Вторник: умеренное снижение

Во вторник 16 августа рынки показали умеренное снижение индексов. Виной тому плохие макроданные по Европе, которые показали существенное замедление европейской экономики. Также во вторник агентство Fitch подтвердило рейтинг США на уровне AAA, что для многих звучало неубедительным, а потому особо не повлияло на ход торгов.

По итогам сессии DJ Industrial упал на 76,97 пунктов (-0,67%), а S&P500 на 11,73 пункта (-0,97%). По Европе индекс CAC 40 упал на –0,25%, DAX 30 на –0,46%, FTSE 100 вырос на 0,13%.

На российском рынке вечерняя торговая сессия закрылась в основном в «красной зоне»: Газпром упал на –0,68%, Роснефть на –0,22%, Лукойл на –0,45%, ВТБ на –0,29%, Сбербанк на –0,33%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль изменились на –0,02% и +0,02% соответственно. Динамику «лучше рынка» показали отдельные бумаги электроэнергетики такие как ОГК-6 (+8,42% за торговый день), ОГК-1 (+5,34%) и др. Также в течение дня неплохо торговали акции Седьмого Континента (+5,56%), в связи с выходом финансовой отчетности, показавшей весьма неплохие результаты.





	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	161740	1617,40	-0,40	1 000 028	166,41%	36 382 532 377	107,92%
ROSN-9.11	20661	206,61	-0,22	50 016	44,60%	19 551 797	10,29%
LKOH-9.11	16247	1624,70	-0,45	110 582	46,11%	153 491 543	16,12%
GAZR-9.11	17035	170,35	-0,68	655 874	60,17%	557 677 426	11,81%
GMKR-9.11	65888	6588,80	-0,56	45 934	187,48%	36 257 110	21,52%
SBRF-9.11	8643	86,43	-0,33	1 051 484	27,21%	650 254 831	25,02%
VTBR-9.11	7179	0,0718	-0,29	243 340	2812,16%	20 124 818	30,11%
GOLD-9.11	1790	1790,2000	0,11	99 484	70,85%	590 017 789	1785,95%
Si-9.11	28800	28,80	-0,02	1 358 192	8229,40%	1 756 738 742	3005,78%
Eu-9.11	41455	41,46	0,02	118 014	-74,77%	8 441 428	0,21%
ED-9.11	1,44	1,44	0,15	166 856	597,09%	5 729 273 678	30872,20%
SBPR-9.11	7159	71,59	-0,25	112 624	-47,63%	5 892 061	0,50%
RTSS-9.11	9960	9960,00	-0,75	31 532	-37,55%	9 193 355	1,67%
BR-9.11	109	109,33	0,12	40 738	22,03%	739 205 482	7915,49%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54323,61	-0,60%	00:15:31
CAC 40	3230,9	-0,25%	19:35:18
DAX 30	5994,9	-0,45%	19:35:30
DJ Industrial	11405,93	-0,67%	00:38:34
FTSE 100	5357,63	0,13%	19:35:31
Hang Seng	20444,1	1,15%	10:06:01
Nikkei 225	9057,26	-0,55%	10:00:02
S&P 500	1192,76	-0,97%	00:03:15
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1788,3	0,11%	10:05:57
Palladium	751,15	-0,22%	10:02:10
Platinum	1818,2	0,28%	10:05:56
RTSI	1 627,40	-0,38%	23:50:00
RTS_Standard	9 962,63	-0,49%	23:50:00
RTSI_DEREX	1677.11	-1.69%	18:45:00

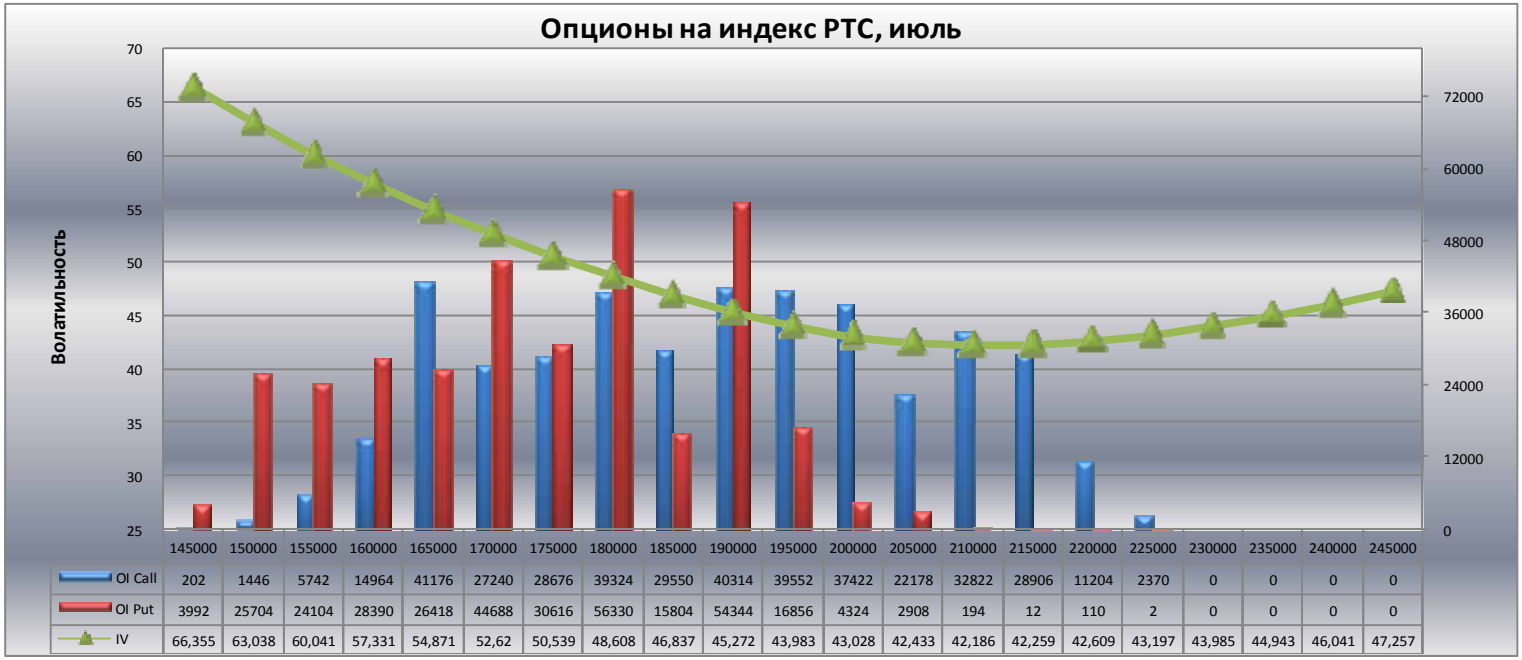
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,4	1000028	36382532377,46	161740
ROSN-9.11	-0,22	50016	19551797,00	20661
LKOH-9.11	-0,45	110582	153491543,00	16247
GAZR-9.11	-0,68	655874	557677426,00	17035
GMKR-9.11	-0,56	45934	36257110,00	65888
SBRF-9.11	-0,33	1051484	650254831,00	8643
VTBR-9.11	-0,29	243340	20124818,00	7179
GOLD-9.11	0,11	99484	590017788,56	1790,2
Si-9.11	-0,02	1358192	1756738742,00	28800
Eu-9.11	0,02	118014	8441428,00	41455
ED-9.11	0,15	166856	5729273678,37	1,4407
SBPR-9.11	-0,25	112624	5892061,00	7159
RTSS-9.11	-0,75	31532	9193355,00	9960
BR-9.11	0,12	40 738	739205482,30	109,33

Дневная сессия

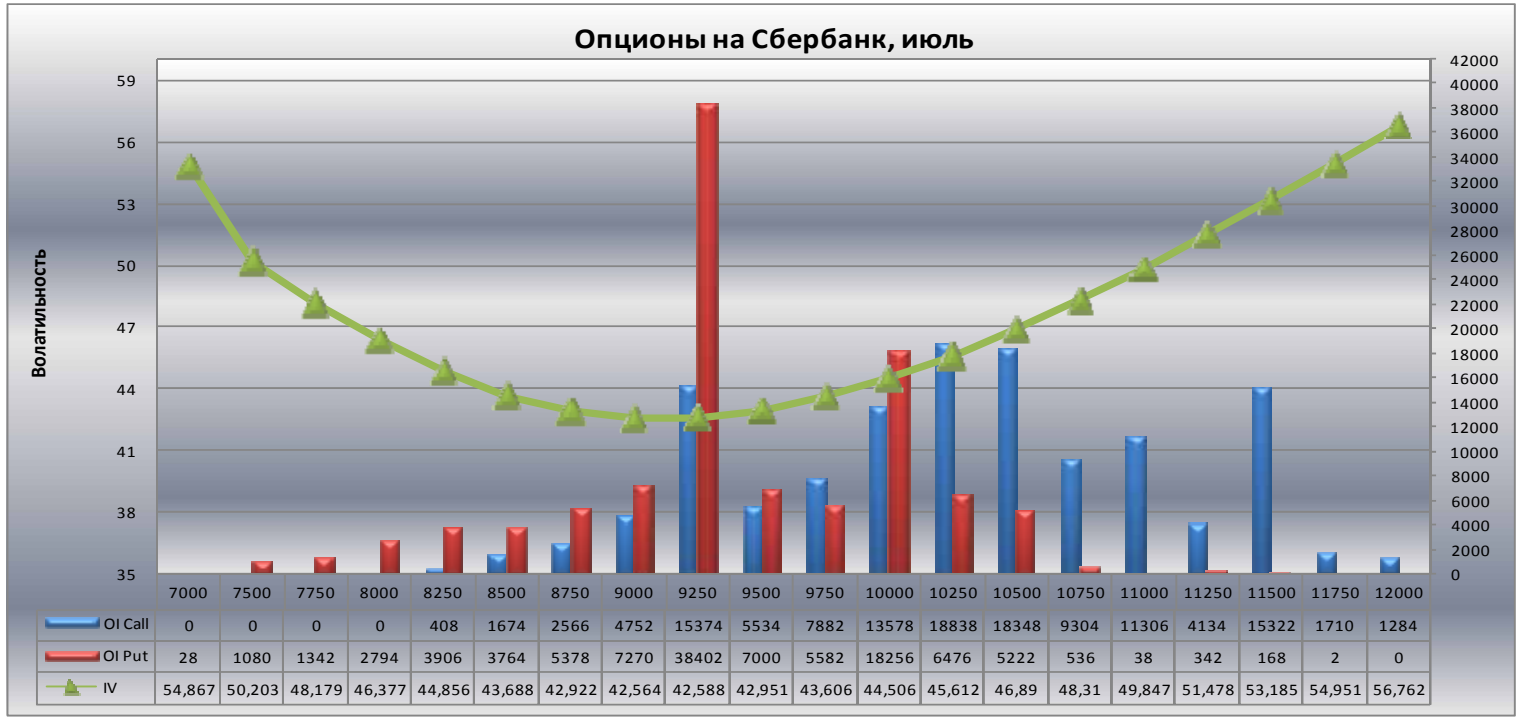
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752	106 500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759	20 140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903	16 002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290	16 427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309	34 223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513	4 923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296	25 786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662	4 390,00
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,8	955
Si-9.09	0,03	467760	3969232519	31 929
Eu-9.09	-0,31	23936	18558032	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585722	1
BR-9.09	1,34	50492	549103769,1	70,64
SBPR-9.09	2,83	33384	9338717	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	202	1446	5742	14964	41176	27240	28676	39324	29550	40314	39552	37422	22178	32822	28906	11204	2370	0	0	0	0
OI Put	3992	25704	24104	28390	26418	44688	30616	56330	15804	54344	16856	4324	2908	194	12	110	2	0	0	0	0
IV	66,355	63,038	60,041	57,331	54,871	52,62	50,539	48,608	46,837	45,272	43,983	43,028	42,433	42,186	42,259	42,609	43,197	43,985	44,943	46,041	47,257

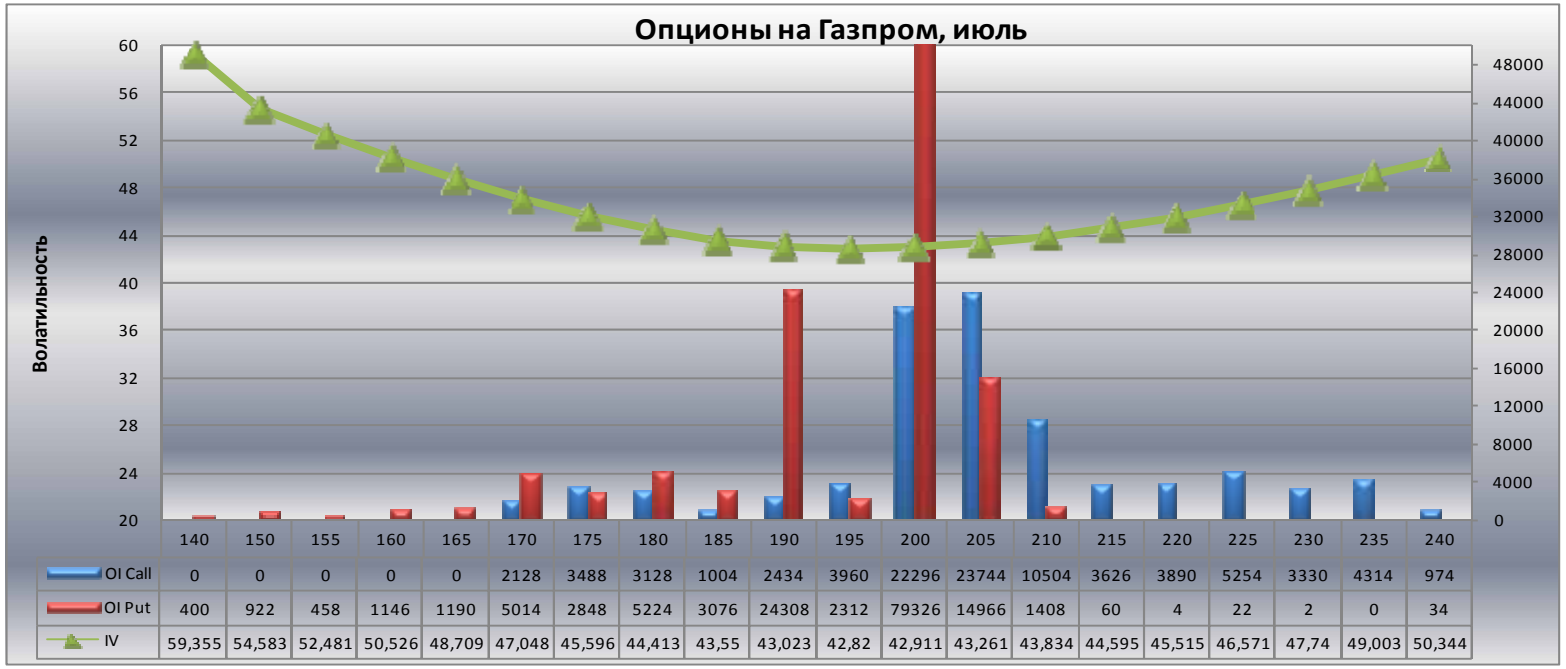
Опционы на Сбербанк, июль



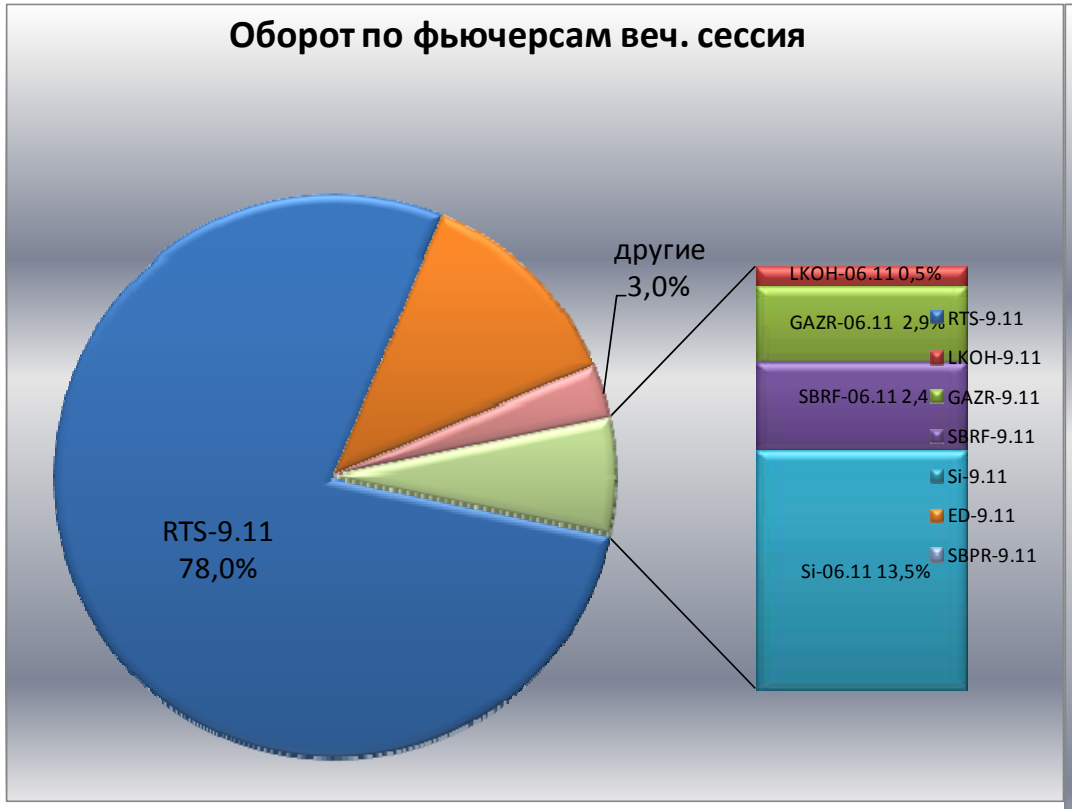
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	408	1674	2566	4752	15374	5534	7882	13578	18838	18348	9304	11306	4134	15322	1710	1284
OI Put	28	1080	1342	2794	3906	3764	5378	7270	38402	7000	5582	18256	6476	5222	536	38	342	168	2	0
IV	54,867	50,203	48,179	46,377	44,856	43,688	42,922	42,564	42,588	42,951	43,606	44,506	45,612	46,89	48,31	49,847	51,478	53,185	54,951	56,762

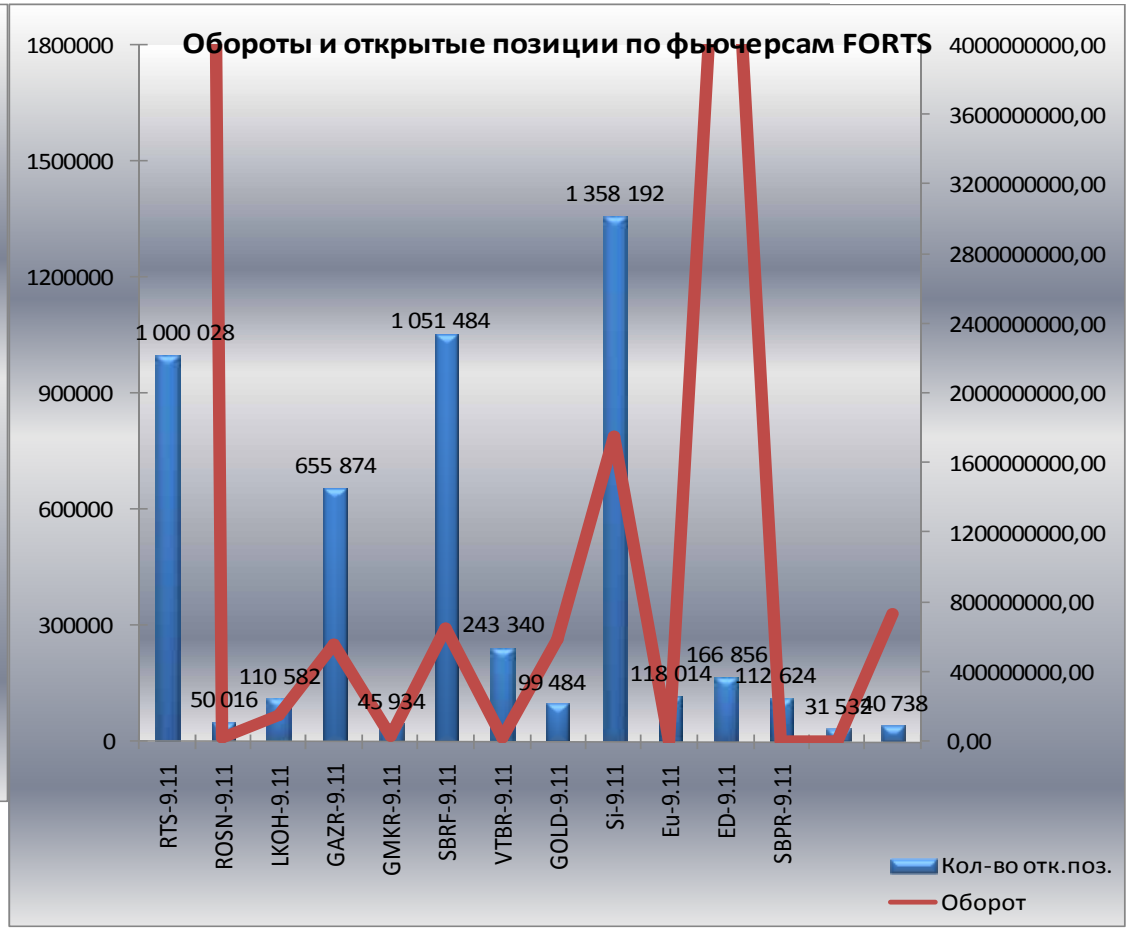


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	40	90	306	2248	2948	1880	1186	272	292	160	70
OI Put	0	4	4	14	350	26	890	1106	876	3708	5206	946	0	16	0	0	0
IV	48,836	46,766	45,008	43,663	42,48	42,62	43,168	44,054	45,215	46,598	48,159	49,862	51,675	53,572	55,532	57,535	59,566



	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	2128	3488	3128	1004	2434	3960	22296	23744	10504	3626	3890	5254	3330	4314	974
OI Put	400	922	458	1146	1190	5014	2848	5224	3076	24308	2312	79326	14966	1408	60	4	22	2	0	34
IV	59,355	54,583	52,481	50,526	48,709	47,048	45,596	44,413	43,55	43,023	42,82	42,911	43,261	43,834	44,595	45,515	46,571	47,74	49,003	50,344


Оборот по фьючерсам веч. сессия
другие
3,0%
RTS-9.11
78,0%
LKOH-06.11 0,5%
GAZR-06.11 2,9%
SBRF-06.11 2,4
Si-06.11 13,5%
RTS-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
SBRF-9.11
Si-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11


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
1 000 028
50 016
110 582
655 874
45 934
1 051 484
243 340
99 484
1 358 192
118 014
166 856
112 624
31 532
40 738
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