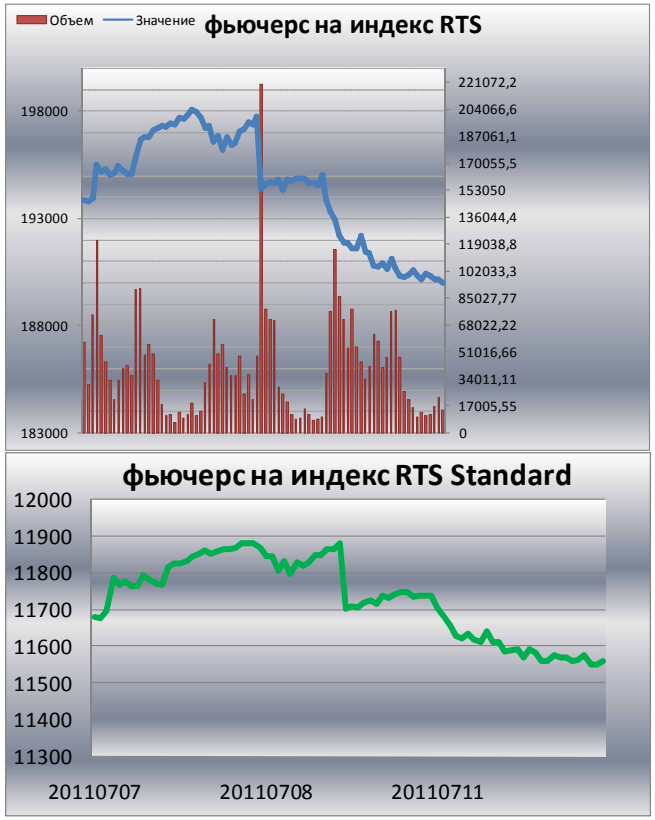
Среда: позитивные ожидания на рынке

В среду 24 августа мировые рынки в основном продолжили некоторый рост. В США Бюджетное управление Конгресса изменило прогноз по бюджетному дефициту США на год с 1,4 трлн до 1,3 трлн долл. Ожидается, что благодаря снижению госрасходов и низкой процентной ставки с течением времени (прибл. 10 лет) долг уменьшится почти вдвое. Индекс DJ Industrial вырос на 1,29% до 11320,71 пунктов , а S&P 500 на 1,31% до 1177,6..

По итогам европейской торговой сессии индексы закрылись уверенно положительно: FTSE 100 вырос на 1,49%, CAC 40 вырос на 1,79%, а DAX 30 на 2,6%.

Что касается российского рынка, внутри дня наблюдался умеренный рост, с некоторым замедлением к вечеру. По итогам вечерних торгов Газпром изменился на –0,07%, Лукойл на +0,26%, Роснефть на –0,16%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на –0,01% и -0,1%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0,08% и –0,06%.



	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	158900	1589,00	-0,18	992 542	164,41%	29 589 752 581	87,77%
ROSN-9.11	20250	202,50	-0,15	58 592	69,39%	18 804 403	9,90%
LKOH-9.11	16908	1690,80	0,26	106 662	40,93%	99 691 423	10,47%
GAZR-9.11	17369	173,69	-0,07	635 894	55,29%	357 733 401	7,58%
GMKR-9.11	64830	6483,00	0,28	49 606	210,46%	17 850 580	10,60%
SBRF-9.11	7840	78,40	0,08	1 116 968	35,13%	500 189 220	19,24%
VTBR-9.11	7197	0,0720	-0,06	216 490	2490,83%	35 030 837	52,42%
GOLD-9.11	1769	1769,0000	-0,56	120 102	106,25%	1 135 994 246	3438,59%
Si-9.11	28958	28,96	-0,01	1 253 738	7588,81%	1 134 711 085	1941,49%
Eu-9.11	41768	41,77	-0,10	118 252	-74,72%	7 057 856	0,18%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,12	163 200	581,82%	724 314 379	3902,97%
SBPR-9.11	6611	66,11	0,18	127 004	-40,94%	4 675 633	0,39%
RTSS-9.11	9879	9878,50	-0,01	32 134	-36,36%	21 595 760	3,93%
BR-9.11	110	110,30	0,09	55 966	67,64%	466 563 453	4996,01%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	53795,7	0,02%	00:13:28
CAC 40	3139,55	1,79%	19:35:17
DAX 30	5681,08	2,69%	19:35:31
DJ Industrial	11320,71	1,29%	00:35:05
FTSE 100	5205,85	1,49%	19:35:31
Hang Seng	19675,42	1,07%	10:06:48
Nikkei 225	8772,36	1,54%	10:00:05
S&P 500	1177,6	1,31%	00:02:14
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1735,9	-0,85%	10:07:02
Palladium	743,38	-0,12%	10:06:47
Platinum	1808	0,32%	10:06:56
RTSI	1 602,46	0,40%	23:50:00
RTS_Standard	9 897,20	0,20%	23:50:00
RTSI_DEREX	1643.20	1.62%	18:45:00

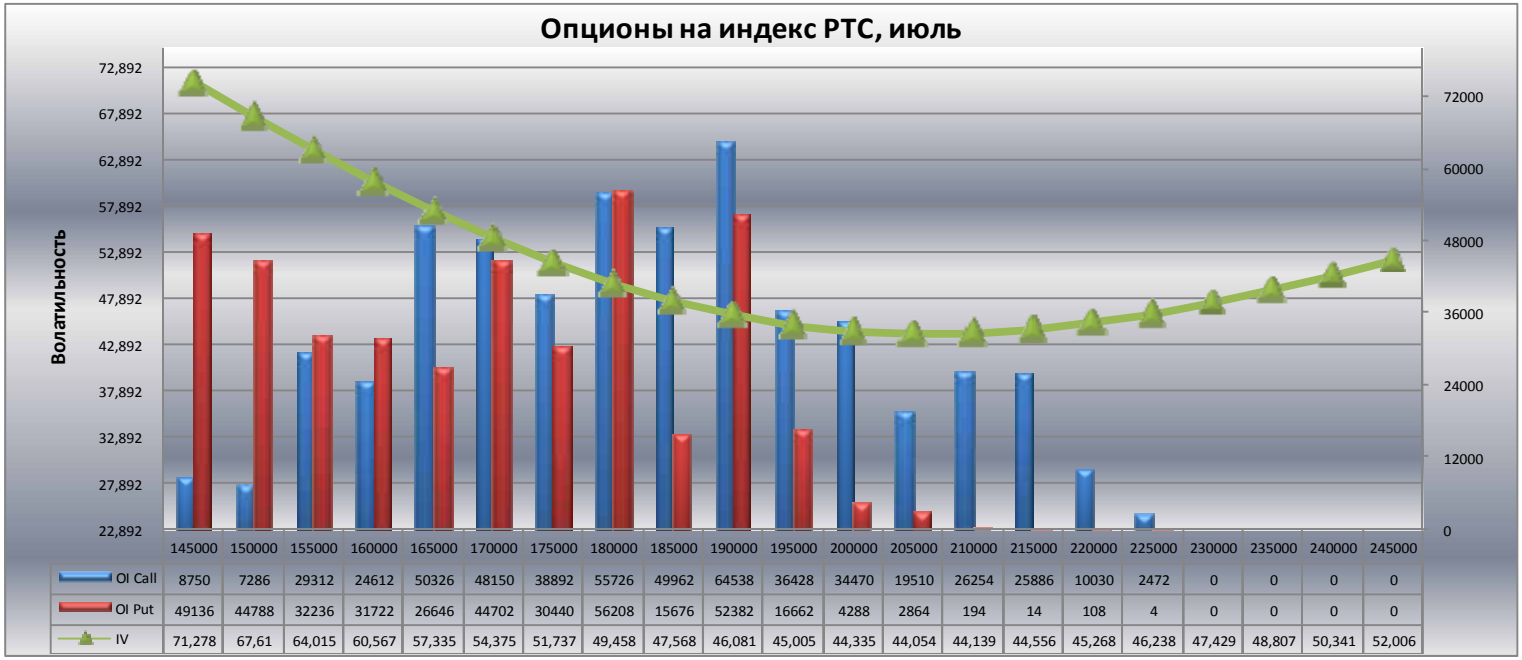
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,18	992542	29589752581,32	158900
ROSN-9.11	-0,15	58592	18804403,00	20250
LKOH-9.11	0,26	106662	99691423,00	16908
GAZR-9.11	-0,07	635894	357733401,00	17369
GMKR-9.11	0,28	49606	17850580,00	64830
SBRF-9.11	0,08	1116968	500189220,00	7840
VTBR-9.11	-0,06	216490	35030837,00	7197
GOLD-9.11	-0,56	120102	1135994245,77	1769
Si-9.11	-0,01	1253738	1134711085,00	28958
Eu-9.11	-0,1	118252	7057856,00	41768
ED-9.11	-0,12	163200	724314379,30	1,4419
SBPR-9.11	0,18	127004	4675633,00	6611
RTSS-9.11	-0,01	32134	21595760,00	9878,5
BR-9.11	0,09	55 966	466563453,02	110,3

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	23 936	18558032,00	45660
ED-9.09	-0,17	215 036	1186585721,79	1
BR-9.09	1,34	50 492	549103769,14	70,64
SBPR-9.09	2,83	33 384	9338717,00	2866

Опционы на индекс РТС, июль

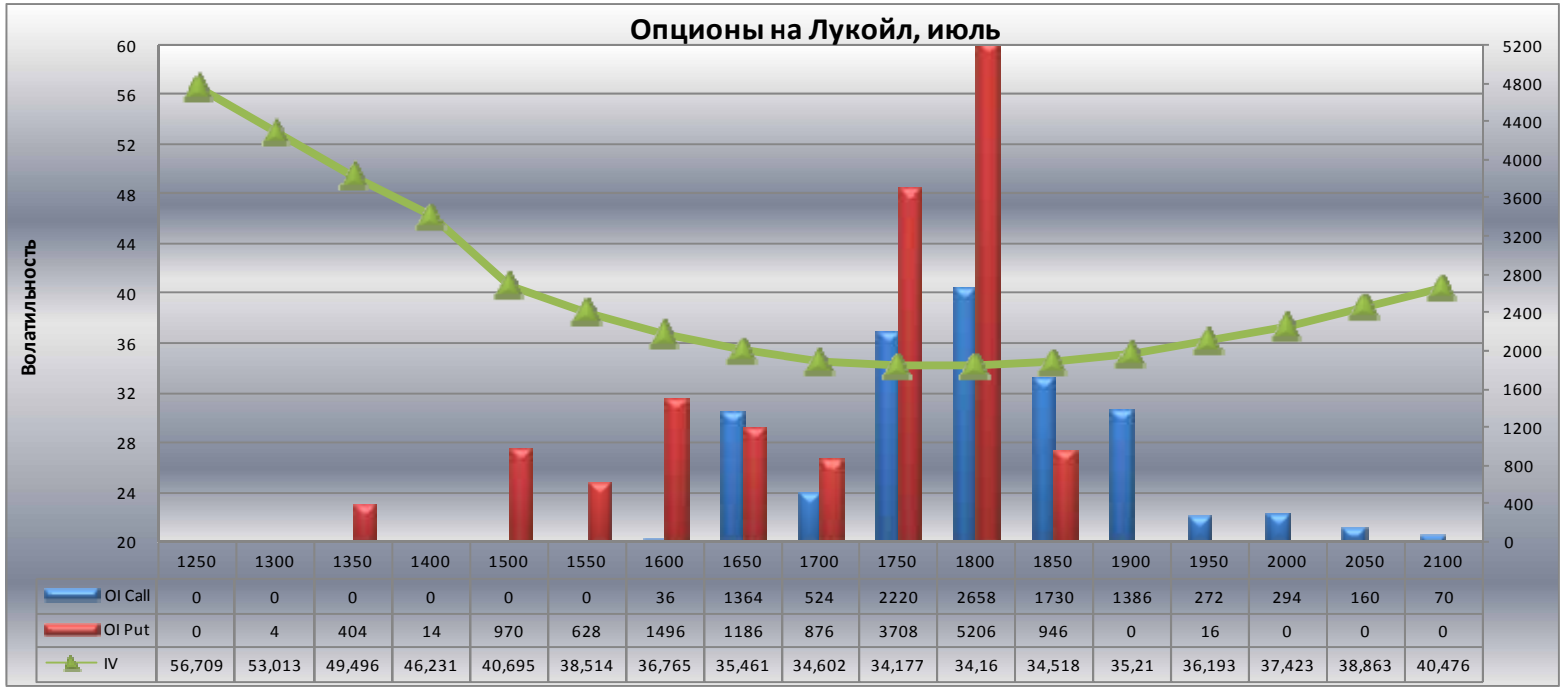


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	8750	7286	29312	24612	50326	48150	38892	55726	49962	64538	36428	34470	19510	26254	25886	10030	2472	0	0	0	0
OI Put	49136	44788	32236	31722	26646	44702	30440	56208	15676	52382	16662	4288	2864	194	14	108	4	0	0	0	0
IV	71,278	67,61	64,015	60,567	57,335	54,375	51,737	49,458	47,568	46,081	45,005	44,335	44,054	44,139	44,556	45,268	46,238	47,429	48,807	50,341	52,006

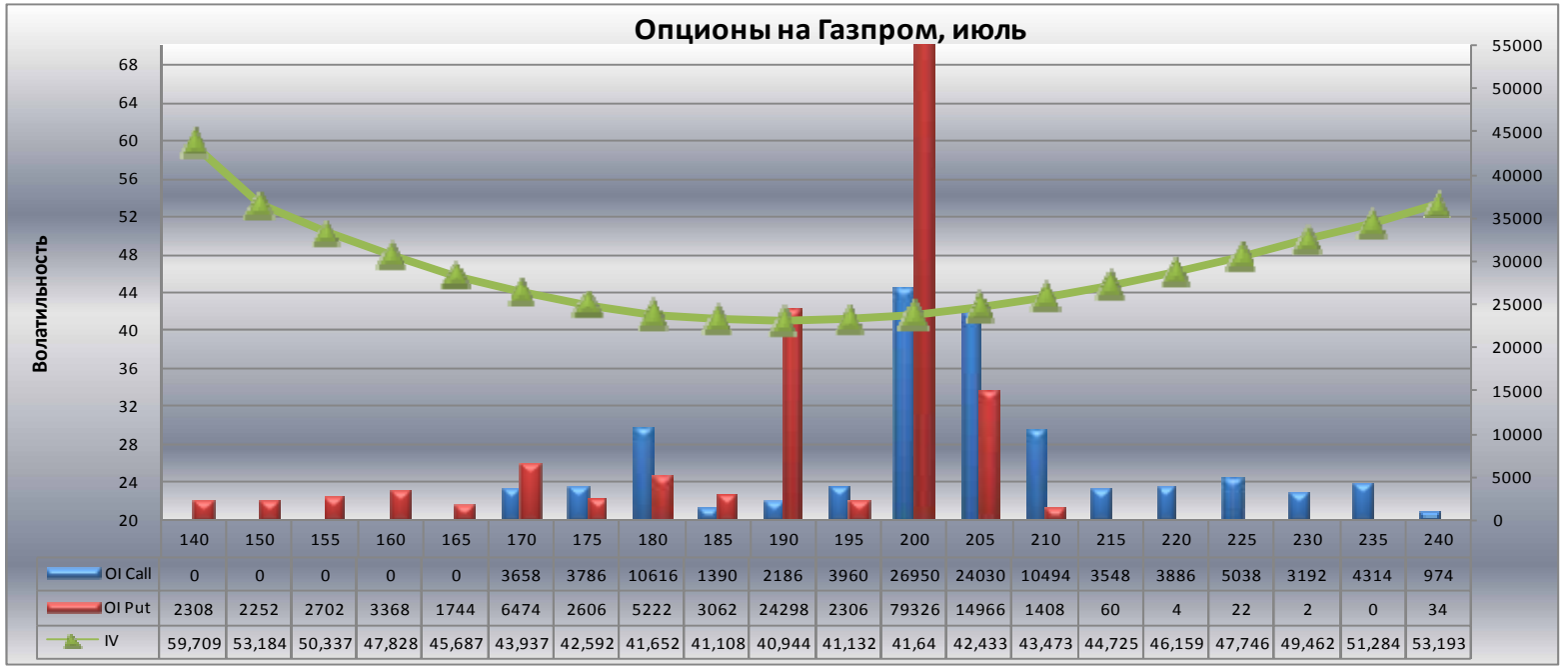
Опционы на Сбербанк, июль



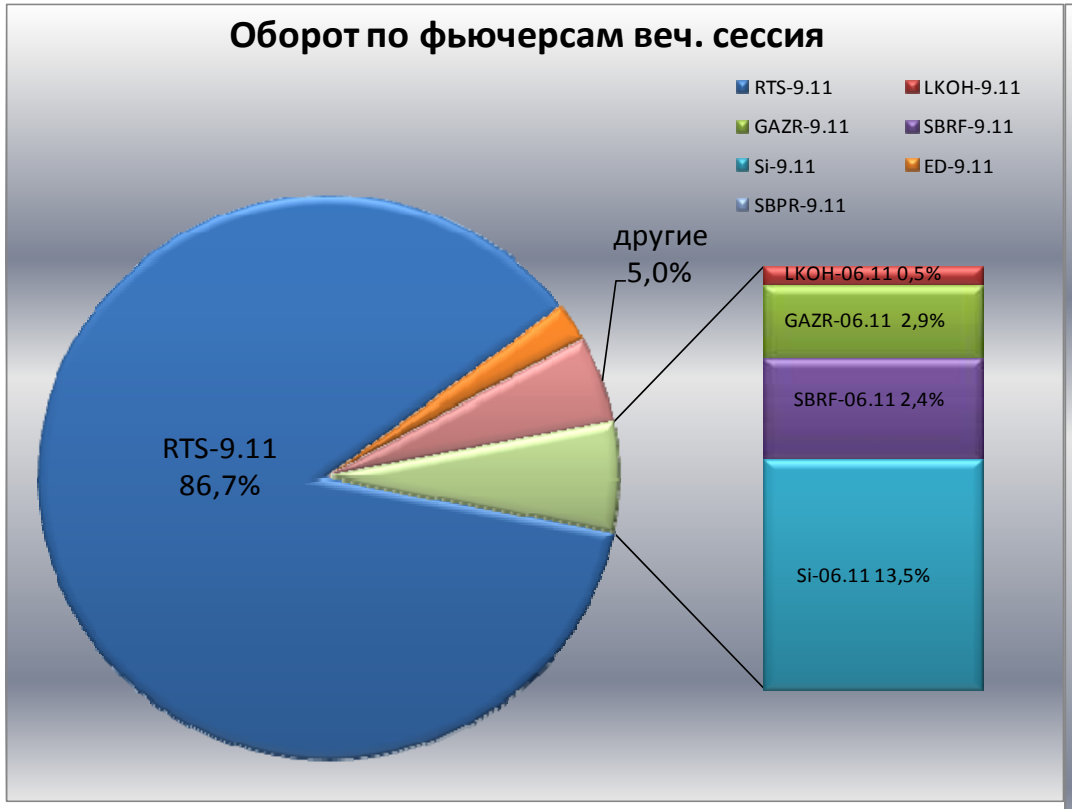
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	4814	6844	7486	26162	25532	12318	8688	15888	19040	17664	9378	11288	4126	15342	1710	1284
OI Put	2960	5734	4284	6132	4398	8486	6002	6862	38186	6942	5040	18236	6442	4946	536	38	342	168	2	0
IV	62,168	57,256	55,429	54,046	53,11	52,61	52,523	52,817	53,449	54,377	55,555	56,944	58,508	60,217	62,045	63,968	65,967	68,023	70,12	72,242

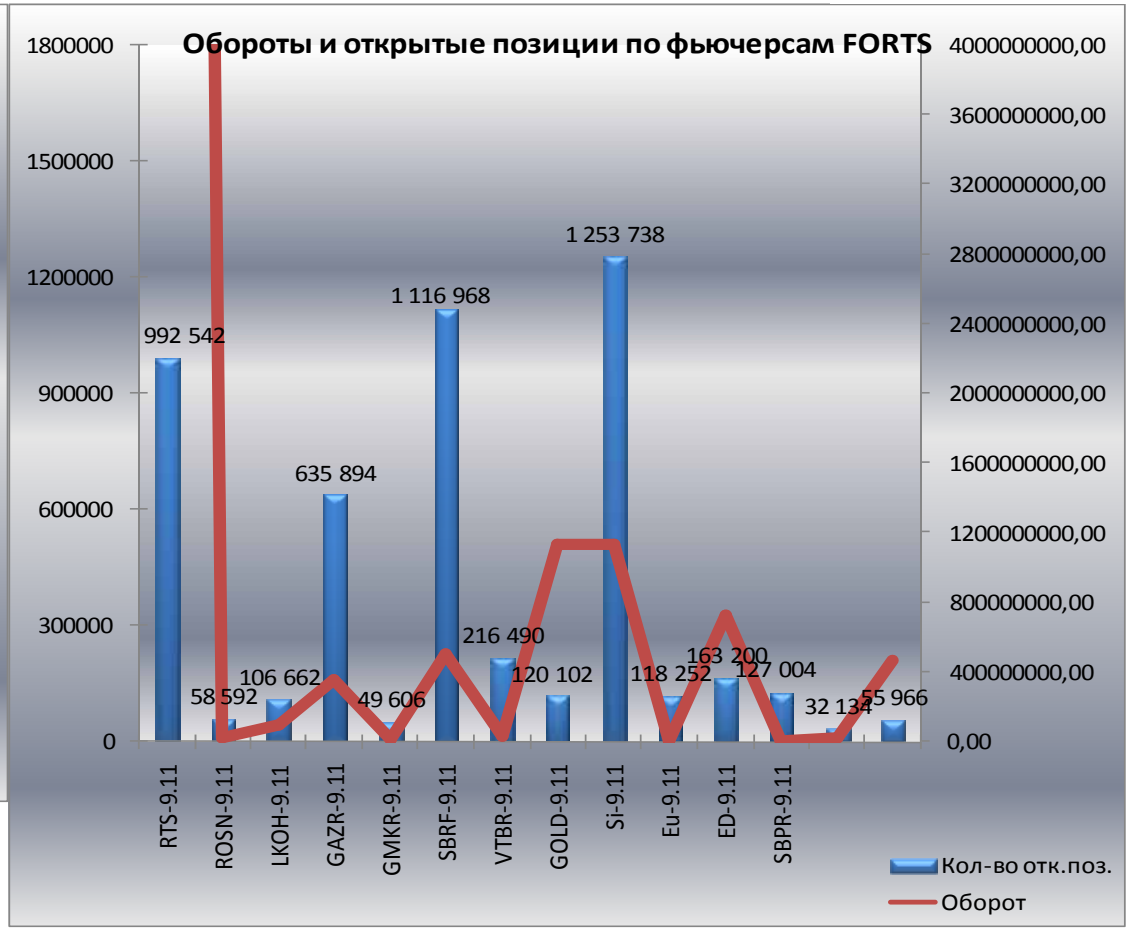


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	36	1364	524	2220	2658	1730	1386	272	294	160	70
OI Put	0	4	404	14	970	628	1496	1186	876	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	56,709	53,013	49,496	46,231	40,695	38,514	36,765	35,461	34,602	34,177	34,16	34,518	35,21	36,193	37,423	38,863	40,476



	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	3658	3786	10616	1390	2186	3960	26950	24030	10494	3548	3886	5038	3192	4314	974
OI Put	2308	2252	2702	3368	1744	6474	2606	5222	3062	24298	2306	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	59,709	53,184	50,337	47,828	45,687	43,937	42,592	41,652	41,108	40,944	41,132	41,64	42,433	43,473	44,725	46,159	47,746	49,462	51,284	53,193


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
5,0%
RTS-9.11
86,7%
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
992 542
58 592
106 662
635 894
49 606
1 116 968
216 490
120 102
1 253 738
118 252
163 200
127 004
32 134
55 966
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