Вторник: рекордное для Европейских рынков падение

Во вторник 2 июля Европа установила рекорд, упав до минимальных за последние 10 месяцев значений: индекс CAC40 упал на –1,82%, DAX30 на –2,26%, FTSE100 на –0,97%. Во многом это было спровоцировано опасениями на счет США (напомним, крупнейшие рейтинговые агентства Standard&Poors, Moodys и Fitch всерьез намереваются понизить кредитный рейтинг США).

Фондовый рынок США также показал отрицательную динамику: S&P упал на –2,56%, а DJ Industrial на –2,19%. . Палата Конгресса одобрила законопроект о повышении лимита госдолга, и 2 августа в 20:00 прошедшее голосование в Сенате утвердило этот законопроект. Тем не менее, пока настроения в основном преобладают пессимистичные

Что касается российских рынков, по итогам вечерних торгов во вторник Газпром упал на -0,16%, а Лукойл прибавил +0,24%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,07% и +0,05%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанк и ВТБ изменились на -0,11% и -0,47%.





	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	190000	1900,00	-0,16	790 284	110,53%	17 212 537 769	51,06%
ROSN-9.11	23813	238,13	0,41	47 738	38,01%	8 373 779	4,41%
LKOH-9.11	18200	1820,00	0,24	116 272	53,63%	33 594 173	3,53%
GAZR-9.11	20297	202,97	-0,16	542 344	32,45%	183 803 044	3,89%
GMKR-9.11	75630	7563,00	-0,01	35 252	120,63%	28 957 046	17,19%
SBRF-9.11	10312	103,12	-0,11	715 700	-13,41%	342 269 694	13,17%
VTBR-9.11	8313	0,0831	-0,47	272 308	3158,83%	15 452 641	23,12%
GOLD-9.11	1557	1556,8000	0,15	73 250	25,79%	444 787 564	1346,35%
Si-9.11	28438	28,44	0,07	1 348 338	8168,97%	945 300 825	1617,41%
Eu-9.11	39785	39,79	0,05	118 800	-74,60%	21 756 700	0,55%
ED-9.11	1,40	1,40	0,01	176 730	638,34%	2 695 759 709	14526,11%
SBPR-9.11	8003	80,03	0,09	127 824	-40,56%	6 583 876	0,55%
RTSS-9.11	11560	11560,00	-0,02	19 248	-61,88%	12 478 830	2,27%
BR-7.11	117	116,81	0,85	112 852	238,04%	2 010 473 038	21528,36%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57310,78	-2,09%	00:15:31
CAC 40	3522,79	-1,82%	19:35:15
DAX 30	6796,75	-2,26%	19:35:31
DJ Industrial	11866,62	-2,19%	00:32:57
FTSE 100	5718,39	-0,97%	19:35:31
Hang Seng	21963,03	-2,04%	10:26:02
Nikkei 225	9637,14	-2,11%	10:00:05
S&P 500	1254,05	-2,56%	00:08:46
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1661,95	0,16%	10:26:02
Palladium	825	0,23%	10:20:30
Platinum	1793,8	0,17%	10:20:11
RTSI	1 952,45	-0,65%	23:50:00
RTS_Standard	11 472,89	-0,87%	23:50:00
RTSI_DEREX	2011.79	-0.75%	18:45:00

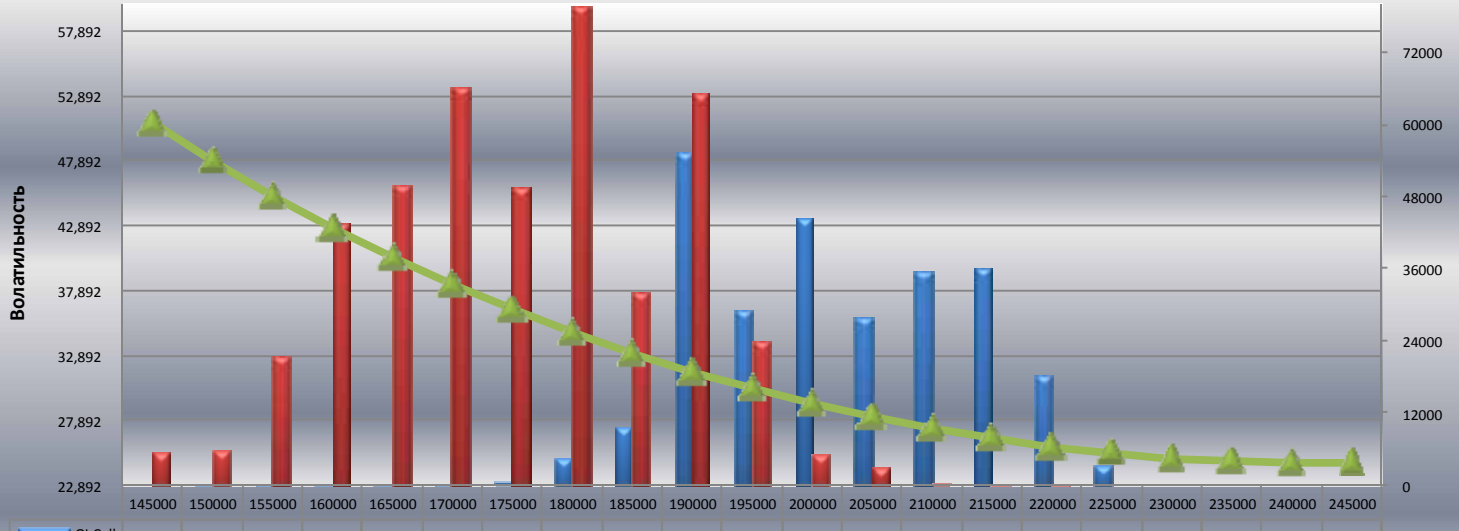
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,16	790284	17212537769,48	190000
ROSN-9.11	0,41	47738	8373779,00	23813
LKOH-9.11	0,24	116272	33594173,00	18200
GAZR-9.11	-0,16	542344	183803044,00	20297
GMKR-9.11	-0,01	35252	28957046,00	75630
SBRF-9.11	-0,11	715700	342269694,00	10312
VTBR-9.11	-0,47	272308	15452641,00	8313
GOLD-9.11	0,15	73250	444787563,76	1556,8
Si-9.11	0,07	1348338	945300825,00	28438
Eu-9.11	0,05	118800	21756700,00	39785
ED-9.11	0,01	176730	2695759708,61	1,399
SBPR-9.11	0,09	127824	6583876,00	8003
RTSS-9.11	-0,02	19248	12478830,00	11560
BR-7.11	0,85	112852	2010473038,21	116,81

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	33384	9338717,00	2866

Опционы на индекс РТС, июль

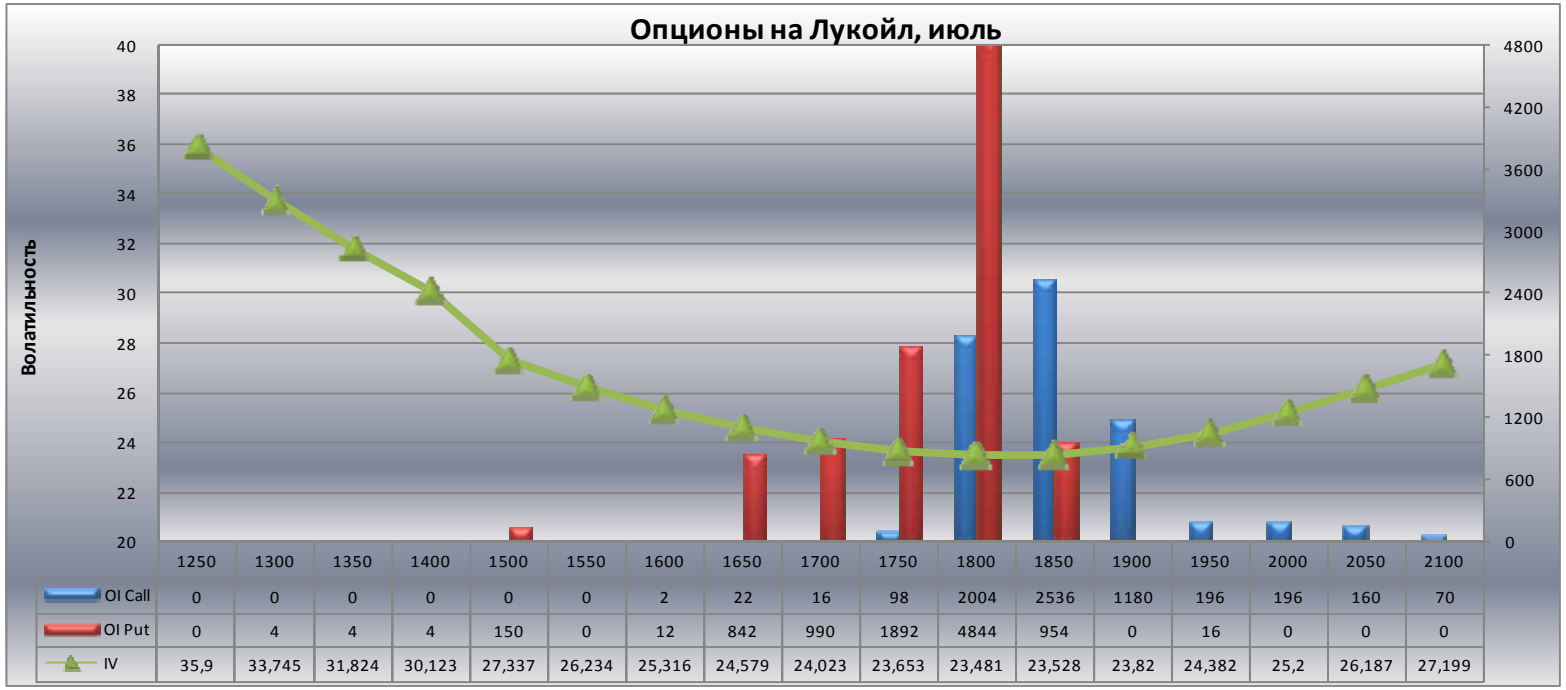


	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	0	2	4	6	6	70	502	4542	9536	55076	29022	44294	27700	35284	36012	18240	3258	0	0	0	0
OI Put	5384	5564	21388	43398	49696	65948	49396	79382	31810	65160	24002	4946	2956	202	6	110	0	0	0	0	0
IV	50,818	47,916	45,23	42,748	40,461	38,361	36,438	34,684	33,091	31,651	30,358	29,206	28,19	27,304	26,545	25,912	25,403	25,021	24,77	24,659	24,7

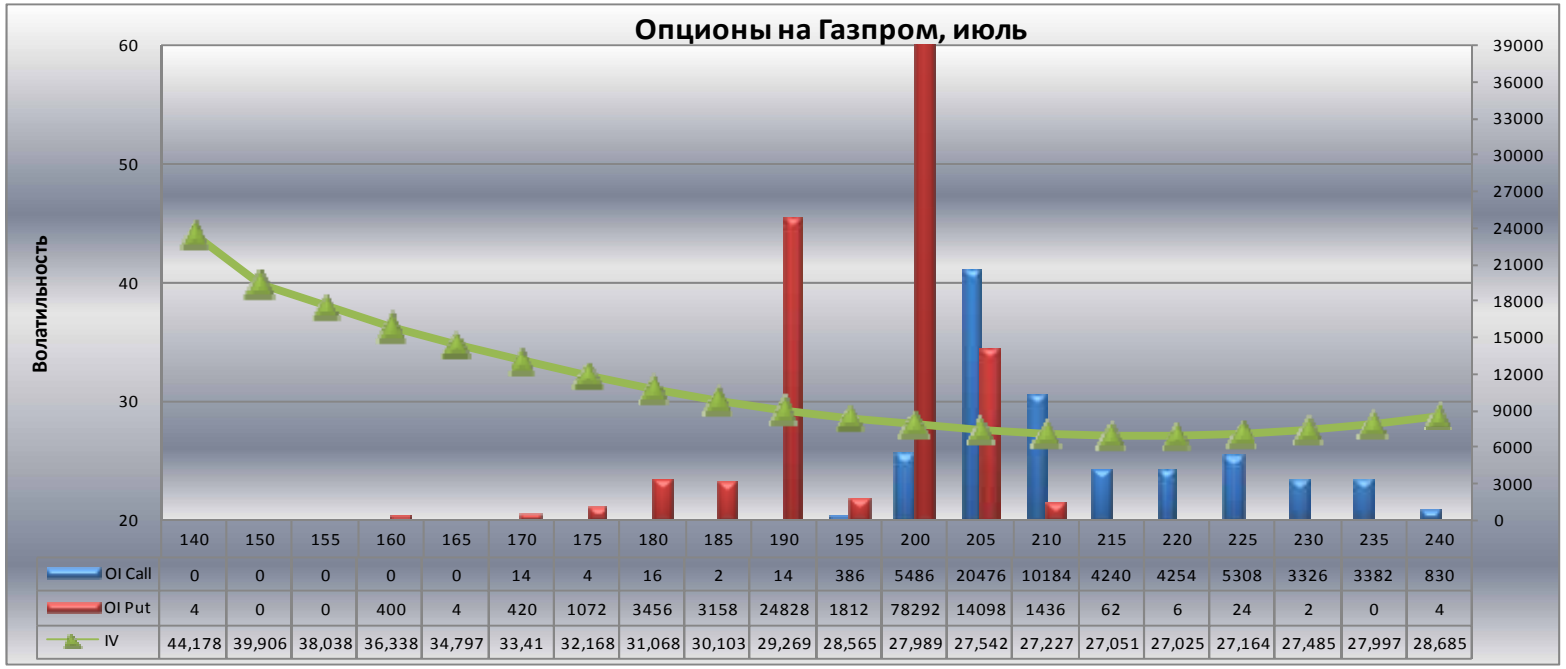
Опционы на Сбербанк, июль



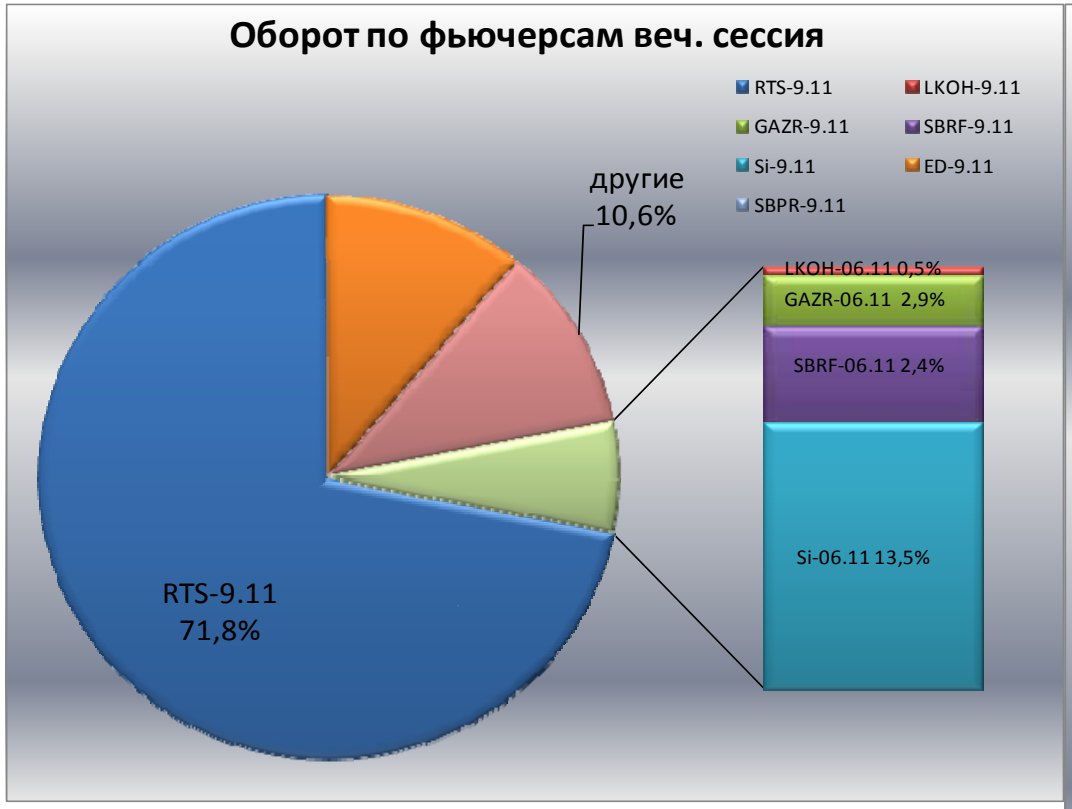
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	4	34	10	18	272	316	6960	11088	18540	17978	9748	24030	3232	20246	1520	1104
OI Put	16	42	0	178	854	2624	3724	4118	35040	15596	5862	17350	7754	6168	562	42	340	172	2	0
IV	47,963	42,018	39,466	37,182	35,161	33,393	31,872	30,595	29,557	28,76	28,21	27,918	27,902	28,179	28,747	29,556	30,504	31,478	32,418	33,314

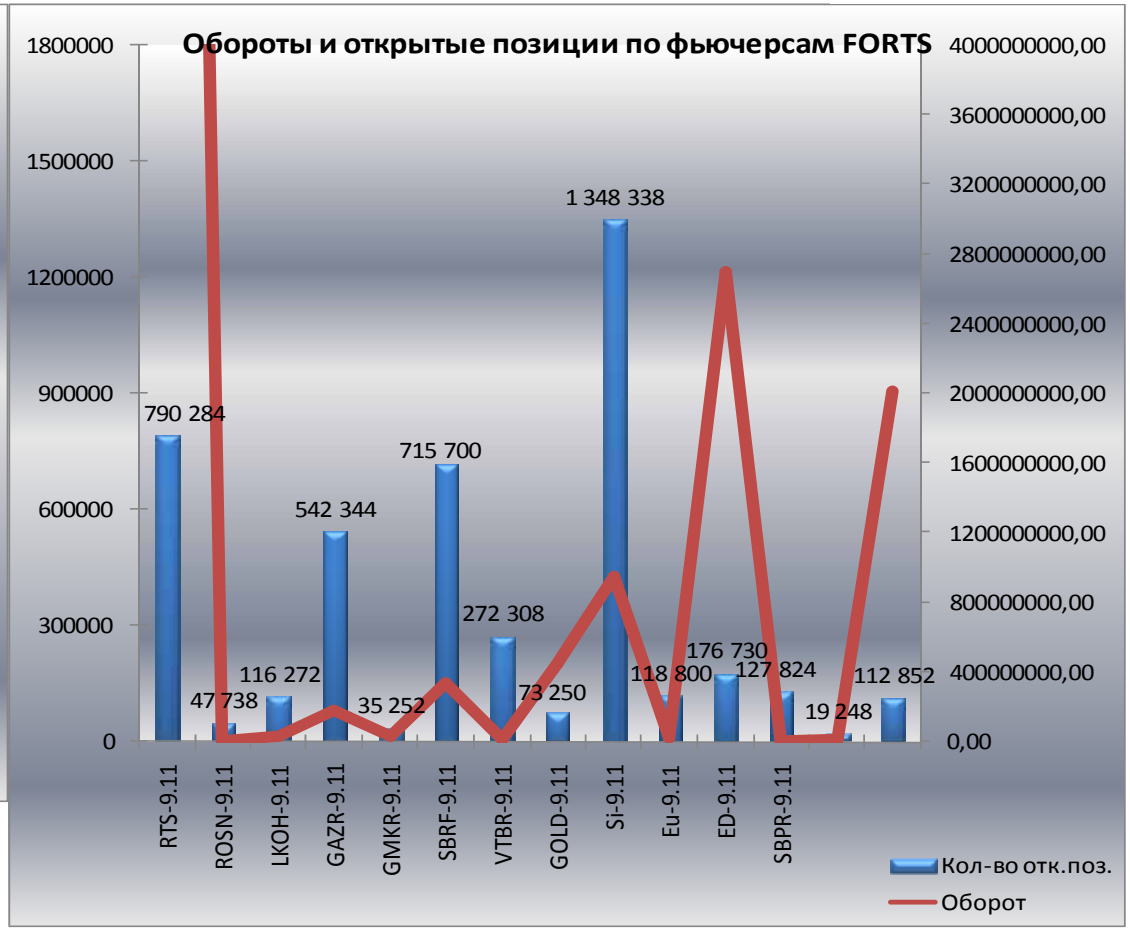


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	2	22	16	98	2004	2536	1180	196	196	160	70
OI Put	0	4	4	4	150	0	12	842	990	1892	4844	954	0	16	0	0	0
IV	35,9	33,745	31,824	30,123	27,337	26,234	25,316	24,579	24,023	23,653	23,481	23,528	23,82	24,382	25,2	26,187	27,199



	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	386	5486	20476	10184	4240	4254	5308	3326	3382	830
OI Put	4	0	0	400	4	420	1072	3456	3158	24828	1812	78292	14098	1436	62	6	24	2	0	4
IV	44,178	39,906	38,038	36,338	34,797	33,41	32,168	31,068	30,103	29,269	28,565	27,989	27,542	27,227	27,051	27,025	27,164	27,485	27,997	28,685


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
10,6%
RTS-9.11
71,8%
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
790 284
47 738
116 272
542 344
35 252
715 700
272 308
73 250
1 348 338
118 800
176 730
127 824
19 248
112 852
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