

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

На открытии прибавим полпроцента, а во второй половине дня возможен более серьезный рост

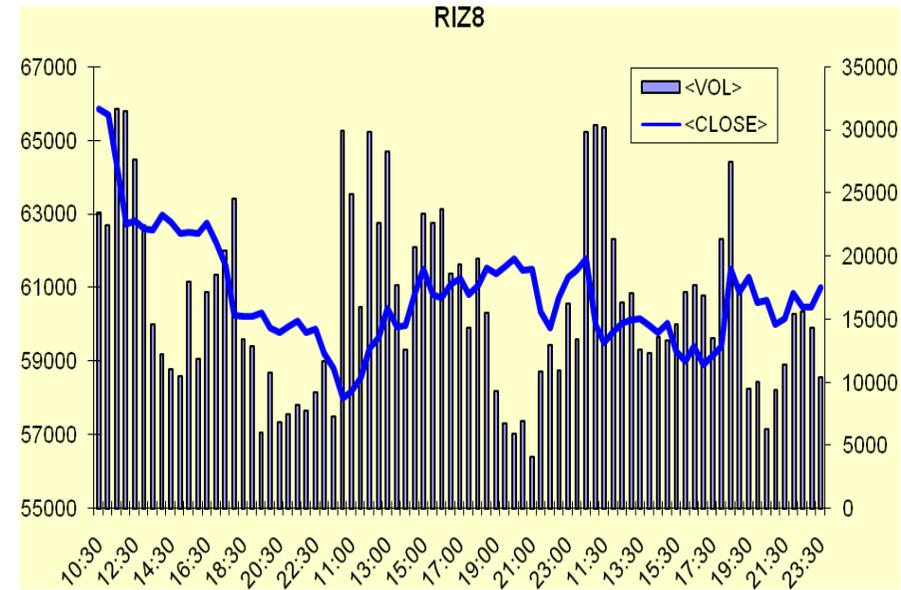
Вышедшая сегодня статистика по рынку труда в очередной раз подчеркнула глубокие проблемы в американской экономике. Индексы всего мира последовали вниз. Однако удалось переломить негативную тенденцию и выйти в положительную зону по всем американским индексам.

Полагаем, что такая стойкость к негативу, да еще и к негативу, вызванному одним из самых важных показателей по экономике Штатов, говорит нам о том, что продавцы на рынке просто закончились.

Быстро и эйфорического роста мы не ожидаем. Открытие пройдет довольно ровно. Затем, наметится небольшая коррекция, и во второй половине дня индекс может попробовать прийти к окрестности 63000 пунктов.

Волатильность на опционах на индекс продолжила свое падение. Однако, если 2 недели назад в рынке торговля шла с 10-20% дисконтом к теоретической волатильности, то сейчас наоборот, этот дисконт практически сошел на нет и в окрестностях центрального страйка опционы торгуются по теории.

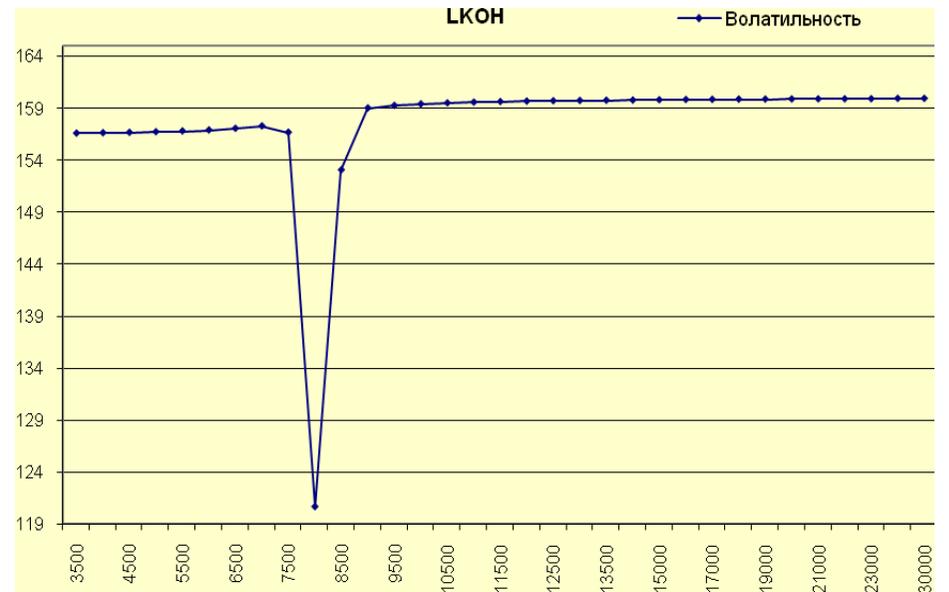
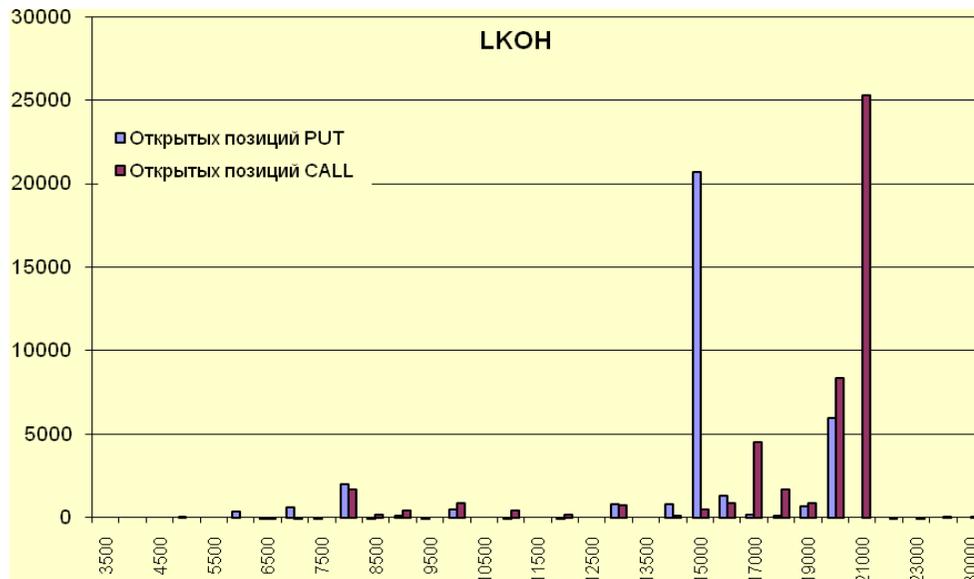
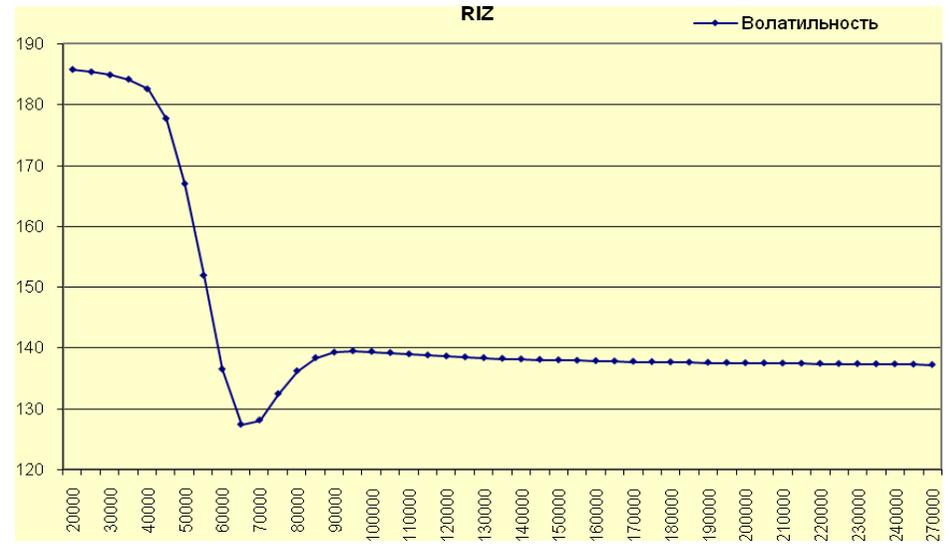
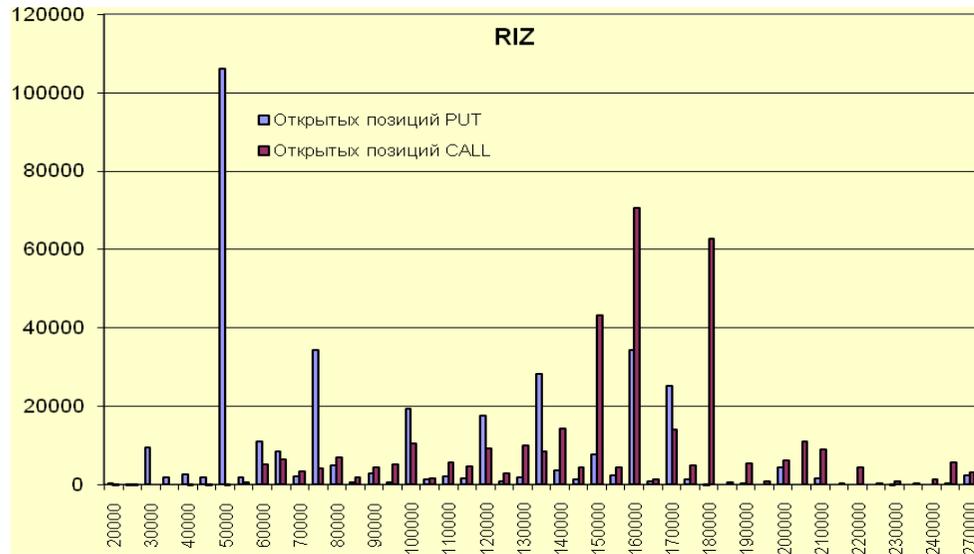
Вероятно что к экспирации мы так и не увидим индекс ниже 50000 пунктов: на этом страйке открыты большие позиции в опционах Put на индекс РТС.



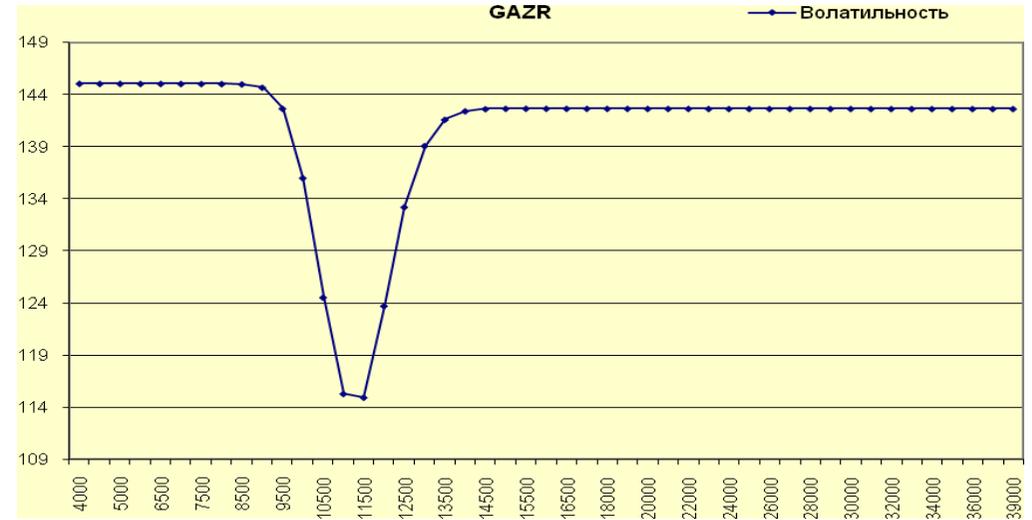
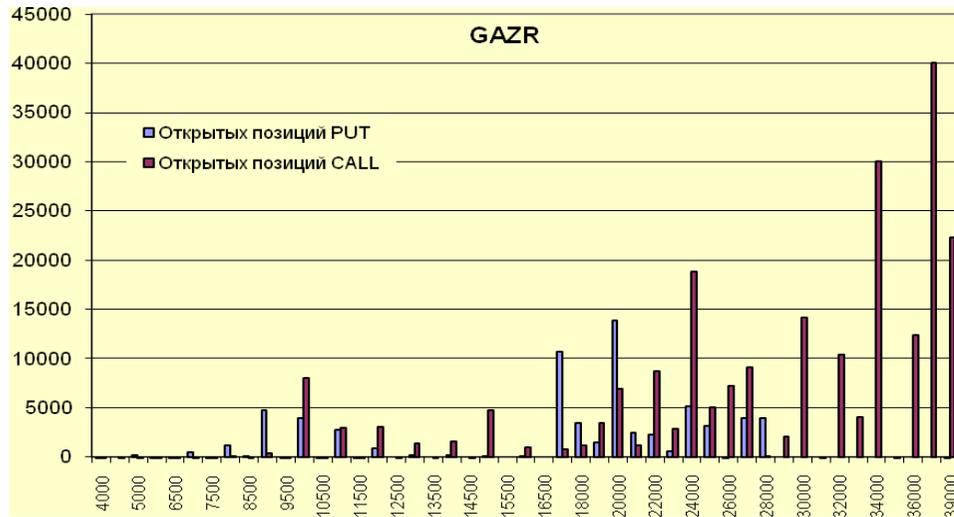
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед БА	% изм. закр.	Кол-во отк.поз.	Изм. ОI	Оборот	В % к дневному
RTS-12.08	61005	610,05	3,15	164654	4,18%	5 693 624 777	41,01%
ROSN-12.08	9932	99,32	3,94	24550	-0,45%	2 100 745	17,07%
LKOH-12.08	8064	806,40	1,81	115968	7,35%	55 185 438	27,86%
GAZR-12.08	11197	111,97	2,34	197054	-2,62%	329 543 554	16,21%
GMKR-12.08	17002	1700,20	1,67	20824	-0,51%	5 318 806	9,13%
SBRF-12.08	2147	21,47	1,7	244608	-1,93%	41 381 220	16,43%
SNGR-12.08	16574	16,57	2,68	23242	-0,66%	2 152 671	30,29%
VTBR-12.08	3100	0,0310	2,92	176812	-0,14%	15 006 557	8,05%
BR-12.08	45,05	45,05	-1,45	3242	0,31%	37 623 802	36,00%
UR-12.08	43,39	43,39	-0,26	828	5,61%	4 844 189	80,18%
GOLD-12.08	771	771,40	-0,13	15828	-4,85%	134 432 306	40,79%
Si-12.08	28162	28,16	-0,28	370604	-0,04%	41 256 377	16,76%

	Закр.	Изм. %	Время посл. изм.
RTSI	603,33	-2,41	18:00
RTSI_Derex	603,00	-2,48	18:45
DJIA	8591	2,05	00:03
S&P 500	870,7	2,58	00:24
NASDAQ	1492,4	2,94	00:24
Brent	45,39	-0,11	00:25
EUR/USD	1,2713	0,38	0:25
Gold	773,7	0,45	00:27

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

