Страны ЕС готовы принять меры для выхода из долгового кризиса

Европейские рынки закончили день в «зеленой зоне» на фоне ожиданий мер со стороны европейских властей: CAC40 вырос на +5,74% составив 3023,8 пункта, DAX30 на +5,29% составив 5628,44 пунктов, FTSE100 на +4,02% составив 5294,05. В настоящее время в ЕС обсуждается вопрос о создании специальной компании для скупки долгов проблемных стран.

Несмотря на статистические данные по продажам нового жилья в США, которые показали отрицательную динамику, благодаря положительному европейскому внешнему фону, американские индексы завершили сессию в плюсе: DJ Industrial вырос на +2,53% составив 11043,86 пунктов, S&P 500 на +2,33% составив 1162,94 пункта.

Несмотря на восстановление цен на энергоносители, инвесторы больше ориентируются на европейскую ситуацию. Торговая сессия закончилась небольшим ростом. Индекс ММВБ закрылся с повышением в 2,49%. Газпром за вечернюю сессию упал на –0,30%, составив 158,27 пункта, Лукойл на –0,12% остановившись на отметке 1626,30 пунктов, Роснефть на +0,18% (196,08 пунктов). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,21% (32,20 пункта) и +0,02% (43,75 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	136460	1364,60	0,04	525 918	-0,48%	22 104 245 012	14,85%
ROSN-12.11	19608	196,08	0,18	97 304	-0,17%	17 869 559	4,07%
LKOH-12.11	16263	1626,30	-0,12	173 012	0,48%	62 961 722	3,25%
GAZR-12.11	15827	158,27	-0,30	323 558	-0,13%	337 334 415	6,34%
GMKR-12.11	64001	6400,10	0,00	42 416	-0,02%	16 756 540	2,75%
SBRF-12.11	7334	73,34	-0,35	702 094	-1,43%	614 590 366	8,34%
VTBR-12.11	6965	0,0697	0,37	79 354	1,02%	11 511 554	6,88%
GOLD-12.11	1652	1652,0000	-1,10	107 064	2,61%	712 906 208	17,87%
Si-12.11	32203	32,20	0,21	982 964	-0,80%	1 913 287 811	4,05%
Eu-12.11	43749	43,75	0,02	116 002	-0,07%	15 637 651	6,93%
ED-12.11	1,36	1,36	-0,13	41 738	2,48%	751 670 781	12,86%
SBPR-12.11	5774	57,74	-0,71	36 516	-0,15%	3 601 322	7,02%
RTSS-12.11	9474	9473,50	0,40	17 840	-0,09%	77 637 165	23,89%
BR-12.11	105	104,77	0,16	2 146	-0,83%	3 692 501	35,76%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	53920,36	0,32%	
CAC 40	3023,8	5,74%	0:00:00
DAX 30	5628,44	5,29%	19:35:31
DJ Industrial	11190,69	1,33%	00:42:54
FTSE 100	5294,05	4,02%	19:35:22
Hang Seng	17941,78	-1,04%	10:19:17
Nikkei 225	8615,65	0,07%	09:00:03
S&P 500	1175,38	1,06%	00:02:19
Brent Crude Oil 1211	104,59	-0,89%	10:07:29
Gold	1641,5	-0,43%	10:07:53
Palladium	641	-0,48%	10:07:30
Platinum	1541,5	-1,36%	10:07:06
RTSI	1 376,94	0,51%	23:50:00
RTS_Standard	9 423,32	0,42%	23:50:00
RTSI_DEREX	1365.96	4.83%	18:45:00

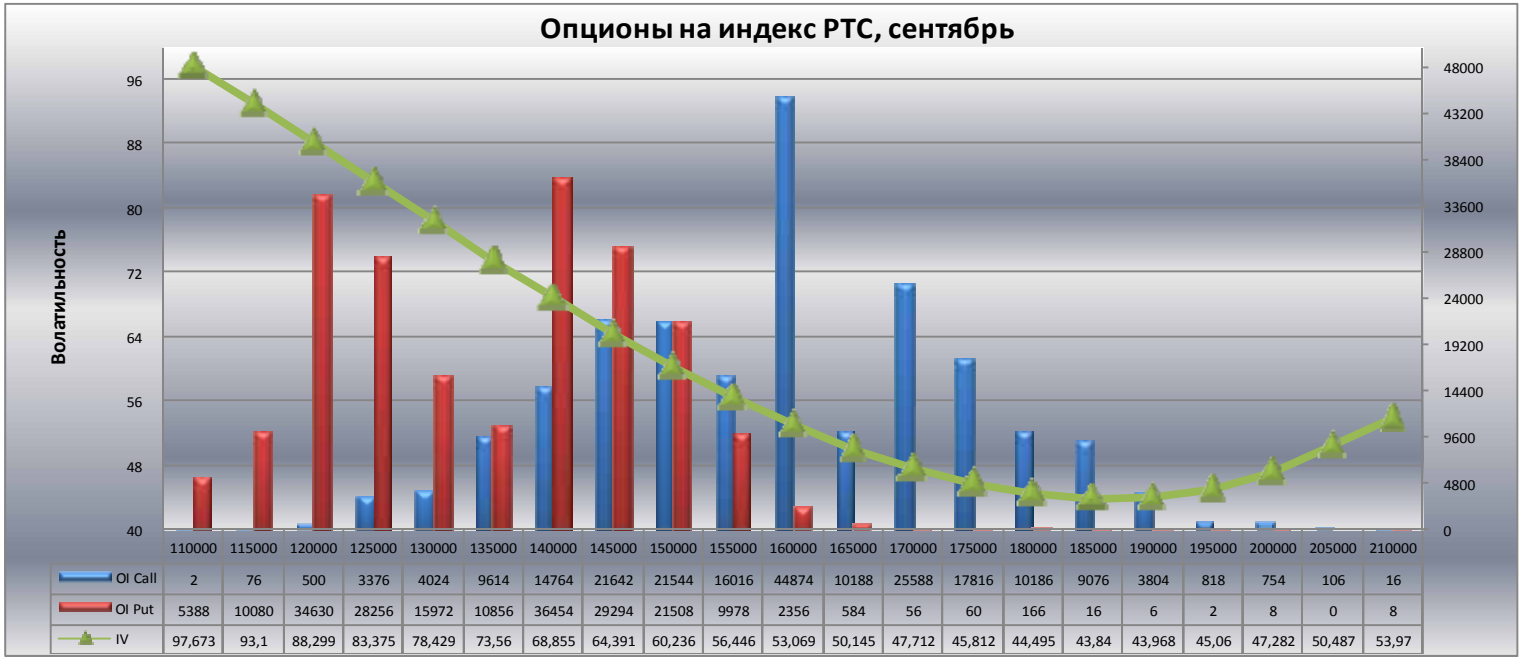
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,04	525918	22104245012,39	136460
ROSN-12.11	0,18	97304	17869559,00	19608
LKOH-12.11	-0,12	173012	62961722,00	16263
GAZR-12.11	-0,3	323558	337334415,00	15827
GMKR-12.11	0	42416	16756540,00	64001
SBRF-12.11	-0,35	702094	614590366,00	7334
VTBR-12.11	0,37	79354	11511554,00	6965
GOLD-12.11	-1,1	107064	712906208,42	1652
Si-12.11	0,21	982964	1913287811,00	32203
Eu-12.11	0,02	116002	15637651,00	43749
ED-12.11	-0,13	41738	751670780,93	1,3589
SBPR-12.11	-0,71	36516	3601322,00	5774
RTSS-12.11	0,4	17840	77637165,00	9473,5
BR-12.11	0,16	2 146	3692501,23	104,77

Дневная сессия

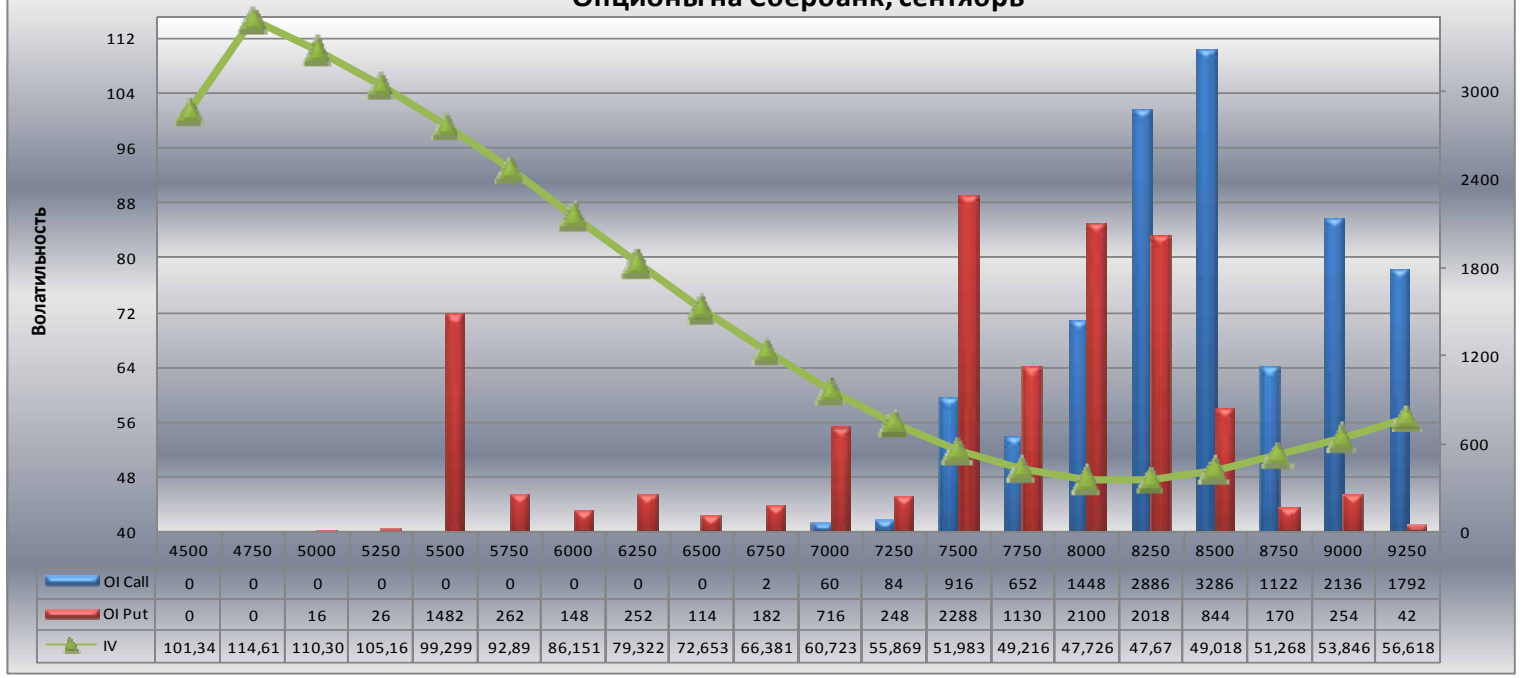
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	5,3	528432	1,48898E+11	136400
ROSN-12.11	3,11	97466	438596947	19573
LKOH-12.11	1,25	172184	1935989933	16260
GAZR-12.11	1,59	323976	5316620739	15875
GMKR-12.11	2,25	42426	609590465	64000
SBRF-12.11	4,93	712264	7371571398	7360
VTBR-12.11	3,17	78552	167342292	6939
GOLD-12.11	3,81	104344	3989712682	1670,4
Si-12.11	-2,64	990902	47291148909	32134
Eu-12.11	-1,44	116086	225604985	43740
ED-12.11	1,15	40728	5845466987	1,3607
SBPR-12.11	1,84	36572	51305190	5815
RTSS-12.11	2,4	17856	324918910	9435,5
BR-12.11	3,32	2164	10326325,9	104,6

Опционы на индекс РТС, сентябрь

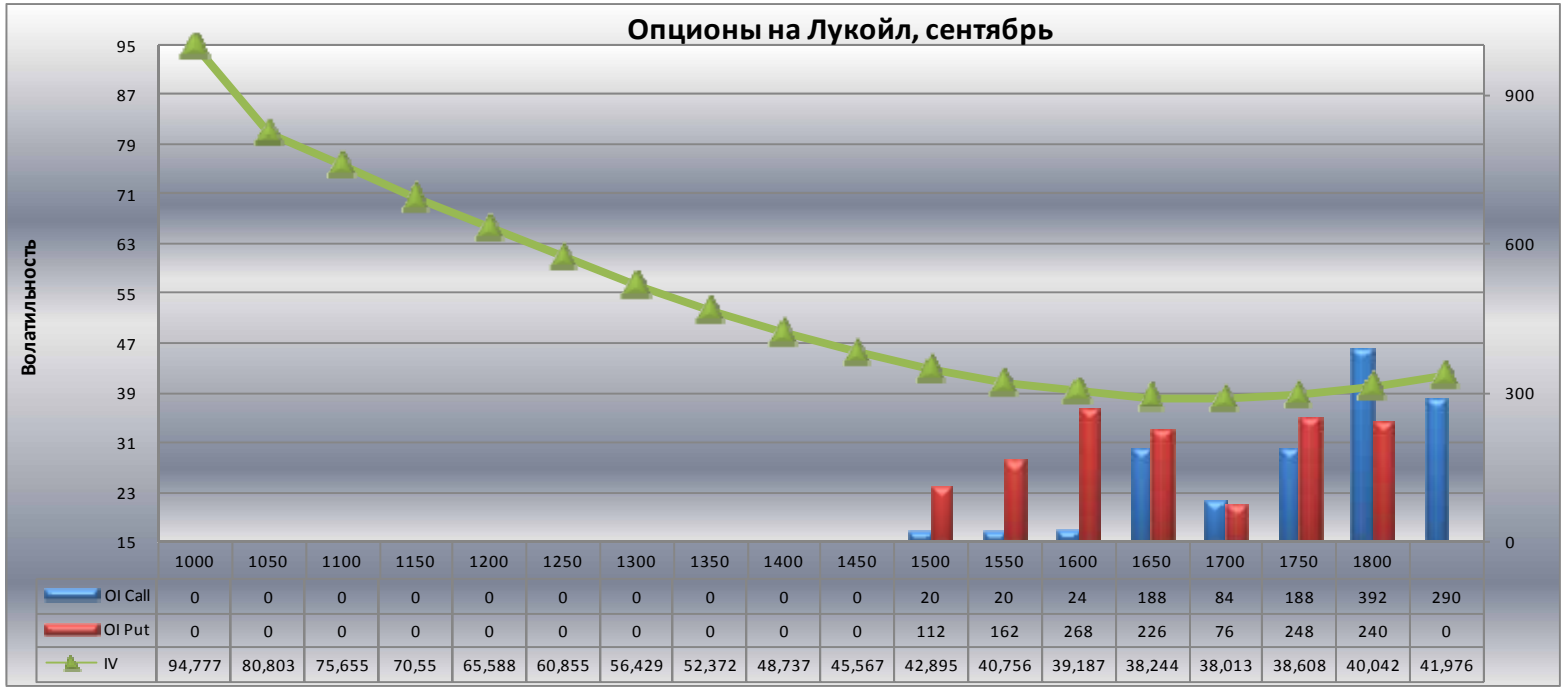


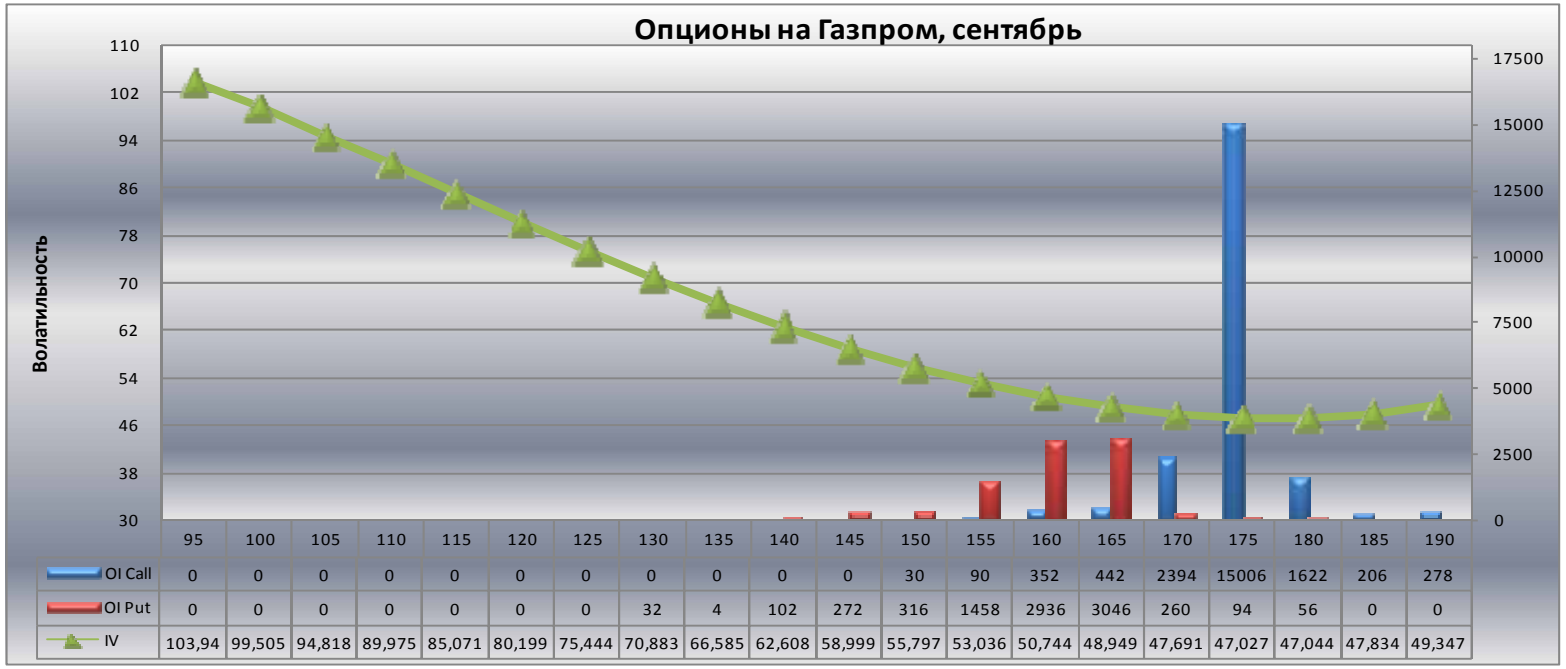
	110000	115000	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000
OI Call	2	76	500	3376	4024	9614	14764	21642	21544	16016	44874	10188	25588	17816	10186	9076	3804	818	754	106	16
OI Put	5388	10080	34630	28256	15972	10856	36454	29294	21508	9978	2356	584	56	60	166	16	6	2	8	0	8
IV	97,673	93,1	88,299	83,375	78,429	73,56	68,855	64,391	60,236	56,446	53,069	50,145	47,712	45,812	44,495	43,84	43,968	45,06	47,282	50,487	53,97

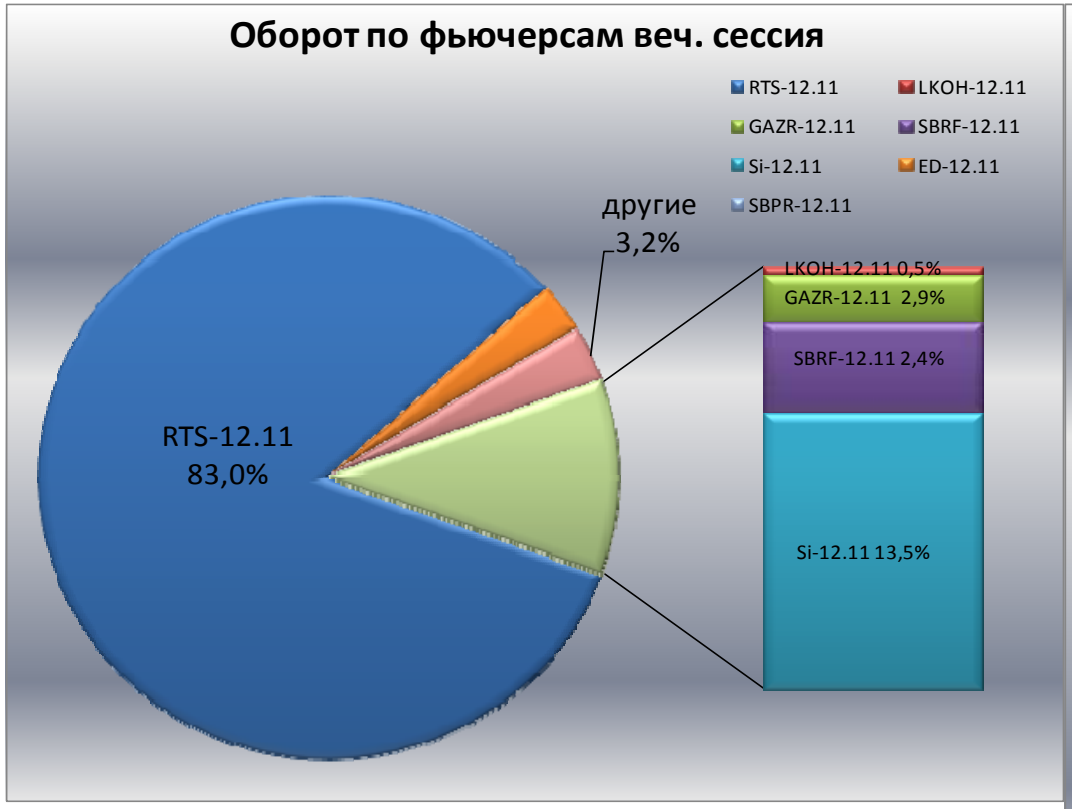
Опционы на Сбербанк, сентябрь

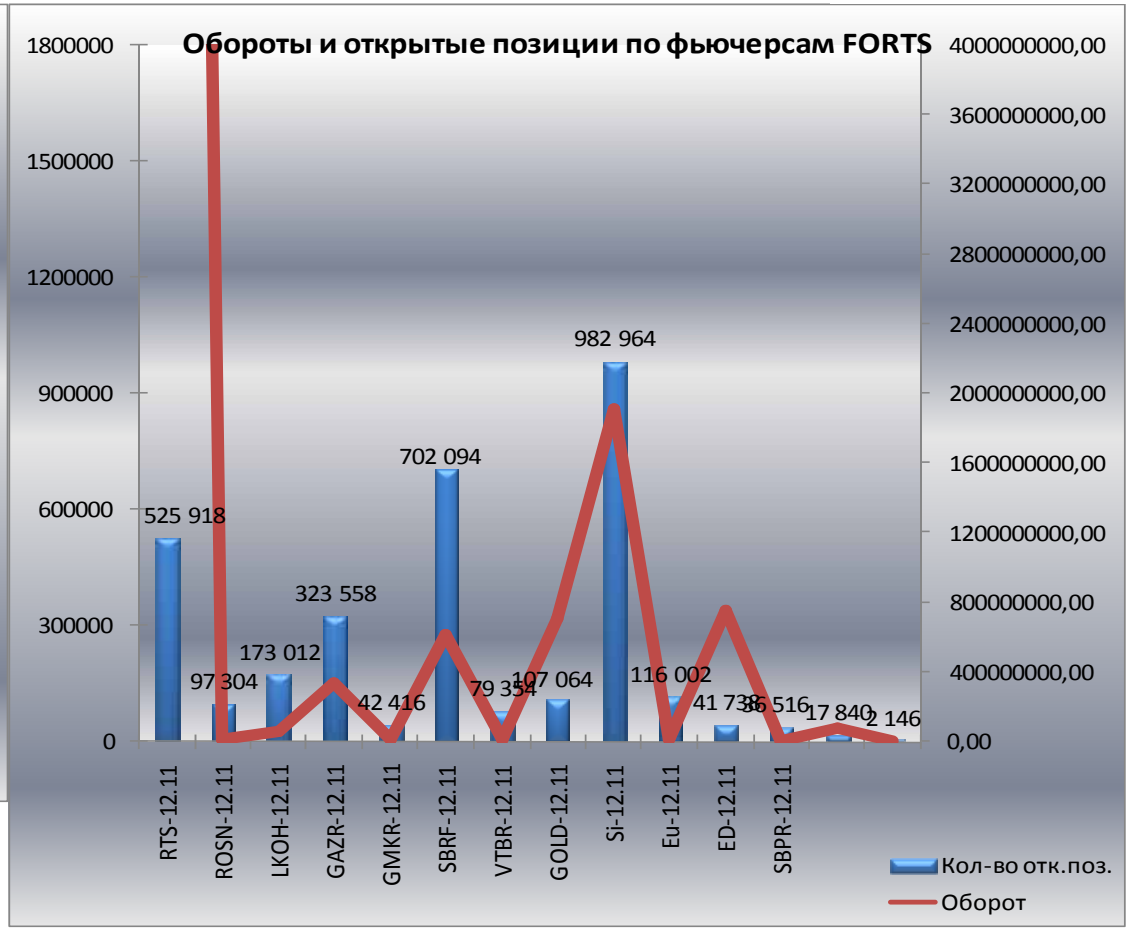


	4500	4750	5000	5250	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2	60	84	916	652	1448	2886	3286	1122	2136	1792
OI Put	0	0	16	26	1482	262	148	252	114	182	716	248	2288	1130	2100	2018	844	170	254	42
IV	101,34	114,61	110,30	105,16	99,299	92,89	86,151	79,322	72,653	66,381	60,723	55,869	51,983	49,216	47,726	47,67	49,018	51,268	53,846	56,618


Опционы на Лукойл, сентябрь
Волатильность
95
87
79
71
63
55
47
39
31
23
15
900
600
300
0
1000 1050 1100 1150 1200 1250 1300 1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 20 20 24 188 84 188 392 290
OI Put 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 112 162 268 226 76 248 240 0
IV 94,777 80,803 75,655 70,55 65,588 60,855 56,429 52,372 48,737 45,567 42,895 40,756 39,187 38,244 38,013 38,608 40,042 41,976


Опционы на Газпром, сентябрь
Волатильность
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
17500
15000
12500
10000
7500
5000
2500
0
95 100 105 110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 30 90 352 442 2394 15006 1622 206 278
OI Put 0 0 0 0 0 0 0 32 4 102 272 316 1458 2936 3046 260 94 56 0 0
IV 103,94 99,505 94,818 89,975 85,071 80,199 75,444 70,883 66,585 62,608 58,999 55,797 53,036 50,744 48,949 47,691 47,027 47,044 47,834 49,347


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
3,2%
RTS-12.11
83,0%
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
525 918
97 304
173 012
323 558
42 416
702 094
79 354
107 064
982 964
116 002
41 738
36 516
17 840
2 146
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