Четверг: новости из Европы продолжают положительно влиять на рынки

ЕЦБ заявил, что был осуществлен договор с ФРС, Банком Японии, Банком Англии и Национальным Банком Швейцарии о предоставлении банкам еврозоны трехмесячных кредитов. Таким образом, европейские индексы завершили сессию в плюсе: CAC40 вырос на +3,27% составив 3045,62 пункта, DAX30 на +3,15% составив 5508,24 пункта, FTSE100 на +2,11% составив 5337,54.

Фондовый рынок США также завершил торговую сессию неплохим ростом основных индексов: DJ Industrial вырос на +1,66% составив 11433,18 пункта, S&P 500 на +1,72% составив 1209,11 пункта.

По итогам четверга индекс ММВБ прибавил 1,35%. В целом в течение дня наблюдался некоторый рост, а во время вечерней торговой сессии— небольшие сдвиги индексов в ту или иную сторону: Газпром за вечернюю сессию изменился на +0,13%, составив 168,33 пункта, Лукойл на +0,18% остановившись на отметке 1757,30 пункта, Роснефть на +0,28% (219,80 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,18% (30,76 пункта) и +0,08% (42,65 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-12.11	157685	1576,85	0,31	597 710	-0,27%	23 306 158 699	17,81%
ROSN-12.11	21980	219,80	0,28	78 210	0,01%	9 016 055	2,27%
LKOH-12.11	17573	1757,30	0,18	125 964	-0,06%	82 229 443	3,82%
GAZR-12.11	16833	168,33	0,13	329 902	1,99%	361 686 027	7,46%
GMKR-12.11	75500	7550,00	-0,01	10 952	0,57%	10 331 591	1,33%
SBRF-12.11	8235	82,35	0,46	488 788	-0,10%	428 808 593	5,72%
VTBR-12.11	7782	0,0778	0,15	71 128	-0,06%	2 467 250	0,79%
GOLD-12.11	1798	1798,0000	0,62	136 126	2,00%	586 416 332	13,60%
Si-12.11	30762	30,76	-0,18	1 293 226	0,65%	867 686 557	2,23%
Eu-12.11	42650	42,65	0,08	101 894	0,27%	18 601 962	1,97%
ED-12.11	1,39	1,39	0,20	55 654	6,85%	790 210 761	15,93%
SBPR-12.11	6680	66,80	-0,15	51 504	0,05%	461 370	0,42%
RTSS-12.11	10341	10341,00	-0,14	3 690	0,27%	4 037 885	1,81%
BR-12.11	112	112,28	0,52	41 288	5571,43%	304 382 258	2962,38%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56381,46	0,17%	00:15:33
CAC 40	3045,62	3,27%	19:35:19
DAX 30	5508,24	3,15%	19:35:34
DJ Industrial	11433,18	1,66%	00:39:23
FTSE 100	5337,54	2,11%	19:35:34
Hang Seng	19523,48	1,78%	10:11:04
Nikkei 225	8864,16	2,25%	10:00:08
S&P 500	1209,11	1,72%	00:04:03
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1770,5	-1,02%	10:11:17
Palladium	715,25	-0,83%	10:09:32
Platinum	1772,5	-0,50%	10:11:04
RTSI	1 592,33	-0,69%	23:50:00
RTS_Standard	10 324,43	-0,06%	23:50:00
RTSI_DEREX	1634.28	1.49%	18:45:00

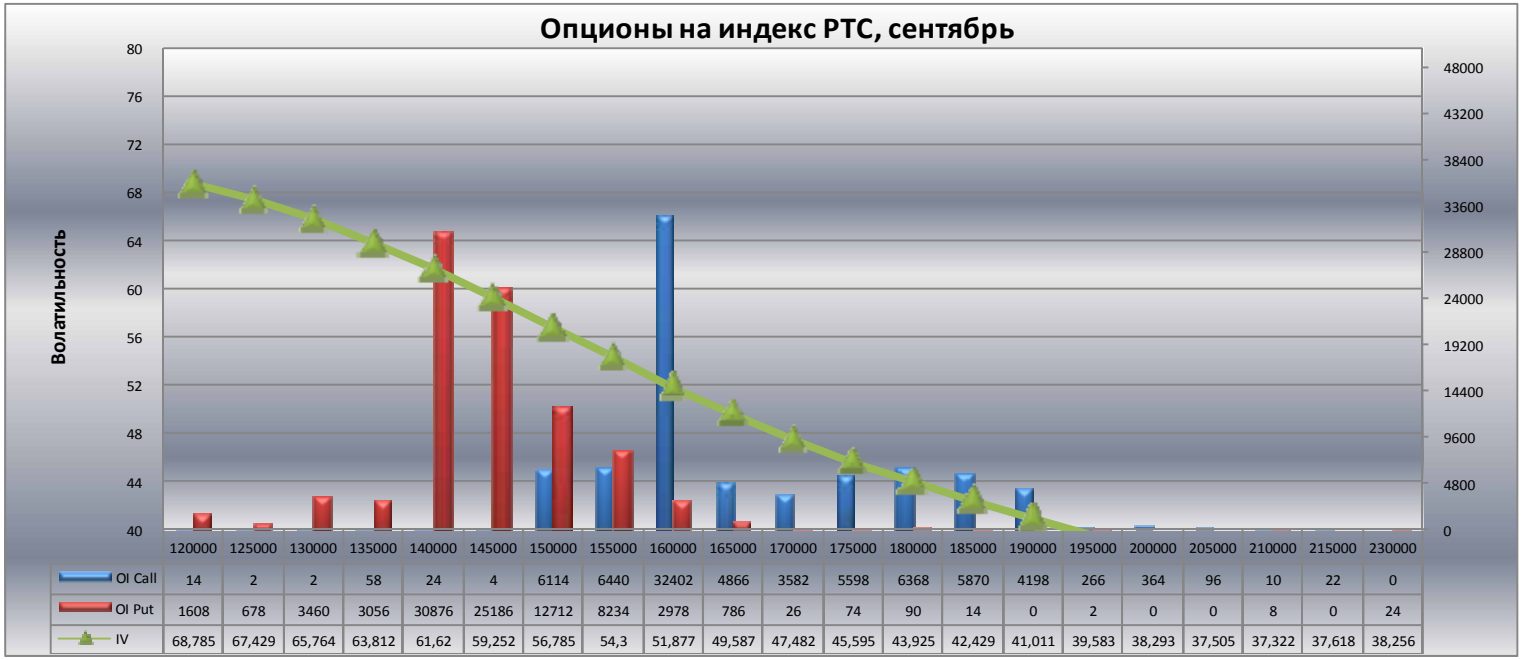
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,31	597710	23306158699,44	157685
ROSN-12.11	0,28	78210	9016055,00	21980
LKOH-12.11	0,18	125964	82229443,00	17573
GAZR-12.11	0,13	329902	361686027,00	16833
GMKR-12.11	-0,01	10952	10331591,00	75500
SBRF-12.11	0,46	488788	428808593,00	8235
VTBR-12.11	0,15	71128	2467250,00	7782
GOLD-12.11	0,62	136126	586416331,66	1798
Si-12.11	-0,18	1293226	867686557,00	30762
Eu-12.11	0,08	101894	18601962,00	42650
ED-12.11	0,2	55654	790210760,78	1,3866
SBPR-12.11	-0,15	51504	461370,00	6680
RTSS-12.11	-0,14	3690	4037885,00	10341
BR-12.11	0,52	41 288	304382257,51	112,28

Дневная сессия

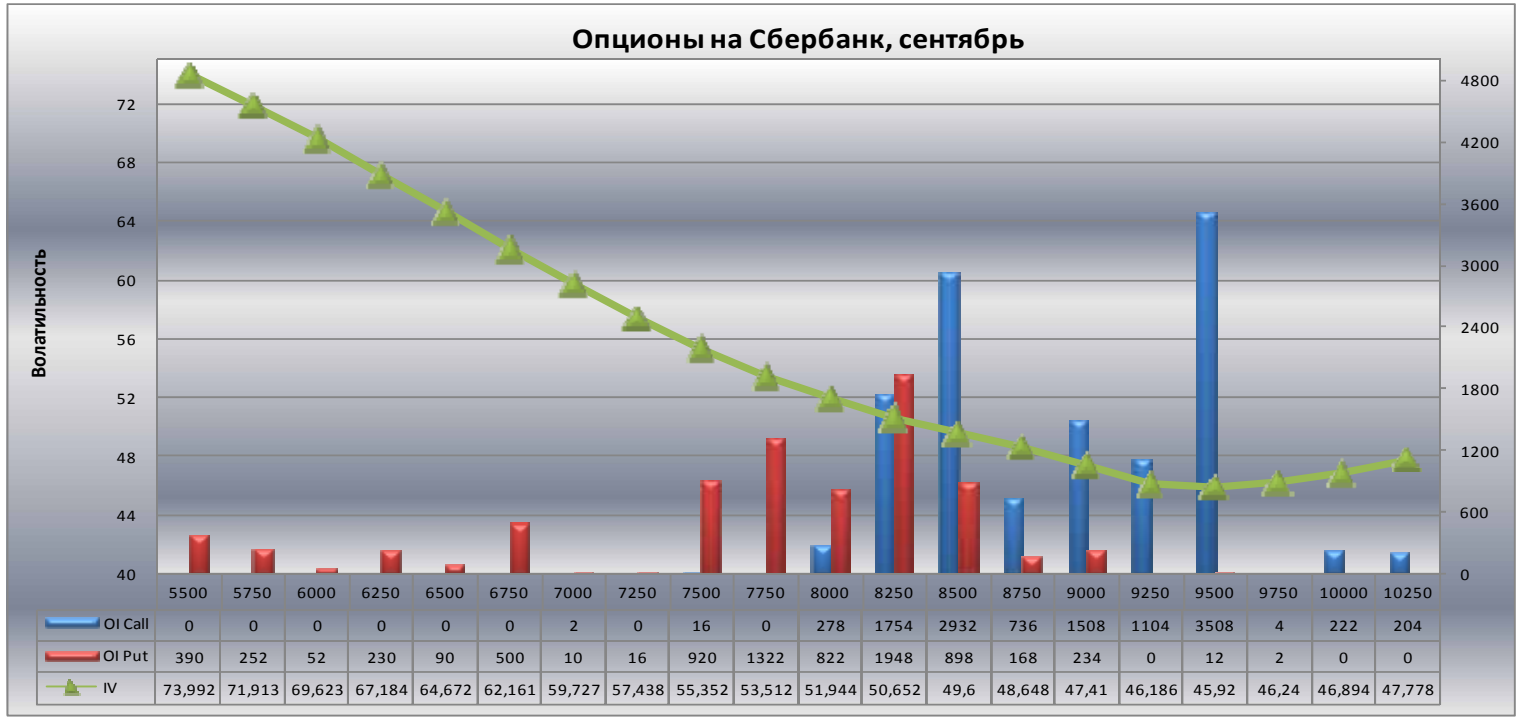
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	1,56	599326	1,30863E+11	157195
ROSN-12.11	0,84	78204	397540033	21918
LKOH-12.11	0,7	126044	2152825971	17541
GAZR-12.11	0,06	323474	4847834107	16811
GMKR-12.11	0,14	10890	779379343	75504
SBRF-12.11	1,07	489294	7492357229	8197
VTBR-12.11	1,12	71168	313450340	7770
GOLD-12.11	-2,65	133460	4310730143	1787
Si-12.11	-0,03	1284890	38825535493	30818
Eu-12.11	1,15	101618	944094003	42615
ED-12.11	1,22	52088	4960701540	1,3839
SBPR-12.11	0,75	51476	108994957	6690
RTSS-12.11	1,05	3680	223156075	10356
BR-12.11	1,64	728	10274927,1	110,79

Опционы на индекс РТС, сентябрь

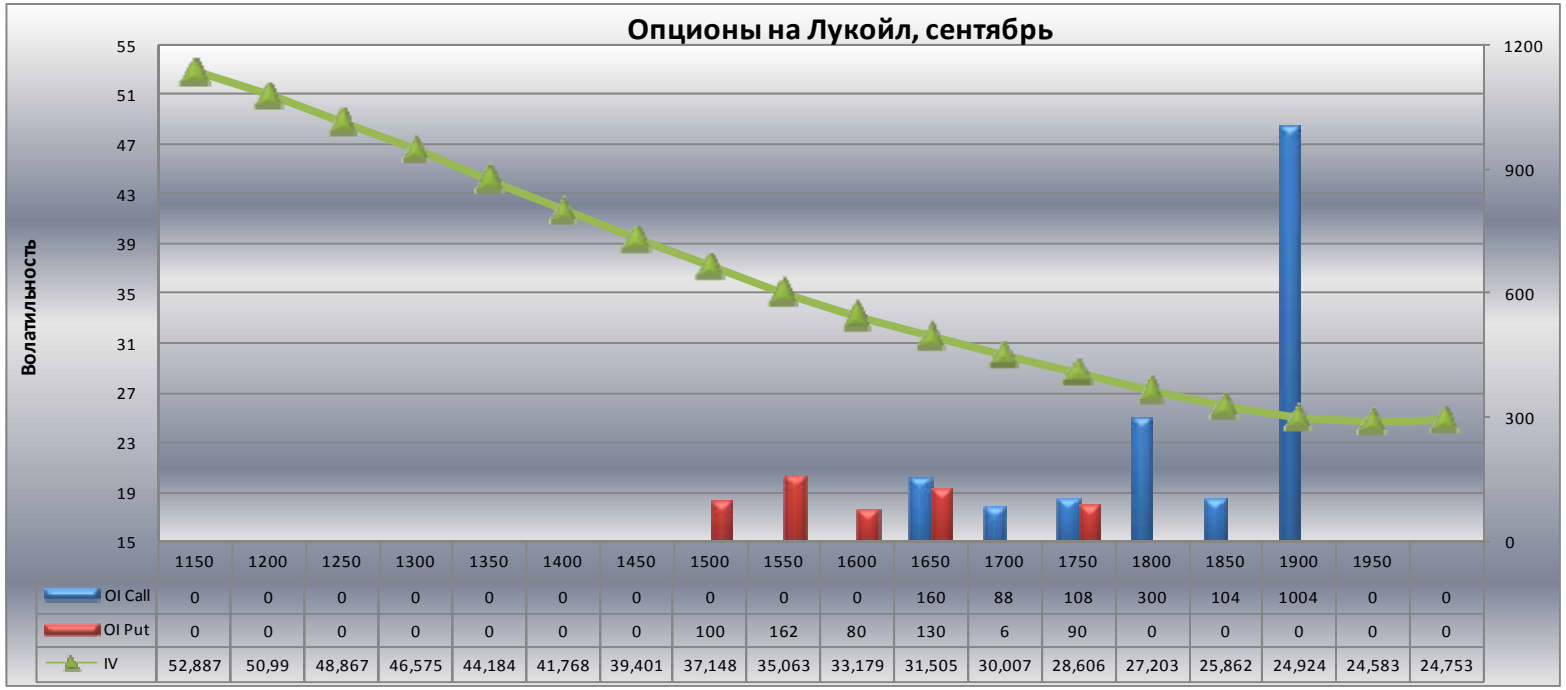


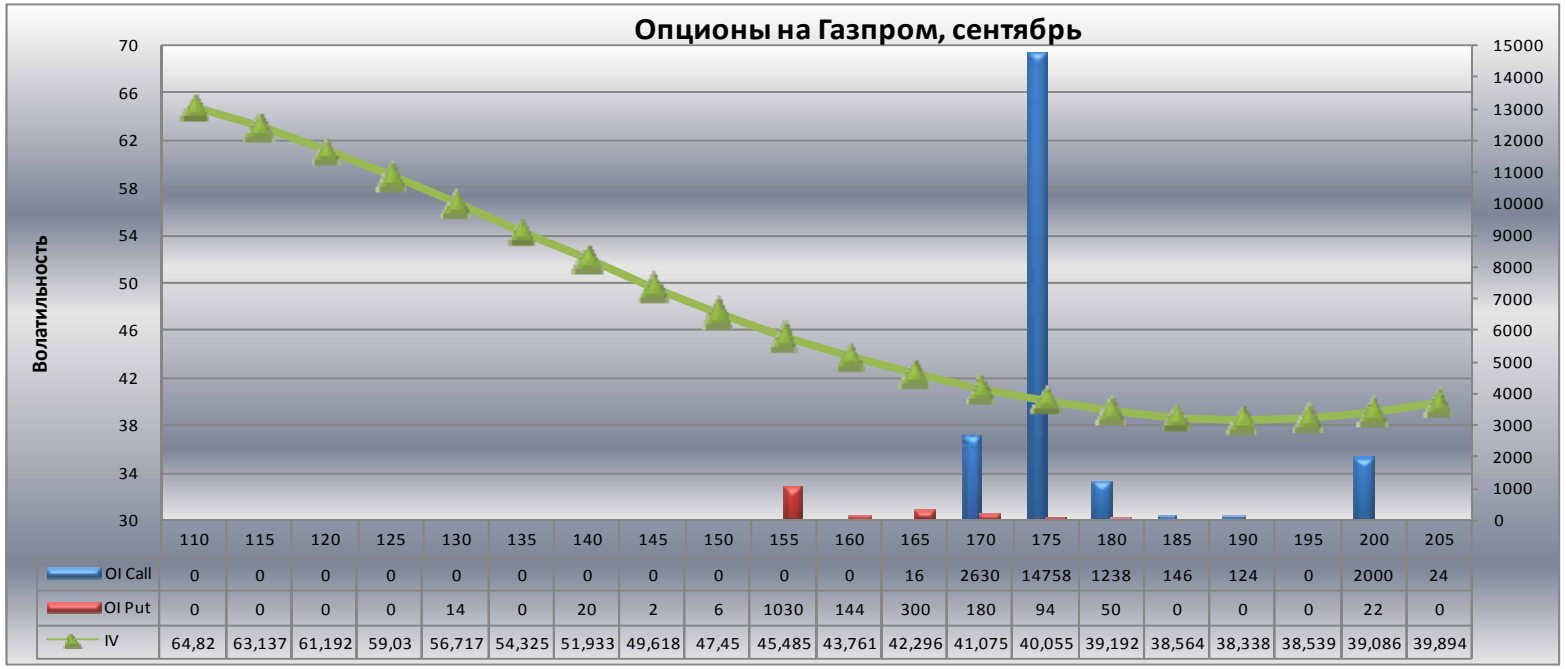
	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	230000
OI Call	14	2	2	58	24	4	6114	6440	32402	4866	3582	5598	6368	5870	4198	266	364	96	10	22	0
OI Put	1608	678	3460	3056	30876	25186	12712	8234	2978	786	26	74	90	14	0	2	0	0	8	0	24
IV	68,785	67,429	65,764	63,812	61,62	59,252	56,785	54,3	51,877	49,587	47,482	45,595	43,925	42,429	41,011	39,583	38,293	37,505	37,322	37,618	38,256

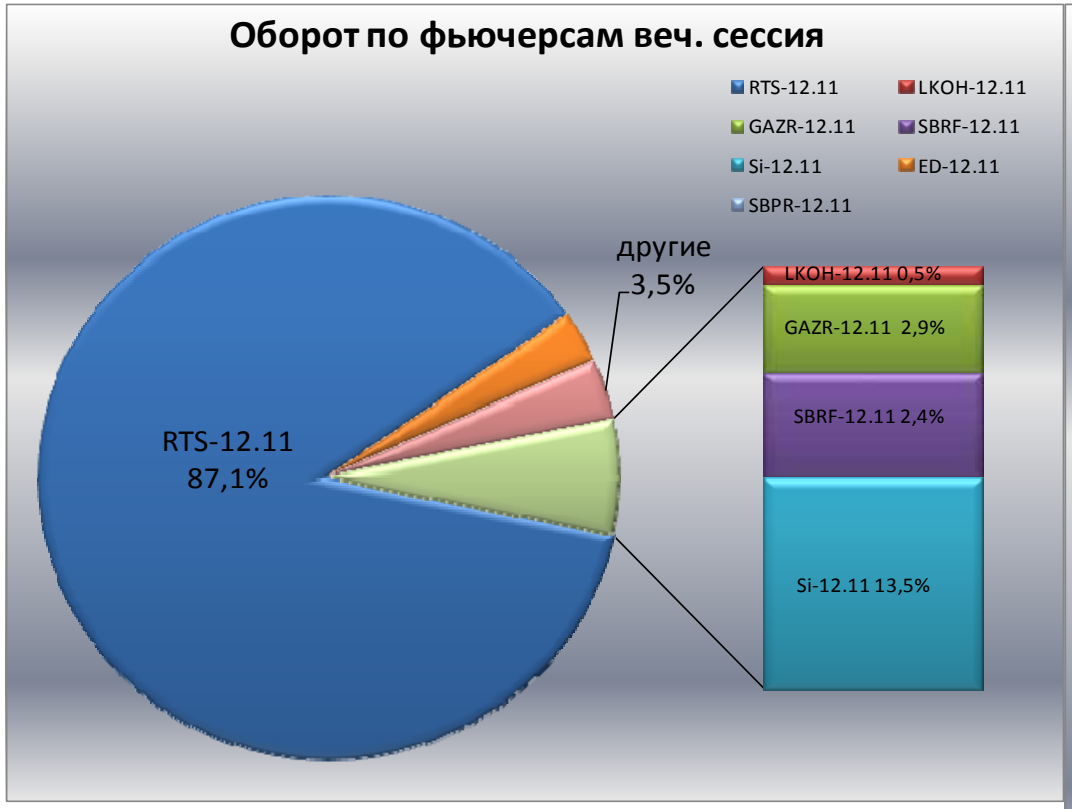
Опционы на Сбербанк, сентябрь

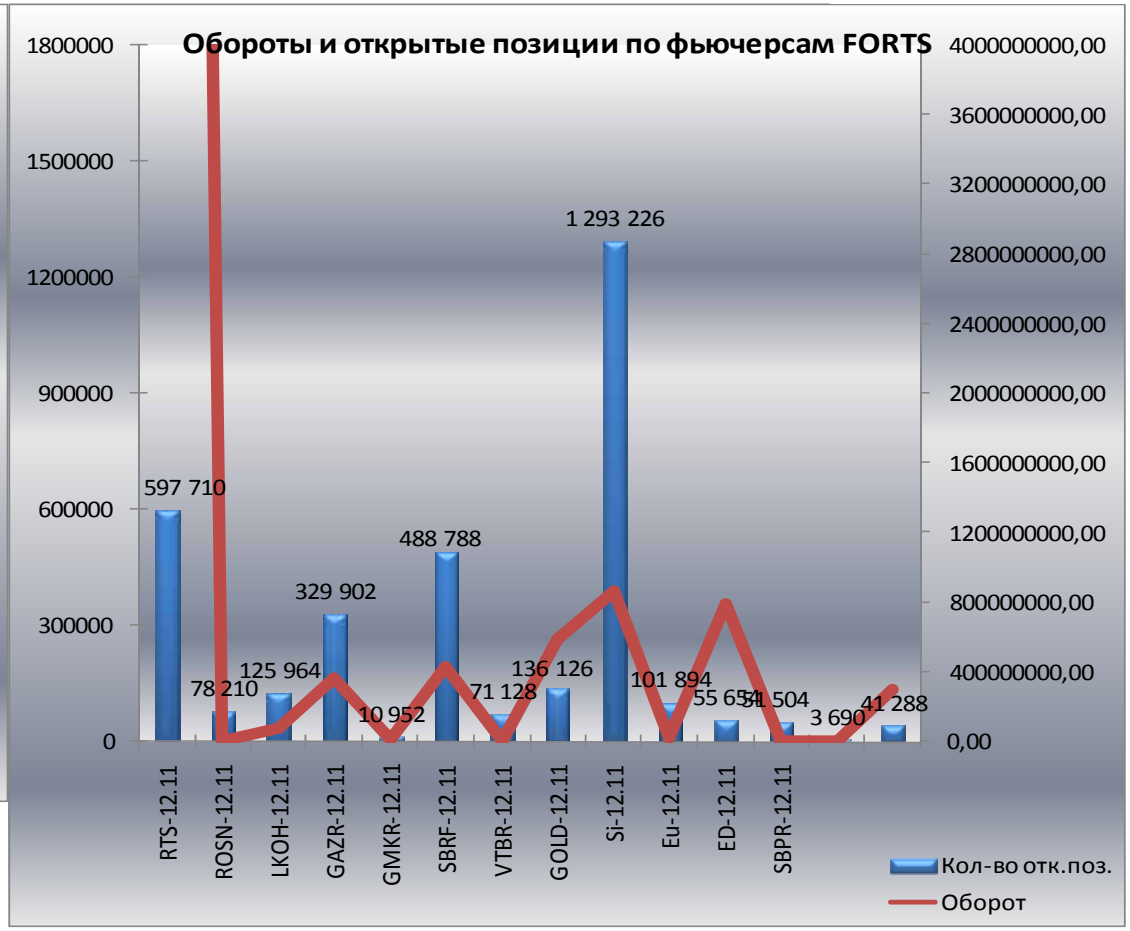


	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250
OI Call	0	0	0	0	0	0	2	0	16	0	278	1754	2932	736	1508	1104	3508	4	222	204
OI Put	390	252	52	230	90	500	10	16	920	1322	822	1948	898	168	234	0	12	2	0	0
IV	73,992	71,913	69,623	67,184	64,672	62,161	59,727	57,438	55,352	53,512	51,944	50,652	49,6	48,648	47,41	46,186	45,92	46,24	46,894	47,778


Опционы на Лукойл, сентябрь
Волатильность
55
51
47
43
39
35
31
27
23
19
15
1200
900
600
300
0
1150 1200 1250 1300 1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800 1850 1900 1950
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 160 88 108 300 104 1004 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 0 0 100 162 80 130 6 90 0 0 0 0 0
IV 52,887 50,99 48,867 46,575 44,184 41,768 39,401 37,148 35,063 33,179 31,505 30,007 28,606 27,203 25,862 24,924 24,583 24,753


Опционы на Газпром, сентябрь
Волатильность
70
66
62
58
54
50
46
42
38
34
30
15000
14000
13000
12000
11000
10000
9000
8000
7000
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200 205
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 16 2630 14758 1238 146 124 0 2000 24
OI Put 0 0 0 0 14 0 20 2 6 1030 144 300 180 94 50 0 0 0 22 0
IV 64,82 63,137 61,192 59,03 56,717 54,325 51,933 49,618 47,45 45,485 43,761 42,296 41,075 40,055 39,192 38,564 38,338 38,539 39,086 39,894


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-12.11
LKOH-12.11
GAZR-12.11
SBRF-12.11
Si-12.11
ED-12.11
SBPR-12.11
другие
3,5%
RTS-12.11
87,1%
LKOH-12.11 0,5%
GAZR-12.11 2,9%
SBRF-12.11 2,4%
Si-12.11 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
597 710
78 210
125 964
329 902
10 952
488 788
71 128
136 126
1 293 226
101 894
55 654
41 504
3 690
41 288
RTS-12.11
ROSN-12.11
LKOH-12.11
GAZR-12.11
GMKR-12.11
SBRF-12.11
VTBR-12.11
GOLD-12.11
Si-12.11
Eu-12.11
ED-12.11
SBPR-12.11
Кол-во отк.поз.
Оборот