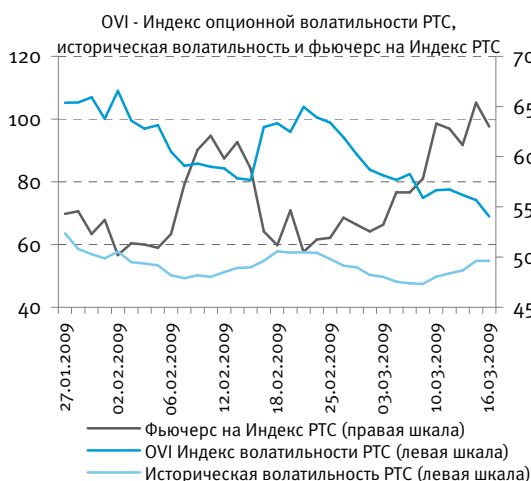
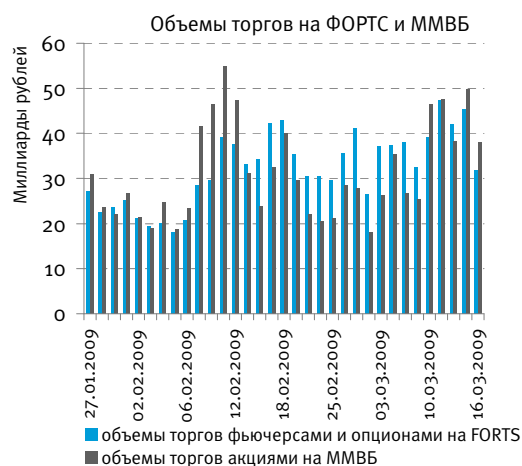




| Ночные торги |               |                                    |                                     |
|--------------|---------------|------------------------------------|-------------------------------------|
| Контракт     | Цена закрытия | Измен-е цены к дневному закрытию % | объем торгов в % к дневному обороту |
| RTS-6.09     | 61 250        | -2.81                              | 43.20                               |
| GAZR-6.09    | 12 729        | -0.18                              | 25.60                               |
| LKOH-6.09    | 12 692        | -1.60                              | 35.76                               |
| GMKR-6.09    | 19 250        | -3.07                              | 11.78                               |
| SBER-6.09    | 1 776         | -0.50                              | 22.16                               |
| VTBR-6.09    | 2 611         | -1.10                              | 18.73                               |
| SNGR-6.09    | 23 150        | -3.58                              | 8.82                                |
| GOLD-6.09    | 928           | 0.19                               | 19.82                               |

## ПЕРВЫЙ ДЕНЬ АКТИВНОЙ ТОРГОВЛИ ИЮНСКИМИ ФЬЮЧЕРСАМИ

Первый день активной торговли июньскими фьючерсами прошел на средних объемах торгов. На ФОРТС суммарная активность игроков снизилась с 45 до 38 млрд руб.

Фьючерс на Индекс РТС в основную сессию продемонстрировал умеренно негативную динамику, снизившись на 0,5%. Участники рынка активно формировали позиции в этих контрактах, что привело к увеличению числа открытых позиций на 21%. Во время вечерней торговой сессии фьючерсы продемонстрировали заметное снижение. Контракт на индекс РТС снизился на 2,8%.

Следует отметить, что наиболее ликвидные контракты начали торговаться в бэквордации. Минимальное значение у фьючерсов Газпрома, что в очередной раз указывает на позитивный настрой по отношению к этим инструментам у участников рынка.

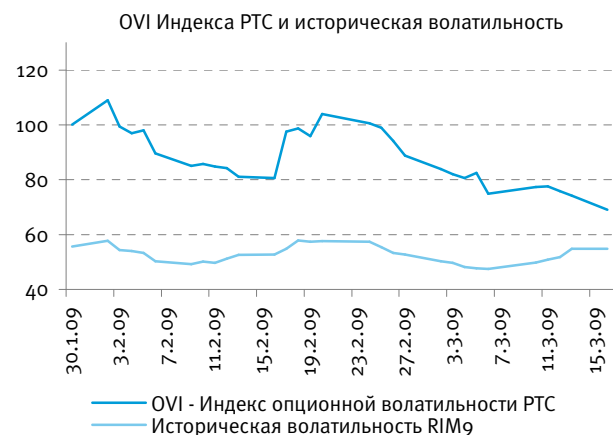
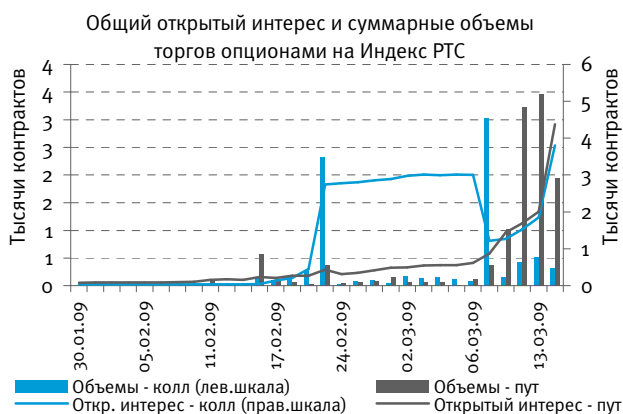
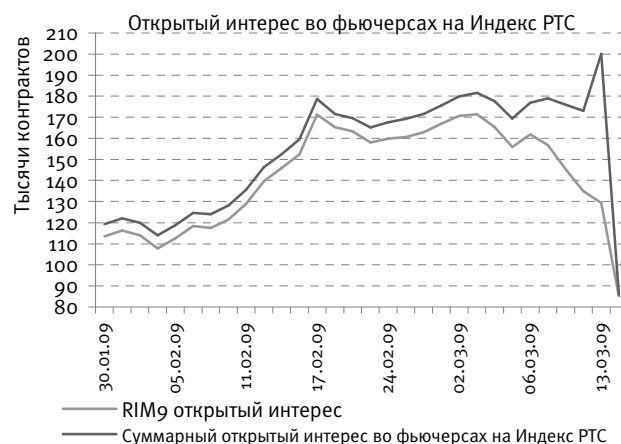
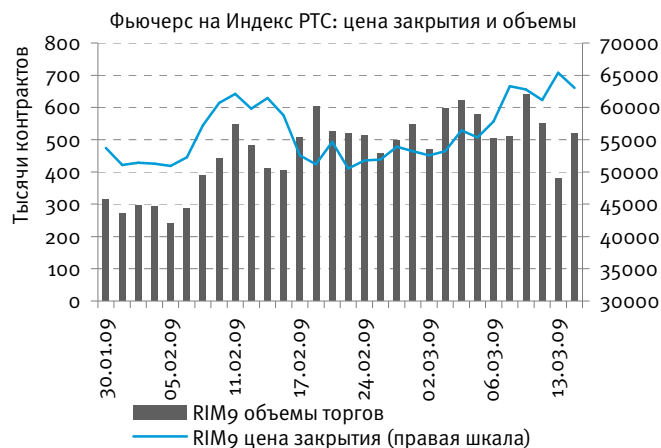
Наибольший спекулятивный интерес наблюдался в контрактах банковского сектора. Во время основной сессии фьючерсы Сбербанка выросли на 2,8%, при этом число открытых позиций возросло на 13%. Еще больший интерес участники проявили к контрактам ВТБ. В этих фьючерсах число открытых позиций возросло на 21%.

Из важных макроэкономических показателей, публикуемых сегодня в 15:30 мск, следует выделить данные по строительству и индексу цен производителей. По ценам производителей аналитики ожидают роста на 0,4%, а по объемам жилищного строительства - сокращения до 450 тыс.

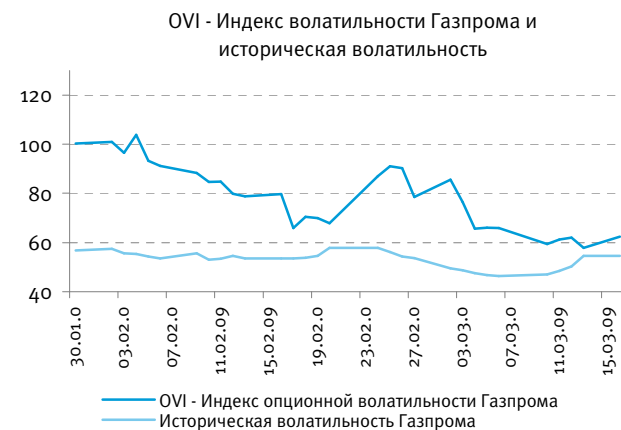
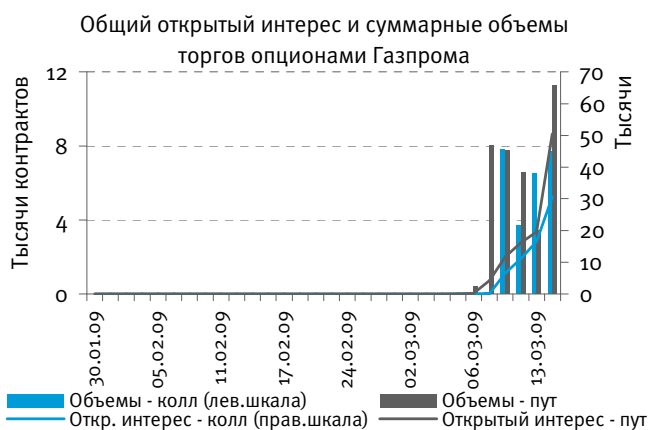
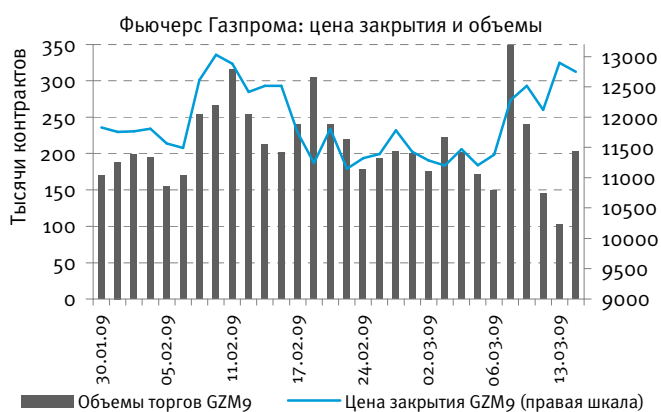
Павел Зайцев

| Контракт  | Дата       | Дней до погашения | Цена закрытия | Измен-е цены % | Объем торгов (контрактов) | Изменение объема торгов % | Открытый интерес по всем фьючерсам | Открытый интерес по текущему фьючерсу | Прир-е открытого интереса | Спрэд, пунктов | Доходность арбитража спот - фьючерс, % |
|-----------|------------|-------------------|---------------|----------------|---------------------------|---------------------------|------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------|----------------|----------------------------------------|
| RTS-6.09  | 16.03.2009 | 87                | 63 020        | -0.52          | 519 497                   | 129.0                     | 85 904                             | 85 176                                | 21.0                      | -17.3          | -10.1                                  |
| GAZR-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 12 752        | -2.13          | 202 554                   | 10.3                      | 97 666                             | 97 529                                | 3.5                       | -1.1           | -2.9                                   |
| LKOH-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 12 898        | -3.43          | 69 345                    | -9.6                      | 35 051                             | 34 917                                | 4.6                       | -34.2          | -8.0                                   |
| GMKR-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 19 860        | 4.75           | 10 316                    | 22.1                      | 6 099                              | 6 095                                 | 10.8                      | 3.0            | 0.5                                    |
| SBER-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 1 785         | 2.88           | 254 853                   | 8.7                       | 135 793                            | 135 787                               | 12.9                      | -0.4           | -8.5                                   |
| VTBR-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 2 640         | 0.11           | 13 693                    | 0.5                       | 11 615                             | 11 615                                | 21.2                      | 0.0            | -8.6                                   |
| SNGR-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 24 010        | -0.37          | 2 267                     | -39.4                     | 3 502                              | 3 502                                 | 1.9                       |                |                                        |
| GOLD-6.09 | 16.03.2009 | 87                | 926           | -0.72          | 8 631                     | -36.5                     | 16 153                             | 16 022                                | 14.3                      |                |                                        |

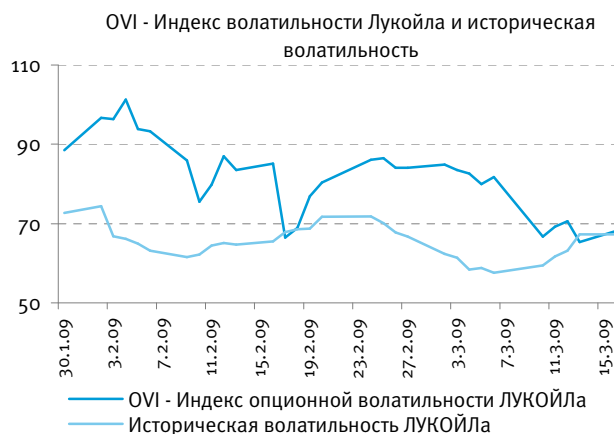
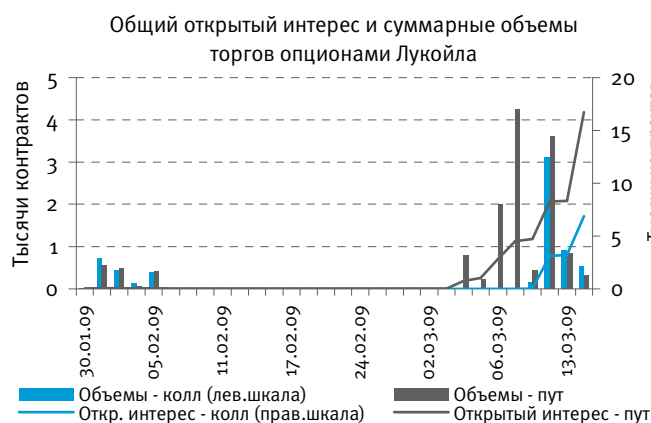
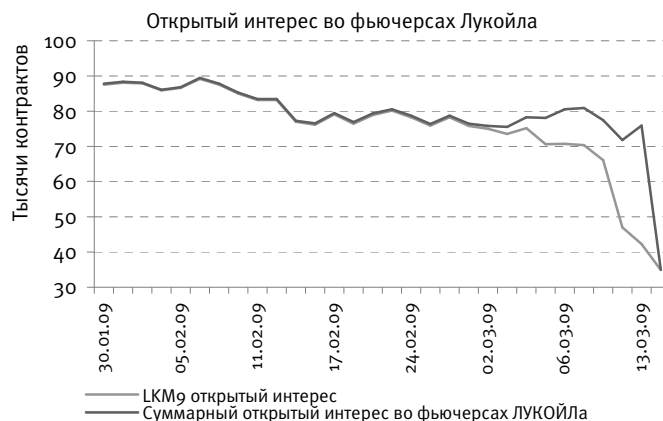
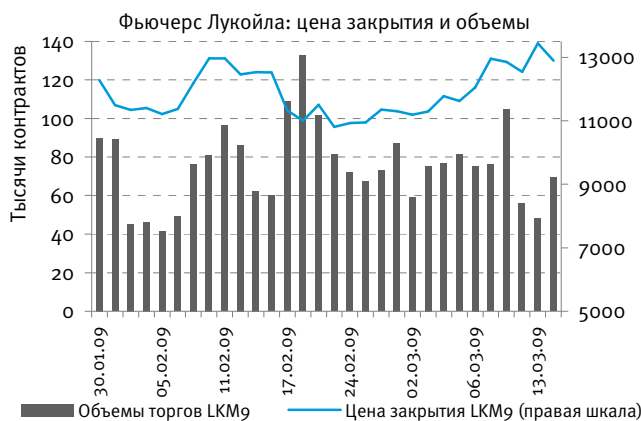
## ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС



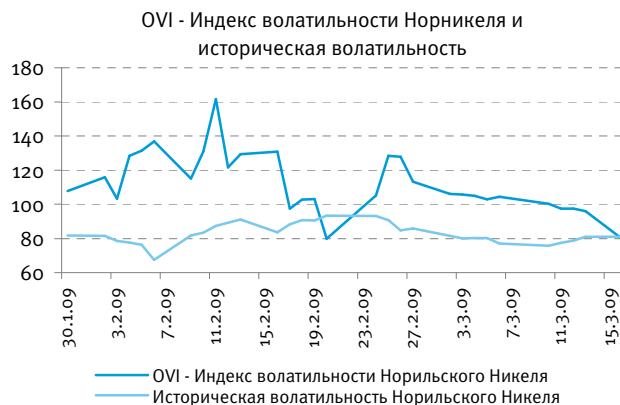
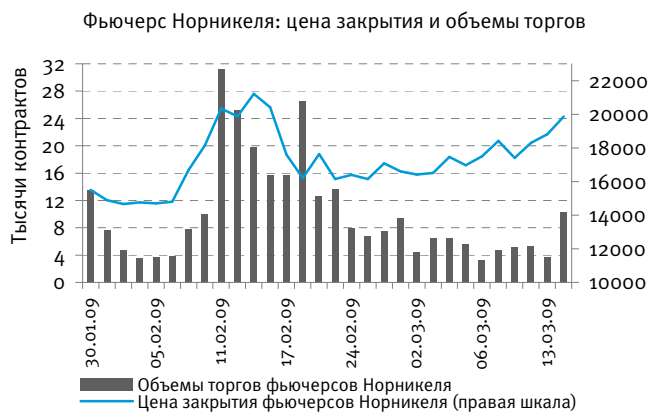
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



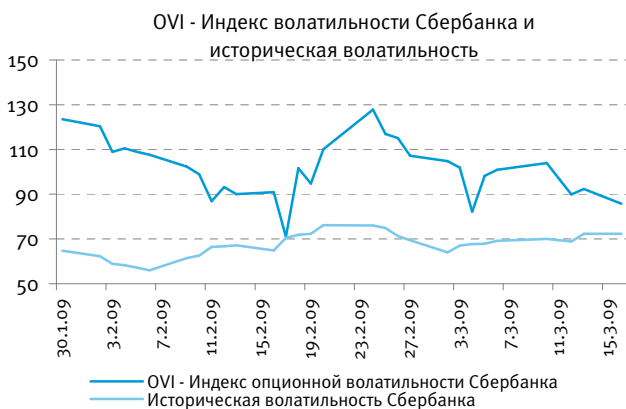
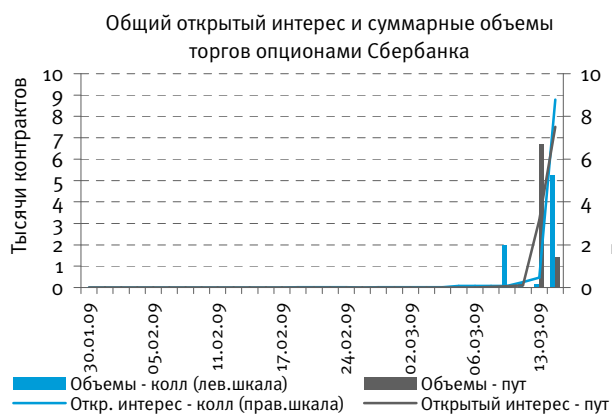
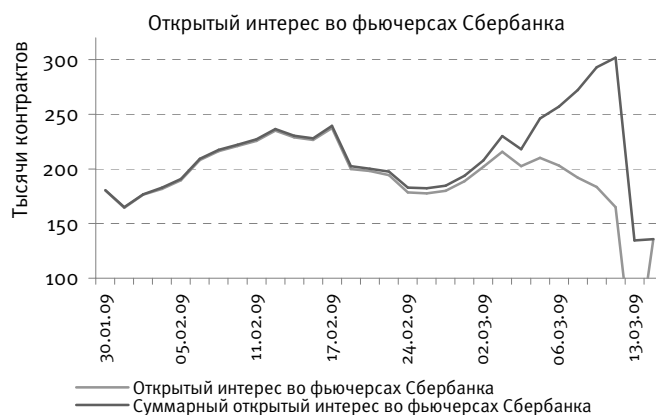
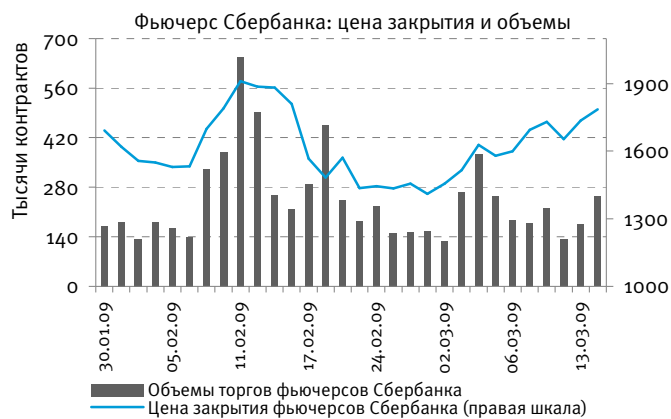
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА



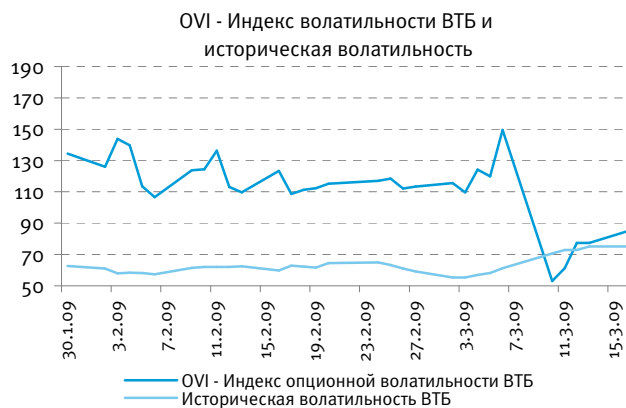
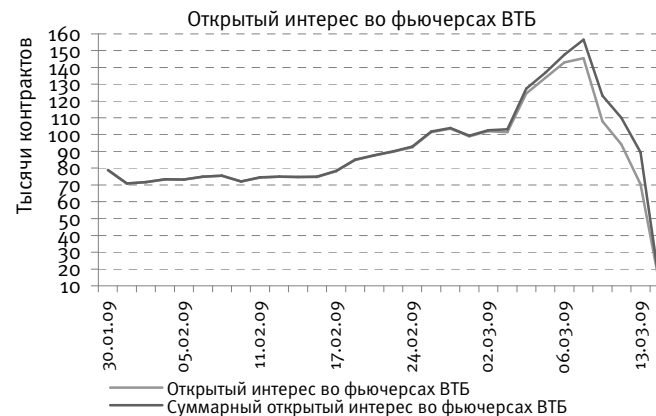
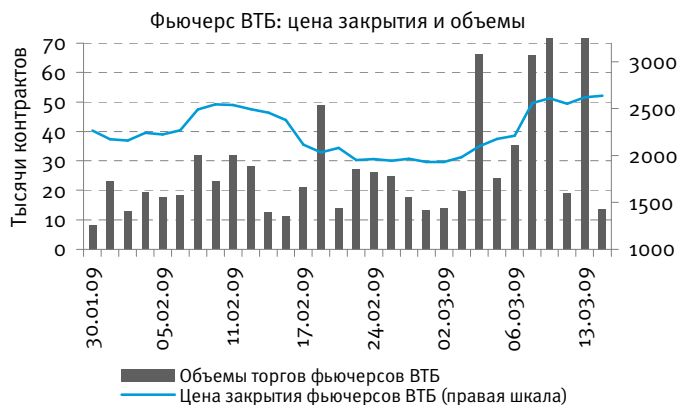
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК «НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ»



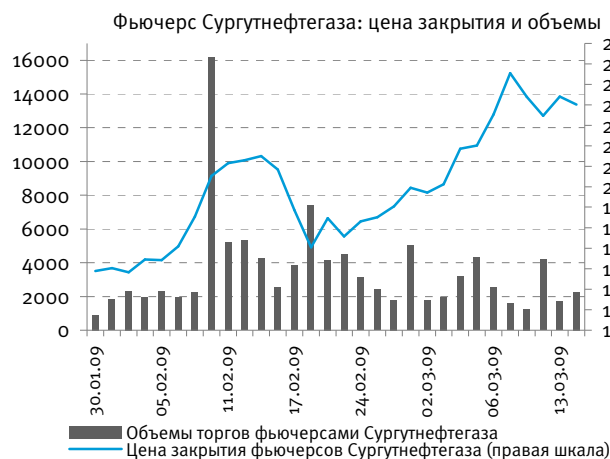
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА



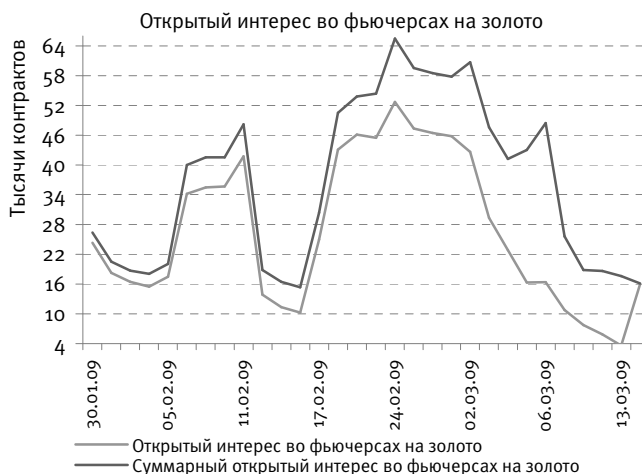
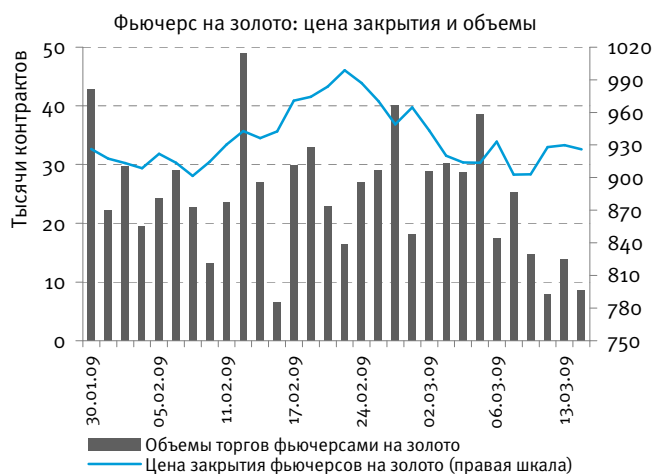
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ



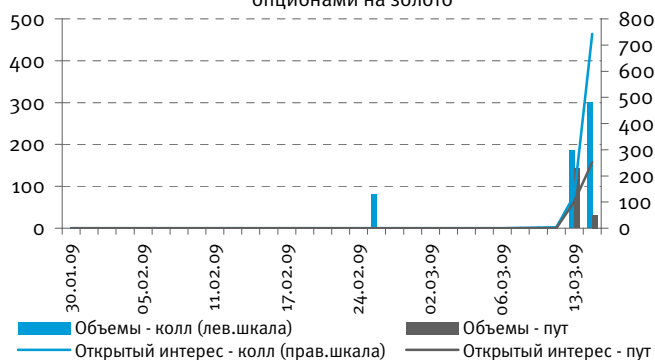
## ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СУРГУТНЕФТЕГАЗА



## ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО

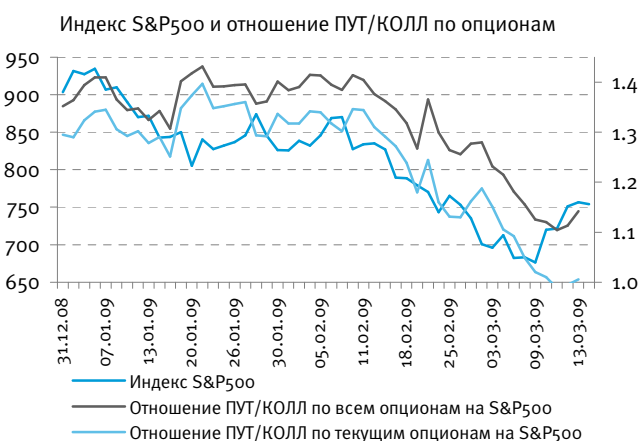
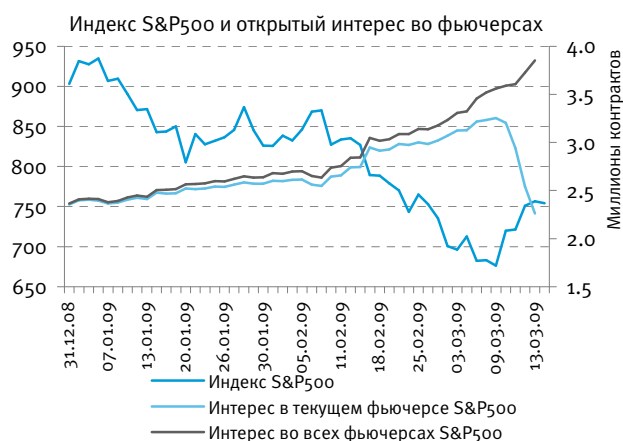
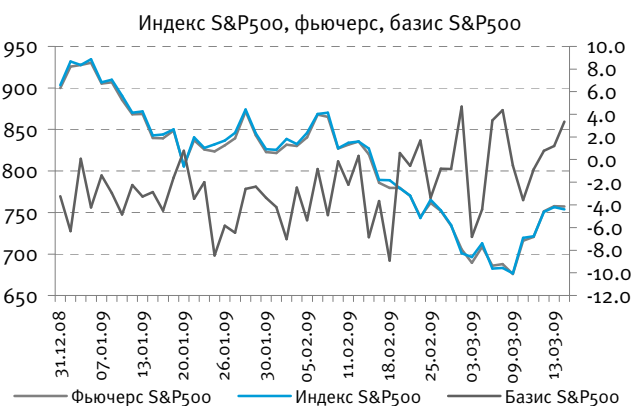
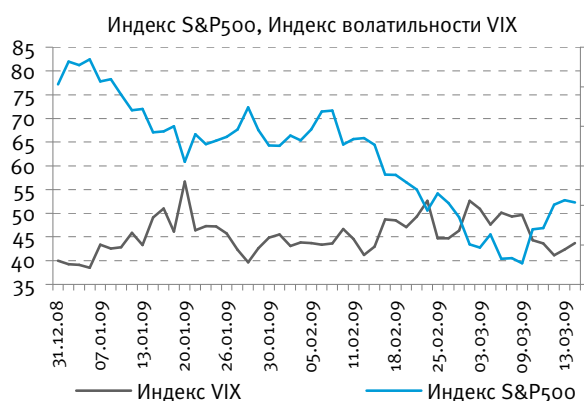


## Общий открытый интерес и суммарные объемы торгов опционами на золото

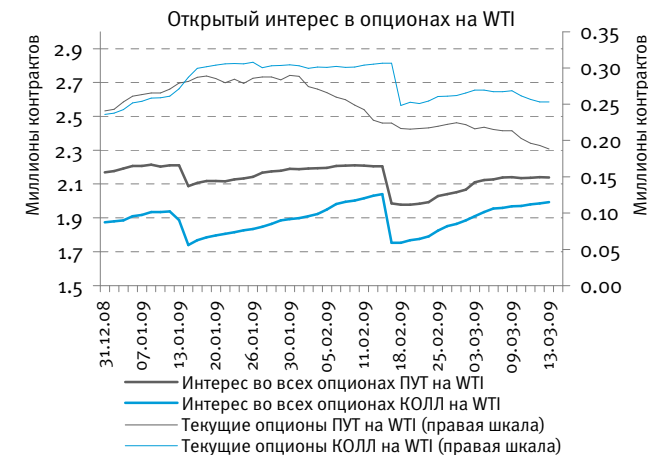
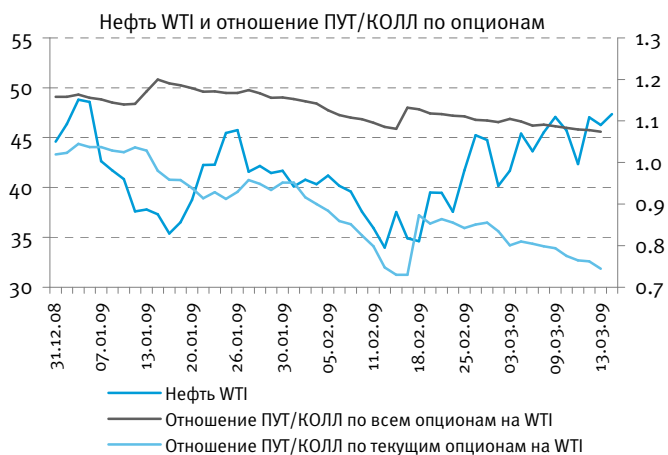
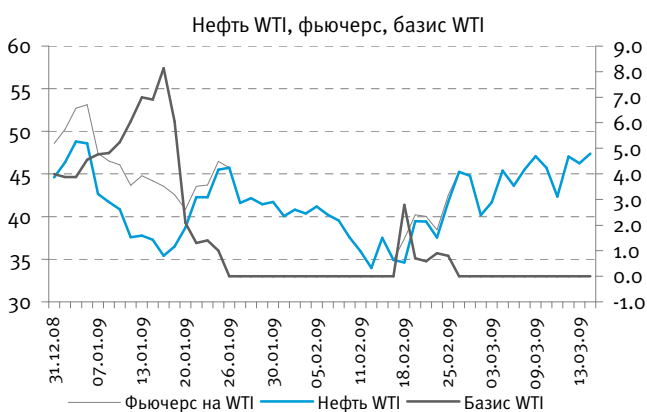


## МЕЖДУНАРОДНЫЕ СРОЧНЫЕ РЫНКИ

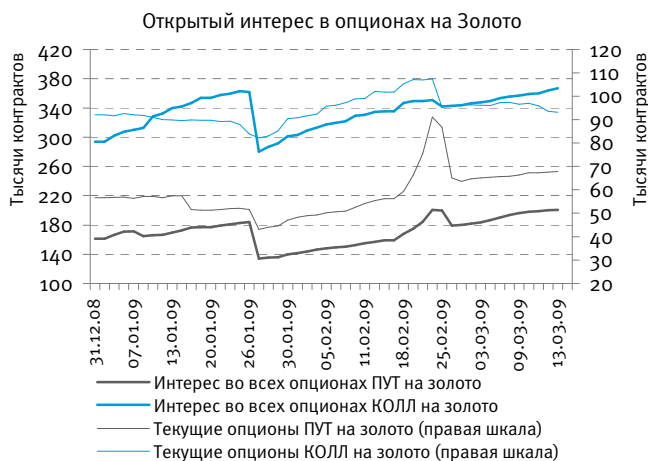
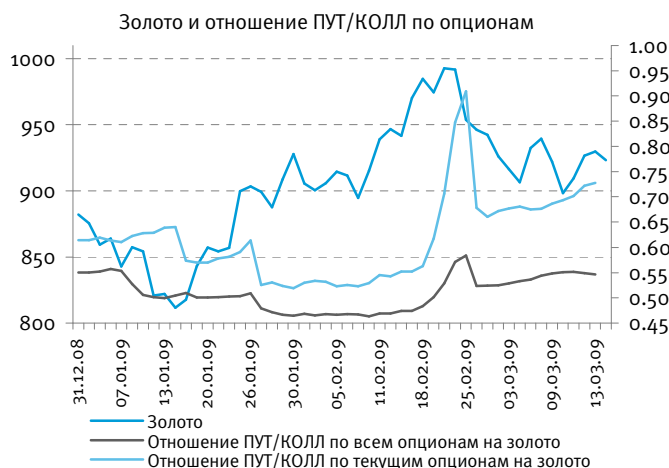
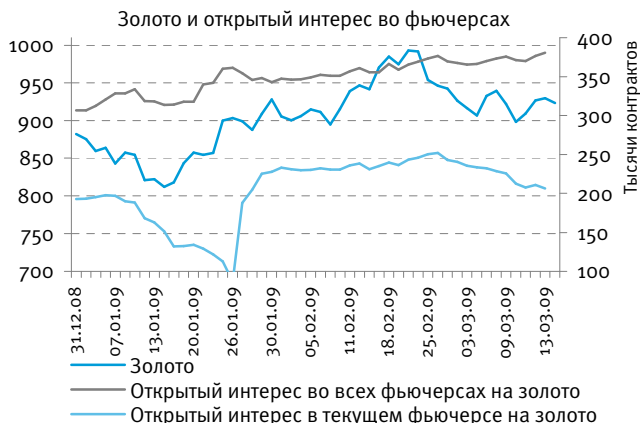
### ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС S&P500



### ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ МАРКИ WTI



## ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



## ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО/ДОЛЛАР

