

Ждем нейтрального открытия

После обвальной торговой сессии в понедельник сегодня в США торги закрылись в положительной зоне, что как минимум не обещает сильного негатива на утреннее открытие российских бирж.

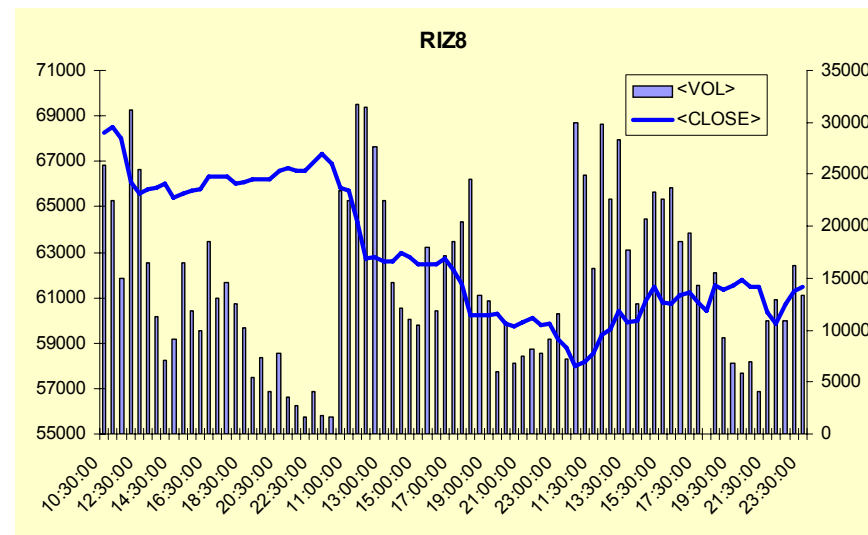
Цены на сырье продолжают падать, однако позитивные настроения инвесторов после выступления Бена Бернанке могут перебороть снижающиеся цены на нефть.

Сегодня появились серьезные открытые позиции на опционах PUT на индекс RTS на страйке 50000 и на опционах Call на страйке 160000, что возможно свидетельствует о приходе некоего крупного игрока, способного повлиять на рынок.

Волатильность продолжает постепенно снижаться.

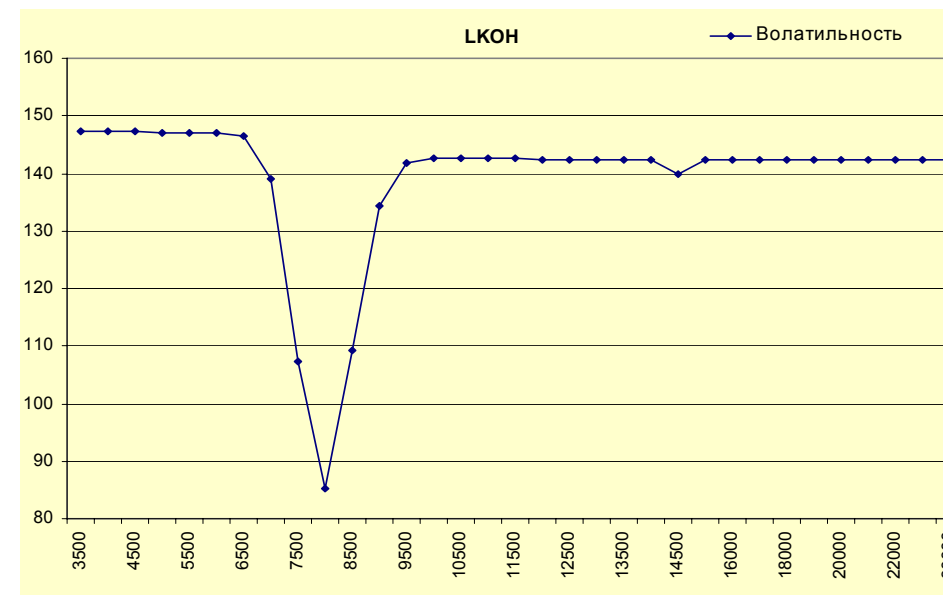
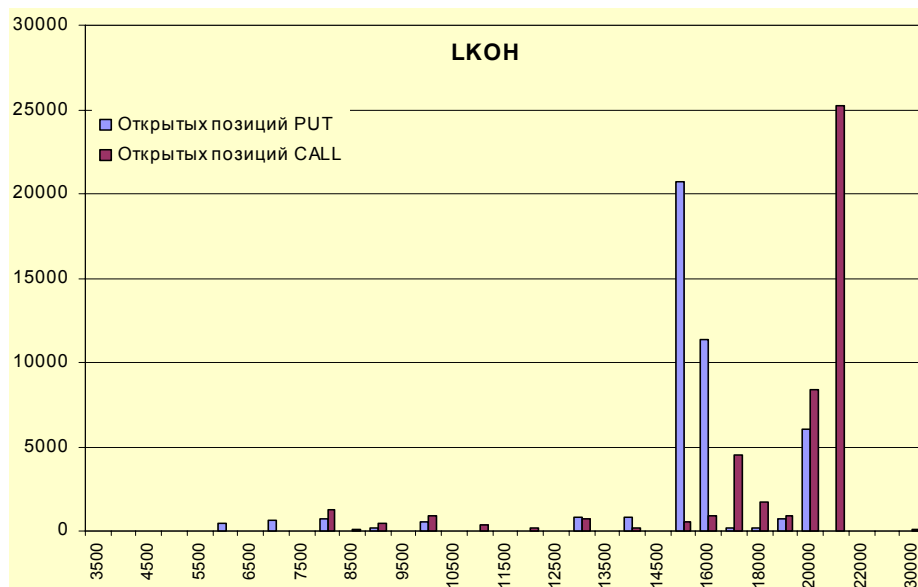
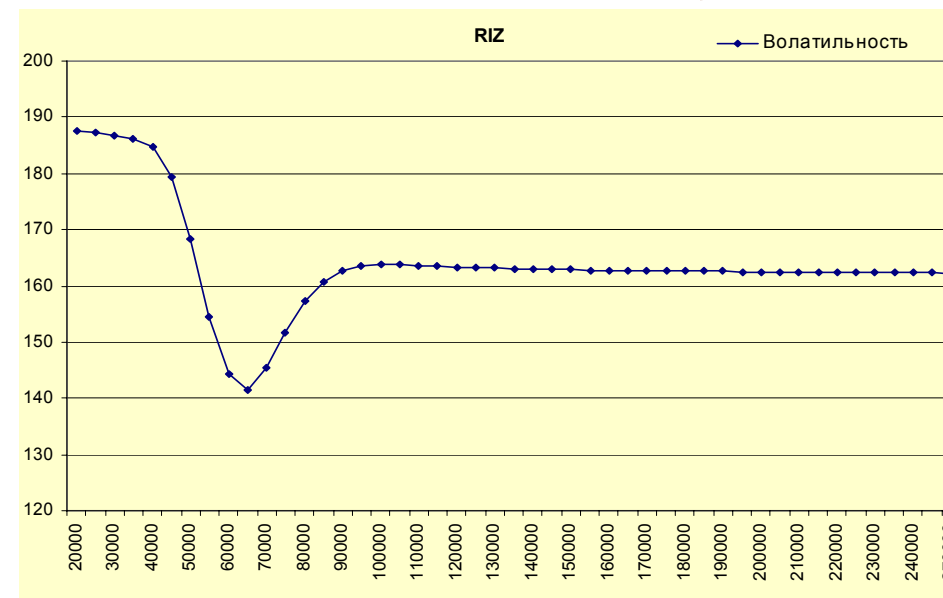
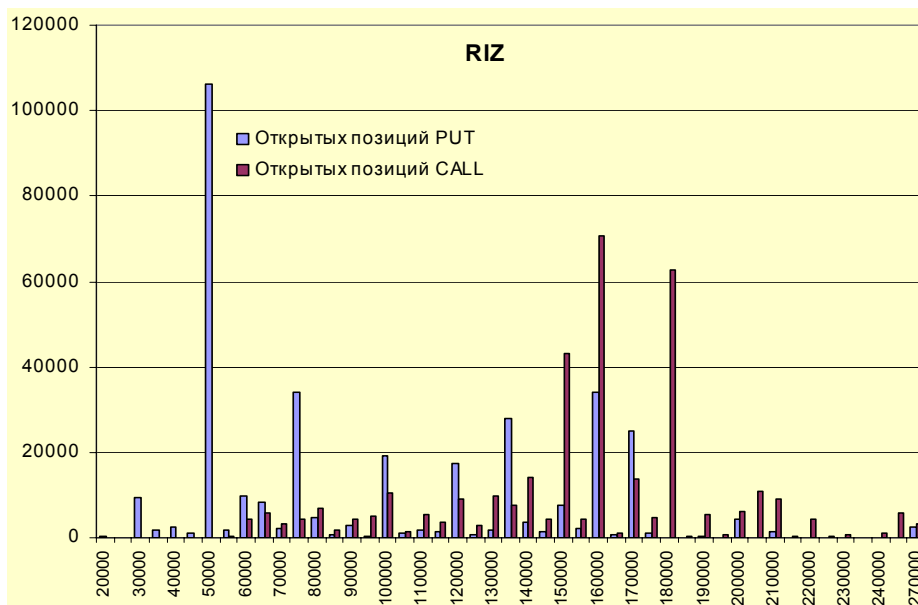
Во время вечерней сессии преобладали позитивные настроения по большинству наиболее ликвидных контрактов. Минусом отметился фьючерс на индекс, Сбербанк, золото и ВТБ.

В целом, отрицательного гэпа вниз утром мы не ожидаем, наиболее вероятно выглядит нейтральное открытие торгов ($\pm 1\%$).

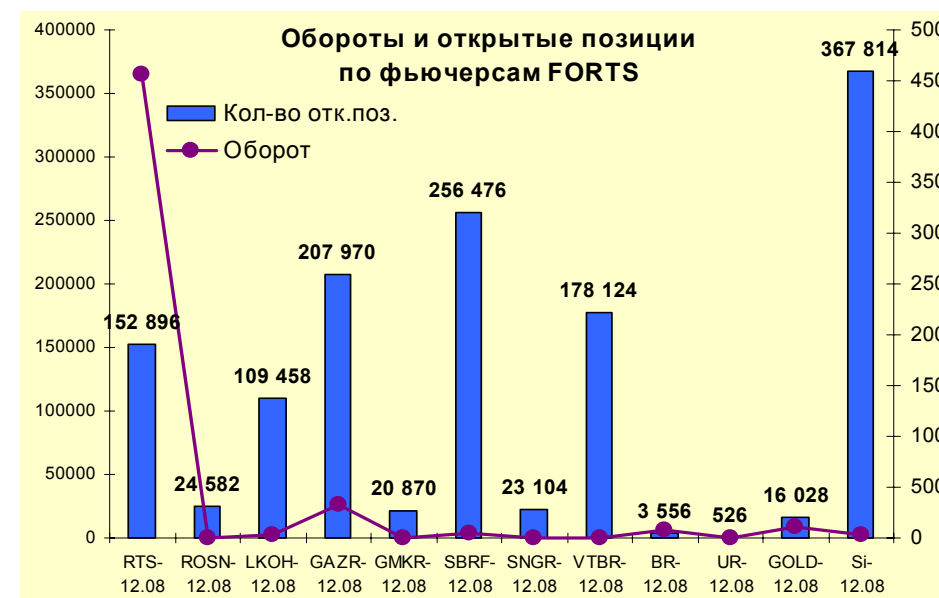
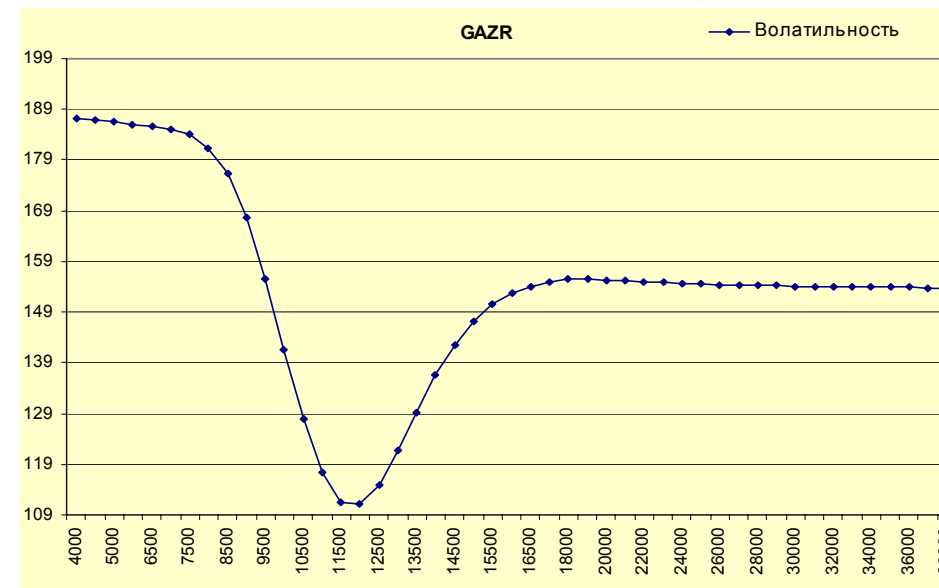
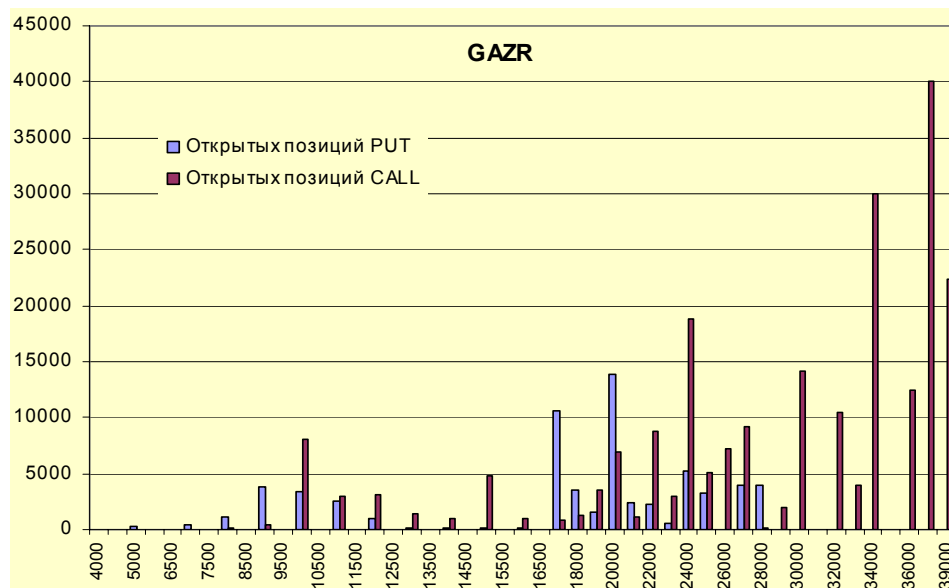


	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед БА	% изм. закр.	Кол-во отк.поз.	Изм. OI	Оборот	В % к дневному
RTS-12.08	61465	614,65	1,11	152896	-4,66%	4 559 635 048	36,31%
ROSN-12.08	9996	99,96	1,95	24582	5,48%	464 761	1,70%
LKOH-12.08	7955	795,50	-1,11	109458	3,15%	29 254 417	14,96%
GAZR-12.08	11432	114,32	1,29	207970	4,87%	325 355 838	21,56%
GMKR-12.08	17590	1759,00	-0,3	20870	3,65%	6 155 857	11,37%
SBRF-12.08	2200	22,00	1,8	256476	-3,97%	45 768 329	24,32%
SNGR-12.08	16600	16,60	1,99	23104	1,54%	1 007 878	2,93%
VTBR-12.08	3100	0,0310	3,23	178124	-0,20%	1 407 445	8,59%
BR-12.08	45,86	45,86	-4,78	3556	14,34%	73 381 201	67,04%
UR-12.08	43,35	43,35	-5,52	526	19,00%	1 707 029	19,56%
GOLD-12.08	780	780,20	0,15	16028	26,71%	107 192 065	30,27%
SI-12.08	28188	28,19	0,01	367814	0,79%	27 831 626	3,13%

	Закр.	Изм. %	Время посл. изм.
RTSI	619,16	-2,01	18:00
RTSI_Derex	618,36	2,37	18:45
DJIA	8419	3,31	00:03
S&P 500	848,8	3,99	00:24
NASDAQ	1449,8	3,70	00:24
Brent	44,95	-4,13	00:25
EUR/USD	1,2612	-0,79	0:25
Gold	782,5	0,04	00:27



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

