Вторник: уверенность инвесторов в банкротстве Греции только растет

По итогам торгов рынки США, несмотря на негативные новости, закрылись с повышением: DJ Industrial вырос на +0,40% составив 11005,85 пункта, S&P 500 на +0,91% составив 1172,87 пункта.

Европейский рынок немного «оправился» после сокрушительного падения: CAC40 вырос на +1,41% составив 2894,93 пункта, DAX30 на +1,85% составив 5166,36 пунктов, FTSE100 на +0,87% составив 5174,25. Тем не менее уверенность инвесторов в банкротстве Греции только растет.

Что касается российского рынка, торги прошли в «боковике»: Газпром за вечернюю сессию изменился на +0,26%, составив 164,61 пункта, Лукойл на +0,20% остановившись на отметке 1718,20 пункта, Роснефть на +0,21% (216,96 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,30% (30,12 пункта) и -0,11% (41,28 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	158105	1581,05	0,37	1 066 632	184,15%	24 360 144 594	72,26%
ROSN-9.11	21696	216,96	0,21	28 512	-17,57%	3 576 419	1,88%
LKOH-9.11	17182	1718,20	0,20	80 718	6,65%	52 382 061	5,50%
GAZR-9.11	16461	164,61	0,26	535 366	30,74%	278 614 763	5,90%
GMKR-9.11	76191	7619,10	0,12	46 518	191,14%	10 562 896	6,27%
SBRF-9.11	8100	81,00	0,72	906 698	9,69%	337 988 108	13,00%
VTBR-9.11	7467	0,0747	0,58	135 176	1517,71%	3 697 398	5,53%
GOLD-9.11	1839	1838,7000	1,17	105 796	81,69%	691 428 308	2092,91%
Si-9.11	30124	30,12	-0,30	1 021 502	6164,58%	669 030 241	1144,71%
Eu-9.11	41275	41,28	-0,11	81 850	-82,50%	7 940 566	0,20%
ED-9.11	1,37	1,37	0,11	136 540	470,44%	1 635 771 148	8814,36%
SBPR-9.11	6669	66,69	0,94	108 340	-49,62%	1 347 157	0,11%
RTSS-9.11	10185	10185,00	0,28	38 690	-23,37%	18 333 945	3,34%
BR-7.11	112	111,91	0,09	50 488	51,23%	203 265 990	2176,59%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55543,97	-0,25%	00:15:33
CAC 40	2894,93	1,41%	05:36:57
DAX 30	5166,36	1,85%	20:48:22
DJ Industrial	11105,85	0,40%	00:33:59
FTSE 100	5174,25	0,87%	19:35:32
Hang Seng	18717,23	-1,65%	10:23:21
Nikkei 225	8518,57	-1,14%	10:00:08
S&P 500	1172,87	0,91%	00:03:33
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1826,5	-0,37%	10:23:25
Palladium	719,5	-0,21%	10:22:10
Platinum	1805,5	-0,26%	10:23:10
RTSI	1 572,87	0,06%	23:50:00
RTS_Standard	10 169,74	0,15%	23:50:00
RTSI_DEREX	1613.32	0.37%	18:45:00

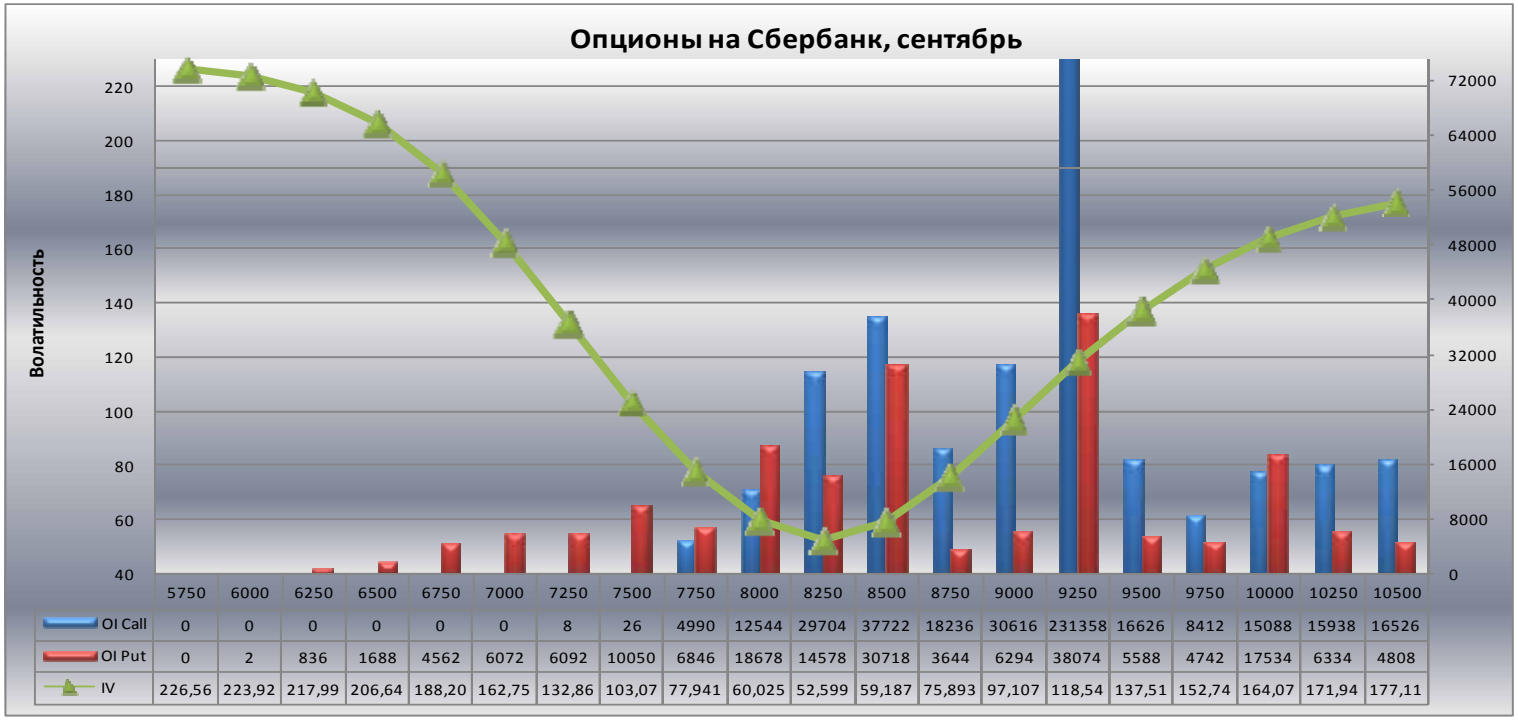
Вечерняя сессия

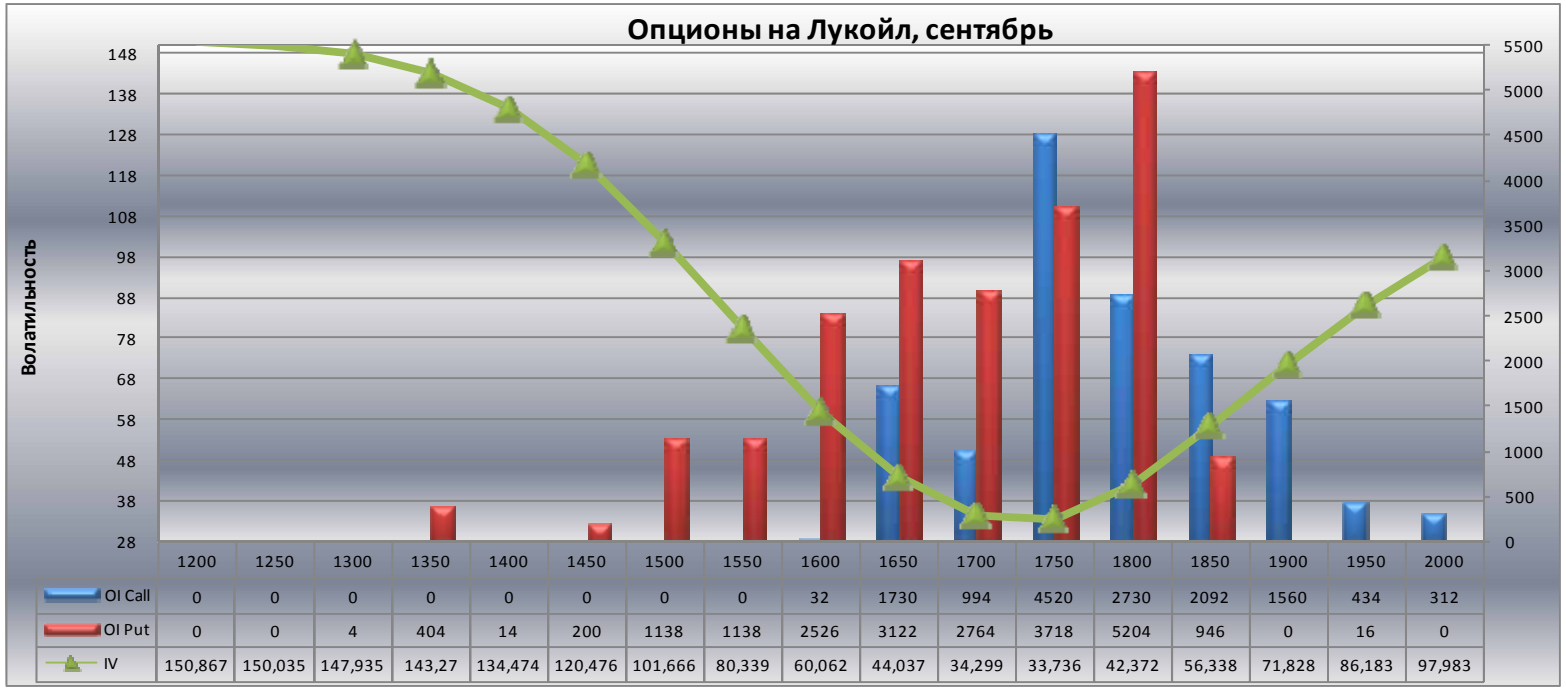
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	0,37	1066632	24360144593,83	158105
ROSN-9.11	0,21	28512	3576419,00	21696
LKOH-9.11	0,2	80718	52382061,00	17182
GAZR-9.11	0,26	535366	278614763,00	16461
GMKR-9.11	0,12	46518	10562896,00	76191
SBRF-9.11	0,72	906698	337988108,00	8100
VTBR-9.11	0,58	135176	3697398,00	7467
GOLD-9.11	1,17	105796	691428307,85	1838,7
Si-9.11	-0,3	1021502	669030241,00	30124
Eu-9.11	-0,11	81850	7940566,00	41275
ED-9.11	0,11	136540	1635771148,05	1,3699
SBPR-9.11	0,94	108340	1347157,00	6669
RTSS-9.11	0,28	38690	18333945,00	10185
BR-7.11	0,09	50 488	203265990,06	111,91

Дневная сессия

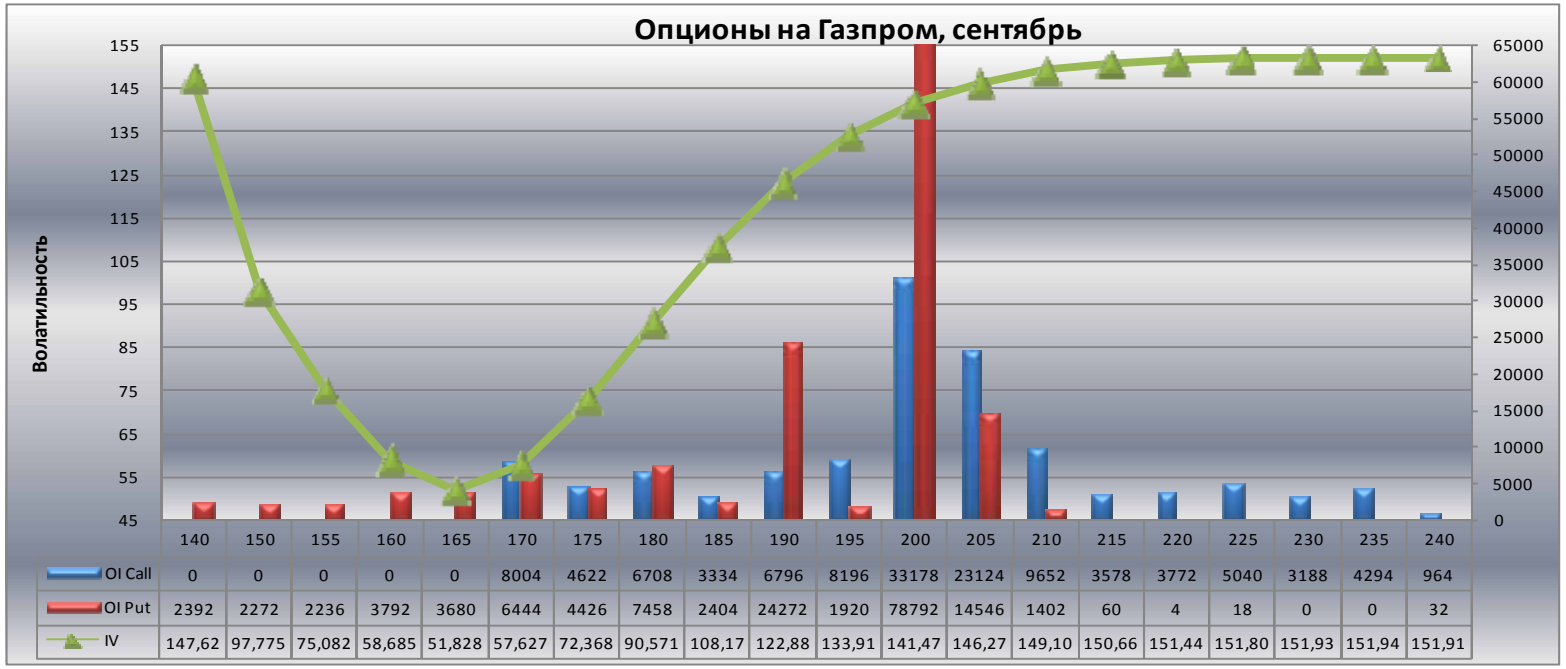
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296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


Опционы на индекс РТС, сентябрь
Волатильность
140
130
120
110
100
90
80
70
60
50
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 5710 8488 34002 39588 70694 49470 49778 51960 59202 73380 36186 32990 16902 24036 20466 9978 2678 0 0 0 0
OI Put 69660 73698 58578 45922 41932 47454 30480 55614 13884 50240 16516 4250 2864 194 14 112 2 0 0 0 0
IV 140,46 128,47 113,85 97,756 81,755 67,391 55,748 47,426 43,349 44,457 50,131 58,843 69,11 79,746 89,9 99,03 106,85 113,31 118,45 122,43 125,42

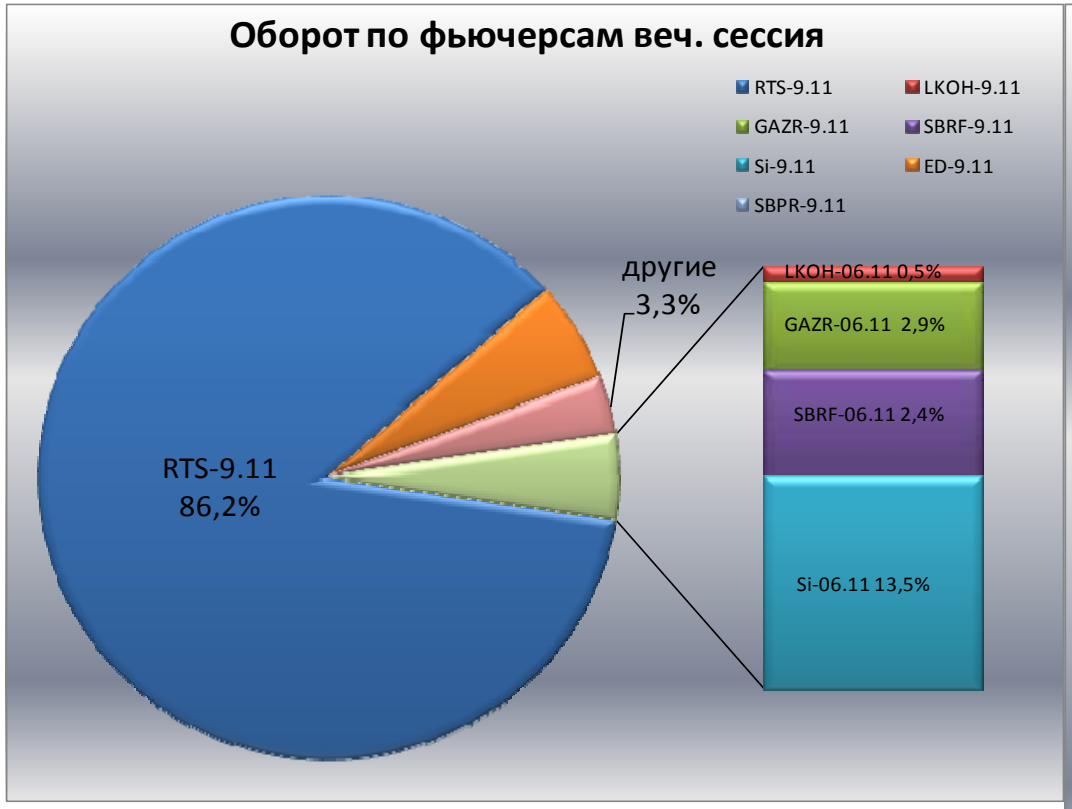

Опционы на Сбербанк, сентябрь
Волатильность
220
200
180
160
140
120
100
80
60
40
72000
64000
56000
48000
40000
32000
24000
16000
8000
0
5750 6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500
OI Call 0 0 0 0 0 0 8 26 4990 12544 29704 37722 18236 30616 231358 16626 8412 15088 15938 16526
OI Put 0 2 836 1688 4562 6072 6092 10050 6846 18678 14578 30718 3644 6294 38074 5588 4742 17534 6334 4808
IV 226,56 223,92 217,99 206,64 188,20 162,75 132,86 103,07 77,941 60,025 52,599 59,187 75,893 97,107 118,54 137,51 152,74 164,07 171,94 177,11

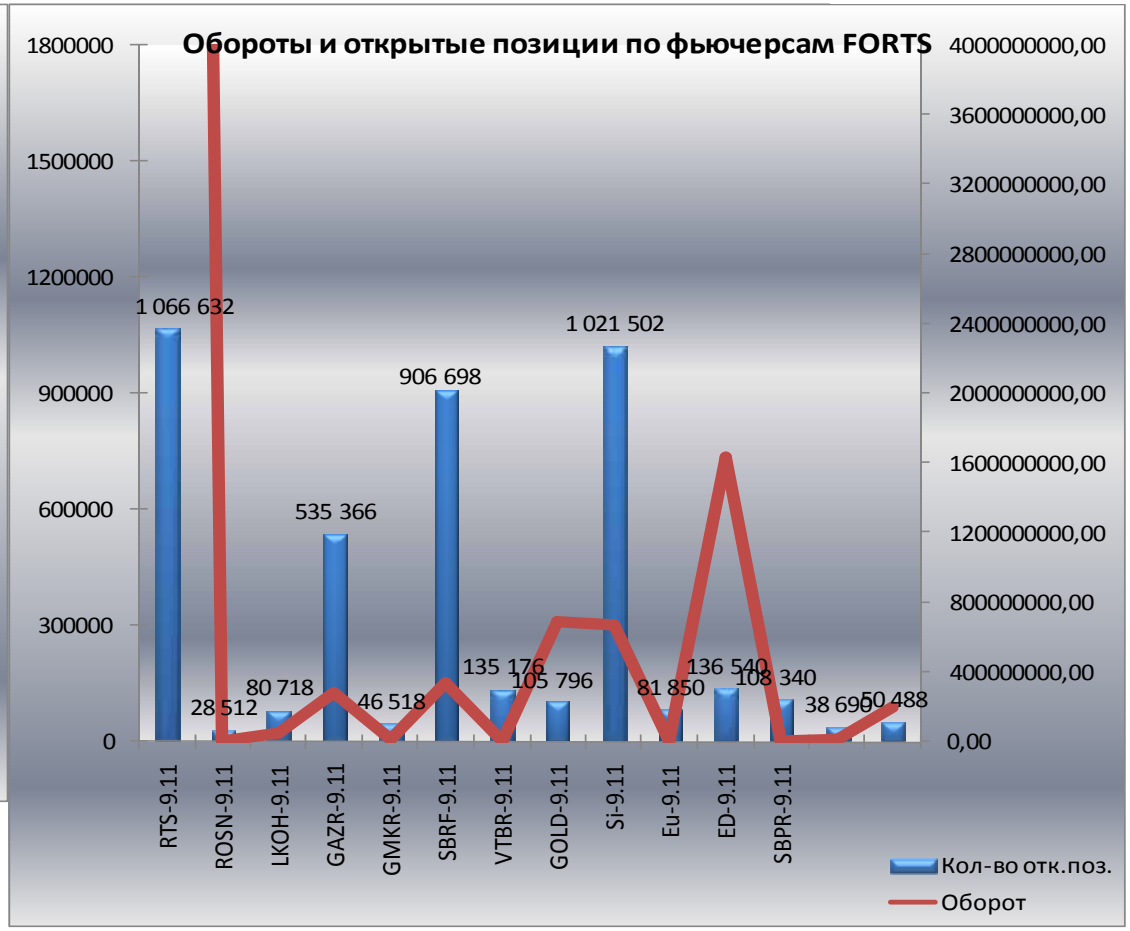


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	32	1730	994	4520	2730	2092	1560	434	312
OI Put	0	0	4	404	14	200	1138	1138	2526	3122	2764	3718	5204	946	0	16	0
IV	150,867	150,035	147,935	143,27	134,474	120,476	101,666	80,339	60,062	44,037	34,299	33,736	42,372	56,338	71,828	86,183	97,983



	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	8004	4622	6708	3334	6796	8196	33178	23124	9652	3578	3772	5040	3188	4294	964
OI Put	2392	2272	2236	3792	3680	6444	4426	7458	2404	24272	1920	78792	14546	1402	60	4	18	0	0	32
IV	147,62	97,775	75,082	58,685	51,828	57,627	72,368	90,571	108,17	122,88	133,91	141,47	146,27	149,10	150,66	151,44	151,80	151,93	151,94	151,91


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
3,3%
RTS-9.11
86,2%
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
1 066 632
28 512
80 718
535 366
46 518
906 698
135 176
105 796
1 021 502
81 850
136 540
108 340
38 690
50 488
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