## Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

# Рост российских индексов продолжился

Во вторник ралли на российском рынке продолжилось, несмотря на поступающий с западных площадок негатив. В частности швейцарский банк UBS еще до открытия российских площадок сообщил о росте чистых убытков по итогам 2008г. в 3,8 раза - до 13,09 млрд. евро.

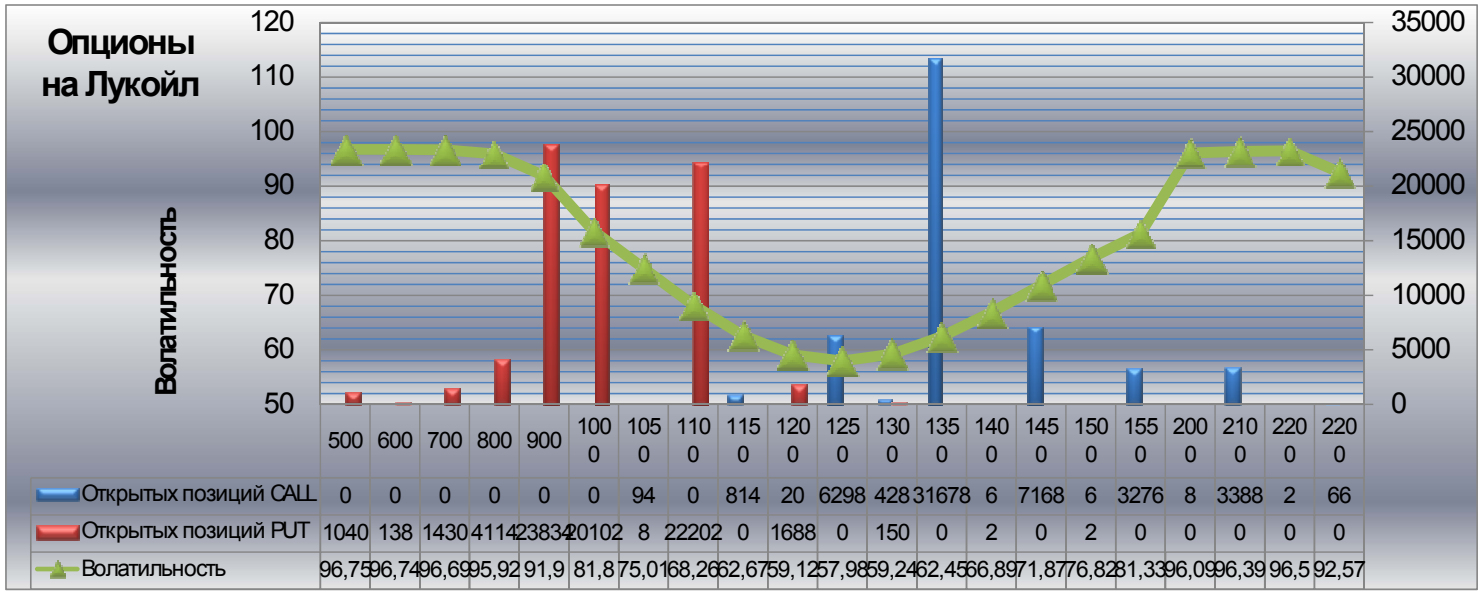
Нефтяные фьючерсы Light Sweet и Brent во вторник торговались в положительной зоне, а максимальный рост цен превысил 4%. Это и сыграло решающую роль в направлении движения российских индексов, несмотря на негатив с Запада.

На срочном рынке вечером нависли хмурые тучи. В вечернюю сессию только товарные и валютные фьючерсы завершили на положительной территории, остальные ушли в глубокий минус. Определяющим фактором, оказавшим влияние на движение котировок фьючерсов, стало поведение американских индексов, которые завершили негативно торги. Наибольшее падение отмечается в контрактах на акции банковского сектора. Фьючерс на акции Сбербанка и ВТБ потеряли 4,42% и 5,31%.

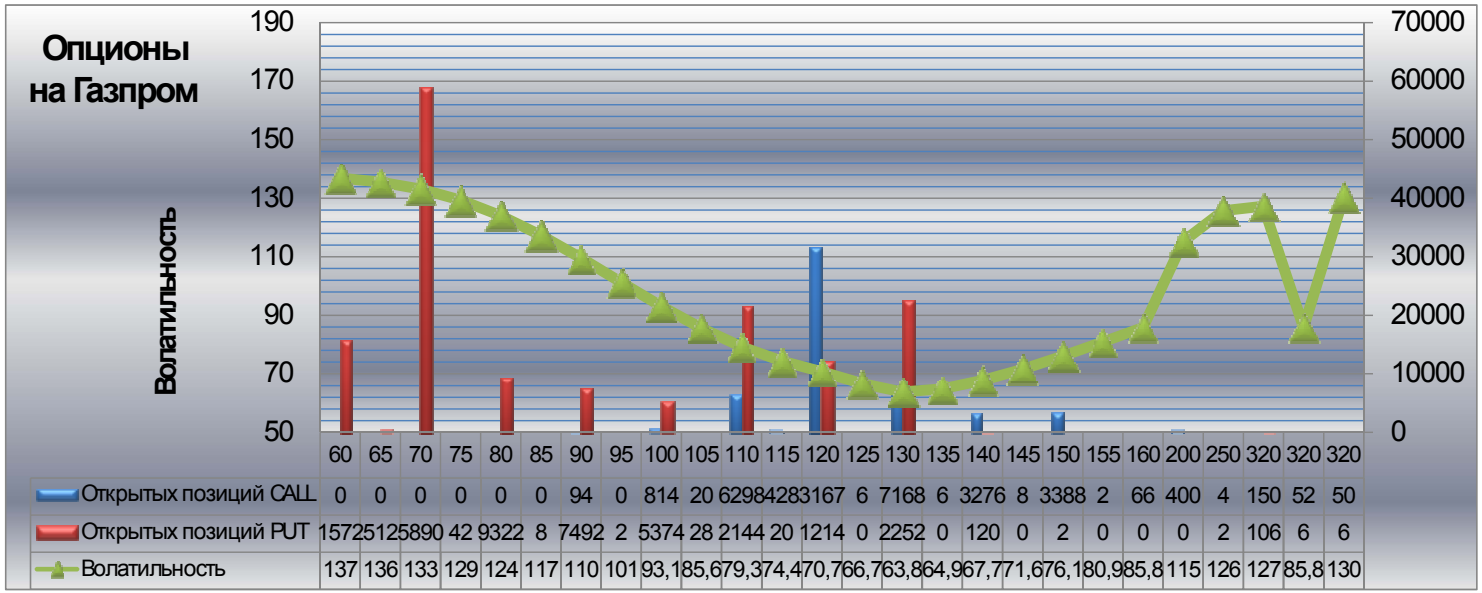
| | Цена фьючерса на 23:50 | Цена в ед. баз. актива | % изм. к закр. На 17:45 | Кол-во отк.поз. (контр.) | % изм. отк. поз. | Оборот (руб.) | Оборот % к дневному |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| RTS-3.09 | 58005 | 580,05 | -4,42 | 242150 | -0,34% | 6 128 440 303 | 33,10% |
| ROSN-3.09 | 12356 | 123,56 | -1,91 | 37906 | 1,59% | 24 742 635 | 22,73% |
| LKOH-3.09 | 12428 | 1242,80 | -4,11 | 169314 | -0,38% | 192 695 130 | 19,07% |
| GAZR-3.09 | 12527 | 125,27 | -3,87 | 339546 | -0,14% | 784 239 125 | 23,17% |
| GMKR-3.09 | 17750 | 1775,00 | -2,21 | 10606 | -3,70% | 140 005 368 | 82,41% |
| SBRF-3.09 | 1711 | 17,11 | -4,42 | 484572 | 9,64% | 166 369 395 | 25,25% |
| SNGR-3.09 | 19858 | 19,86 | -3,38 | 10610 | 0,04% | 8 803 783 | 2,86% |
| VTBR-3.09 | 2410 | 0,0241 | -5,31 | 143884 | -0,12% | 6 226 987 | 10,74% |
| BR-2.09 | 45,61 | 45,61 | -4,73 | 5266 | 17,34% | 66 673 506 | 24,41% |
| UR-2.09 | 46,30 | 46,30 | 0,43 | 30 | -76,56% | 953 004 | 198,32% |
| GOLD-3.09 | 920 | 919,90 | 0,6 | 69252 | -2,85% | 239 315 678 | 55,68% |
| Si-3.09 | 36335 | 36,34 | 0,53 | 369164 | 0,64% | 425 137 555 | 32,13% |

| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| DJ Industrial | 7884,1 | -4,68% | 00:00:15 |
| S&P 500 | 826,96 | -4,94% | 00:00:13 |
| DAX 30 | 4505,54 | -3,46% | 23:41:51 |
| CAC 40 | 3020,75 | -3,64% | 21:26:28 |
| FTSE 100 | 4213,08 | -2,19% | 20:03:39 |
| Hang Seng | 13880,64 | 0,81% | 20:03:39 |
| Nikkei 225 | 7945,94 | -0,29% | 20:03:39 |
| BOVESPA Brazil | 41207,43 | -2,12% | 23:22:35 |
| Gold | 916,97 | 2,62% | 00:00:16 |
| Silver | 13,132 | 2,34% | 00:00:17 |
| Palladium | 210 | 2,44% | 23:50:50 |
| Platinum | 1034 | 4,66% | 23:59:17 |
| Brent Crude Oil 0209 | 44,69 | 0,00% | 06:06:15 |
| RTSI | 539,38 | 8,27% | 18:00:00 |
| RTSI_DEREX | 553,08 | 10,54% | 18:45:00 |

## Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert

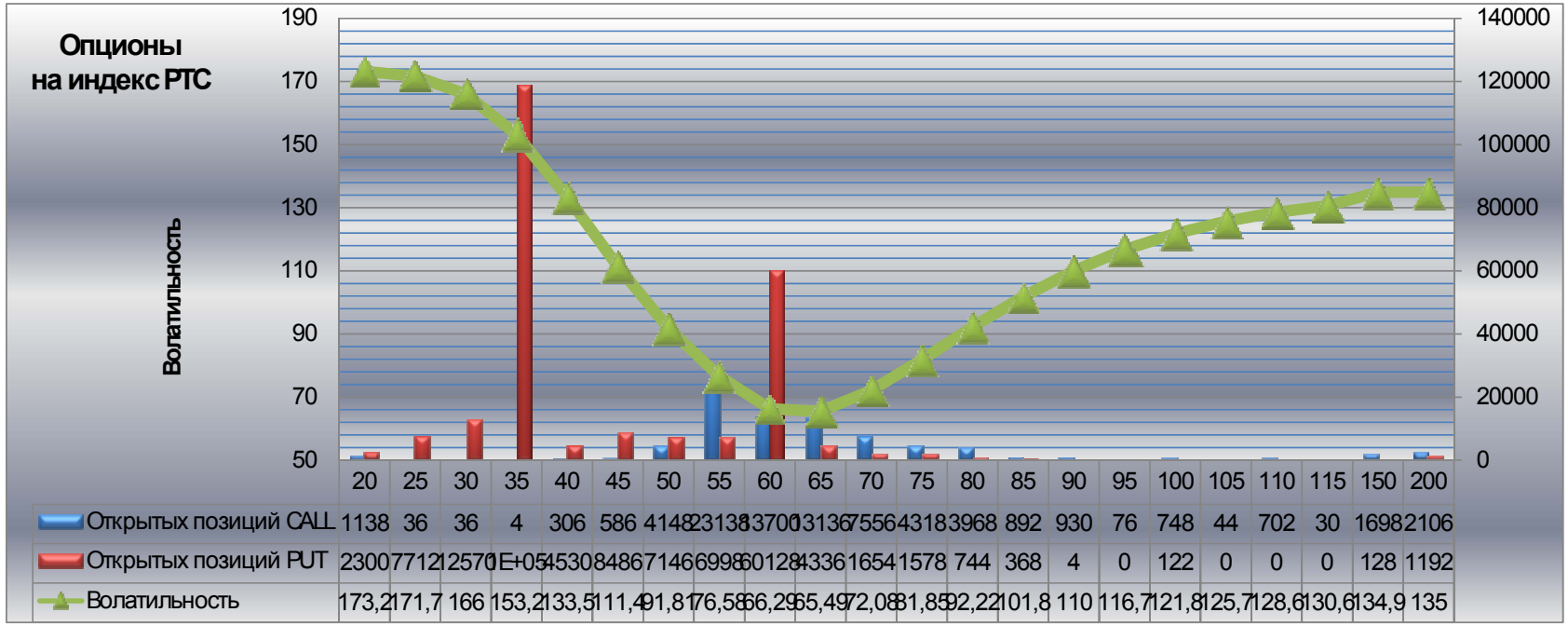


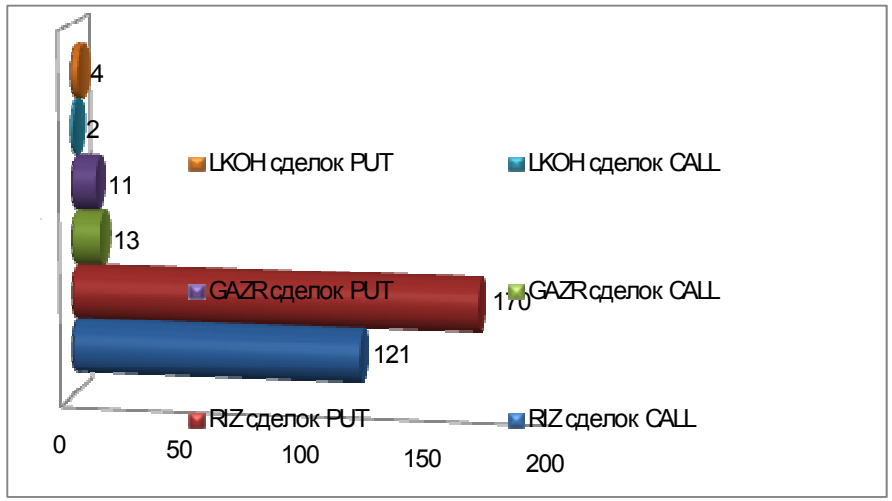

| | 500 | 600 | 700 | 800 | 900 | 1000 | 1050 | 1100 | 1150 | 1200 | 1250 | 1300 | 1350 | 1400 | 1450 | 1500 | 1550 | 2000 | 2100 | 2200 | 2200 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Открытых позиций CALL | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 94 | 0 | 814 | 20 | 6298 | 428 | 31678 | 6 | 7168 | 6 | 3276 | 8 | 3388 | 2 | 66 |
| Открытых позиций PUT | 1040 | 138 | 1430 | 4114 | 23834 | 20102 | 8 | 22202 | 0 | 1688 | 0 | 150 | 0 | 2 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Волатильность | 96,75 | 96,74 | 96,69 | 95,92 | 91,9 | 81,8 | 75,01 | 68,26 | 62,67 | 59,12 | 57,98 | 59,24 | 62,45 | 66,89 | 71,87 | 76,82 | 81,33 | 96,09 | 96,39 | 96,5 | 92,57 |

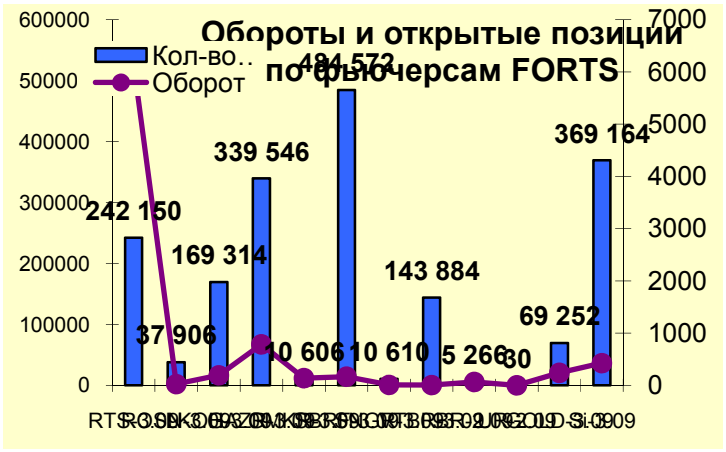


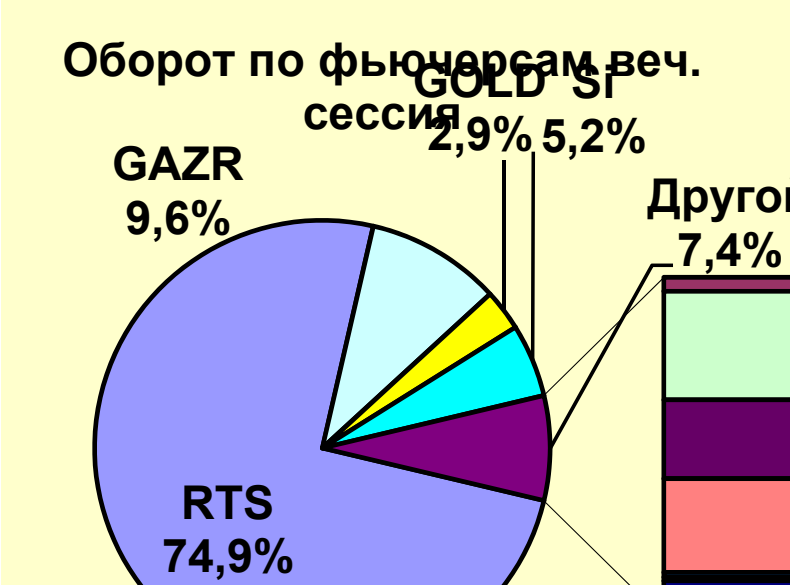

| | 60 | 65 | 70 | 75 | 80 | 85 | 90 | 95 | 100 | 105 | 110 | 115 | 120 | 125 | 130 | 135 | 140 | 145 | 150 | 155 | 160 | 200 | 250 | 320 | 320 | 320 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Открытых позиций CALL | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 94 | 0 | 814 | 20 | 6298 | 428 | 3167 | 6 | 7168 | 6 | 3276 | 8 | 3388 | 2 | 66 | 400 | 4 | 150 | 52 | 50 |
| Открытых позиций PUT | 1572 | 5125 | 8904 | 2 | 9322 | 8 | 7492 | 2 | 5374 | 28 | 2144 | 20 | 1214 | 0 | 2252 | 0 | 120 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 2 | 106 | 6 | 6 |
| Волатильность | 137 | 136 | 133 | 129 | 124 | 117 | 110 | 101 | 93,1 | 85,6 | 79,3 | 74,4 | 70,7 | 66,7 | 63,8 | 64,9 | 67,7 | 71,6 | 76,1 | 80,9 | 85,8 | 115 | 126 | 127 | 85,8 | 130 |

## Обзор вечерней торговой сессии от Derivative Expert




Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
Кол-во..
Оборот
600000
50000
400000
300000
200000
100000
0
7000
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
242 150
37 906
169 314
339 546
10 606
484 572
10 610
143 884
5 266
30
69 252
369 164


Оборот по фьючерсам веч. сессия
GAZR
9,6%
GOLD SI
2,9%
5,2%
Другие
7,4%
RTS
74,9%