Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

После праздников на рынке царит безыдейность

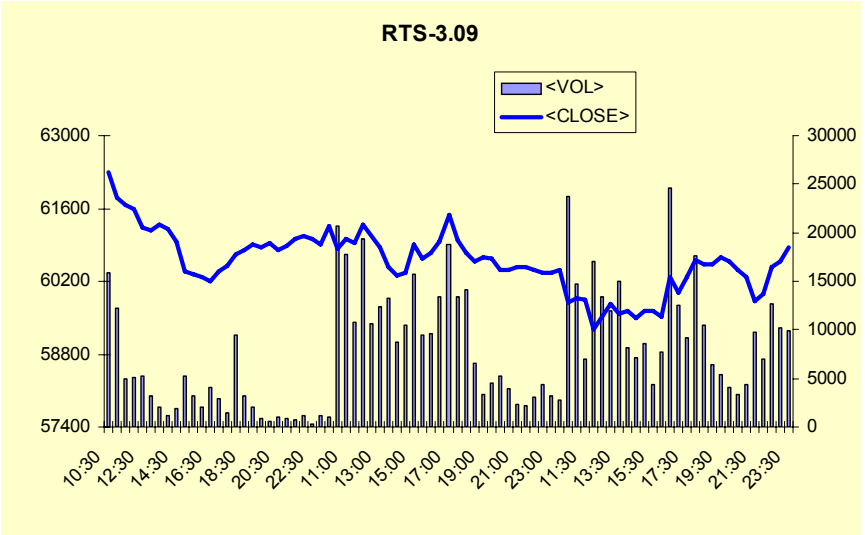
Торги большую часть дневной сессии проходили на малых объемах, хотя несколько больших, чем за предыдущие дни. Можно сказать, что рынок немного уснул и ищет факторы выхода из флета.

Полагаю, что сильные движения могут начаться не раньше, чем пройдет инаугурация Барака Обамы (20 января). Затем последует ряд корпоративных отчетов крупнейших корпораций и макростатистики по которой можно будет судить о сложности положения в Америке.

Поэтому имеет смысл присмотреться к продаже февральских стрэнглов на ближайшие 4-5 дней. Скорее всего, эта стратегия сможет принести небольшую прибыль на фоне продолжающегося застоя рынка.

Единственным ориентиром сейчас для российского рынка является нефть. Мы четко можем наблюдать сонаправленные движения индекса и барреля марки Brent.

В настоящий момент, с открытием февральской серии опционов, для любителей острых ощущений, есть варианты построить спрэды по волатильности на мартовской и февральской сериях. Данная стратегия так же может принести неплохой результат, однако является довольно рискованной.



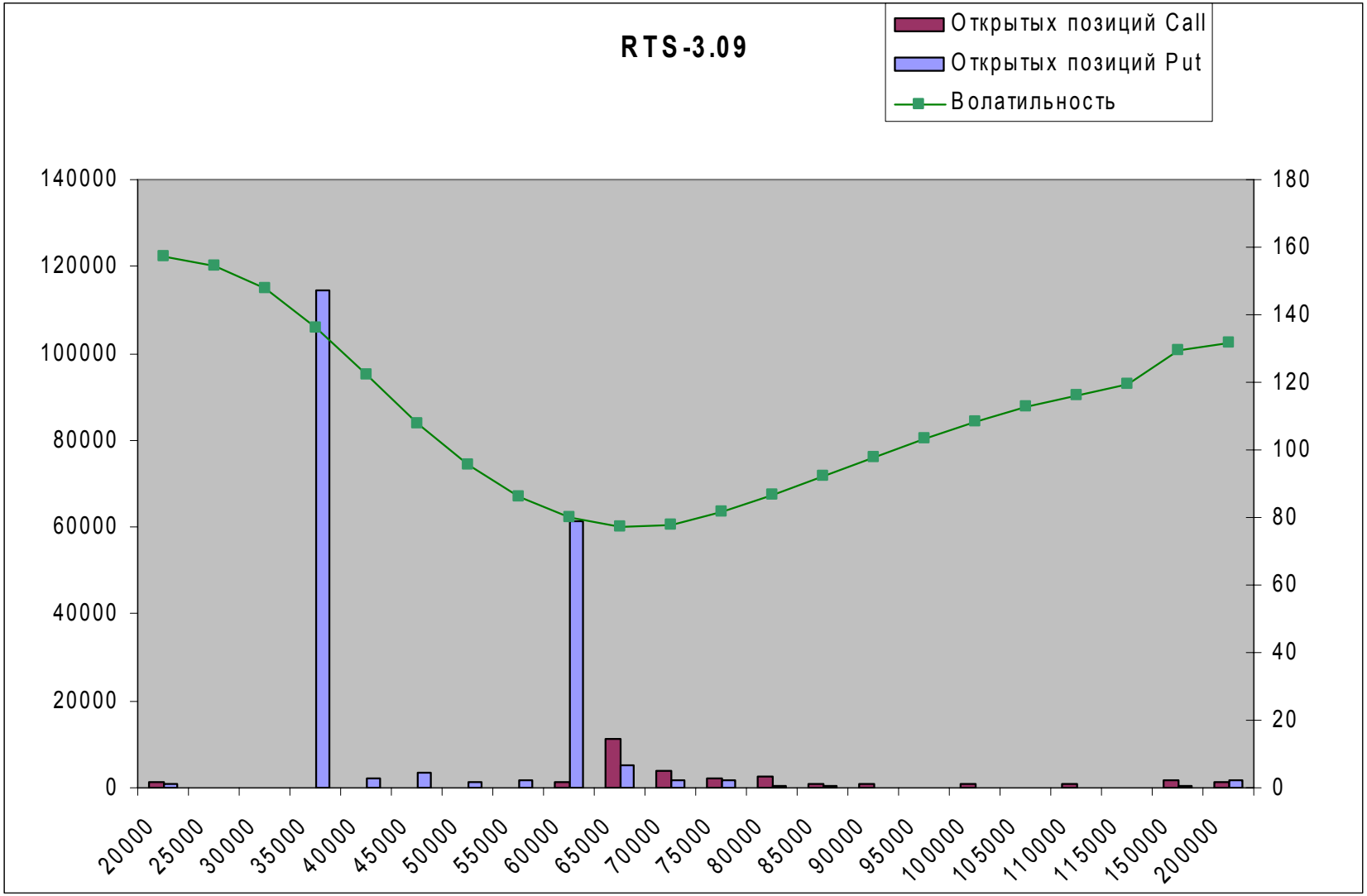
	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 17:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-3.09	60850	608,50	0,92	182268	0,66%	3 822 193 656	42,64%
ROSN-3.09	11930	119,30	0,72	31234	0,02%	4 492 735	5,40%
LKOH-3.09	11277	1127,70	1,19	120154	0,37%	117 870 212	14,69%
GAZR-3.09	11528	115,28	0,7	270294	-1,64%	309 349 150	21,41%
GMKR-3.09	18600	1860,00	-0,46	5426	2,84%	6 979 541	15,93%
SBRF-3.09	2256	22,56	1,66	231440	-0,89%	38 025 517	23,04%
SNGR-3.09	14450	14,45	2,48	17436	-3,23%	7 805 389	5,40%
VTBR-3.09	3310	0,0331	0,3	159508	-0,10%	4 077 374	12,42%
BR-1.09	45,40	45,40	3,96	8436	5,48%	163 438 551	83,87%
UR-1.09	43,99	43,99	4,63	658	-3,24%	9 538 410	387,81%
GOLD-3.09	824	823,90	-0,1	18054	1,15%	96 391 556	30,11%
Si-3.09	33592	33,59	0,59	366616	2,11%	634 158 578	63,82%

	Закрытие	Изменение %	Время
DJ Industrial	8448,56	-0,30%	00:03:10
S&P 500	871,79	0,18%	00:41:34
DAX 30	4636,94	-1,75%	20:31:19
CAC 40	3197,89	-1,49%	21:58:39
FTSE 100	4399,15	-0,61%	19:40:17
Nikkei 225	8413,91	-4,79%	17:23:28
Hang Seng	13668,05	-2,17%	17:23:28
BOVESPA Brazil	39544,23	0,36%	23:10:31
Gold	821	0,06%	00:46:09
Silver	10,72	0,56%	00:43:27
Palladium	182	-1,09%	23:57:05
Platinum	941	-1,57%	23:54:07
Brent Crude Oil 0209	45,05	4,99%	00:46:11
RTSI	621	-1,35%	18:00:00
RTSI_DEREX	622,57	-1,94%	18:45:00

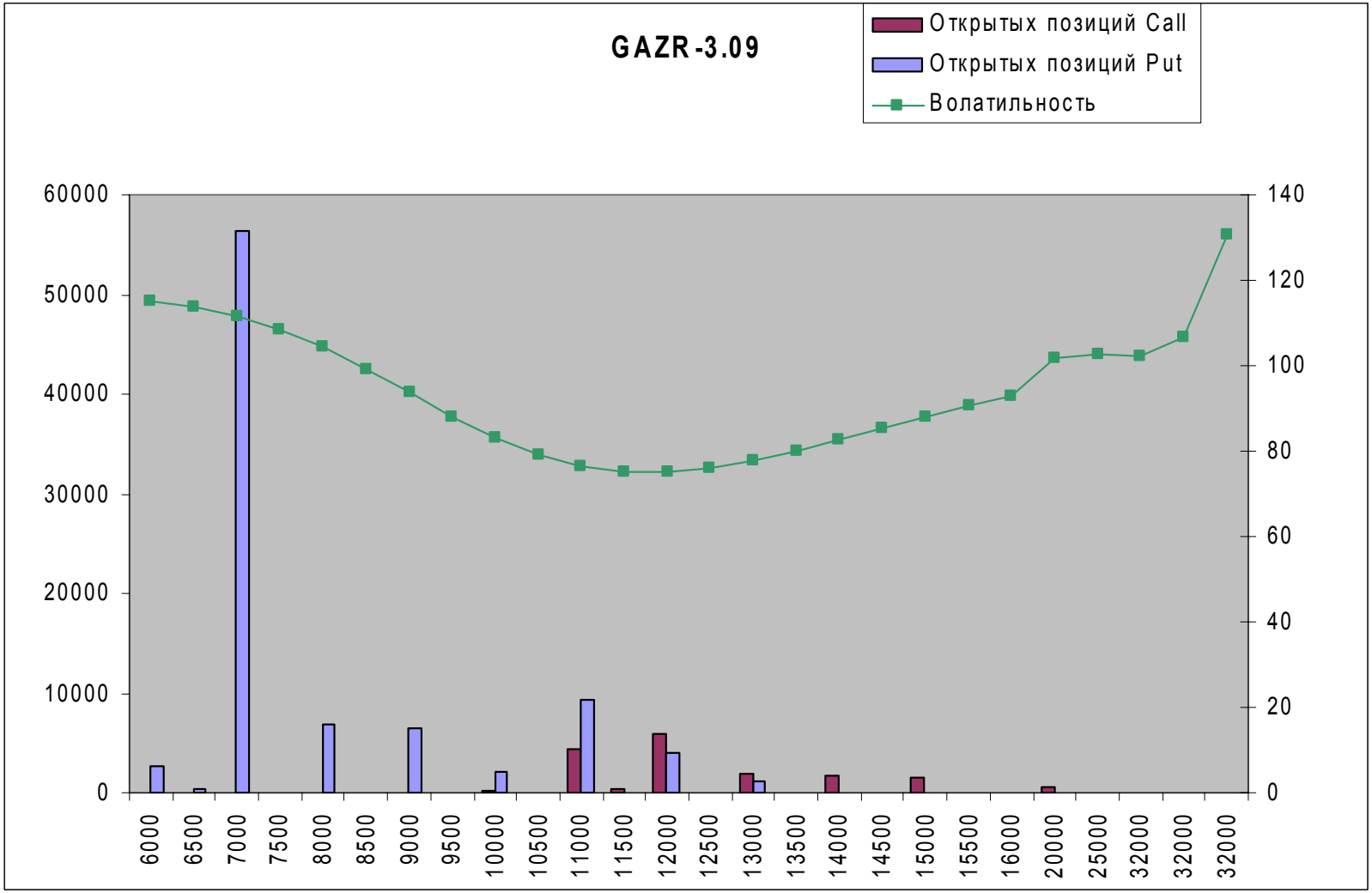
Головин Евгений

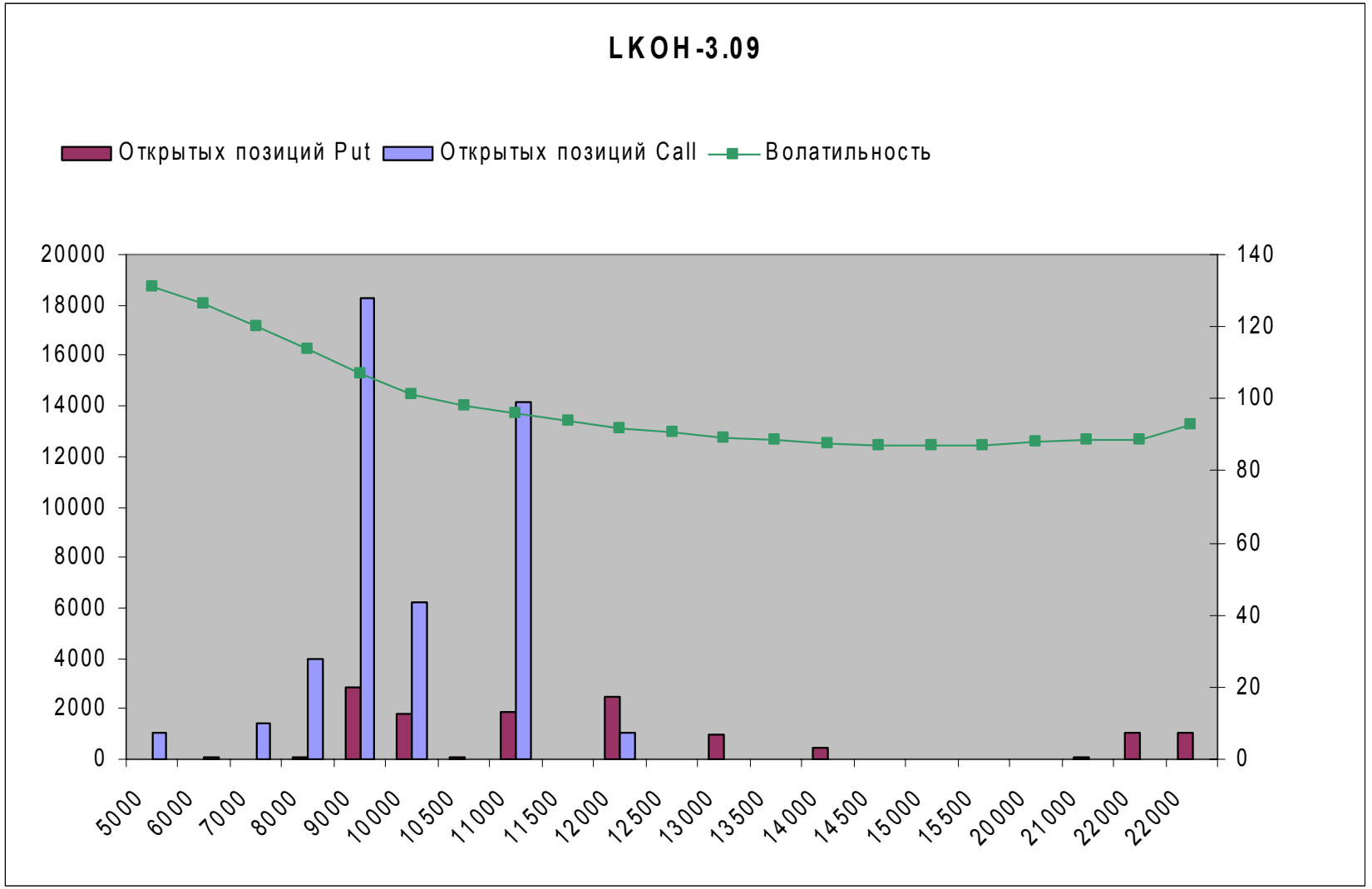
14.01.2009

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

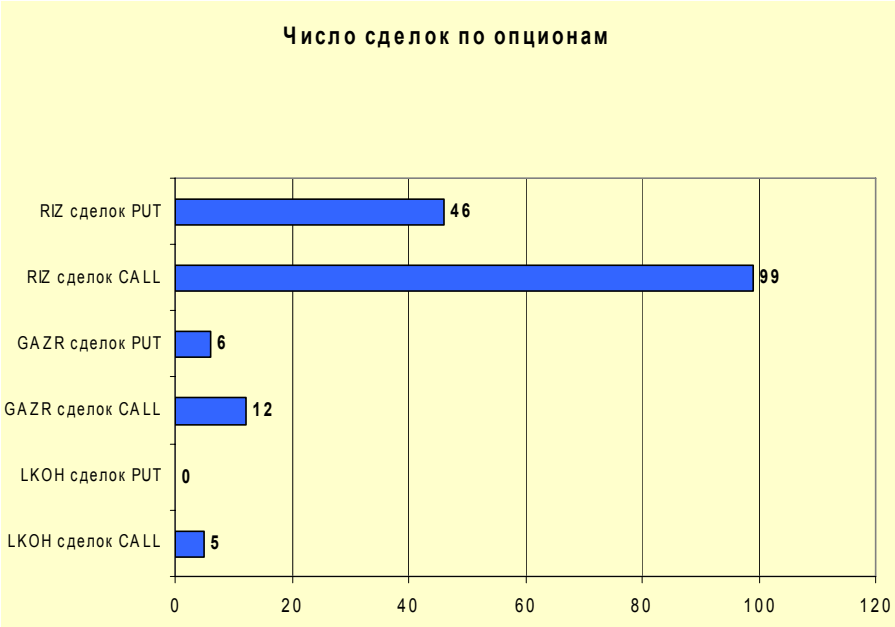


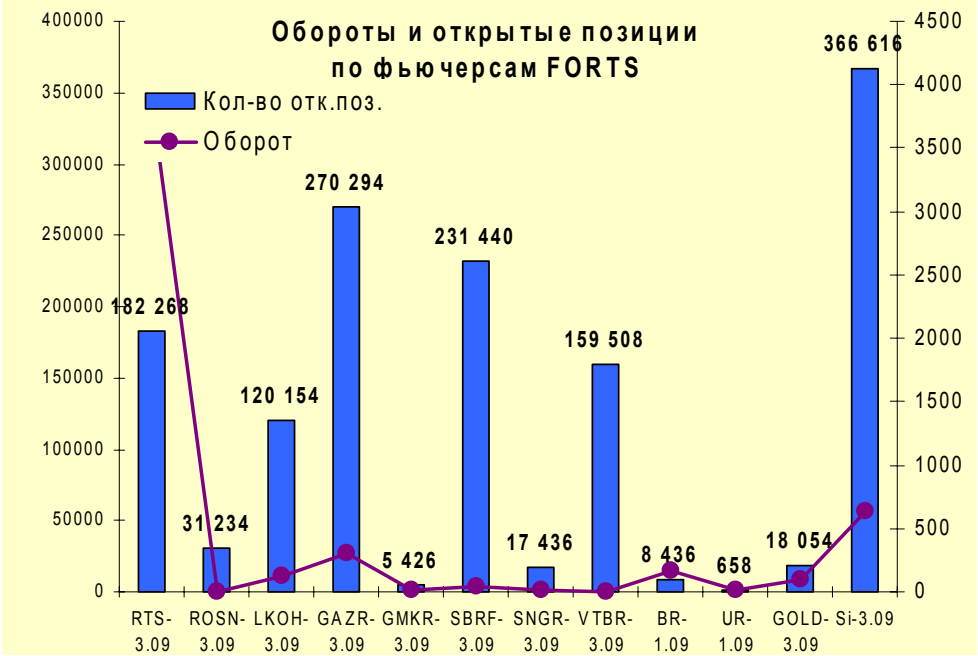
Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert




LKOH-3.09
Открытых позиций Put
Открытых позиций Call
Волатильность
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
140
120
100
80
60
40
20
0
5000
6000
7000
8000
9000
10000
10500
11000
11500
12000
12500
13000
13500
14000
14500
15000
15500
20000
21000
22000
22000

Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert





Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

