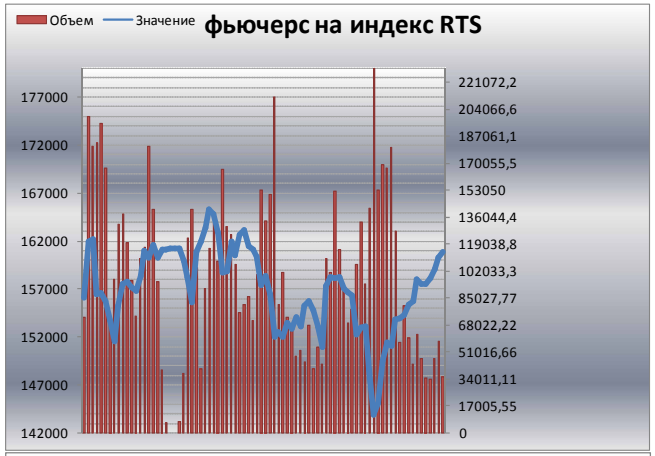
Четверг: коррекция на рынках после падения в среду

В четверг можно отметить некоторую коррекцию на рынках: почти все индексы без исключения пошли в плюс. Конечно, неопределенность на рынках все еще наблюдается, но на данный момент инвесторы склоняются все-таки к более оптимистичной модели развития событий. Итак, CAC40 вырос на +2,89%, DAX30 на +3,28%, FTSE100 на 3,11%, S&P500 на 4,63%, Nikkei 225 на –0,2%, Hang Seng на +0,81%.

По итогам торгов Индекс РТС наконец закрылся в плюсе, прибавив 4,46%. Газпром изменился на +2,56%, Лукойл на +2,33%, Роснефть прибавила +4,81%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,73% и -0,7%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на +3,36% и +3,43%.





	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	160830	1608,30	4,46	937 874	149,85%	46 695 285 536	138,51%
ROSN-9.11	20368	203,68	4,81	55 898	61,60%	65 186 500	34,32%
LKOH-9.11	16570	1657,00	2,33	90 842	20,03%	192 724 716	20,23%
GAZR-9.11	16963	169,63	2,56	601 632	46,93%	656 673 469	13,91%
GMKR-9.11	67635	6763,50	4,98	39 570	147,65%	55 450 701	32,92%
SBRF-9.11	8702	87,02	3,36	1 016 594	22,99%	977 026 775	37,59%
VTBR-9.11	7205	0,0721	3,43	230 232	2655,29%	30 396 664	45,48%
GOLD-9.11	1752	1752,2000	-0,47	103 410	77,59%	487 584 007	1475,89%
Si-9.11	29376	29,38	-0,73	1 471 740	8925,76%	1 701 718 715	2911,64%
Eu-9.11	41838	41,84	-0,70	126 052	-73,05%	23 607 884	0,59%
ED-9.11	1,42	1,42	-0,08	262 332	995,97%	2 408 294 628	12977,10%
SBPR-9.11	7269	72,69	2,76	115 352	-46,36%	4 154 711	0,35%
RTSS-9.11	10052	10051,50	3,49	30 222	-40,14%	31 821 215	5,80%
BR-7.11	108	107,59	1,14	21 658	-35,12%	40 408 246	432,70%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	53343,11	3,79%	02:34:50
CAC 40	3089,66	2,89%	20:41:02
DAX 30	5797,66	3,28%	19:35:32
DJ Industrial	11143,31	3,95%	00:35:53
FTSE 100	5162,83	3,11%	19:35:32
Hang Seng	19754,78	0,81%	10:32:16
Nikkei 225	8963,72	-0,20%	10:00:03
S&P 500	1172,64	4,63%	00:09:14
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1755,25	-0,59%	10:32:26
Palladium	745	0,86%	10:26:55
Platinum	1792	0,56%	10:31:26
RTSI	1 576,47	2,05%	23:50:00
RTS_Standard	9 940,18	2,61%	23:50:00
RTSI_DEREX	1575.58	0.72%	18:45:00

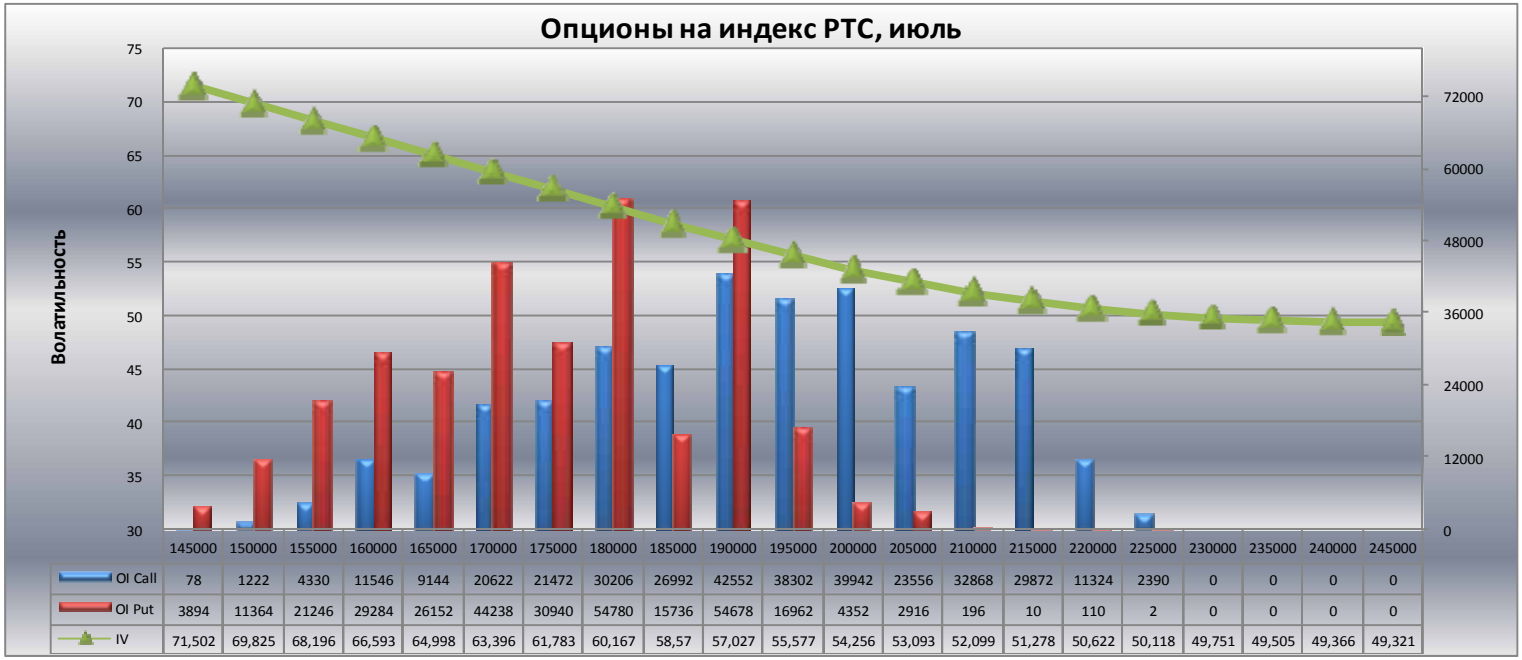
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	4,46	937874	46695285535,81	160830
ROSN-9.11	4,81	55898	65186500,00	20368
LKOH-9.11	2,33	90842	192724716,00	16570
GAZR-9.11	2,56	601632	656673469,00	16963
GMKR-9.11	4,98	39570	55450701,00	67635
SBRF-9.11	3,36	1016594	977026775,00	8702
VTBR-9.11	3,43	230232	30396664,00	7205
GOLD-9.11	-0,47	103410	487584006,68	1752,2
Si-9.11	-0,73	1471740	1701718715,00	29376
Eu-9.11	-0,7	126052	23607884,00	41838
ED-9.11	-0,08	262332	2408294627,87	1,4222
SBPR-9.11	2,76	115352	4154711,00	7269
RTSS-9.11	3,49	30222	31821215,00	10051,5
BR-7.11	1,14	21 658	40408246,23	107,59

Дневная сессия

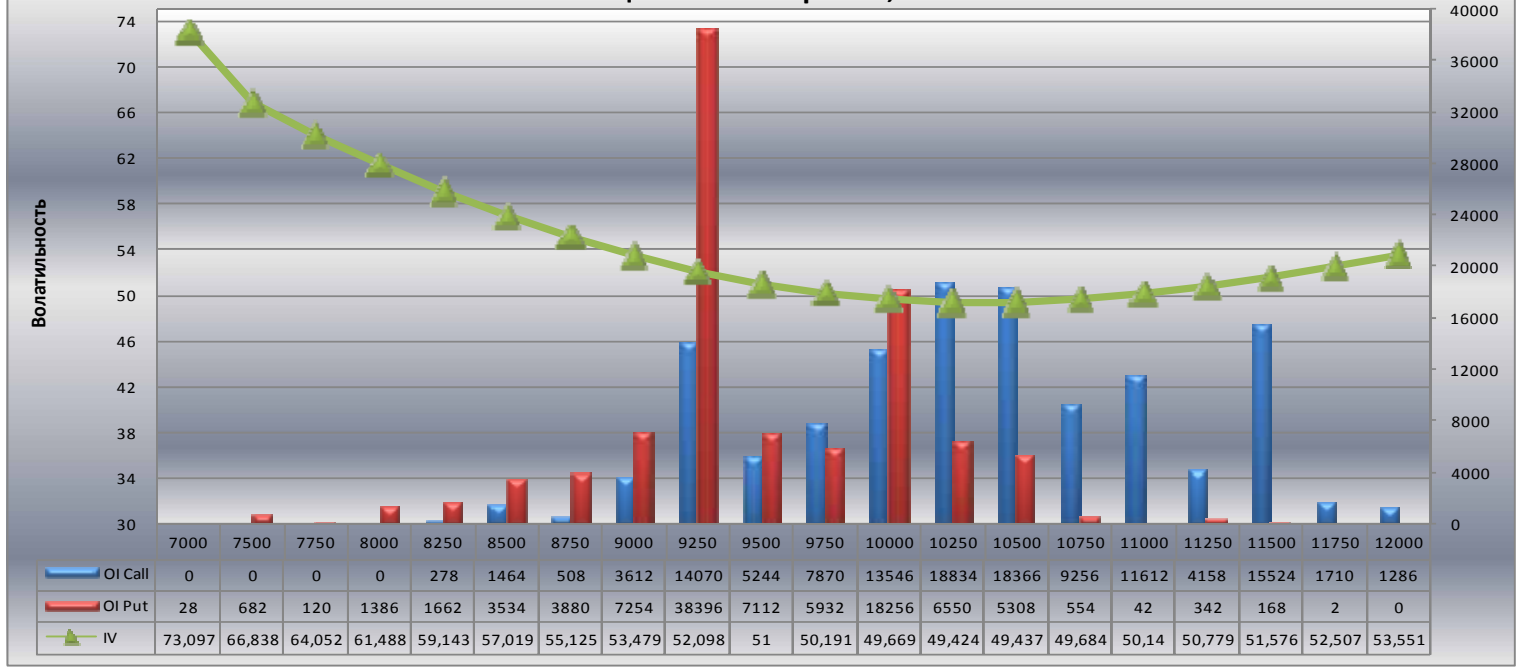
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375 378	33712923752,00	106 500
ROSN-9.09	1,45	34 590	189 953 759	20 140
LKOH-9.09	1,18	75 684	952 454 903	16 002
GAZR-9.09	0,25	409 478	4 720 165 290	16 427
GMKR-9.09	1,1	15 978	168466309,00	34 223
SBRF-9.09	3,72	826 566	2 599 351 513	4 923
SNGR-9.09	-0,94	8 356	66 832 296	25 786
VTBR-9.09	1,12	58 230	33036662,00	4 390,00
GOLD-9.09	0,6	16 306	58 445 323	955
Si-9.09	0,03	467 760	3 969 232 519	31 929
Eu-9.09	-0,31	23 936	18 558 032	45660
ED-9.09	-0,17	215 036	1 186 585 722	1
BR-9.09	1,34	50 492	549 103 769	70,64
SBPR-9.09	2,83	33 384	9 338 717	2866

Опционы на индекс РТС, июль

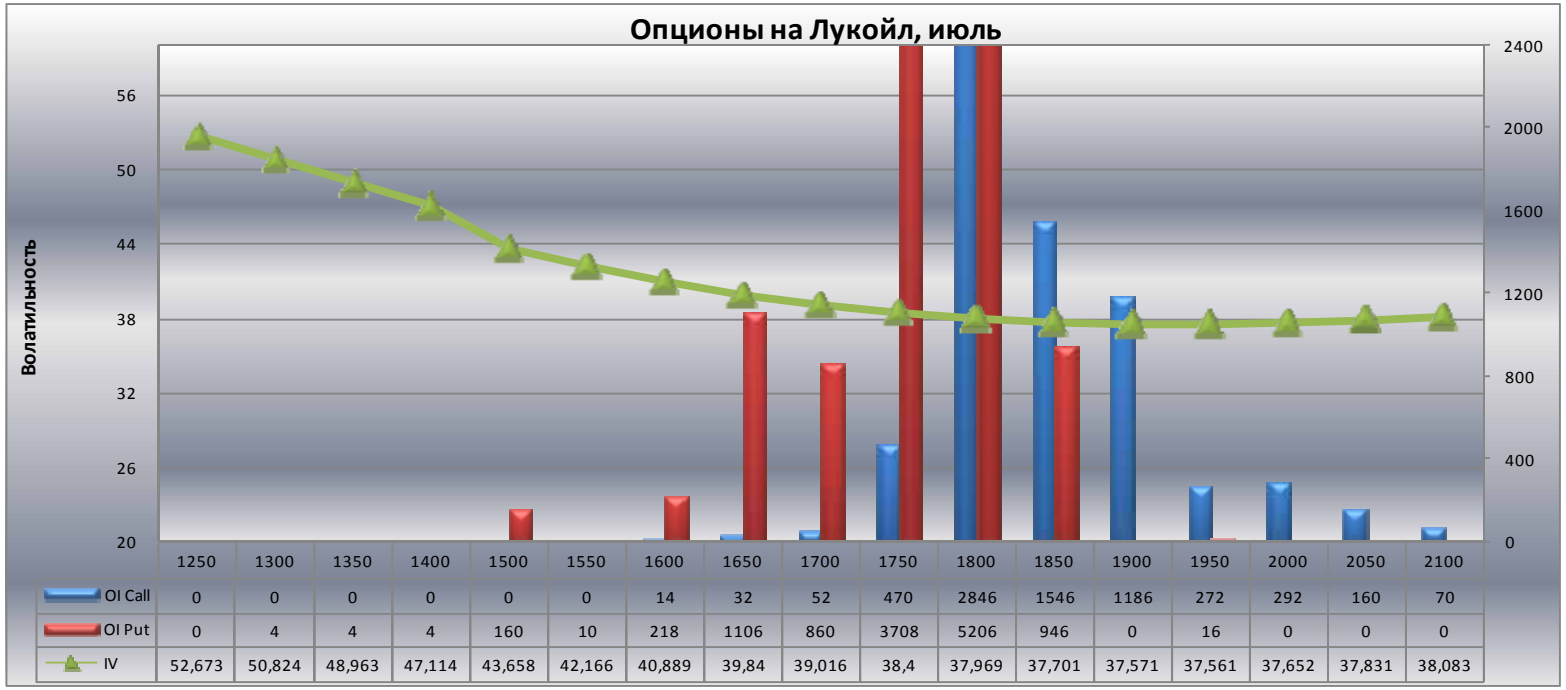


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	78	1222	4330	11546	9144	20622	21472	30206	26992	42552	38302	39942	23556	32868	29872	11324	2390	0	0	0	0
OI Put	3894	11364	21246	29284	26152	44238	30940	54780	15736	54678	16962	4352	2916	196	10	110	2	0	0	0	0
IV	71,502	69,825	68,196	66,593	64,998	63,396	61,783	60,167	58,57	57,027	55,577	54,256	53,093	52,099	51,278	50,622	50,118	49,751	49,505	49,366	49,321

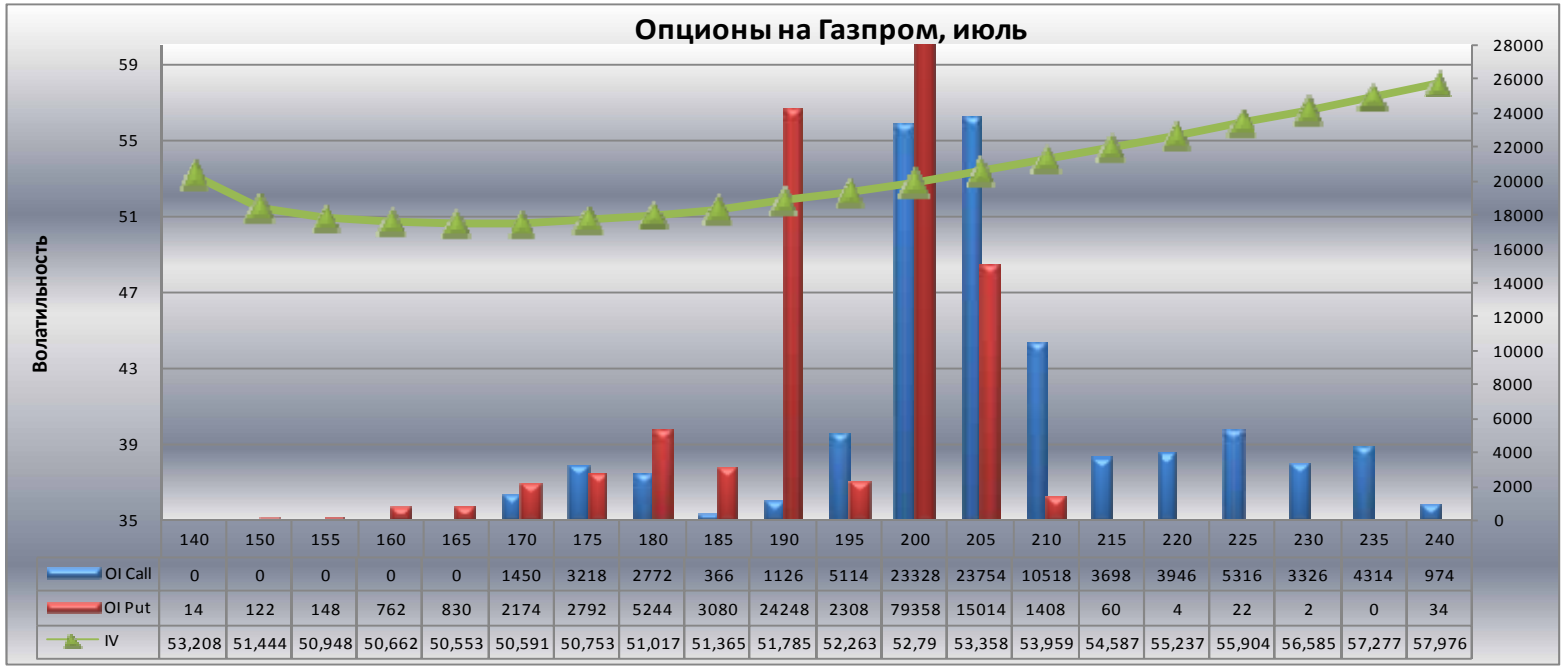
Опционы на Сбербанк, июль



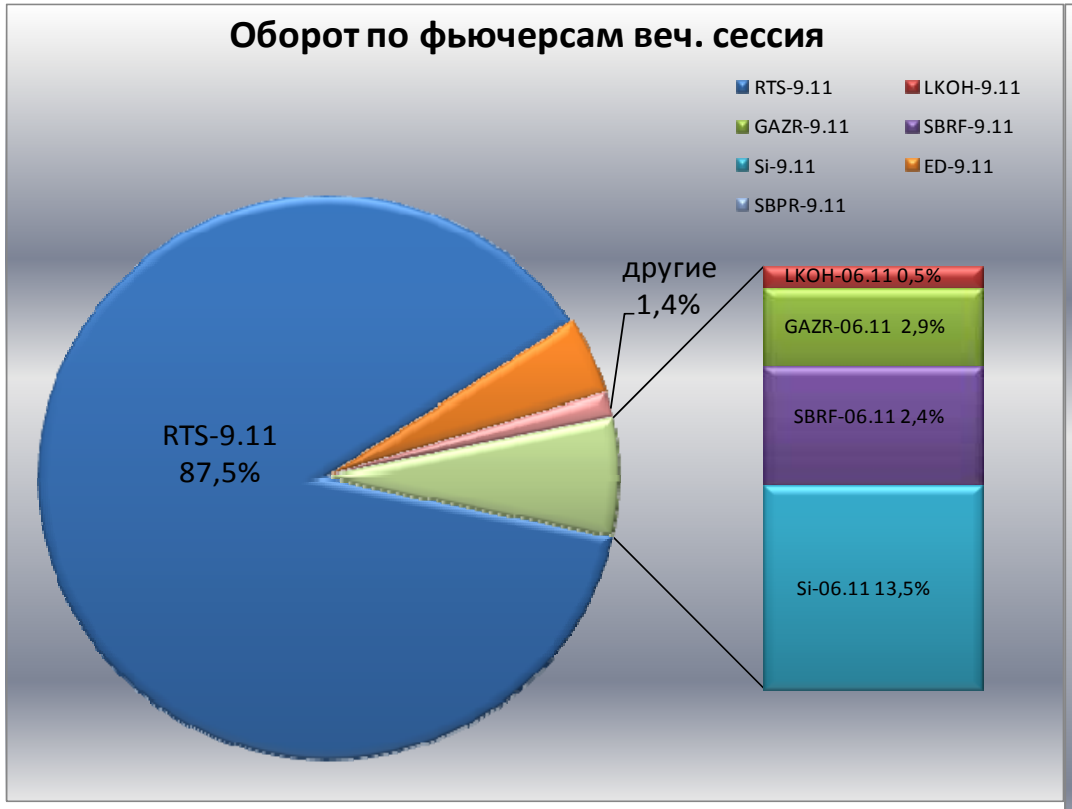
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	278	1464	508	3612	14070	5244	7870	13546	18834	18366	9256	11612	4158	15524	1710	1286
OI Put	28	682	120	1386	1662	3534	3880	7254	38396	7112	5932	18256	6550	5308	554	42	342	168	2	0
IV	73,097	66,838	64,052	61,488	59,143	57,019	55,125	53,479	52,098	51	50,191	49,669	49,424	49,437	49,684	50,14	50,779	51,576	52,507	53,551

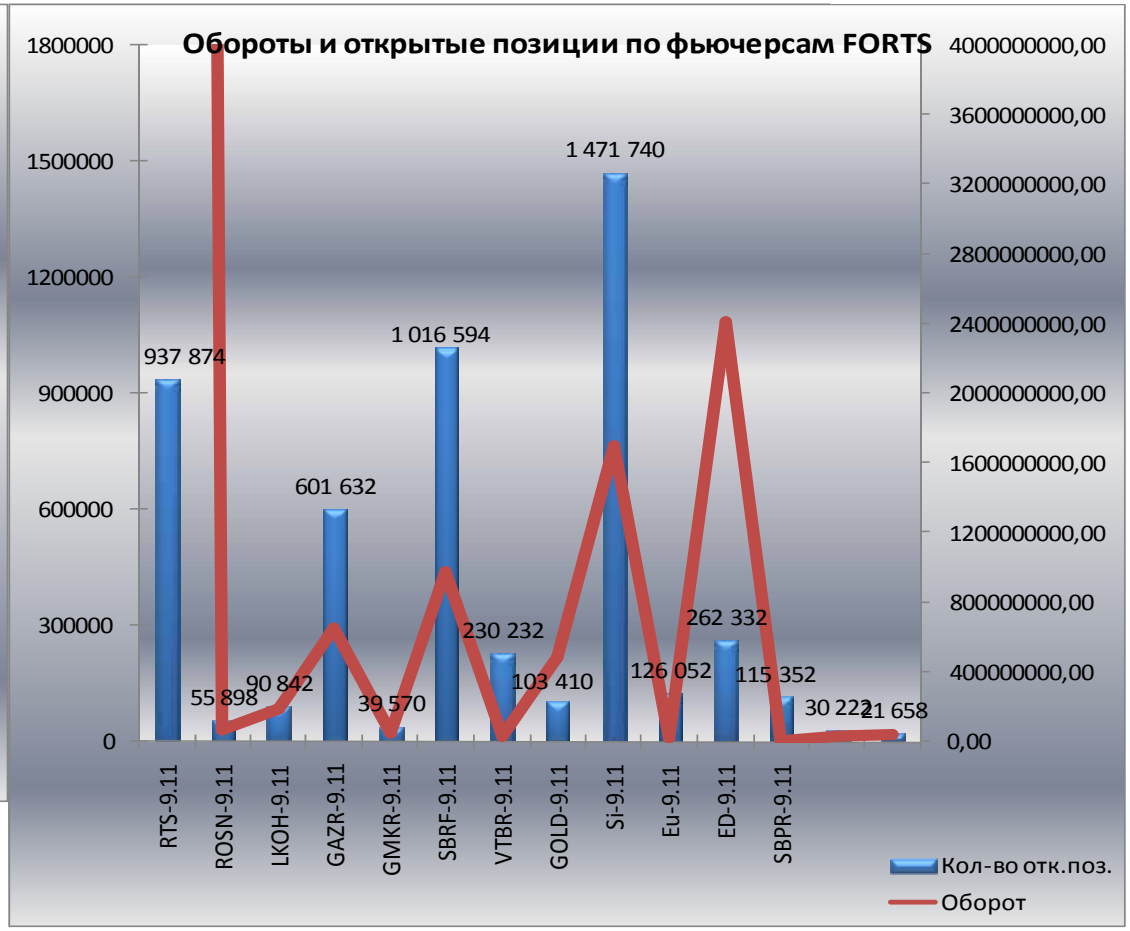


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	14	32	52	470	2846	1546	1186	272	292	160	70
OI Put	0	4	4	4	160	10	218	1106	860	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	52,673	50,824	48,963	47,114	43,658	42,166	40,889	39,84	39,016	38,4	37,969	37,701	37,571	37,561	37,652	37,831	38,083



	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	1450	3218	2772	366	1126	5114	23328	23754	10518	3698	3946	5316	3326	4314	974
OI Put	14	122	148	762	830	2174	2792	5244	3080	24248	2308	79358	15014	1408	60	4	22	2	0	34
IV	53,208	51,444	50,948	50,662	50,553	50,591	50,753	51,017	51,365	51,785	52,263	52,79	53,358	53,959	54,587	55,237	55,904	56,585	57,277	57,976


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
87,5%
другие
1,4%
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
937 874
55 898
90 842
601 632
39 570
1 016 594
230 232
103 410
1 471 740
126 052
262 332
115 352
30 222
21 658
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