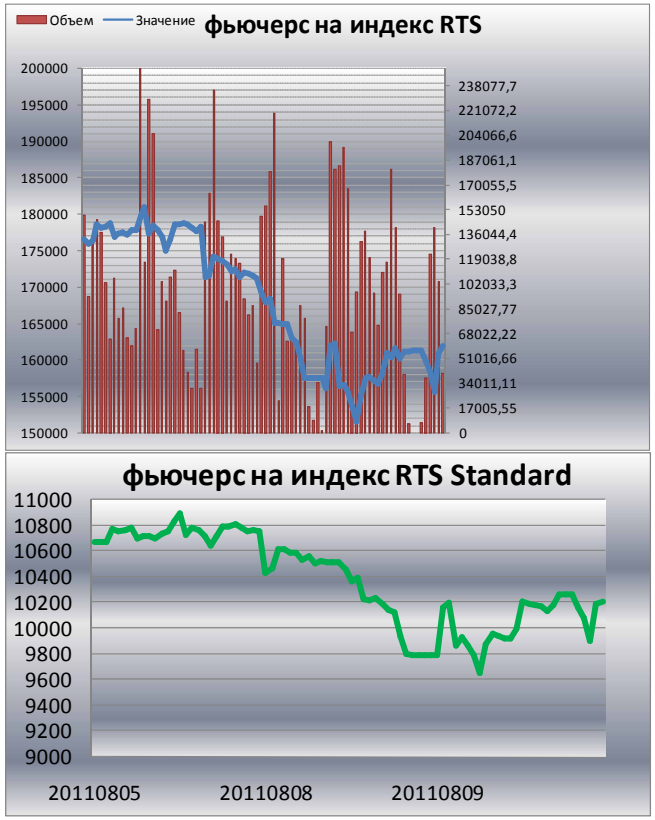
Мировые рынки в ближайшее время могут немного подрасти

Вторник 9 августа можно обозначить как день “ожиданий»: если еще с утра продолжалось около-паническое настроение 8 августа, то уже днем рынки даже начали коррекцию и медленно поползли вверх, к середине торгов основные индексы прибавляли порядка 2% на фоне предвкушения результатов заседания ФРС. Позднее энтузиазм поубавился. Комментарий ФРС был следующим: в этом году экономический рост оказался слабее ожидаемого, как и показатели занятости, потребительский спрос несколько уменьшился, рынок жилья находится в депрессивном состоянии. Однако было обещано сохранить минимальную % ставку до середины 2013г. при условии приемлемого уровня инфляции.

По итогам торгов DJ прибавил +3,98%, S&P500 +4,74%, CAC40 +1,63%, DAX30 –0,1%, FTSE100 +1,89%, Hang Seng +3,1%, Nikkei225 +1,06%.

На российских рынках Газпром изменился на –0,16%, а Лукойл +0,24%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,07% и +0,05%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ изменились на –0,11% и –0,47%.



	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	190000	1900,00	-0,16	790 284	110,53%	17 212 537 769	51,06%
ROSN-9.11	23813	238,13	0,41	47 738	38,01%	8 373 779	4,41%
LKOH-9.11	18200	1820,00	0,24	116 272	53,63%	33 594 173	3,53%
GAZR-9.11	20297	202,97	-0,16	542 344	32,45%	183 803 044	3,89%
GMKR-9.11	75630	7563,00	-0,01	35 252	120,63%	28 957 046	17,19%
SBRF-9.11	10312	103,12	-0,11	715 700	-13,41%	342 269 694	13,17%
VTBR-9.11	8313	0,0831	-0,47	272 308	3158,83%	15 452 641	23,12%
GOLD-9.11	1557	1556,8000	0,15	73 250	25,79%	444 787 564	1346,35%
Si-9.11	28438	28,44	0,07	1 348 338	8168,97%	945 300 825	1617,41%
Eu-9.11	39785	39,79	0,05	118 800	-74,60%	21 756 700	0,55%
ED-9.11	1,40	1,40	0,01	176 730	638,34%	2 695 759 709	14526,11%
SBPR-9.11	8003	80,03	0,09	127 824	-40,56%	6 583 876	0,55%
RTSS-9.11	11560	11560,00	-0,02	19 248	-61,88%	12 478 830	2,27%
BR-7.11	117	116,81	0,85	112 852	238,04%	2 010 473 038	21528,36%

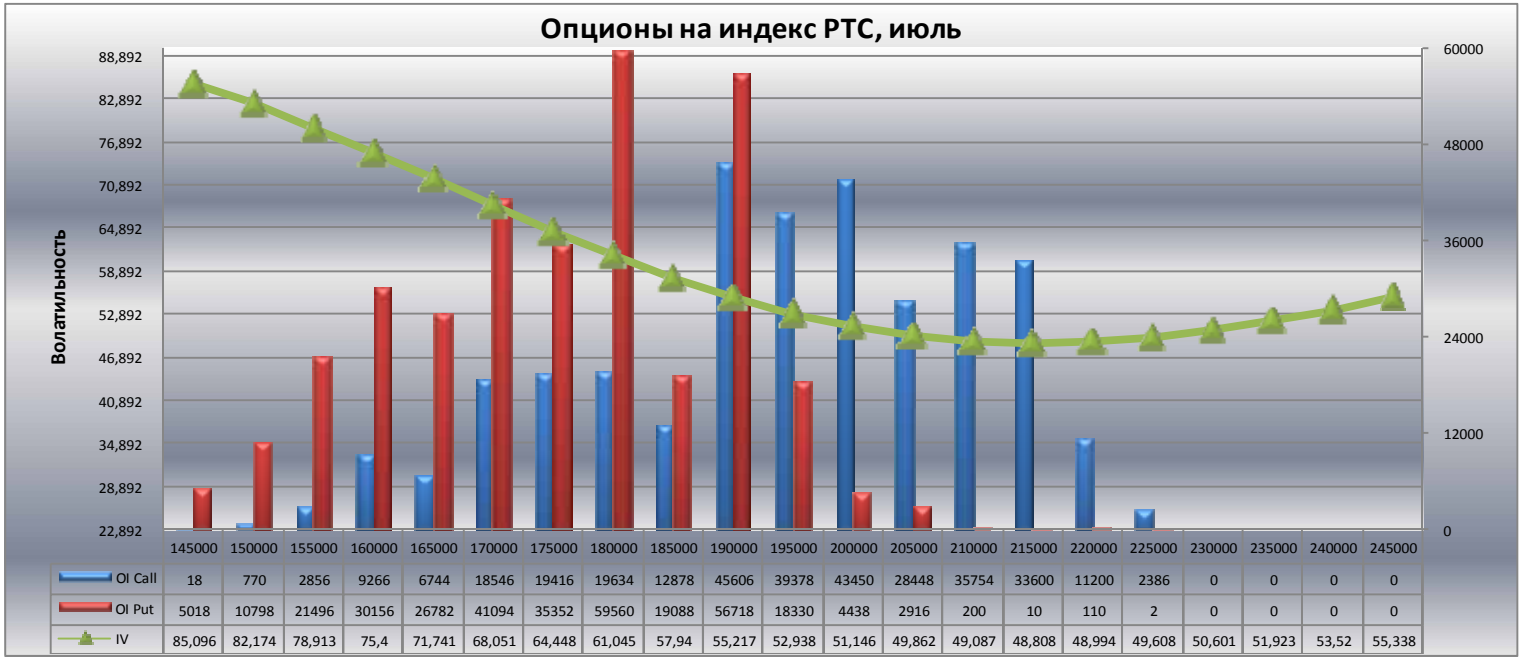
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	51150,9	5,10%	00:55:30
CAC 40	3176,19	1,63%	19:35:18
DAX 30	5917,08	-0,10%	19:35:32
DJ Industrial	11239,77	3,98%	00:35:52
FTSE 100	5164,92	1,89%	19:35:32
Hang Seng	19929,04	3,10%	10:04:46
Nikkei 225	9038,74	1,05%	10:00:05
S&P 500	1172,53	4,74%	00:05:59
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1744,04	0,04%	10:04:59
Palladium	743,75	1,27%	10:03:18
Platinum	1750,75	0,12%	10:03:42
RTSI	1 605,41	-0,30%	23:50:00
RTS_Standard	10 137,90	0,07%	23:50:00
RTSI_DEREX	1642.32	-2.43%	18:45:00

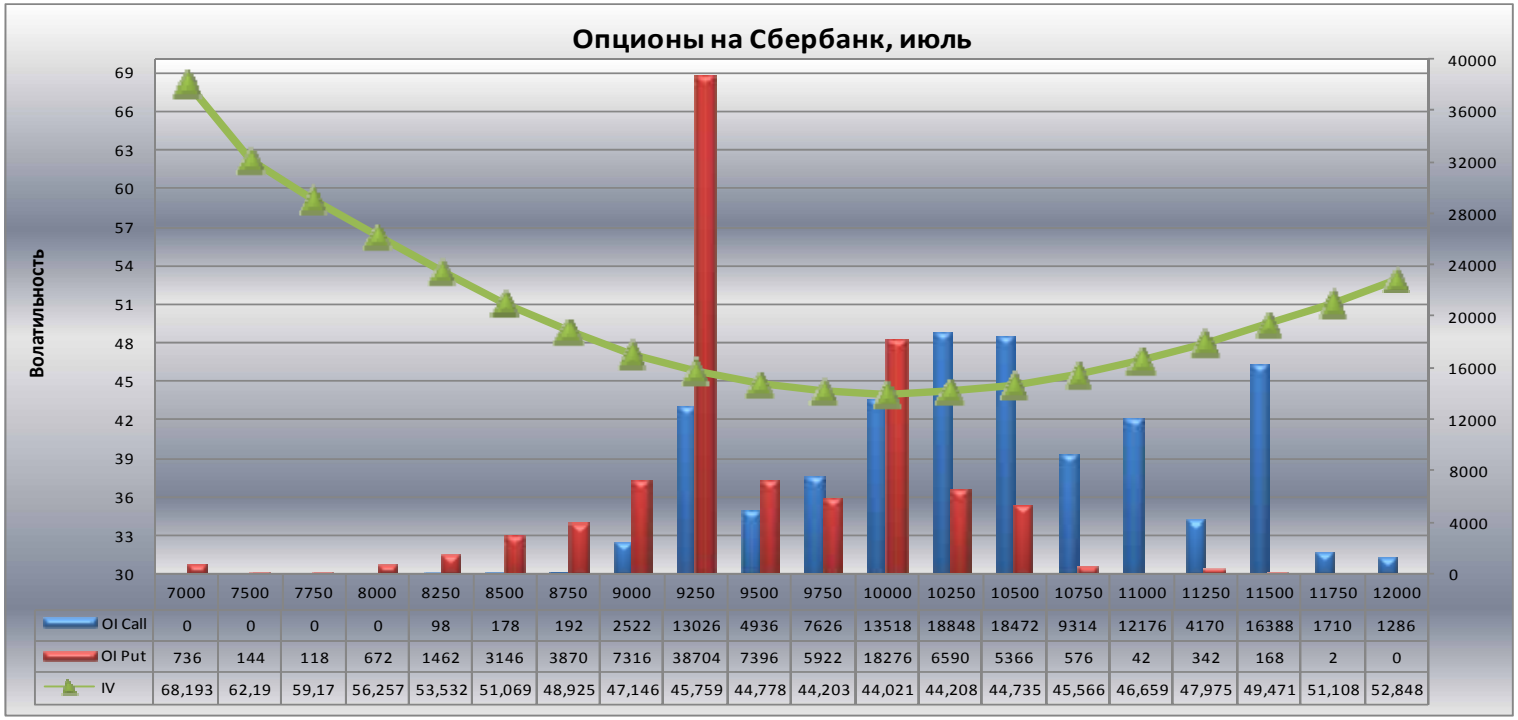
Вечерняя сессия

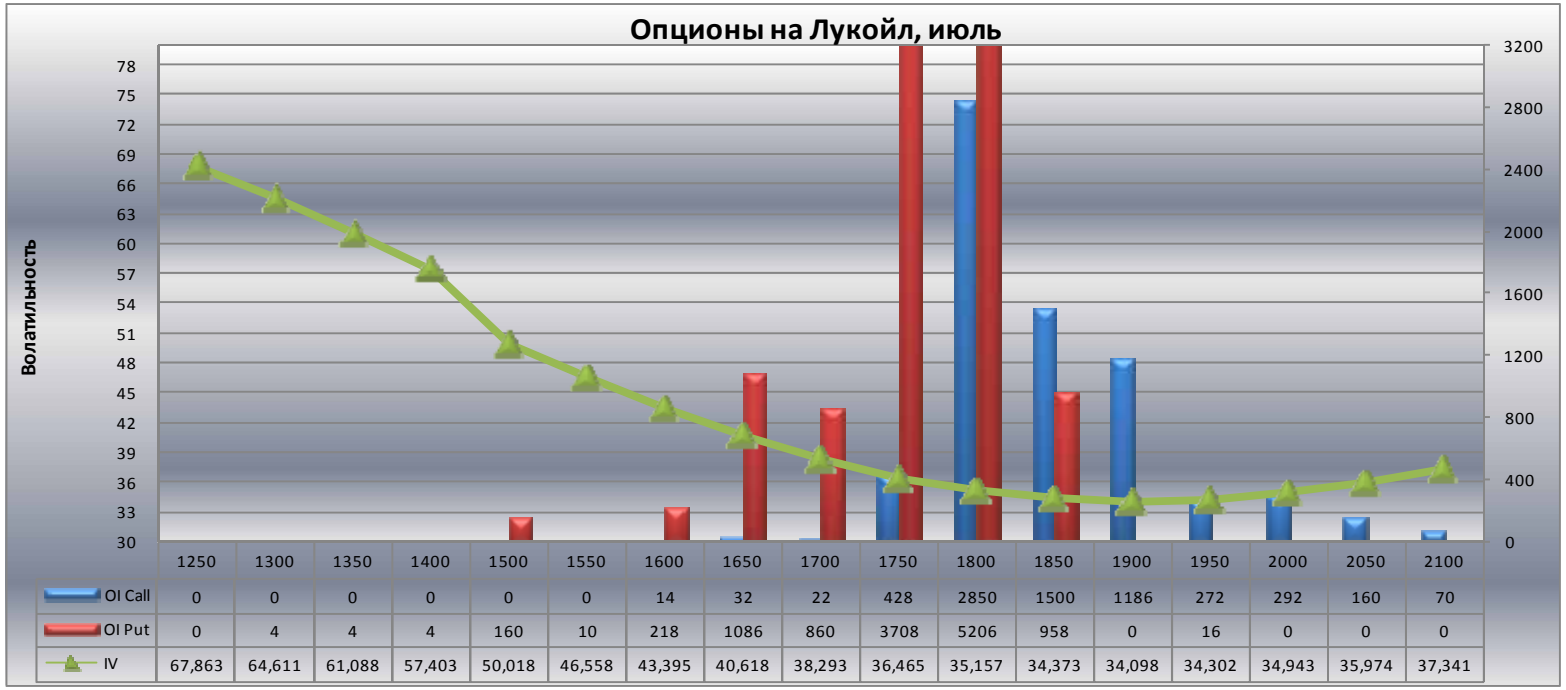
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,16	790284	17212537769,48	190000
ROSN-9.11	0,41	47738	8373779,00	23813
LKOH-9.11	0,24	116272	33594173,00	18200
GAZR-9.11	-0,16	542344	183803044,00	20297
GMKR-9.11	-0,01	35252	28957046,00	75630
SBRF-9.11	-0,11	715700	342269694,00	10312
VTBR-9.11	-0,47	272308	15452641,00	8313
GOLD-9.11	0,15	73250	444787563,76	1556,8
Si-9.11	0,07	1348338	945300825,00	28438
Eu-9.11	0,05	118800	21756700,00	39785
ED-9.11	0,01	176730	2695759708,61	1,399
SBPR-9.11	0,09	127824	6583876,00	8003
RTSS-9.11	-0,02	19248	12478830,00	11560
BR-7.11	0,85	112852	2010473038,21	116,81

Дневная сессия

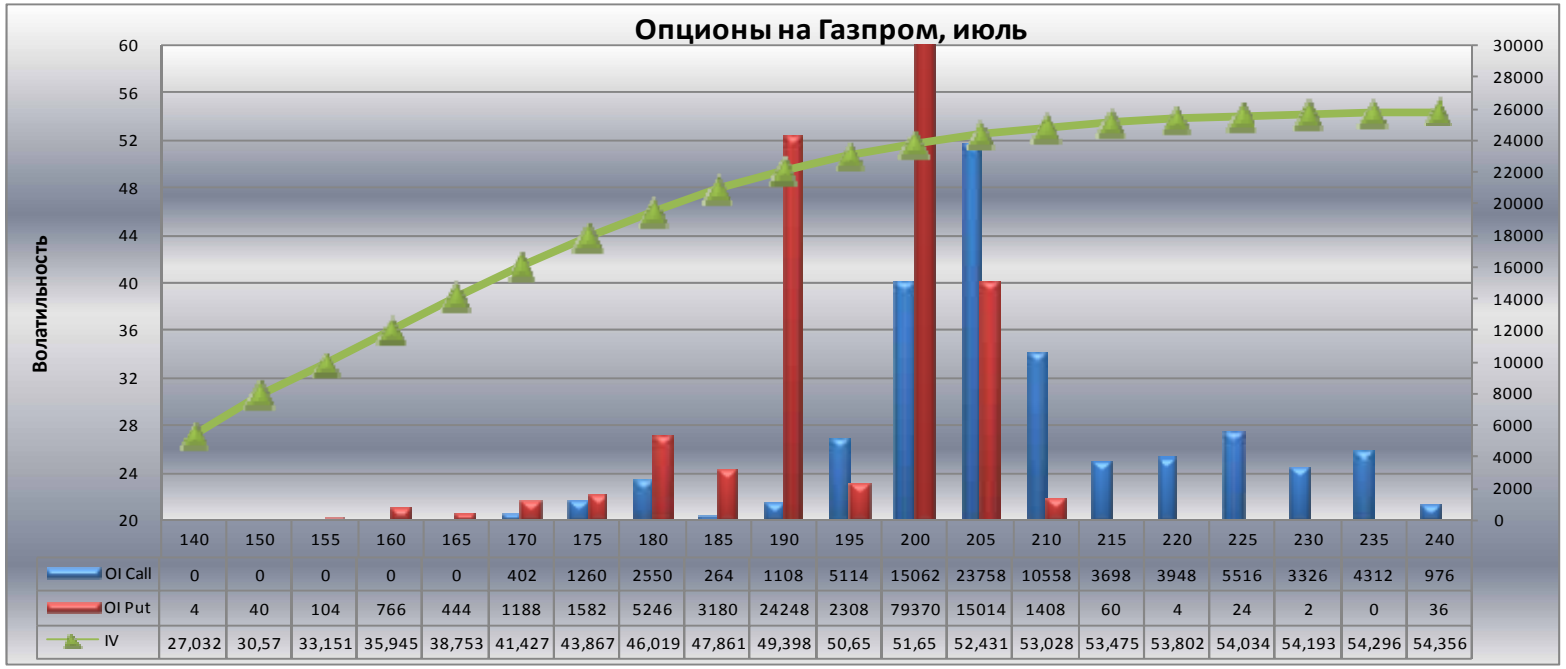
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752,00	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759,00	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903,00	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290,00	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309,00	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513,00	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296,00	25786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662,00	4390
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,80	955,2
Si-9.09	0,03	467760	3969232519,00	31929
Eu-9.09	-0,31	23936	18558032,00	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585721,79	1,4317
BR-9.09	1,34	50492	549103769,14	70,64
SBPR-9.09	2,83	33384	9338717,00	2866


Опционы на индекс РТС, июль
Волатильность
88,892
82,892
76,892
70,892
64,892
58,892
52,892
46,892
40,892
34,892
28,892
22,892
60000
48000
36000
24000
12000
0
145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000
OI Call 18 770 2856 9266 6744 18546 19416 19634 12878 45606 39378 43450 28448 35754 33600 11200 2386 0 0 0 0
OI Put 5018 10798 21496 30156 26782 41094 35352 59560 19088 56718 18330 4438 2916 200 10 110 2 0 0 0 0
IV 85,096 82,174 78,913 75,4 71,741 68,051 64,448 61,045 57,94 55,217 52,938 51,146 49,862 49,087 48,808 48,994 49,608 50,601 51,923 53,52 55,338

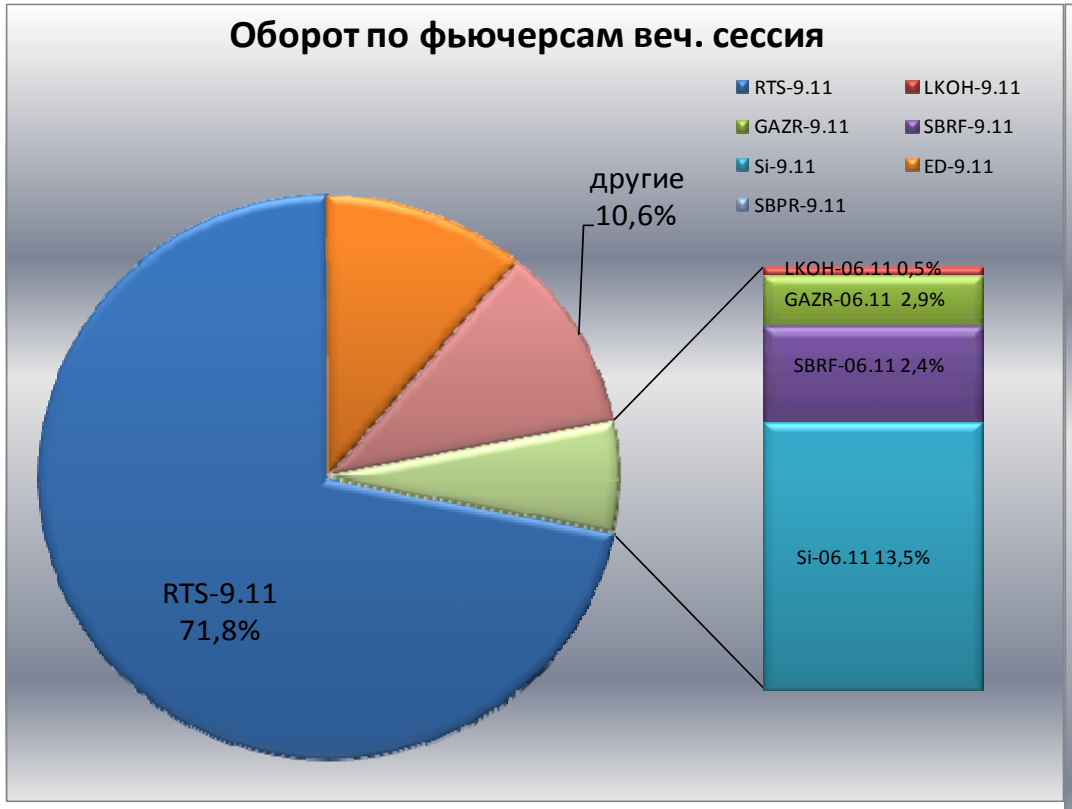

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
69
66
63
60
57
54
51
48
45
42
39
36
33
30
40000
36000
32000
28000
24000
20000
16000
12000
8000
4000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 98 178 192 2522 13026 4936 7626 13518 18848 18472 9314 12176 4170 16388 1710 1286
OI Put 736 144 118 672 1462 3146 3870 7316 38704 7396 5922 18276 6590 5366 576 42 342 168 2 0
IV 68,193 62,19 59,17 56,257 53,532 51,069 48,925 47,146 45,759 44,778 44,203 44,021 44,208 44,735 45,566 46,659 47,975 49,471 51,108 52,848

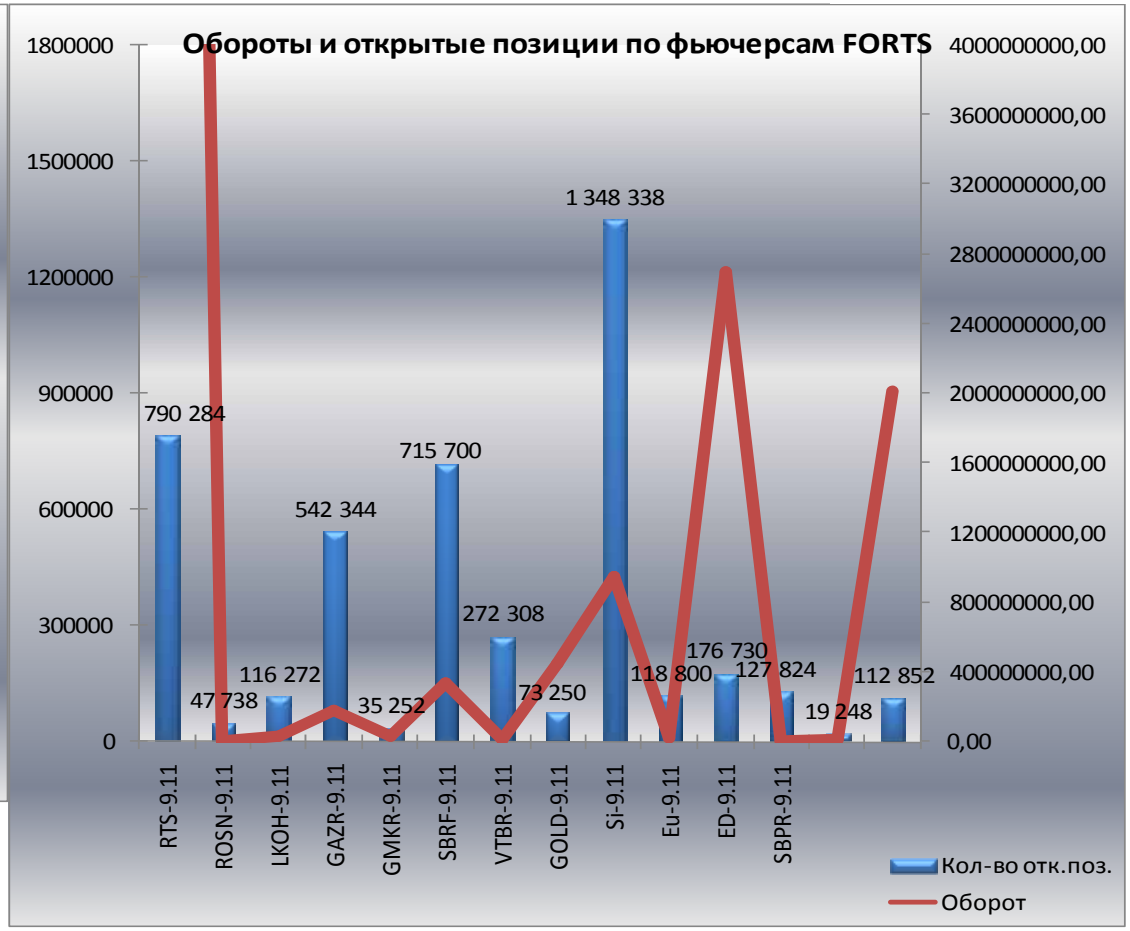


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	14	32	22	428	2850	1500	1186	272	292	160	70
OI Put	0	4	4	4	160	10	218	1086	860	3708	5206	958	0	16	0	0	0
IV	67,863	64,611	61,088	57,403	50,018	46,558	43,395	40,618	38,293	36,465	35,157	34,373	34,098	34,302	34,943	35,974	37,341



	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	402	1260	2550	264	1108	5114	15062	23758	10558	3698	3948	5516	3326	4312	976
OI Put	4	40	104	766	444	1188	1582	5246	3180	24248	2308	79370	15014	1408	60	4	24	2	0	36
IV	27,032	30,57	33,151	35,945	38,753	41,427	43,867	46,019	47,861	49,398	50,65	51,65	52,431	53,028	53,475	53,802	54,034	54,193	54,296	54,356


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
другие
10,6%
RTS-9.11
71,8%
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
790 284
47 738
116 272
542 344
35 252
715 700
272 308
73 250
1 348 338
118 800
176 730
127 824
19 248
112 852
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