В ближайшее время следует проявлять осторожность

Агенство Moody's в минувшую среду опубликовало новые данные согласно которым кредитный рейтинг США может быть понижен, также было подмечено, что лимит по долгу может быть не повышен, а также есть некий риск кратковременного дефолта по облигациям и векселям правительства США, во что многие пока предпочитают не верить. Не лучше обстоят дела в Еврозоне: теперь уже сказывается «итальянский» долговой вопрос. Однако если с Испанией уровень долга не был большим, то у Италии долг сопоставим с греческим, хотя дефицит бюджета не так велик, как у греков. Однако все это довольно сильные системные риски.

Тем не менее, рынок США закрылся в небольшом плюсе: S&P500 поднялся на 0,31%, а DJ Industrial на 0,36%. Рынки Азии оказались в «минусе»: Hang Seng упал на –0,68%.

Российские рынки закончили в основном в «положительной» зоне. По итогам вечерних торгов в среду Газпром прибавил +0,8%, а Лукойл +0,62%. Контракты на валютные пары доллар -рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,84% и +0,25%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ изменились на +1,2% и +0.2%.





	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	193350	1933,50	1,48	829 758	0,56%	165 660 022 973	765,28%
ROSN-9.11	23776	237,76	0,34	40 424	-0,41%	401 887 154	1968,69%
LKOH-9.11	18327	1832,70	0,62	118 414	-0,32%	1 213 020 630	1854,00%
GAZR-9.11	20456	204,56	0,80	564 784	-0,78%	5 483 847 981	1469,90%
GMKR-9.11	76040	7604,00	-0,74	45 708	-0,01%	679 875 195	2319,25%
SBRF-9.11	10472	104,72	1,27	740 126	-0,86%	6 334 494 793	1146,66%
VTBR-9.11	8329	0,0833	0,20	300 098	0,03%	438 424 608	1931,54%
GOLD-9.11	1590	1589,8000	2,18	102 738	-0,44%	3 622 897 690	918,63%
Si-9.11	28263	28,26	-0,84	1 388 158	0,71%	20 792 956 480	1630,99%
Eu-9.11	39878	39,88	0,25	118 440	0,46%	105 199 446	480,21%
ED-9.11	1,41	1,41	1,15	267 010	-4,22%	13 482 660 869	684,55%
SBPR-9.11	8228	82,28	1,28	119 792	0,01%	109 632 713	3206,63%
RTSS-9.11	11668	11667,50	0,50	20 618	0,18%	384 015 445	1390,82%
BR-7.11	119	119,12	2,42	55 440	8,47%	4 122 360 582	523,13%

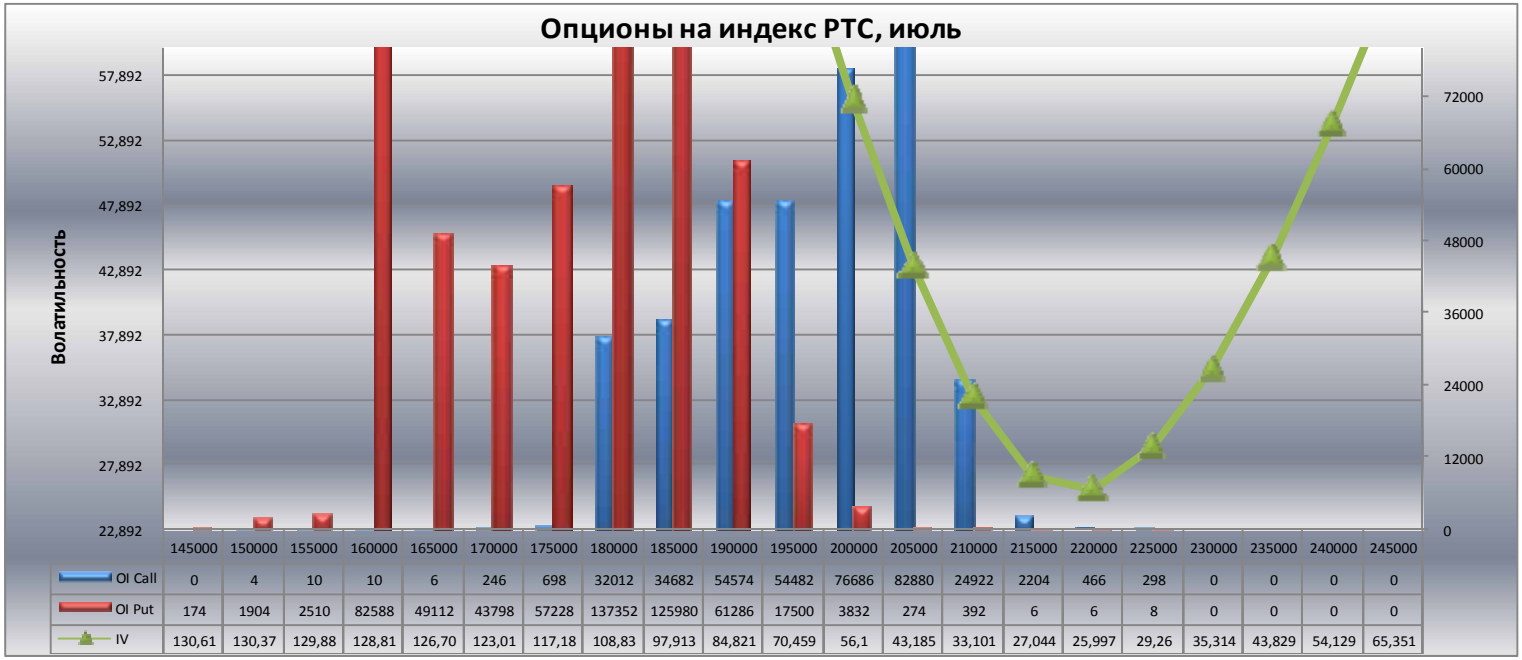
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	60669,89	1,62%	00:11:29
CAC 40	3793,27	0,51%	19:35:36
DAX 30	7267,87	1,31%	19:35:49
DJ Industrial	12491,61	0,36%	00:49:18
FTSE 100	5906,43	0,64%	19:35:51
Hang Seng	21798,65	-0,58%	09:37:13
Nikkei 225	9959,6	-0,04%	09:37:00
S&P 500	1317,72	0,31%	00:03:43
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1582,39	0,01%	09:37:13
Palladium	775,45	0,35%	09:37:03
Platinum	1754,9	0,17%	09:37:03
RTSI	1 932,54	-0,40%	23:50:00
RTS_Standard	11 593,70	-0,25%	23:50:00
RTSI_DEREX	1989.58	1.55%	18:45:00

Вечерняя сессия

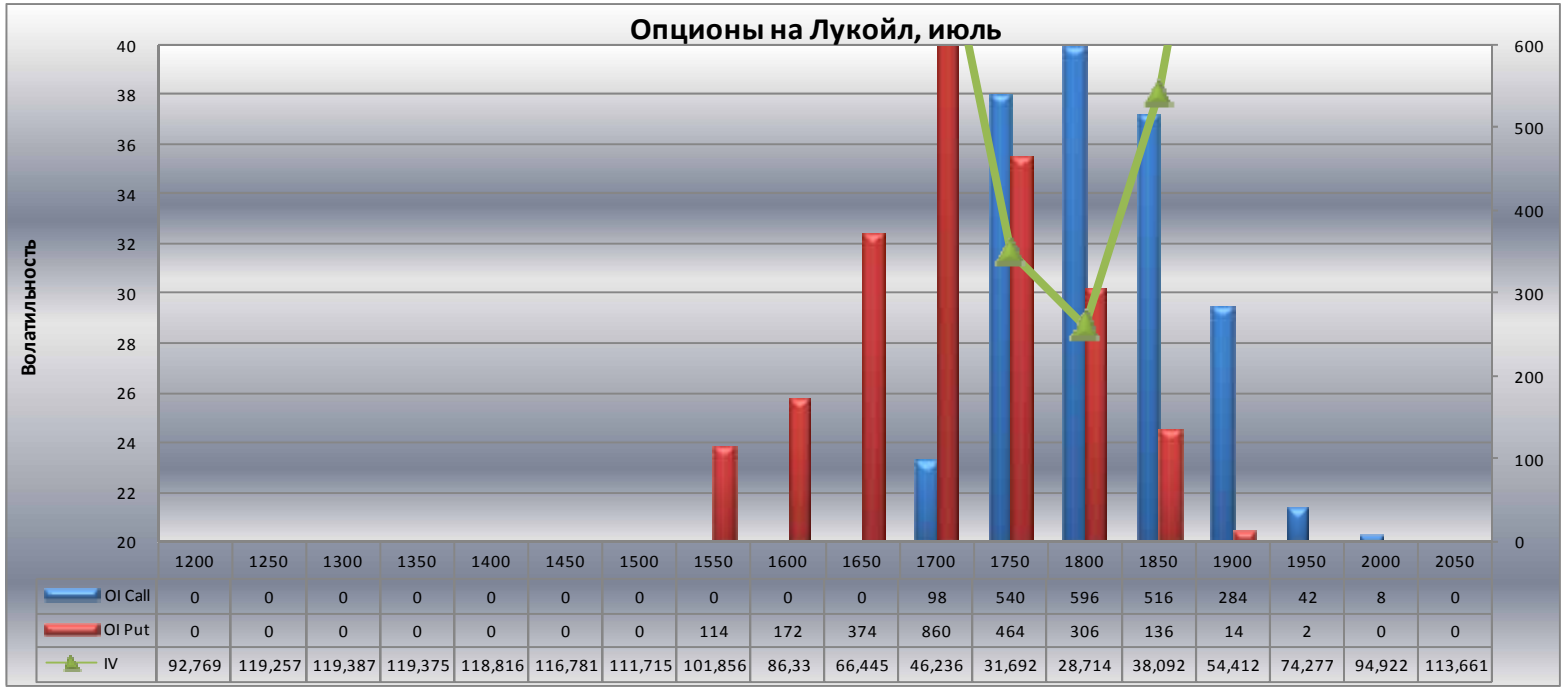
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	1,48	829758	165660022972,69	193350
ROSN-9.11	0,34	40424	401887154,00	23776
LKOH-9.11	0,62	118414	1213020630,00	18327
GAZR-9.11	0,8	564784	5483847981,00	20456
GMKR-9.11	-0,74	45708	679875195,00	76040
SBRF-9.11	1,27	740126	6334494793,00	10472
VTBR-9.11	0,2	300098	438424608,00	8329
GOLD-9.11	2,18	102738	3622897689,98	1589,8
Si-9.11	-0,84	1388158	20792956480,00	28263
Eu-9.11	0,25	118440	105199446,00	39878
ED-9.11	1,15	267010	13482660868,58	1,411
SBPR-9.11	1,28	119792	109632713,00	8228
RTSS-9.11	0,5	20618	384015445,00	11667,5
BR-7.11	2,42	55440	4122360582,02	119,12

Дневная сессия

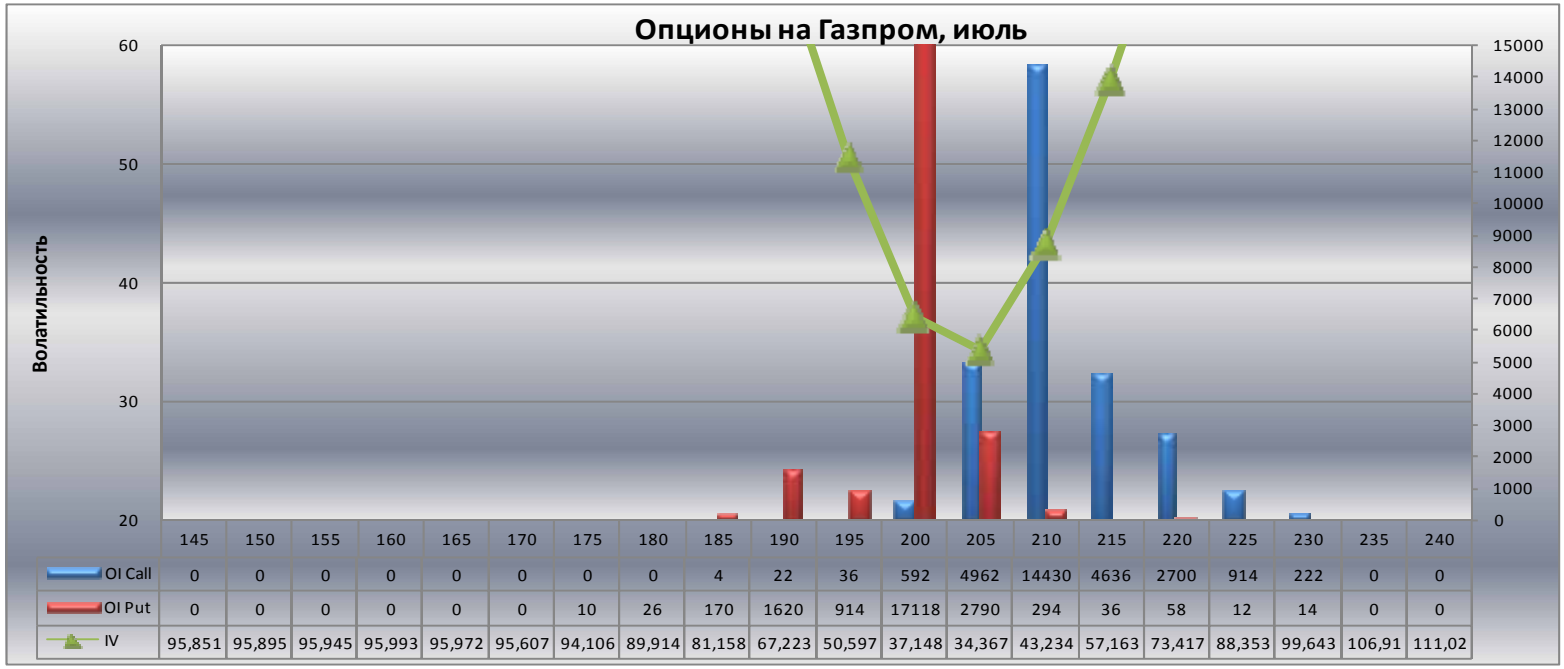
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,54	825142	21647110254,67	192300
ROSN-9.11	-0,34	40592	20413944,00	23694
LKOH-9.11	-0,69	118792	65427261,00	18201
GAZR-9.11	-0,41	569230	373076625,00	20372
GMKR-9.11	-0,05	45714	29314418,00	76000
SBRF-9.11	0,02	746558	552430215,00	10474
VTBR-9.11	-0,7	300012	22698223,00	8271
GOLD-9.11	-0,33	103194	394379849,44	1584,6
Si-9.11	-0,02	1378340	1274863430,00	28256
Eu-9.11	0,04	117894	21906806,00	39893
ED-9.11	0,03	278762	1969567487,39	1,4114
SBPR-9.11	-0,32	119782	3418939,00	8202
RTSS-9.11	-0,42	20580	27610805,00	11618
BR-7.11	-0,36	51112	788024220,18	118,69


Опционы на индекс РТС, июль
Волатильность
57,892
52,892
47,892
42,892
37,892
32,892
27,892
22,892
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 0 4 10 10 6 246 698 32012 34682 54574 54482 76686 82880 24922 2204 466 298 0 0 0 0
OI Put 174 1904 2510 82588 49112 43798 57228 137352 125980 61286 17500 3832 274 392 6 6 8 0 0 0 0
IV 130,61 130,37 129,88 128,81 126,70 123,01 117,18 108,83 97,913 84,821 70,459 56,1 43,185 33,101 27,044 25,997 29,26 35,314 43,829 54,129 65,351

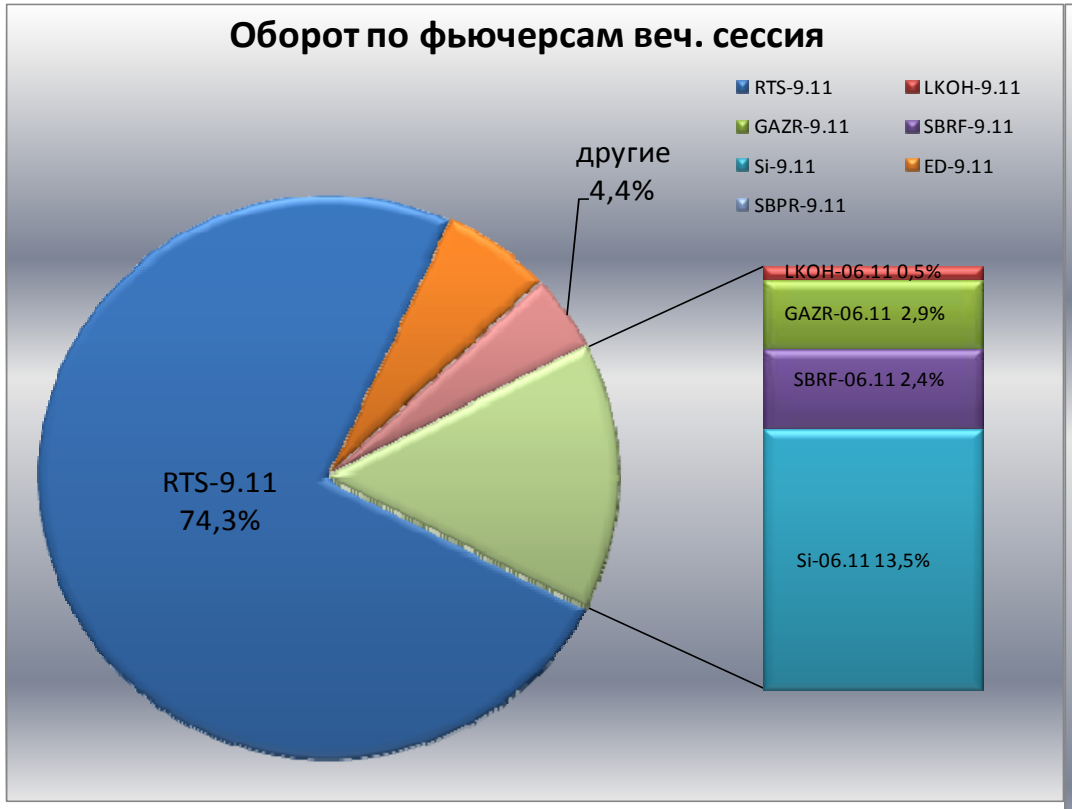

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
45
42
39
36
33
30
27
24
21
18
15
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 0 0 4 144 14 462 3972 9214 1446 3508 9746 2954 214 2 0 2000
OI Put 24 60 62 12 30 8 72 3162 828 5266 2008 1516 1484 1120 352 42 0 0 0 0
IV 158,06 158,03 157,81 157,05 154,95 150,16 141,02 126,17 105,58 81,325 57,472 39,109 30,797 34,124 46,416 64,869 86,199 107,15 125,41 139,89

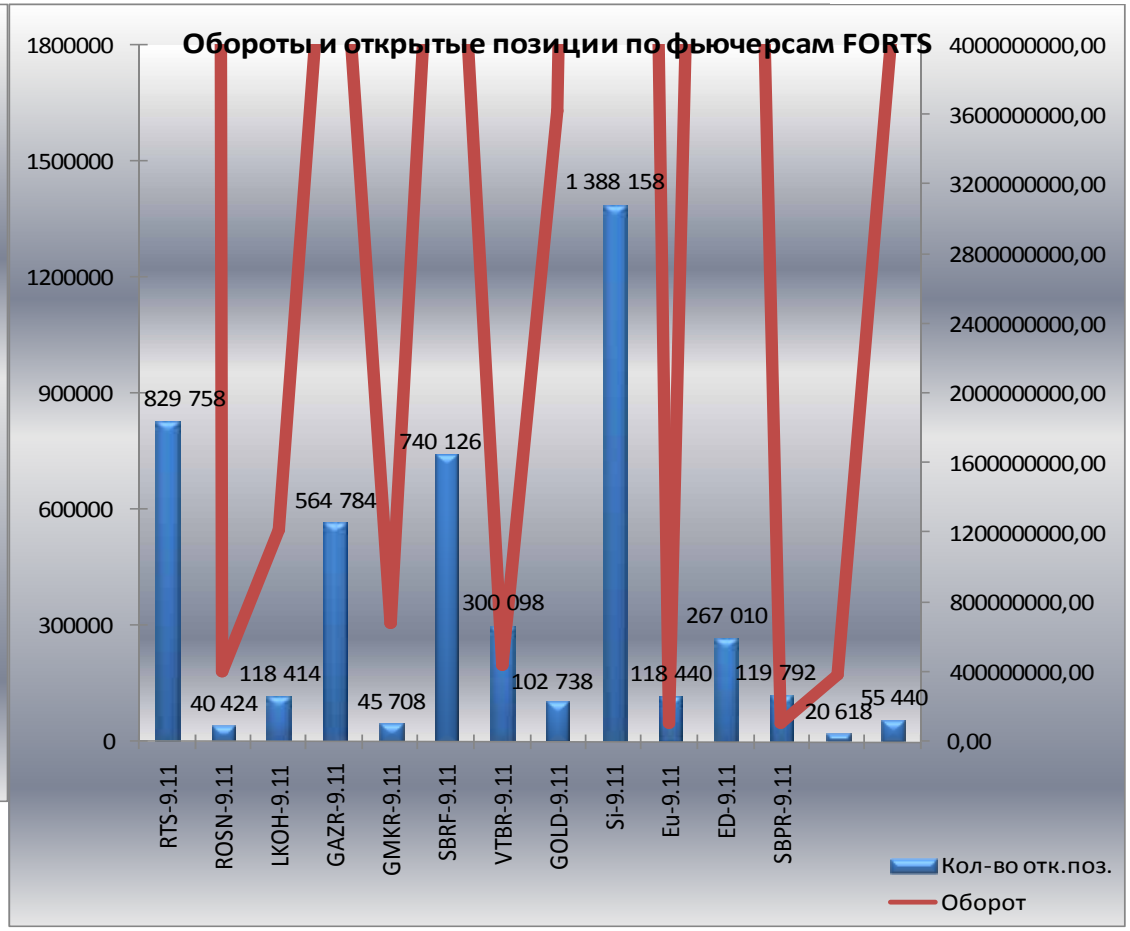


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	98	540	596	516	284	42	8	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	114	172	374	860	464	306	136	14	2	0	0
IV	92,769	119,257	119,387	119,375	118,816	116,781	111,715	101,856	86,33	66,445	46,236	31,692	28,714	38,092	54,412	74,277	94,922	113,661



	145	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	0	0	0	4	22	36	592	4962	14430	4636	2700	914	222	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	10	26	170	1620	914	17118	2790	294	36	58	12	14	0	0
IV	95,851	95,895	95,945	95,993	95,972	95,607	94,106	89,914	81,158	67,223	50,597	37,148	34,367	43,234	57,163	73,417	88,353	99,643	106,91	111,02


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
4,4%
RTS-9.11
74,3%
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
829 758
40 424
118 414
564 784
45 708
740 126
300 098
102 738
1 388 158
118 440
267 010
119 792
20 618
55 440
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