Понедельник: мировые рынки ушли в минус

Торги в США не проводились из-за празднования Дня Труда, а вот азиатские рынки демонстрировали негативную динамику: Hang Seng упал на –1,51%, составив 8590,57 пункта, а Nikkei 225 на –2,25% составив 19320,58 пункта.

В Европе индексы ушли в сильный минус. По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 упал на –3,58% составив 5102,58 пункта, CAC 40 на –4,73% составив 2999,54 пункта, а DAX 30 упал на –5,28% составив 5246,18 пункта. Причинами тому послужили провал Ангелы Меркель на региональных выборах, а также приостановление переговоров между Грецией, МВФ и ЕЦБ насчет дальнейших мер.

Что касается российского рынка, РТС составил к концу сессии 1617,01 пункта. Несмотря на крайне негативный внешний фон, падение было умеренным: Газпром за вечернюю сессию изменился на –0,21%, составив 169,4 пункта, Лукойл на –0,61% остановившись на отметке 1690,2 пункта, Роснефть на +0,07% (221,8 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,03% (29,51 пункта) и +0,1% (41,59 пункта), акции Сбербанка и ВТБ изменились на –0,04% (80,16 пункта) и –0,54% (0,072 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	158260	1582,60	-0,47	1 125 318	0,00%	12 432 751 429	100,00%
ROSN-9.11	22180	221,80	0,07	56 358	0,00%	9 324 437	100,00%
LKOH-9.11	16902	1690,20	-0,61	111 398	0,00%	47 703 646	100,00%
GAZR-9.11	16940	169,40	-0,21	642 842	0,00%	143 753 302	100,00%
GMKR-9.11	70263	7026,30	-0,27	53 146	0,00%	48 239 967	100,00%
SBRF-9.11	8016	80,16	-0,04	1 078 624	0,00%	341 916 329	100,00%
VTBR-9.11	7203	0,0720	-0,54	230 188	0,00%	4 731 331	100,00%
GOLD-9.11	1901	1901,2000	0,18	118 332	0,00%	367 617 984	100,00%
Si-9.11	29511	29,51	-0,03	1 382 596	0,00%	782 839 049	100,00%
Eu-9.11	41586	41,59	0,10	121 926	0,00%	5 908 533	100,00%
ED-9.11	1,41	1,41	0,12	143 094	0,00%	414 858 188	100,00%
SBPR-9.11	6723	67,23	0,18	111 650	0,00%	1 318 939	100,00%
RTSS-9.11	10060	10059,50	-0,44	46 302	0,00%	6 829 200	100,00%
BR-7.11	110	110,39	-0,24	51 292	0,00%	151 363 675	100,00%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54998,41	-2,71%	00:14:31
CAC 40	2999,54	-4,73%	19:35:14
DAX 30	5246,18	-5,28%	19:35:28
DJ Industrial	11240,26	-2,20%	00:32:21
FTSE 100	5102,58	-3,58%	19:35:28
Hang Seng	19320,58	-1,51%	10:04:31
Nikkei 225	8590,57	-2,21%	10:00:03
S&P 500	1173,97	-2,53%	00:07:29
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1919,75	1,06%	10:04:31
Palladium	763,68	0,40%	10:04:24
Platinum	1891	0,39%	10:04:26
RTSI	1 614,00	-0,13%	23:50:00
RTS_Standard	10 059,68	-0,27%	23:50:00
RTSI_DEREX	1695.46	-2.71%	18:45:00

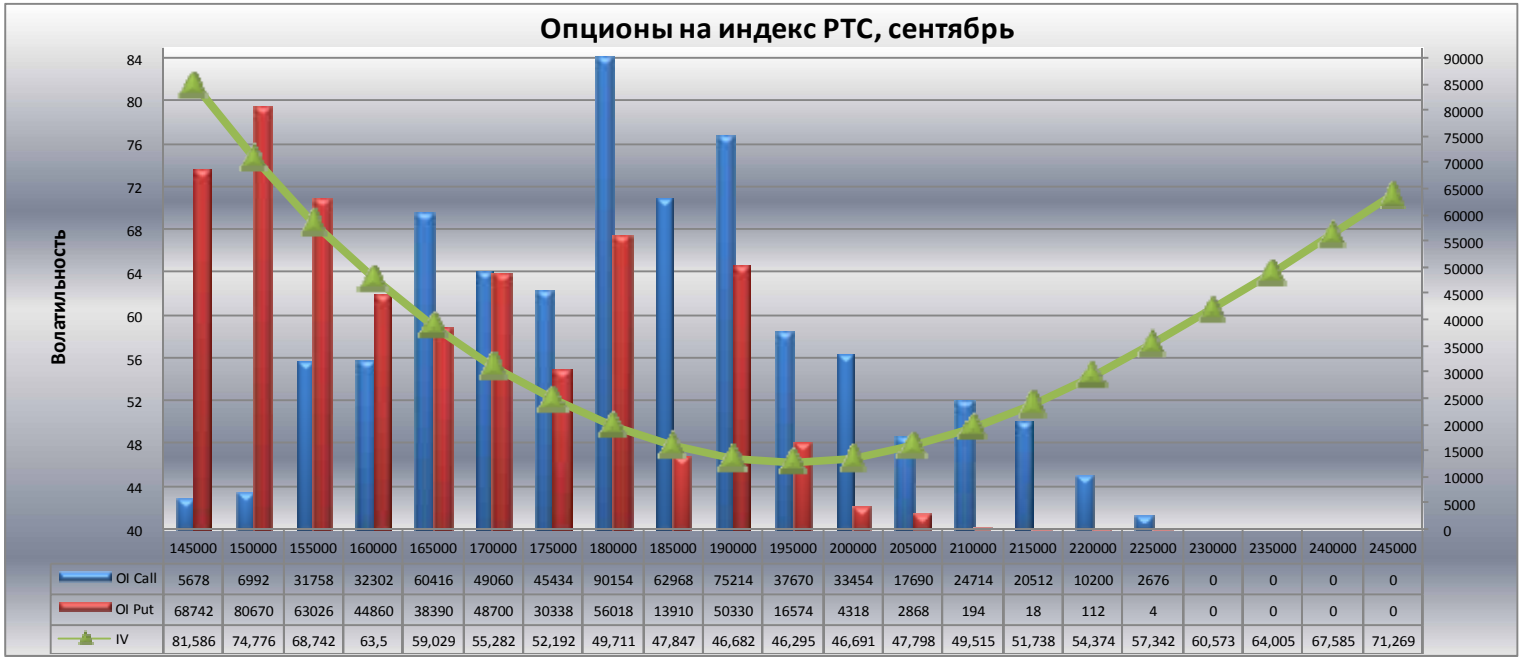
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,47	1125318	12432751428,78	158260
ROSN-9.11	0,07	56358	9324437,00	22180
LKOH-9.11	-0,61	111398	47703646,00	16902
GAZR-9.11	-0,21	642842	143753302,00	16940
GMKR-9.11	-0,27	53146	48239967,00	70263
SBRF-9.11	-0,04	1078624	341916329,00	8016
VTBR-9.11	-0,54	230188	4731331,00	7203
GOLD-9.11	0,18	118332	367617983,82	1901,2
Si-9.11	-0,03	1382596	782839049,00	29511
Eu-9.11	0,1	121926	5908533,00	41586
ED-9.11	0,12	143094	414858188,32	1,4092
SBPR-9.11	0,18	111650	1318939,00	6723
RTSS-9.11	-0,44	46302	6829200,00	10059,5
BR-7.11	-0,24	51 292	151363674,53	110,39

Дневная сессия

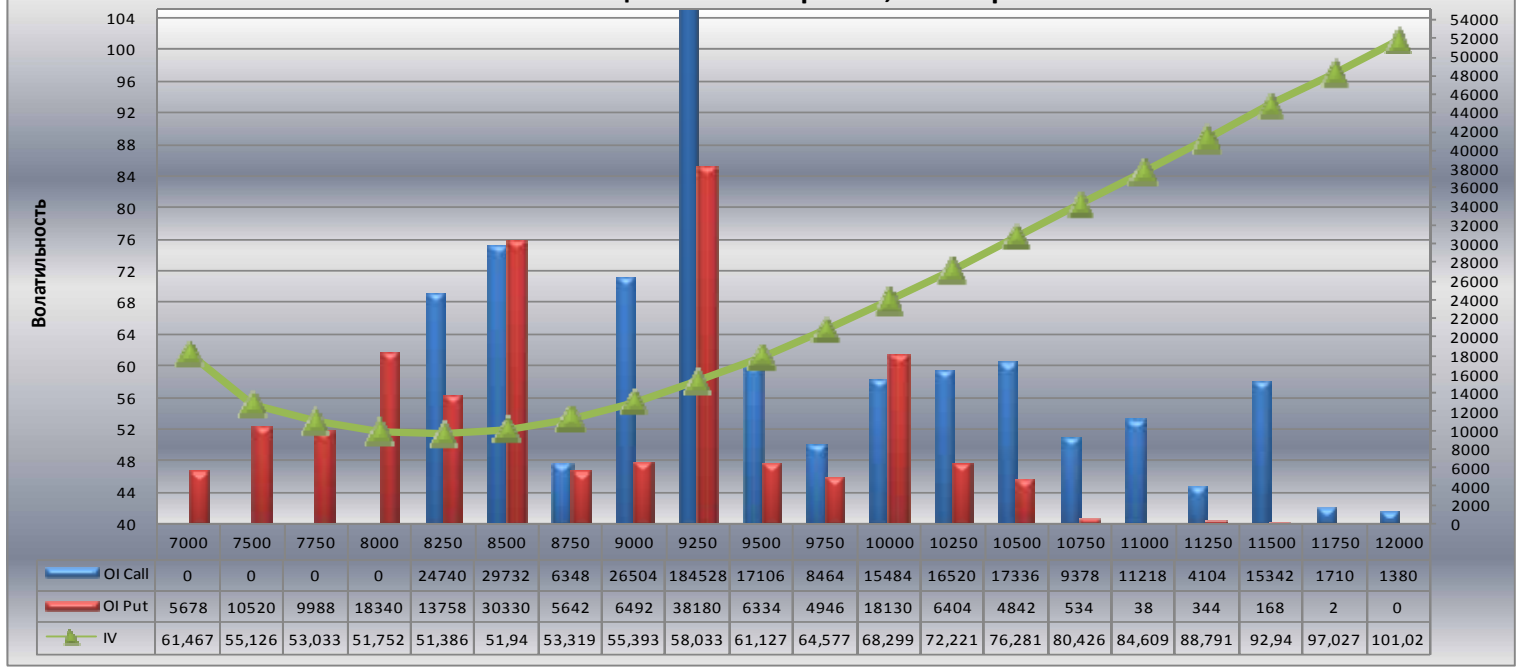
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,47	1125318	12432751429	159015
ROSN-9.11	0,07	56358	9324437	22165
LKOH-9.11	-0,61	111398	47703646	17004
GAZR-9.11	-0,21	642842	143753302	16974
GMKR-9.11	-0,27	53146	48239967	70457
SBRF-9.11	-0,04	1078624	341916329	8019
VTBR-9.11	-0,54	230188	4731331	7242
GOLD-9.11	0,18	118332	367617983,8	1897,8
Si-9.11	-0,03	1382596	782839049	29519
Eu-9.11	0,1	121926	5908533	41545
ED-9.11	0,12	143094	414858188,3	1,4075
SBPR-9.11	0,18	111650	1318939	6711
RTSS-9.11	-0,44	46302	6829200	10104
BR-7.11	-0,24	51292	151363674,5	110,66

Опционы на индекс РТС, сентябрь

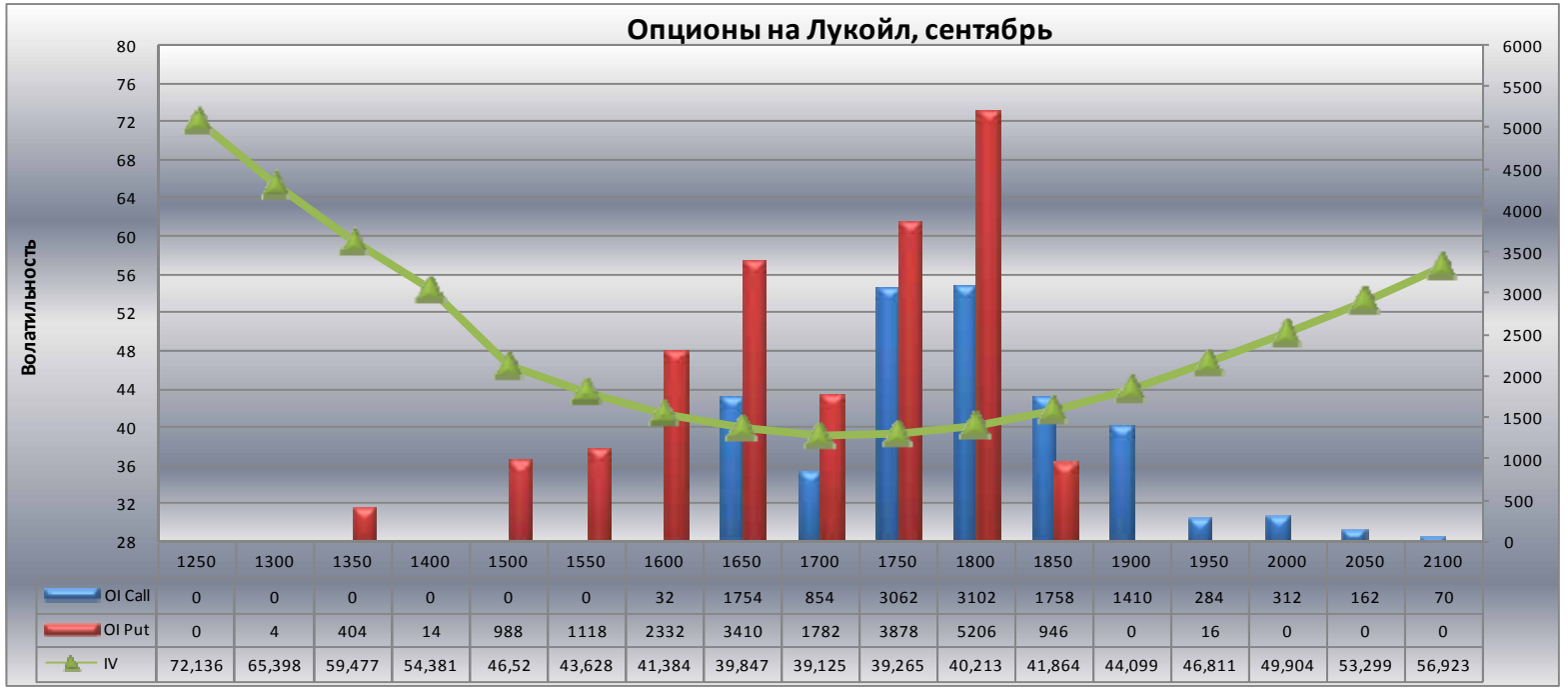


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	5678	6992	31758	32302	60416	49060	45434	90154	62968	75214	37670	33454	17690	24714	20512	10200	2676	0	0	0	0
OI Put	68742	80670	63026	44860	38390	48700	30338	56018	13910	50330	16574	4318	2868	194	18	112	4	0	0	0	0
IV	81,586	74,776	68,742	63,5	59,029	55,282	52,192	49,711	47,847	46,682	46,295	46,691	47,798	49,515	51,738	54,374	57,342	60,573	64,005	67,585	71,269

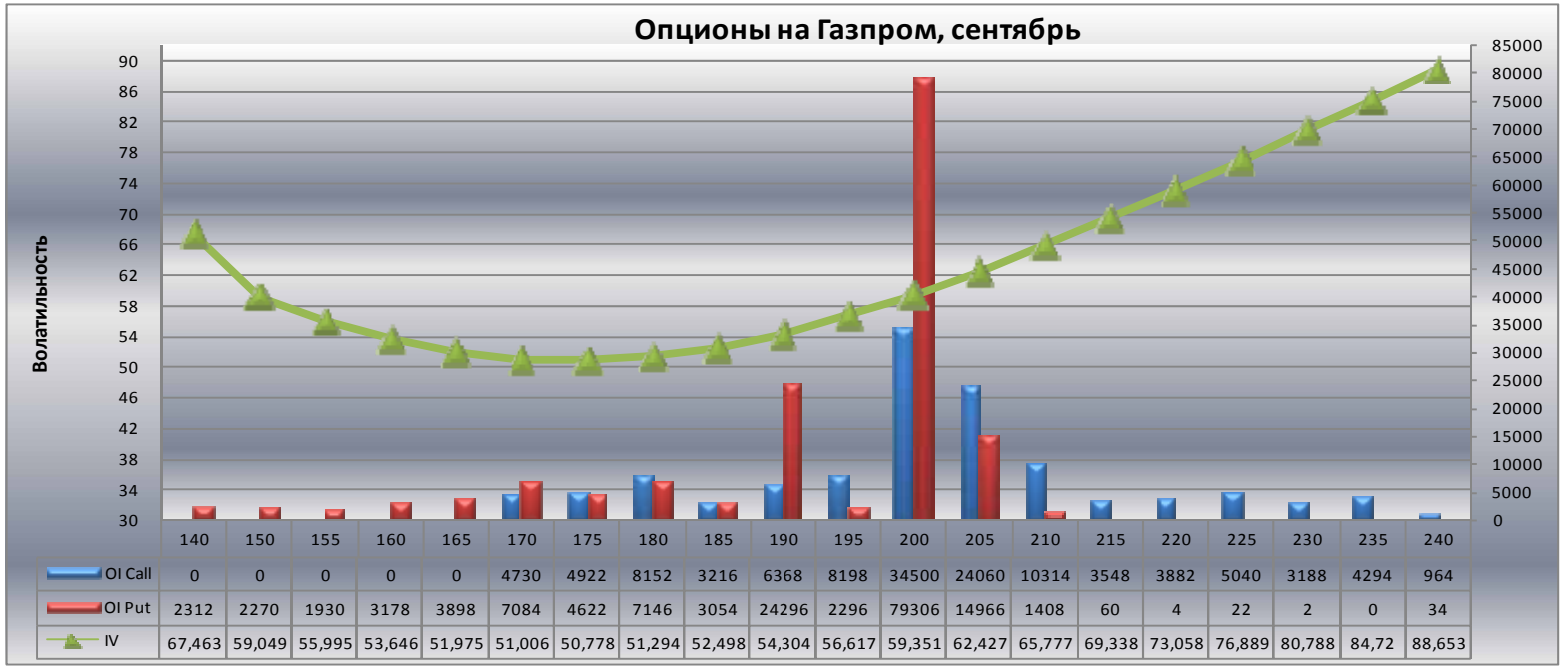
Опционы на Сбербанк, сентябрь



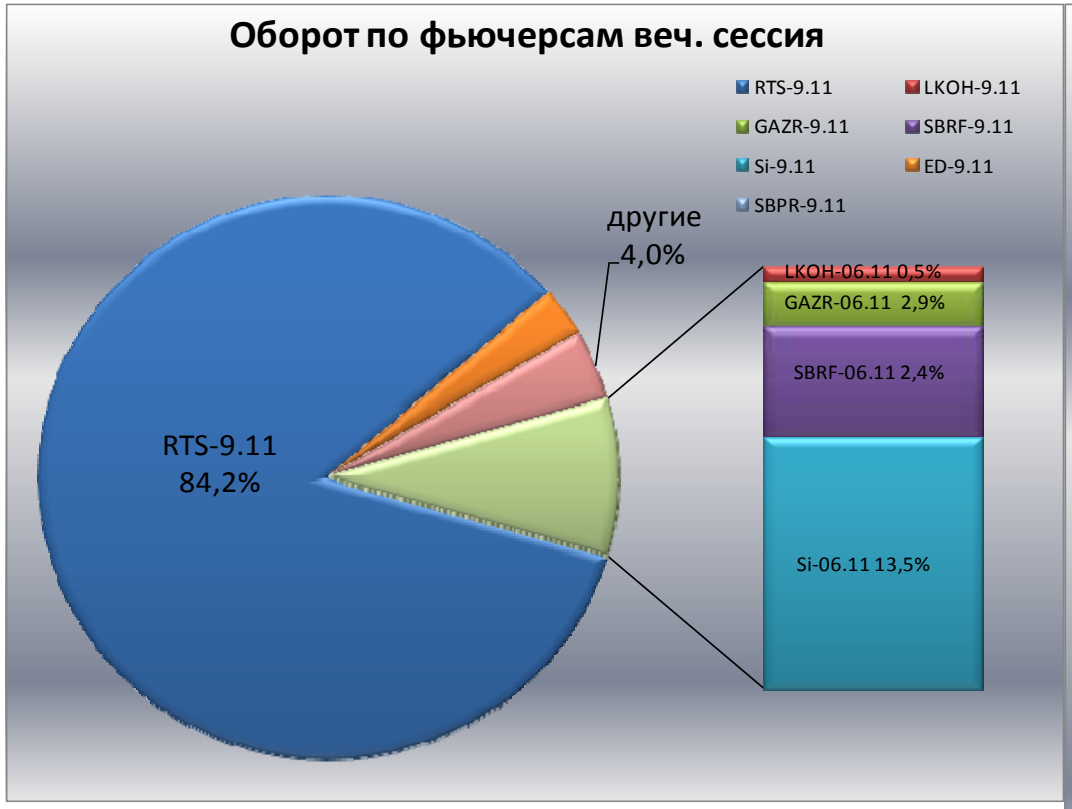
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	24740	29732	6348	26504	184528	17106	8464	15484	16520	17336	9378	11218	4104	15342	1710	1380
OI Put	5678	10520	9988	18340	13758	30330	5642	6492	38180	6334	4946	18130	6404	4842	534	38	344	168	2	0
IV	61,467	55,126	53,033	51,752	51,386	51,94	53,319	55,393	58,033	61,127	64,577	68,299	72,221	76,281	80,426	84,609	88,791	92,94	97,027	101,02

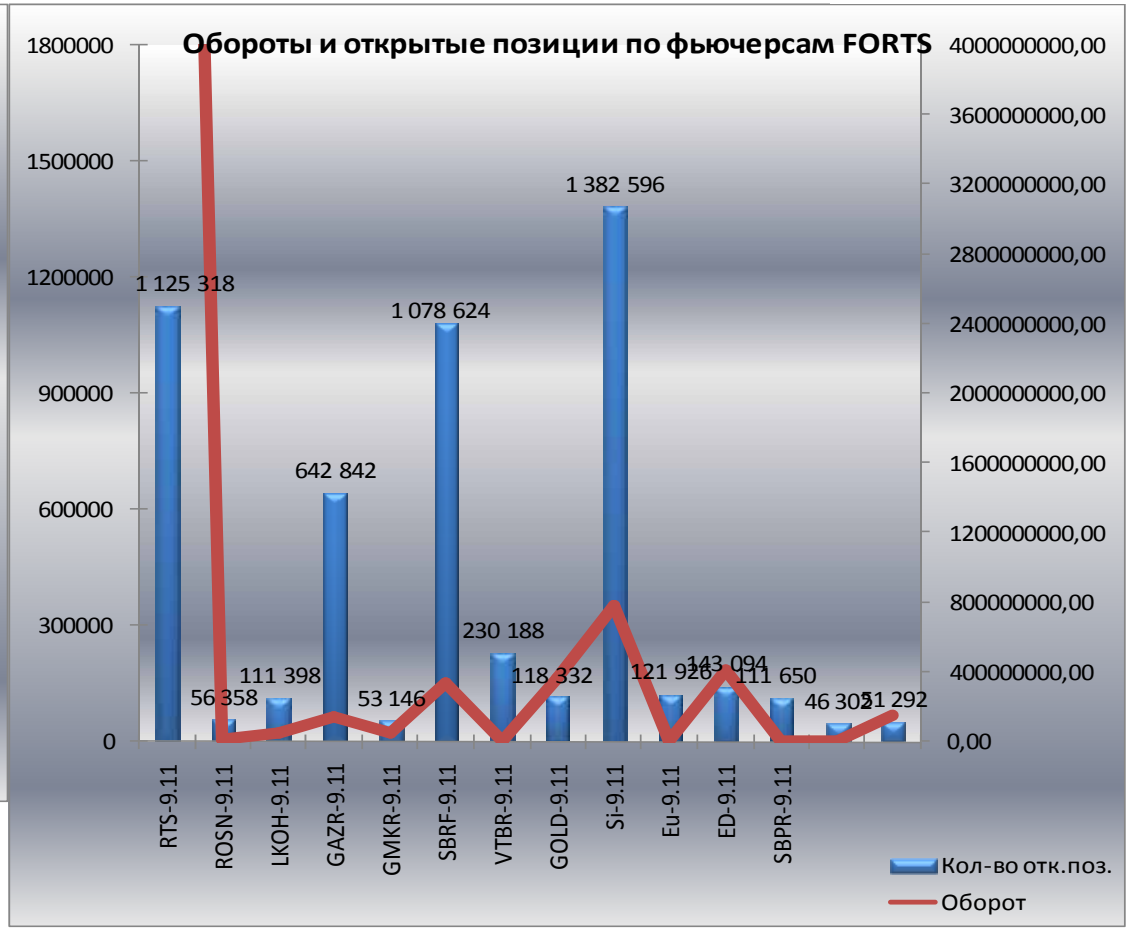


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1754	854	3062	3102	1758	1410	284	312	162	70
OI Put	0	4	404	14	988	1118	2332	3410	1782	3878	5206	946	0	16	0	0	0
IV	72,136	65,398	59,477	54,381	46,52	43,628	41,384	39,847	39,125	39,265	40,213	41,864	44,099	46,811	49,904	53,299	56,923



	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	4730	4922	8152	3216	6368	8198	34500	24060	10314	3548	3882	5040	3188	4294	964
OI Put	2312	2270	1930	3178	3898	7084	4622	7146	3054	24296	2296	79306	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	67,463	59,049	55,995	53,646	51,975	51,006	50,778	51,294	52,498	54,304	56,617	59,351	62,427	65,777	69,338	73,058	76,889	80,788	84,72	88,653


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
4,0%
RTS-9.11
84,2%
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
1 125 318
56 358
111 398
642 842
53 146
1 078 624
230 188
118 332
1 382 596
121 926
143 094
111 650
46 302
51 292
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