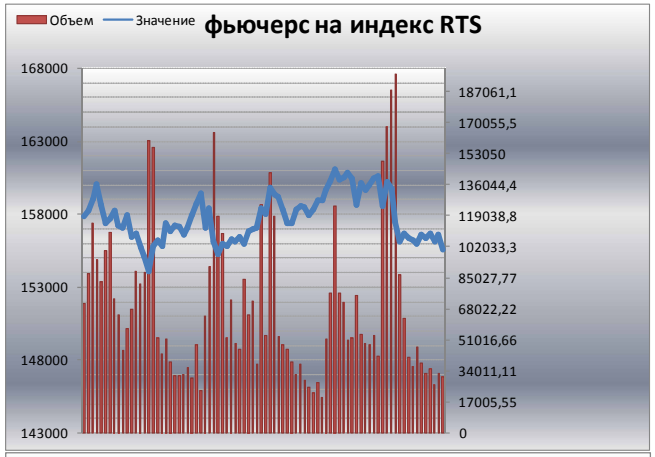
Четверг: умеренно отрицательная динамика

В четверг 24 августа мировые рынки несколько утратили «бычий настрой»: рынки как европейского региона, так и США закончили вечернюю торговую сессию в «красной зоне». Вышедшие данные по занятости в США, а также макроданные по Европе в основном носили негативный характер. В итоге индекс DJ Industrial упал на 1,51% до 11149,82 пунктов , а S&P 500 на 1,56% до 1159,27..

По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 упал на 1,44%, CAC 40 на 0,65%, а DAX 30 на 1,71%.

Что касается российского рынка, по итогам вечерних торгов РТС упал на –1,07%, составив 1583,97 пункта. Газпром упал на 1,57%, Лукойл на 1,97%, Роснефть на 1,51%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,21% и +0,1%, акции Сбербанка и ВТБ изменились на –0,5% и -1,77%.

Ключевым фактором, который сможет задать настроения на рынках на следующей неделе, может стать пятничное долгожданное выступление Бена Бернанке.





	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	155530	1555,30	-0,94	1 045 894	178,62%	33 343 914 373	98,91%
ROSN-9.11	19976	199,76	0,13	57 116	65,12%	8 635 000	4,55%
LKOH-9.11	16544	1654,40	0,10	115 152	52,15%	96 601 014	10,14%
GAZR-9.11	17084	170,84	-0,54	634 630	54,99%	609 582 200	12,91%
GMKR-9.11	64169	6416,90	-0,41	50 276	214,66%	60 991 530	36,20%
SBRF-9.11	7885	78,85	-0,50	1 128 716	36,55%	663 159 158	25,51%
VTBR-9.11	7106	0,0711	-1,77	205 612	2360,65%	19 673 373	29,44%
GOLD-9.11	1774	1773,8000	1,86	99 920	71,60%	409 637 695	1239,95%
Si-9.11	29023	29,02	0,21	1 322 948	8013,26%	1 131 892 954	1936,67%
Eu-9.11	41698	41,70	0,10	118 486	-74,67%	1 707 577	0,04%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,12	162 794	580,12%	712 605 764	3839,88%
SBPR-9.11	6597	65,97	-0,38	118 208	-45,03%	1 321 865	0,11%
RTSS-9.11	9750	9750,00	-0,18	33 432	-33,79%	6 638 510	1,21%
BR-7.11	110	110,43	1,00	54 992	64,73%	332 052 054	3555,65%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	52953,3	-1,57%	00:14:29
CAC 40	3119	-0,65%	19:35:17
DAX 30	5584,14	-1,71%	19:35:29
DJ Industrial	11149,82	-1,51%	00:36:04
FTSE 100	5131,1	-1,44%	19:35:32
Hang Seng	19787,95	0,18%	10:35:17
Nikkei 225	8797,78	0,29%	10:00:03
S&P 500	1159,27	-1,56%	00:03:59
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1768,1	-0,24%	10:35:22
Palladium	747,25	0,01%	10:31:35
Platinum	1810,75	-0,08%	10:35:11
RTSI	1 585,67	0,14%	23:50:00
RTS_Standard	9 793,26	0,14%	23:50:00
RTSI_DEREX	1623.14	-1.22%	18:45:00

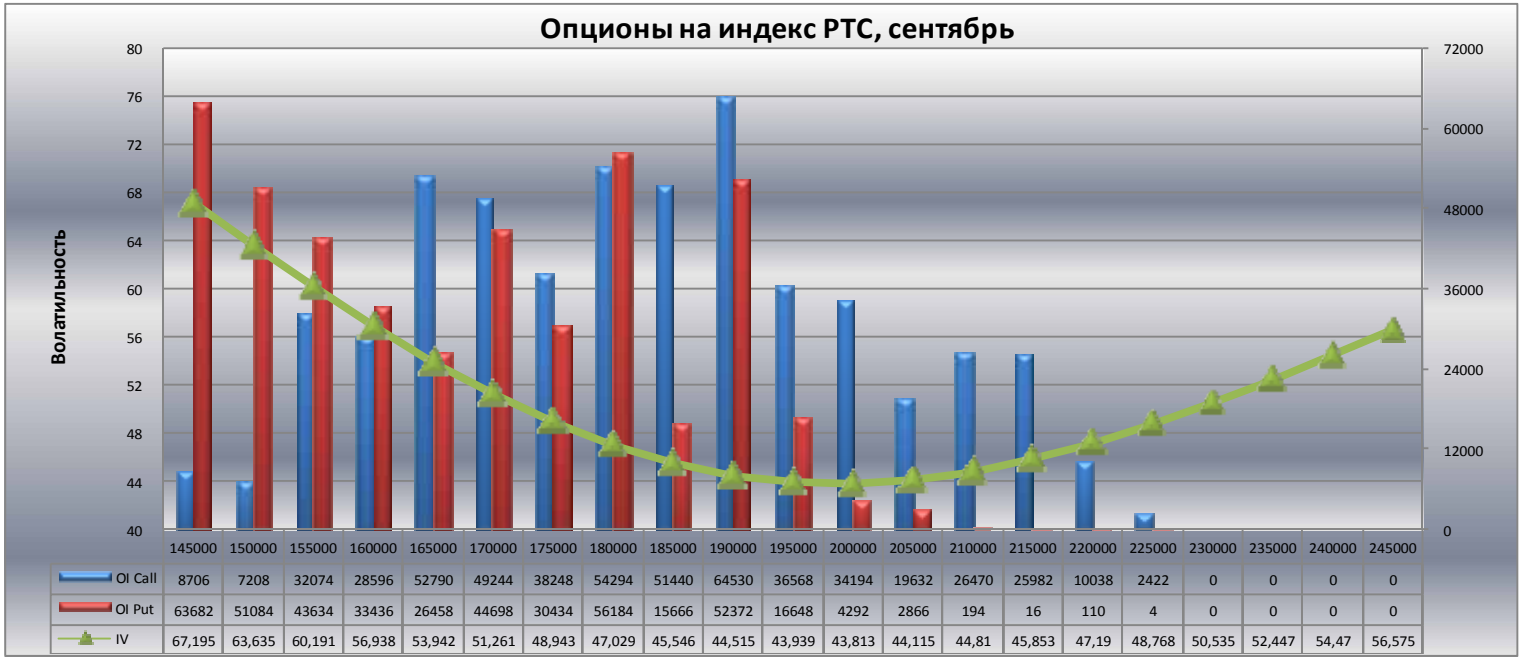
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,94	1 045 894	33343914373,00	155530
ROSN-9.11	0,13	57 116	8635000,00	19976
LKOH-9.11	0,1	115 152	96601014,00	16544
GAZR-9.11	-0,54	634 630	609582200,00	17084
GMKR-9.11	-0,41	50 276	60991530,00	64169
SBRF-9.11	-0,5	1 128 716	663159158,00	7885
VTBR-9.11	-1,77	205 612	19673373,00	7106
GOLD-9.11	1,86	99 920	409637695,00	1773,8
Si-9.11	0,21	1 322 948	1131892954,00	29023
Eu-9.11	0,1	118 486	1707577,00	41698
ED-9.11	-0,12	162 794	712605764,00	1,438
SBPR-9.11	-0,38	118 208	1321865,00	6597
RTSS-9.11	-0,18	33 432	6638510,00	9750
BR-7.11	1	54 992	332052054,00	110,43

Дневная сессия

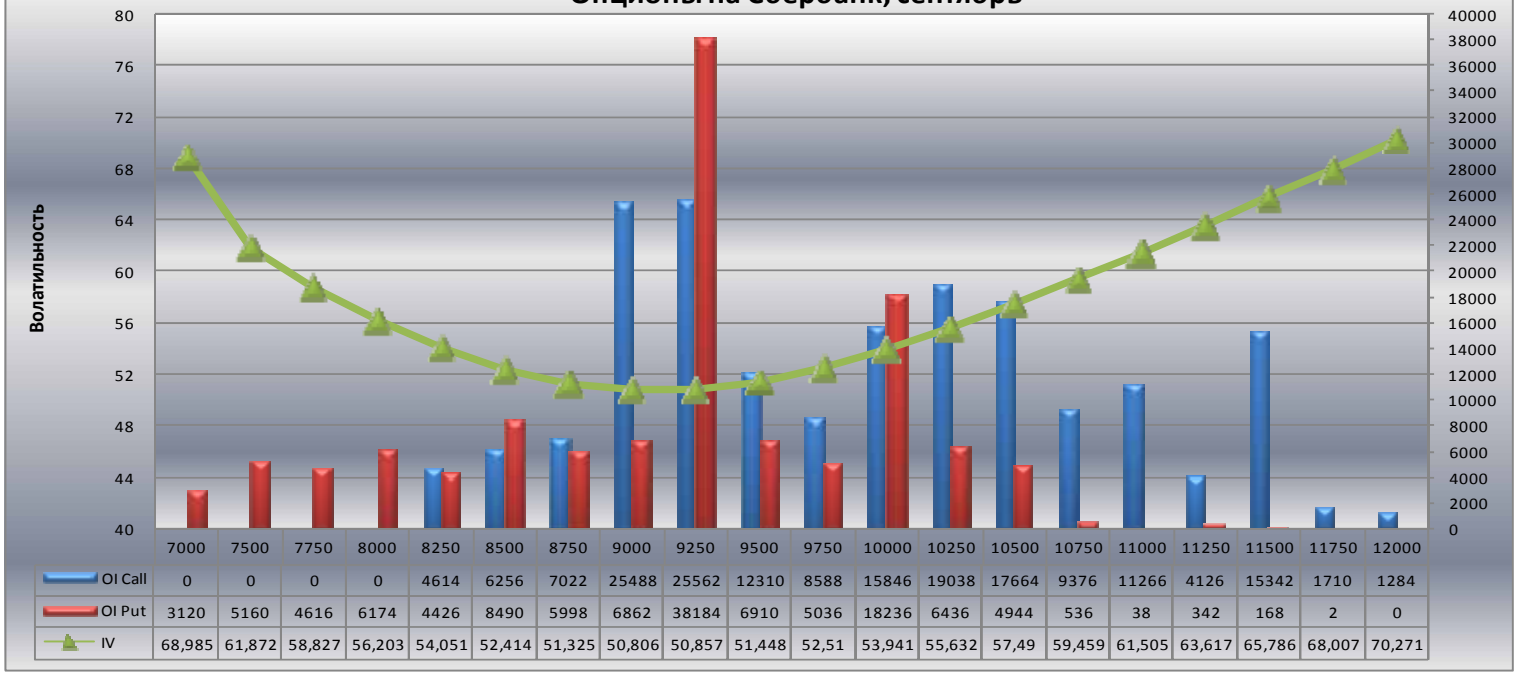
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296	25786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662	4390
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,8	955,2
Si-9.09	0,03	467760	3969232519	31929
Eu-9.09	-0,31	23936	18558032	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585722	1,4317
BR-9.09	1,34	50492	549103769,1	70,64
SBPR-9.09	2,83	33384	9338717	2866

Опционы на индекс РТС, сентябрь

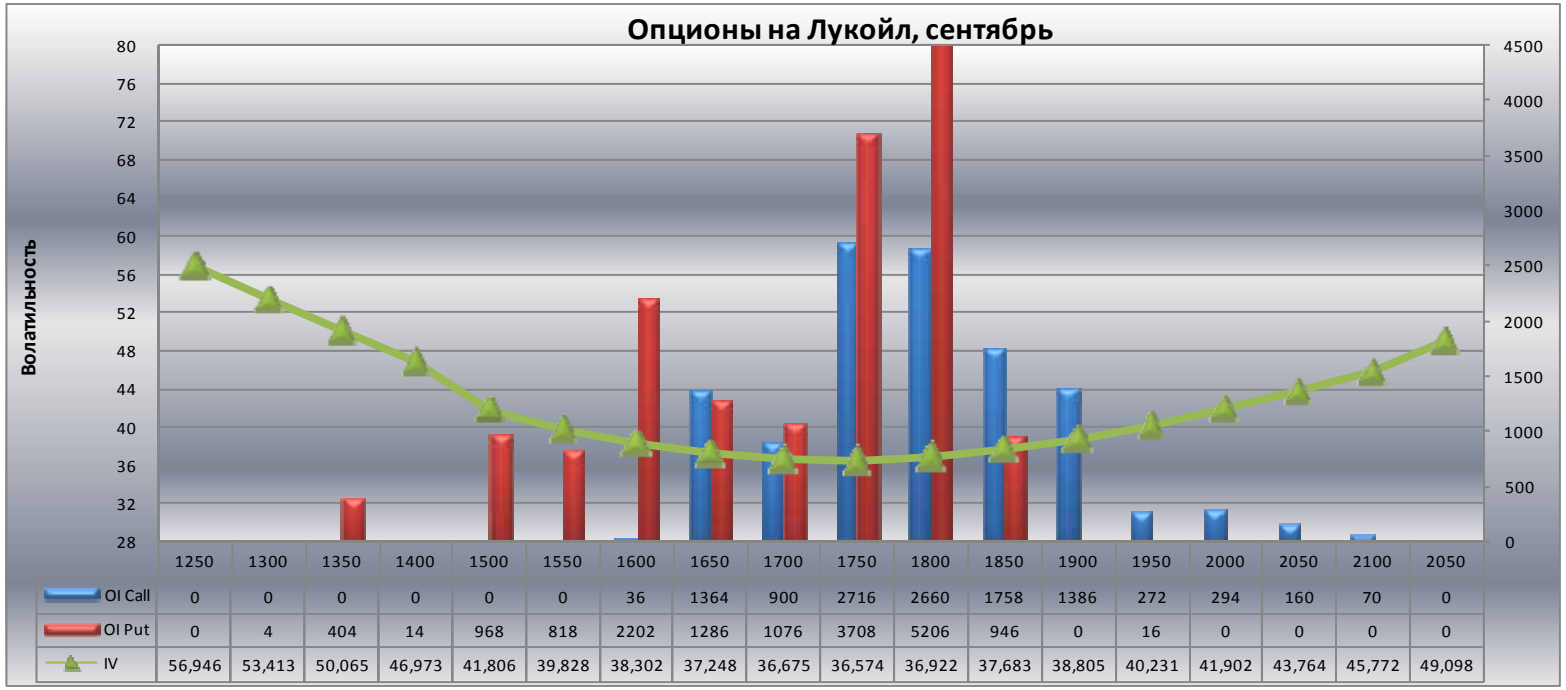


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	8706	7208	32074	28596	52790	49244	38248	54294	51440	64530	36568	34194	19632	26470	25982	10038	2422	0	0	0	0
OI Put	63682	51084	43634	33436	26458	44698	30434	56184	15666	52372	16648	4292	2866	194	16	110	4	0	0	0	0
IV	67,195	63,635	60,191	56,938	53,942	51,261	48,943	47,029	45,546	44,515	43,939	43,813	44,115	44,81	45,853	47,19	48,768	50,535	52,447	54,47	56,575

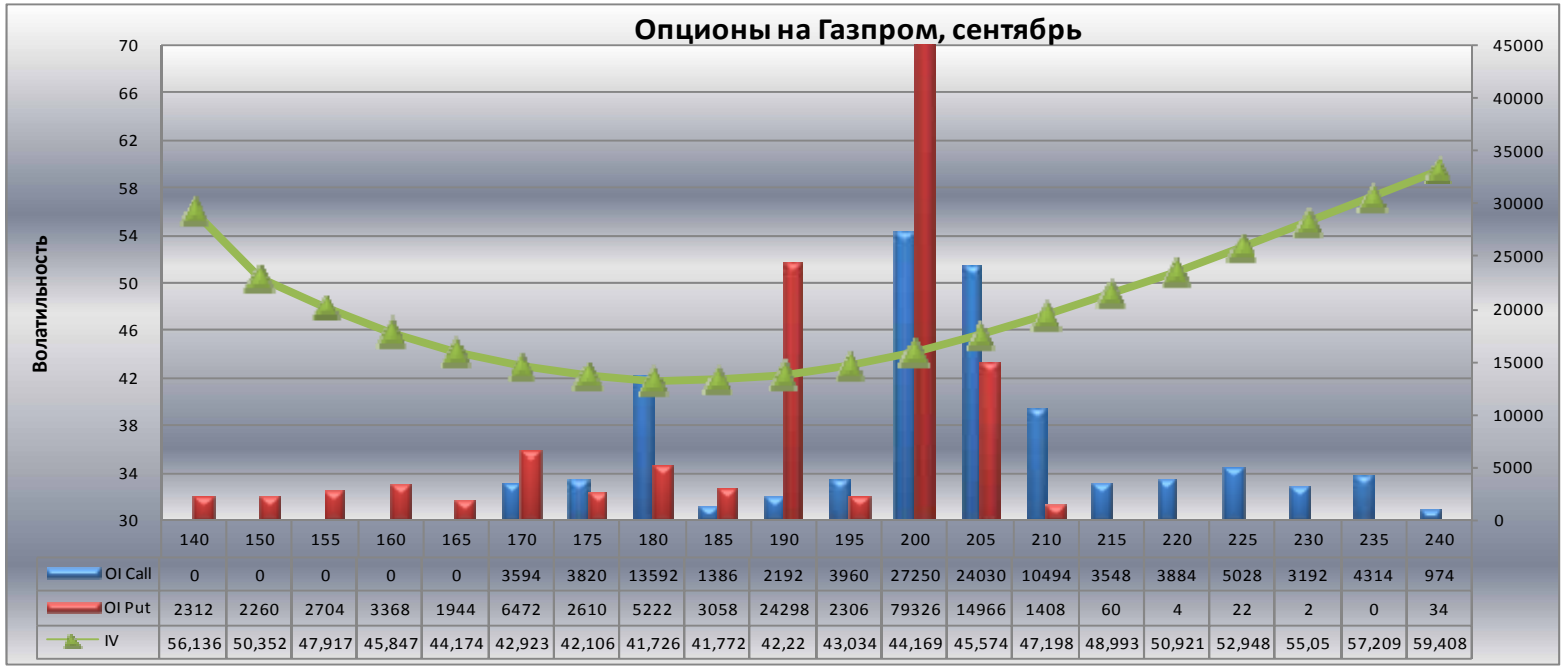
Опционы на Сбербанк, сентябрь



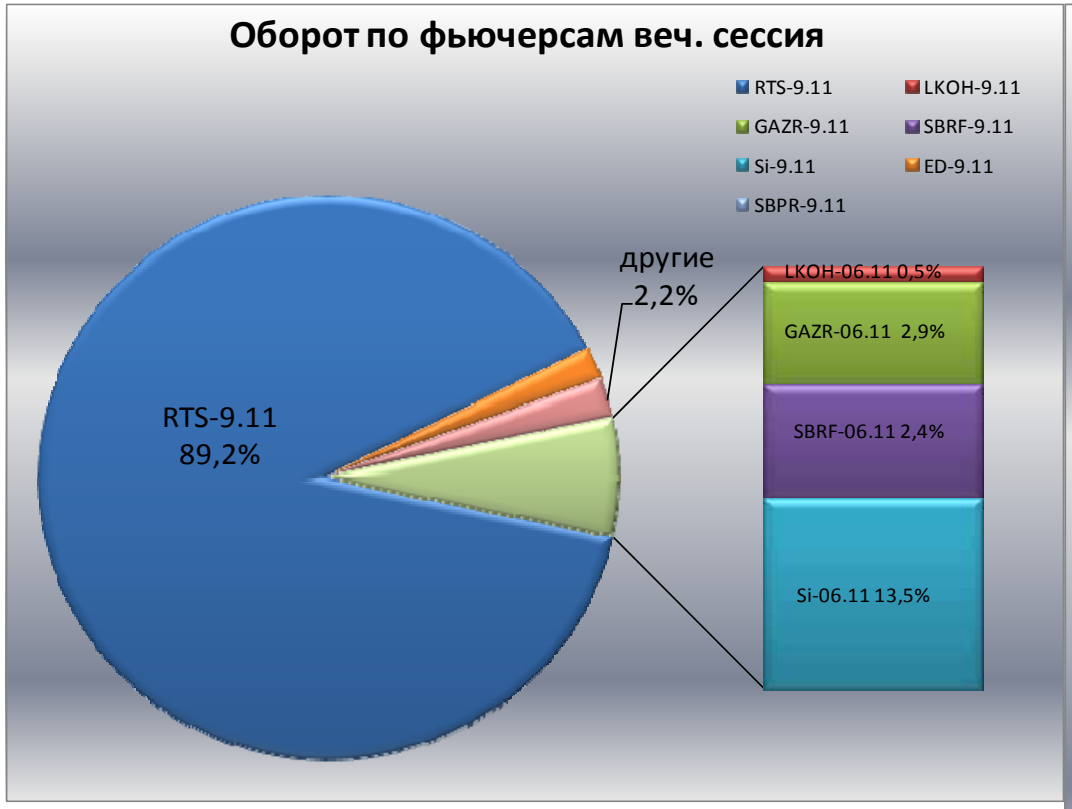
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	4614	6256	7022	25488	25562	12310	8588	15846	19038	17664	9376	11266	4126	15342	1710	1284
OI Put	3120	5160	4616	6174	4426	8490	5998	6862	38184	6910	5036	18236	6436	4944	536	38	342	168	2	0
IV	68,985	61,872	58,827	56,203	54,051	52,414	51,325	50,806	50,857	51,448	52,51	53,941	55,632	57,49	59,459	61,505	63,617	65,786	68,007	70,271

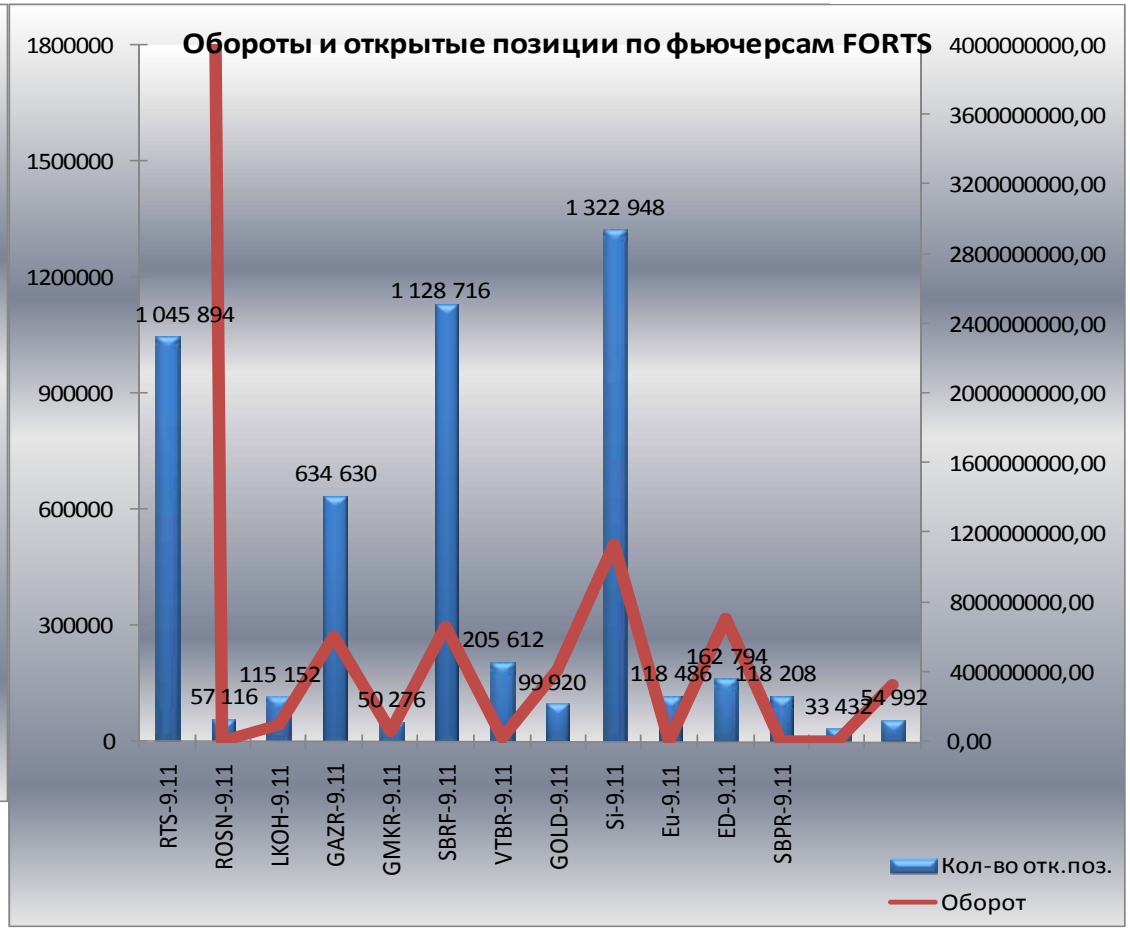


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	36	1364	900	2716	2660	1758	1386	272	294	160	70	0
OI Put	0	4	404	14	968	818	2202	1286	1076	3708	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	56,946	53,413	50,065	46,973	41,806	39,828	38,302	37,248	36,675	36,574	36,922	37,683	38,805	40,231	41,902	43,764	45,772	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	3594	3820	13592	1386	2192	3960	27250	24030	10494	3548	3884	5028	3192	4314	974
OI Put	2312	2260	2704	3368	1944	6472	2610	5222	3058	24298	2306	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	56,136	50,352	47,917	45,847	44,174	42,923	42,106	41,726	41,772	42,22	43,034	44,169	45,574	47,198	48,993	50,921	52,948	55,05	57,209	59,408


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
RTS-9.11
89,2%
другие
2,2%
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
1 045 894
57 116
115 152
634 630
50 276
1 128 716
205 612
99 920
1 322 948
118 486
162 794
118 208
33 432
54 992
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