Четверг: понижение российского рынка на фоне внешнего негатива

По итогам минувшей сессии основные фондовые индикаторы США закрылись в минусе: DJ Industrial упал на –1,03% до 11493,57 пунктов , а S&P 500 на –1,19% до 1204,42. Вышли довольно слабые данные по занятости, хотя данные ISM показали небольшой рост промышленности в августе.

В Европе индексы показали смешанную динамику. По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 вырос на 0,46% составив 5418,65 пункта, CAC 40 вырос на 0,28% составив 3265,83 пункта, а DAX 30 упал на –0,94% составив 5730,63 пункта.

Что касается российского рынка, РТС составил к концу сессии 1674,6 пункта. Газпром за вечернюю сессию изменился на –0,72%, составив 176,34 пункта, Лукойл на –0,87% остановившись на отметке 1723,00 пункта, Роснефть на -0,95% (229,46 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,01% (29,00 пункта) и +0,13% (41,37 пункта), акции Сбербанка и ВТБ изменились на –1,1% (84,37 пункта) и –1,39% (0,0752 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	167460	1674,60	-1,04	1 055 216	-0,81%	23 247 785 211	14,14%
ROSN-9.11	22946	229,46	-0,95	63 598	-0,02%	16 840 461	2,35%
LKOH-9.11	17234	1723,40	-0,87	101 864	-0,35%	39 554 407	2,53%
GAZR-9.11	17634	176,34	-0,72	631 150	0,40%	203 402 193	3,29%
GMKR-9.11	71130	7113,00	-1,05	53 426	0,06%	41 330 357	4,45%
SBRF-9.11	8437	84,37	-1,10	1 136 060	-0,03%	391 156 403	4,80%
VTBR-9.11	7520	0,0752	-1,39	247 346	-0,21%	6 498 119	1,42%
GOLD-9.11	1828	1827,5000	0,27	109 580	-2,89%	255 409 330	16,01%
Si-9.11	28999	29,00	-0,01	1 266 642	-0,14%	523 440 065	1,98%
Eu-9.11	41374	41,37	0,13	121 656	-0,02%	6 417 175	6,45%
ED-9.11	1,43	1,43	0,20	136 084	7,04%	1 397 394 291	15,12%
SBPR-9.11	7051	70,51	-1,16	117 314	0,01%	488 776	1,11%
RTSS-9.11	10462	10461,50	-0,84	42 386	-0,11%	17 025 690	1,86%
BR-7.11	114	114,25	-0,51	64 018	-2,16%	363 624 204	13,57%

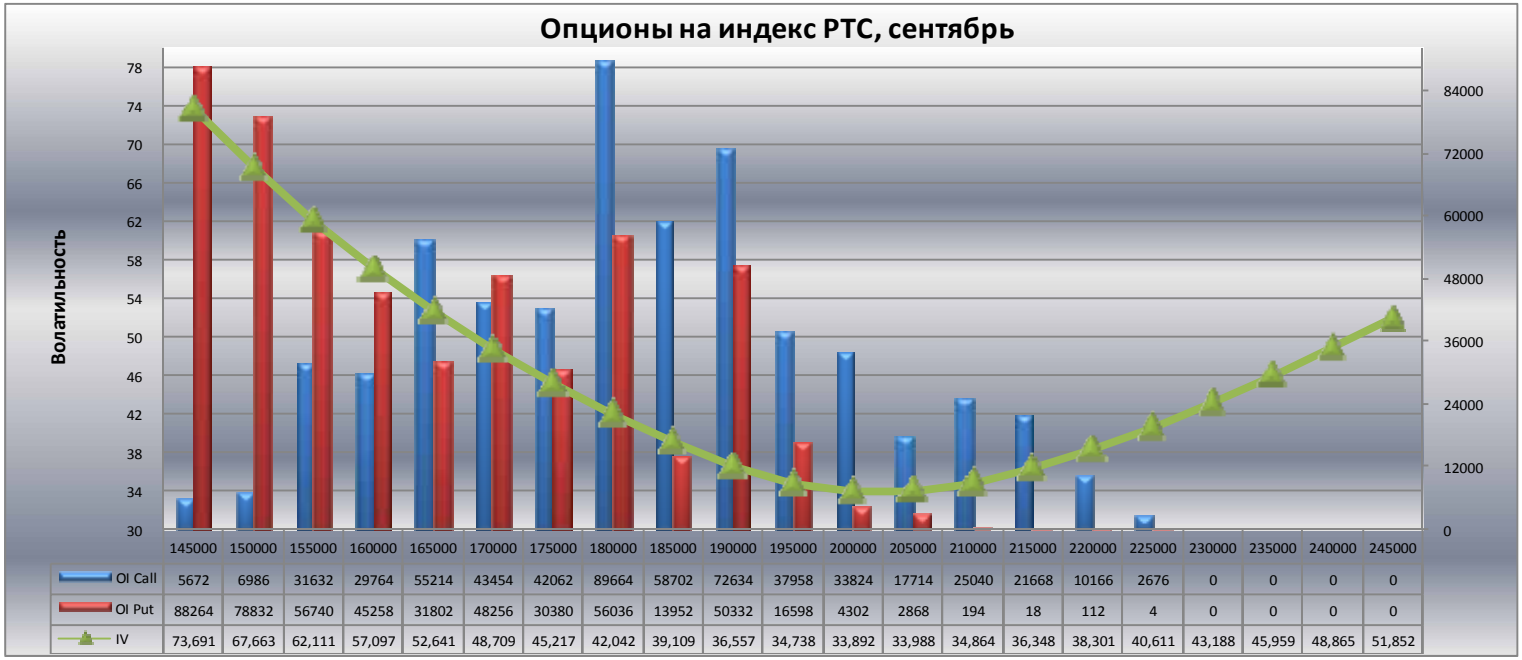
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58118,2	2,87%	00:15:31
CAC 40	3265,83	0,28%	19:35:15
DAX 30	5730,63	-0,94%	19:35:27
DJ Industrial	11493,57	-1,03%	00:35:39
FTSE 100	5418,65	0,45%	19:35:30
Hang Seng	20291,84	-1,43%	09:58:38
Nikkei 225	8955,48	-1,16%	09:58:33
S&P 500	1204,42	-1,19%	00:03:30
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1827,99	0,19%	09:58:44
Palladium	780	0,02%	09:57:41
Platinum	1842,7	-0,06%	09:58:41
RTSI	1 693,01	-0,51%	23:50:00
RTS_Standard	10 460,36	-0,82%	23:50:00
RTSI_DEREX	1744.56	-0.15%	18:45:00

Вечерняя сессия

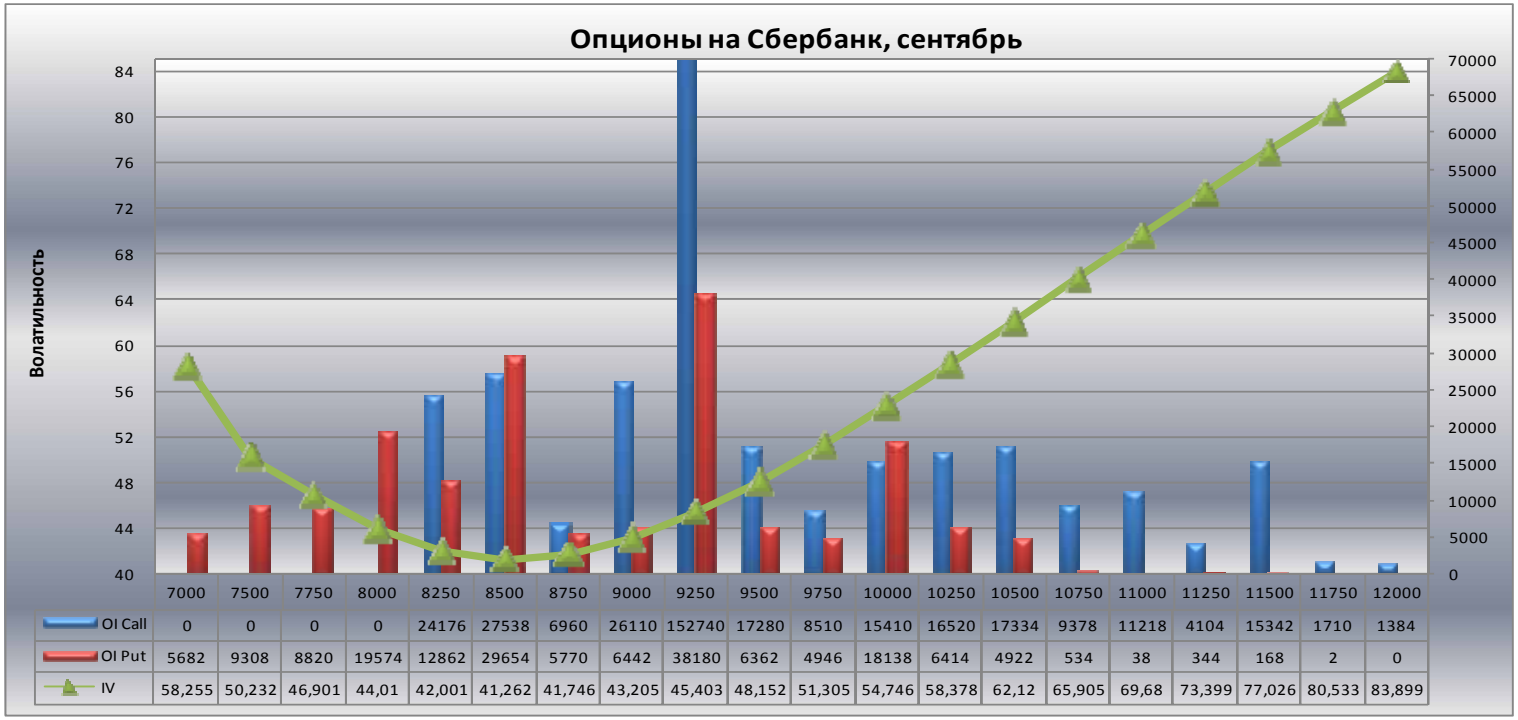
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-1,04	1055216	23247785210,78	167460
ROSN-9.11	-0,95	63598	16840461,00	22946
LKOH-9.11	-0,87	101864	39554407,00	17234
GAZR-9.11	-0,72	631150	203402193,00	17634
GMKR-9.11	-1,05	53426	41330357,00	71130
SBRF-9.11	-1,1	1136060	391156403,00	8437
VTBR-9.11	-1,39	247346	6498119,00	7520
GOLD-9.11	0,27	109580	255409330,31	1827,5
Si-9.11	-0,01	1266642	523440065,00	28999
Eu-9.11	0,13	121656	6417175,00	41374
ED-9.11	0,2	136084	1397394291,10	1,4268
SBPR-9.11	-1,16	117314	488776,00	7051
RTSS-9.11	-0,84	42386	17025690,00	10461,5
BR-7.11	-0,51	64 018	363624203,55	114,25

Дневная сессия

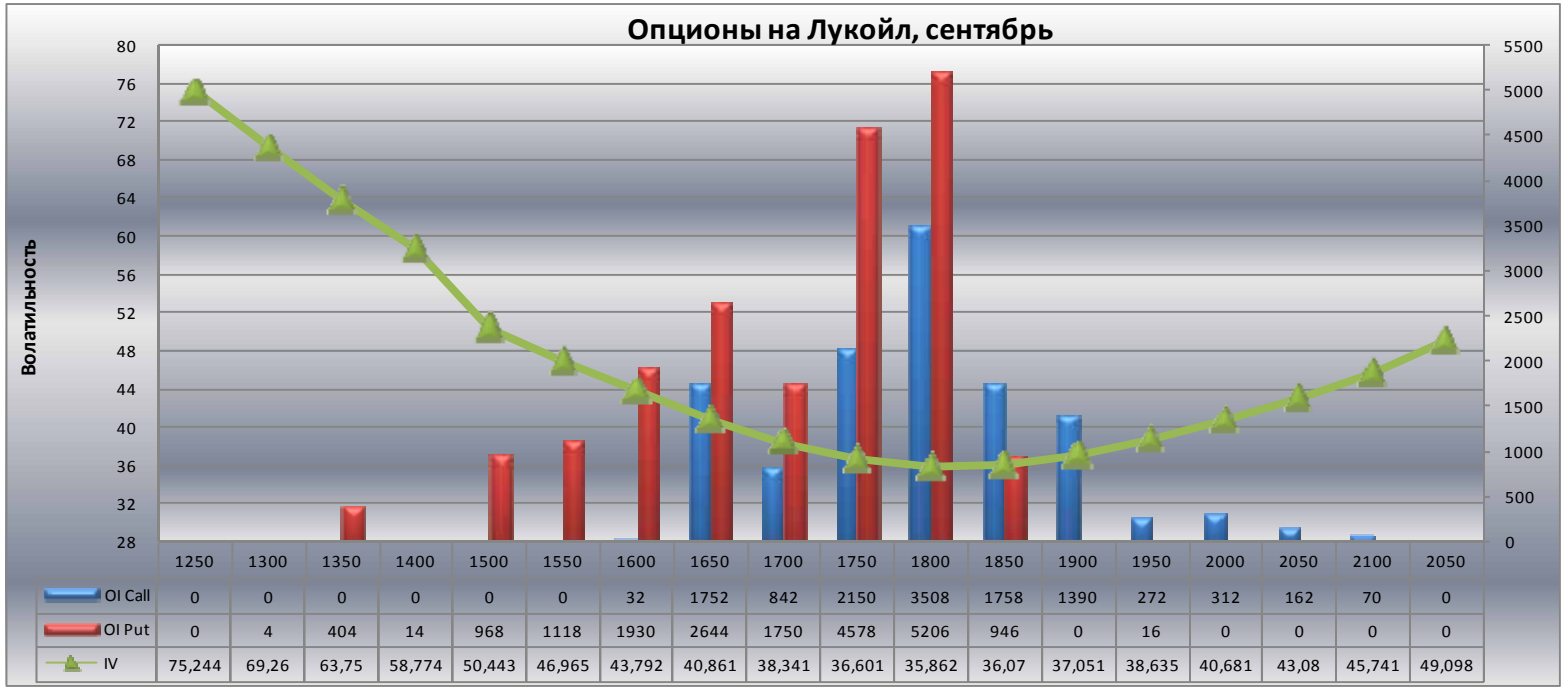
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,19	1063798	164371350724,83	169215
ROSN-9.11	1,86	63608	717075910,00	23164
LKOH-9.11	0,03	102220	1561957764,00	17386
GAZR-9.11	-0,44	628624	6174143893,00	17761
GMKR-9.11	0,13	53394	928251135,00	71884
SBRF-9.11	0,25	1136354	8157171866,00	8531
VTBR-9.11	1,59	247866	458273449,00	7626
GOLD-9.11	-0,37	112838	1595072536,36	1822,5
Si-9.11	0,32	1268358	26493562655,00	29002
Eu-9.11	-0,82	121680	99424774,00	41320
ED-9.11	-1,17	127130	9242446554,00	1,4239
SBPR-9.11	0,24	117304	44137761,00	7134
RTSS-9.11	0,43	42434	917642795,00	10550
BR-7.11	0,3	65 434	2679313150,40	114,84



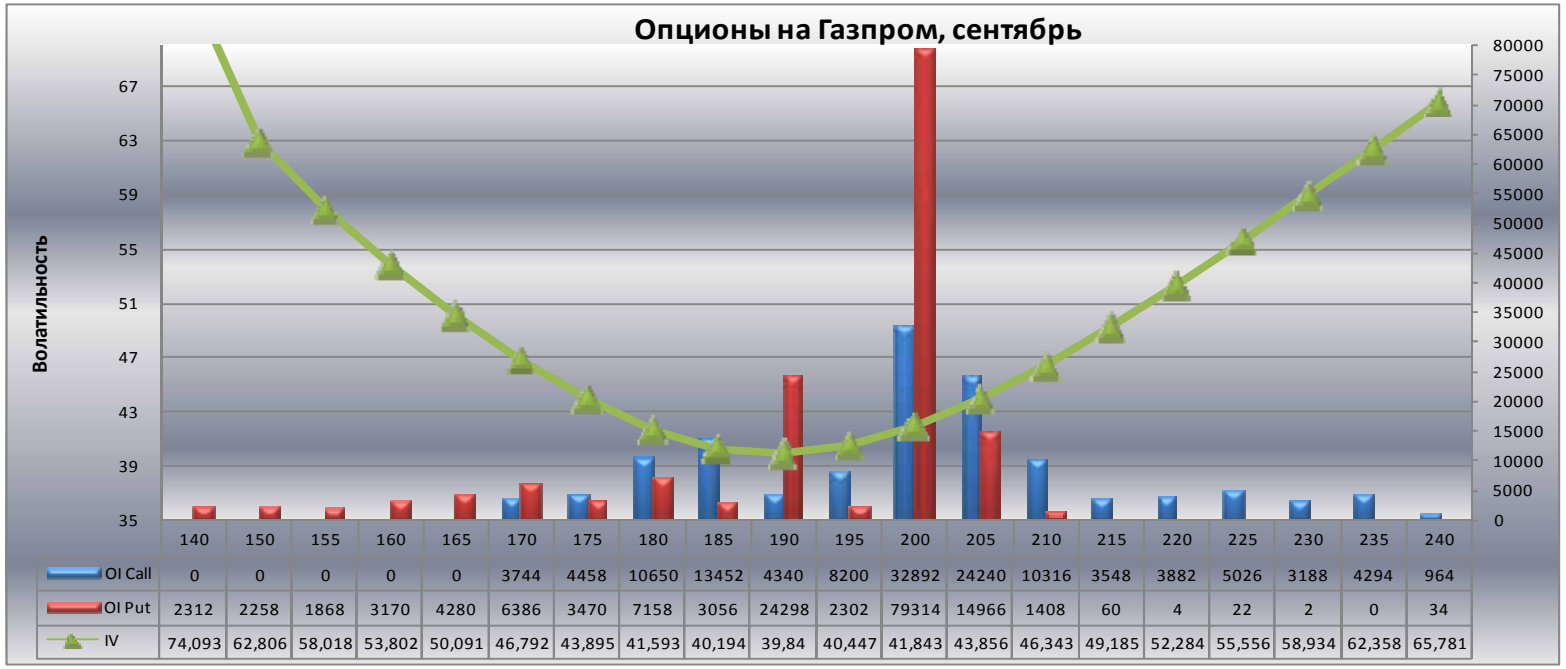
	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	5672	6986	31632	29764	55214	43454	42062	89664	58702	72634	37958	33824	17714	25040	21668	10166	2676	0	0	0	0
OI Put	88264	78832	56740	45258	31802	48256	30380	56036	13952	50332	16598	4302	2868	194	18	112	4	0	0	0	0
IV	73,691	67,663	62,111	57,097	52,641	48,709	45,217	42,042	39,109	36,557	34,738	33,892	33,988	34,864	36,348	38,301	40,611	43,188	45,959	48,865	51,852



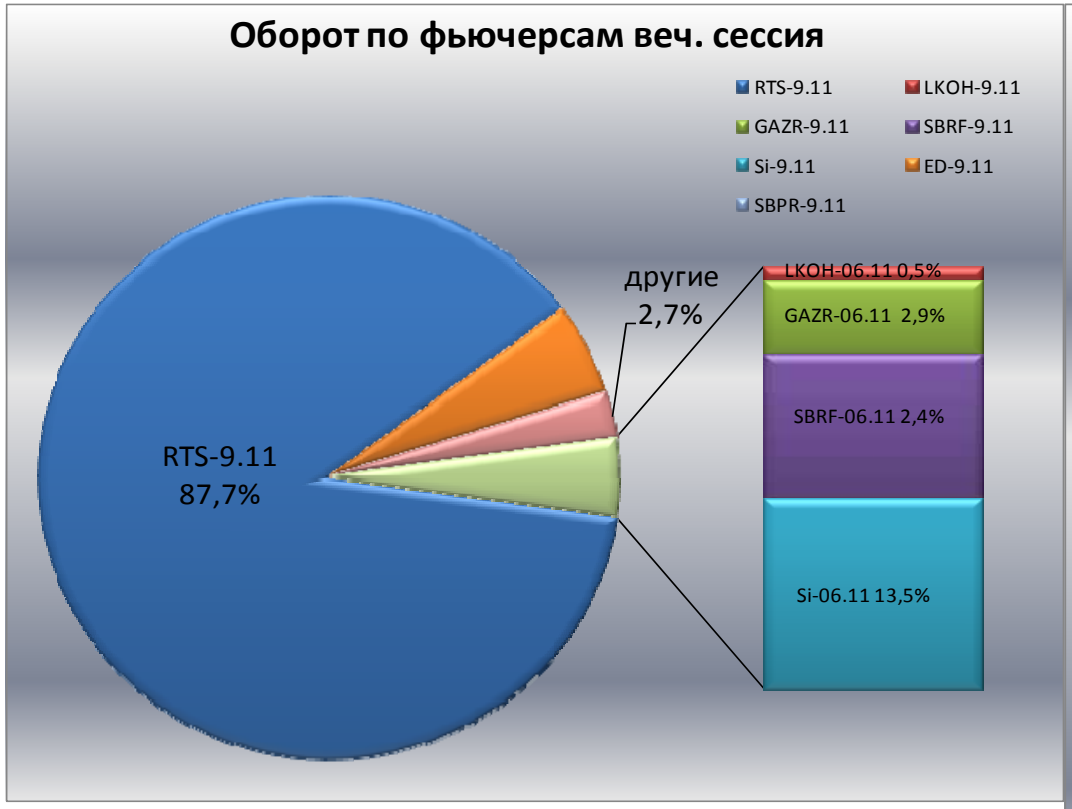
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	24176	27538	6960	26110	152740	17280	8510	15410	16520	17334	9378	11218	4104	15342	1710	1384
OI Put	5682	9308	8820	19574	12862	29654	5770	6442	38180	6362	4946	18138	6414	4922	534	38	344	168	2	0
IV	58,255	50,232	46,901	44,01	42,001	41,262	41,746	43,205	45,403	48,152	51,305	54,746	58,378	62,12	65,905	69,68	73,399	77,026	80,533	83,899

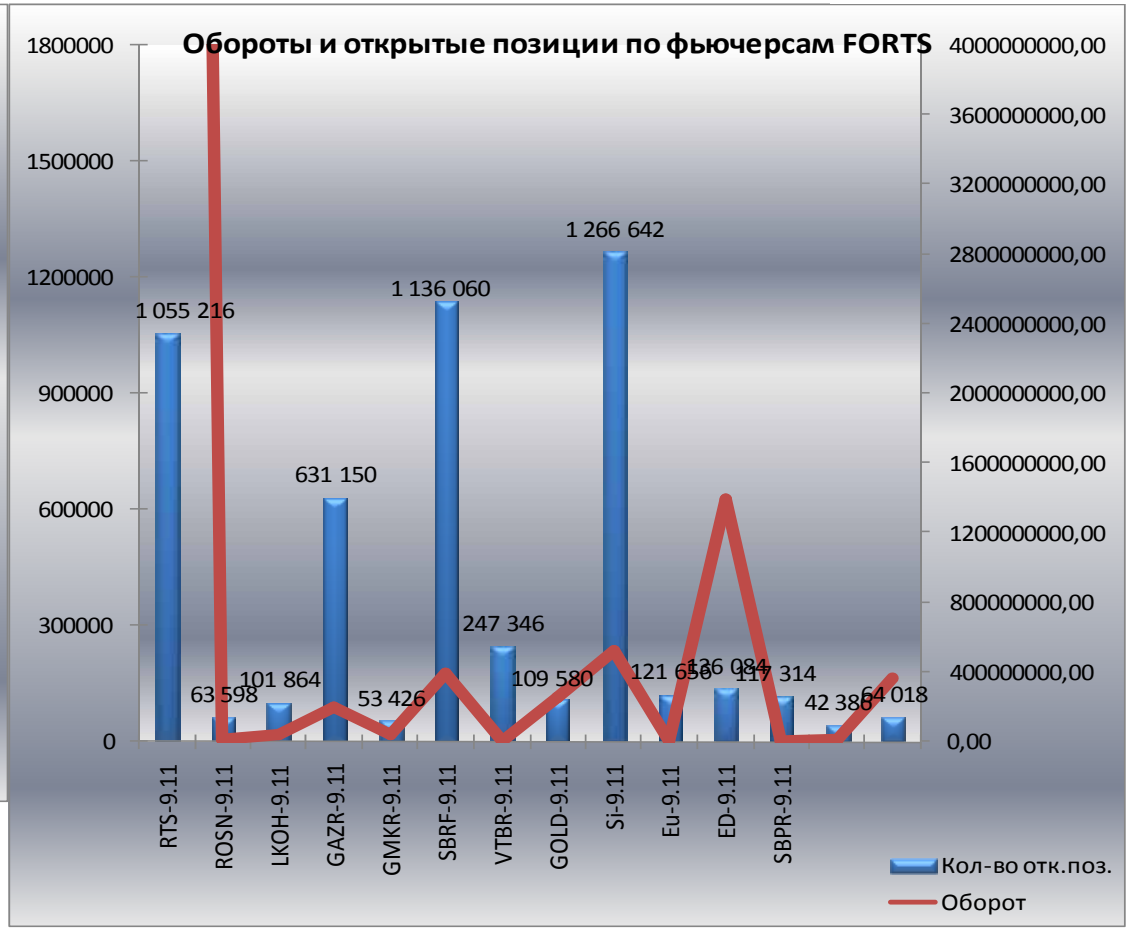


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1752	842	2150	3508	1758	1390	272	312	162	70	0
OI Put	0	4	404	14	968	1118	1930	2644	1750	4578	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	75,244	69,26	63,75	58,774	50,443	46,965	43,792	40,861	38,341	36,601	35,862	36,07	37,051	38,635	40,681	43,08	45,741	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	3744	4458	10650	13452	4340	8200	32892	24240	10316	3548	3882	5026	3188	4294	964
OI Put	2312	2258	1868	3170	4280	6386	3470	7158	3056	24298	2302	79314	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	74,093	62,806	58,018	53,802	50,091	46,792	43,895	41,593	40,194	39,84	40,447	41,843	43,856	46,343	49,185	52,284	55,556	58,934	62,358	65,781


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
87,7%
другие
2,7%
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
1 055 216
63 598
101 864
631 150
53 426
1 136 060
247 346
109 580
1 266 642
121 650
136 084
117 314
42 388
64 018
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