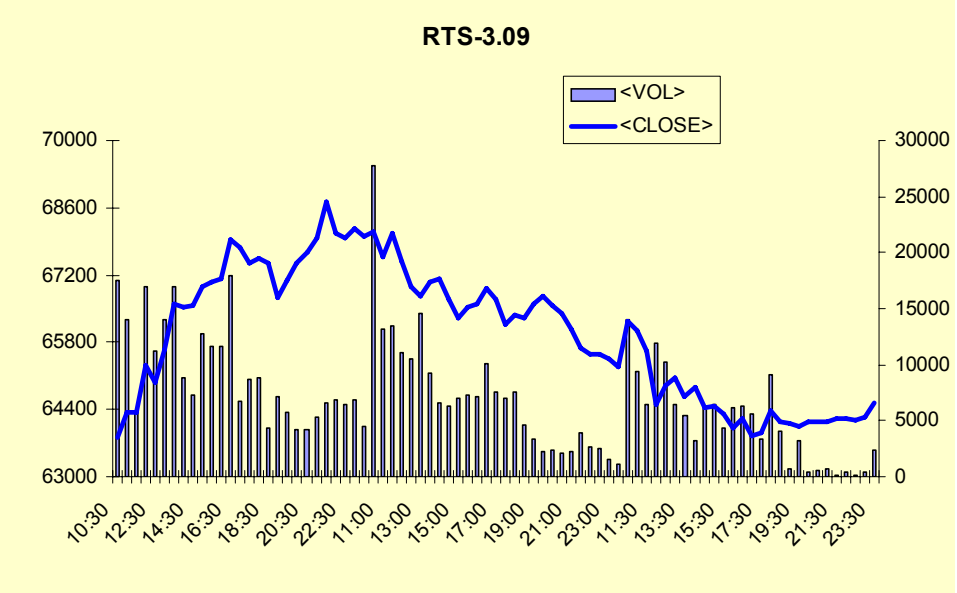
Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

Напоследк сползли

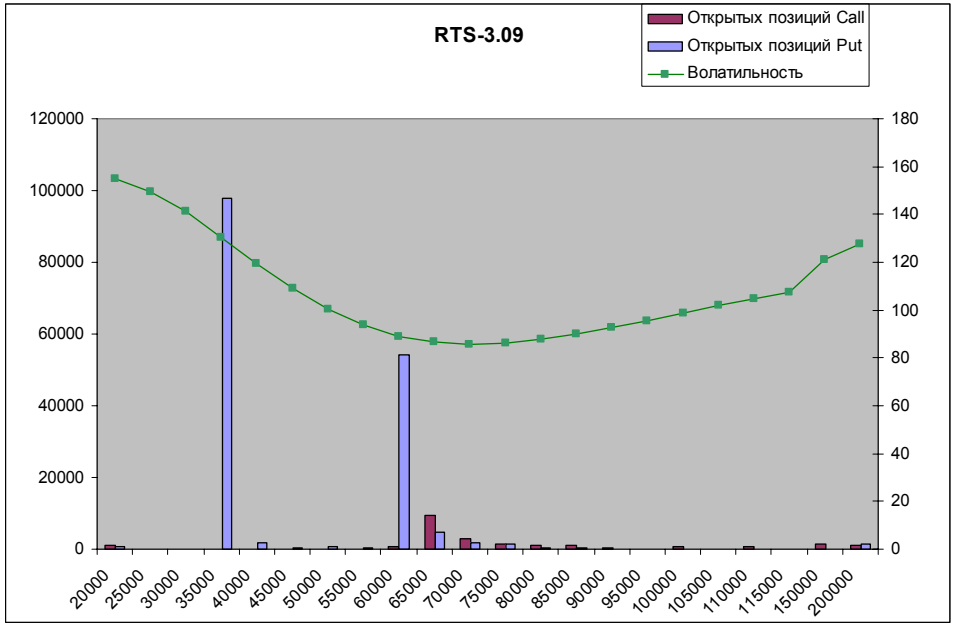
Сегодняшний день был совершенно неинтересен и предсказуем. В отсутствии новостей и близости праздников объемы торгов были незначительными.
Некоторое снижение, обусловлено провалом нефтяных котировок, которое в принципе ожидалось.
Скорее всего завтра мы продолжим плавное снижение, целью которого является отметка 60000 пунктов по фьючерсу на индекс РТС.
На опционном рынке наблюдается некоторое затишье и сильного изменения открытого интереса не происходит.
Вероятно, что после рождественских праздников наш рынок направится либо вверх либо резко вниз. Это подтверждает статистика. Ввиду этого, имеет смысл присмотреться к достаточно дешевым стрэддлам и стрэнглам на центральных страйках на индекс РТС и Газпром. Стоит воспользоваться моментом и возможностью сбирать эту комбинацию всего лишь по 70-80% волатильности. Совсем на последний момент откладывать эту стратегию не стоит, так как временной распад перед новогодними праздниками несколько искажен.
Завтрашнее открытие мы ожидаем нейтральным, вероятен даже временный отскок в пределах 0,7-1%, затем пойдем вниз и сползем на 1-2%.

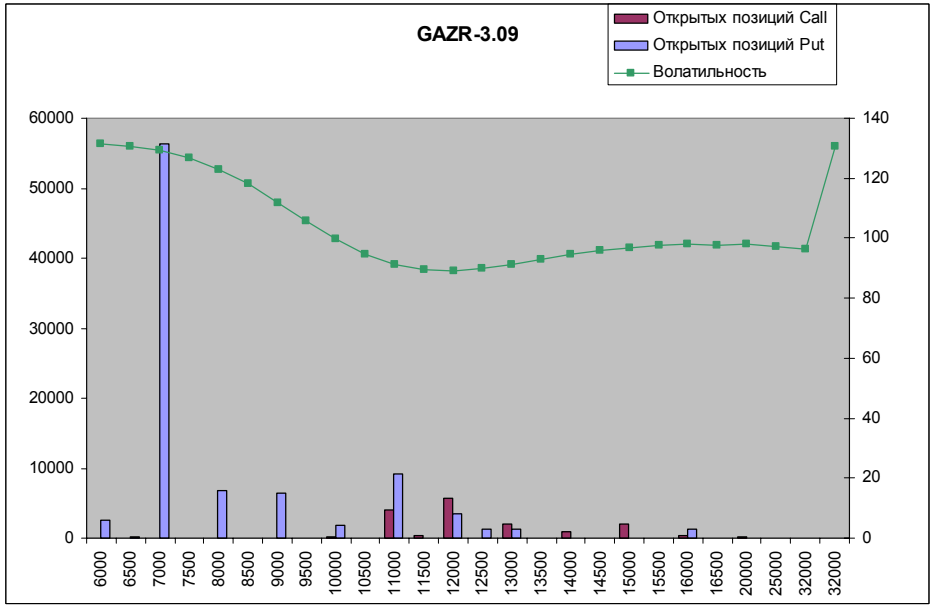


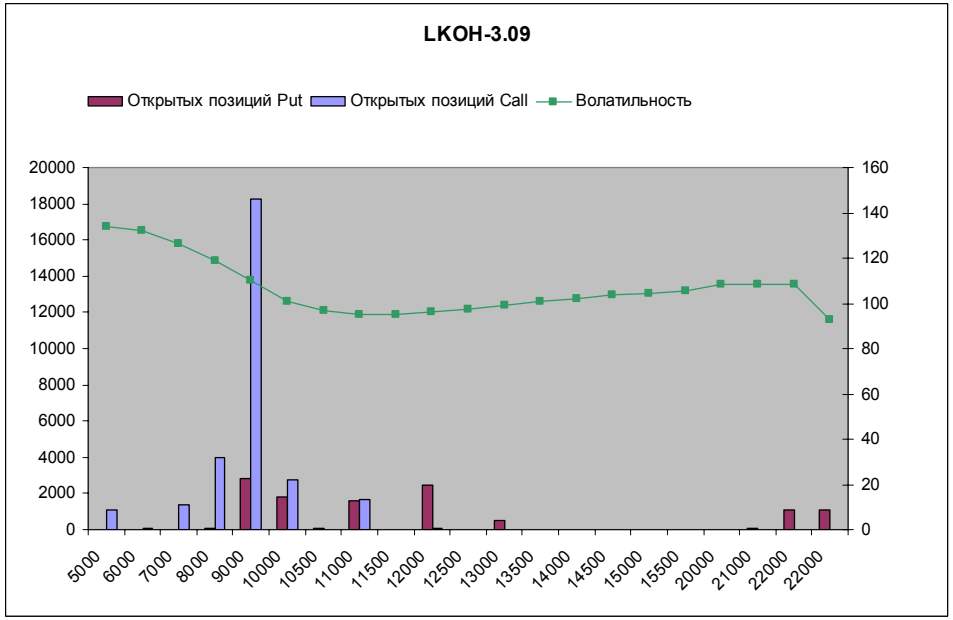
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 17:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-3.09	64540	645,40	1	131274	0,79%	827 955 730	15,18%
ROSN-3.09	11300	113,00	0,29	16742	0,63%	6 908 449	31,76%
LKOH-3.09	10009	1000,90	1,31	65212	-0,97%	27 277 192	17,15%
GAZR-3.09	10843	108,43	1,3	214008	-0,87%	130 102 786	12,45%
GMKR-3.09	18451	1845,10	-1,33	7076	-0,73%	3 658 692	20,40%
SBRF-3.09	2340	23,40	3,4	188272	0,38%	14 172 072	16,14%
SNGR-3.09	16750	16,75	0,3	8276	-0,02%	33 650	0,37%
VTBR-3.09	3390	0,0339	1,16	153574	-0,14%	1 350 225	49,78%
BR-1.09	37,56	37,56	2,65	14670	0,74%	9 409 920	17,70%
UR-1.09	35,00	35,00	-1,36	1186	0,00%	7 678 010	497,04%
GOLD-3.09	849	849,00	-0,71	10902	-1,94%	9 143 558	12,59%
Si-3.09	31096	31,10	0,3	300578	0,25%	20 711 225	2,40%

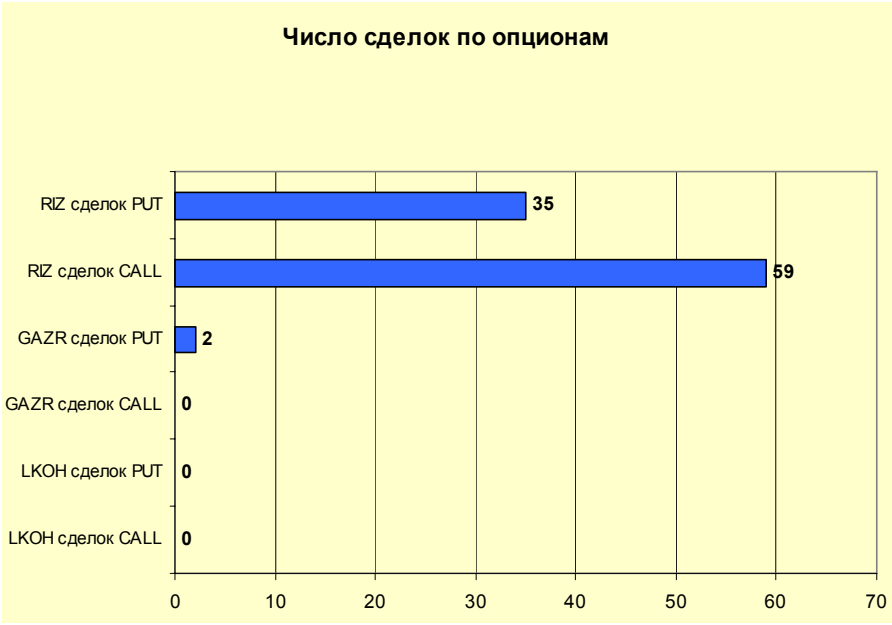
	Закрытие	Изменение %	Время
S&P 500	868,15	0,58%	21:59:03
DJ Industrial	8468,48	0,58%	00:46:35
DAX 30	4629,38	-0,21%	20:31:18
RTSI_DEREX	706,53	4,27%	18:44:49
RTSI	682,37	3,84%	17:59:59
CAC 40	3116,21	-0,39%	20:39:04
FTSE 100	4216,59	0,00%	23:33:01
Nikkei 225	8599,5	0,97%	10:00:19
Hang Seng	14184,14	-0,26%	11:54:17
BOVESPA Brazil	36470,78	-3,07%	04:05:34
Brent Crude Oil 0109	40,44	-2,44%	04:34:08
Gold	844	0,00%	01:13:47
Silver	10,33	0,00%	01:10:12
Palladium	174,5	0,00%	01:03:21
Platinum	855	0,00%	01:03:25

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert









Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

