Наконец было принято решение по повышению лимита госдолга США

В понедельник 1 августа основные индикаторы Европы и США завершили торговую сессию в минусе: индекс CAC40 упал на –2,27%, DAX30 на –2,86%, FTSE100 на –0,7%, DJ Industrial S&P500 на –0,09%.

Наконец было принято решение по повышению лимита госдолга США, также было одобрено сокращение госрасходов США. В краткосрочном периоде это даст некоторые преимущества, однако в долгосрочном последствия будут негативны: социалка, здравоохранение и т.д. урезаны, что непременно скажется на потребительском спросе в будущем.

Что касается российских рынков, по итогам вечерних торгов во вторник Газпром прибавил +0,23%, а Лукойл +0,26%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,33% и +0,31%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ изменились на -0.01% и -0.07%.

Поведение рынков очень неоднозначно, однако скорее всего доллар пойдет вверх в сторону отметки в 28, также возможно начало медленного роста по Европе после нескольких подряд сессий в минус.





	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	197635	1976,35	-0,05	810 518	115,92%	31 026 262 026	92,03%
ROSN-9.11	24101	241,01	0,25	49 358	42,69%	15 094 199	7,95%
LKOH-9.11	18745	1874,50	0,26	112 558	48,72%	77 366 250	8,12%
GAZR-9.11	20355	203,55	0,23	677 760	65,52%	270 645 447	5,73%
GMKR-9.11	75079	7507,90	0,12	41 026	156,77%	27 722 341	16,46%
SBRF-9.11	10338	103,38	-0,01	996 450	20,55%	413 422 835	15,90%
VTBR-9.11	8485	0,0849	-0,07	334 222	3899,78%	29 866 605	44,69%
GOLD-9.11	1622	1622,2000	-0,45	103 926	78,48%	450 465 507	1363,53%
Si-9.11	27927	27,93	0,33	1 480 254	8977,97%	1 267 399 410	2168,52%
Eu-9.11	39797	39,80	0,31	115 234	-75,36%	10 553 645	0,27%
ED-9.11	1,43	1,43	0,06	213 676	792,70%	2 605 122 148	14037,71%
SBPR-9.11	8392	83,92	0,27	129 184	-39,92%	4 357 927	0,37%
RTSS-9.11	11750	11750,00	0,30	34 622	-31,43%	29 878 955	5,44%
BR-9.11	117	116,62	-0,72	11 472	-65,64%	234 524 938	2511,32%

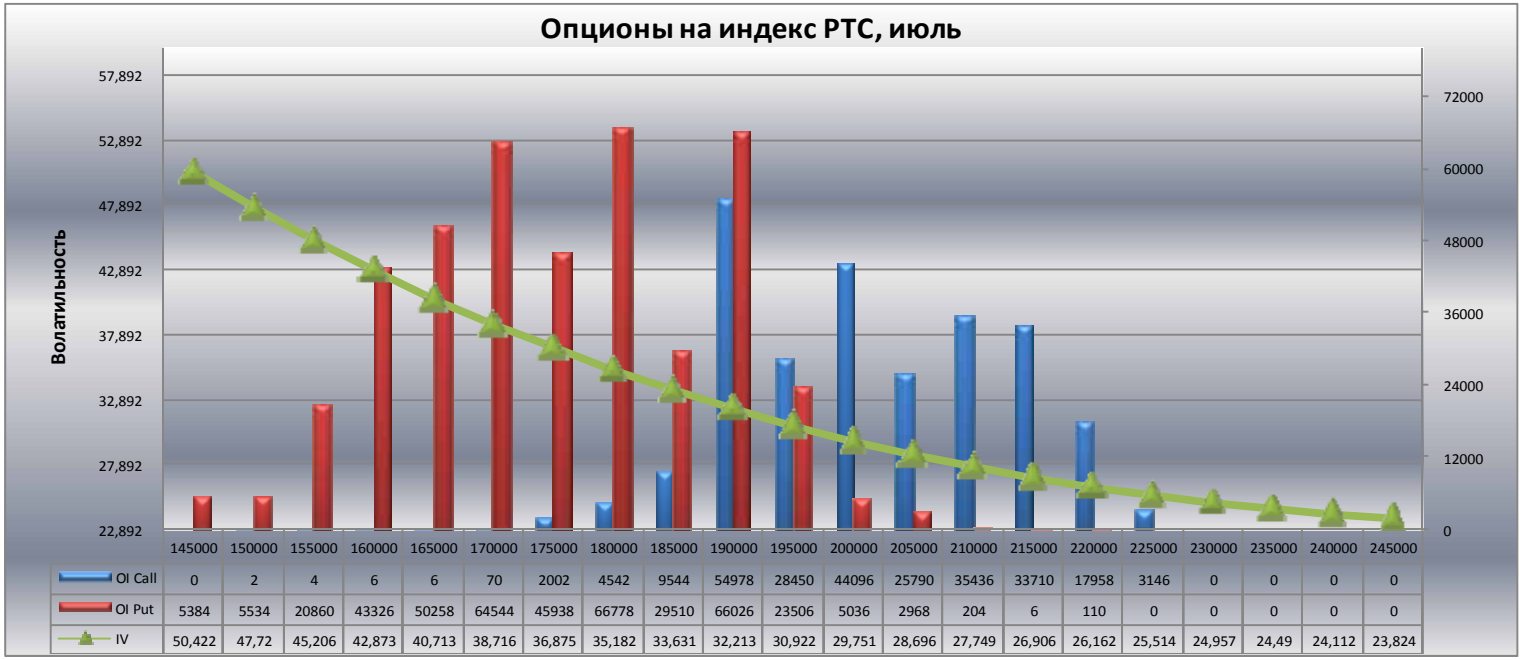
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58535,74	-0,49%	00:13:31
CAC 40	3588,05	-2,27%	20:28:06
DAX 30	6953,98	-2,86%	19:37:55
DJ Industrial	12132,49	-0,09%	00:35:17
FTSE 100	5774,43	-0,70%	07:00:33
Hang Seng	22538,61	-0,55%	10:31:32
Nikkei 225	9844,59	-1,21%	10:00:03
S&P 500	1286,94	-0,41%	00:05:29
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1623,73	0,29%	10:31:39
Palladium	828,03	0,25%	10:23:49
Platinum	1790,7	0,12%	10:31:11
RTSI	1 980,76	-0,25%	23:50:00
RTS_Standard	11 671,60	0,05%	23:50:00
RTSI_DEREX	2027.05	0.82%	18:45:00

Вечерняя сессия

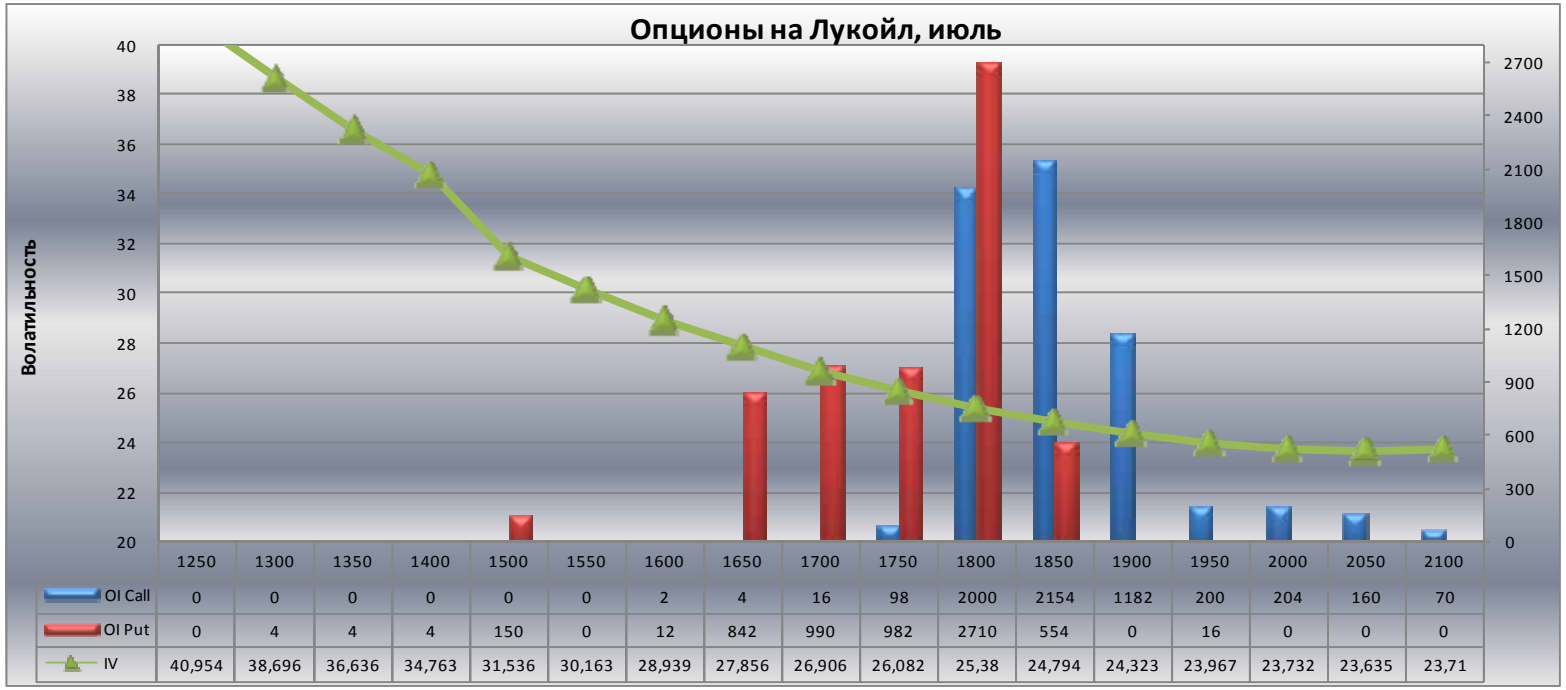
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,05	810518	31026262025,53	197635
ROSN-9.11	0,25	49358	15094199,00	24101
LKOH-9.11	0,26	112558	77366250,00	18745
GAZR-9.11	0,23	677760	270645447,00	20355
GMKR-9.11	0,12	41026	27722341,00	75079
SBRF-9.11	-0,01	996450	413422835,00	10338
VTBR-9.11	-0,07	334222	29866605,00	8485
GOLD-9.11	-0,45	103926	450465506,92	1622,2
Si-9.11	0,33	1480254	1267399410,00	27927
Eu-9.11	0,31	115234	10553645,00	39797
ED-9.11	0,06	213676	2605122147,62	1,4258
SBPR-9.11	0,27	129184	4357927,00	8392
RTSS-9.11	0,3	34622	29878955,00	11750
BR-9.11	-0,72	11 472	234524938,29	116,62

Дневная сессия

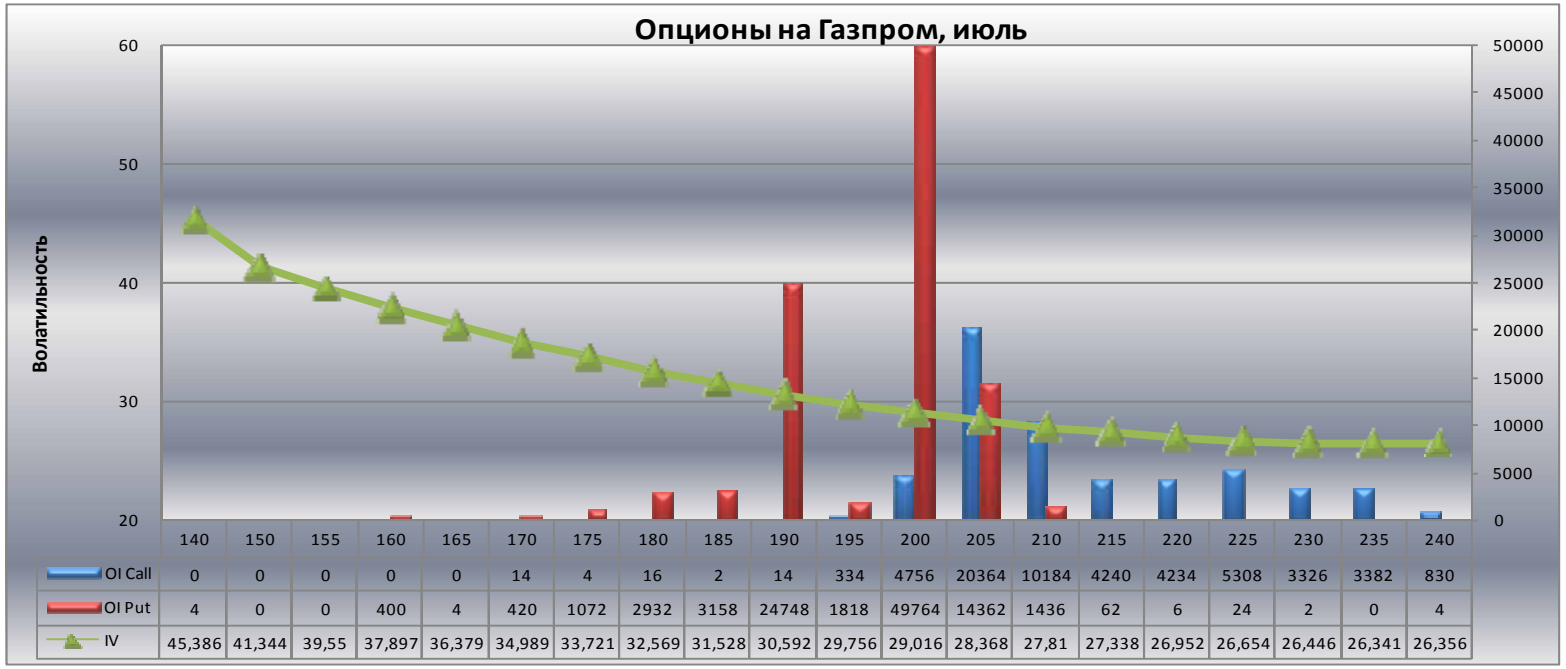
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752,00	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759,00	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903,00	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290,00	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309,00	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513,00	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296,00	25786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662,00	4390
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,80	955,2
Si-9.09	0,03	467760	3969232519,00	31929
Eu-9.09	-0,31	23936	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
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 2 4 6 6 70 2002 4542 9544 54978 28450 44096 25790 35436 33710 17958 3146 0 0 0 0
OI Put 5384 5534 20860 43326 50258 64544 45938 66778 29510 66026 23506 5036 2968 204 6 110 0 0 0 0 0
IV 50,422 47,72 45,206 42,873 40,713 38,716 36,875 35,182 33,631 32,213 30,922 29,751 28,696 27,749 26,906 26,162 25,514 24,957 24,49 24,112 23,824

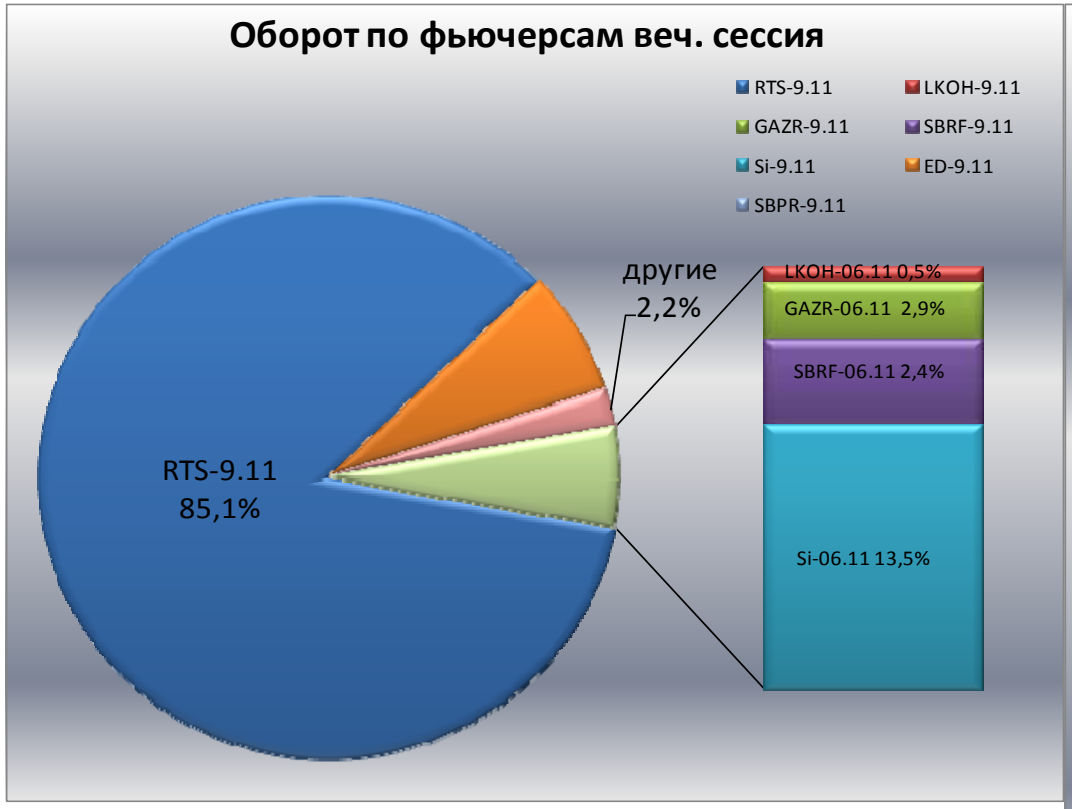

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
45
42
39
36
33
30
27
24
21
18
15
35000
30000
25000
20000
15000
10000
5000
0
7000 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 4 34 10 18 292 328 6960 10908 18442 17372 9744 24010 3232 20248 1520 1104
OI Put 16 42 0 178 854 2624 3722 4118 35054 15482 5862 17298 6460 6266 554 42 340 172 2 0
IV 49,101 44,78 42,85 41,064 39,417 37,903 36,514 35,245 34,09 33,045 32,104 31,263 30,517 29,863 29,299 28,821 28,429 28,124 27,911 27,799

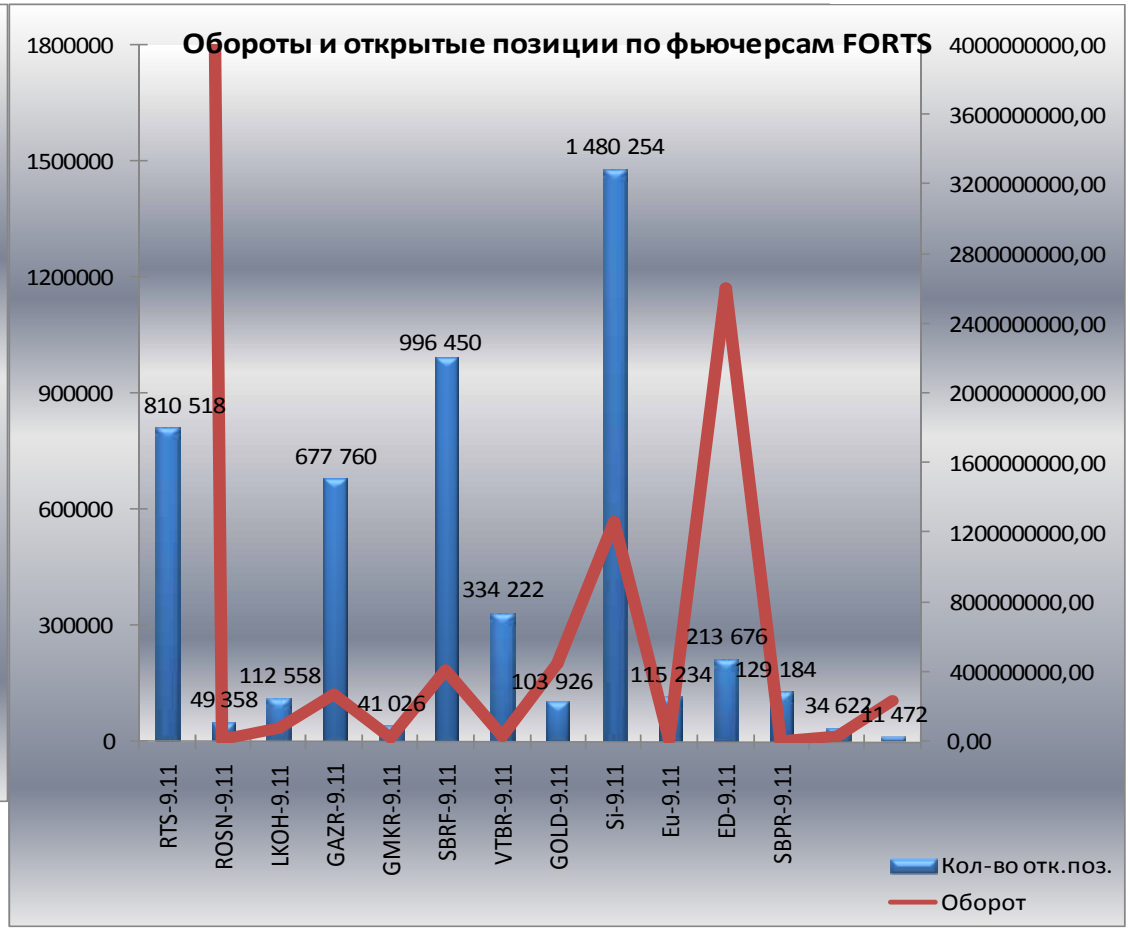


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	2	4	16	98	2000	2154	1182	200	204	160	70
OI Put	0	4	4	4	150	0	12	842	990	982	2710	554	0	16	0	0	0
IV	40,954	38,696	36,636	34,763	31,536	30,163	28,939	27,856	26,906	26,082	25,38	24,794	24,323	23,967	23,732	23,635	23,71



	140	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	14	4	16	2	14	334	4756	20364	10184	4240	4234	5308	3326	3382	830
OI Put	4	0	0	400	4	420	1072	2932	3158	24748	1818	49764	14362	1436	62	6	24	2	0	4
IV	45,386	41,344	39,55	37,897	36,379	34,989	33,721	32,569	31,528	30,592	29,756	29,016	28,368	27,81	27,338	26,952	26,654	26,446	26,341	26,356


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
RTS-9.11
85,1%
другие
2,2%
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
810 518
49 358
112 558
677 760
41 026
996 450
334 222
103 926
1 480 254
115 234
213 676
129 184
34 622
11 472
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