

Ночные торги			
Контракт	Цена закрытия	Измен-е цены к дневному закрытию %	объем торгов в % к дневному обороту
RTS-3.09	55 545	2.15	25.76
GAZR-3.09	11 015	2.86	12.32
LKOH-3.09	10 285	1.95	9.42
GMKR-3.09	16 100	1.46	13.02
SBER-3.09	2 104	3.29	10.10
VTBR-3.09	3 137	2.18	1.83
SNGR-3.09	13 939	2.81	4.06
GOLD-3.09	822	0.78	47.04

БАНКОВСКИЙ СЕКТОР США ПОДДЕРЖАЛ СРОЧНЫЙ РЫНОК В ВЕЧЕРНЮЮ СЕССИЮ

В четверг на срочном рынке наблюдался резкий рост активности игроков. Объемы торгов выросли с 21,8 до 29,6 млрд руб. Индекс РТС снизился на 3,8% до отметки 569 пунктов. Индекс ММВБ потерял всего 0,77%, закрывшись на отметке 605 пунктов.

Снижение котировок на срочном рынке проходило на фоне заметного роста активности игроков. Хотя днем фьючерс на индекс РТС упал на 5,5%, объемы торгов выросли на 50%, а число открытых позиций - еще на 3%. На рынке опционных контрактов на индекс РТС игроки продавали опционы пут на страйке 60 000 и наращивали позиции на страйках 50 000 и 55 000.

Фьючерсы Газпрома в основную сессию снижались медленнее рынка, потеряв 3,7%. При этом наблюдалось резкое сокращение числа открытых позиций во фьючерсных контрактах (-8,8%). На рынке опционных контрактов Газпрома игроки покупали опционы пут на страйках 6 000 и 8 000, также были заметны продажи опционов пут на страйке 11 000.

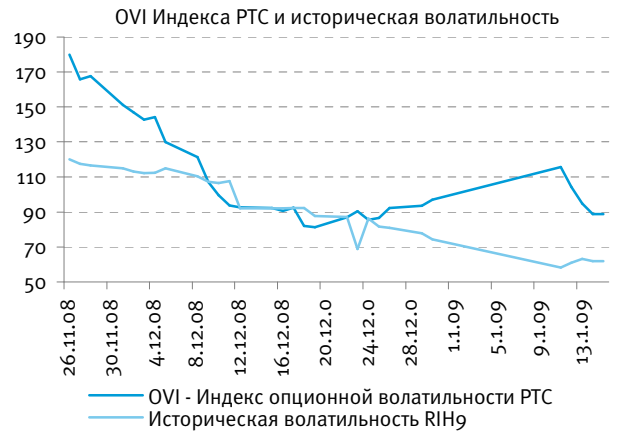
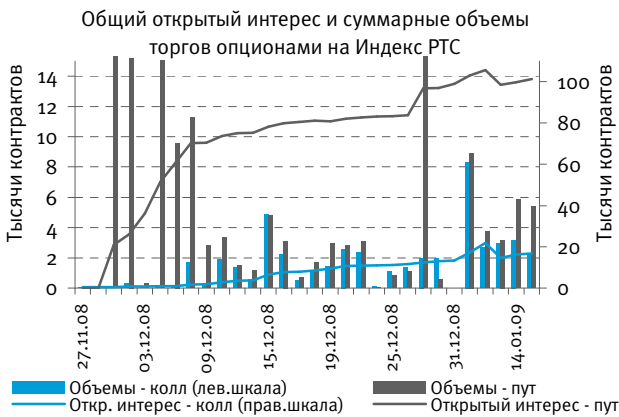
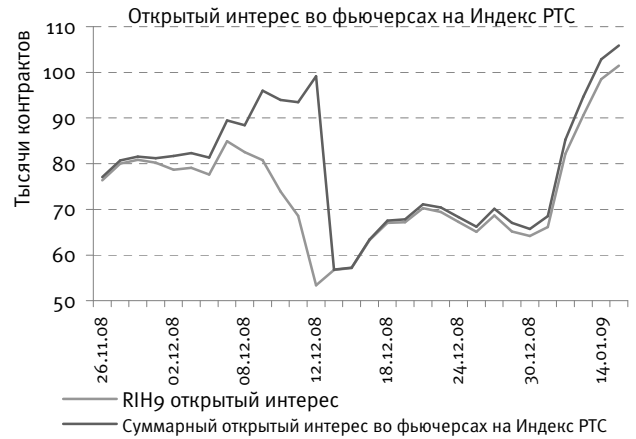
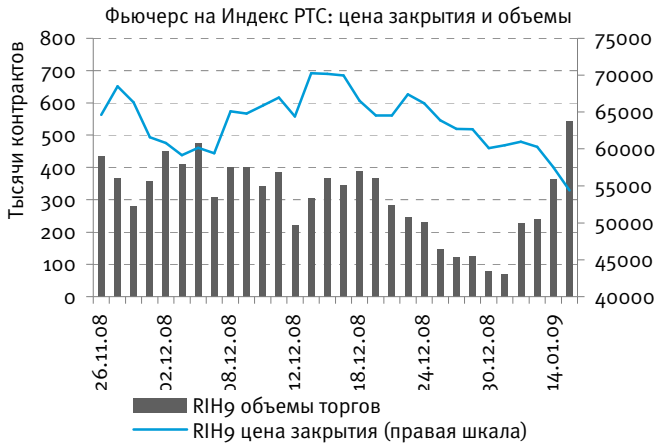
Во время вечерней торговой сессии срочный рынок вырос, практически отыграв дневное падение. Поддержку игрокам оказало разрешение сената США использовать вторую часть средств из плана Полсона в размере \$350 млрд а также заявления City Bank о том что он не будет покупаться правительством США. Выделение банку The Bank of America больших средств также было позитивно воспринято игроками. Фьючерс на индекс РТС вырос на 2,1%. Газпром вновь выглядел сильнее рынка, его контракты прибавили 2,9%. Активнее всего на решение американских сенаторов отреагировали фьючерсы Сбербанка, прибавив в вечернюю сессию 3,4%.

К открытию российских площадок фьючерсы на Индекс S&P500 прибавляют 1%, это создает умеренно положительный фон в начале торгов в России.

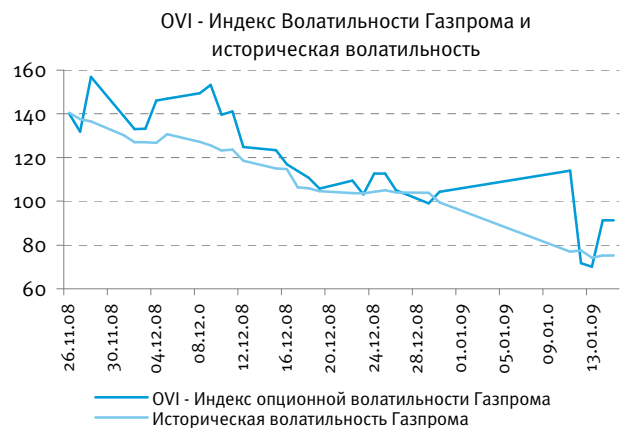
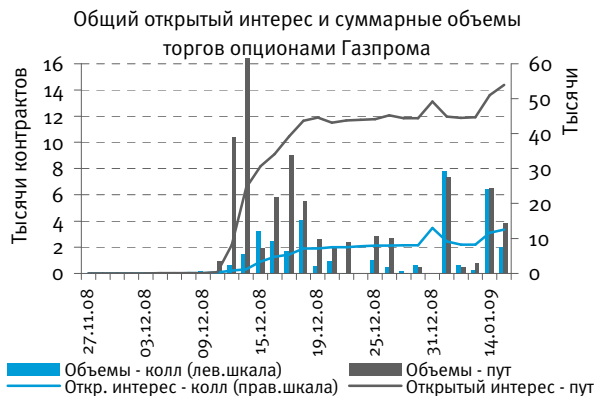
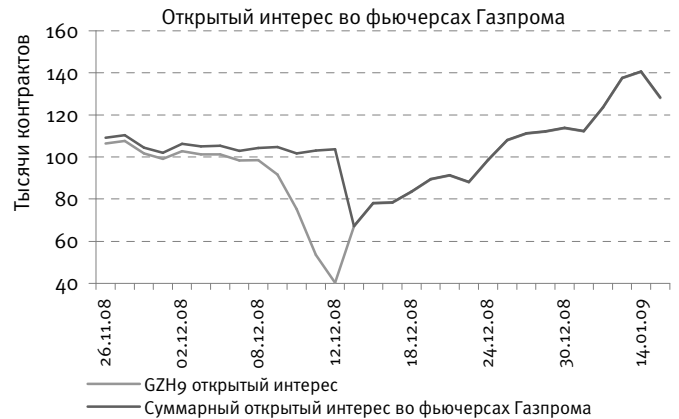
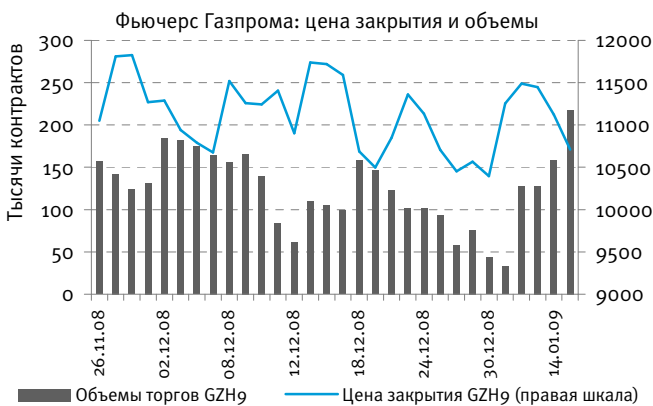
Павел Зайцев

Контракт	Дата	Дней до погашения	Цена закрытия	Измен-е цены %	Объем торгов (контрактов)	Изменение объема торгов %	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-фьючерс, % годовых
RTS-3.09	15.01.2009	57	54 375	-5.51	543 700	49.9	105 885	2.9	101 455	3.0	-25.4	-25.7
GAZR-3.09	15.01.2009	57	10 709	-3.70	217 938	37.7	128 267	-8.8	128 061	-8.8	-0.2	-0.9
LKOH-3.09	15.01.2009	57	10 088	-5.21	114 224	27.6	58 375	-2.1	58 144	-2.2	-8.7	-4.0
GMKR-3.09	15.01.2009	57	15 869	-8.04	6 522	65.7	2 342	-9.3	2 300	-9.4	-1.1	-0.3
SBER-3.09	15.01.2009	57	2 037	-4.46	156 788	62.4	139 112	12.3	138 855	12.3	0.1	2.9
VTBR-3.09	15.01.2009	57	3 070	-0.71	7 388	22.2	81 614	0.6	81 570	1.2	0.0	1.7
SNGR-3.09	15.01.2009	57	13 558	-2.25	5 124	35.5	6 796	-21.1	6 795	-21.1	-0.3	-10.8
GOLD-3.09	15.01.2009	57	815	-0.97	13 290	47.8	11 550	14.2	10 746	15.2		

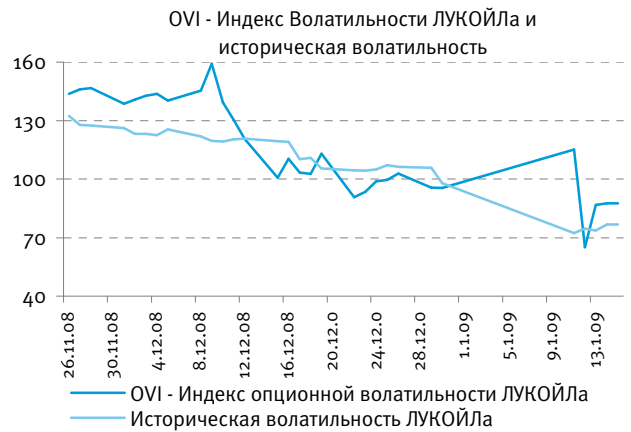
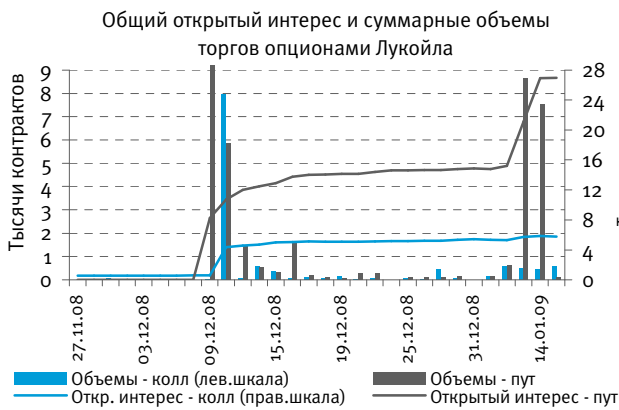
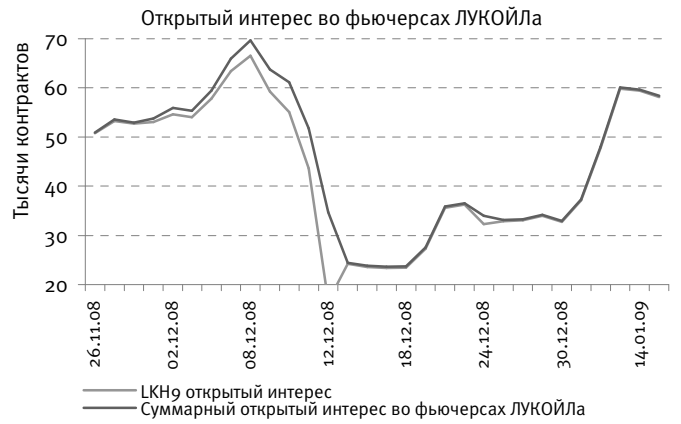
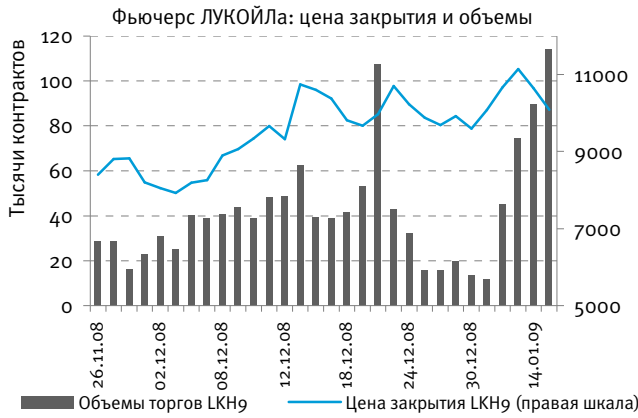
ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС



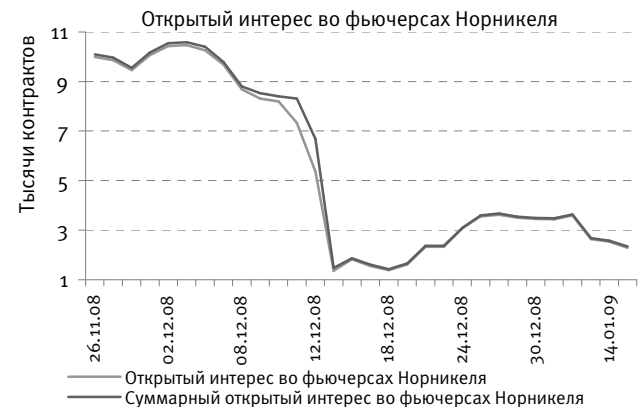
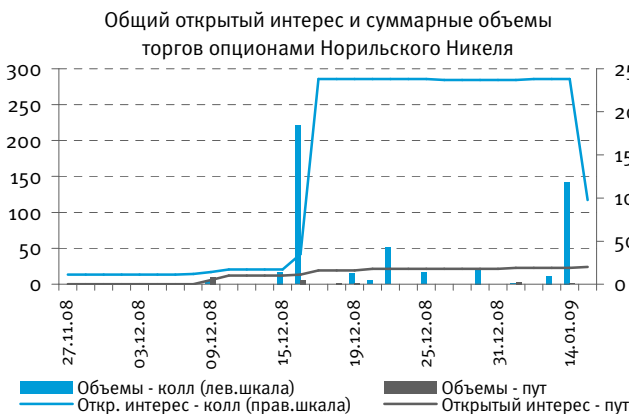
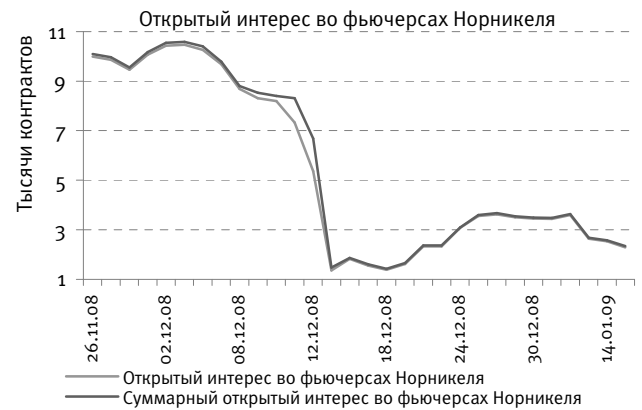
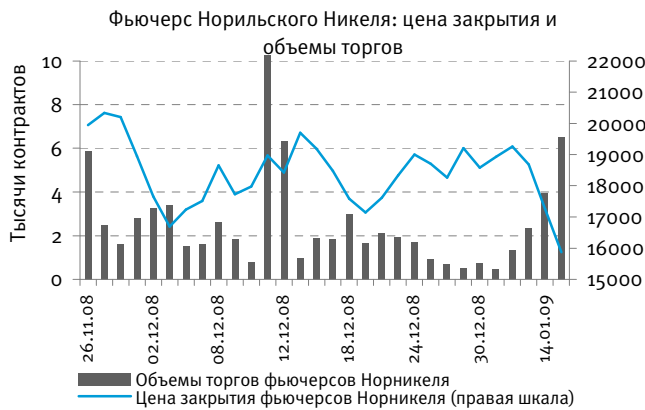
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



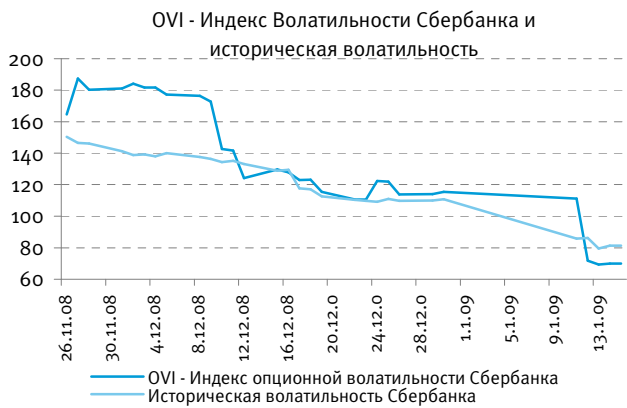
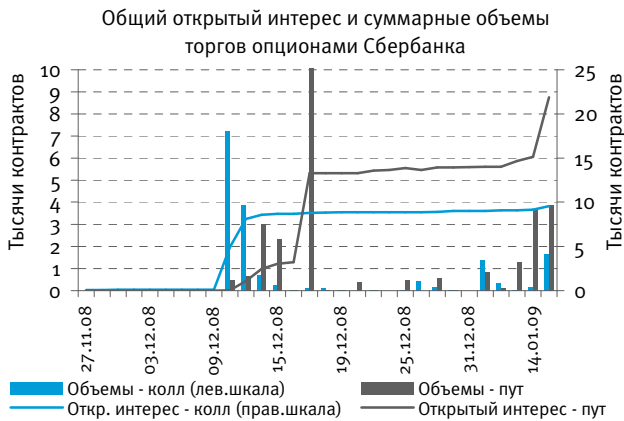
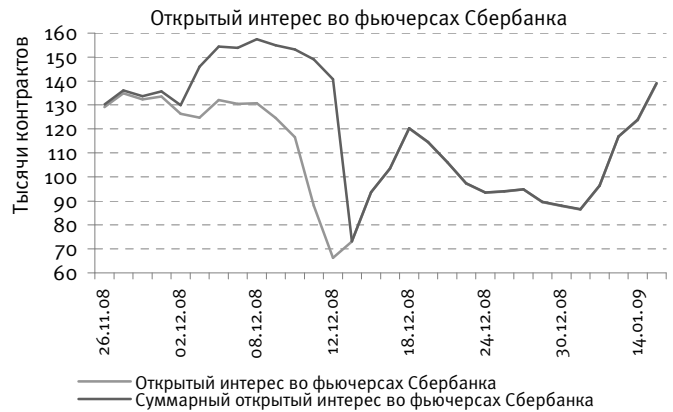
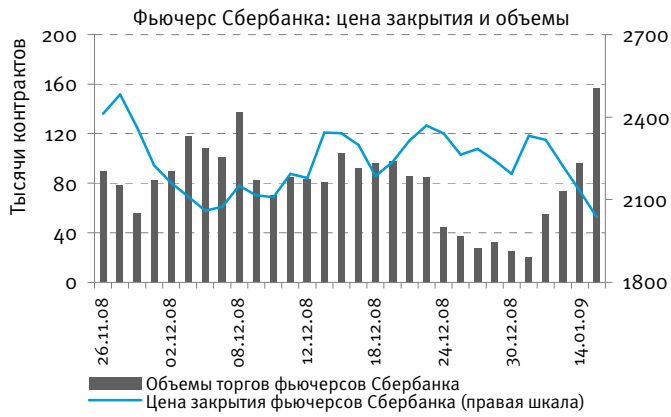
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА



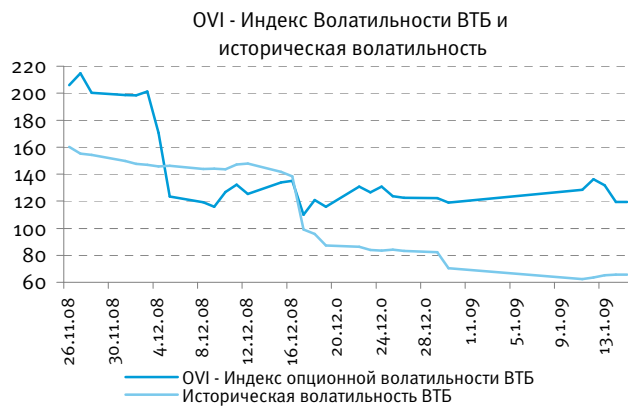
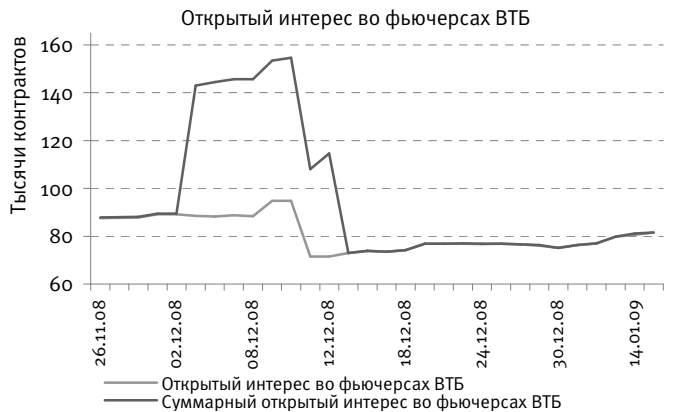
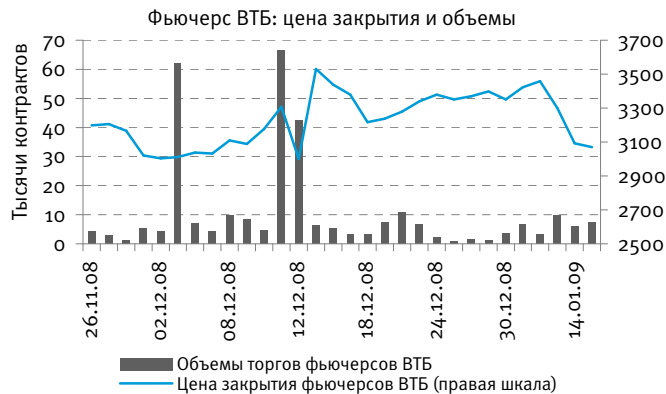
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ



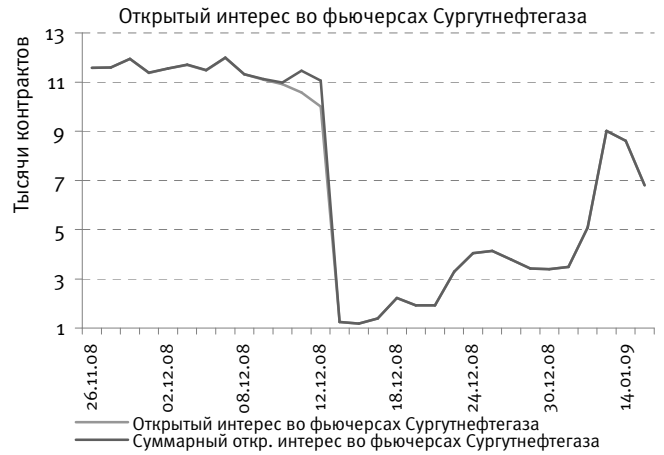
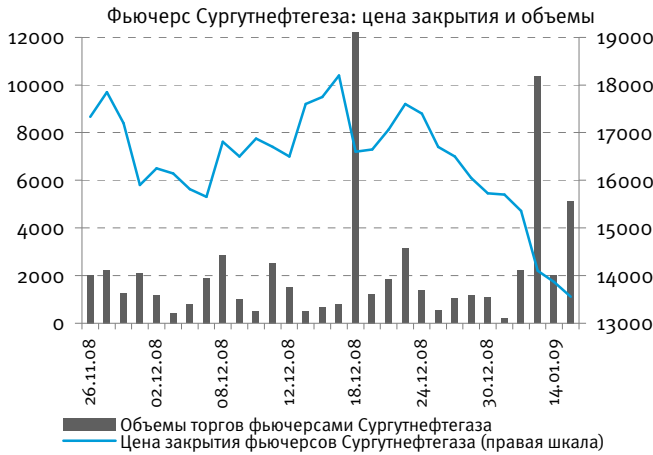
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА



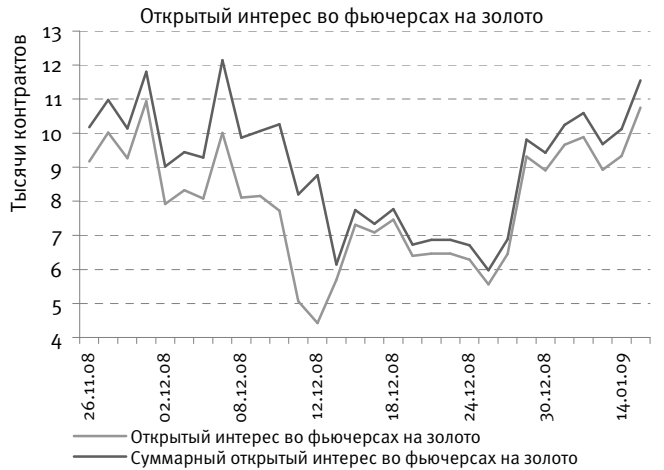
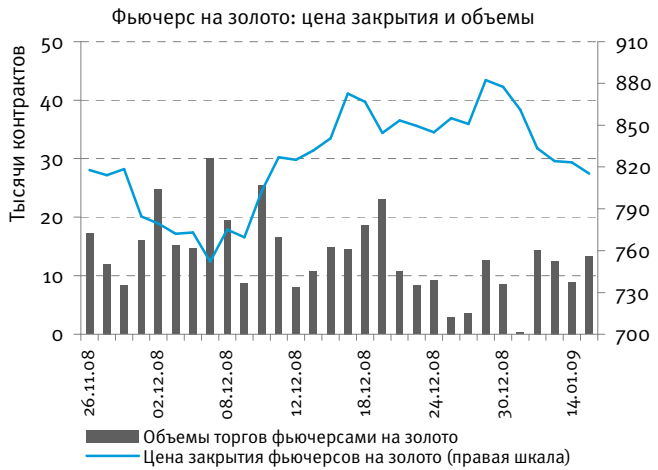
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ



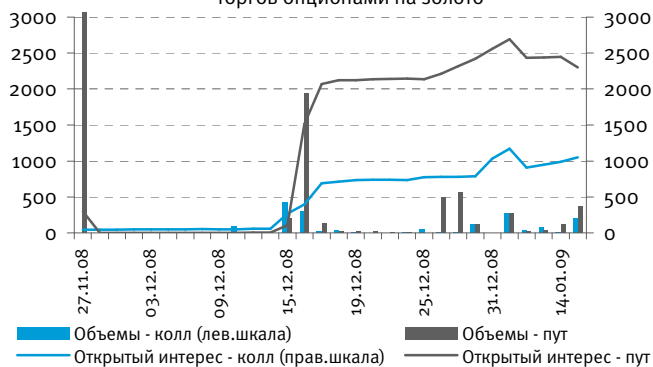
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СУРГУТНЕФТЕГАЗА



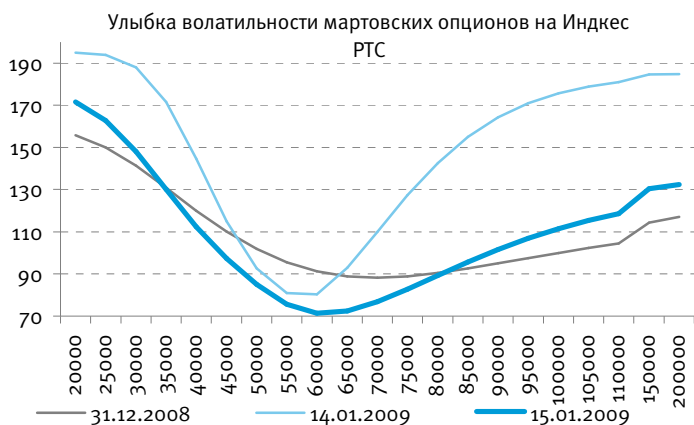
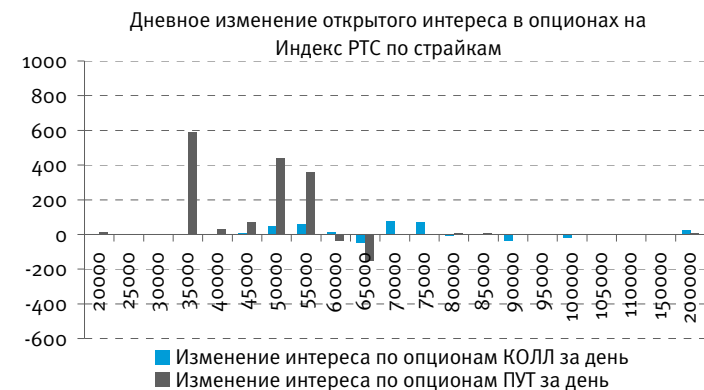
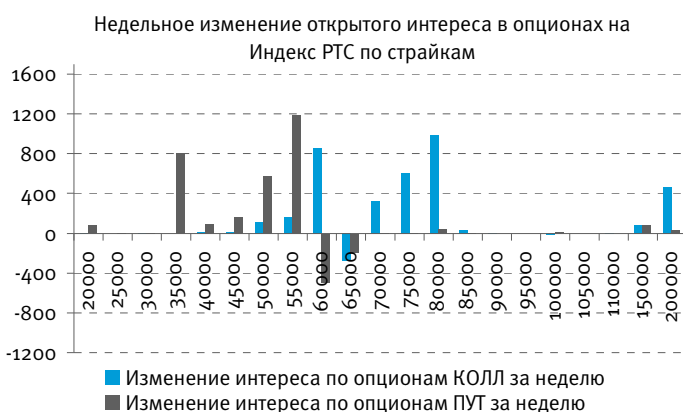
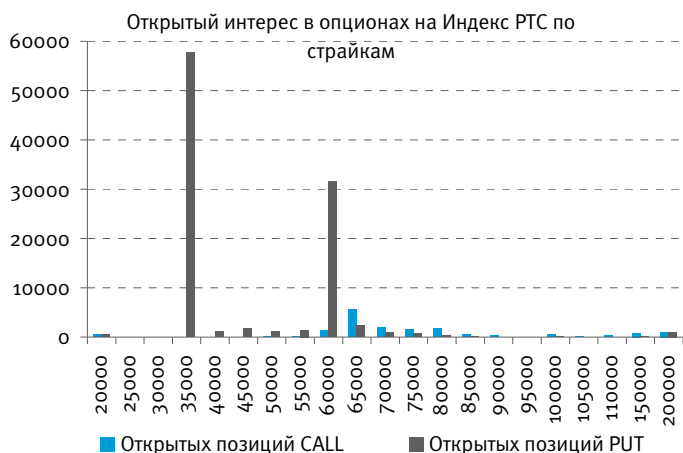
ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



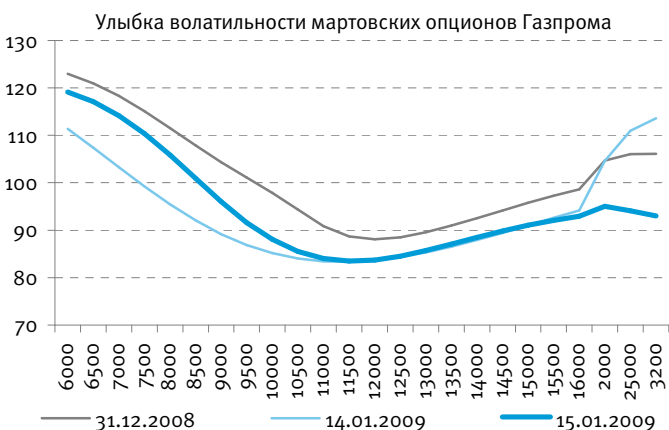
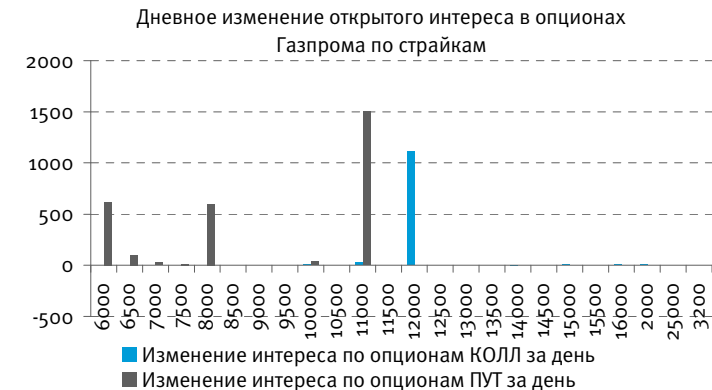
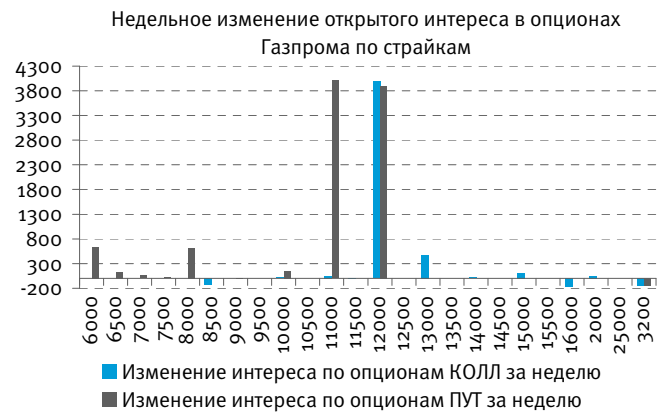
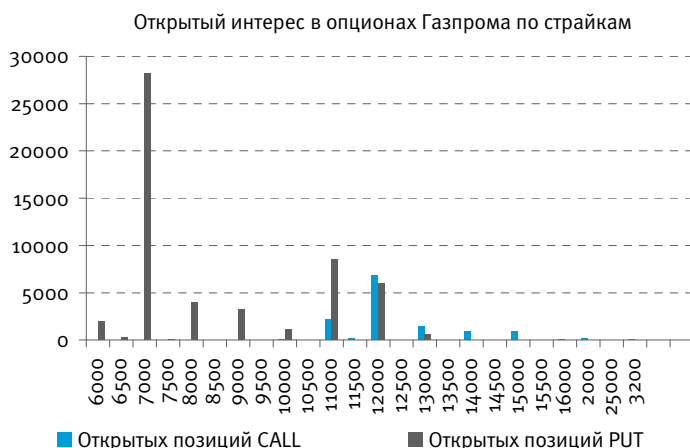
Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами на золото



ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС

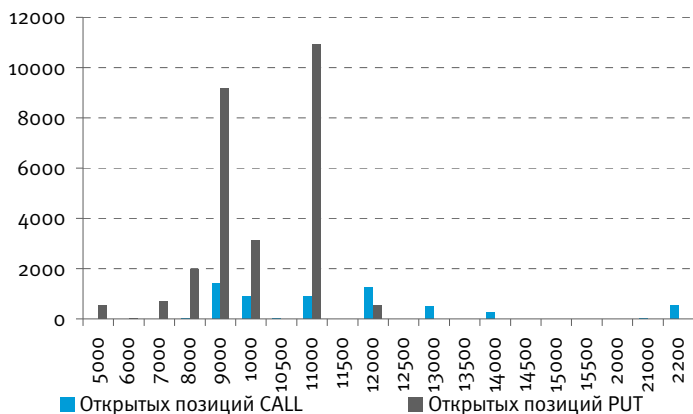


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ГАЗПРОМА



ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ЛУКОЙЛА

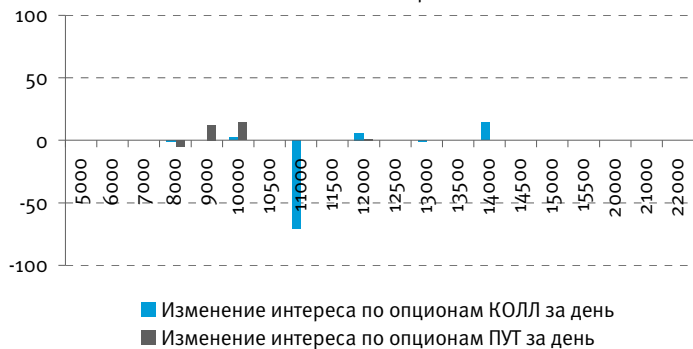
Открытый интерес в опционах ЛУКОЙЛа по страйкам



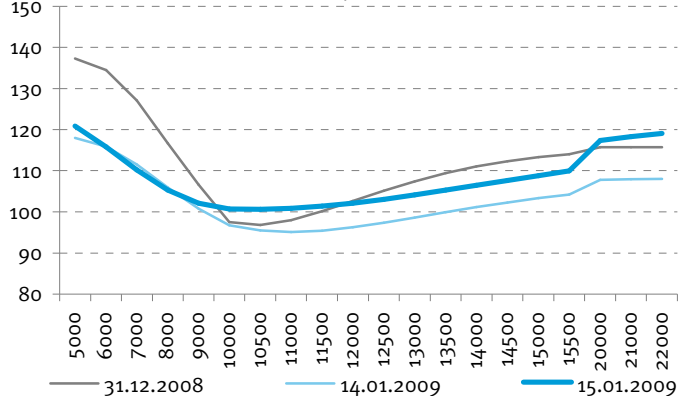
Недельное изменение открытого интереса в опционах ЛУКОЙЛа по страйкам



Дневное изменение открытого интереса в опционах ЛУКОЙЛа по страйкам

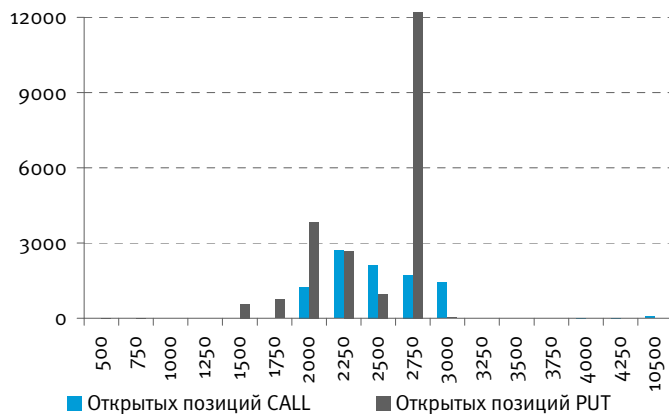


Улыбка волатильности мартовских опционов ЛУКОЙЛа

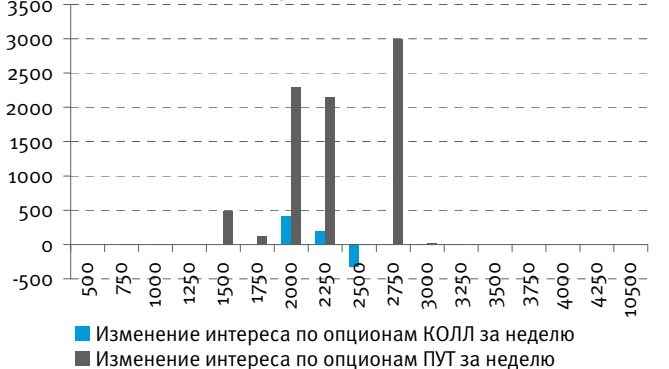


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ СБЕРБАНКА

Открытый интерес в опционах Сбербанка по страйкам



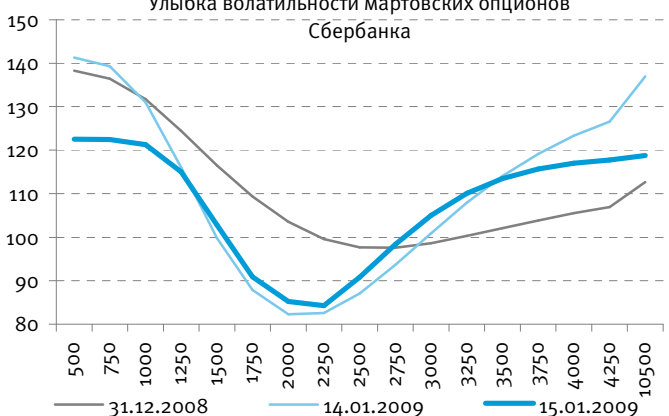
Недельное изменение открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам



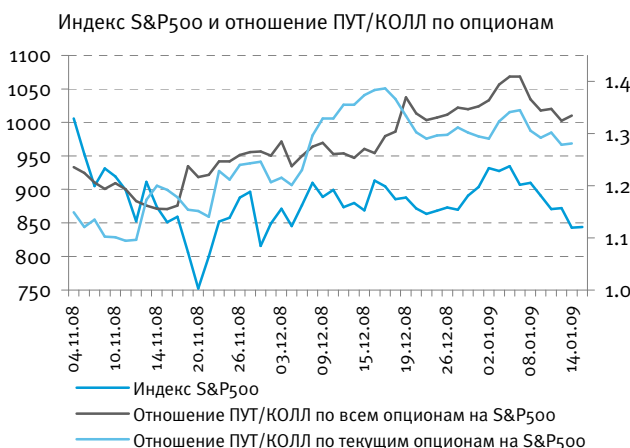
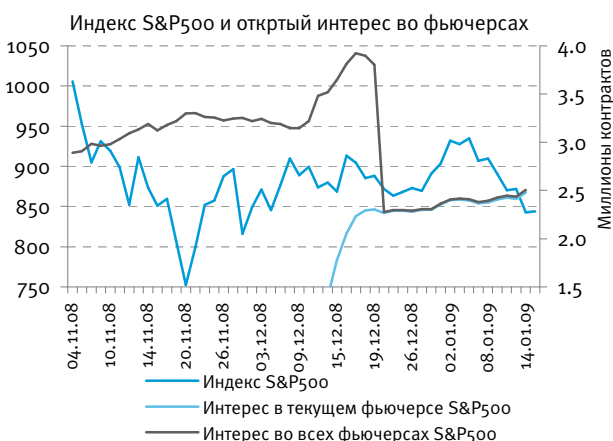
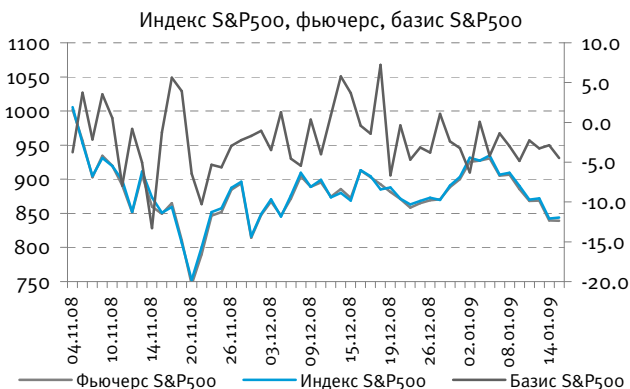
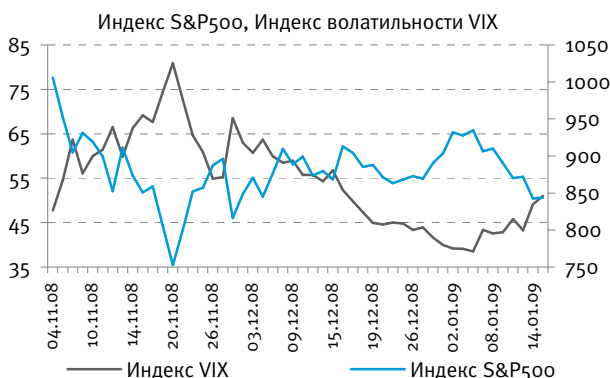
Дневное изменение открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам



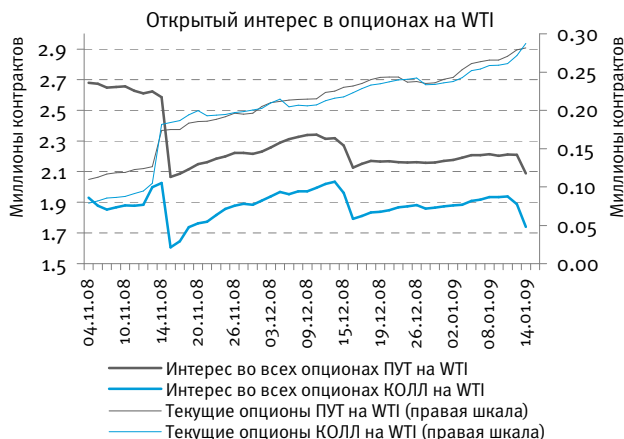
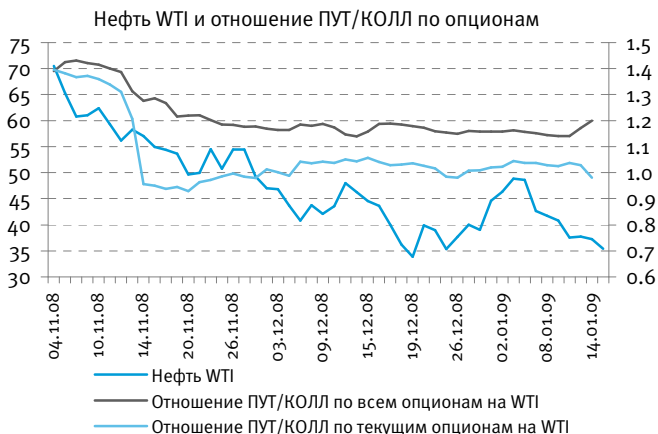
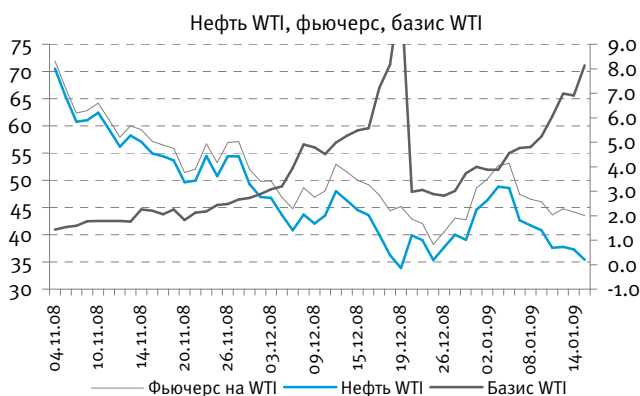
Улыбка волатильности мартовских опционов Сбербанка



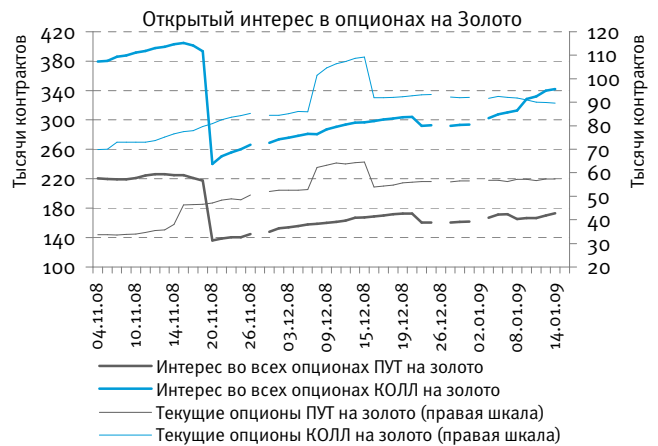
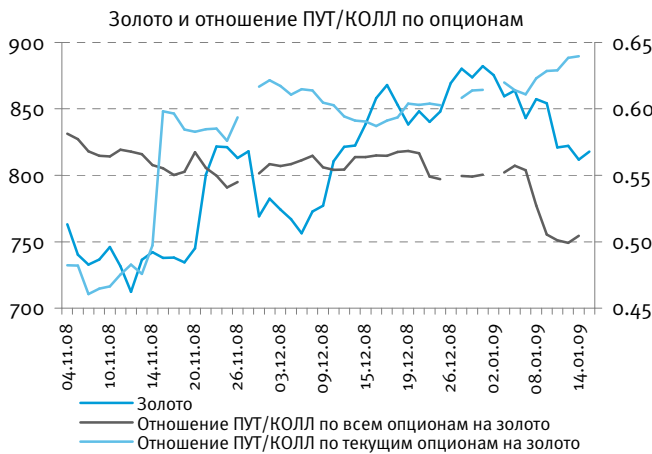
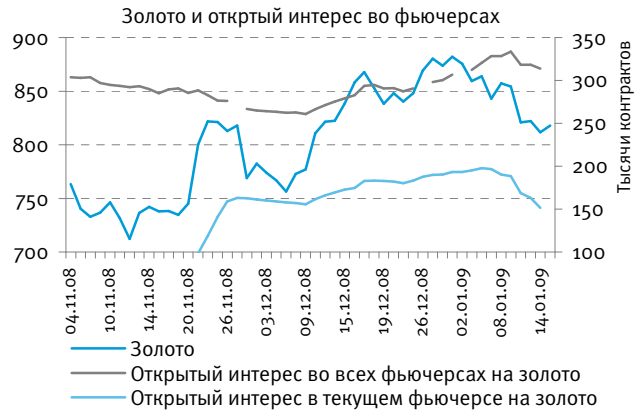
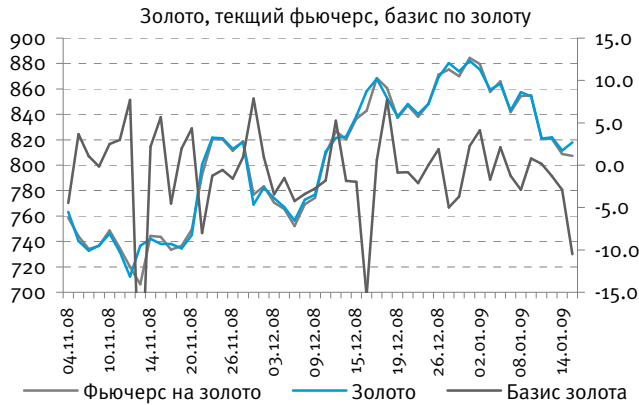
МЕЖДУНАРОДНЫЕ СРОЧНЫЕ РЫНКИ ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС S&P500



ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ МАРКИ WTI



ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО/ДОЛЛАР

