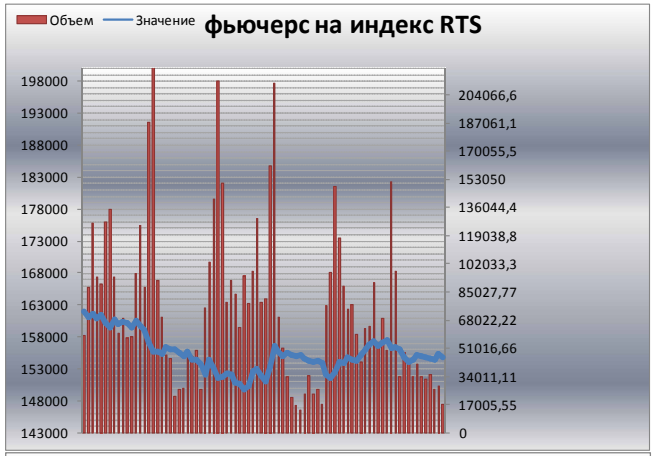
Понедельник: слабоположительная динамика

В понедельник 22 августа мировые рынки показывали более оптимистичные настроения: американский фондовый рынок завершил торговую сессию в «зеленой зоне» на фоне ожиданий выступления Бена Бернанке. Индекс DJ Industrial вырос на 0,342% до 10854,65 пунктов , а S&P 500 на 0,026% до 1123,82..

По итогам европейской торговой сессии индексы в основном закрылись положительно: FTSE 100 вырос на 1,06%, CAC 40 вырос на 1,14%, а DAX 30 просел на 0,11%.

Что касается российского рынка, по итогам вечерних торгов Газпром изменился на –0,41%, Лукойл на –0,94%, Роснефть на - 0,49%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,12% и -0,09%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0,51% и –0,85%.





	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	154860	1548,60	-0,70	1 036 882	0,90%	30 439 565 843	19,22%
ROSN-9.11	19958	199,58	-0,49	45 828	0,07%	15 260 967	3,25%
LKOH-9.11	16166	1616,60	-0,94	100 036	1,09%	93 883 251	3,53%
GAZR-9.11	16850	168,50	-0,41	636 812	0,25%	340 836 838	5,19%
GMKR-9.11	64052	6405,20	-0,64	48 112	0,03%	40 487 149	5,82%
SBRF-9.11	7868	78,68	-0,51	1 113 000	0,15%	530 808 008	5,98%
VTBR-9.11	6878	0,0688	-0,85	214 848	0,06%	31 161 011	11,67%
GOLD-9.11	1899	1898,7000	0,61	133 106	0,47%	686 978 143	23,71%
Si-9.11	29171	29,17	0,12	1 482 814	-0,17%	1 084 390 081	4,27%
Eu-9.11	41894	41,89	-0,09	118 302	0,04%	7 543 555	1,09%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,21	148 336	-6,75%	713 952 273	17,01%
SBPR-9.11	6698	66,98	-0,83	115 350	-0,12%	3 554 202	5,47%
RTSS-9.11	9685	9684,50	-0,58	32 196	0,43%	26 001 420	9,66%
BR-7.11	108	108,18	1,09	75 256	9,46%	338 801 472	17,48%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	52440,23	-0,01%	00:13:00
CAC 40	3051,36	1,14%	05:36:46
DAX 30	5473,78	-0,11%	19:35:47
DJ Industrial	10854,65	0,34%	00:37:08
FTSE 100	5095,3	1,08%	19:35:31
Hang Seng	19653,9	0,86%	10:01:02
Nikkei 225	8733,01	1,22%	10:00:05
S&P 500	1123,82	0,03%	00:04:15
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1900,7	0,20%	10:01:03
Palladium	759	0,04%	10:00:56
Platinum	1905	0,29%	10:00:55
RTSI	1 919,01	-0,01%	23:50:00
RTS_Standard	11 515,15	-0,02%	23:50:00
RTSI_DEREX	1620.34	0.64%	18:45:00

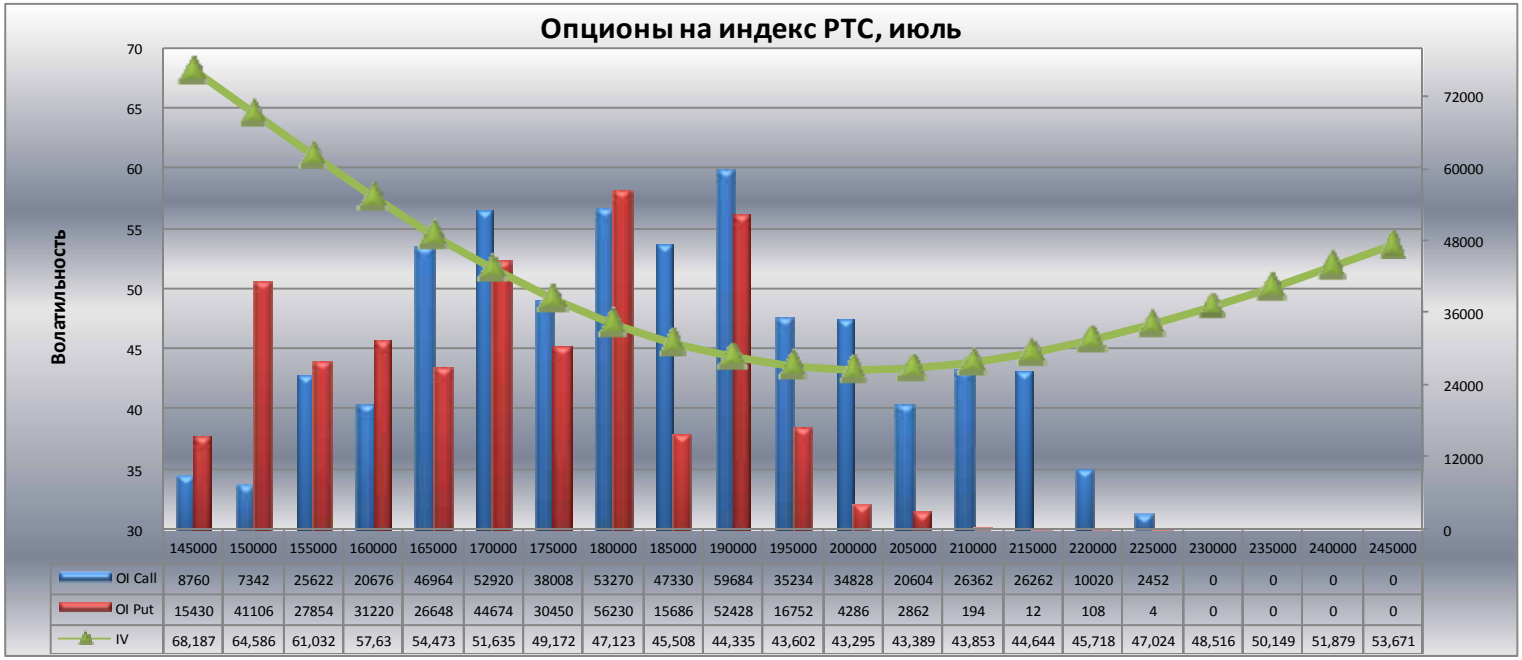
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,7	1036882	30439565843,37	154860
ROSN-9.11	-0,49	45828	15260967,00	19958
LKOH-9.11	-0,94	100036	93883251,00	16166
GAZR-9.11	-0,41	636812	340836838,00	16850
GMKR-9.11	-0,64	48112	40487149,00	64052
SBRF-9.11	-0,51	1113000	530808008,00	7868
VTBR-9.11	-0,85	214848	31161011,00	6878
GOLD-9.11	0,61	133106	686978142,86	1898,7
Si-9.11	0,12	1482814	1084390081,00	29171
Eu-9.11	-0,09	118302	7543555,00	41894
ED-9.11	-0,21	148336	713952272,60	1,4363
SBPR-9.11	-0,83	115350	3554202,00	6698
RTSS-9.11	-0,58	32196	26001420,00	9684,5
BR-7.11	1,09	75 256	338801472,09	108,18

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,18	1 027 624	158388041043,00	156585
ROSN-9.11	0,4	45 796	470284776,00	20 056
LKOH-9.11	-0,01	98 956	2659978023,00	16 320
GAZR-9.11	-0,64	635 252	6562656394,00	16 920
GMKR-9.11	-0,32	48 096	695744973,00	64 466
SBRF-9.11	1,23	1111324	8875606757,00	8007
VTBR-9.11	1,63	214710	267114116,00	6930
GOLD-9.11	1,92	132 478	2897184734,00	1 887,10
Si-9.11	0,02	1485276	25407775871,00	29119
Eu-9.11	-0,19	118 256	691126168,00	41 930
ED-9.11	-0,18	159 078	4198292755,00	1,4393
SBPR-9.11	2,11	115490	64933901,00	6782
RTSS-9.11	0,6	32058	269144545,00	9762,5
BR-7.11	-1,09	68 754	1937946893,00	107,01

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	8760	7342	25622	20676	46964	52920	38008	53270	47330	59684	35234	34828	20604	26362	26262	10020	2452	0	0	0	0
OI Put	15430	41106	27854	31220	26648	44674	30450	56230	15686	52428	16752	4286	2862	194	12	108	4	0	0	0	0
IV	68,187	64,586	61,032	57,63	54,473	51,635	49,172	47,123	45,508	44,335	43,602	43,295	43,389	43,853	44,644	45,718	47,024	48,516	50,149	51,879	53,671

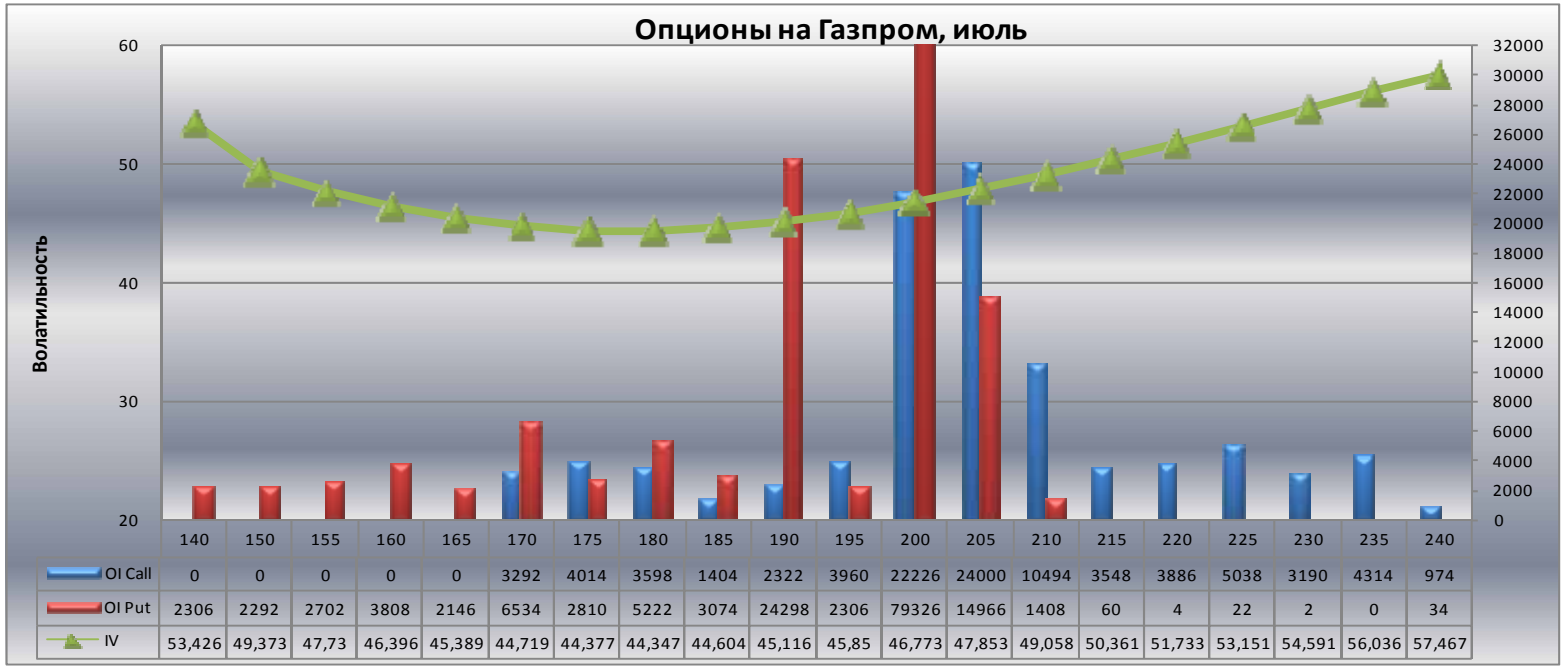
Опционы на Сбербанк, июль



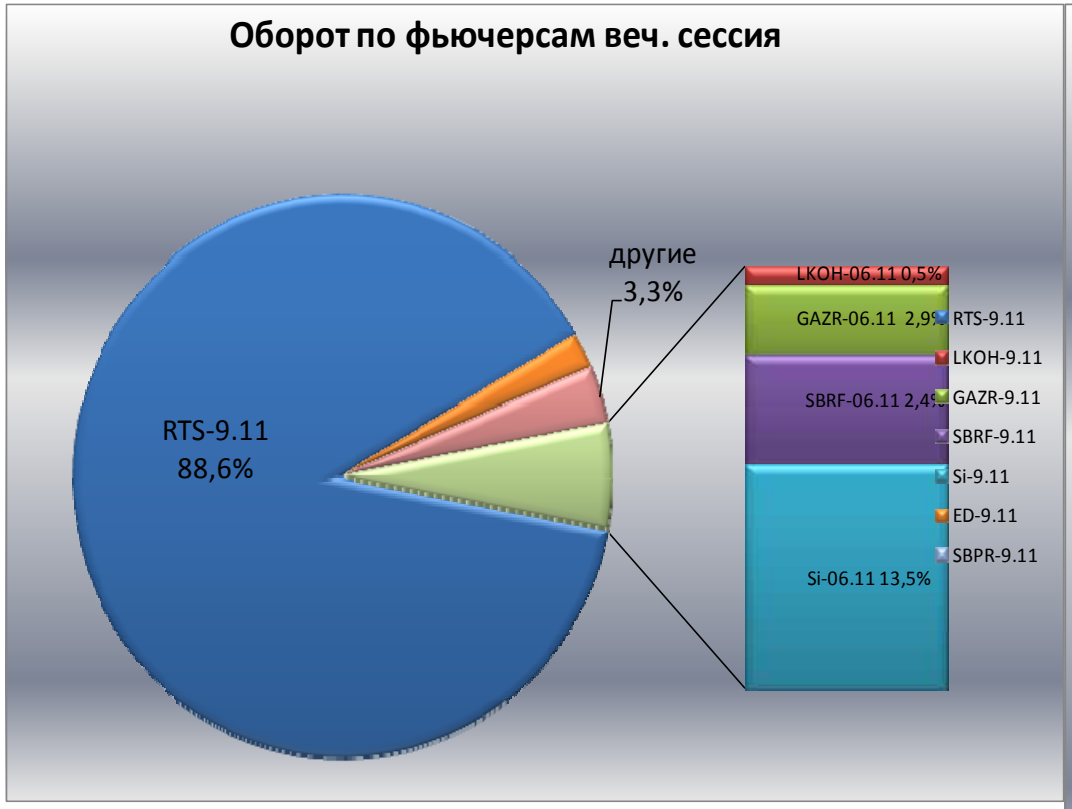
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	2110	4650	7128	27054	25614	12190	8714	13324	18958	17674	9378	11274	4126	15342	1710	1284
OI Put	2046	3504	2366	4696	4454	8506	5996	7262	38408	6944	5114	18256	6462	5174	536	38	342	168	2	0
IV	61,751	54,918	52,3	50,291	48,909	48,152	47,99	48,378	49,254	50,543	52,17	54,056	56,127	58,316	60,562	62,816	65,034	67,184	69,24	71,184

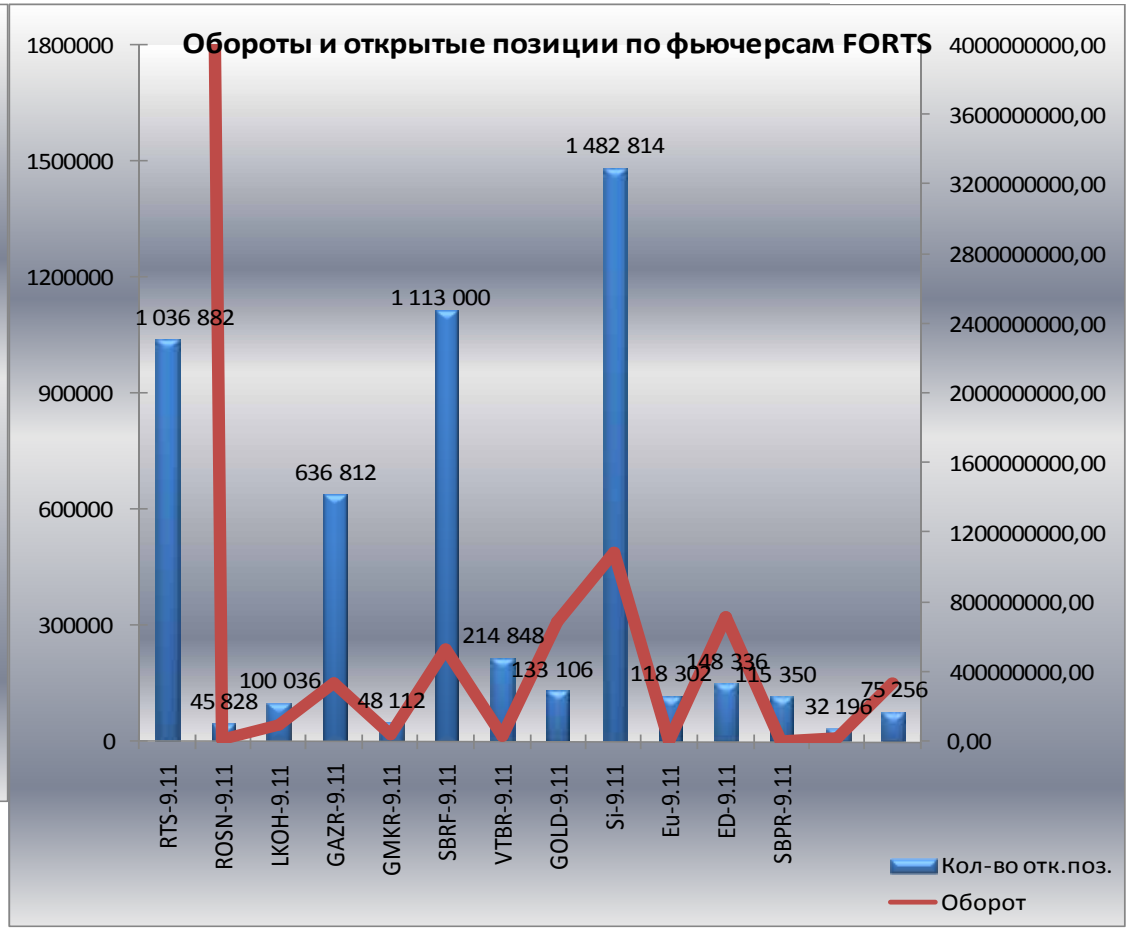


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	40	426	440	2700	2756	1730	1386	272	292	160	70	0
OI Put	0	4	4	14	968	628	920	1086	876	3708	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	58,46	54,829	51,359	48,149	42,807	40,772	39,198	38,09	37,445	37,244	37,461	38,056	38,984	40,193	41,63	43,244	44,987	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	3292	4014	3598	1404	2322	3960	22226	24000	10494	3548	3886	5038	3190	4314	974
OI Put	2306	2292	2702	3808	2146	6534	2810	5222	3074	24298	2306	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	53,426	49,373	47,73	46,396	45,389	44,719	44,377	44,347	44,604	45,116	45,85	46,773	47,853	49,058	50,361	51,733	53,151	54,591	56,036	57,467


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-9.11
88,6%
другие
3,3%
LKOH-06.11 0,5%
GAZR-06.11 2,9%
SBRF-06.11 2,4%
Si-06.11 13,5%
RTS-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
SBRF-9.11
Si-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11


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
1 036 882
45 828
100 036
636 812
48 112
1 113 000
214 848
133 106
1 482 814
118 302
148 336
115 350
32 196
75 256
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