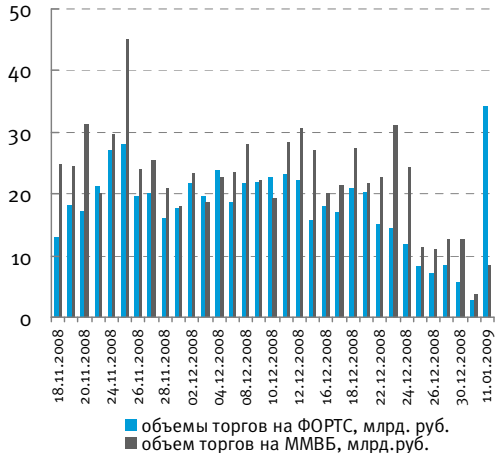
ФИНАНСОВАЯ КОРПОРАЦИЯ Открытие

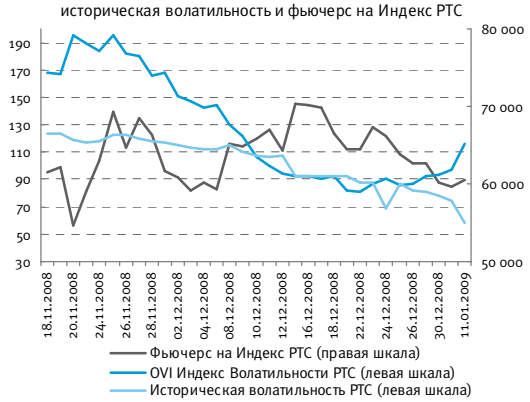
ЕЖЕДНЕВНЫЙ ОБЗОР РЫНКА ДЕРИВАТИВОВ

12 ЯНВАРЯ 2009 Г.

Объемы торгов на ФОРТС и ММВБ



OVI - Индекс опционной волатильности РТС, историческая волатильность и фьючерс на Индекс РТС



УЧАСТНИКИ СРОЧНОГО РЫНКА АКТИВНО ВКЛЮЧИЛИСЬ В ИГРУ

В воскресенье на срочном рынке наблюдался всплеск активности игроков. Объемы торгов на ФОРТС составили 34 млрд руб. против 8 млрд руб. на ММВБ. Участники довольно энергично восстанавливали позиции, закрытые перед новогодними каникулами.

Основные биржевые индикаторы в минувшую торговую сессию закрылись разнонаправленно. Индекс ММВБ прибавил 2,5%, РТС потерял 0,8%. Фьючерс на РТС вырос на 1,5% во время дневной сессии и на 1,3% во время вечерней, закрывшись на отметке 61 265 пунктов.

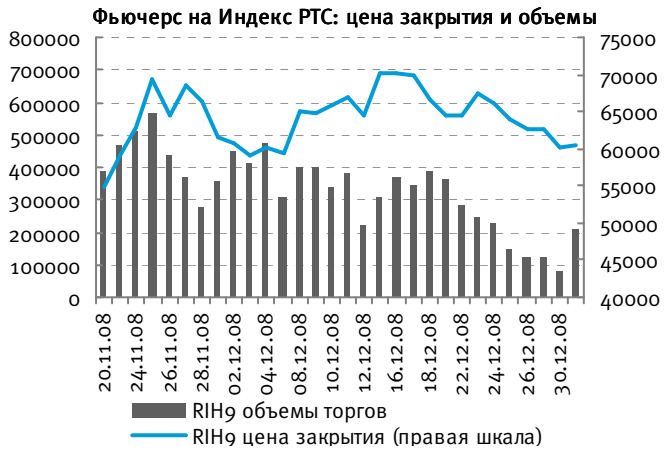
Сильнее рынка выглядели фьючерсы Газпрома и Лукойла, прибавив 4 и 5,7% соответственно.

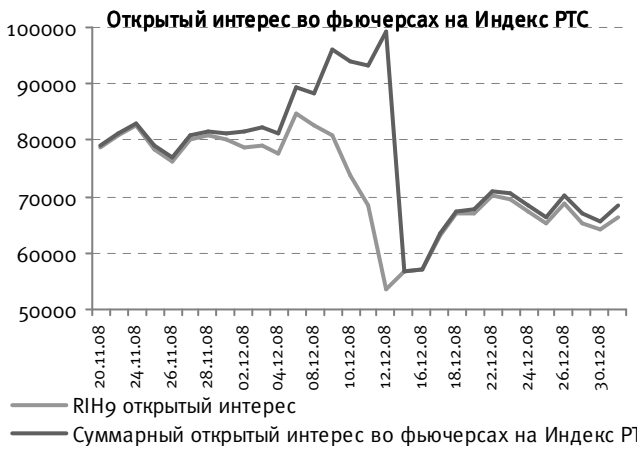
В воскресенье на рынке опционных контрактов наблюдался рост числа позиций в опционных контрактах на страйках 20 000 и 200 000 пунктов.

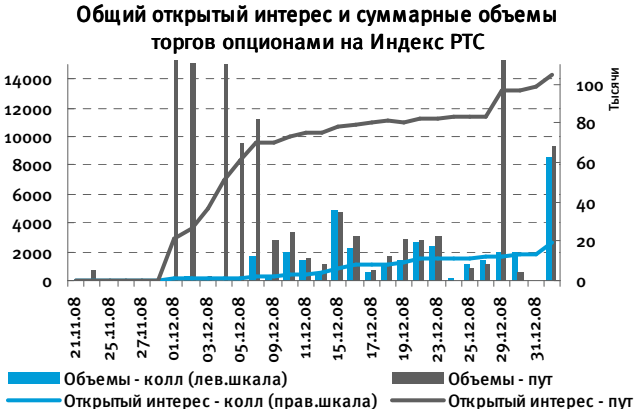
Павел Зайцев

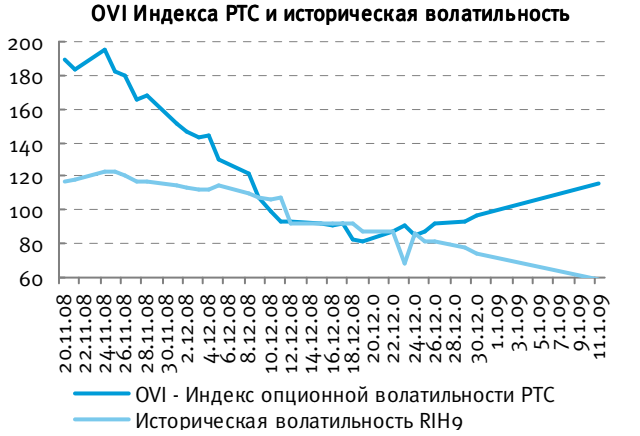
Контракт	Дата	Дней до погашения	Цена закрытия	Измен-е цены %	Объем торгов (контрактов)	Открытый интерес по всем фьючерсам	Изм-е откр-го интереса по всем фьючерсам	Открытый интерес по текущему фьючерсу	Прир-е открытого интереса	Спрэд, пунктов	Доходность арбитража спот -
RTS-3.09	11.01.2009	61	60 490	1.36	208 742	68 518	3.9	66 160	3.2	-22.0	-18.8
GAZR-3.09	11.01.2009	61	11 254	4.05	135 668	112 395	2.5	112 232	2.5	1.0	4.1
LKOH-3.09	11.01.2009	61	10 077	5.73	26 601	37 348	2.9	37 117	2.9	-8.4	-3.6
GMKR-3.09	11.01.2009	61	18 924	-0.94	6 094	3 488	4.4	3 446	4.5	-55.1	-12.9
SBER-3.09	11.01.2009	61	2 332	6.48	19 761	86 615	0.5	86 534	0.5	0.3	7.3
VTBR-3.09	11.01.2009	61	3 423	1.00	10 036	76 357	1.8	76 329	1.8	0.0	3.2
SNGR-3.09	11.01.2009	61	15 700	-6.26	2 571	3 493	3.0	3 492	3.0	-0.2	-5.1
GOLD-3.09	11.01.2009	61	861	-1.12	20 321	10 246	0.1	9 662	0.0		

ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС

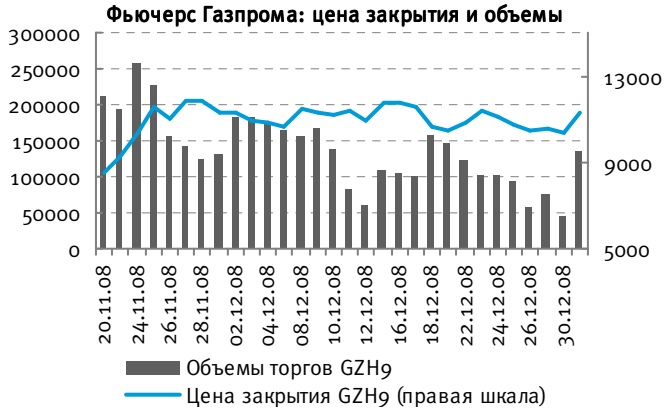


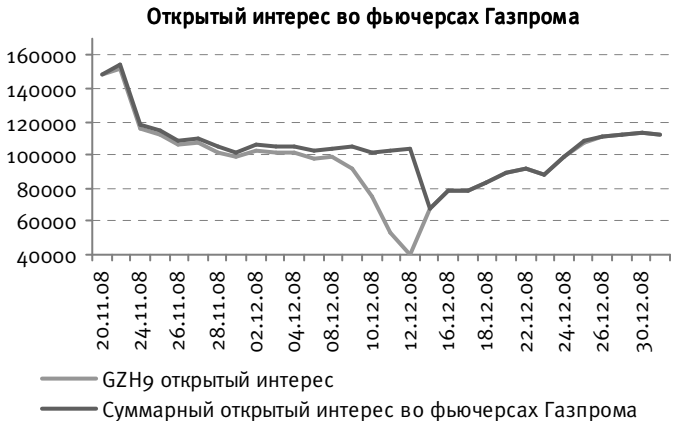


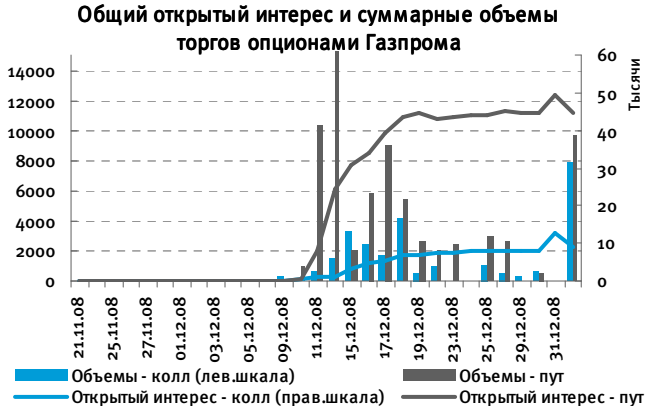


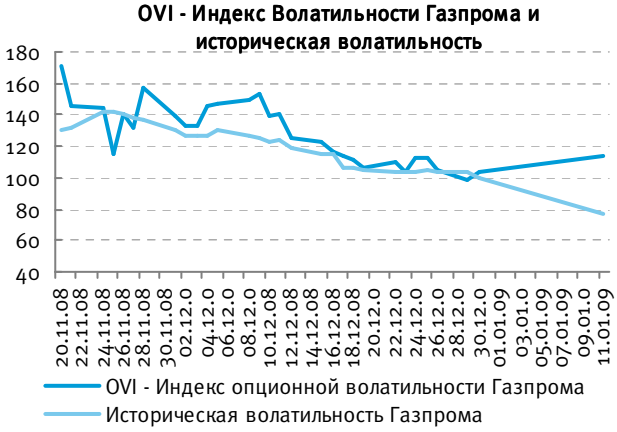


ФЬЮЧЕРС НА АКИЦИИ ГАЗПРОМА



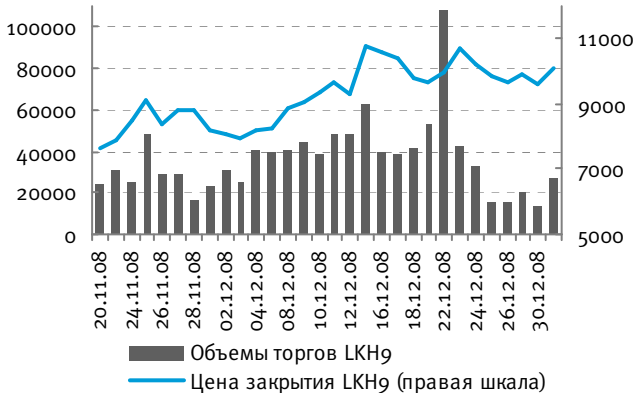




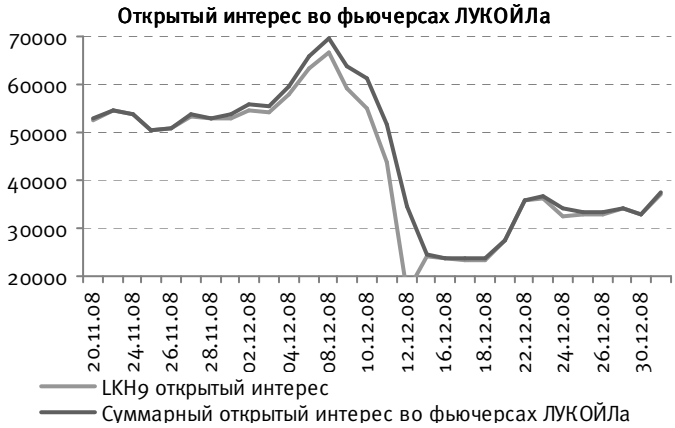


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА

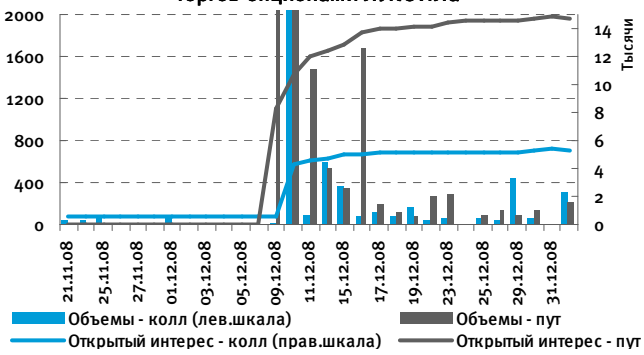
Фьючерс ЛУКОЙЛа: цена закрытия и объемы



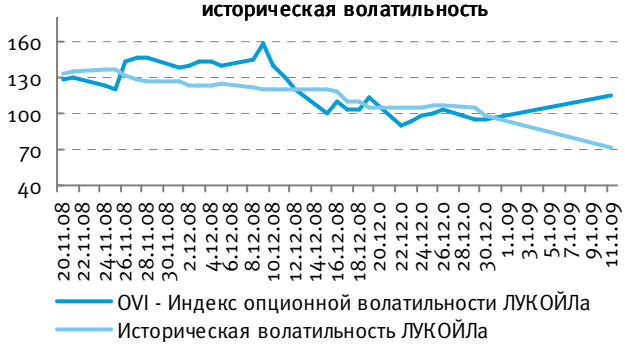
Открытый интерес во фьючерсах ЛУКОЙЛа



Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами ЛУКОЙЛа

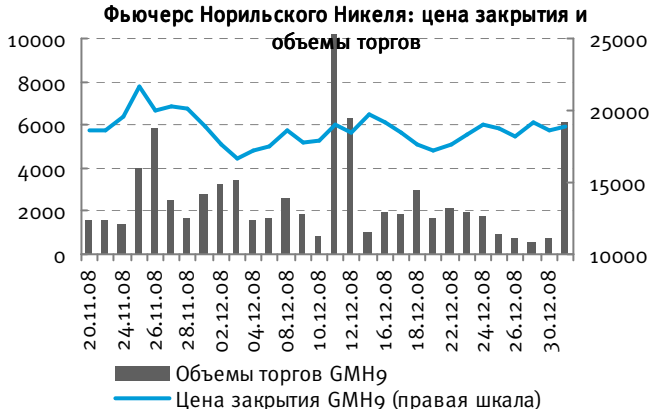


OVI - Индекс Волатильности ЛУКОЙЛа и историческая волатильность

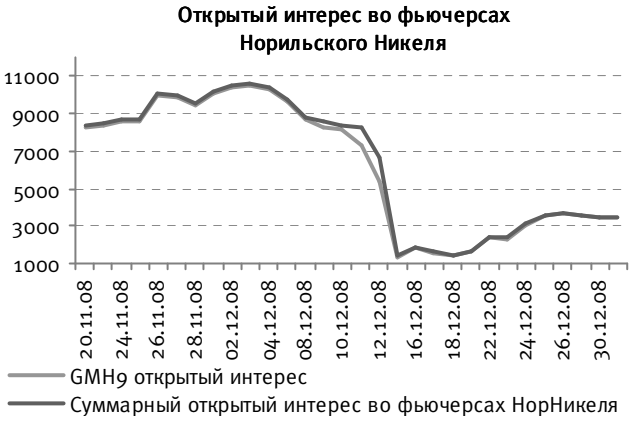


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ

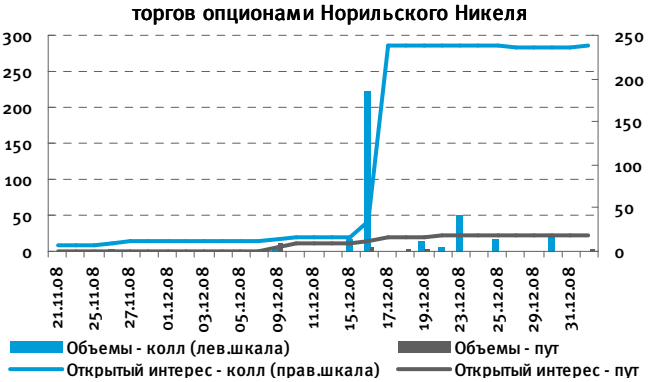
Фьючерс Норильского Никеля: цена закрытия и объемы торгов



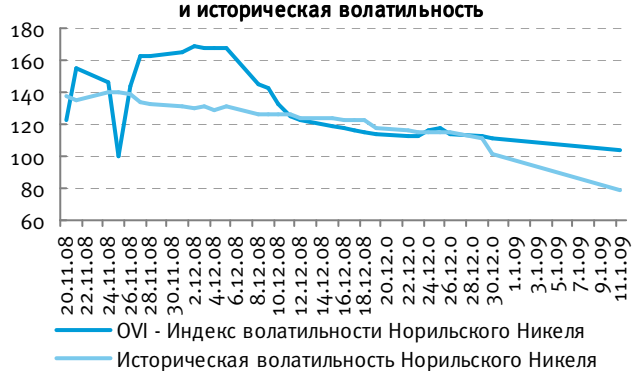
Открытый интерес во фьючерсах Норильского Никеля



Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами Норильского Никеля

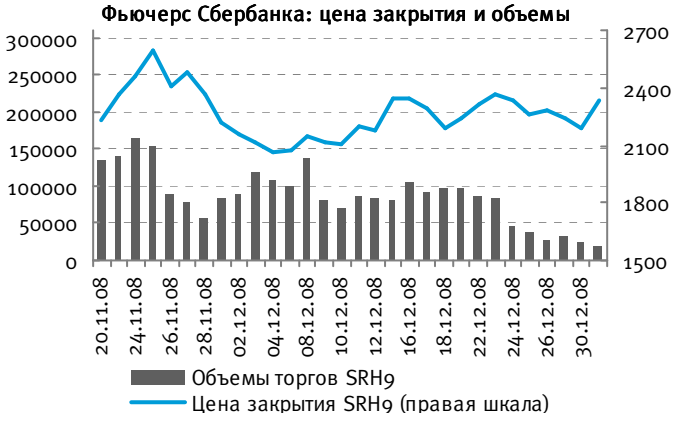


OVI - Индекс Волатильности Норильского Никеля и историческая волатильность

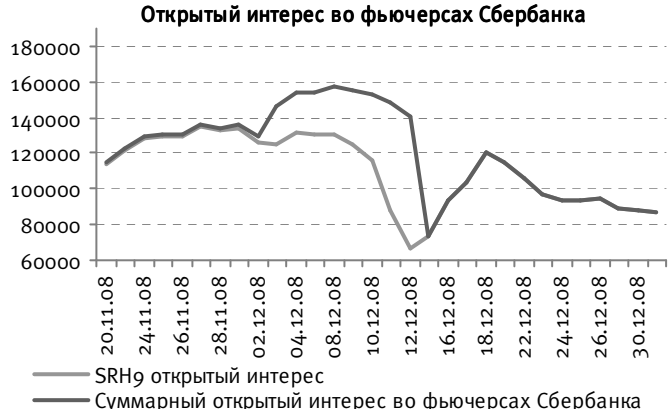


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА

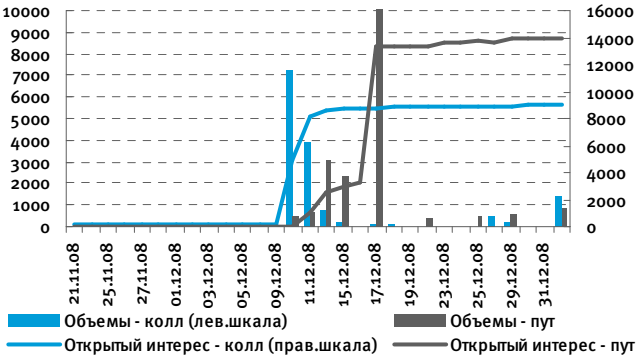
Фьючерс Сбербанка: цена закрытия и объемы



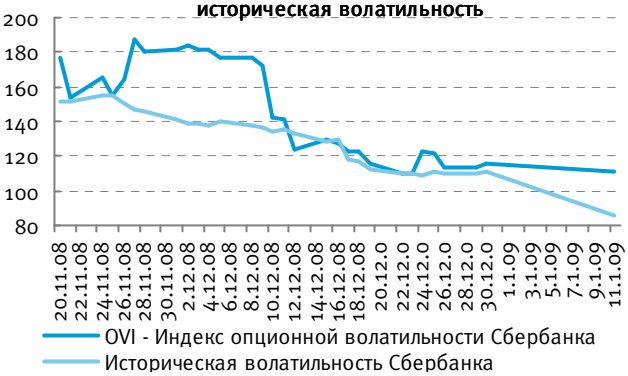
Открытый интерес во фьючерсах Сбербанка



Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами Сбербанка

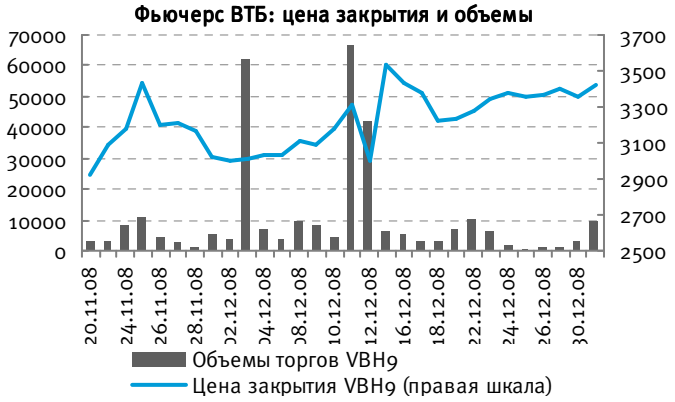


OVI - Индекс Волатильности Сбербанка и историческая волатильность

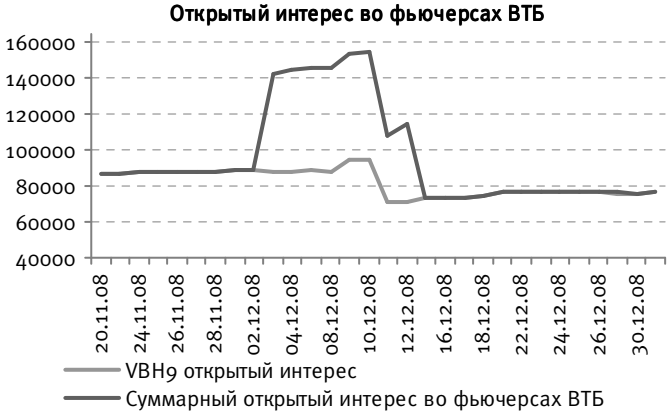


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ

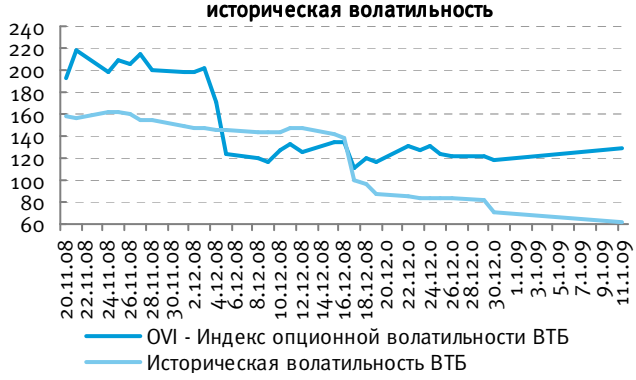
Фьючерс ВТБ: цена закрытия и объемы



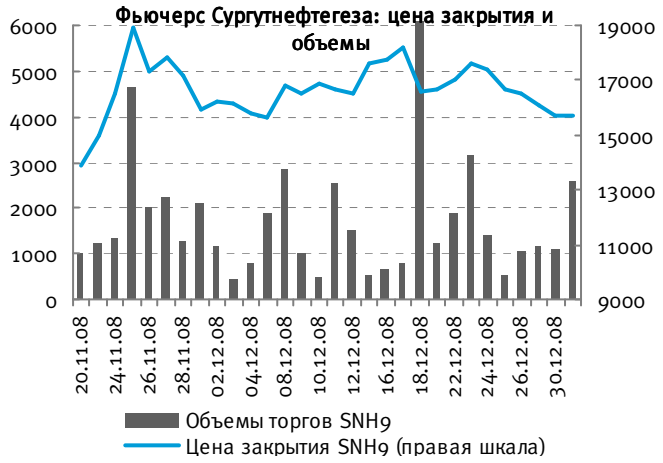
Открытый интерес во фьючерсах ВТБ

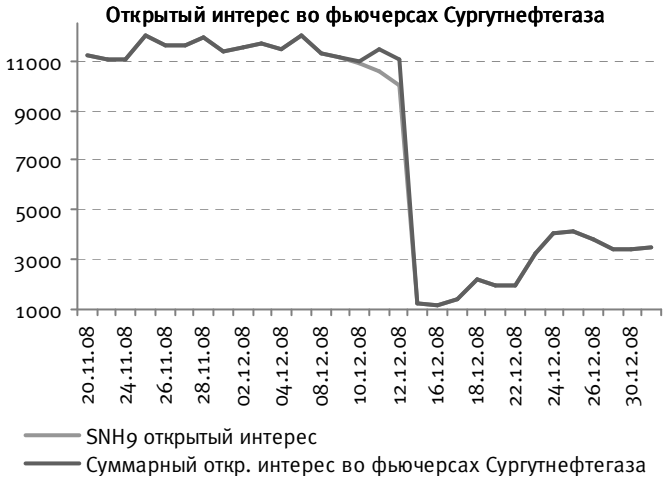


OVI - Индекс Волатильности ВТБ и историческая волатильность

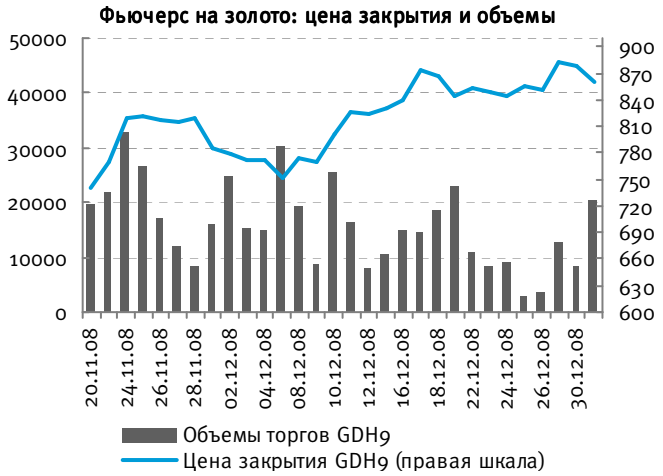


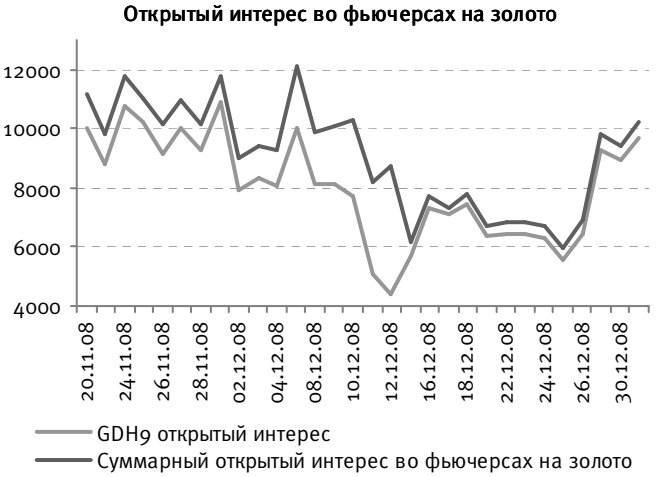
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СУРГУТНЕФТЕГАЗА

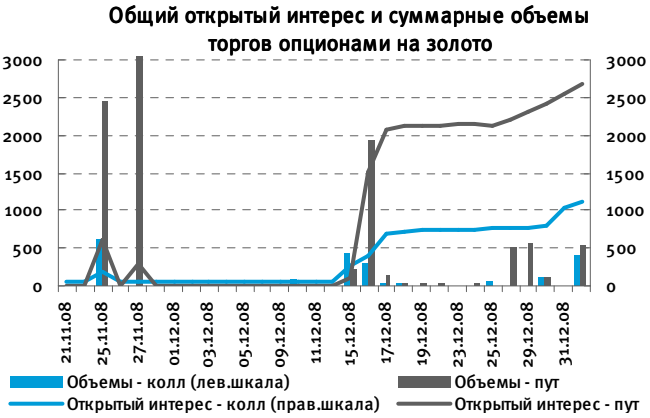




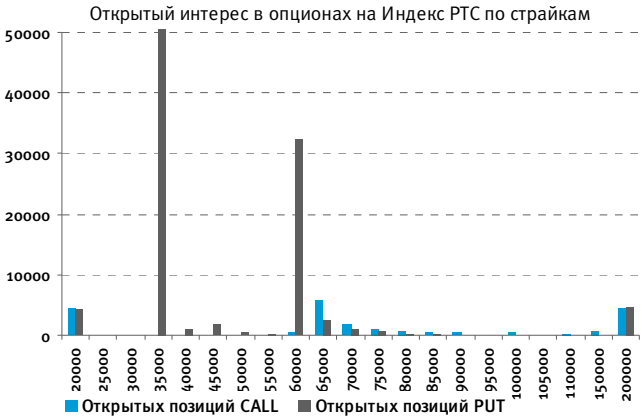
ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО

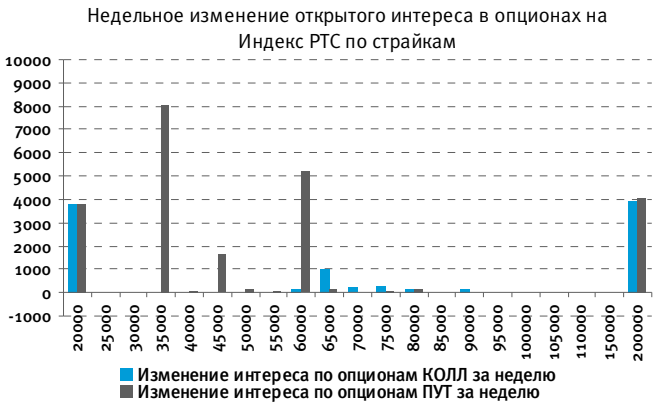


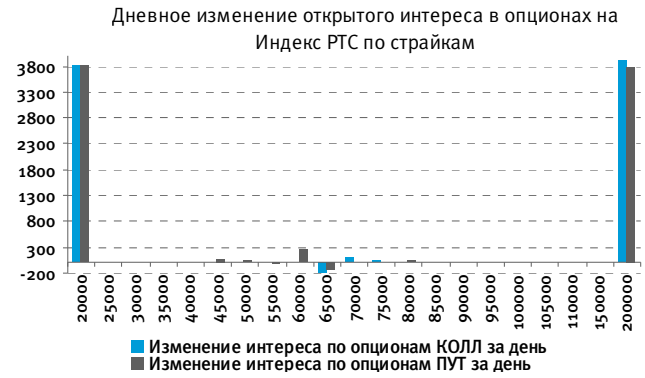


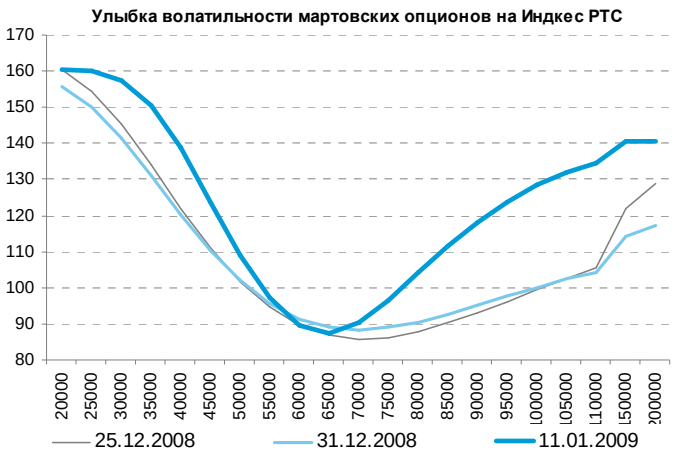


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС

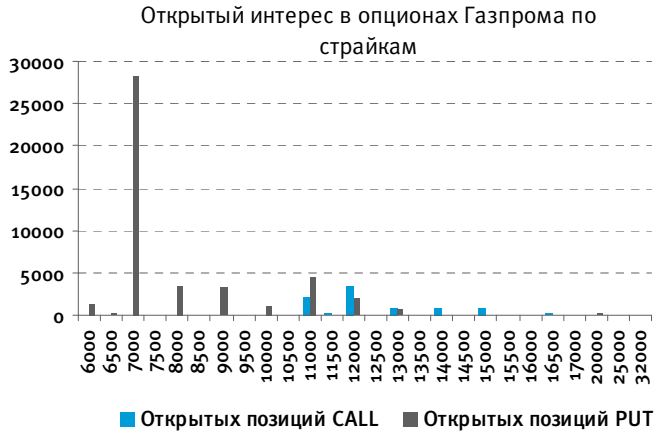


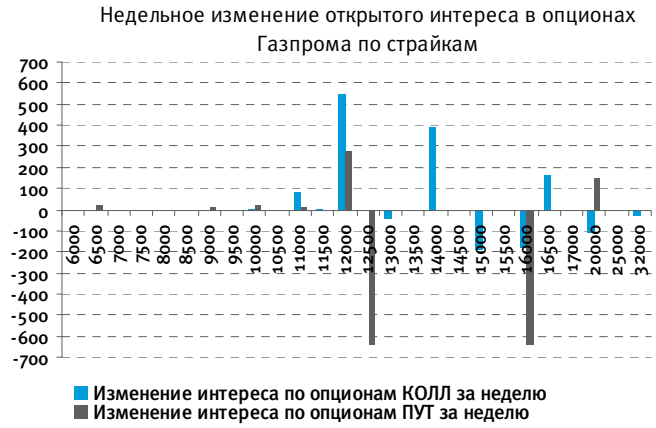


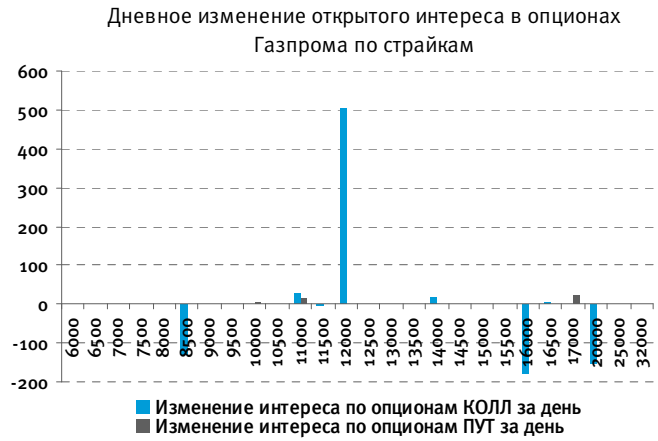


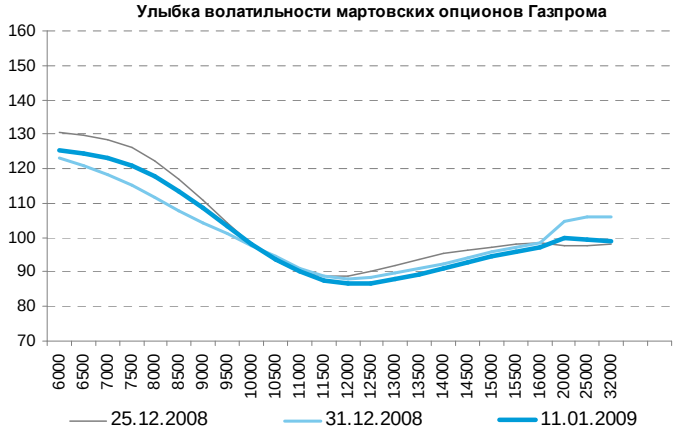


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ГАЗПРОМА

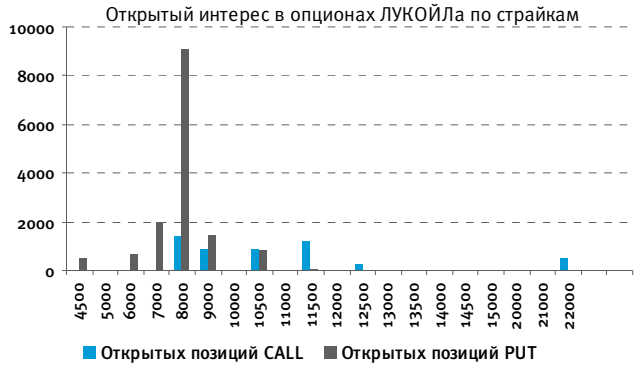




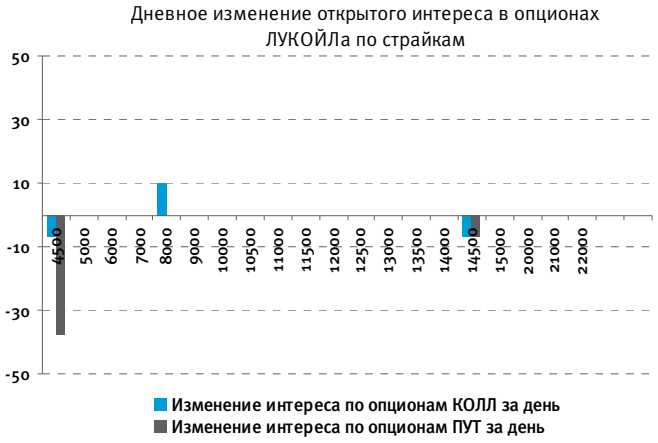


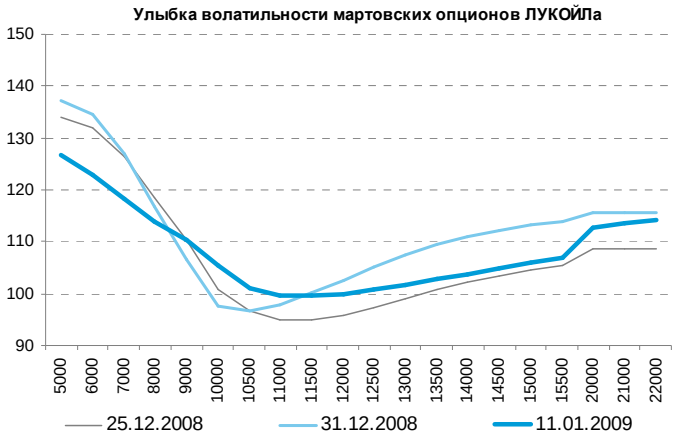


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ЛУКОЙЛА









ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ СБЕРБАНКА



