Понедельник: пессимистичные настроения на рынках

Рейтинговое агенство Moody's решило снизить рейтинг Греции сразу на три ступени с Caa1 до Ca, рейтинговые агенства S&P и Fitch могут также понизить рейтинг Греции. Таким образом, в понедельник 25 июля ключевые индикаторы еврозоны завершили торги в основном в отрицательной зоне: CAC40 (Франци) на 0,77%, FTSE100 (Великобритания) на –0,16%, IBEX35 (Испания) на –1,92%, в плюсе закрылся разве что DAX30 (+0,25%).

Также никаких сдвигов не намечается в проблеме долгового лимита США, что, как уже упоминалось, может привести к техническому дефолту. Тем не менее, большая часть отчитывающихся компаний показывает нормальные результаты, что сдерживает биржи от резкого разворота в «красную» зону.

Что касается российских рынков, по итогам вечерних торгов во вторник Газпром упал на -0,29%, а Лукойл изменился на +0,02%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на –0,03% и +0,18%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ изменились на -0,14% и -0,22%.





	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	197070	1970,70	-0,08	787 844	-0,63%	13 676 500 720	15,78%
ROSN-9.11	24311	243,11	-0,18	45 848	0,11%	7 845 985	0,70%
LKOH-9.11	18845	1884,50	0,02	109 582	0,68%	32 040 743	1,56%
GAZR-9.11	20173	201,73	-0,29	685 250	0,15%	187 875 300	1,36%
GMKR-9.11	75229	7522,90	-0,13	44 582	0,04%	9 482 272	0,28%
SBRF-9.11	10321	103,21	-0,14	963 258	-0,03%	273 319 888	2,74%
VTBR-9.11	8530	0,0853	-0,22	311 212	-0,01%	7 746 071	0,29%
GOLD-9.11	1618	1618,1000	0,04	120 102	-4,12%	429 035 069	7,64%
Si-9.11	27861	27,86	-0,03	1 382 396	-0,69%	498 937 372	1,29%
Eu-9.11	40003	40,00	0,18	111 672	0,34%	8 678 348	0,20%
ED-9.11	1,44	1,44	0,20	257 106	-1,23%	512 927 433	4,96%
SBPR-9.11	8252	82,52	0,18	119 150	-7,63%	2 128 324	1,40%
RTSS-9.11	11710	11710,00	-0,04	31 540	64,51%	7 027 200	1,79%
BR-7.11	118	117,70	-0,35	46 290	-7,55%	223 002 118	8,22%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	59970,54	-0,50%	00:12:29
CAC 40	3812,97	-0,77%	19:35:17
DAX 30	7344,54	0,25%	19:35:31
DJ Industrial	12592,8	-0,70%	00:46:10
FTSE 100	5925,26	-0,16%	19:35:31
Hang Seng	22498,27	0,92%	10:11:47
Nikkei 225	10097,72	0,47%	10:00:04
S&P 500	1337,43	-0,56%	00:03:59
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1614,68	0,08%	10:11:45
Palladium	805,78	0,22%	10:11:00
Platinum	1781,5	-0,21%	10:11:28
RTSI	1 978,21	-0,09%	23:50:00
RTS_Standard	11 660,64	-0,09%	23:50:00
RTSI_DEREX	2031.53	0.14%	18:45:00

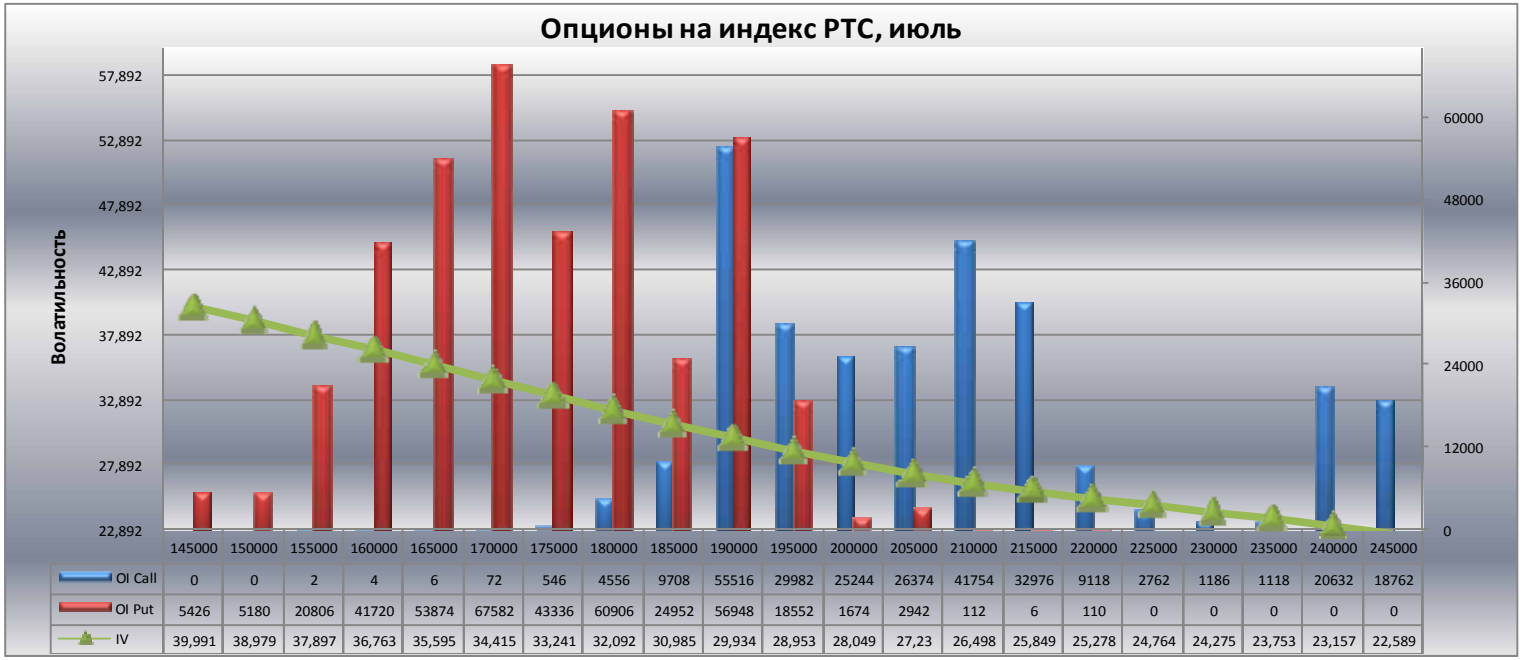
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,08	787844	13676500720,48	197070
ROSN-9.11	-0,18	45848	7845985,00	24311
LKOH-9.11	0,02	109582	32040743,00	18845
GAZR-9.11	-0,29	685250	187875300,00	20173
GMKR-9.11	-0,13	44582	9482272,00	75229
SBRF-9.11	-0,14	963258	273319888,00	10321
VTBR-9.11	-0,22	311212	7746071,00	8530
GOLD-9.11	0,04	120102	429035069,32	1618,1
Si-9.11	-0,03	1382396	498937372,00	27861
Eu-9.11	0,18	111672	8678348,00	40003
ED-9.11	0,2	257106	512927433,43	1,4358
SBPR-9.11	0,18	119150	2128324,00	8252
RTSS-9.11	-0,04	31540	7027200,00	11710
BR-7.11	-0,35	46 290	223002118,13	117,7

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375 378	33712923752,00	106500
ROSN-9.09	1,45	34 590	189953759,00	20140
LKOH-9.09	1,18	75 684	952454903,00	16002
GAZR-9.09	0,25	409 478	4720165290,00	16427
GMKR-9.09	1,1	15 978	168466309,00	34223
SBRF-9.09	3,72	826 566	2599351513,00	4923
SNGR-9.09	-0,94	8 356	66832296,00	25786
VTBR-9.09	1,12	58 230	33036662,00	4390
GOLD-9.09	0,6	16 306	58445322,80	955,2
Si-9.09	0,03	467 760	3969232519,00	31929
Eu-9.09	-0,31	23 936	18558032,00	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585721,79	1,4317
BR-9.09	1,34	50492	549103769,14	70,64
SBPR-9.09	2,83	33 384	9338717,00	2866

Опционы на индекс РТС, июль

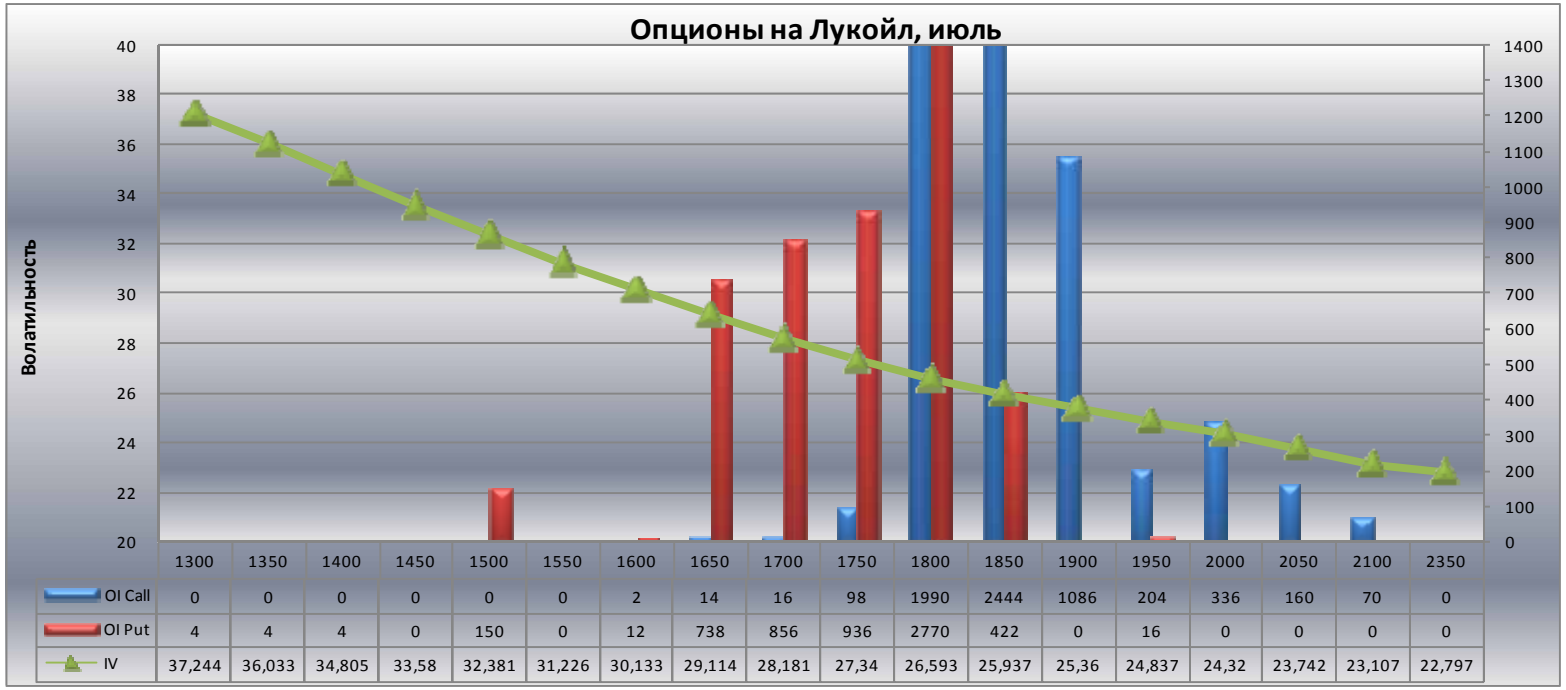


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	0	0	2	4	6	72	546	4556	9708	55516	29982	25244	26374	41754	32976	9118	2762	1186	1118	20632	18762
OI Put	5426	5180	20806	41720	53874	67582	43336	60906	24952	56948	18552	1674	2942	112	6	110	0	0	0	0	0
IV	39,991	38,979	37,897	36,763	35,595	34,415	33,241	32,092	30,985	29,934	28,953	28,049	27,23	26,498	25,849	25,278	24,764	24,275	23,753	23,157	22,589

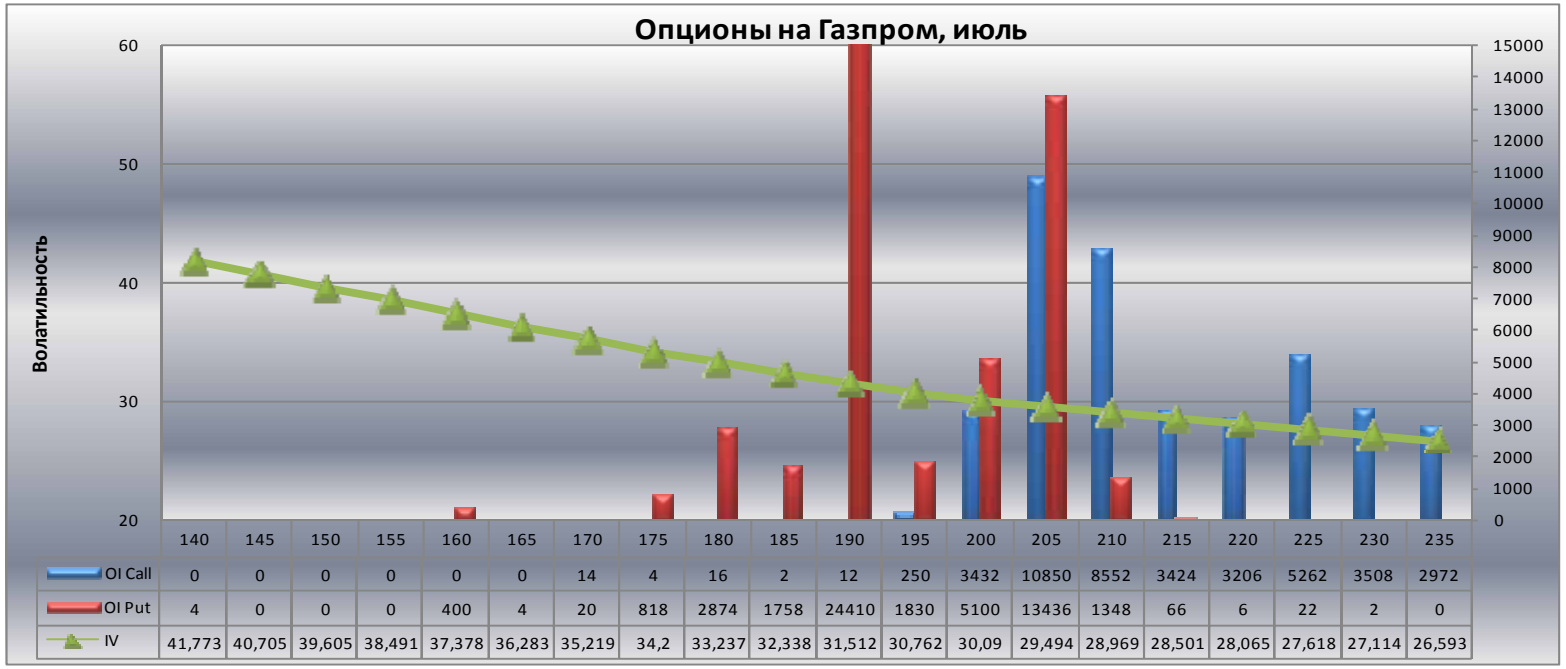
Опционы на Сбербанк, июль



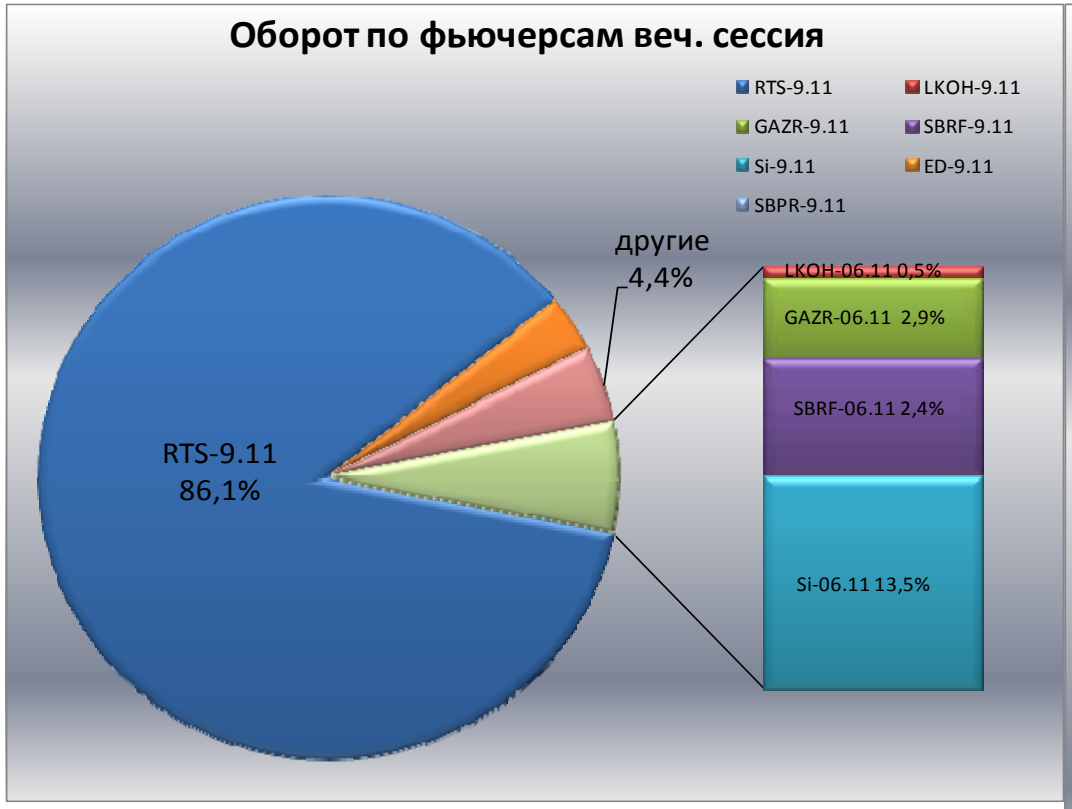
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	4	34	10	18	270	316	6998	10814	17886	16964	9630	23492	2838	18770	1318	1100
OI Put	16	42	0	188	856	2632	3132	4210	3018	15010	5792	13552	6146	6348	554	42	338	174	2	0
IV	44,012	42,001	40,945	39,875	38,806	37,752	36,727	35,742	34,807	33,931	33,121	32,38	31,711	31,112	30,577	30,096	29,648	29,195	28,692	28,137

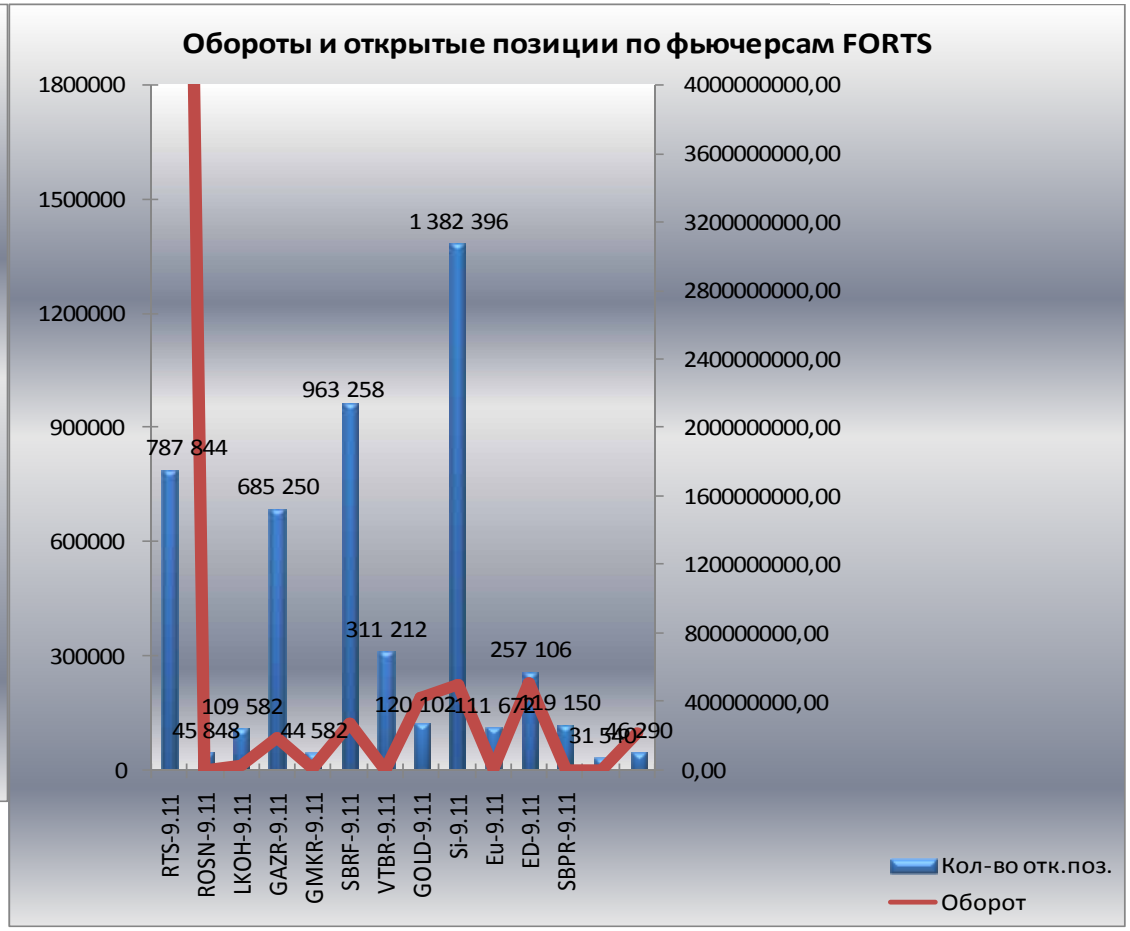


	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2350
OI Call	0	0	0	0	0	0	2	14	16	98	1990	2444	1086	204	336	160	70	0
OI Put	4	4	4	0	150	0	12	738	856	936	2770	422	0	16	0	0	0	0
IV	37,244	36,033	34,805	33,58	32,381	31,226	30,133	29,114	28,181	27,34	26,593	25,937	25,36	24,837	24,32	23,742	23,107	22,797



	140	145	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235
OI Call	0	0	0	0	0	0	14	4	16	2	12	250	3432	10850	8552	3424	3206	5262	3508	2972
OI Put	4	0	0	0	400	4	20	818	2874	1758	24410	1830	5100	13436	1348	66	6	22	2	0
IV	41,773	40,705	39,605	38,491	37,378	36,283	35,219	34,2	33,237	32,338	31,512	30,762	30,09	29,494	28,969	28,501	28,065	27,618	27,114	26,593


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
86,1%
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
787 844
45 848
109 582
685 250
44 582
963 258
311 212
120 102
1 382 396
111 672
257 106
219 150
31 540
46 290
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