Понедельник: преобладают позитивные настроения

В понедельник 29 августа мировые рынки в основном показывали положительную динамику. Ураган «Айрин» не повлиял сильно на индексы США, к тому же внешний фон оказался положительным: рынки Европы и Азии показали рост. По итогам сессии индекс DJ Industrial выром на 2,26% до 11539,25 пунктов , а S&P 500 на 2,83% до 1210,08.

По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 после колебаний внутри сессии закончил торговую сессию с 0% составив 5129,92 пункта, CAC 40 вырос на 2,16% составив 3154,2 пункта, а DAX 30 вырос на 2,39% составив 5670,07 пункта. Более всего инвесторов вдохновили новости в секторе M & A из Греции, что, конечно же, вселило надежду на более быстрое восстановление экономики страны.

Что касается российского рынка, площадки открылись с гэпом вверх (положительная реакция на речь Бернанке в основном), РТС составил к концу сессии 1667,66 пунктов. Газпром за вечернюю сессию изменился на –0,03%, составив 177,98 пунктов, Лукойл на –0,24% на отметке 1737,7 пункта, Роснефть на +0,18% (221,48 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,02% (28,82 пункта) и -0,2% (41,8 пункта), акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0,45% (82,24 пункта) и +0,55% (0,0765 пункта).





	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	165695	1656,95	0,00	1 108 430	0,12%	16 317 799 137	13,41%
ROSN-9.11	22148	221,48	0,18	51 662	0,79%	23 413 687	3,79%
LKOH-9.11	17377	1737,70	-0,24	94 046	-0,53%	48 101 356	2,56%
GAZR-9.11	17798	177,98	-0,03	613 698	-0,02%	191 099 375	4,38%
GMKR-9.11	70434	7043,40	-0,14	52 962	0,05%	9 380 095	1,48%
SBRF-9.11	8224	82,24	0,45	1 181 946	0,60%	409 706 233	5,90%
VTBR-9.11	7650	0,0765	0,55	212 936	-0,01%	11 470 476	2,16%
GOLD-9.11	1792	1792,3000	-0,27	111 394	-0,84%	729 338 930	13,10%
Si-9.11	28824	28,82	0,02	1 217 884	-0,17%	417 694 369	2,68%
Eu-9.11	41796	41,80	-0,20	119 160	-0,01%	1 254 337	2,00%
ED-9.11	1,45	1,45	-0,18	168 306	-16,10%	1 378 275 049	24,13%
SBPR-9.11	6894	68,94	0,45	112 490	0,31%	8 791 763	13,69%
RTSS-9.11	10325	10325,00	0,36	35 510	0,03%	1 547 555	0,72%
BR-7.11	112	112,19	-0,17	51 650	-6,31%	300 397 587	18,26%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54860,73	2,83%	09:41:13
CAC 40	3154,2	2,16%	09:41:13
DAX 30	5670,07	2,39%	09:41:13
DJ Industrial	11539,25	2,26%	09:41:13
FTSE 100	5129,92	0,00%	09:41:13
Hang Seng	20221,59	1,79%	09:52:48
Nikkei 225	8959,96	1,23%	09:52:48
S&P 500	1210,08	2,83%	09:41:13
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1794,43	0,40%	09:52:56
Palladium	749,03	-0,22%	09:43:43
Platinum	1819	0,07%	09:52:56
RTSI	1 672,64	0,30%	23:50:00
RTS_Standard	10 356,87	0,45%	23:50:00
RTSI_DEREX	1712.97	4.60%	18:45:00

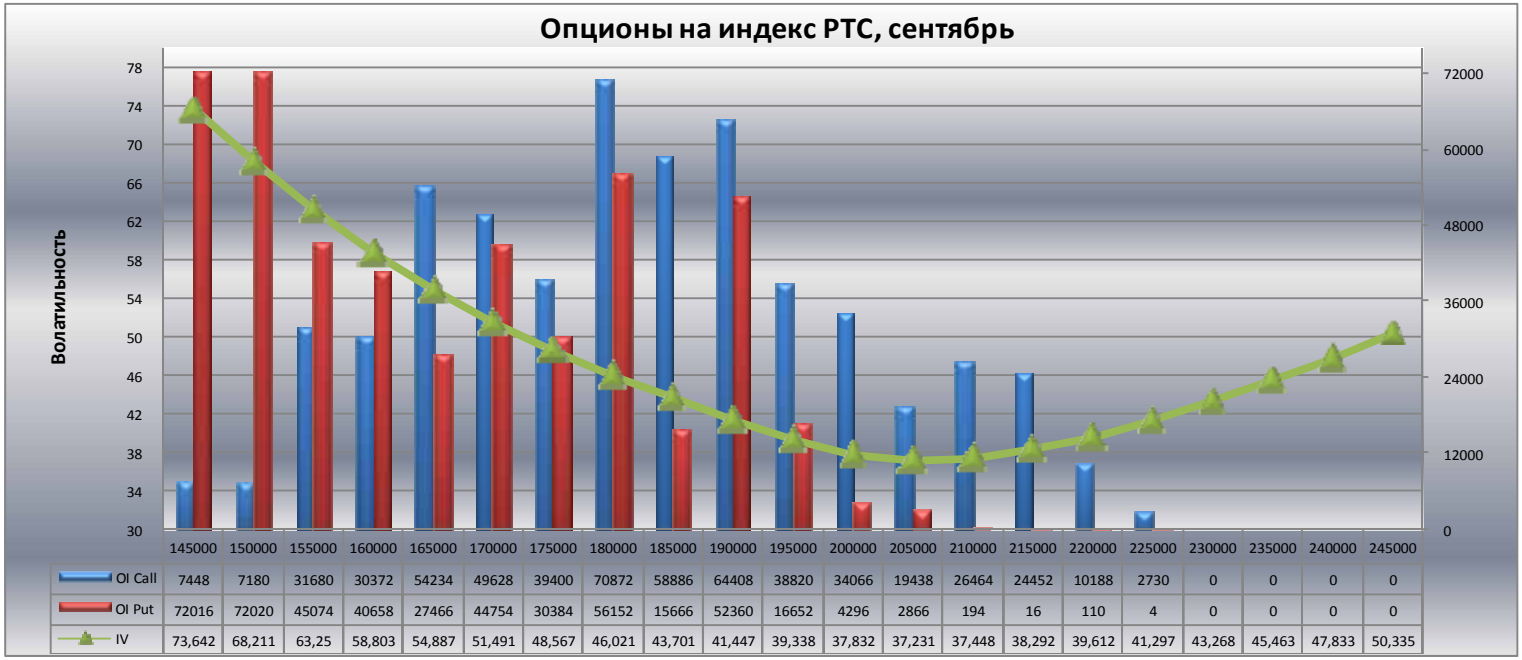
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0	1108430	16317799137,02	165695
ROSN-9.11	0,18	51662	23413687,00	22148
LKOH-9.11	-0,24	94046	48101356,00	17377
GAZR-9.11	-0,03	613698	191099375,00	17798
GMKR-9.11	-0,14	52962	9380095,00	70434
SBRF-9.11	0,45	1181946	409706233,00	8224
VTBR-9.11	0,55	212936	11470476,00	7650
GOLD-9.11	-0,27	111394	729338929,99	1792,3
Si-9.11	0,02	1217884	417694369,00	28824
Eu-9.11	-0,2	119160	1254337,00	41796
ED-9.11	-0,18	168306	1378275049,34	1,451
SBPR-9.11	0,45	112490	8791763,00	6894
RTSS-9.11	0,36	35510	1547555,00	10325
BR-7.11	-0,17	51 650	300397587,31	112,19

Дневная сессия

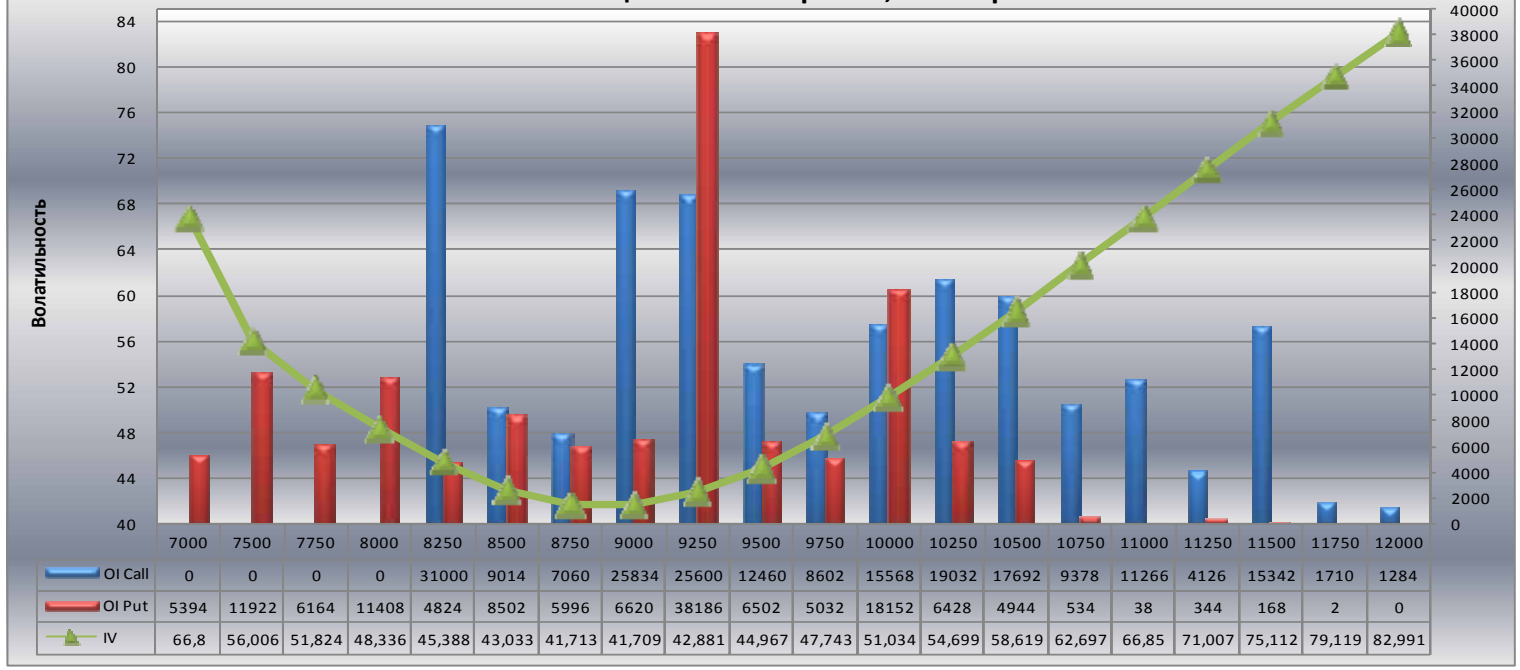
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	4,53	1107138	121704341040,51	165695
ROSN-9.11	7,01	51256	617066840,00	22108
LKOH-9.11	3,51	94544	1879518715,00	17418
GAZR-9.11	2,84	613838	4363085745,00	17804
GMKR-9.11	3,85	52934	632808542,00	70530
SBRF-9.11	4,84	1174946	6939197942,00	8187
VTBR-9.11	4,09	212948	532004988,00	7608
GOLD-9.11	0,94	112334	5565994141,60	1797,1
Si-9.11	-0,77	1219900	15577430567,00	28817
Eu-9.11	0,6	119176	62600703,00	41880
ED-9.11	1,3	200610	5712115089,67	1,4536
SBPR-9.11	4,35	112142	64203077,00	6863
RTSS-9.11	3,58	35498	216246160,00	10287,5
BR-7.11	1,67	55 130	1645056402,26	112,38

Опционы на индекс РТС, сентябрь

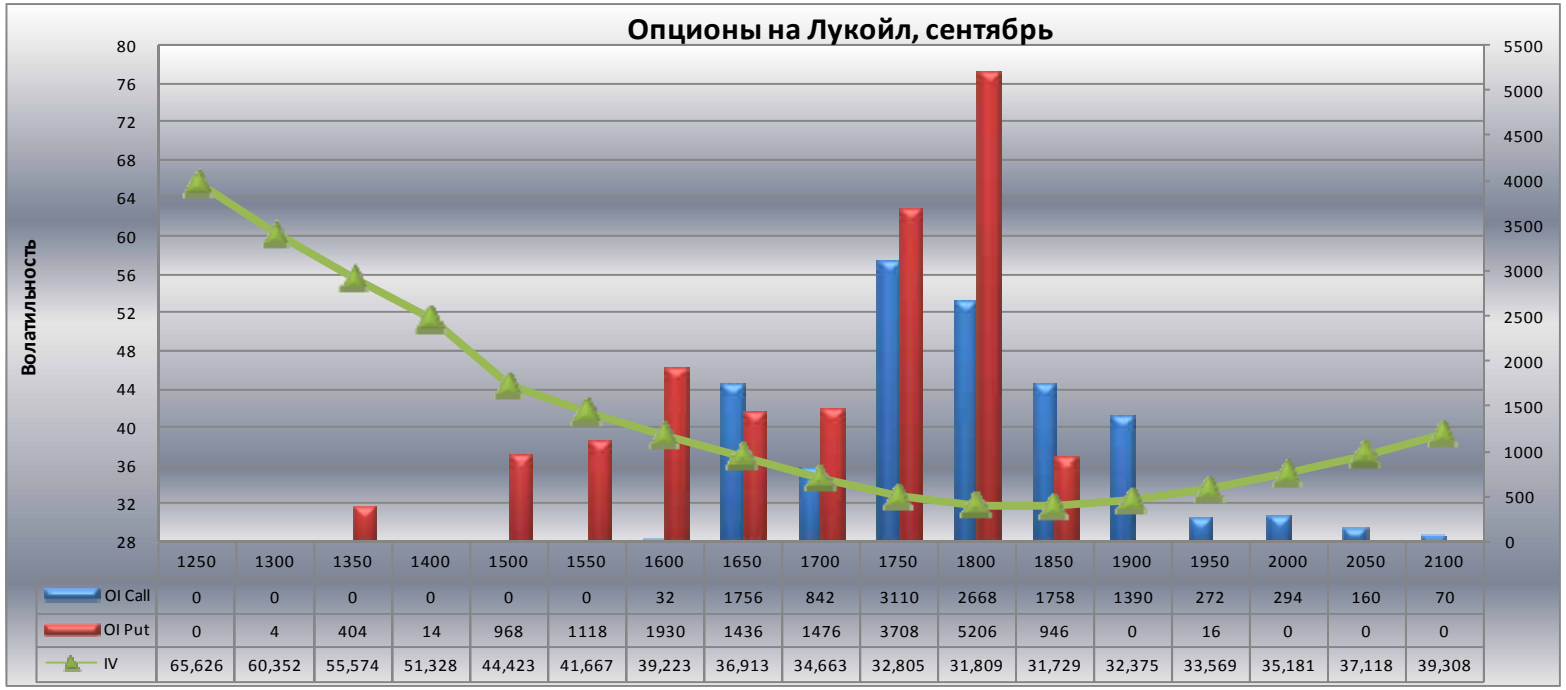


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	7448	7180	31680	30372	54234	49628	39400	70872	58886	64408	38820	34066	19438	26464	24452	10188	2730	0	0	0	0
OI Put	72016	72020	45074	40658	27466	44754	30384	56152	15666	52360	16652	4296	2866	194	16	110	4	0	0	0	0
IV	73,642	68,211	63,25	58,803	54,887	51,491	48,567	46,021	43,701	41,447	39,338	37,832	37,231	37,448	38,292	39,612	41,297	43,268	45,463	47,833	50,335

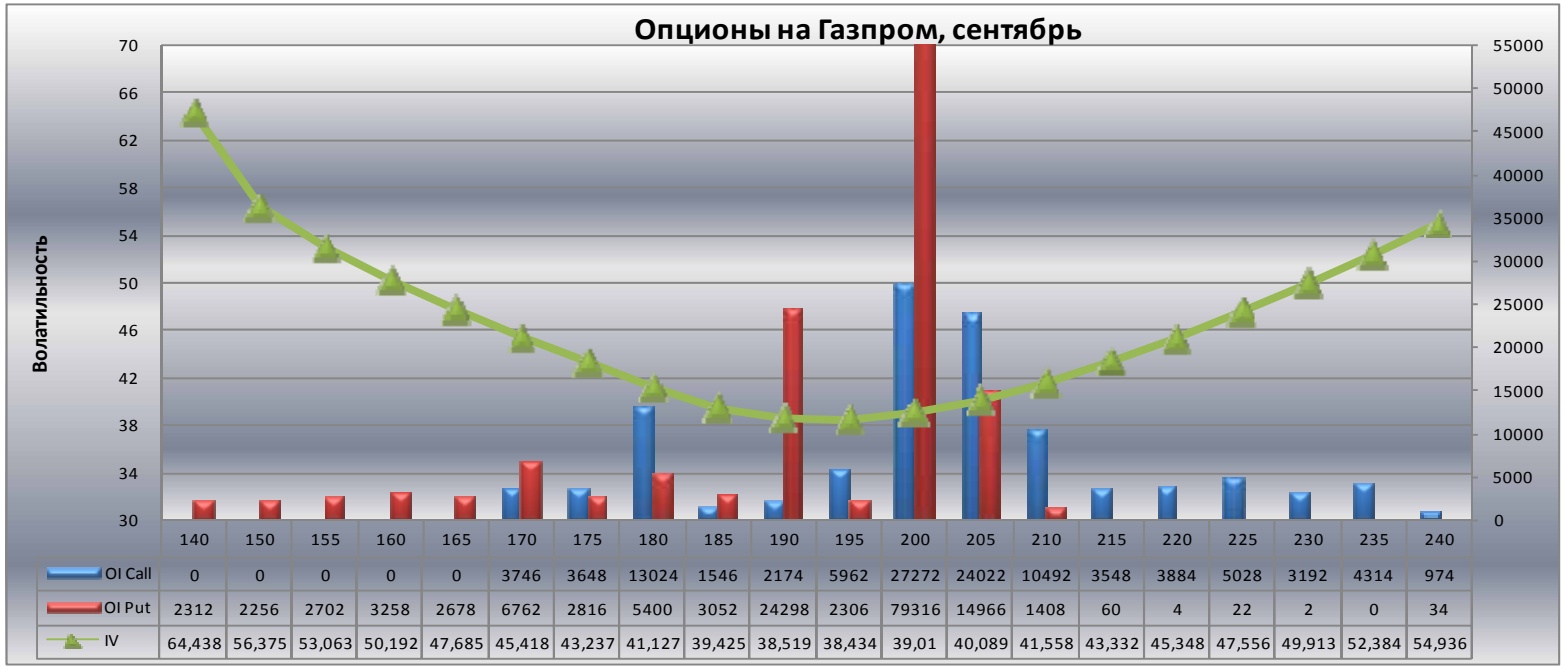
Опционы на Сбербанк, сентябрь



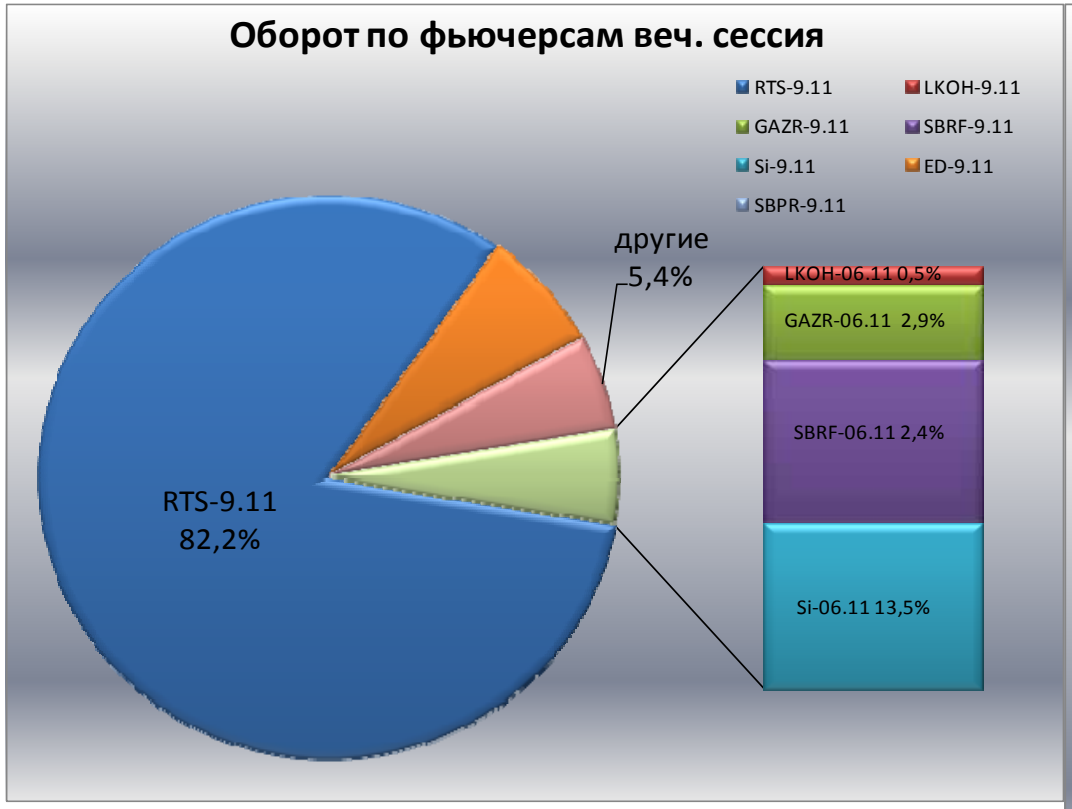
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	31000	9014	7060	25834	25600	12460	8602	15568	19032	17692	9378	11266	4126	15342	1710	1284
OI Put	5394	11922	6164	11408	4824	8502	5996	6620	38186	6502	5032	18152	6428	4944	534	38	344	168	2	0
IV	66,8	56,006	51,824	48,336	45,388	43,033	41,713	41,709	42,881	44,967	47,743	51,034	54,699	58,619	62,697	66,85	71,007	75,112	79,119	82,991

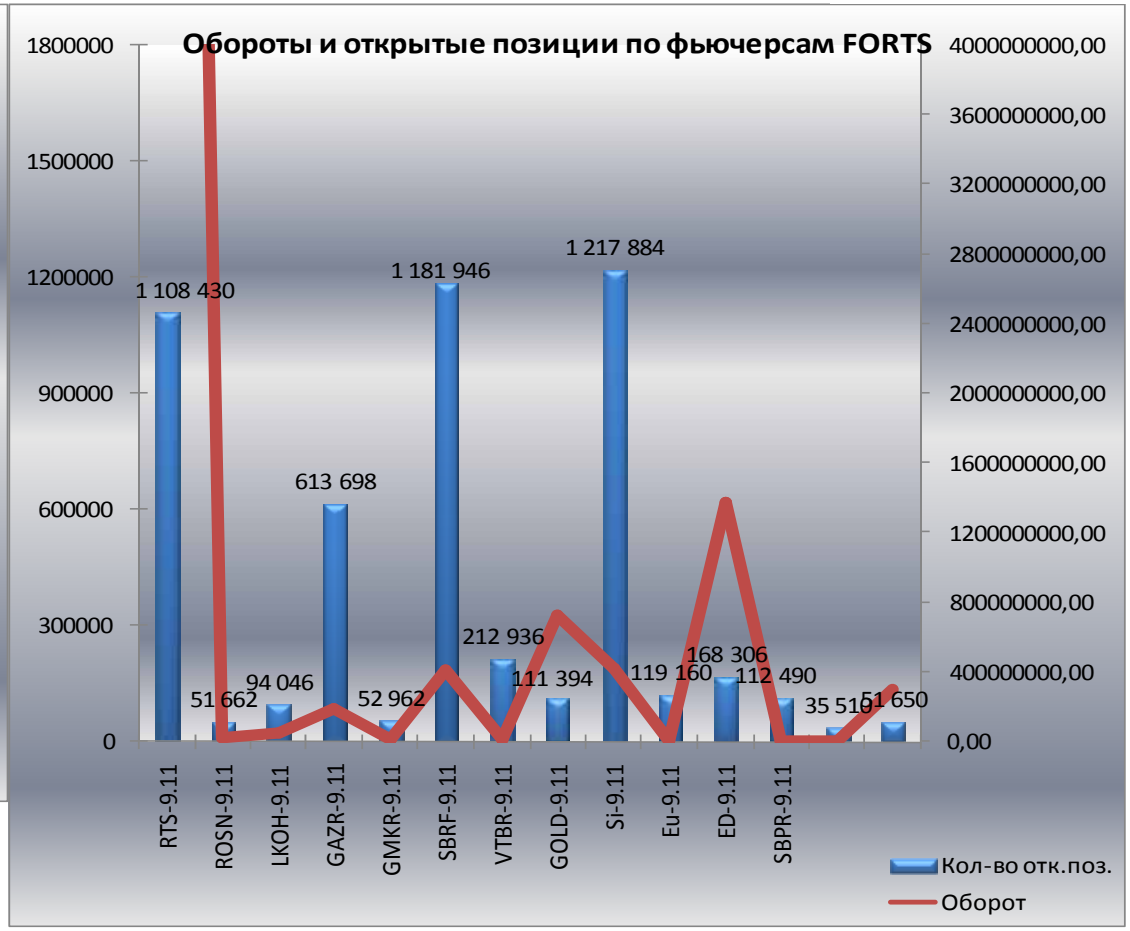


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1756	842	3110	2668	1758	1390	272	294	160	70
OI Put	0	4	404	14	968	1118	1930	1436	1476	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	65,626	60,352	55,574	51,328	44,423	41,667	39,223	36,913	34,663	32,805	31,809	31,729	32,375	33,569	35,181	37,118	39,308



	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	3746	3648	13024	1546	2174	5962	27272	24022	10492	3548	3884	5028	3192	4314	974
OI Put	2312	2256	2702	3258	2678	6762	2816	5400	3052	24298	2306	79316	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	64,438	56,375	53,063	50,192	47,685	45,418	43,237	41,127	39,425	38,519	38,434	39,01	40,089	41,558	43,332	45,348	47,556	49,913	52,384	54,936


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
5,4%
RTS-9.11
82,2%
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
1 108 430
51 662
94 046
613 698
52 962
1 181 946
212 936
111 394
1 217 884
119 160
168 306
112 490
35 510
51 650
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