Возможно умеренное падение на российском рынке

В среду 17 августа мировые рынки показывали разнонаправленную динамику: после встречи глав Германии и Франции настроения на рынках несколько ухудшились (было решено не повышать размер стабилизационного фонда), однако в течение дня вышла неплохая отчетность по европейским компаниям. Итак, по итогам сессии FTSE 100 упал на –0,49%, CAC 40 вырос на +0,73%, а DAX 30 просел на 0,77%.

По США статистика подтвердила нарастание инфляции: повысился базовый индекс производителей выше прогнозируемых величин, составив 0,4% м/м или 2,5% г/г. Индекс DJ Industrial вырос на 0,04%, а S&P 500 на 0,09%.

Что касается российского рынка, вполне возможен некоторый откат вниз как и в среду. По итогам вечерних торгов Газпром изменился на –1,01%, Лукойл на –0,94%, Роснефть на -0,86%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,19% и -0,1%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0,71% и –0,82%.





	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	163790	1637,90	-1,36	1 042 348	177,68%	33 709 227 503	99,99%
ROSN-9.11	21001	210,01	-0,86	49 868	44,17%	15 981 834	8,41%
LKOH-9.11	16403	1640,30	-0,94	99 830	31,90%	82 632 039	8,68%
GAZR-9.11	17408	174,08	-1,01	632 874	54,56%	464 501 204	9,84%
GMKR-9.11	65921	6592,10	-1,37	45 914	187,36%	15 059 179	8,94%
SBRF-9.11	8674	86,74	-0,71	1 052 706	27,36%	486 740 095	18,73%
VTBR-9.11	7217	0,0722	-0,82	221 838	2554,83%	9 659 593	14,45%
GOLD-9.11	1797	1797,0000	0,04	121 770	109,12%	321 322 201	972,62%
Si-9.11	28821	28,82	0,19	1 510 788	9165,23%	2 021 722 363	3459,17%
Eu-9.11	41614	41,61	-0,10	140 922	-69,87%	13 205 397	0,33%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,28	158 718	563,09%	2 662 577 179	14347,30%
SBPR-9.11	7234	72,34	-0,47	107 798	-49,87%	4 177 883	0,35%
RTSS-9.11	10091	10091,00	-1,05	30 988	-38,63%	19 792 115	3,60%
BR-7.11	111	110,74	-0,39	49 470	48,18%	461 791 011	4944,91%

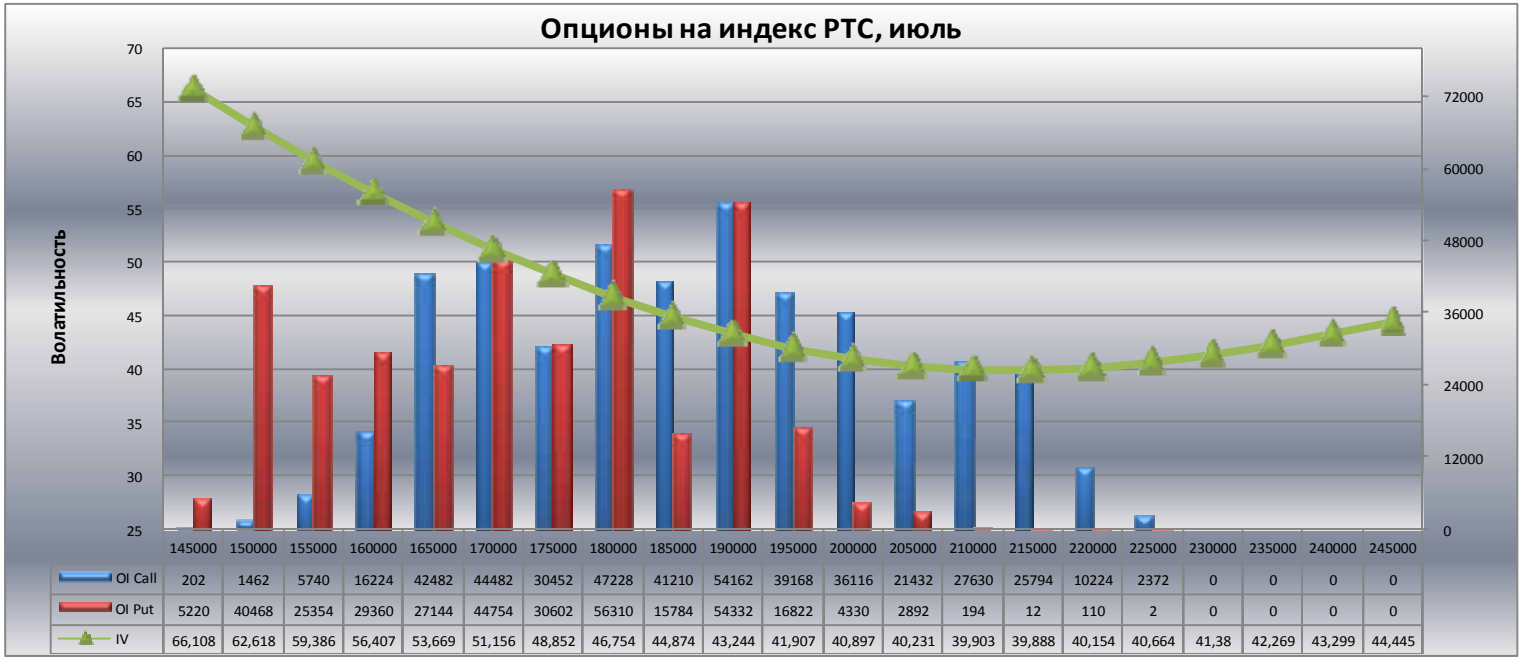
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55073,02	1,38%	00:11:30
CAC 40	3254,34	0,73%	19:35:16
DAX 30	5948,94	-0,77%	19:35:31
DJ Industrial	11410,21	0,04%	00:35:40
FTSE 100	5331,6	-0,49%	19:35:32
Hang Seng	20129,05	-0,79%	10:36:46
Nikkei 225	8943,76	-1,25%	10:00:04
S&P 500	1193,89	0,09%	00:32:01
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1792,9	0,27%	10:36:56
Palladium	774	0,42%	10:36:02
Platinum	1834	-0,09%	10:35:37
RTSI	1 653,14	-0,64%	23:50:00
RTS_Standard	10 099,02	-0,80%	23:50:00
RTSI_DEREX	1708.91	1.9%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-1,36	1042348	33709227503,45	163790
ROSN-9.11	-0,86	49868	15981834,00	21001
LKOH-9.11	-0,94	99830	82632039,00	16403
GAZR-9.11	-1,01	632874	464501204,00	17408
GMKR-9.11	-1,37	45914	15059179,00	65921
SBRF-9.11	-0,71	1052706	486740095,00	8674
VTBR-9.11	-0,82	221838	9659593,00	7217
GOLD-9.11	0,04	121770	321322201,09	1797
Si-9.11	0,19	1510788	2021722363,00	28821
Eu-9.11	-0,1	140922	13205397,00	41614
ED-9.11	-0,28	158718	2662577178,83	1,4435
SBPR-9.11	-0,47	107798	4177883,00	7234
RTSS-9.11	-1,05	30988	19792115,00	10091
BR-7.11	-0,39	49 470	461791011,48	110,74

Дневная сессия

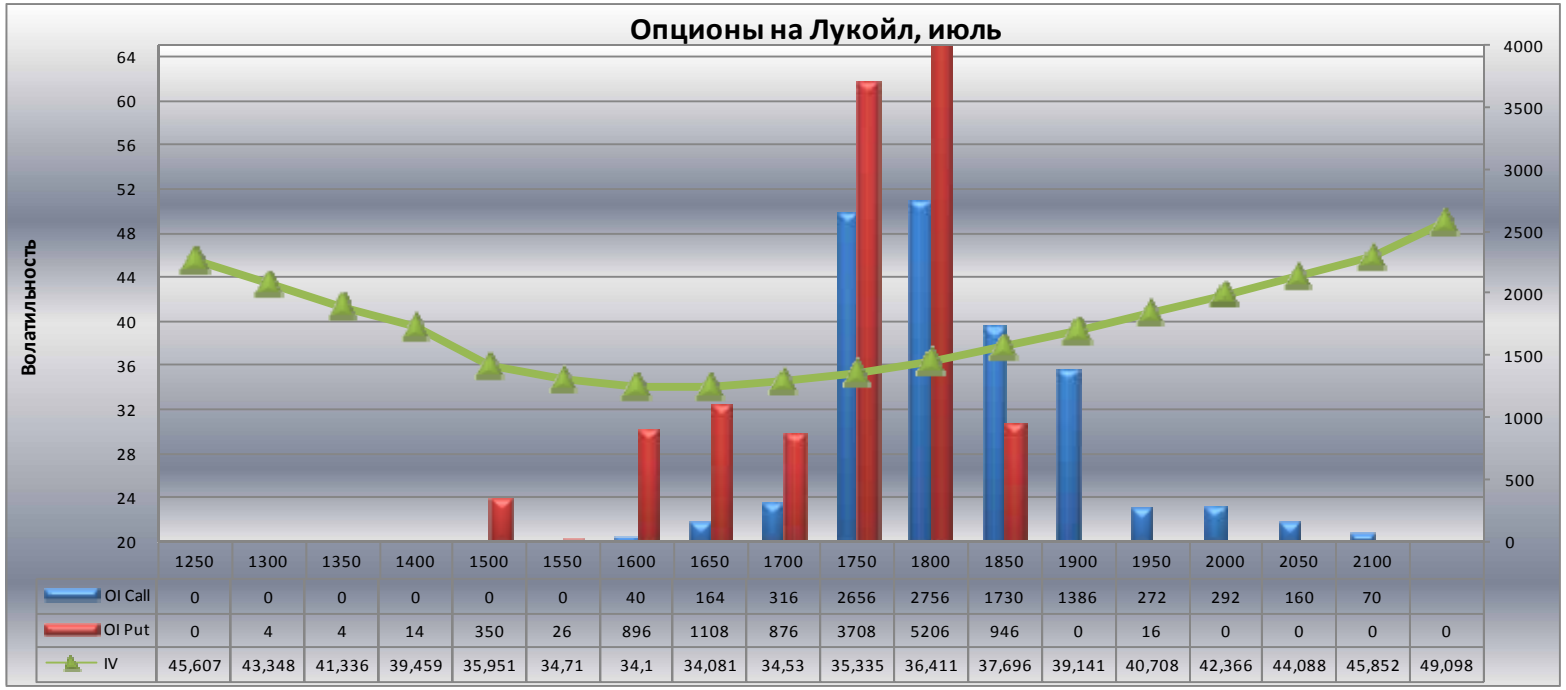
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752,00	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759,00	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903,00	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290,00	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309,00	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513,00	4923
SNGR-9.09	-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	33 384	9338717,00	2866



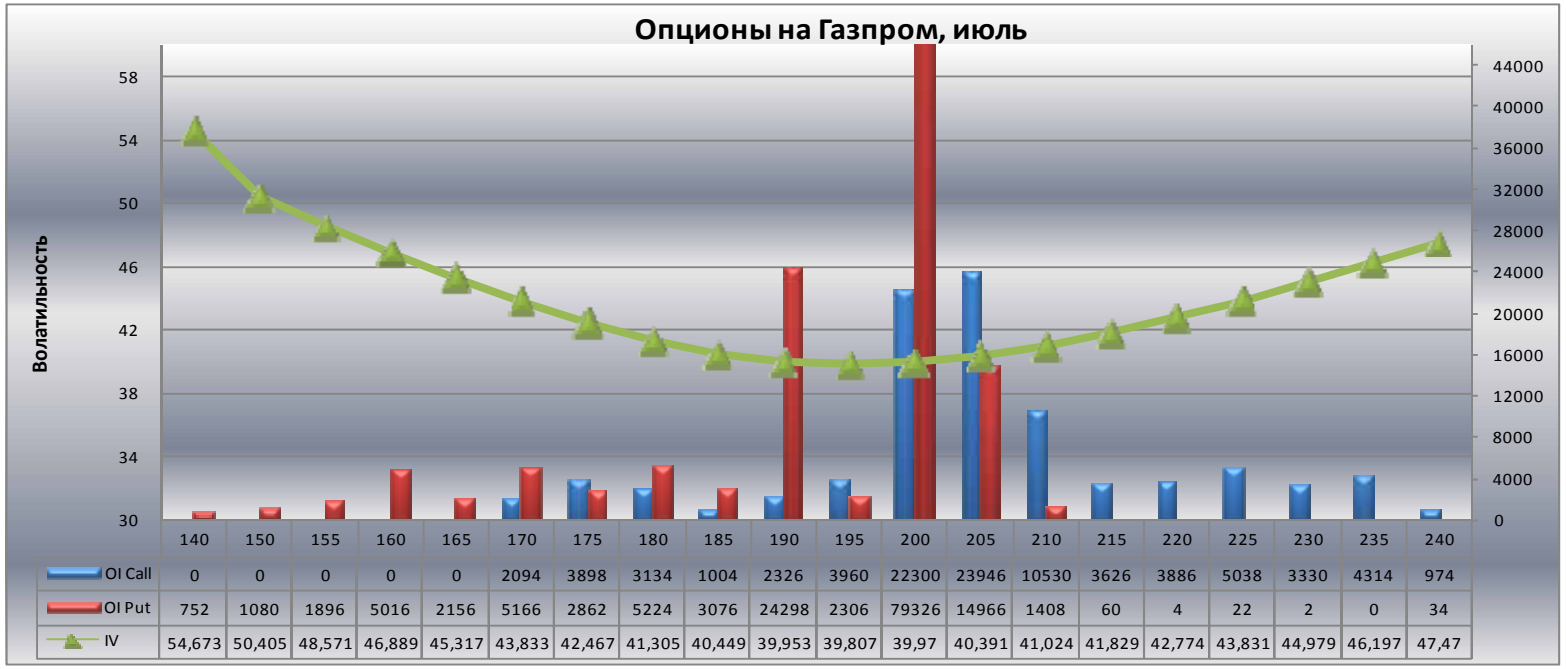
	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	202	1462	5740	16224	42482	44482	30452	47228	41210	54162	39168	36116	21432	27630	25794	10224	2372	0	0	0	0
OI Put	5220	40468	25354	29360	27144	44754	30602	56310	15784	54332	16822	4330	2892	194	12	110	2	0	0	0	0
IV	66,108	62,618	59,386	56,407	53,669	51,156	48,852	46,754	44,874	43,244	41,907	40,897	40,231	39,903	39,888	40,154	40,664	41,38	42,269	43,299	44,445



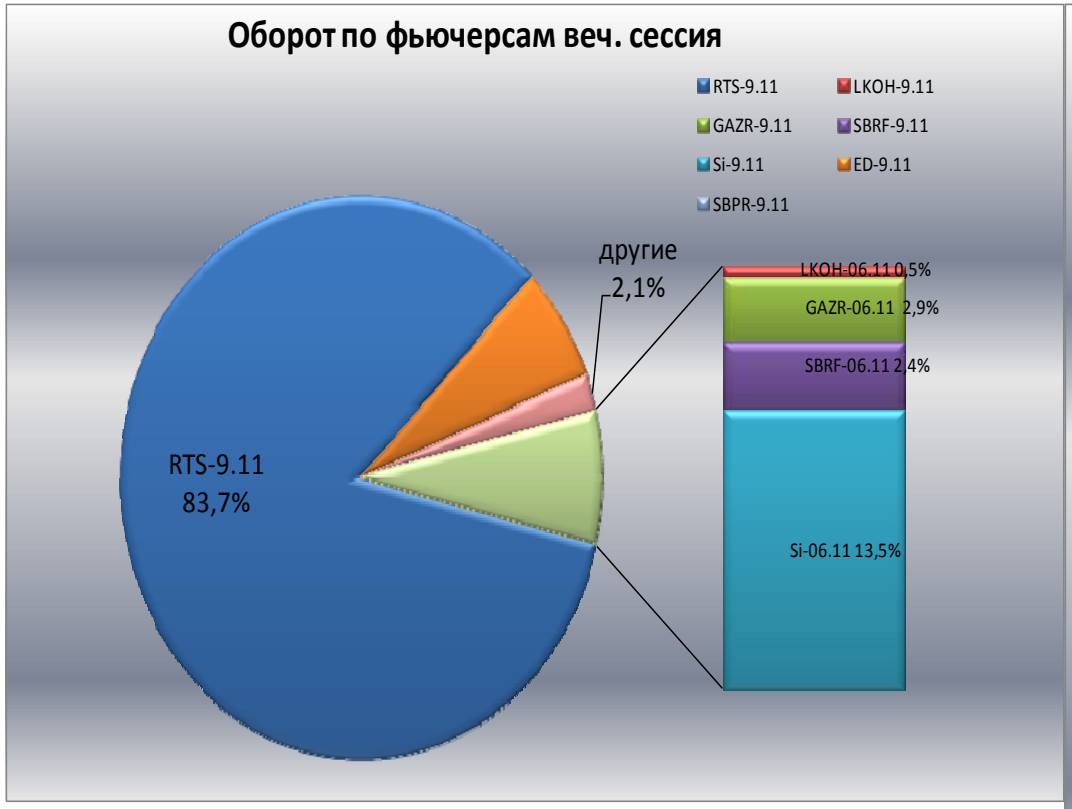
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	426	1680	4282	5378	16116	6158	7938	13728	18948	17796	9298	11272	4126	15318	1710	1284
OI Put	28	1286	1372	3406	3914	6674	5494	7270	38408	6998	5578	18256	6468	5222	536	38	342	168	2	0
IV	55,85	50,846	48,672	46,727	45,041	43,66	42,619	41,938	41,612	41,615	41,912	42,463	43,23	44,176	45,269	46,481	47,785	49,161	50,589	52,053

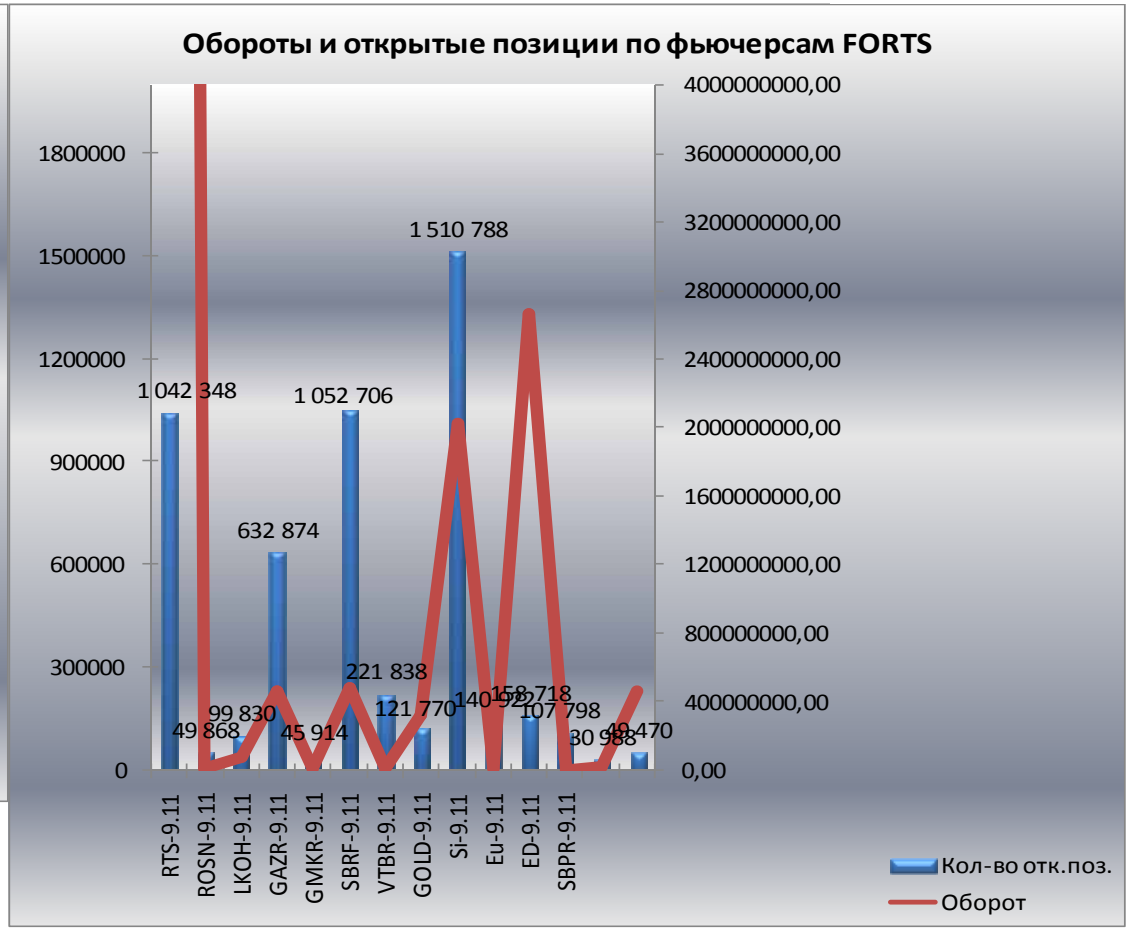


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	
OI Call	0	0	0	0	0	0	40	164	316	2656	2756	1730	1386	272	292	160	70	
OI Put	0	4	4	14	350	26	896	1108	876	3708	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	45,607	43,348	41,336	39,459	35,951	34,71	34,1	34,081	34,53	35,335	36,411	37,696	39,141	40,708	42,366	44,088	45,852	49,098



	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	2094	3898	3134	1004	2326	3960	22300	23946	10530	3626	3886	5038	3330	4314	974
OI Put	752	1080	1896	5016	2156	5166	2862	5224	3076	24298	2306	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	54,673	50,405	48,571	46,889	45,317	43,833	42,467	41,305	40,449	39,953	39,807	39,97	40,391	41,024	41,829	42,774	43,831	44,979	46,197	47,47


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
2,1%
RTS-9.11
83,7%
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
1 042 348
49 868
99 830
632 874
45 914
1 052 706
221 838
121 770
1 510 788
140 922
158 718
107 798
30 988
48 470
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