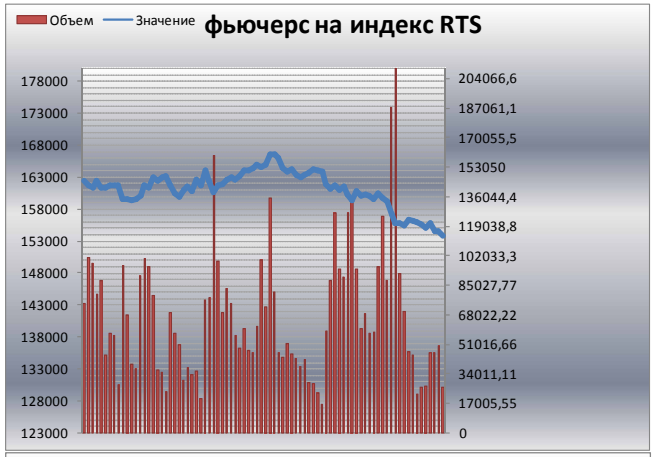
США и Европа:в опасной близости от рецессии

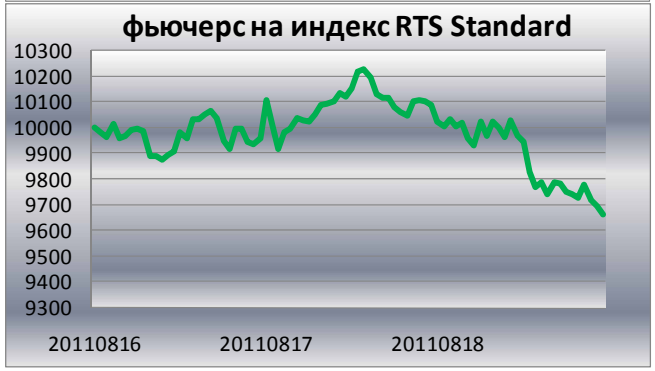
В четверг 28 августа мировые рынки продемонстрировали значительное падение. Итак, по итогам сессии FTSE 100 упал на –4,49%, CAC 40 на –5,48%, а DAX 30 просел на –5,82%.

Индекс DJ Industrial упал на –3,68%, а S&P 500 на –4,46%. В Morgan Stanley подчеркнули, что США и Европа сейчас находятся "в опасной близости от рецессии", и "недавние политические ошибки, в особенности медленный и недостаточный ответ Европы на долговой кризис и драматические события, связанные с повышением потолка госдолга Соединённых Штатов, привели к падению финансовых рынков и подорвали доверие бизнеса и потребителей".

Соответственно, золото подорожало: на 01:10:12 оно составило 1843,07 пункта (+1,06%).

По итогам вечерних торгов на российском рынке Газпром изменился на –0,9%, Лукойл на –1,08%, Роснефть на - 0,96% (днем же падение было куда более ощутимым). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,14% и +0,41%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на –1,53% и –1,55%.





	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	153720	1537,20	-1,29	1 020 746	-0,04%	37 342 474 929	17,84%
ROSN-9.11	20138	201,38	-0,95	45 138	0,06%	16 384 812	2,23%
LKOH-9.11	16092	1609,20	-1,08	103 780	0,48%	109 840 399	4,04%
GAZR-9.11	16744	167,44	-0,90	613 324	0,25%	382 368 742	5,45%
GMKR-9.11	64090	6409,00	-1,00	47 088	-27,26%	43 891 883	6,04%
SBRF-9.11	8060	80,60	-1,53	1 045 064	0,87%	615 245 208	7,10%
VTBR-9.11	6750	0,0675	-1,55	220 472	0,33%	14 287 853	4,38%
GOLD-9.11	1830	1829,5000	0,17	132 662	3,67%	611 702 899	17,32%
Si-9.11	29342	29,34	0,14	1 495 354	2,38%	1 967 466 542	4,90%
Eu-9.11	42020	42,02	0,41	140 964	-0,04%	26 749 268	14,33%
ED-9.11	1,43	1,43	0,27	142 082	-2,02%	1 675 768 936	12,09%
SBPR-9.11	6755	67,55	-1,66	116 184	0,01%	2 856 712	2,46%
RTSS-9.11	9665	9665,00	-1,29	32 618	-0,10%	25 991 690	6,54%
BR-7.11	106	106,45	-1,44	54 552	-0,37%	631 957 461	26,48%

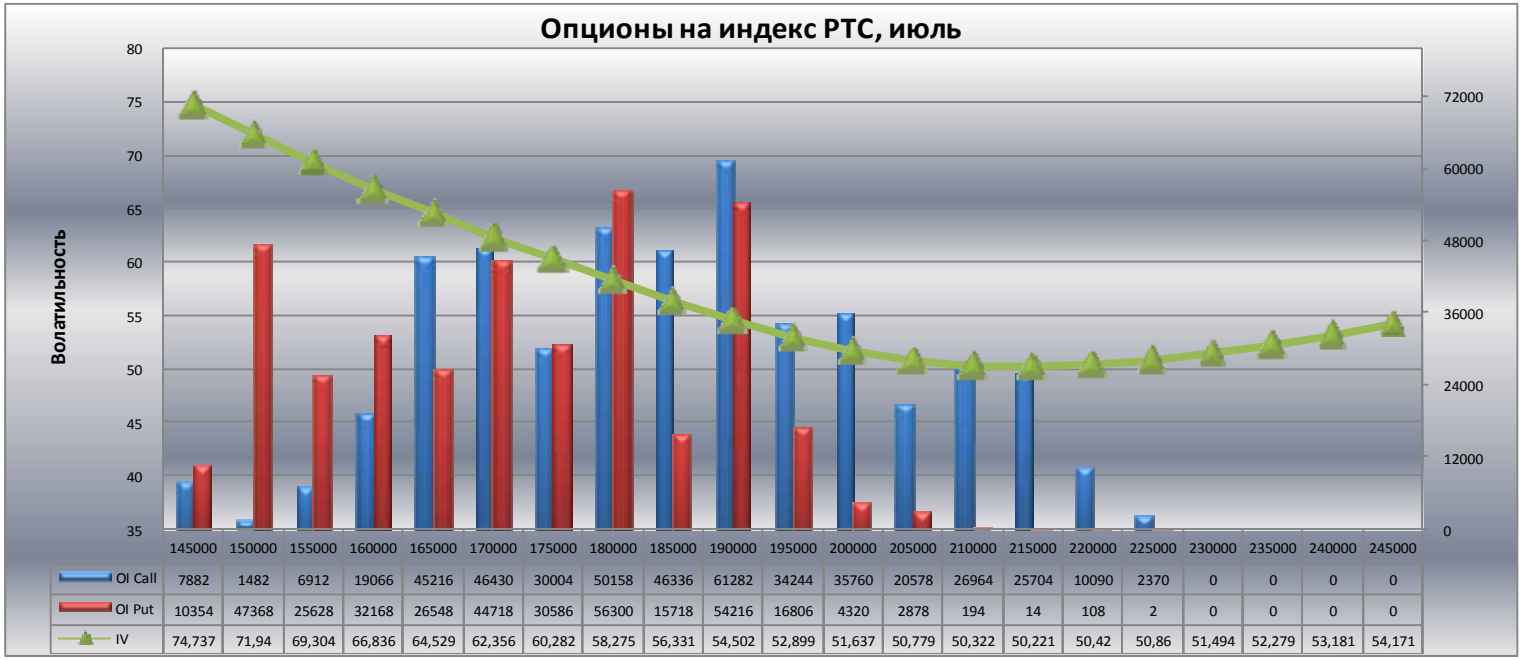
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	53134,1	-3,52%	00:14:30
CAC 40	3076,04	-5,48%	19:35:16
DAX 30	5602,8	-5,82%	19:35:33
DJ Industrial	10990,58	-3,68%	00:37:29
FTSE 100	5092,23	-4,49%	19:35:32
Hang Seng	19440,71	-2,88%	10:02:02
Nikkei 225	8719,24	-2,51%	10:00:04
S&P 500	1140,65	-4,46%	00:05:16
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1843,07	1,06%	10:02:08
Palladium	754,2	0,27%	09:49:55
Platinum	1850,25	0,73%	10:02:02
RTSI	1 575,85	-0,73%	23:50:00
RTS_Standard	9 687,82	-0,95%	23:50:00
RTSI_DEREX	1614.78	-5.51%	18:45:00

Вечерняя сессия

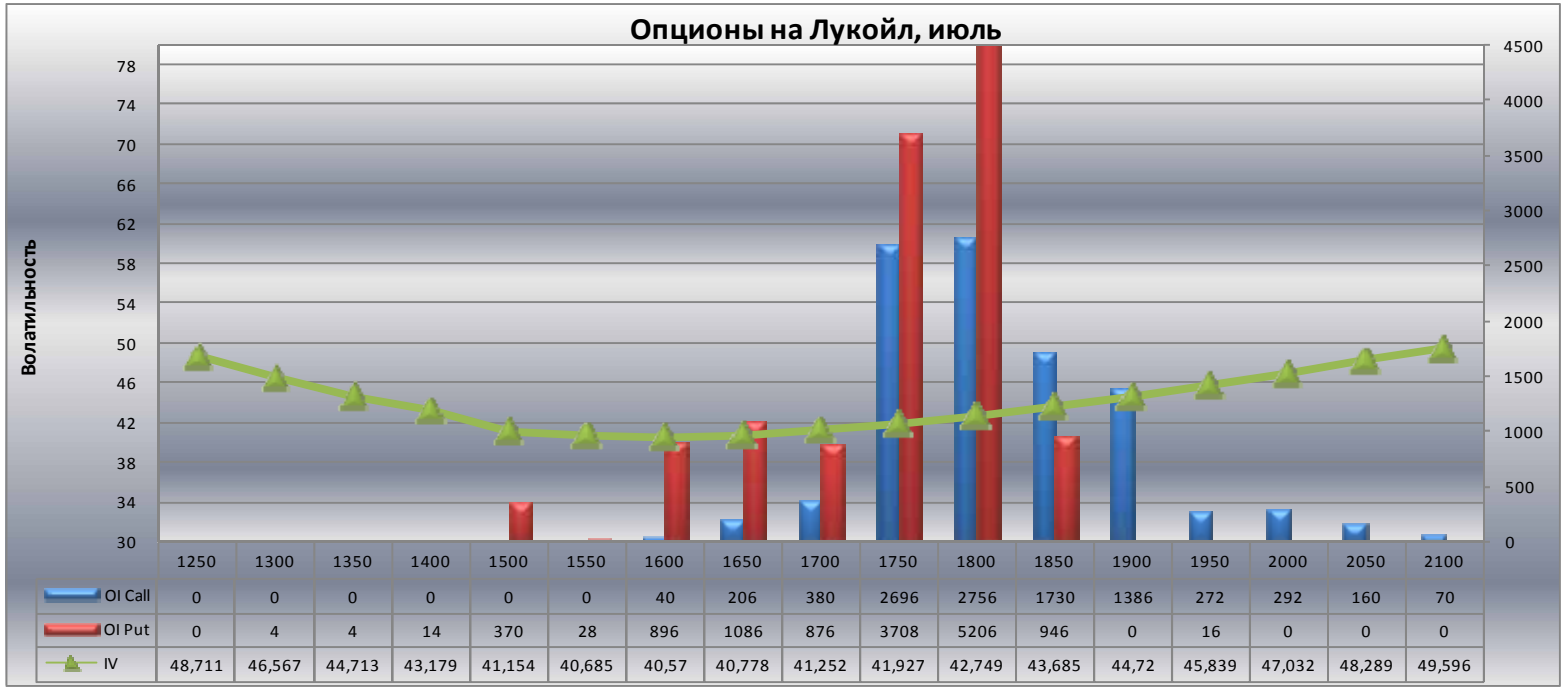
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-1,29	1020746	37342474929,14	153720
ROSN-9.11	-0,95	45138	16384812,00	20138
LKOH-9.11	-1,08	103780	109840399,00	16092
GAZR-9.11	-0,9	613324	382368742,00	16744
GMKR-9.11	-1	47088	43891883,00	64090
SBRF-9.11	-1,53	1045064	615245208,00	8060
VTBR-9.11	-1,55	220472	14287853,00	6750
GOLD-9.11	0,17	132662	611702898,83	1829,5
Si-9.11	0,14	1495354	1967466542,00	29342
Eu-9.11	0,41	140964	26749268,00	42020
ED-9.11	0,27	142082	1675768935,67	1,4314
SBPR-9.11	-1,66	116184	2856712,00	6755
RTSS-9.11	-1,29	32618	25991690,00	9665
BR-7.11	-1,44	54 552	631957461,07	106,45

Дневная сессия

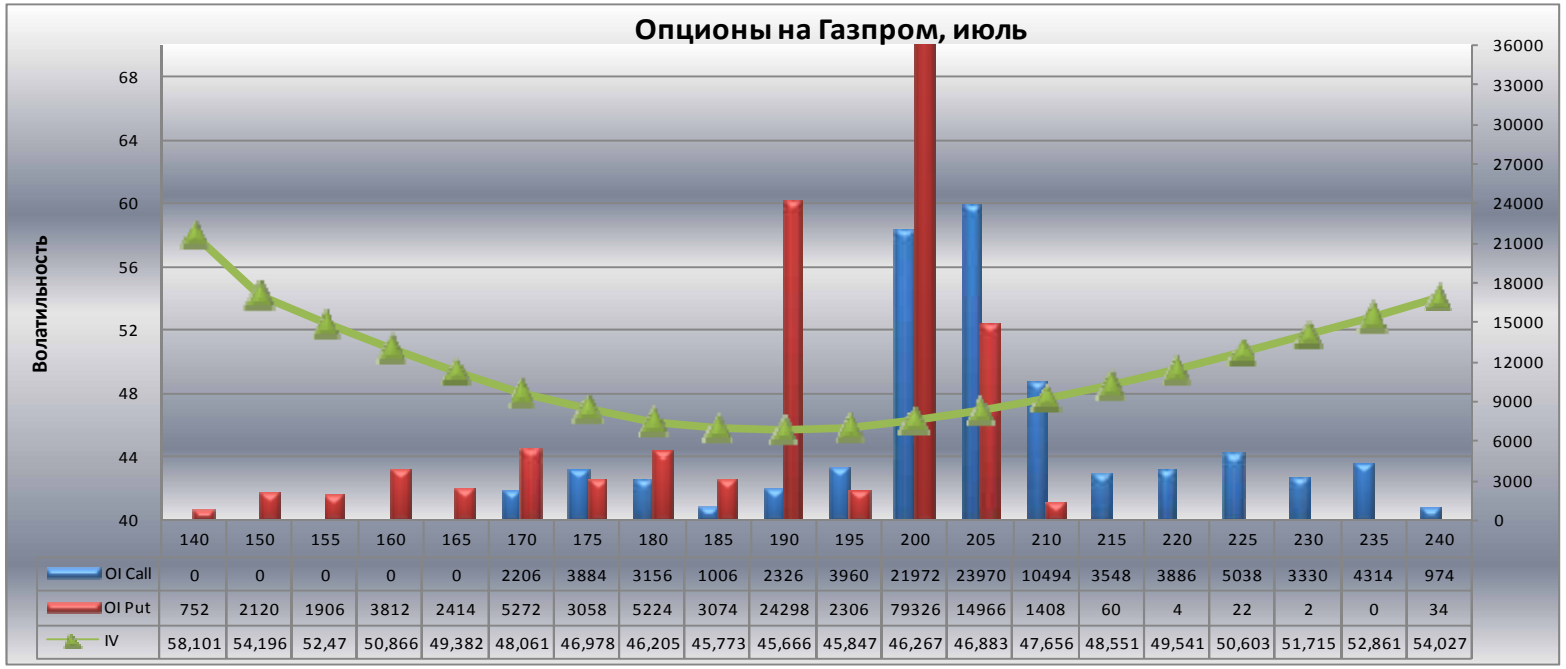
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-6,62	1 021 114	209267169060,00	155 735
ROSN-9.11	-4,08	45 110	736219248,00	20 319
LKOH-9.11	-2,31	103 286	2717696185,00	16 267
GAZR-9.11	-4,05	611 774	7021070829,00	16 896
GMKR-9.11	-2,98	64 737	726635938,00	64 737
SBRF-9.11	-6,39	1 036 018	8659661209,00	8 185
VTBR-9.11	-5,73	219 738	326441933,00	6 860
GOLD-9.11	1,6	127 960	3532505842,00	1 826,40
Si-9.11	1,83	1 460 604	40182900635,00	29 300
Eu-9.11	0,46	141 024	186668855,00	41 848
ED-9.11	-1,4	145 012	13858852932,00	1,4274
SBPR-9.11	-5,81	116 170	115996981,00	6 869
RTSS-9.11	-4,34	32 652	397335385,00	9 756
BR-7.11	-3,38	54 756	2386643903,00	107,43


Опционы на индекс РТС, июль
Волатильность
80
75
70
65
60
55
50
45
40
35
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 7882 1482 6912 19066 45216 46430 30004 50158 46336 61282 34244 35760 20578 26964 25704 10090 2370 0 0 0 0
OI Put 10354 47368 25628 32168 26548 44718 30586 56300 15718 54216 16806 4320 2878 194 14 108 2 0 0 0 0
IV 74,737 71,94 69,304 66,836 64,529 62,356 60,282 58,275 56,331 54,502 52,899 51,637 50,779 50,322 50,221 50,42 50,86 51,494 52,279 53,181 54,171

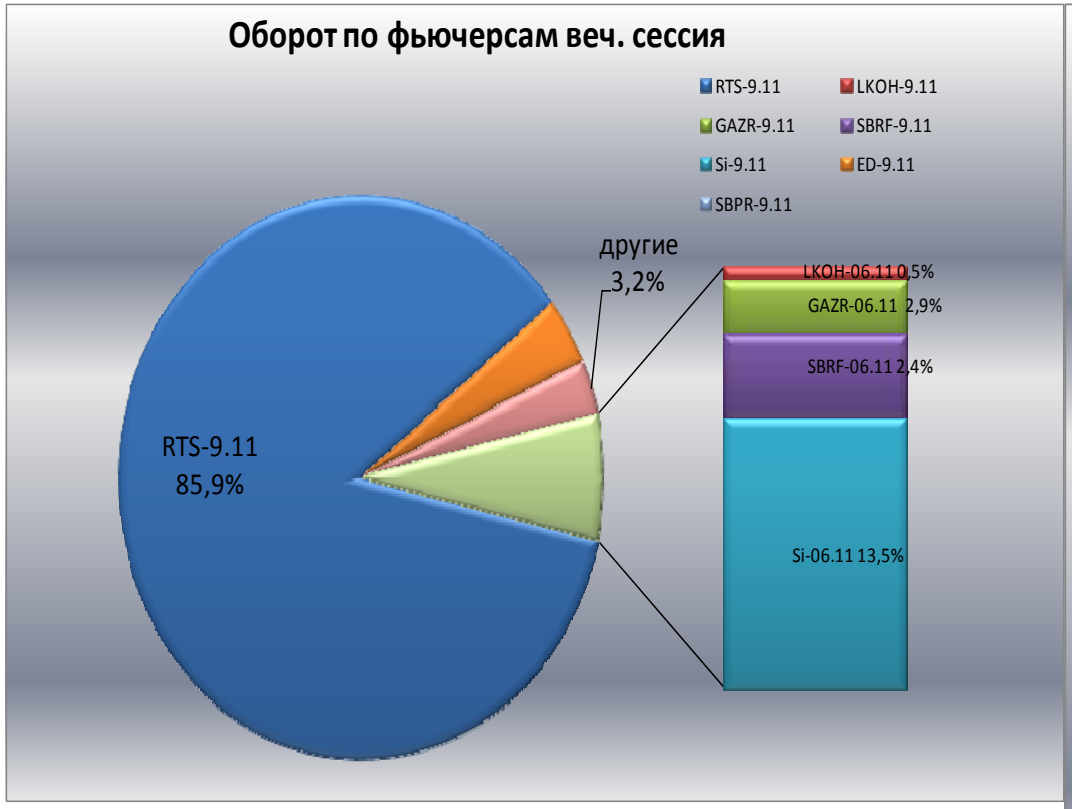

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
68
65
62
59
56
53
50
47
44
41
38
35
42000
39000
36000
33000
30000
27000
24000
21000
18000
15000
12000
9000
6000
3000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 500 3010 6750 14686 25566 11914 8436 13126 18950 17678 9278 11272 4126 15332 1710 1284
OI Put 1030 4924 2588 4498 4440 8482 6038 7266 38408 6996 5160 18256 6468 5180 534 38 342 168 2 0
IV 50,994 47,201 45,302 43,716 43,009 43,138 43,858 44,997 46,443 48,117 49,96 51,923 53,966 56,054 58,161 60,261 62,336 64,368 66,345 68,257

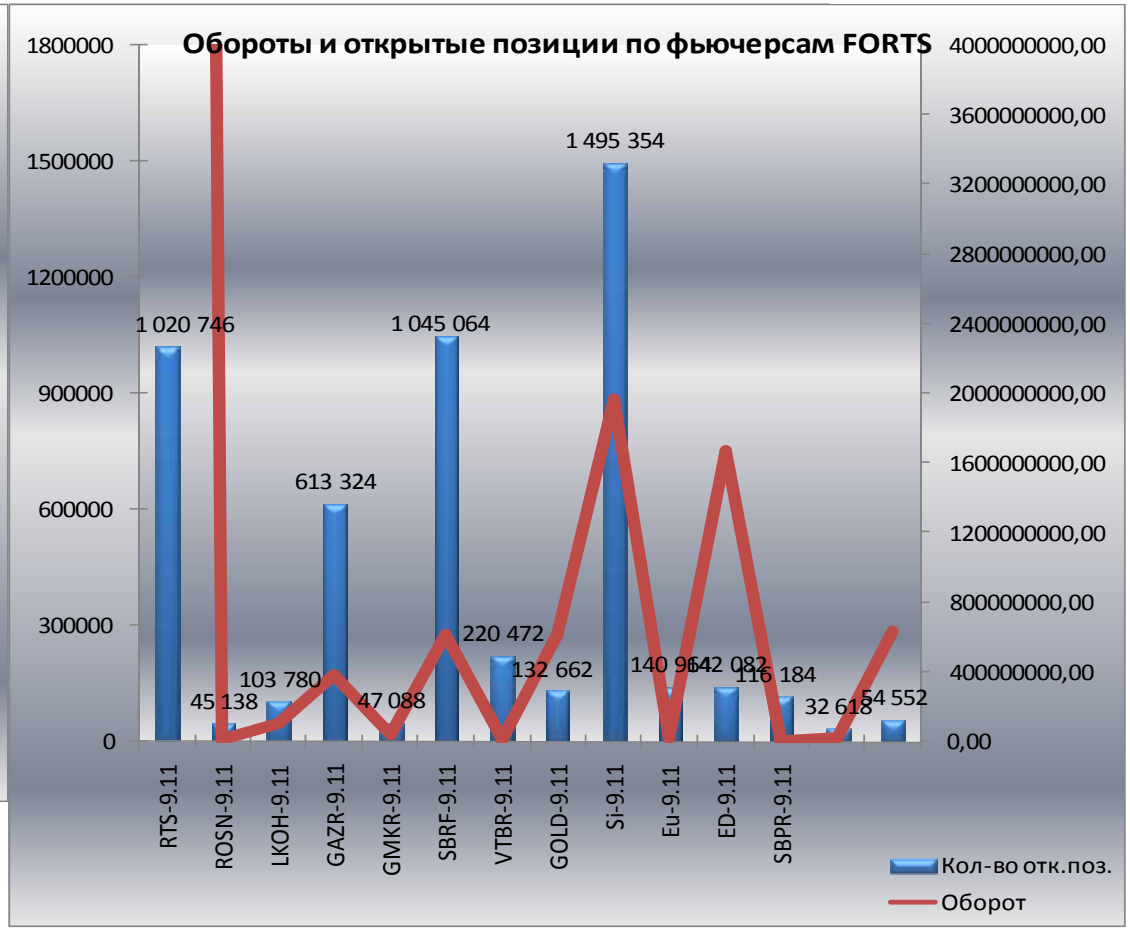


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	40	206	380	2696	2756	1730	1386	272	292	160	70
OI Put	0	4	4	14	370	28	896	1086	876	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	48,711	46,567	44,713	43,179	41,154	40,685	40,57	40,778	41,252	41,927	42,749	43,685	44,72	45,839	47,032	48,289	49,596



	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	2206	3884	3156	1006	2326	3960	21972	23970	10494	3548	3886	5038	3330	4314	974
OI Put	752	2120	1906	3812	2414	5272	3058	5224	3074	24298	2306	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	58,101	54,196	52,47	50,866	49,382	48,061	46,978	46,205	45,773	45,666	45,847	46,267	46,883	47,656	48,551	49,541	50,603	51,715	52,861	54,027


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
3,2%
RTS-9.11
85,9%
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
1 020 746
45 138
103 780
613 324
47 088
1 045 064
220 472
132 662
1 495 354
140 964
642 082
116 184
32 618
54 552
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