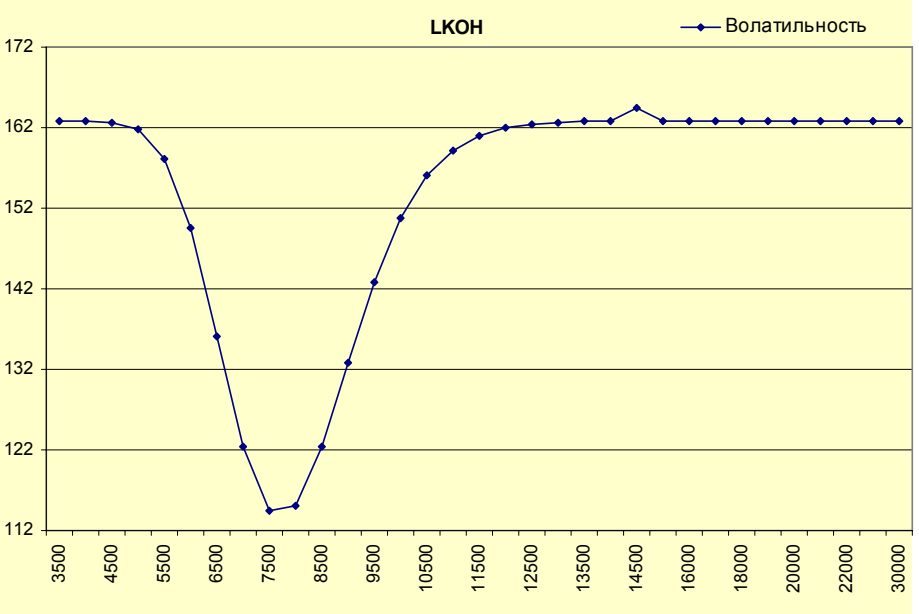
02.12.2008

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

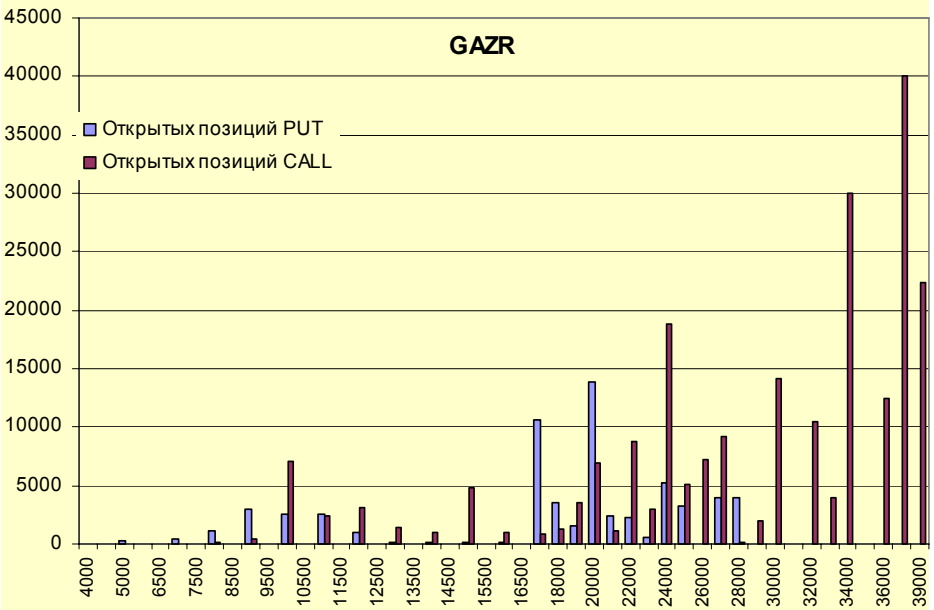


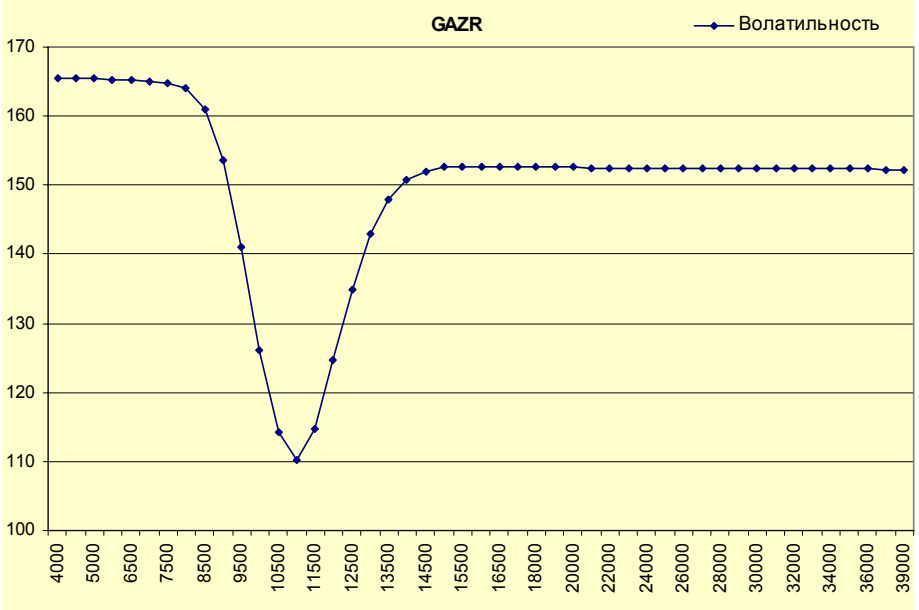




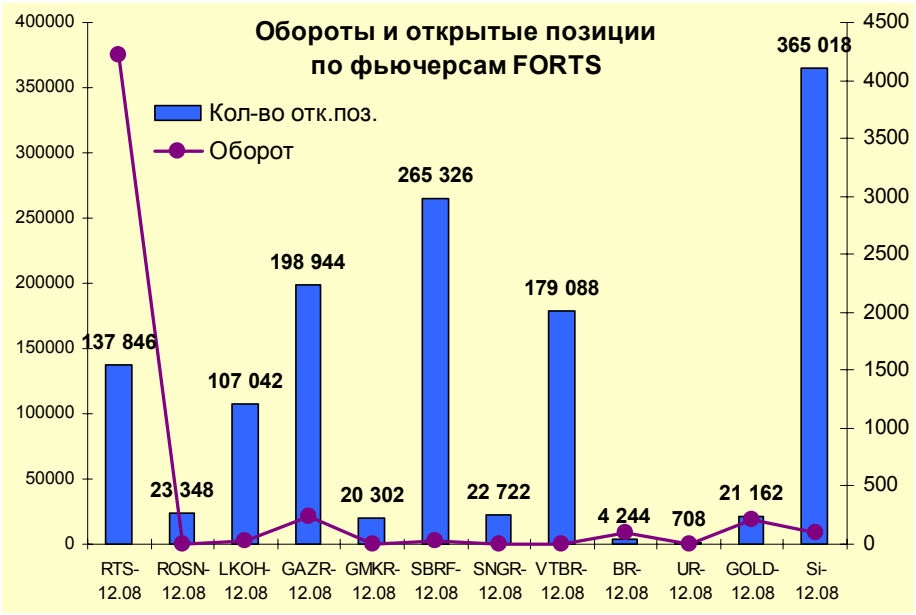


Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert









Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

