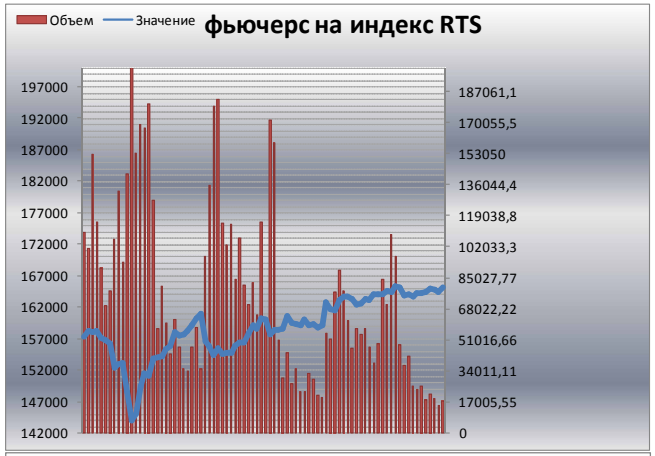
Понедельник: на мировых рынках наблюдается рост

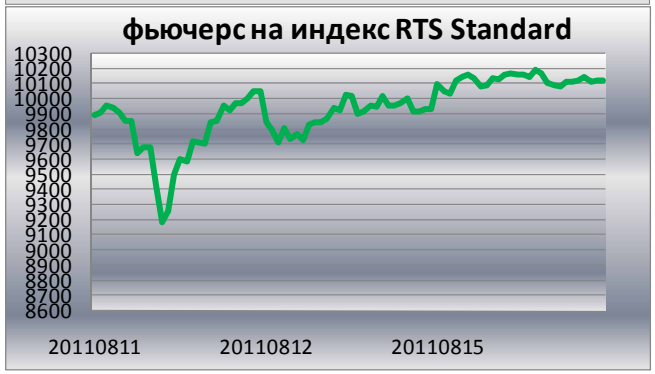
В понедельник 15 августа рынки показывали в основном положительную динамику Итак, CAC40 вырос на +0,78%, DAX30 на +0,41%, FTSE100 на +0,57%, S&P500 на +2,18%, Nikkei 225 на +0,23%, Hang Seng на -0,39%.

Европейский рынок находится в ожидании встречи Николя Саркози и Ангелы Меркель, в ходе которой представители обеих стран обсудят общую ситуацию в еврозоне, а также способы выхода из долгового кризиса.

Несколько выросла нефть: сорт Brent в течение дня подорожал до 109$ за баррель и еще может вырасти до вплоть до 115$, что обязательно скажется на российском рынке.

Итак, эксперты прогнозируют что рост российского рынка еще будет продолжаться в краткосрочном периоде. По итогам вечерних торгов Газпром изменился на –0,24%, Лукойл на –0,14%, Роснефть прибавила 2,08%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,22% и -0,3%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0,14% и –0,12%.





	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	165020	1650,20	0,05	987 144	162,97%	24 039 301 354	71,31%
ROSN-9.11	20741	207,41	2,08	46 524	34,50%	437 637 881	230,39%
LKOH-9.11	16482	1648,20	-0,14	102 678	35,67%	1 685 068 333	176,92%
GAZR-9.11	17385	173,85	-0,24	624 168	52,43%	361 500 865	7,66%
GMKR-9.11	67622	6762,20	-0,62	46 150	188,83%	16 057 711	9,53%
SBRF-9.11	8779	87,79	0,14	1 050 808	27,13%	363 514 931	13,98%
VTBR-9.11	7325	0,0733	-0,12	240 540	2778,65%	9 327 068	13,96%
GOLD-9.11	1741	1741,1000	1,50	105 484	81,15%	363 839 123	1101,32%
Si-9.11	28819	28,82	-0,22	1 586 930	9632,18%	1 249 292 101	2137,54%
Eu-9.11	41474	41,47	-0,30	134 634	-71,22%	43 763 934	1,10%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,07	181 564	658,54%	2 633 773 241	14192,09%
SBPR-9.11	7379	73,79	0,14	113 312	-47,31%	4 467 349	0,38%
RTSS-9.11	10136	10135,50	-0,48	30 832	-38,94%	16 572 485	3,02%
BR-7.11	109	108,85	0,70	33 398	0,04%	245 054 344	2624,07%

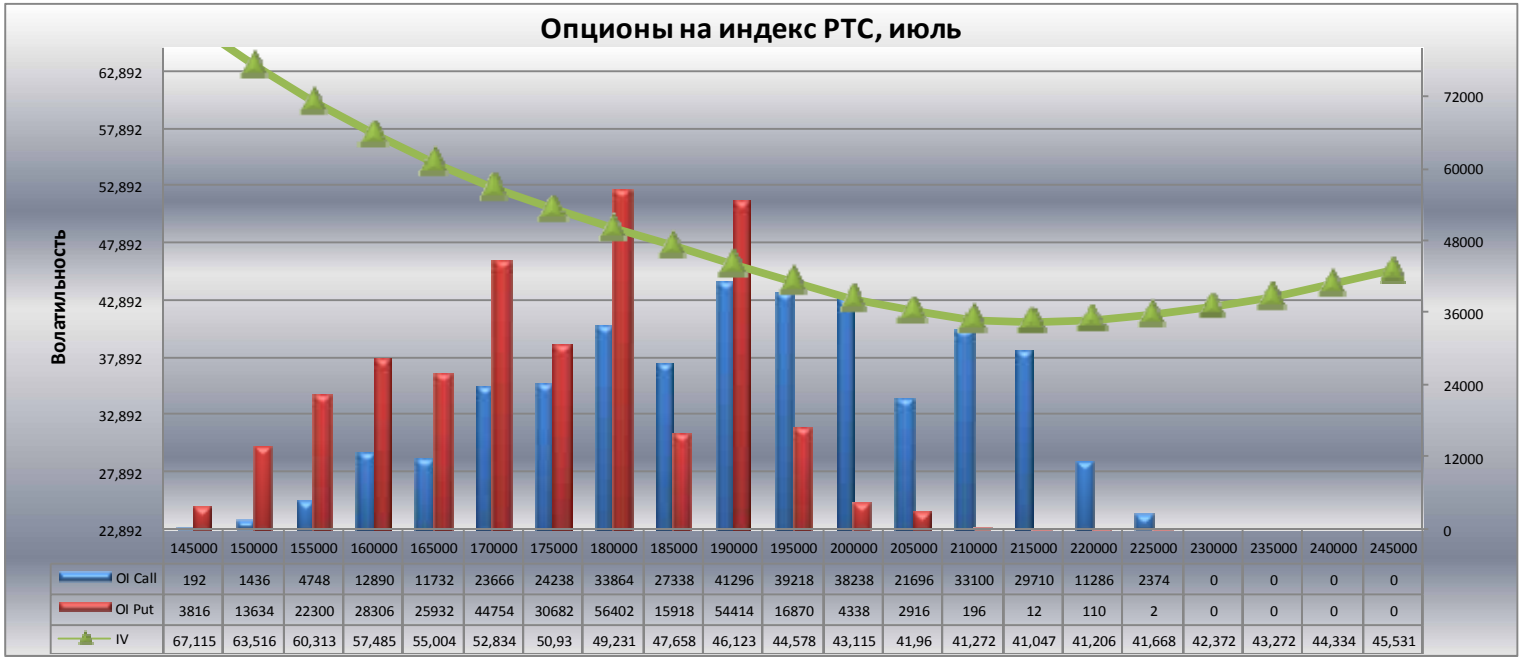
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54651,83	2,20%	00:16:30
CAC 40	3239,06	0,78%	19:35:16
DAX 30	6022,24	0,41%	19:35:30
DJ Industrial	11482,9	1,90%	00:39:05
FTSE 100	5350,58	0,57%	19:35:30
Hang Seng	20181,83	-0,39%	10:39:46
Nikkei 225	9107,43	0,23%	10:00:04
S&P 500	1204,49	2,18%	00:03:59
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1767,7	0,10%	10:39:53
Palladium	748,5	0,50%	10:38:53
Platinum	1814,5	0,61%	10:39:54
RTSI	1 656,18	0,07%	23:50:00
RTS_Standard	10 161,99	-0,11%	23:50:00
RTSI_DEREX	1631.75	4.54%	18:45:00

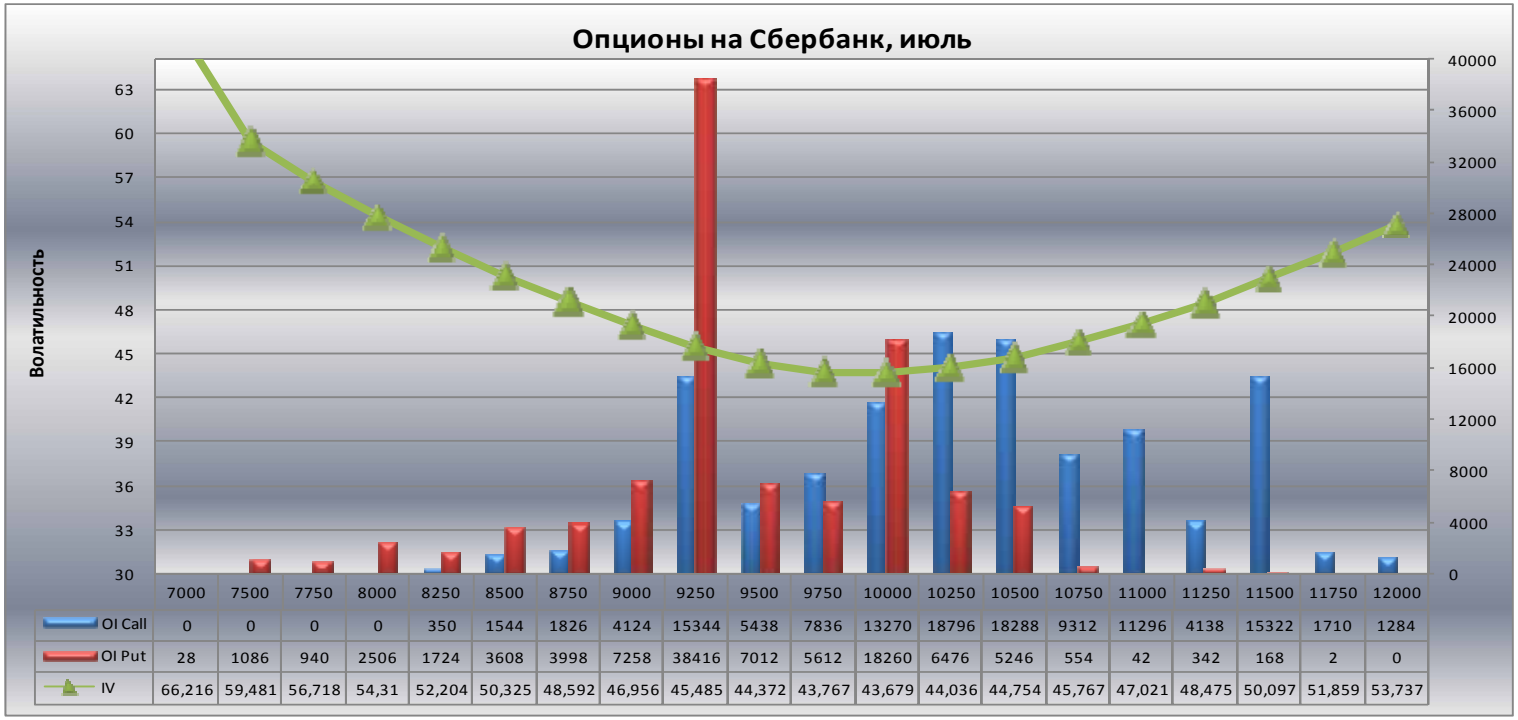
Вечерняя сессия

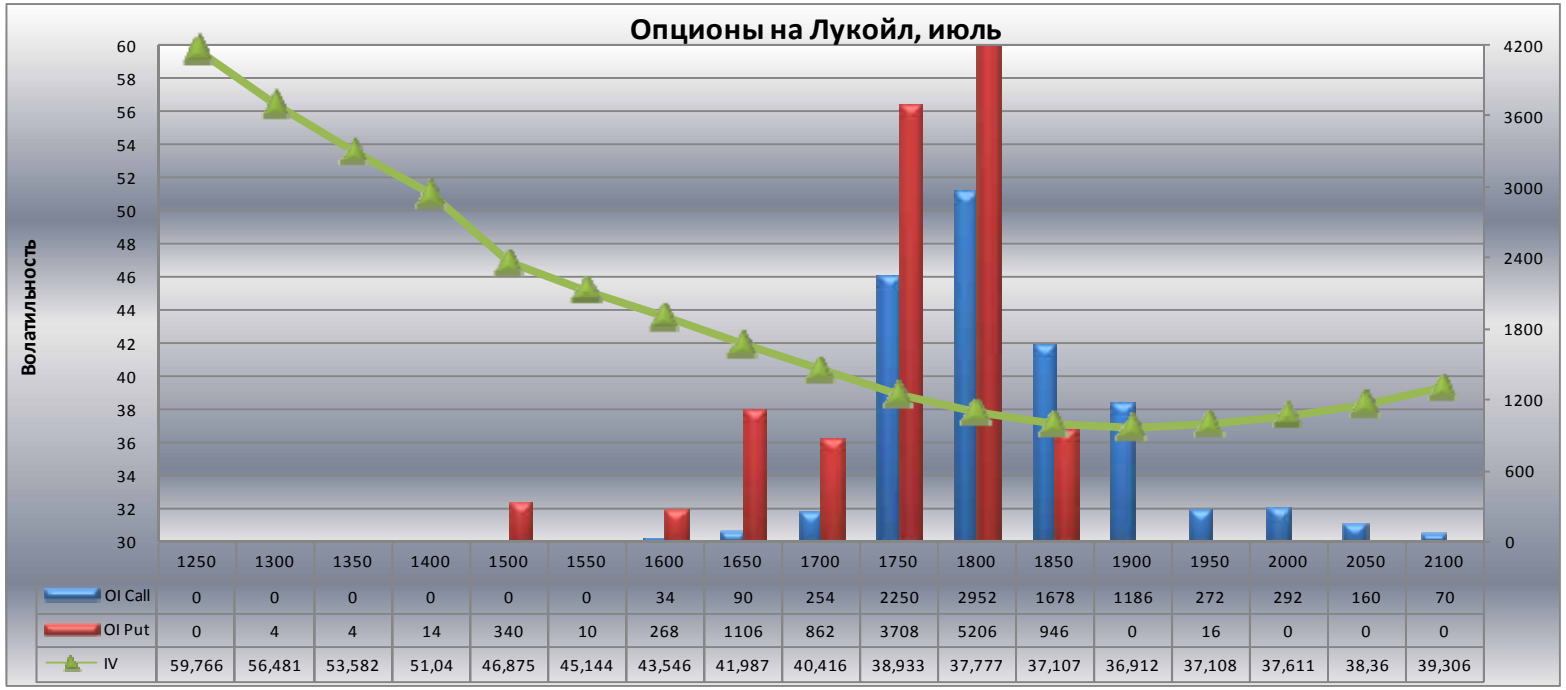
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,05	987 144	24039301354,00	165 020
ROSN-9.11	2,08	46524	437637881,00	20741
LKOH-9.11	-0,14	102678	1685068333,00	16482
GAZR-9.11	-0,24	624 168	361500865,00	17385
GMKR-9.11	-0,62	46 150	16057711,00	67622
SBRF-9.11	0,14	1 050 808	363514931,00	8779
VTBR-9.11	-0,12	240 540	9327068,00	7325
GOLD-9.11	1,5	105 484	363839123,00	1741,1
Si-9.11	-0,22	1 586 930	1249292101,00	28819
Eu-9.11	-0,3	134 634	43763934,00	41 474
ED-9.11	-0,07	181 564	2633773241,00	1,444
SBPR-9.11	0,14	113 312	4467349,00	7 379
RTSS-9.11	-0,48	30 832	16572485,00	10135,5
BR-7.11	0,7	33 398	245054344,00	108,85

Дневная сессия

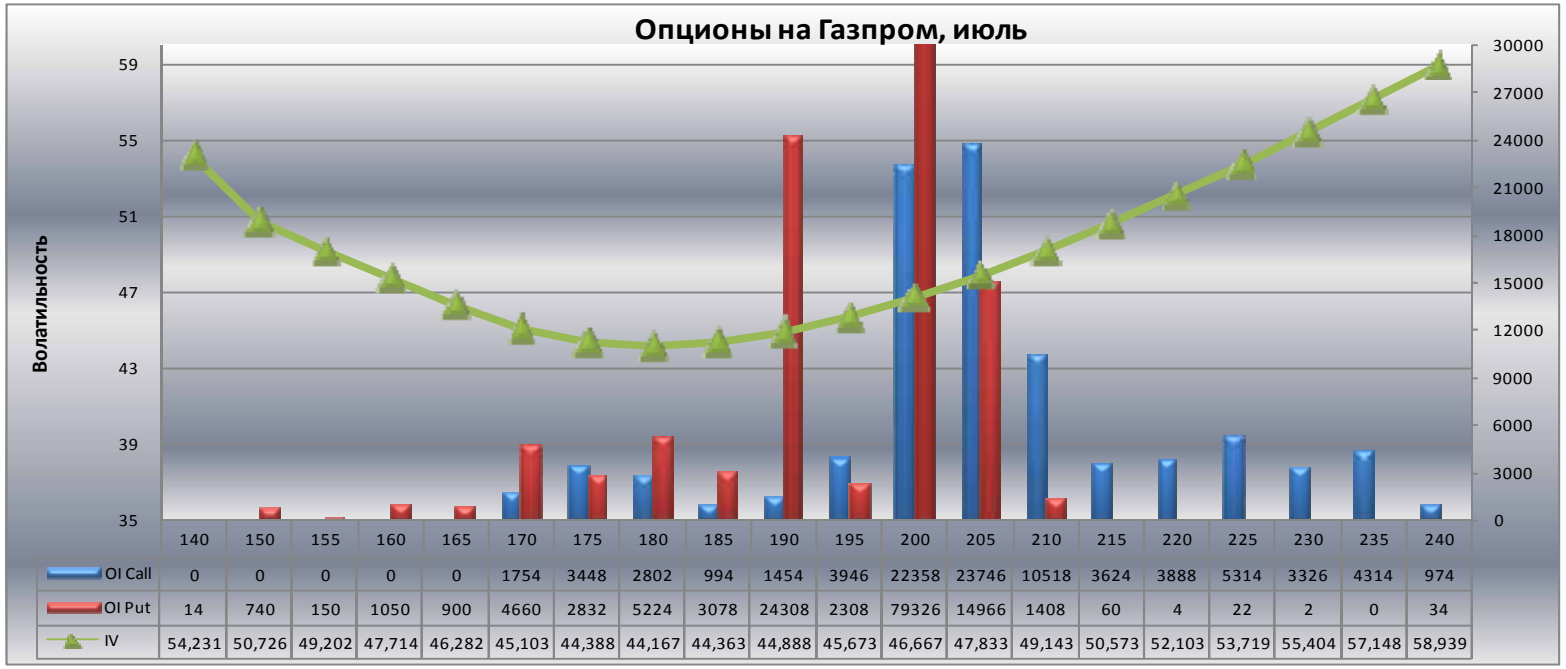
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375 378	33712923752,00	106 500
ROSN-9.09	1,45	34 590	189953759,00	20 140
LKOH-9.09	1,18	75 684	952454903,00	16 002
GAZR-9.09	0,25	409 478	4720165290,00	16 427
GMKR-9.09	1,1	15 978	168466309,00	34 223
SBRF-9.09	3,72	826 566	2599351513,00	4 923
SNGR-9.09	-0,94	8 356	66832296,00	25 786
VTBR-9.09	1,12	58 230	33036662,00	4 390
GOLD-9.09	0,6	16 306	58445322,80	955
Si-9.09	0,03	467 760	3969232519,00	31 929
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
62,892
57,892
52,892
47,892
42,892
37,892
32,892
27,892
22,892
72000
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 192 1436 4748 12890 11732 23666 24238 33864 27338 41296 39218 38238 21696 33100 29710 11286 2374 0 0 0 0
OI Put 3816 13634 22300 28306 25932 44754 30682 56402 15918 54414 16870 4338 2916 196 12 110 2 0 0 0 0
IV 67,115 63,516 60,313 57,485 55,004 52,834 50,93 49,231 47,658 46,123 44,578 43,115 41,96 41,272 41,047 41,206 41,668 42,372 43,272 44,334 45,531

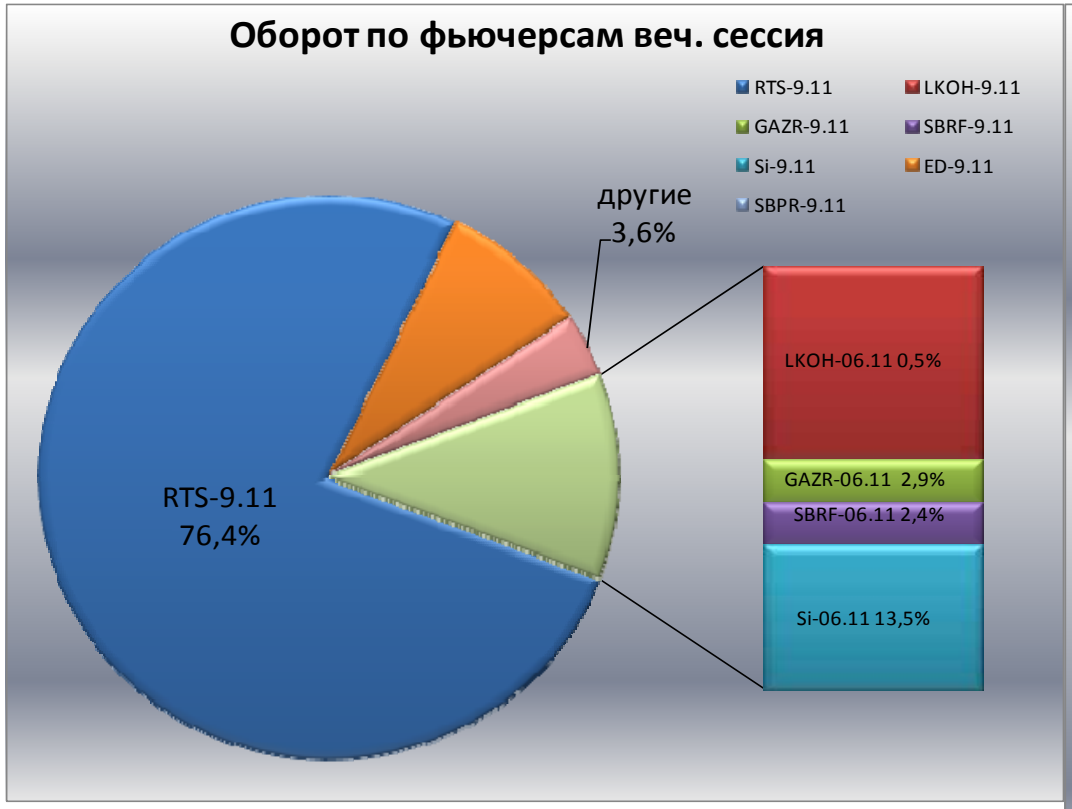

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
63
60
57
54
51
48
45
42
39
36
33
30
40000
36000
32000
28000
24000
20000
16000
12000
8000
4000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 350 1544 1826 4124 15344 5438 7836 13270 18796 18288 9312 11296 4138 15322 1710 1284
OI Put 28 1086 940 2506 1724 3608 3998 7258 38416 7012 5612 18260 6476 5246 554 42 342 168 2 0
IV 66,216 59,481 56,718 54,31 52,204 50,325 48,592 46,956 45,485 44,372 43,767 43,679 44,036 44,754 45,767 47,021 48,475 50,097 51,859 53,737

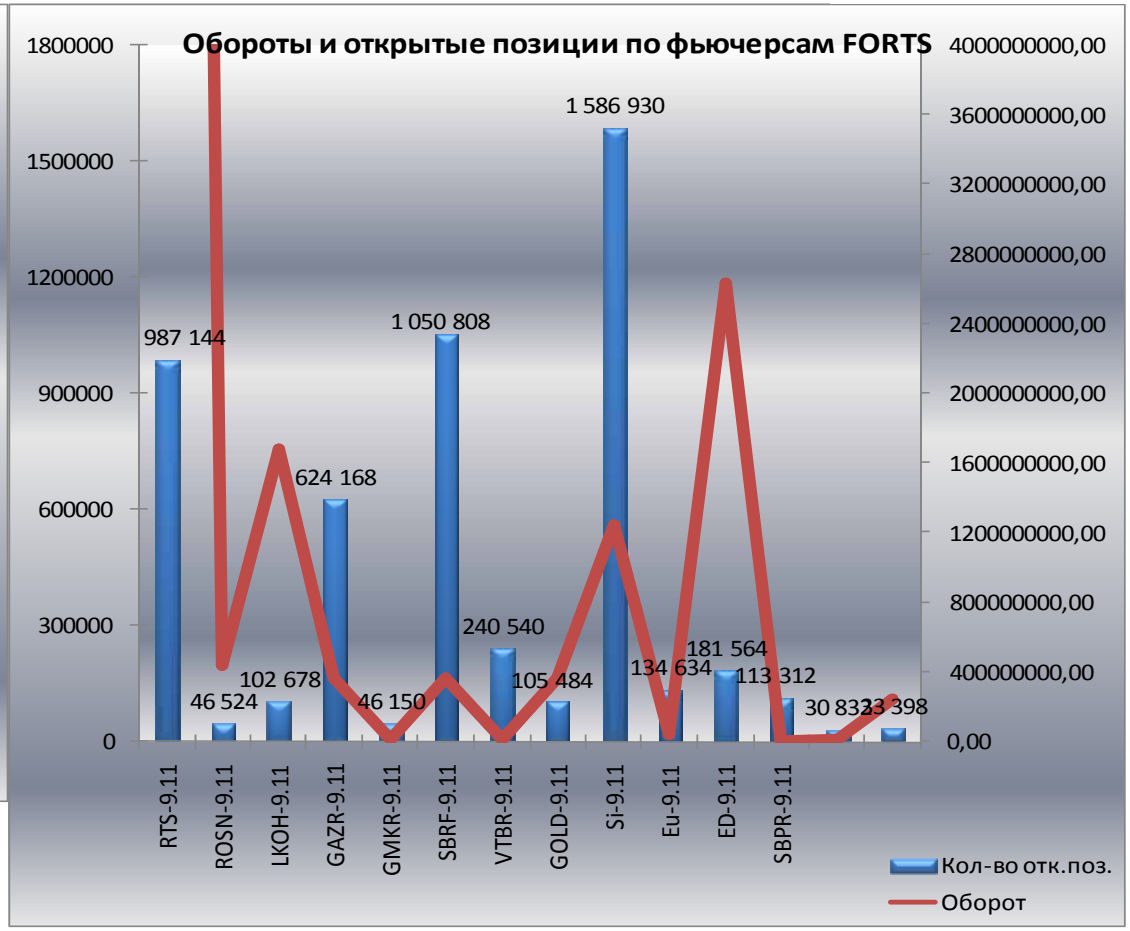


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	34	90	254	2250	2952	1678	1186	272	292	160	70
OI Put	0	4	4	14	340	10	268	1106	862	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	59,766	56,481	53,582	51,04	46,875	45,144	43,546	41,987	40,416	38,933	37,777	37,107	36,912	37,108	37,611	38,36	39,306



	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	1754	3448	2802	994	1454	3946	22358	23746	10518	3624	3888	5314	3326	4314	974
OI Put	14	740	150	1050	900	4660	2832	5224	3078	24308	2308	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	54,231	50,726	49,202	47,714	46,282	45,103	44,388	44,167	44,363	44,888	45,673	46,667	47,833	49,143	50,573	52,103	53,719	55,404	57,148	58,939


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
3,6%
RTS-9.11
76,4%
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
987 144
46 524
102 678
624 168
46 150
1 050 808
240 540
105 484
1 586 930
134 634
181 564
113 312
30 832
23 398
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