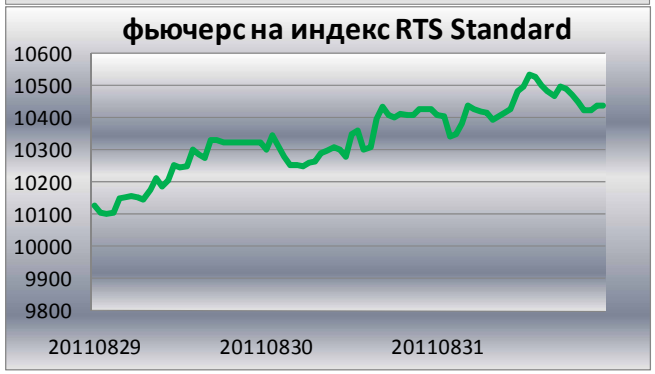
Среда: на рынках сохраняется оптимизм

По итогам минувшей сессии основные фондовые индикаторы США немного выросли: DJ Industrial вырос на 0,46% до 11613,53 пунктов , а S&P 500 на 0,49% до 1218,89. Крепятся слухи о том, что ФРС возможно примет очередной пакет мер для стимулирования роста экономики США, что не могло не повлиять на настроения инвесторов.

В Европе кабинет министров Германии одобрил законопроект по обновлению и расширению фонда стабильности EFSF. По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 вырос на 2,39% составив 5394,53 пункта, CAC 40 вырос на 3,07% составив 3256,76 пункта, а DAX 30 вырос на 2,5% составив 5784,85 пункта.

Что касается российского рынка, РТС составил к концу сессии 1677,95 пунктов. Газпром за вечернюю сессию изменился на –0,71%, составив 177,12 пунктов, Лукойл на –0,35% остановившись на отметке 1732,00 пункта, Роснефть на -0,62% (226,15 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,03% (28,92 пункта) и -0,16% (41,59 пункта), акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0,56% (84,62 пункта) и -0,13% (0,075 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	167795	1677,95	-0,65	1 081 830	188,20%	25 461 714 515	75,53%
ROSN-9.11	22615	226,15	-0,62	62 064	79,43%	16 767 279	8,83%
LKOH-9.11	17320	1732,00	-0,35	89 338	18,04%	55 744 679	5,85%
GAZR-9.11	17712	177,12	-0,71	646 518	57,89%	272 477 386	5,77%
GMKR-9.11	71412	7141,20	-0,53	51 692	223,52%	5 796 992	3,44%
SBRF-9.11	8462	84,62	-0,56	1 174 194	42,06%	536 755 448	20,65%
VTBR-9.11	7497	0,0750	-0,13	263 392	3052,13%	16 724 788	25,03%
GOLD-9.11	1829	1829,0000	0,03	110 638	90,00%	417 996 370	1265,25%
Si-9.11	28919	28,92	0,03	1 290 620	7815,00%	774 524 888	1325,21%
Eu-9.11	41594	41,59	-0,16	121 294	-74,07%	3 201 004	0,08%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,23	140 406	486,59%	827 018 266	4456,39%
SBPR-9.11	7106	71,06	-0,15	119 886	-44,25%	938 108	0,08%
RTSS-9.11	10439	10438,50	-0,63	35 668	-29,36%	12 845 340	2,34%
BR-7.11	115	114,69	0,17	63 066	88,91%	614 654 181	6581,78%

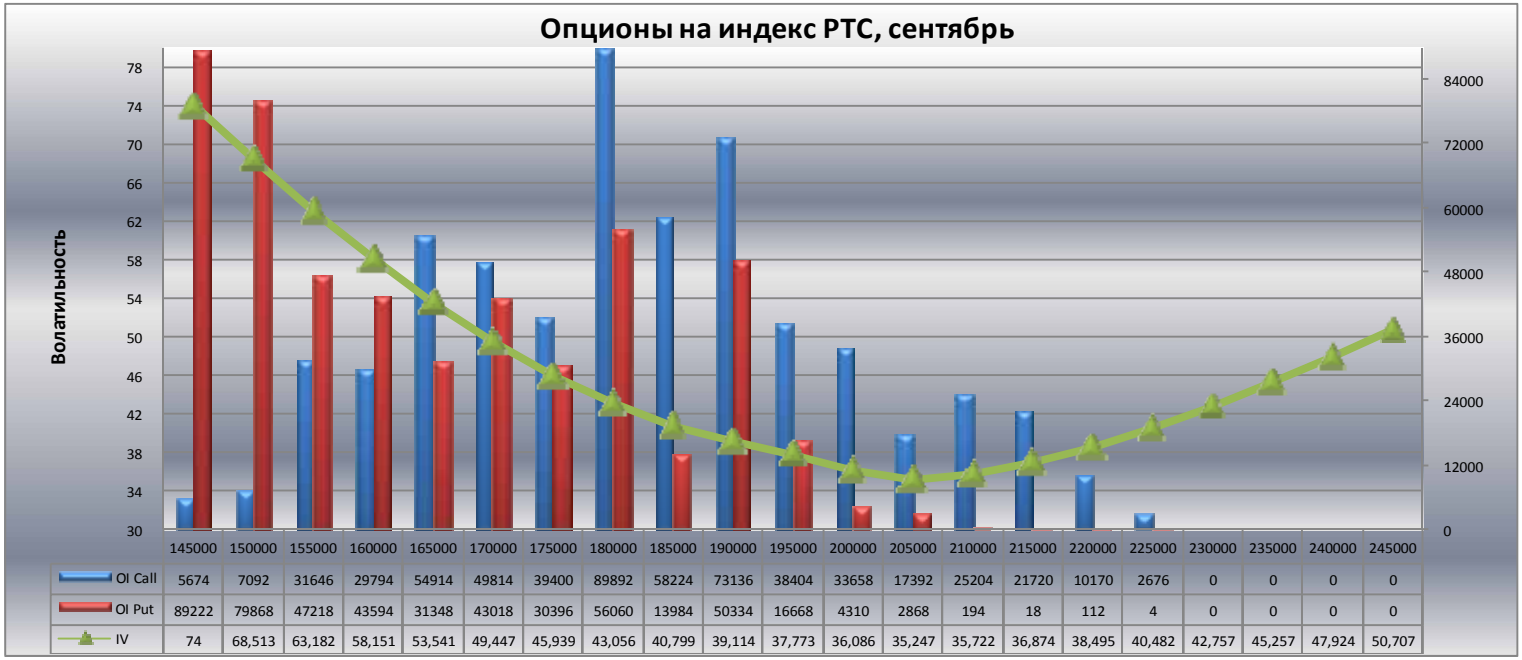
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56495,12	2,00%	00:16:30
CAC 40	3256,76	3,07%	19:35:33
DAX 30	5784,85	2,50%	19:35:33
DJ Industrial	11613,53	0,46%	00:35:40
FTSE 100	5394,53	2,39%	19:35:32
Hang Seng	20765,22	1,12%	10:06:32
Nikkei 225	9060,8	1,18%	10:00:04
S&P 500	1218,89	0,49%	00:04:29
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1821,55	-0,10%	10:06:40
Palladium	782,25	0,42%	10:06:12
Platinum	1848,5	0,50%	10:06:19
RTSI	1 696,02	-0,37%	23:50:00
RTS_Standard	10 449,23	-0,54%	23:50:00
RTSI_DEREX	1747.18	2.28%	18:45:00

Вечерняя сессия

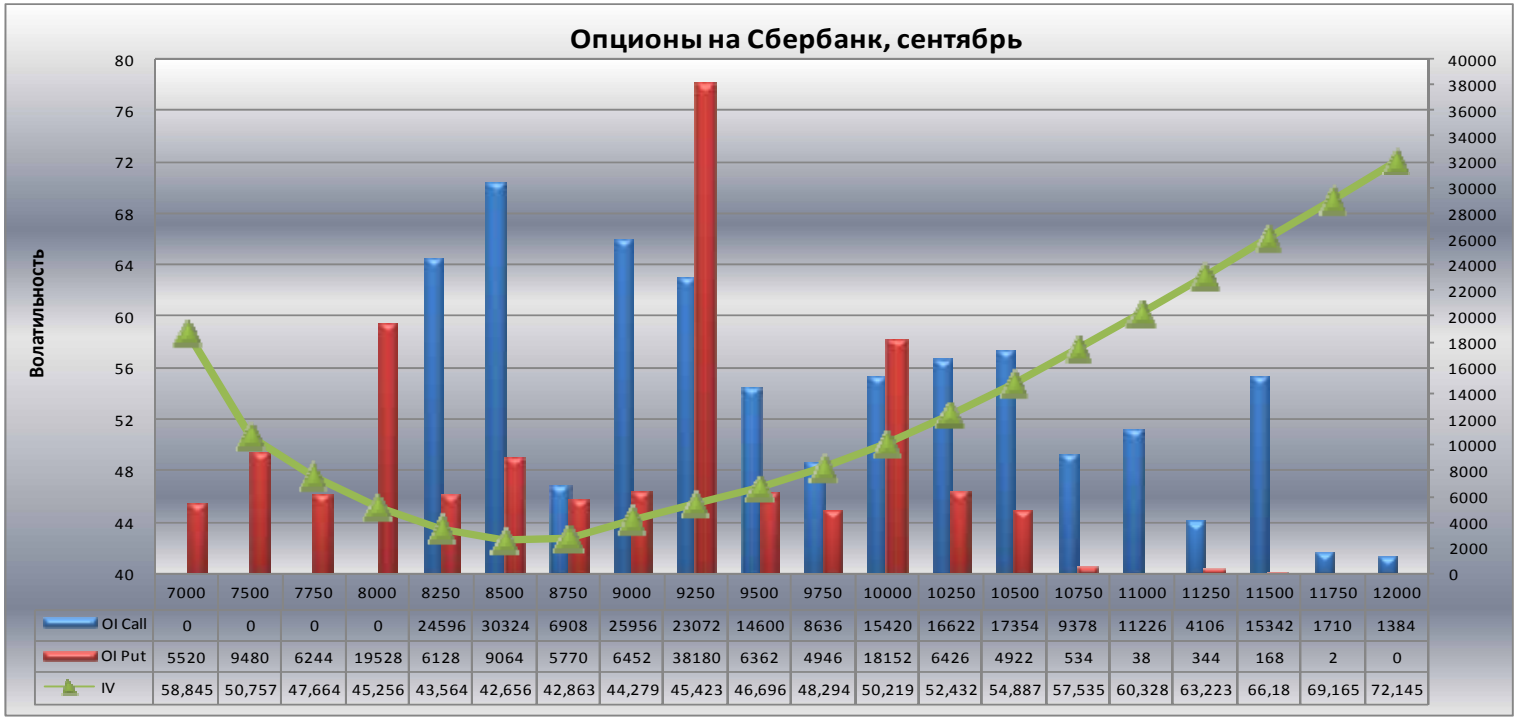
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,65	1081830	25461714514,61	167795
ROSN-9.11	-0,62	62064	16767279,00	22615
LKOH-9.11	-0,35	89338	55744679,00	17320
GAZR-9.11	-0,71	646518	272477386,00	17712
GMKR-9.11	-0,53	51692	5796992,00	71412
SBRF-9.11	-0,56	1174194	536755448,00	8462
VTBR-9.11	-0,13	263392	16724788,00	7497
GOLD-9.11	0,03	110638	417996370,25	1829
Si-9.11	0,03	1290620	774524888,00	28919
Eu-9.11	-0,16	121294	3201004,00	41594
ED-9.11	-0,23	140406	827018266,17	1,4374
SBPR-9.11	-0,15	119886	938108,00	7106
RTSS-9.11	-0,63	35668	12845340,00	10438,5
BR-7.11	0,17	63 066	614654180,51	114,69

Дневная сессия

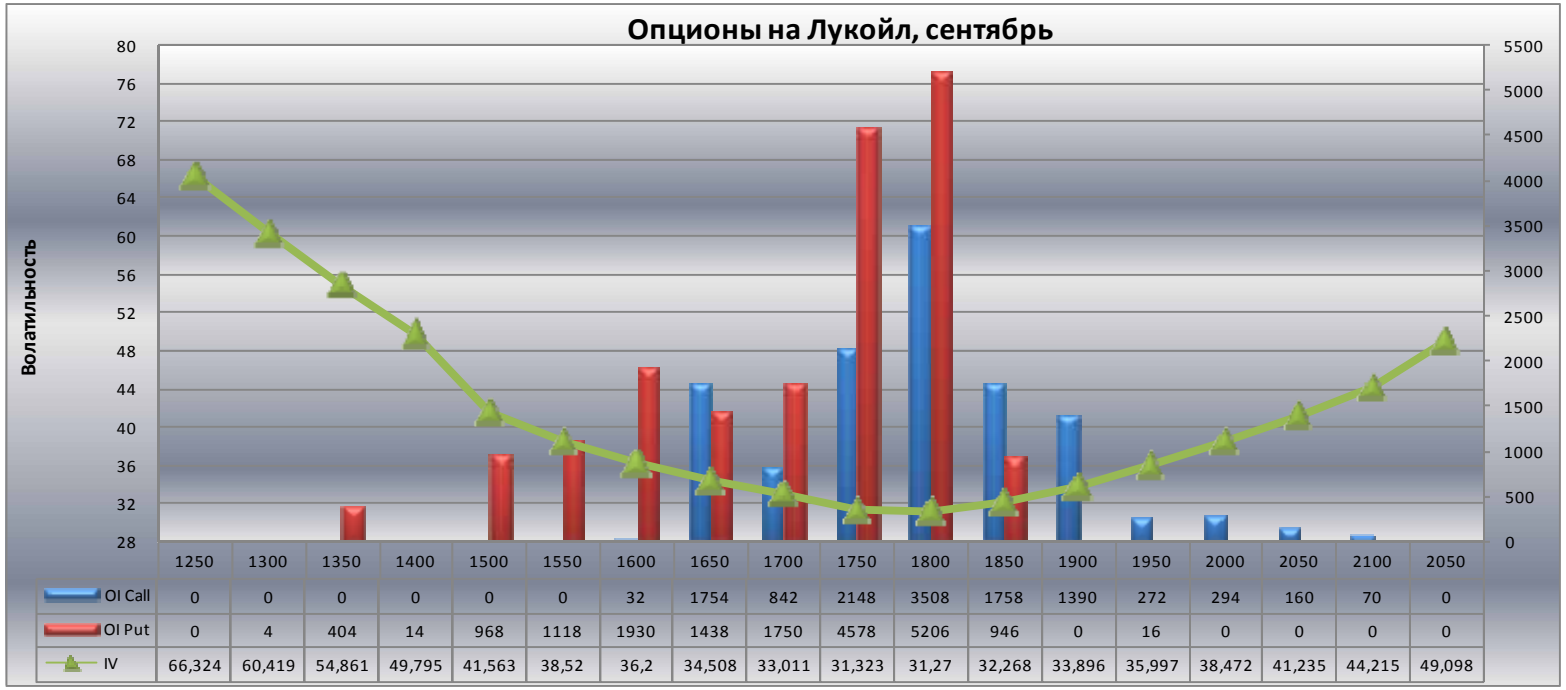
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296	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



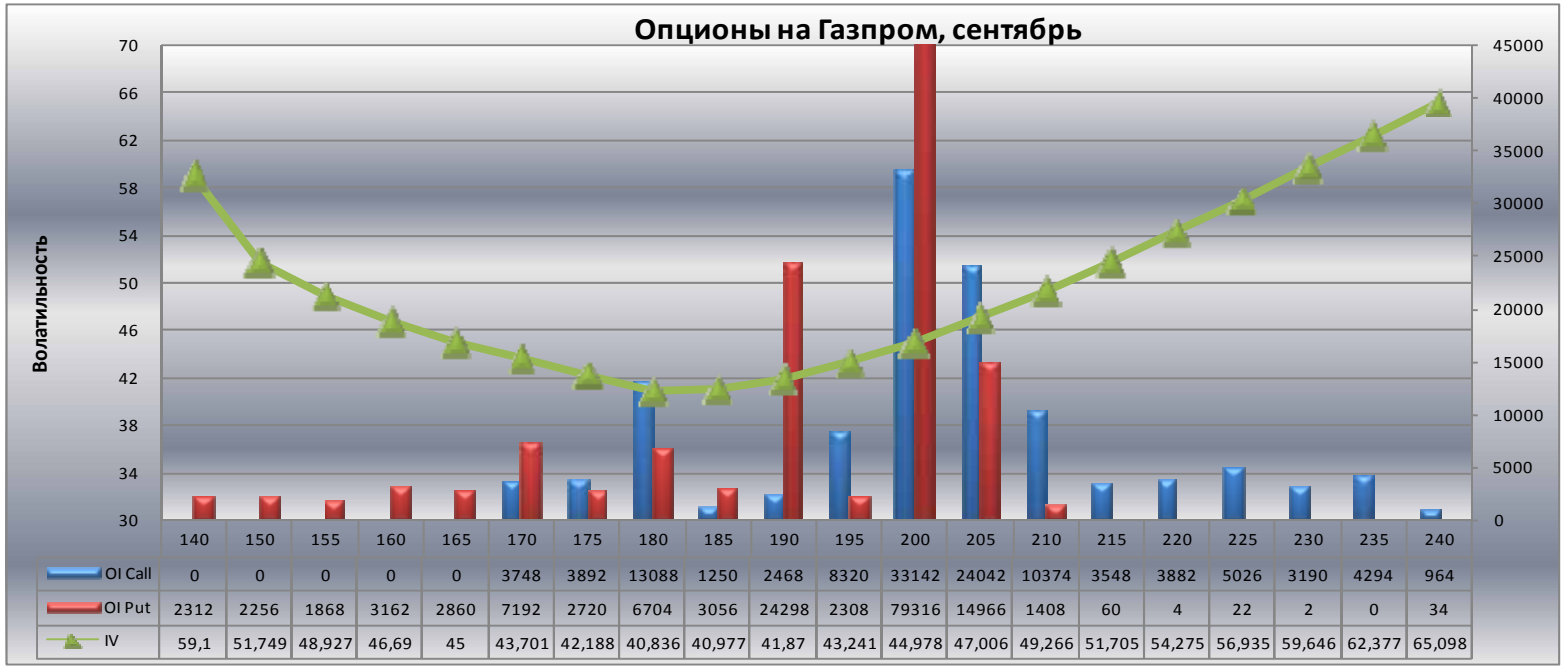
	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	5674	7092	31646	29794	54914	49814	39400	89892	58224	73136	38404	33658	17392	25204	21720	10170	2676	0	0	0	0
OI Put	89222	79868	47218	43594	31348	43018	30396	56060	13984	50334	16668	4310	2868	194	18	112	4	0	0	0	0
IV	74	68,513	63,182	58,151	53,541	49,447	45,939	43,056	40,799	39,114	37,773	36,086	35,247	35,722	36,874	38,495	40,482	42,757	45,257	47,924	50,707



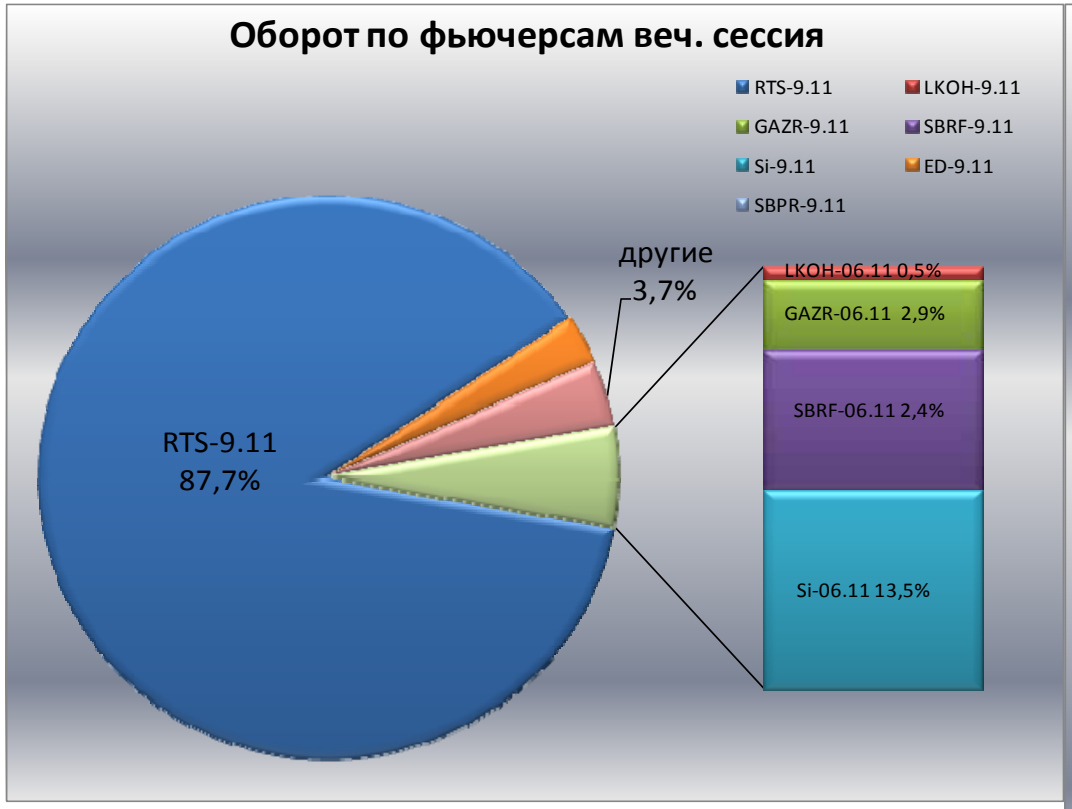
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	24596	30324	6908	25956	23072	14600	8636	15420	16622	17354	9378	11226	4106	15342	1710	1384
OI Put	5520	9480	6244	19528	6128	9064	5770	6452	38180	6362	4946	18152	6426	4922	534	38	344	168	2	0
IV	58,845	50,757	47,664	45,256	43,564	42,656	42,863	44,279	45,423	46,696	48,294	50,219	52,432	54,887	57,535	60,328	63,223	66,18	69,165	72,145

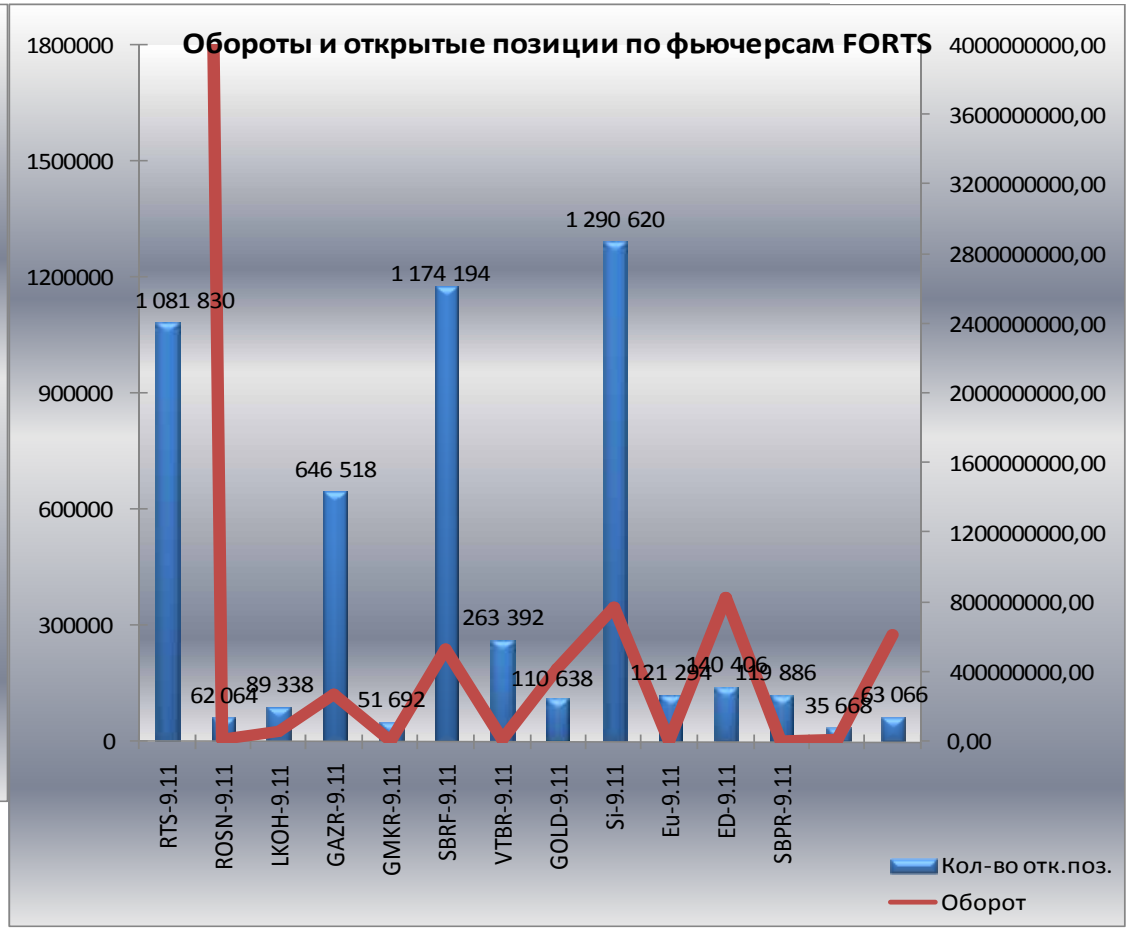


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1754	842	2148	3508	1758	1390	272	294	160	70	0
OI Put	0	4	404	14	968	1118	1930	1438	1750	4578	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	66,324	60,419	54,861	49,795	41,563	38,52	36,2	34,508	33,011	31,323	31,27	32,268	33,896	35,997	38,472	41,235	44,215	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	3748	3892	13088	1250	2468	8320	33142	24042	10374	3548	3882	5026	3190	4294	964
OI Put	2312	2256	1868	3162	2860	7192	2720	6704	3056	24298	2308	79316	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	59,1	51,749	48,927	46,69	45	43,701	42,188	40,836	40,977	41,87	43,241	44,978	47,006	49,266	51,705	54,275	56,935	59,646	62,377	65,098


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
3,7%
RTS-9.11
87,7%
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
1 081 830
62 064
89 338
646 518
51 692
1 174 194
263 392
110 638
1 290 620
121 294
140 406
119 886
35 668
63 066
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