Наметились небольшие сдвиги в процессе решения госдолга США

После вчерашнего активного обсуждения проблемы госдолга США представителями республиканской и демократической фракции различия в точках зрениях заметно сократились: теперь основной спор заключается в вопросе повышать ли лимит заимствований сейчас, в 2011 году, или сделать это по частям (и в 2011, и в 2012 году.). В течение дня индекс S&P остановился на отметке в 1300,67 пунктов (-0,32%), а DJ Industrial составил к концу торгов 12240,1 пункта (-0,51%).

Европейские рынки.на фоне нынешней неопределенности и разочаровывающих отчетностей компаний Credit Suisse, Volkswagen, BASF в основном ушли в красную зону: CAC40 упал на –0,57, DAX30 на –0,86, FTSE100 же вырос на 0,28%.

Что касается российских рынков, по итогам вечерних торгов в четверг Газпром упал на -0,51%, а Лукойл -0,55%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,02% и 0,00%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ упали на –0,48% и -0,09%.





	Цена фьючерса на 23:50	Цена в ед. баз. актива	% изм. к закр. На 18:45	Кол-во отк.поз. (контр.)	% изм. отк. поз.	Оборот (руб.)	Оборот % к дневному
RTS-9.11	196515	1965,15	-0,55	791 452	110,84%	21 674 126 700	64,29%
ROSN-9.11	23942	239,42	-0,40	43 626	26,12%	8 652 646	4,56%
LKOH-9.11	18581	1858,10	-0,55	113 896	50,49%	34 758 531	3,65%
GAZR-9.11	20212	202,12	-0,51	668 364	63,22%	231 906 048	4,91%
GMKR-9.11	73433	7343,30	-0,60	42 552	166,32%	15 404 142	9,14%
SBRF-9.11	10275	102,75	-0,48	1 038 872	25,69%	332 778 605	12,80%
VTBR-9.11	8545	0,0855	-0,09	313 608	3653,09%	14 998 184	22,44%
GOLD-9.11	1618	1617,8000	0,40	96 598	65,89%	412 576 126	1248,84%
Si-9.11	27749	27,75	0,02	1 294 394	7838,15%	695 810 240	1190,53%
Eu-9.11	39626	39,63	0,00	114 078	-75,61%	3 130 645	0,08%
ED-9.11	1,43	1,43	-0,03	207 032	764,94%	1 701 228 445	9167,07%
SBPR-9.11	8343	83,43	-0,82	131 358	-38,91%	14 851 973	1,25%
RTSS-9.11	11620	11620,00	-0,52	33 698	-33,26%	25 220 900	4,59%
BR-9.11	117	117,04	-0,65	10 804	-67,64%	169 203 003	1811,84%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58708,25	0,72%	00:12:31
CAC 40	3712,66	-0,57%	20:27:17
DAX 30	7190,06	-0,86%	19:35:30
DJ Industrial	12240,11	-0,51%	00:49:49
FTSE 100	5873,21	0,28%	19:43:52
Hang Seng	22472,06	-0,44%	10:17:47
Nikkei 225	9833,03	-0,69%	10:00:04
S&P 500	1300,67	-0,32%	00:04:46
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1613,29	-0,26%	10:17:53
Palladium	823,25	-0,27%	10:16:05
Platinum	1776,5	-0,29%	10:17:05
RTSI	1 981,26	-0,20%	23:50:00
RTS_Standard	11 612,62	-0,24%	23:50:00
RTSI_DEREX	2030.70	0.28%	18:45:00

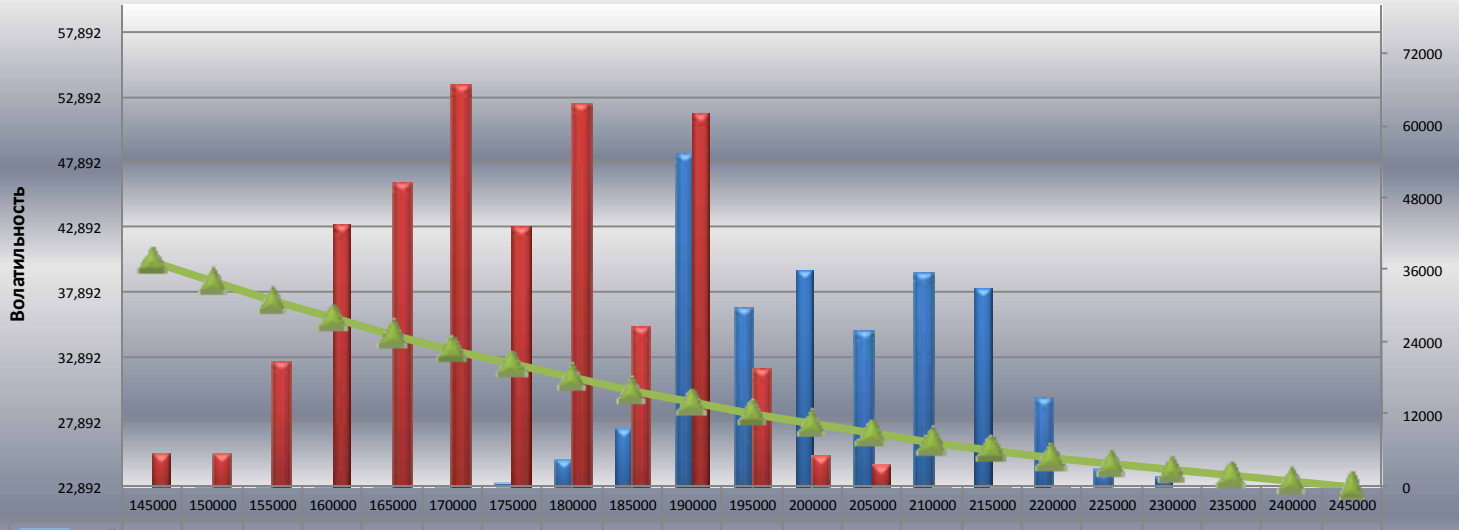
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,55	791452	21674126700,45	196515
ROSN-9.11	-0,4	43626	8652646,00	23942
LKOH-9.11	-0,55	113896	34758531,00	18581
GAZR-9.11	-0,51	668364	231906048,00	20212
GMKR-9.11	-0,6	42552	15404142,00	73433
SBRF-9.11	-0,48	1038872	332778605,00	10275
VTBR-9.11	-0,09	313608	14998184,00	8545
GOLD-9.11	0,4	96598	412576125,79	1617,8
Si-9.11	0,02	1294394	695810240,00	27749
Eu-9.11	0	114078	3130645,00	39626
ED-9.11	-0,03	207032	1701228444,96	1,428
SBPR-9.11	-0,82	131358	14851973,00	8343
RTSS-9.11	-0,52	33698	25220900,00	11620
BR-9.11	-0,65	10 804	169203002,73	117,04

Дневная сессия

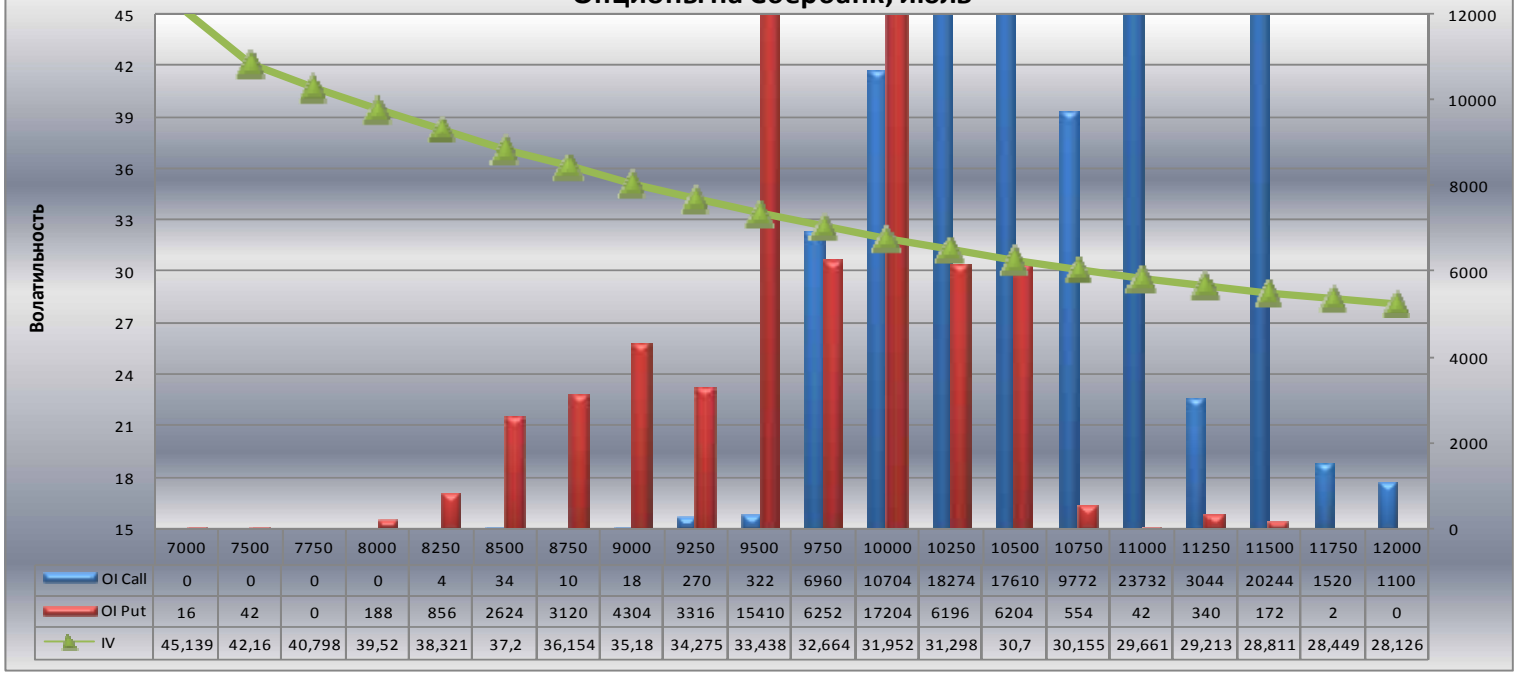
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296	25786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662	4390
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,8	955,2
Si-9.09	0,03	467760	3969232519	31929
Eu-9.09	-0,31	23936	18558032	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585722	1,4317
BR-9.09	1,34	50492	549103769,1	70,64
SBPR-9.09	2,83	33 384	9338717	2866

Опционы на индекс РТС, июль

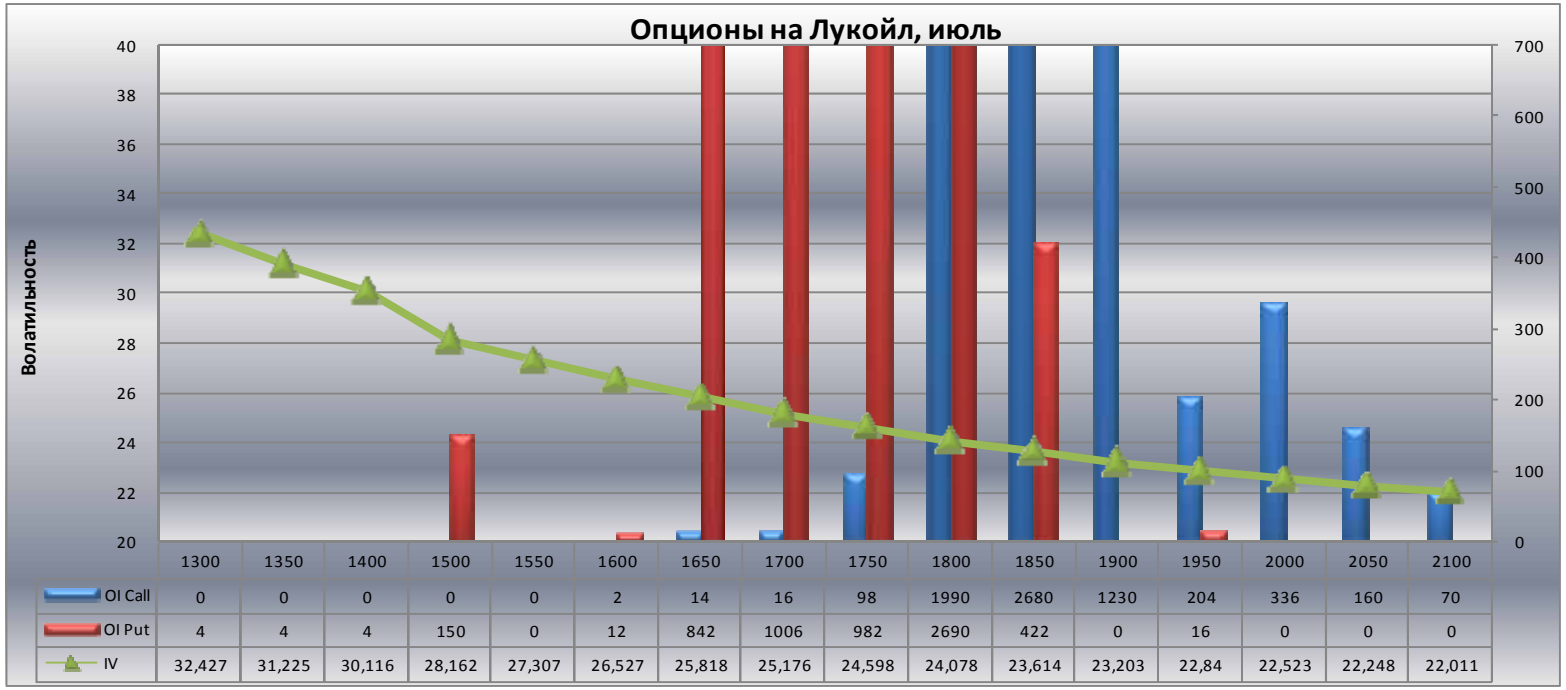


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	0	2	4	6	6	70	502	4546	9502	55314	29736	35844	25756	35368	32968	14552	2738	1496	0	0	0
OI Put	5384	5494	20862	43380	50500	66594	42958	63608	26312	61790	19430	5014	3346	112	6	110	0	0	0	0	0
IV	40,212	38,679	37,236	35,879	34,605	33,411	32,293	31,248	30,273	29,365	28,52	27,735	27,008	26,336	25,716	25,146	24,622	24,144	23,708	23,312	22,954

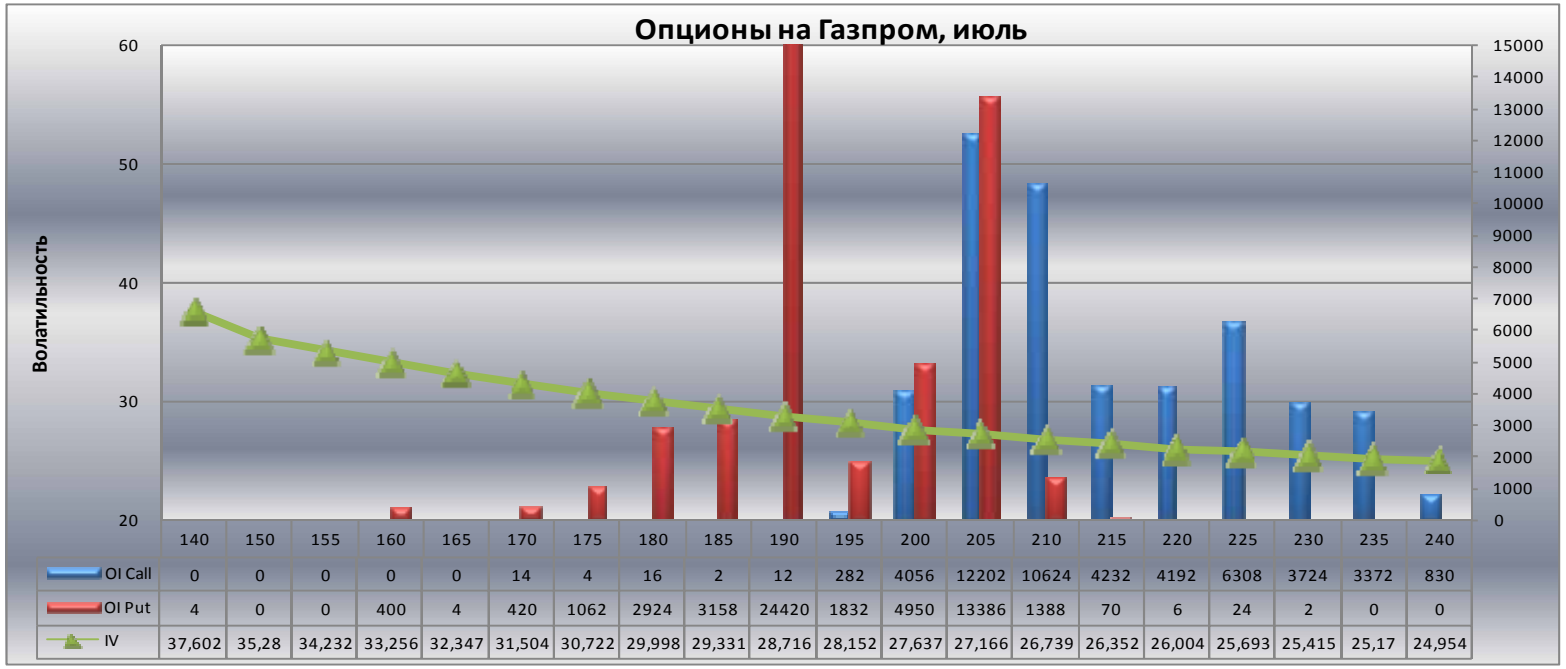
Опционы на Сбербанк, июль



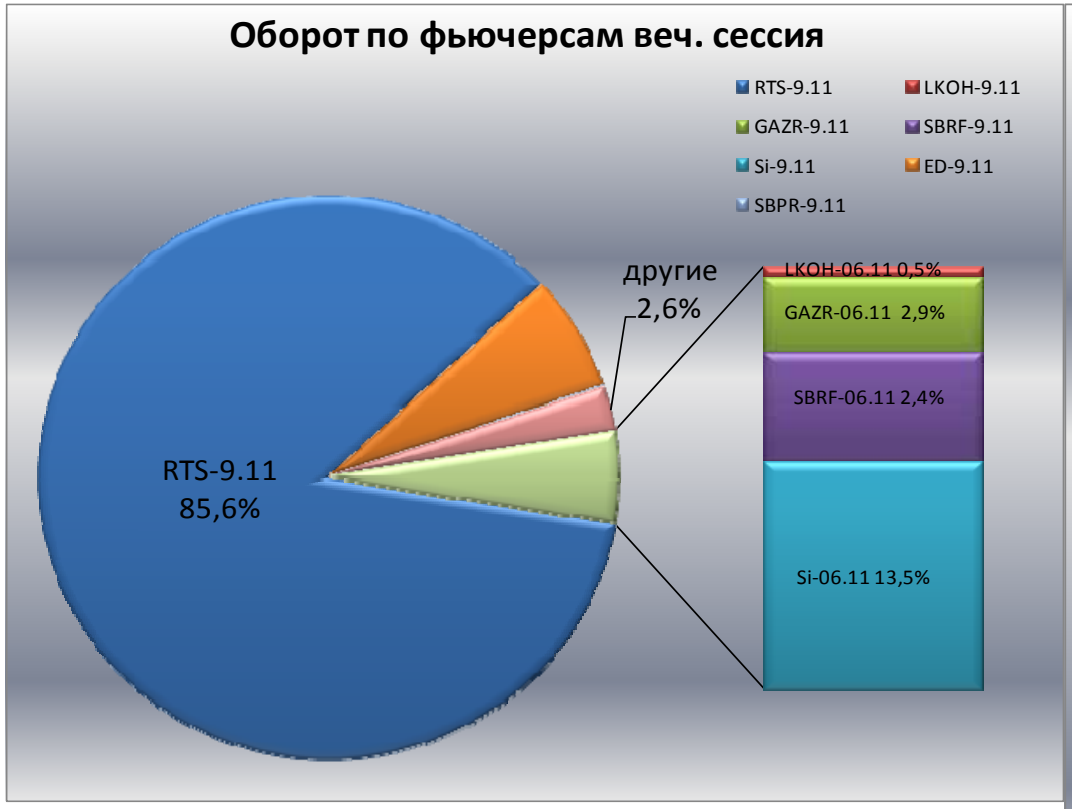
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	4	34	10	18	270	322	6960	10704	18274	17610	9772	23732	3044	20244	1520	1100
OI Put	16	42	0	188	856	2624	3120	4304	3316	15410	6252	17204	6196	6204	554	42	340	172	2	0
IV	45,139	42,16	40,798	39,52	38,321	37,2	36,154	35,18	34,275	33,438	32,664	31,952	31,298	30,7	30,155	29,661	29,213	28,811	28,449	28,126

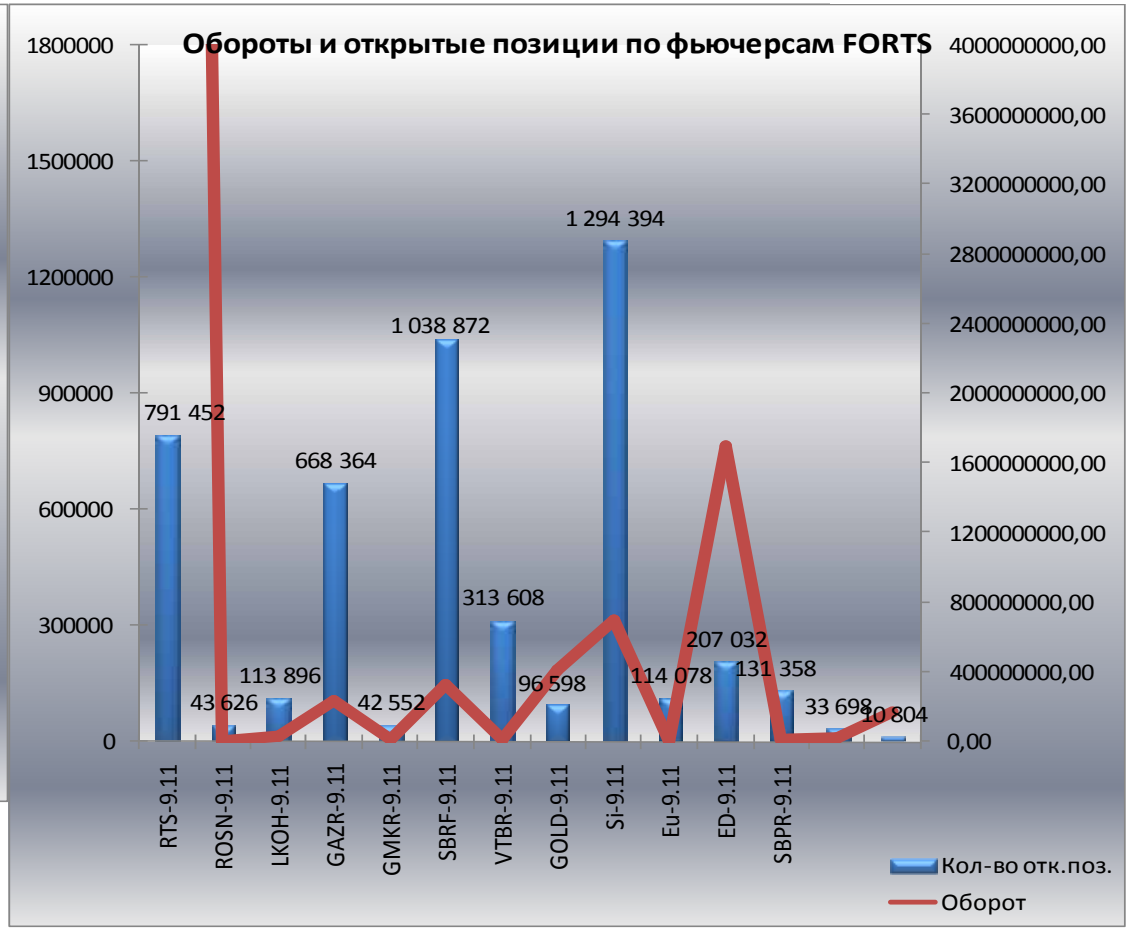


	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	2	14	16	98	1990	2680	1230	204	336	160	70
OI Put	4	4	4	150	0	12	842	1006	982	2690	422	0	16	0	0	0
IV	32,427	31,225	30,116	28,162	27,307	26,527	25,818	25,176	24,598	24,078	23,614	23,203	22,84	22,523	22,248	22,011



	140	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240
OI Call	0	0	0	0	0	14	4	16	2	12	282	4056	12202	10624	4232	4192	6308	3724	3372	830
OI Put	4	0	0	400	4	420	1062	2924	3158	24420	1832	4950	13386	1388	70	6	24	2	0	0
IV	37,602	35,28	34,232	33,256	32,347	31,504	30,722	29,998	29,331	28,716	28,152	27,637	27,166	26,739	26,352	26,004	25,693	25,415	25,17	24,954


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
SBRF-9.11
Si-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11
RTS-9.11
85,6%
другие
2,6%
LKOH-06.11 0,5%
GAZR-06.11 2,9%
SBRF-06.11 2,4%
Si-06.11 13,5%


Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
1800000
1500000
1200000
900000
600000
300000
0
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
791 452
43 626
113 896
668 364
42 552
1 038 872
313 608
96 598
1 294 394
114 078
207 032
131 358
33 698
10 804
RTS-9.11
ROSN-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
GMKR-9.11
SBRF-9.11
VTBR-9.11
GOLD-9.11
Si-9.11
Eu-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11
Кол-во отк.поз.
Оборот