Вторник: мировые рынки не спешат расти

По итогам торгов рынки США показали умеренно негативную динамику: DJ Industrial упал на –0,9% составив 11139,3 пункта, S&P 500 упал на –0,74% составив 1165,24 пункта.

Европейские рынки все еще находятся под влиянием новостей о поражнии Ангелы Меркель на региональных выборах, а потому не спешат расти. По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 изменился на +1,06% составив 5156,84 пункта, CAC 40 на –1,13% составив 2965,64 пункта, а DAX 30 упал на –1,00% составив 5193,97 пункта.

Что касается российского рынка, Газпром за вечернюю сессию изменился на +1,47%, составив 170,7 пункта, Лукойл на +1,03% остановившись на отметке 1740,00 пункта, Роснефть на +1,14% (224,92 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,15% (29,59 пункта) и -0,44% (41,42 пункта), акции Сбербанка и ВТБ изменились на +1,07% (81,43 пункта) и +1,00% (0,0747 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	162200	1622,00	1,68	1 147 940	7,91%	27 205 641 718	16,55%
ROSN-9.11	22492	224,92	1,14	56 090	-11,82%	6 895 667	0,96%
LKOH-9.11	17400	1740,00	1,03	123 938	21,25%	89 161 297	5,71%
GAZR-9.11	17070	170,70	1,47	664 360	5,68%	352 641 179	5,71%
GMKR-9.11	72109	7210,90	0,72	51 456	-3,63%	22 541 569	2,43%
SBRF-9.11	8143	81,43	1,07	1 099 410	-3,25%	342 282 563	4,20%
VTBR-9.11	7471	0,0747	1,00	210 660	-15,01%	7 070 180	1,54%
GOLD-9.11	1876	1876,3000	-1,37	123 046	9,05%	1 346 250 167	84,40%
Si-9.11	29591	29,59	-0,15	1 279 266	0,86%	1 877 065 986	7,08%
Eu-9.11	41418	41,42	-0,44	119 750	-1,59%	12 742 915	12,82%
ED-9.11	1,40	1,40	-0,30	136 158	7,10%	2 594 596 824	28,07%
SBPR-9.11	6824	68,24	0,74	111 664	-4,81%	1 104 252	2,50%
RTSS-9.11	10260	10260,00	1,13	47 020	10,81%	19 855 390	2,16%
BR-7.11	113	113,00	1,42	52 114	-20,36%	652 200 044	24,34%

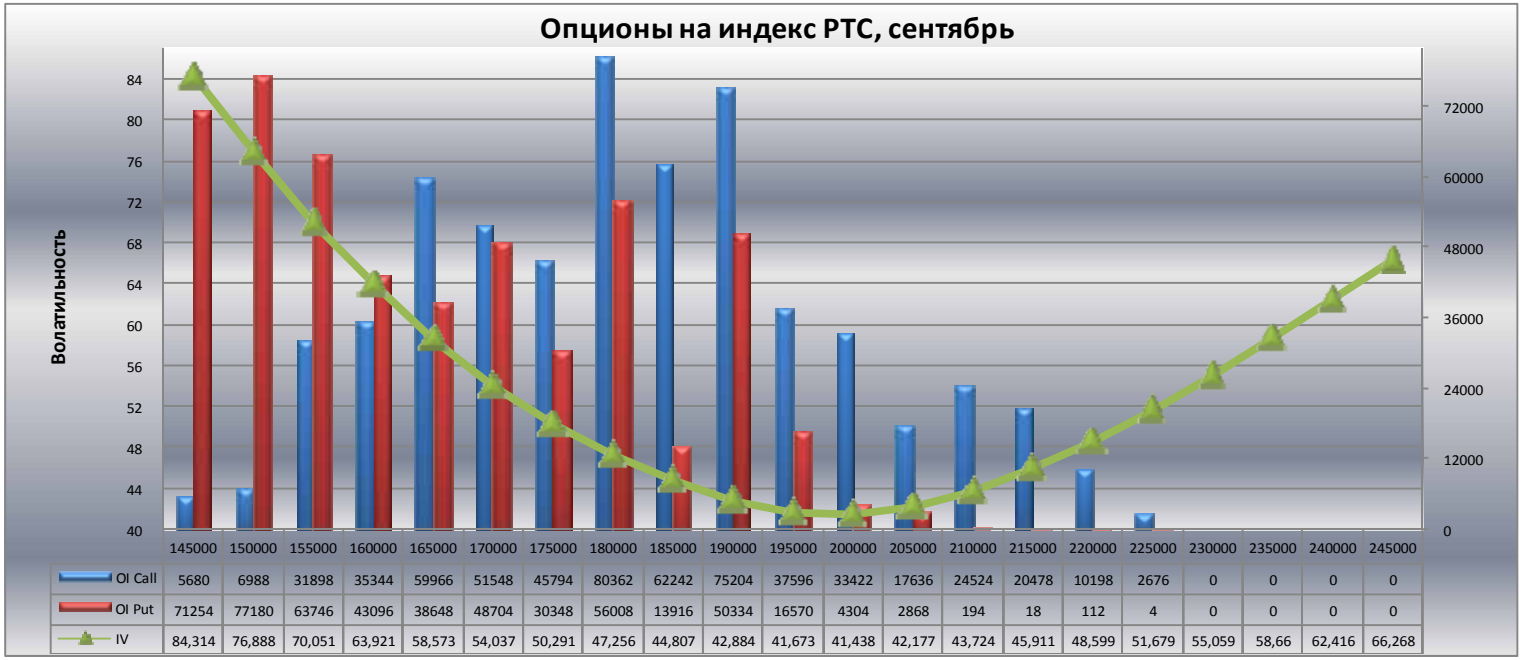
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56607,3	2,93%	00:14:33
CAC 40	2965,64	-1,13%	19:35:19
DAX 30	5193,97	-1,00%	19:35:33
DJ Industrial	11139,3	-0,90%	00:36:22
FTSE 100	5156,84	1,06%	19:35:34
Hang Seng	20010,3	1,52%	10:00:50
Nikkei 225	8763,41	2,01%	10:00:08
S&P 500	1165,24	-0,74%	00:03:33
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1833,29	-2,11%	10:00:53
Palladium	747,25	0,16%	09:59:45
Platinum	1830	-0,87%	10:00:08
RTSI	1 624,47	0,36%	23:50:00
RTS_Standard	10 213,43	0,61%	23:50:00
RTSI_DEREX	1650.70	0.08%	18:45:00

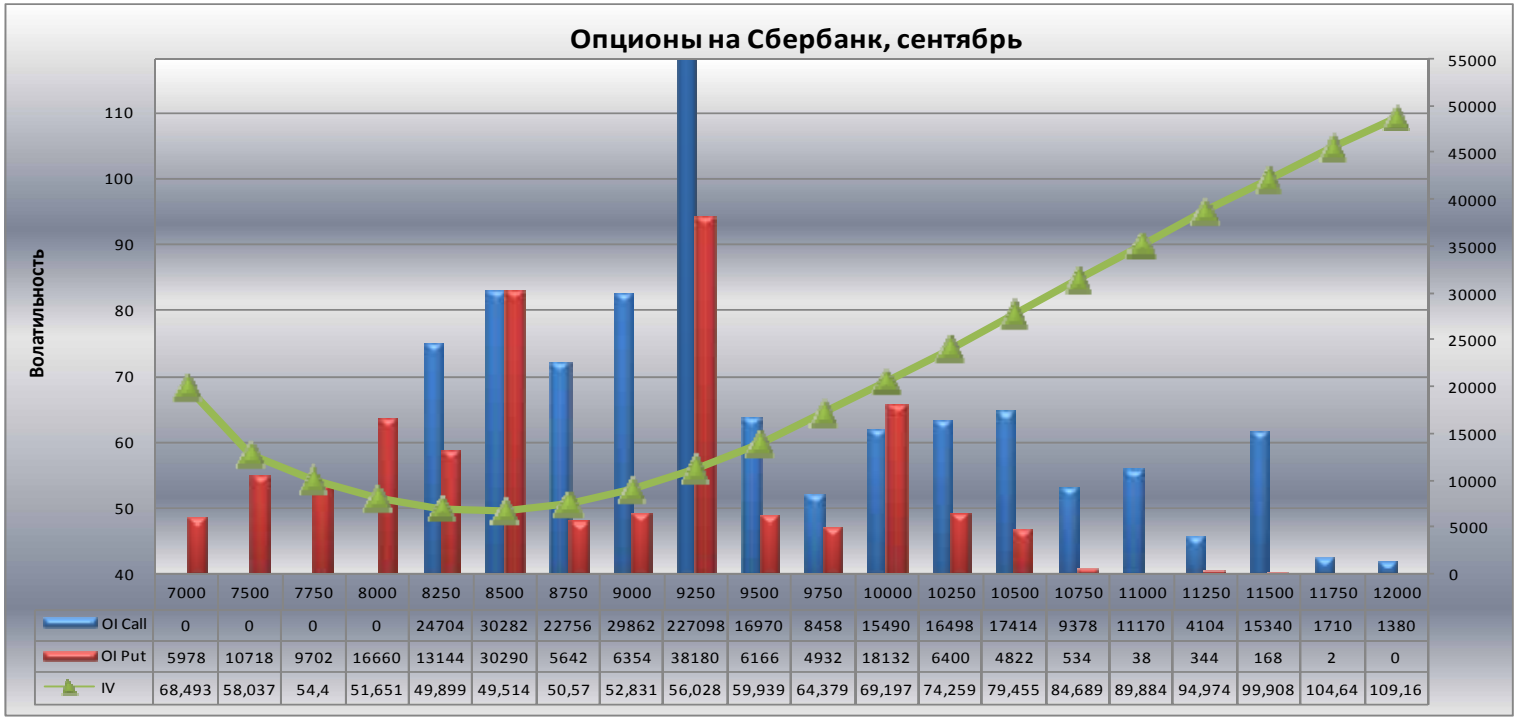
Вечерняя сессия

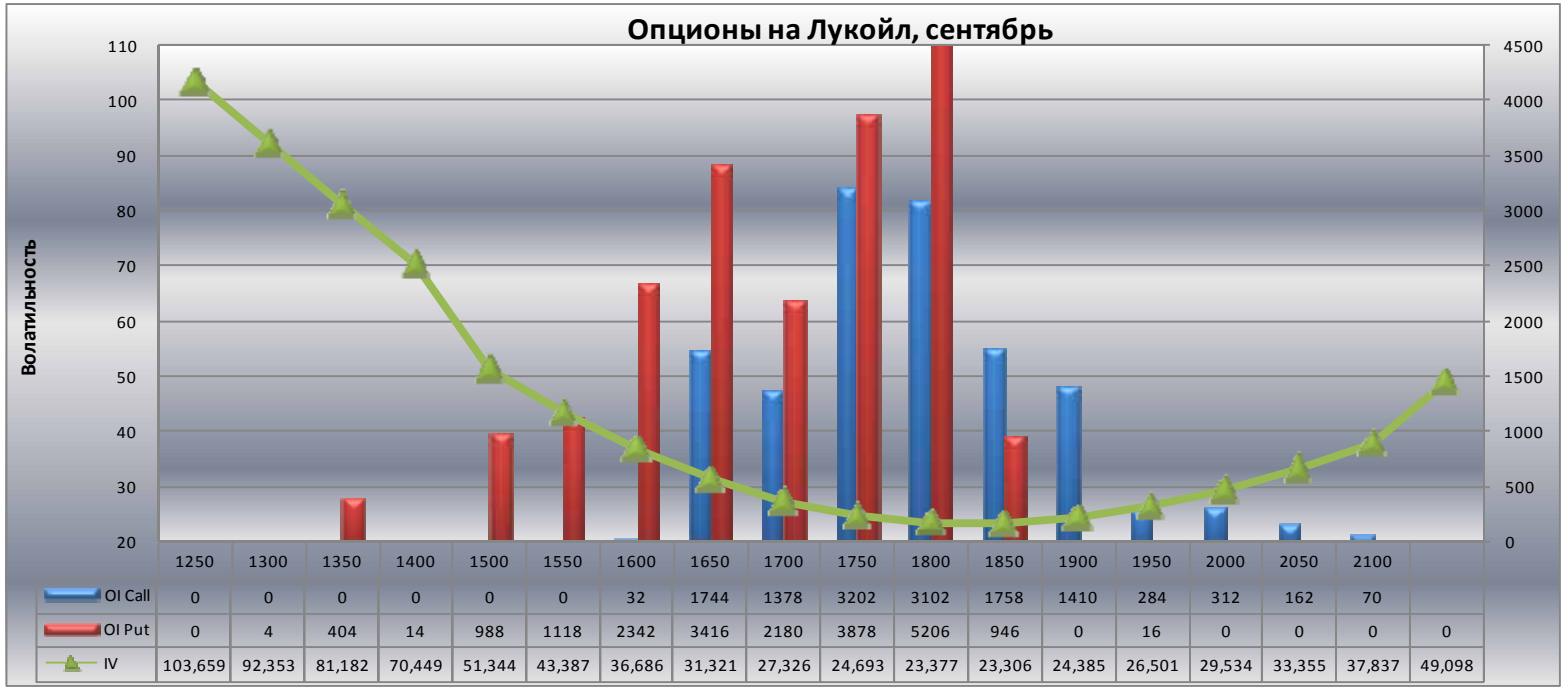
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	1,68	1147940	27205641718,26	162200
ROSN-9.11	1,14	56090	6895667,00	22492
LKOH-9.11	1,03	123938	89161297,00	17400
GAZR-9.11	1,47	664360	352641179,00	17070
GMKR-9.11	0,72	51456	22541569,00	72109
SBRF-9.11	1,07	1099410	342282563,00	8143
VTBR-9.11	1	210660	7070180,00	7471
GOLD-9.11	-1,37	123046	1346250166,67	1876,3
Si-9.11	-0,15	1279266	1877065986,00	29591
Eu-9.11	-0,44	119750	12742915,00	41418
ED-9.11	-0,3	136158	2594596824,12	1,3996
SBPR-9.11	0,74	111664	1104252,00	6824
RTSS-9.11	1,13	47020	19855390,00	10260
BR-7.11	1,42	52 114	652200044,09	113

Дневная сессия

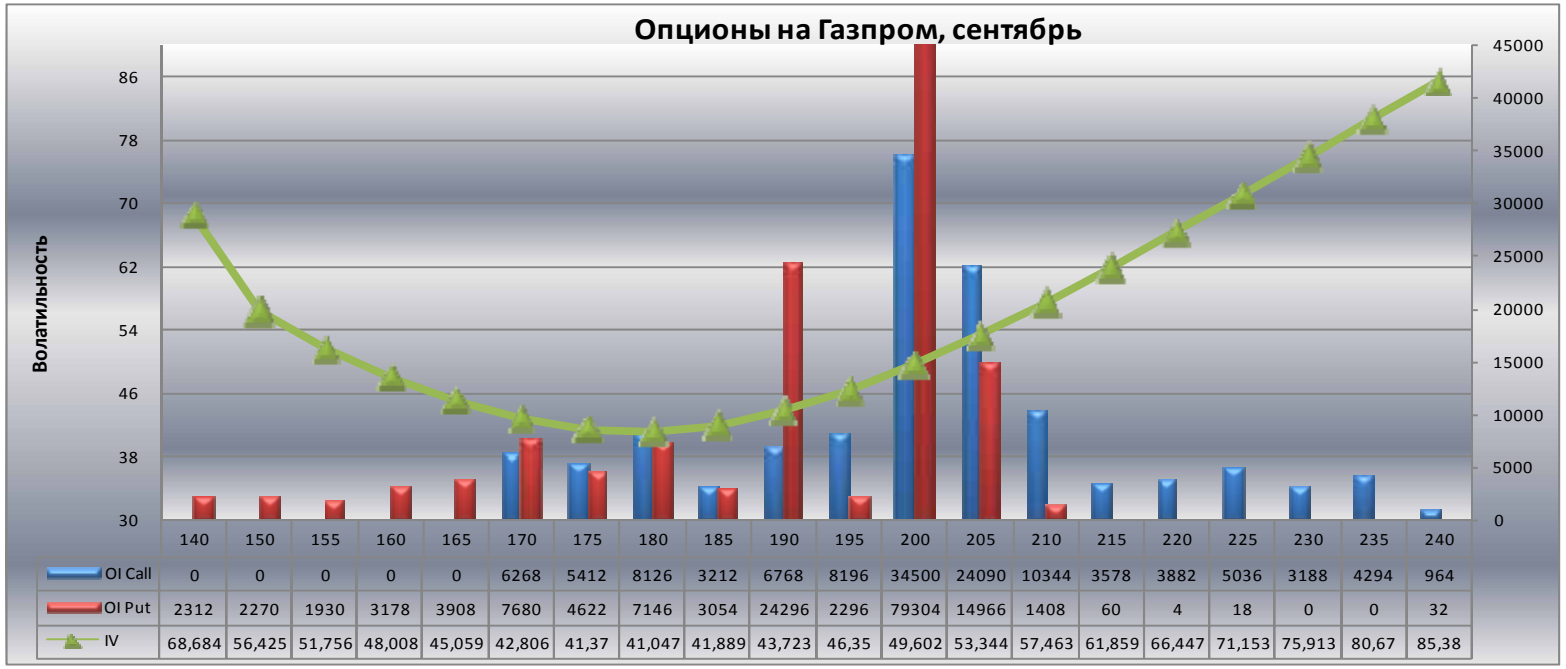
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,19	1063798	164371350724,83	169215
ROSN-9.11	1,86	63608	717075910,00	23164
LKOH-9.11	0,03	102220	1561957764,00	17386
GAZR-9.11	-0,44	628624	6174143893,00	17761
GMKR-9.11	0,13	53394	928251135,00	71884
SBRF-9.11	0,25	1136354	8157171866,00	8531
VTBR-9.11	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


Опционы на индекс РТС, сентябрь
Волатильность
84
80
76
72
68
64
60
56
52
48
44
40
72000
60000
48000
36000
24000
12000
0
145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000
OI Call 5680 6988 31898 35344 59966 51548 45794 80362 62242 75204 37596 33422 17636 24524 20478 10198 2676 0 0 0 0
OI Put 71254 77180 63746 43096 38648 48704 30348 56008 13916 50334 16570 4304 2868 194 18 112 4 0 0 0 0
IV 84,314 76,888 70,051 63,921 58,573 54,037 50,291 47,256 44,807 42,884 41,673 41,438 42,177 43,724 45,911 48,599 51,679 55,059 58,66 62,416 66,268

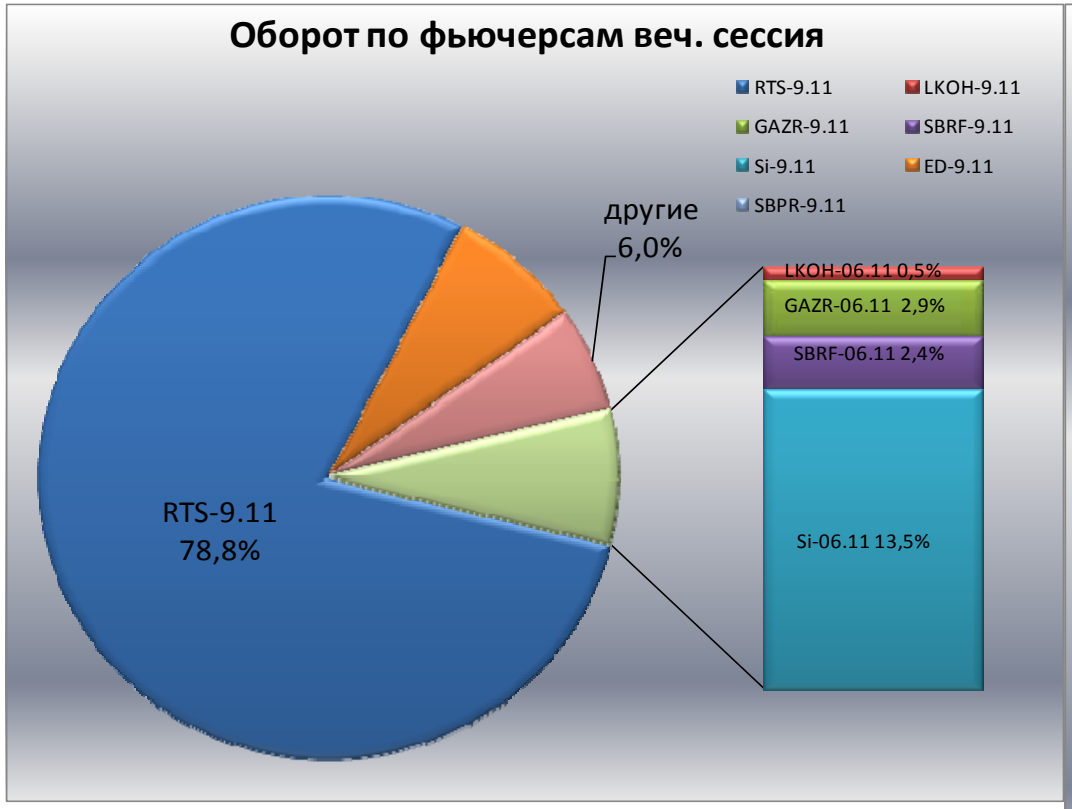

Опционы на Сбербанк, сентябрь
Волатильность
110
100
90
80
70
60
50
40
55000
50000
45000
40000
35000
30000
25000
20000
15000
10000
5000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 24704 30282 22756 29862 227098 16970 8458 15490 16498 17414 9378 11170 4104 15340 1710 1380
OI Put 5978 10718 9702 16660 13144 30290 5642 6354 38180 6166 4932 18132 6400 4822 534 38 344 168 2 0
IV 68,493 58,037 54,4 51,651 49,899 49,514 50,57 52,831 56,028 59,939 64,379 69,197 74,259 79,455 84,689 89,884 94,974 99,908 104,64 109,16

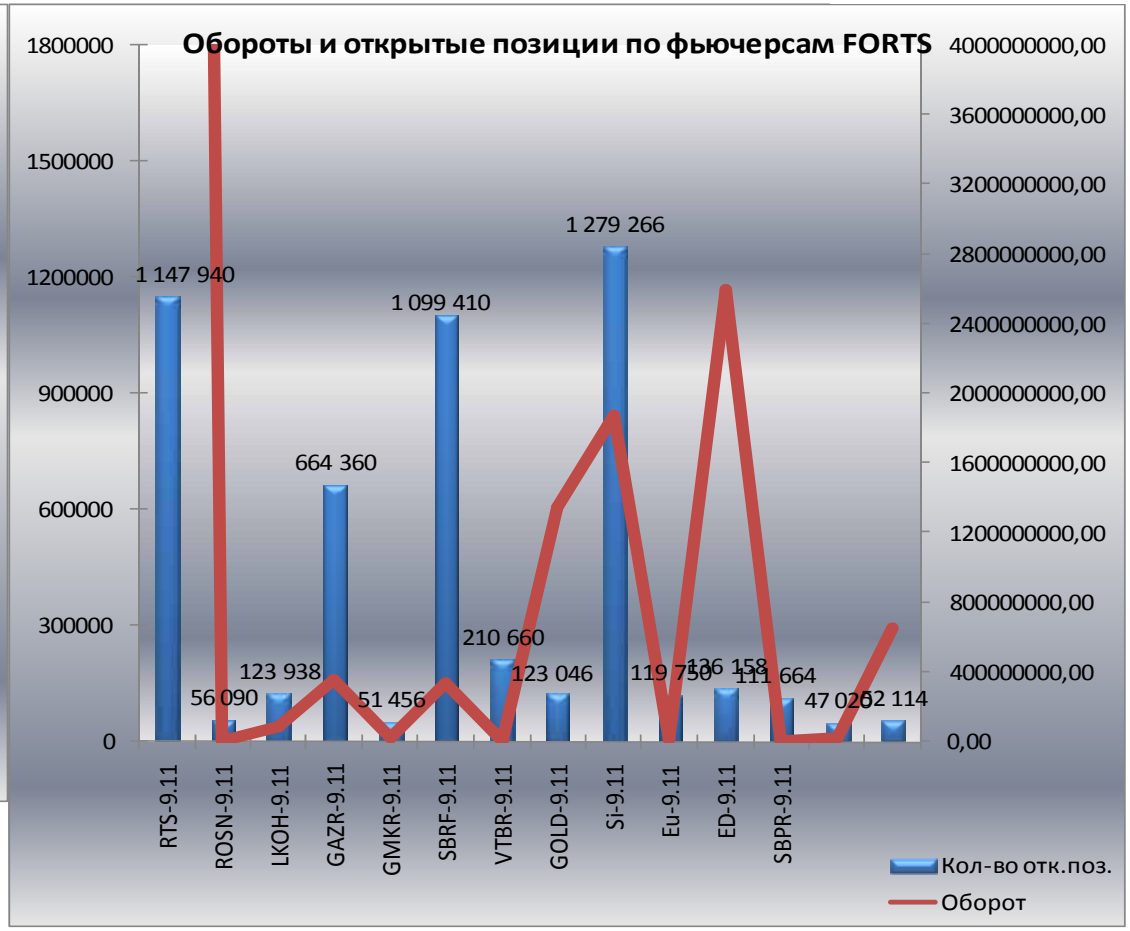


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1744	1378	3202	3102	1758	1410	284	312	162	70	
OI Put	0	4	404	14	988	1118	2342	3416	2180	3878	5206	946	0	16	0	0	0	0
IV	103,659	92,353	81,182	70,449	51,344	43,387	36,686	31,321	27,326	24,693	23,377	23,306	24,385	26,501	29,534	33,355	37,837	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	6268	5412	8126	3212	6768	8196	34500	24090	10344	3578	3882	5036	3188	4294	964
OI Put	2312	2270	1930	3178	3908	7680	4622	7146	3054	24296	2296	79304	14966	1408	60	4	18	0	0	32
IV	68,684	56,425	51,756	48,008	45,059	42,806	41,37	41,047	41,889	43,723	46,35	49,602	53,344	57,463	61,859	66,447	71,153	75,913	80,67	85,38


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
6,0%
RTS-9.11
78,8%
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
1 147 940
56 090
123 938
664 360
51 456
1 099 410
210 660
123 046
1 279 266
119 750
136 158
111 664
47 026
52 114
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