Умеренное снижение на фоне заявлений ФРС и статистики по ВВП США

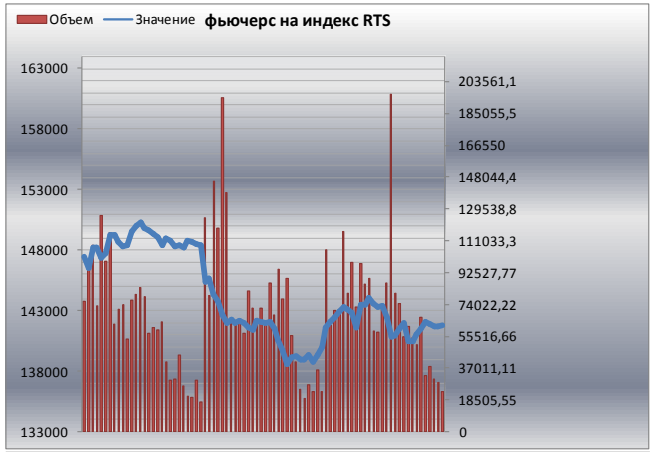
Во вторник стало известно, что по итогам аукциона доходность 10летних испанских гособлигаций достигла своего максимума за последние 10 лет. Что касается США, опубликованные вчера данные показали, что ВВП замедлился еще сильнее: зафиксировано понижение с 2,5% до 2%. В ближайшее время ФРС намеревается провести стресс-тесты крупнейших банков США.

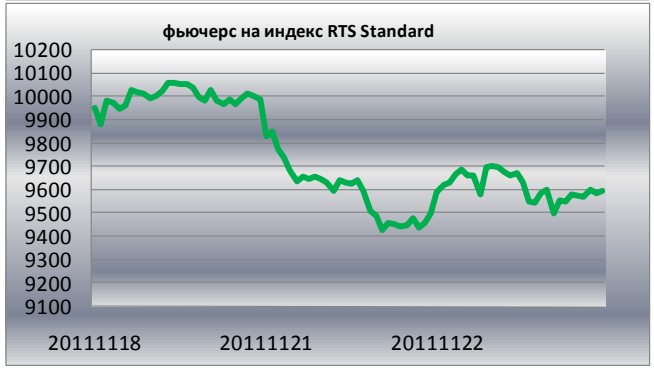
Т.о., основные индексы закончили вечернюю торговую сессию со следующими изменениями: DJ Industrial –0,46%, S&P 500 –0,41%, а по Европе— FTSE100 –0,30%, DAX –1,22%, CAC40 –0,84%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии подрос и составил $112,39 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1707,69 за тройскую унцию, что несколько ниже значения понедельника.

К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1401,91 пункта, поднявшись на 0,82%, РТС остановился на уровне 1431,13 пункта, увеличившись на 0,43%

Лучше рынка выглядели Акрон (+4,18%), Северсталь (+2,53%), Роснефть (+2,17%).





	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	141760	1417,60	0,20	1 010 194	0,35%	38 417 773 769	22,04%
ROSN-12.11	20576	205,76	-0,03	101 100	0,69%	22 994 808	7,98%
LKOH-12.11	16520	1652,00	-0,06	176 924	0,13%	107 043 034	7,94%
GAZR-12.11	17050	170,50	0,51	387 640	-0,65%	511 183 434	9,70%
GMKR-12.11	51631	5163,10	0,10	129 492	0,05%	14 963 721	2,39%
SBRF-12.11	7669	76,69	0,45	987 768	0,23%	867 012 293	9,95%
VTBR-12.11	6432	0,0643	0,70	136 814	0,01%	19 232 548	11,55%
GOLD-12.11	1705	1705,2000	0,19	99 582	5,13%	598 461 907	26,04%
Si-12.11	31140	31,14	-0,06	1 660 662	-0,45%	1 466 124 909	5,39%
Eu-12.11	42100	42,10	-0,08	94 808	-1,03%	46 190 190	35,02%
ED-12.11	1,35	1,35	-0,12	62 836	-23,68%	1 160 278 435	31,74%
SBPR-12.11	5946	59,46	0,97	64 488	-0,08%	1 365 552	3,30%
RTSS-12.11	9597	9597,00	0,13	70 832	-0,01%	13 958 455	5,11%
BR-12.11	109	108,67	0,37	35 772	18,28%	365 987 842	36,93%

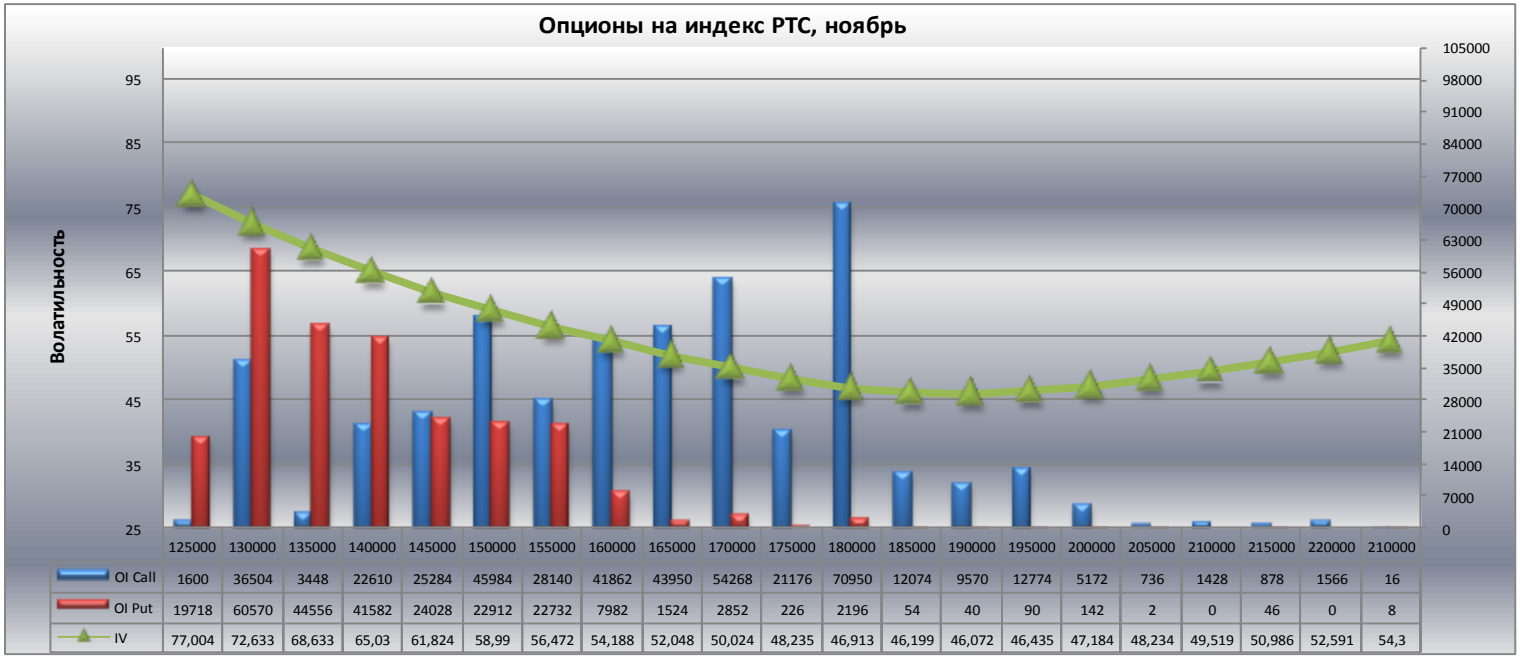
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55878,44	-0,72%	00:12:30
CAC 40	2870,68	-0,84%	19:35:18
DAX 30	5537,39	-1,22%	19:35:31
DJ Industrial	11493,72	-0,46%	00:42:54
FTSE 100	5206,82	-0,30%	19:35:22
Hang Seng	17876,23	-2,06%	10:19:17
Nikkei 225	8314,74	-0,40%	09:00:03
S&P 500	1188,04	-0,41%	00:02:19
Brent 12.11	112,39	0,45%	01:09:18
Gold	1707,69	0,31%	10:19:18
Palladium	602,75	0,27%	10:19:25
Platinum	1568,35	-0,17%	10:18:11
RTSI	1 433,04	0,13%	23:50:00
RTS_Standard	9 560,21	0,12%	23:50:00
RTSI_DEREX	1485,72	-0,82%	18:45:00

Вечерняя сессия

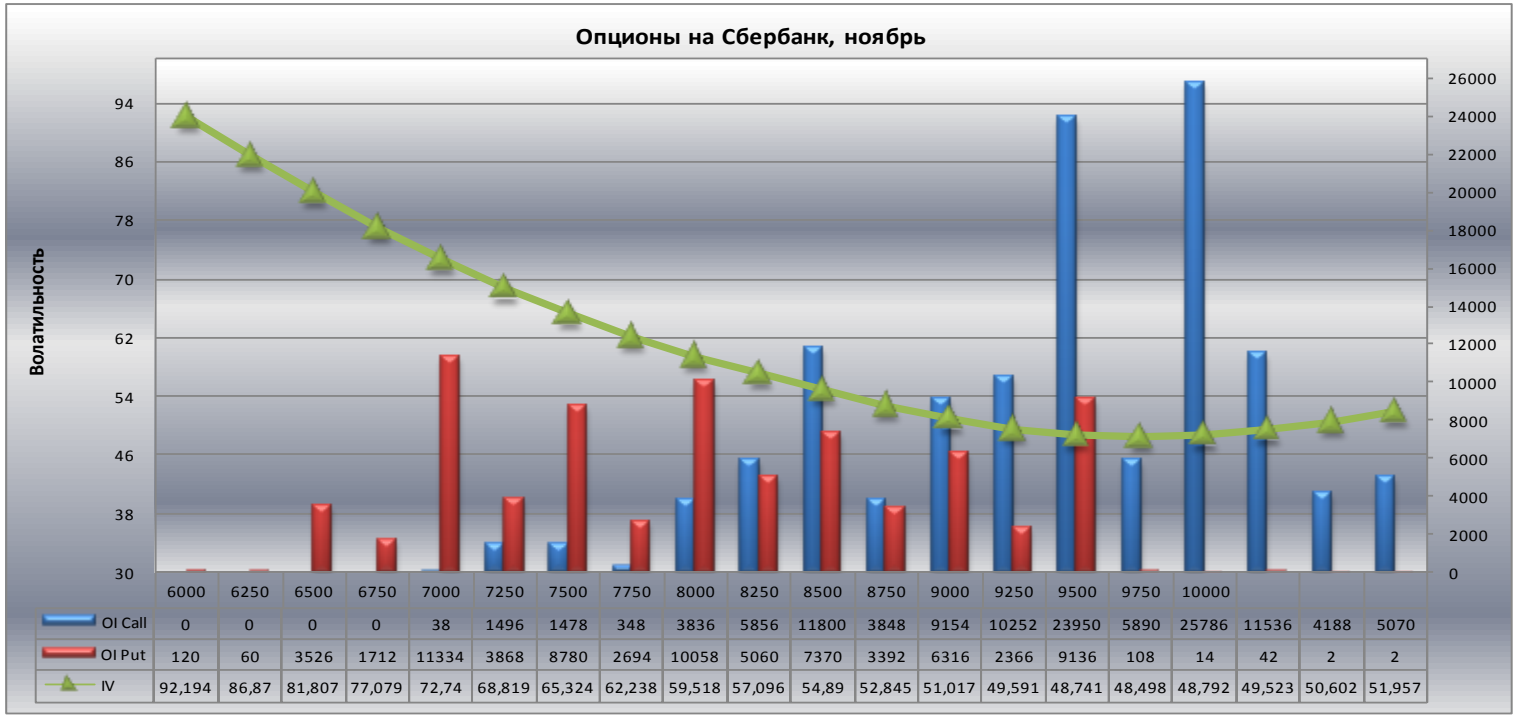
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,2	1010194	38417773768,66	141760
ROSN-12.11	-0,03	101100	22994808,00	20576
LKOH-12.11	-0,06	176924	107043034,00	16520
GAZR-12.11	0,51	387640	511183434,00	17050
GMKR-12.11	0,1	129492	14963721,00	51631
SBRF-12.11	0,45	987768	867012293,00	7669
VTBR-12.11	0,7	136814	19232548,00	6432
GOLD-12.11	0,19	99582	598461906,78	1705,2
Si-12.11	-0,06	1660662	1466124909,00	31140
Eu-12.11	-0,08	94808	46190190,00	42100
ED-12.11	-0,12	62836	1160278434,97	1,3513
SBPR-12.11	0,97	64488	1365552,00	5946
RTSS-12.11	0,13	70832	13958455,00	9597
BR-12.11	0,37	35 772	365987842,45	108,67

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,66	1006700	1,74305E+11	141460
ROSN-12.11	0,79	100404	288103171	20582
LKOH-12.11	-0,14	176702	1348117959	16529
GAZR-12.11	-0,28	390176	5268819874	16967
GMKR-12.11	1,9	129422	624976941	51580
SBRF-12.11	0,32	985464	8717930606	7635
VTBR-12.11	0,76	136802	166464126	6387
GOLD-12.11	-0,56	94724	2297997754	1702
Si-12.11	-0,09	1668162	27195364692	31159
Eu-12.11	0,38	95792	131903086	42135
ED-12.11	0,54	82330	3655784964	1,3529
SBPR-12.11	-0,92	64538	41405331	5894
RTSS-12.11	0,8	70840	273254980	9585
BR-12.11	1,28	30244	990980204,7	108,3



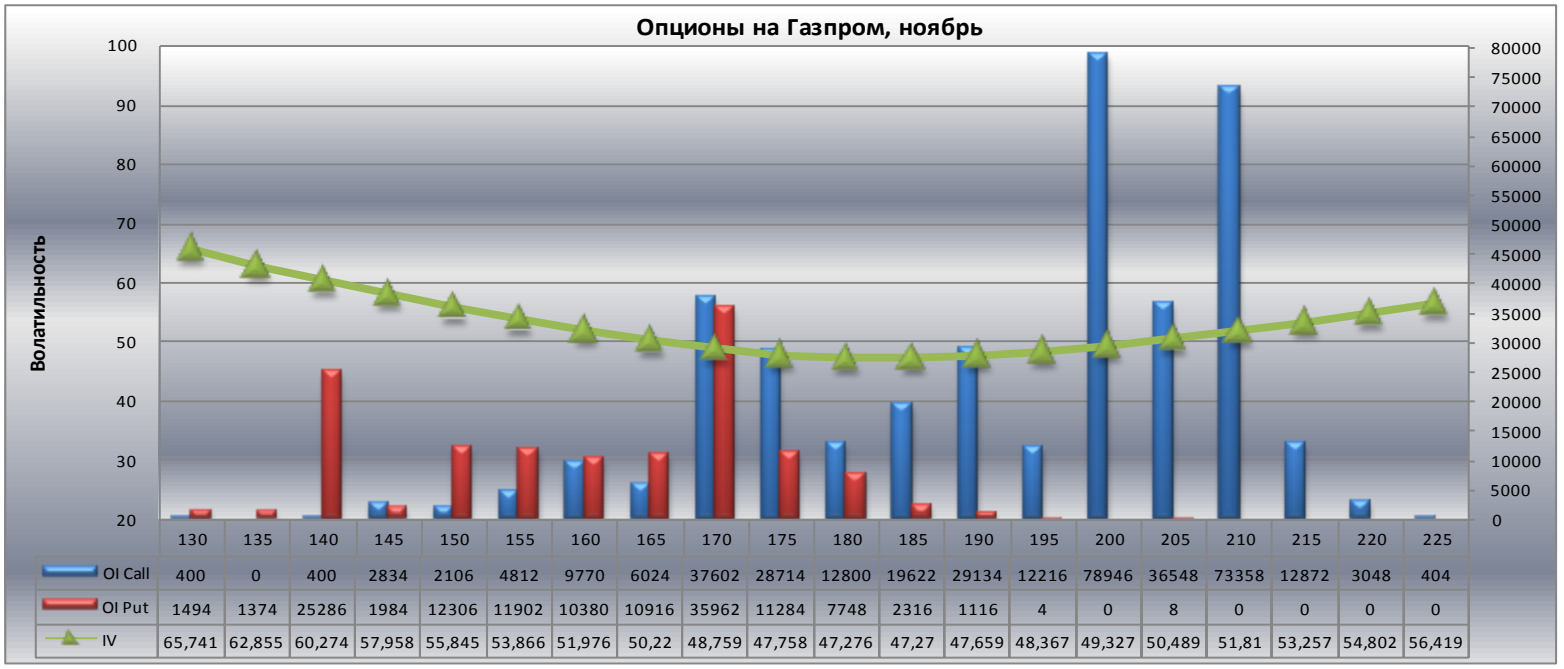
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	1600	36504	3448	22610	25284	45984	28140	41862	43950	54268	21176	70950	12074	9570	12774	5172	736	1428	878	1566	16
OI Put	19718	60570	44556	41582	24028	22912	22732	7982	1524	2852	226	2196	54	40	90	142	2	0	46	0	8
IV	77,004	72,633	68,633	65,03	61,824	58,99	56,472	54,188	52,048	50,024	48,235	46,913	46,199	46,072	46,435	47,184	48,234	49,519	50,986	52,591	54,3



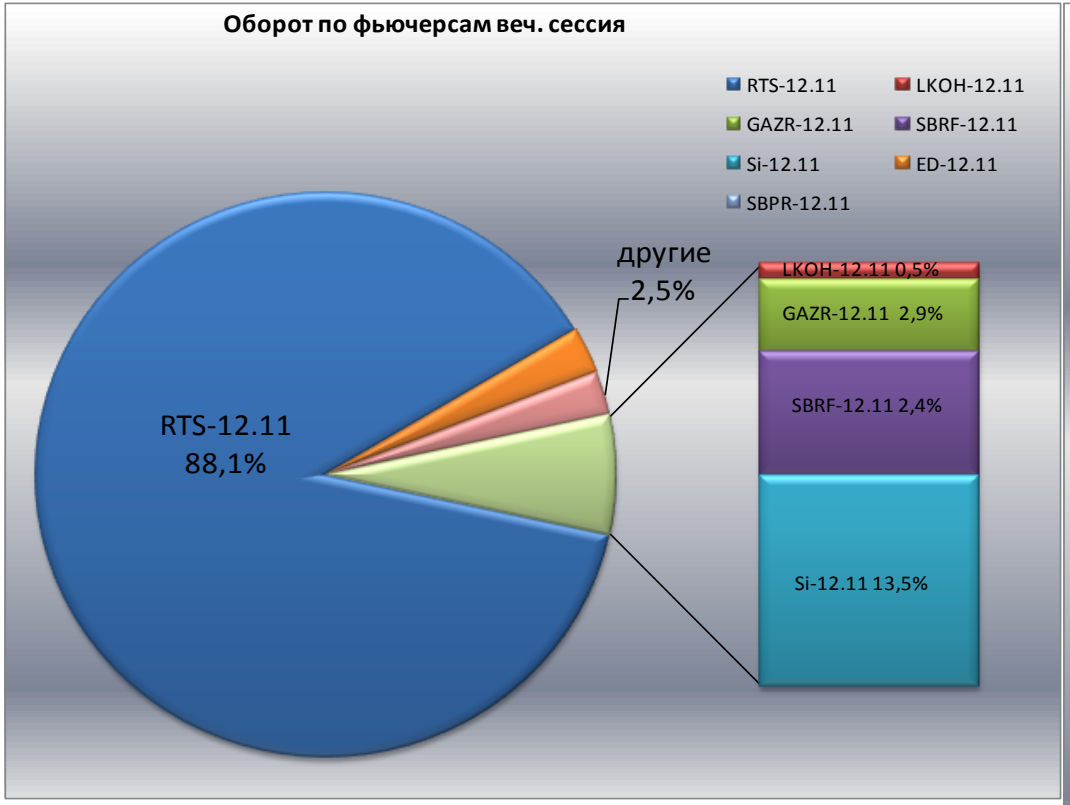
	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	38	1496	1478	348	3836	5856	11800	3848	9154	10252	23950	5890	25786	11536	4188	5070
OI Put	120	60	3526	1712	11334	3868	8780	2694	10058	5060	7370	3392	6316	2366	9136	108	14	42	2	2
IV	92,194	86,87	81,807	77,079	72,74	68,819	65,324	62,238	59,518	57,096	54,89	52,845	51,017	49,591	48,741	48,498	48,792	49,523	50,602	51,957

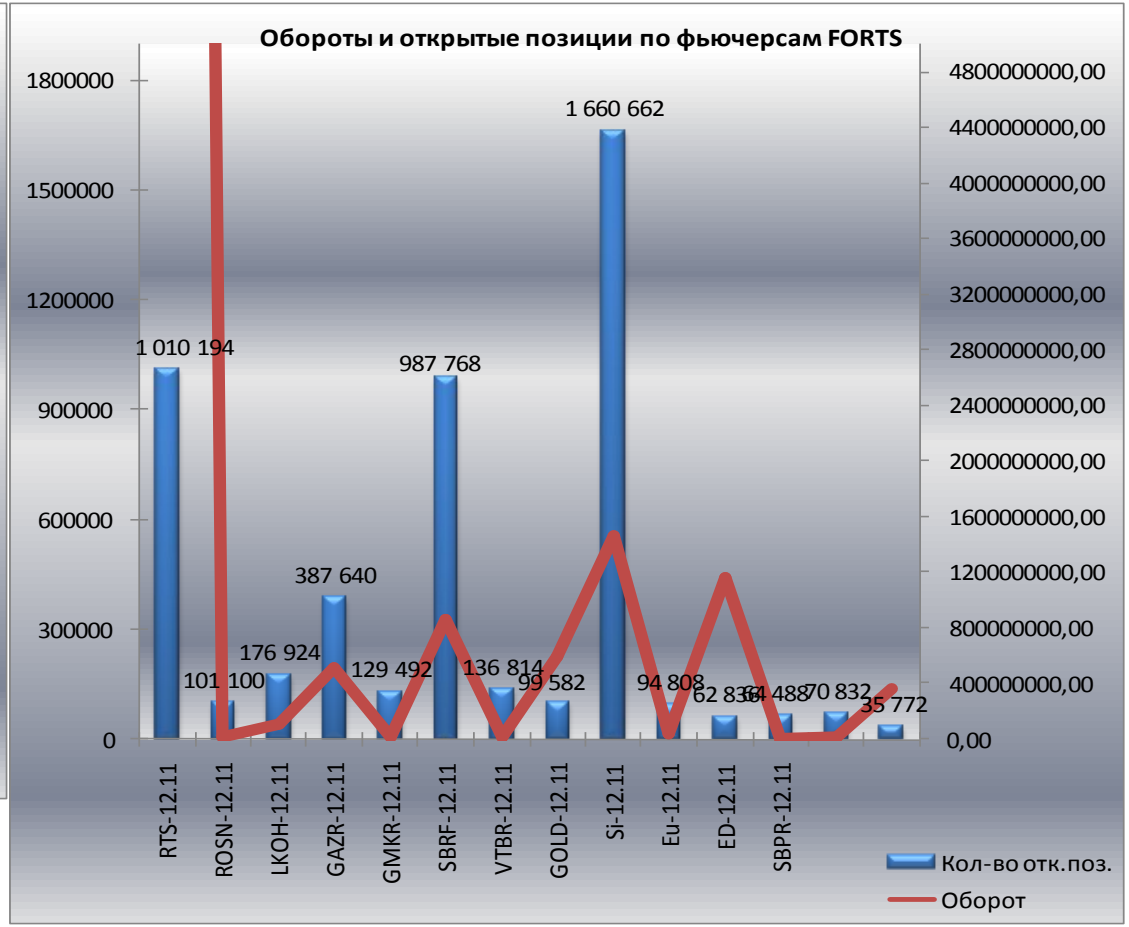


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1326	1872	1348
OI Put	0	0	0	0	10	0	100	502	1180	610	2608	702	1454
IV	62,239	58,332	54,801	51,648	48,851	46,36	44,1	41,985	39,976	38,169	36,781	35,972	35,746



	130	135	140	145	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225
OI Call	400	0	400	2834	2106	4812	9770	6024	37602	28714	12800	19622	29134	12216	78946	36548	73358	12872	3048	404
OI Put	1494	1374	25286	1984	12306	11902	10380	10916	35962	11284	7748	2316	1116	4	0	8	0	0	0	0
IV	65,741	62,855	60,274	57,958	55,845	53,866	51,976	50,22	48,759	47,758	47,276	47,27	47,659	48,367	49,327	50,489	51,81	53,257	54,802	56,419


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
2,5%
RTS-12.11
88,1%
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
4800000000,00
4400000000,00
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
1 010 194
101 100
176 924
387 640
129 492
987 768
136 814
99 582
1 660 662
94 808
62 836
64 488
70 832
35 772
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