

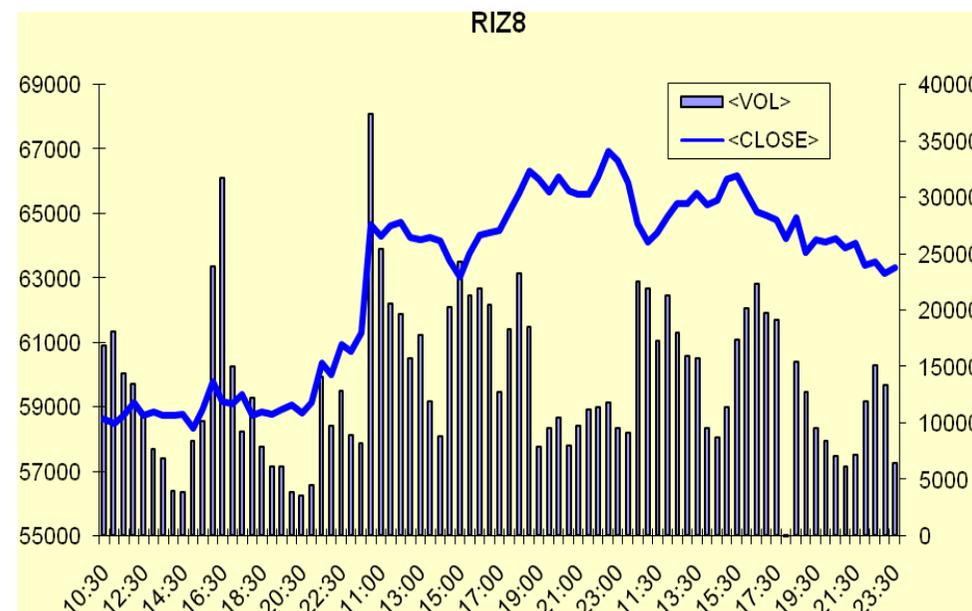
## Завтра "Ралли" уже не будет

После бурного роста российский рынок встал на распутье. Сил роста уже нет, сил падать так же не хватает. Остается альтернативный вариант плавного сползания к поддержке в 60000 пунктов по фьючерсу на индекс РТС.

Что касается срочного рынка, то многие участники решают не искушая судьбу закрывать свои позиции не выходя на экспирацию, совершая оффсетные сделки. Волатильность и биржевая и реальная рыночная значительно понизилась, что благоприятно сказалось на спредах в стаканах и на чиле проводимых сделок.

По мнению многих профессионалов, нормальную ликвидность мы увидим при любом значении индекса, но при условии того, что волатильность центрального страйка опустится до 80%. Вероятно завтра мы уже увидим эти значения.

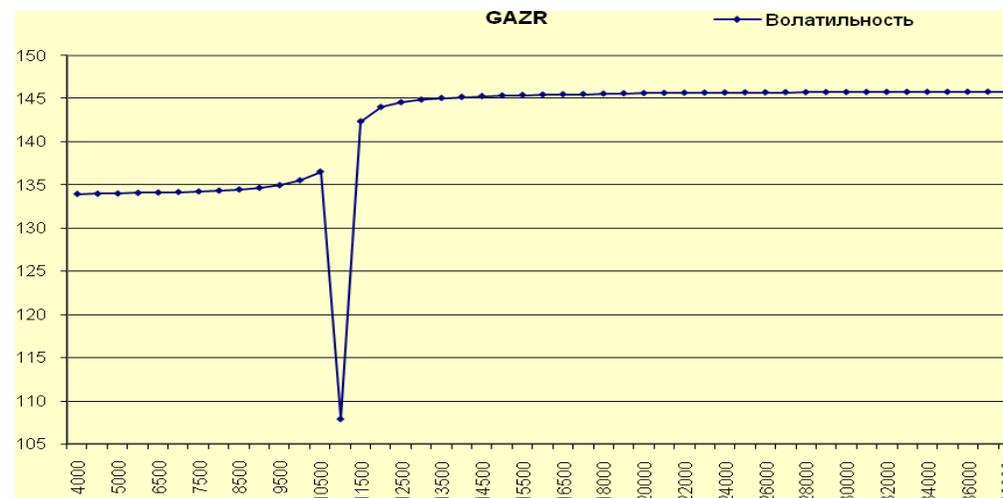
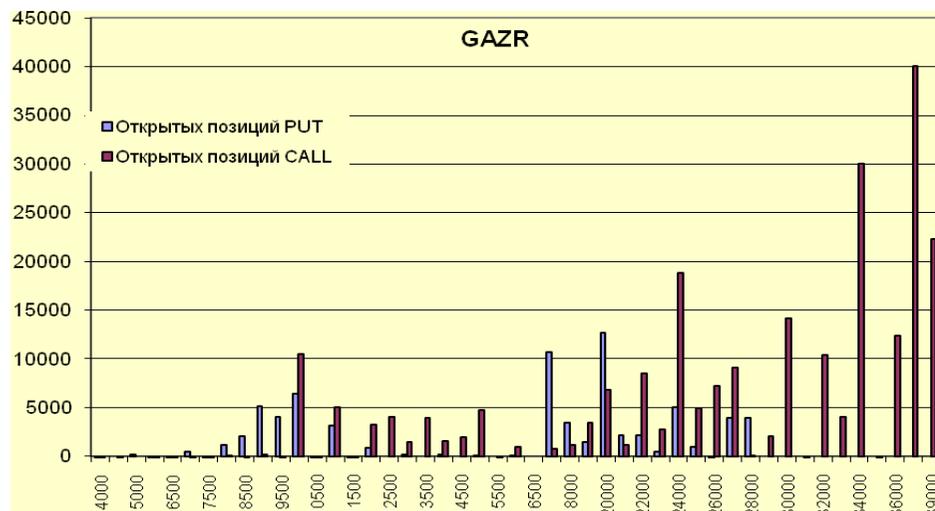
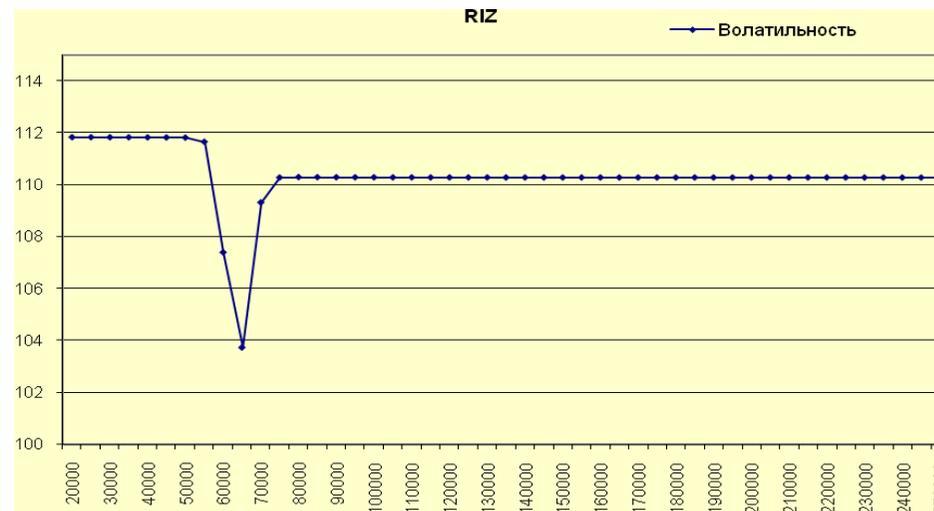
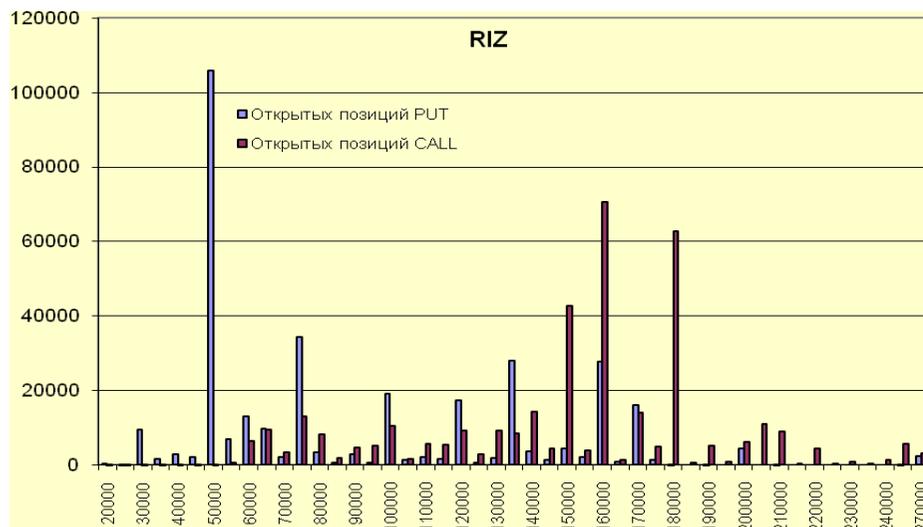
Что касается завтрашнего открытия то мы не ожидаем значительного гэпа. Скорее всего, на падающей нефти и сигналах к развороту на американском рынке завтра индекс может просесть на 2,5%-3%. Из которых около 1% потеряем с открытия.



|            | 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-12.08  | 63320                  | 633,20                 | -2,31                   | 158702                   | -1,69%           | 4 777 596 998 | 32,43%              |
| ROSN-12.08 | 10839                  | 108,39                 | -2,04                   | 19212                    | -1,43%           | 3 356 781     | 4,25%               |
| LKOH-12.08 | 8810                   | 881,00                 | -2,75                   | 116290                   | -1,87%           | 58 892 282    | 14,76%              |
| GAZR-12.08 | 11001                  | 110,01                 | -2,29                   | 185074                   | 0,97%            | 243 690 962   | 12,90%              |
| GMKR-12.08 | 17555                  | 1755,50                | -0,96                   | 16604                    | -0,16%           | 1 168 071     | 3,50%               |
| SBRF-12.08 | 2057                   | 20,57                  | -2,79                   | 251572                   | 1,00%            | 26 822 086    | 15,39%              |
| SNGR-12.08 | 16580                  | 16,58                  | 0,48                    | 22190                    | -0,04%           | 1 770 647     | 10,55%              |
| VTBR-12.08 | 3100                   | 0,0310                 | 0,38                    | 189846                   | 0,10%            | 3 269 276     | 12,54%              |
| BR-12.08   | 41,91                  | 41,91                  | -3,84                   | 5444                     | 11,33%           | 14 654 264    | 14,87%              |
| UR-12.08   | 39,20                  | 39,20                  | -4,4                    | 1232                     | 25,97%           | 9 371 017     | 268,38%             |
| GOLD-12.08 | 773                    | 773,40                 | 0,33                    | 16134                    | -1,08%           | 242 488 802   | 127,86%             |
| Si-12.08   | 28129                  | 28,13                  | -0,04                   | 367002                   | 0,24%            | 48 531 923    | 10,66%              |

|            | Закр.   | Изм. % | Время посл. изм. |
|------------|---------|--------|------------------|
| RTSI       | 641,92  | 1,54   | 18:00            |
| RTSI_Derex | 649,75  | -1,63  | 18:45            |
| DJIA       | 8691,33 | -2,72  | 00:05            |
| S&P 500    | 888,7   | -2,31  | 00:05            |
| NASDAQ     | 1547,34 | -1,55  | 00:05            |
| Brent      | 41,64   | -4,12  | 00:05            |
| EUR/USD    | 1,29175 | -0,47  | 00:05            |
| Gold       | 775,8   | -0,21  | 00:05            |

# Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert



# Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

