Четверг: смешанный внешний фон для России

Президент США Барак Обама в минувший четверг выступил перед конгрессом с предложением по сокращению налогов на зарплату и увеличению госрасходов на сумму в 447 млрд долл. Глава ФРС Бен Бернанке, к разочарованию многих, не предоставил каких-либо четких планов по стимулированию экономики. По итогам торгов рынки США несколько «просели»:: DJ Industrial упал на –1,04% составив 11295,81 пунктов, S&P 500 на –1,061% составив 1185,9 пункта.

Также, в четверг глава ЕЦБ Жан-Клод Трише заявил, что риски ухудшения темпов развития повысились, и что экономика находится в зоне весьма высокой неопределенности. По итогам европейской торговой сессии FTSE 100 вырос на +0,41% составив 5340,38 пункта, CAC 40 на +0,41% составив 3086,83 пункта, а DAX 30 на +0,06% составив 5408,46 пункта.

Что касается российского рынка, вечерней сессия завершилась в «красной зоне». Газпром за вечернюю сессию изменился на -0,77%, составив 173,78 пункта, Лукойл на -0,59% остановившись на отметке 1749,7 пункта, Роснефть на -0,59% (227,15 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,45% (29,73 пункта) и -0,36% (41,3 пункта), акции Сбербанка изменились на -0,99% (84,74 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	165180	1651,80	-0,99	1 117 460	-1,01%	31 694 041 951	21,64%
ROSN-9.11	22715	227,15	-0,59	55 214	-0,10%	8 492 596	1,87%
LKOH-9.11	17497	1749,70	-0,59	114 836	0,81%	97 772 972	5,88%
GAZR-9.11	17378	173,78	-0,77	617 804	0,07%	337 148 337	7,91%
GMKR-9.11	75049	7504,90	-0,09	55 554	-0,01%	4 867 933	0,60%
SBRF-9.11	8474	84,74	-0,99	1 055 080	-0,98%	696 786 381	9,99%
VTBR-9.11	7522	0,0752	-0,30	200 046	0,09%	4 322 946	1,47%
GOLD-9.11	1875	1874,5000	1,09	127 022	1,29%	992 028 863	22,99%
Si-9.11	29725	29,73	0,45	1 158 674	-0,80%	1 562 371 393	6,45%
Eu-9.11	41300	41,30	-0,36	118 812	0,45%	33 055 863	12,81%
ED-9.11	1,39	1,39	-0,82	197 976	4,18%	2 560 253 368	40,42%
SBPR-9.11	7079	70,79	-1,15	101 124	-1,84%	8 508 012	16,39%
RTSS-9.11	10507	10507,00	-0,47	41 762	0,30%	23 678 080	4,57%
BR-7.11	114	114,38	-1,46	60 832	-10,66%	688 390 737	33,76%

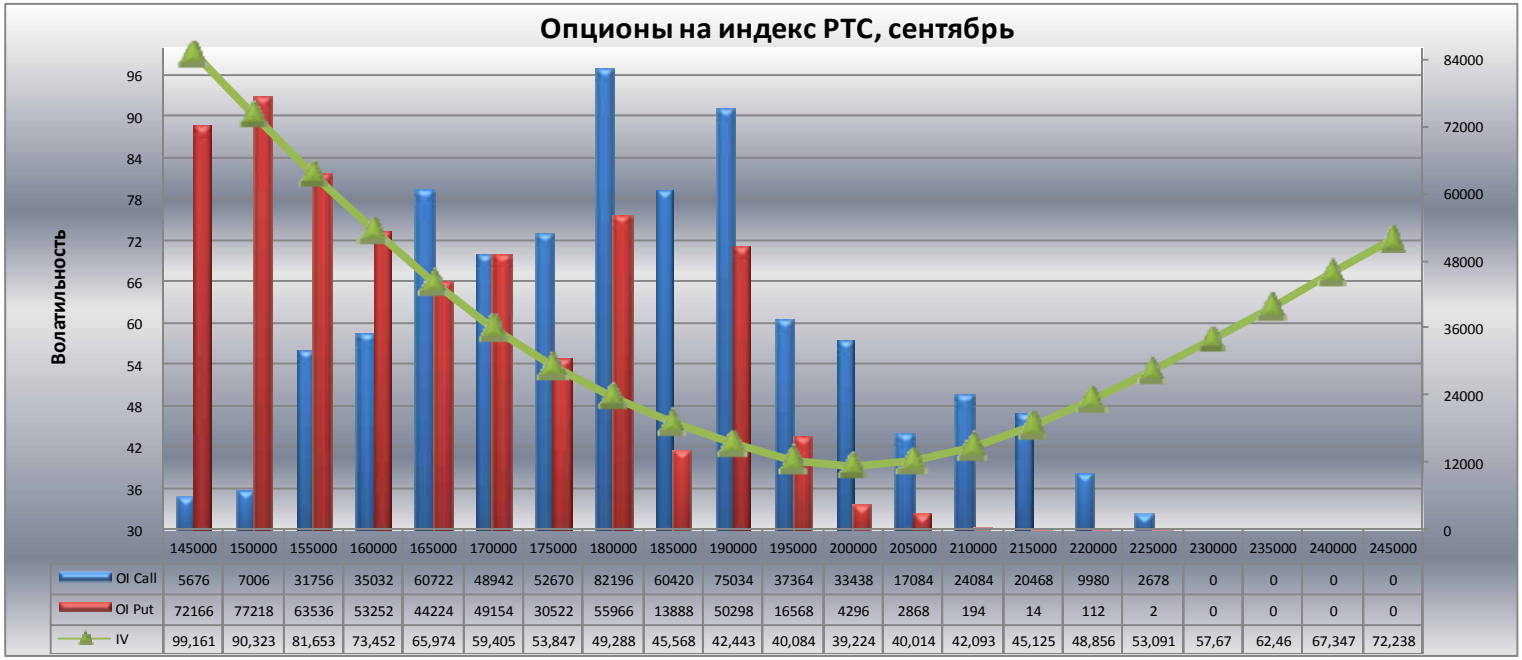
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57623,63	1,80%	00:12:33
CAC 40	3085,83	0,41%	19:35:19
DAX 30	5408,46	0,05%	19:35:31
DJ Industrial	11295,81	-1,04%	00:32:13
FTSE 100	5340,38	0,41%	19:35:35
Hang Seng	19855,06	-0,29%	10:01:19
Nikkei 225	8737,66	-0,63%	10:00:06
S&P 500	1185,9	-1,06%	00:03:02
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1870,4	0,11%	10:01:27
Palladium	756,38	0,52%	09:55:48
Platinum	1848	-0,40%	10:01:18
RTSI	1 672,35	-0,17%	23:50:00
RTS_Standard	10 515,74	-0,33%	23:50:00
RTSI_DEREX	1713.92	0.42%	18:45:00

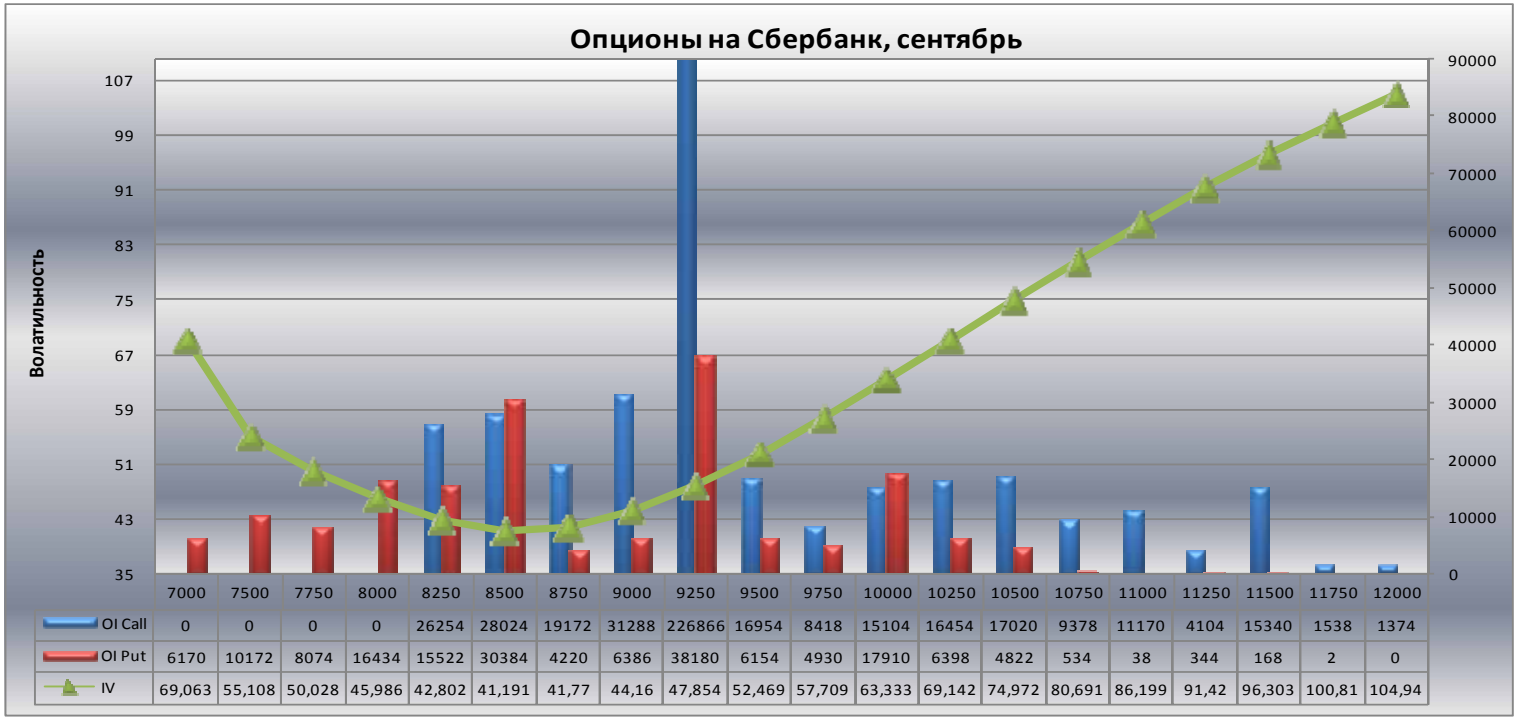
Вечерняя сессия

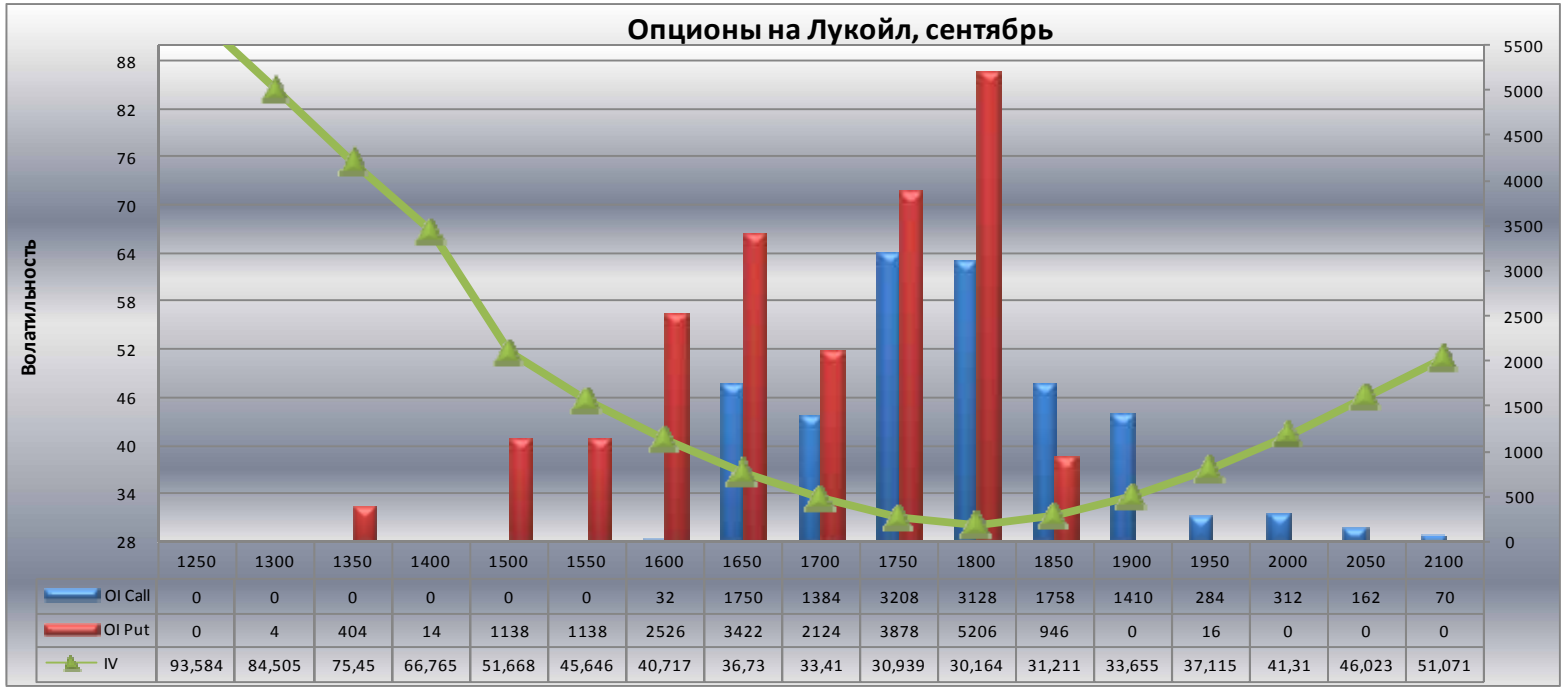
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,99	1117460	31694041950,76	165180
ROSN-9.11	-0,59	55214	8492596,00	22715
LKOH-9.11	-0,59	114836	97772972,00	17497
GAZR-9.11	-0,77	617804	337148337,00	17378
GMKR-9.11	-0,09	55554	4867933,00	75049
SBRF-9.11	-0,99	1055080	696786381,00	8474
VTBR-9.11	-0,3	200046	4322946,00	7522
GOLD-9.11	1,09	127022	992028863,41	1874,5
Si-9.11	0,45	1158674	1562371393,00	29725
Eu-9.11	-0,36	118812	33055863,00	41300
ED-9.11	-0,82	197976	2560253368,20	1,389
SBPR-9.11	-1,15	101124	8508012,00	7079
RTSS-9.11	-0,47	41762	23678080,00	10507
BR-7.11	-1,46	60 832	688390736,55	114,38

Дневная сессия

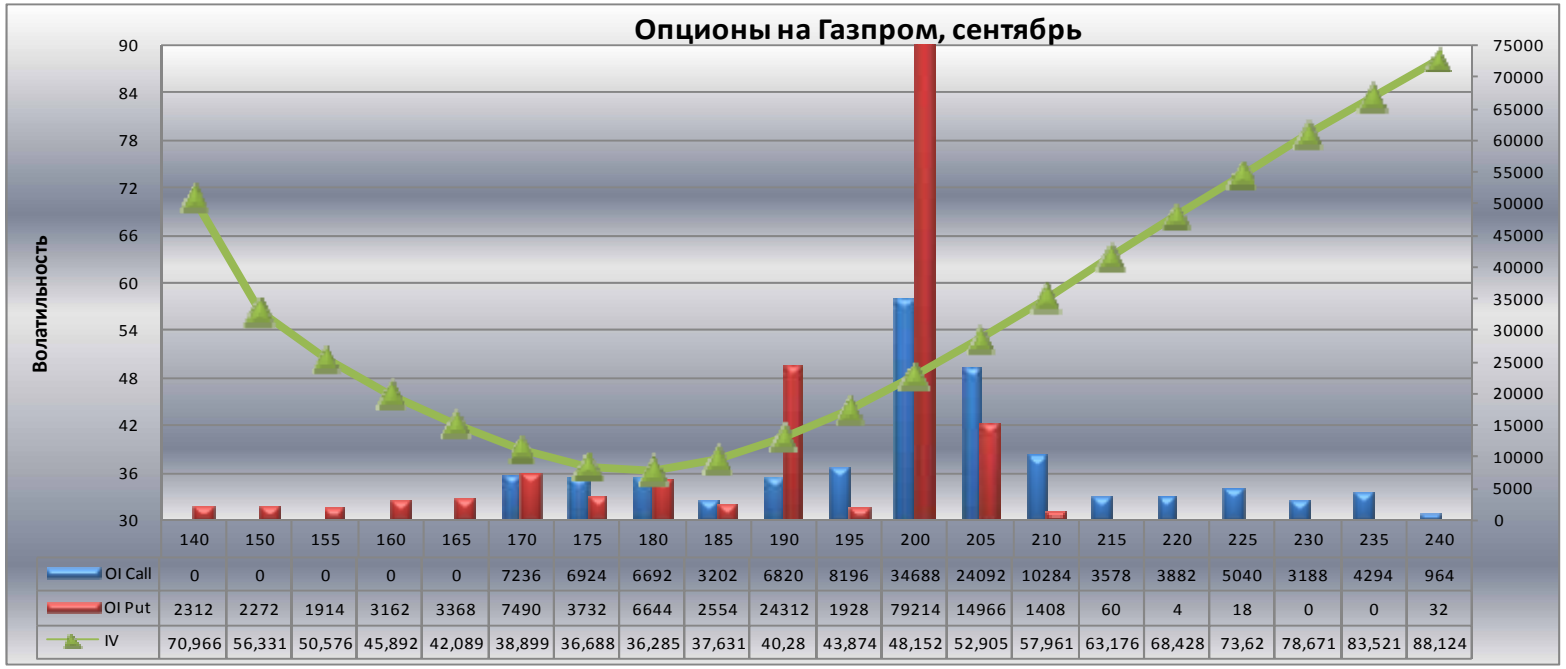
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,56	1128890	1,46489E+11	166835
ROSN-9.11	-0,21	55268	454938416	22849
LKOH-9.11	-0,54	113914	1662301432	17600
GAZR-9.11	0,6	617370	4260791947	17512
GMKR-9.11	2,43	55558	804662721	75116
SBRF-9.11	2,11	1065474	6972299734	8559
VTBR-9.11	-0,08	199858	294977889	7545
GOLD-9.11	2,67	125404	4315374817	1854,3
Si-9.11	0,22	1168044	24206199872	29595
Eu-9.11	-0,12	118280	257992721	41446
ED-9.11	-0,37	190040	6334666166	1,4003
SBPR-9.11	1,19	103022	51894525	7161
RTSS-9.11	0,68	41636	518070195	10557
BR-7.11	1,09	68094	2039106163	116,08


Опционы на индекс РТС, сентябрь
Волатильность
96
90
84
78
72
66
60
54
48
42
36
30
84000
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 5676 7006 31756 35032 60722 48942 52670 82196 60420 75034 37364 33438 17084 24084 20468 9980 2678 0 0 0 0
OI Put 72166 77218 63536 53252 44224 49154 30522 55966 13888 50298 16568 4296 2868 194 14 112 2 0 0 0 0
IV 99,161 90,323 81,653 73,452 65,974 59,405 53,847 49,288 45,568 42,443 40,084 39,224 40,014 42,093 45,125 48,856 53,091 57,67 62,46 67,347 72,238

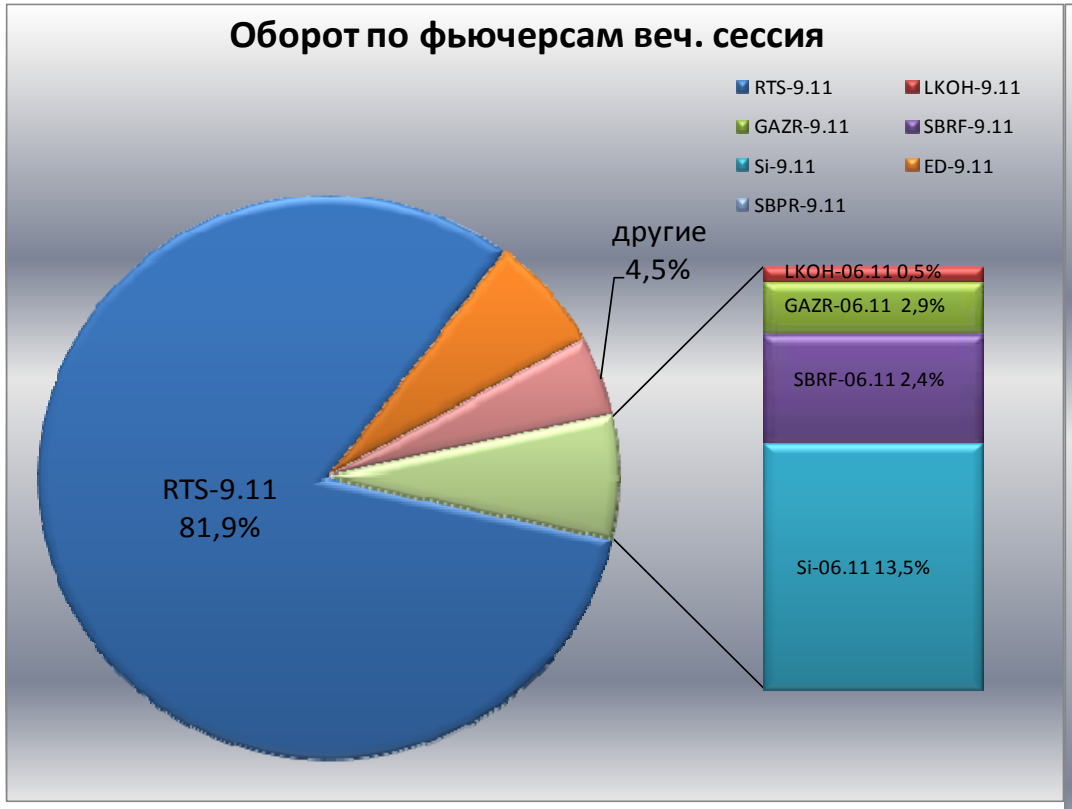

Опционы на Сбербанк, сентябрь
Волатильность
107
99
91
83
75
67
59
51
43
35
90000
80000
70000
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 26254 28024 19172 31288 226866 16954 8418 15104 16454 17020 9378 11170 4104 15340 1538 1374
OI Put 6170 10172 8074 16434 15522 30384 4220 6386 38180 6154 4930 17910 6398 4822 534 38 344 168 2 0
IV 69,063 55,108 50,028 45,986 42,802 41,191 41,77 44,16 47,854 52,469 57,709 63,333 69,142 74,972 80,691 86,199 91,42 96,303 100,81 104,94

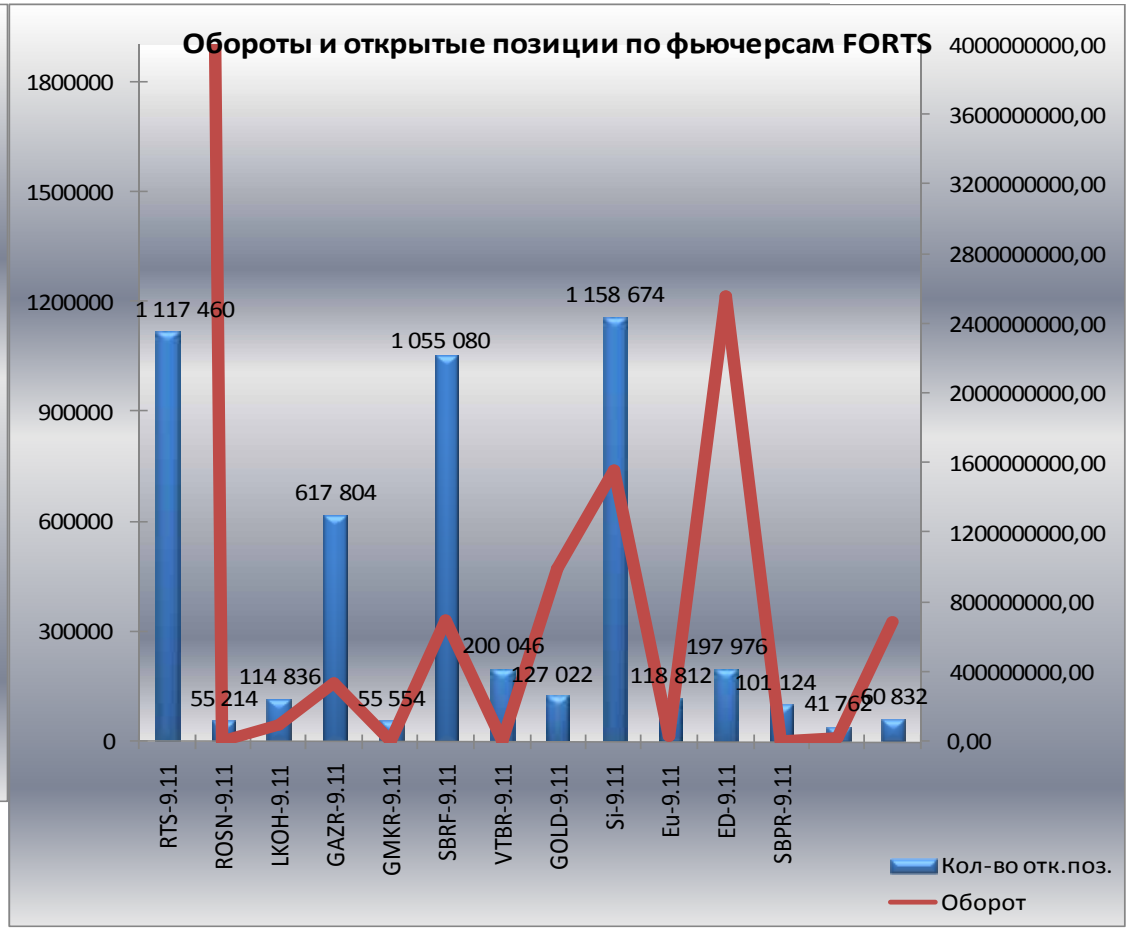


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1750	1384	3208	3128	1758	1410	284	312	162	70
OI Put	0	4	404	14	1138	1138	2526	3422	2124	3878	5206	946	0	16	0	0	0
IV	93,584	84,505	75,45	66,765	51,668	45,646	40,717	36,73	33,41	30,939	30,164	31,211	33,655	37,115	41,31	46,023	51,071



	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	7236	6924	6692	3202	6820	8196	34688	24092	10284	3578	3882	5040	3188	4294	964
OI Put	2312	2272	1914	3162	3368	7490	3732	6644	2554	24312	1928	79214	14966	1408	60	4	18	0	0	32
IV	70,966	56,331	50,576	45,892	42,089	38,899	36,688	36,285	37,631	40,28	43,874	48,152	52,905	57,961	63,176	68,428	73,62	78,671	83,521	88,124


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
4,5%
RTS-9.11
81,9%
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
1 117 460
55 214
114 836
617 804
55 554
1 055 080
200 046
127 022
1 158 674
118 812
197 976
101 124
41 762
60 832
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