Понедельник: вероятность дальнейшего снижения ММВБ и РТС довольно высока

По итогам торгов рынки США закрылись с некоторым повышением, хотя торги начинались негативно: DJ Industrial вырос на +0,43% составив 11061,12 пункта, S&P 500 на +0,70% составив 1162,27 пункта. Рынки сохраняют тревожность относительно возможного греческого дефолта, к тому же рейтинговое агентство Moody's обещает понизить рейтинги трем крупнейшим французским банкам.

На данный момент Китай ведет переговоры с итальянским правительством о покупке долга. Европейская торговая сессия закрылась в минусе : CAC40 упал на –4,03% составив 2854,81 пункта, DAX30 на –2,27% составив 5072,33 пункта, FTSE100 на –1,63% составив 5129,62.

Что касается российского рынка, внутри дня наблюдалось внушительное падение, которое к вечерней сессии замедлилось. Газпром за вечернюю сессию изменился на +1,11%, составив 167,3 пункта, Лукойл на +0,87% остановившись на отметке 1735,50 пункта, Роснефть на +0,96% (220,29 пункта). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на +0,14% (30,33 пункта) и +0,09% (41,29 пункта).





	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	158590	1585,90	1,09	1 164 370	-0,52%	30 242 888 090	16,84%
ROSN-9.11	22029	220,29	0,96	33 456	-0,20%	7 590 835	0,87%
LKOH-9.11	17355	1735,50	0,87	102 964	-0,06%	82 188 287	4,10%
GAZR-9.11	16730	167,30	1,11	542 010	-0,15%	301 382 623	4,43%
GMKR-9.11	76275	7627,50	1,03	49 096	-0,06%	21 023 833	3,39%
SBRF-9.11	8051	80,51	1,09	975 868	0,01%	653 037 572	7,25%
VTBR-9.11	7362	0,0736	0,68	162 964	-0,09%	4 690 158	1,52%
GOLD-9.11	1818	1818,2000	-0,96	106 532	1,10%	663 966 363	13,07%
Si-9.11	30325	30,33	0,14	937 078	-2,50%	1 695 914 467	5,04%
Eu-9.11	41292	41,29	0,09	105 856	-0,02%	9 125 977	2,53%
ED-9.11	1,36	1,36	0,01	129 504	1,35%	1 737 875 067	19,47%
SBPR-9.11	6671	66,71	0,41	91 796	-0,31%	11 708 768	3,24%
RTSS-9.11	10250	10250,00	1,03	39 712	-0,08%	13 542 235	2,07%
BR-7.11	112	112,45	0,42	49 878	1,16%	447 824 639	25,66%

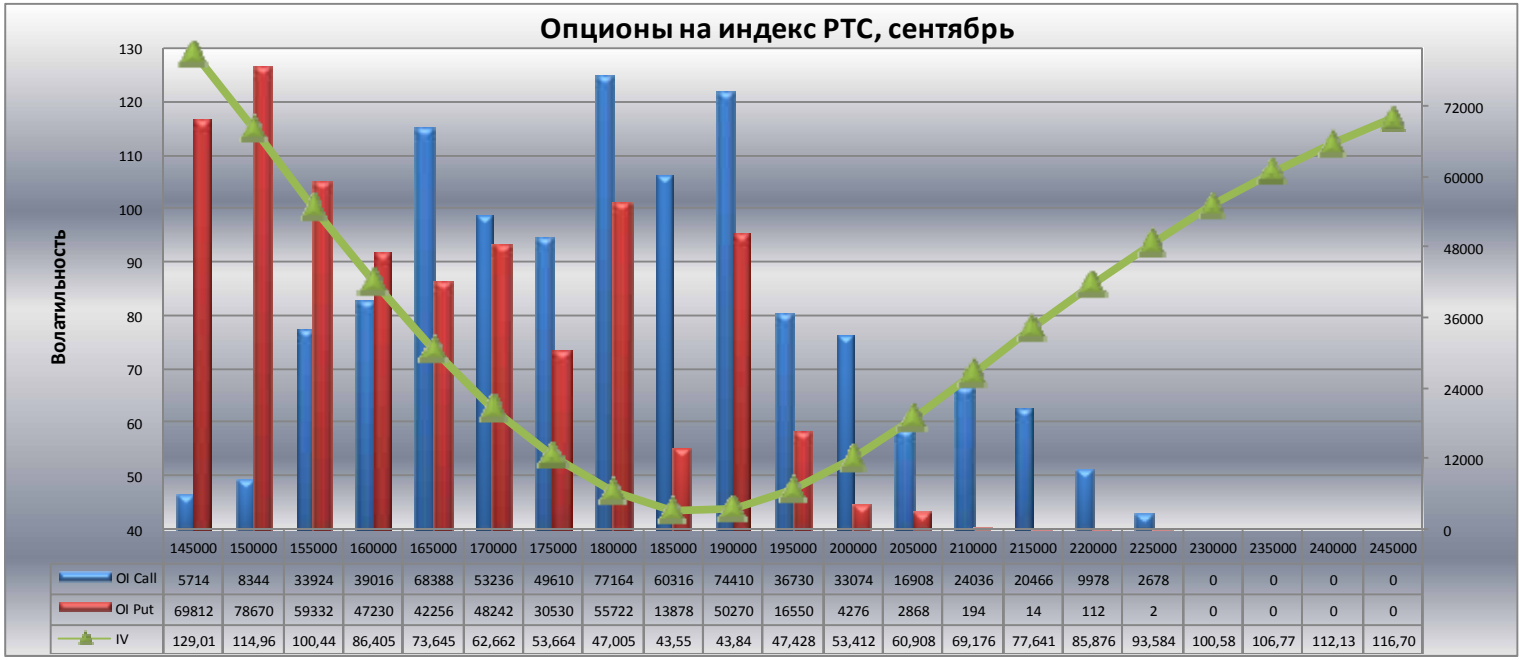
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55685,47	-0,17%	00:14:30
CAC 40	2854,81	-4,03%	19:35:20
DAX 30	5072,33	-2,27%	19:35:39
DJ Industrial	11061,12	0,63%	00:36:51
FTSE 100	5129,62	-1,63%	19:35:33
Hang Seng	19030,54	-4,21%	12:01:19
Nikkei 225	8614,77	0,93%	09:54:33
S&P 500	1162,27	0,70%	00:01:30
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:10:18
Gold	1825,1	0,63%	09:54:38
Palladium	712,39	1,61%	09:54:01
Platinum	1816	0,83%	09:54:26
RTSI	1 574,59	0,51%	23:50:00
RTS_Standard	10 201,04	0,60%	23:50:00
RTSI_DEREX	1607.31	-2.80%	18:45:00

Вечерняя сессия

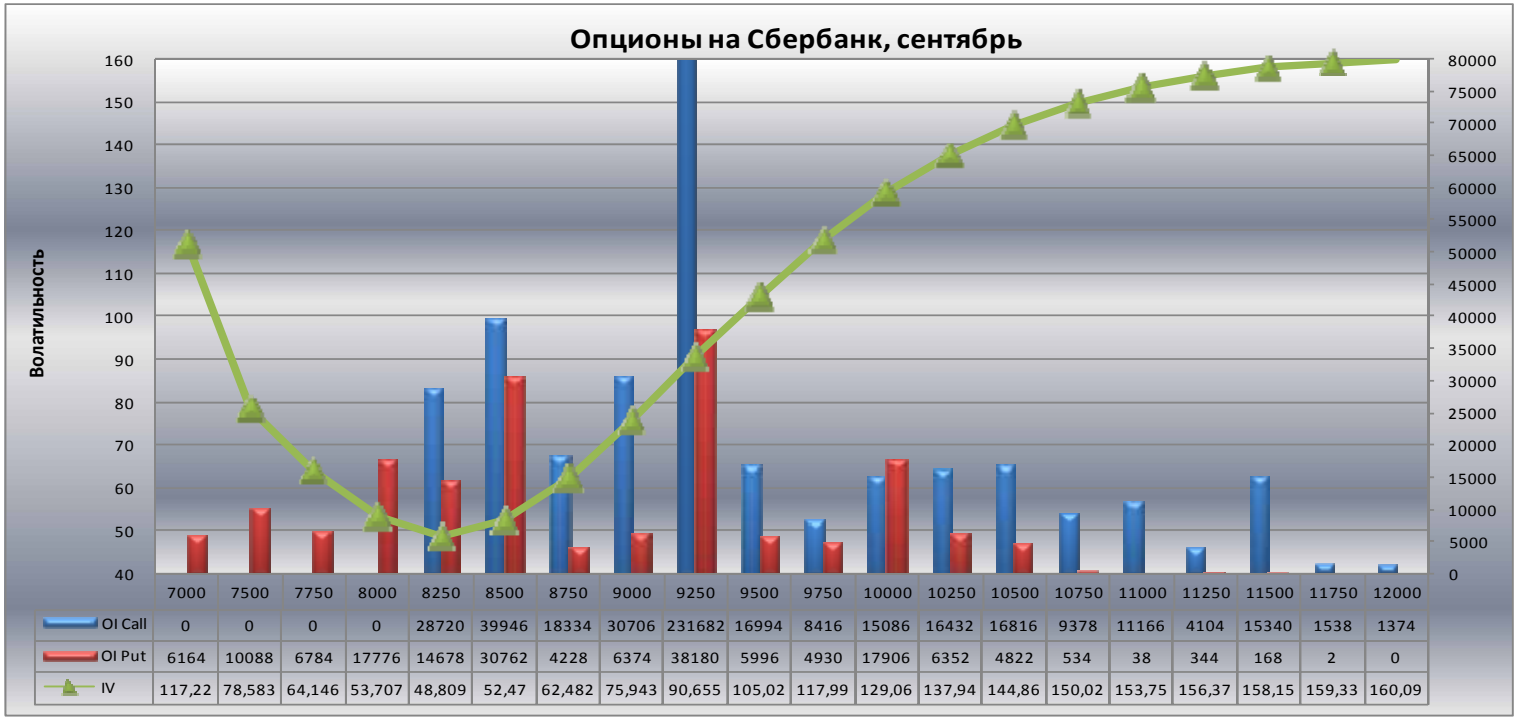
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	1,09	1164370	30242888089,77	158590
ROSN-9.11	0,96	33456	7590835,00	22029
LKOH-9.11	0,87	102964	82188287,00	17355
GAZR-9.11	1,11	542010	301382623,00	16730
GMKR-9.11	1,03	49096	21023833,00	76275
SBRF-9.11	1,09	975868	653037572,00	8051
VTBR-9.11	0,68	162964	4690158,00	7362
GOLD-9.11	-0,96	106532	663966363,41	1818,2
Si-9.11	0,14	937078	1695914467,00	30325
Eu-9.11	0,09	105856	9125977,00	41292
ED-9.11	0,01	129504	1737875067,39	1,3629
SBPR-9.11	0,41	91796	11708768,00	6671
RTSS-9.11	1,03	39712	13542235,00	10250
BR-7.11	0,42	49 878	447824638,91	112,45

Дневная сессия

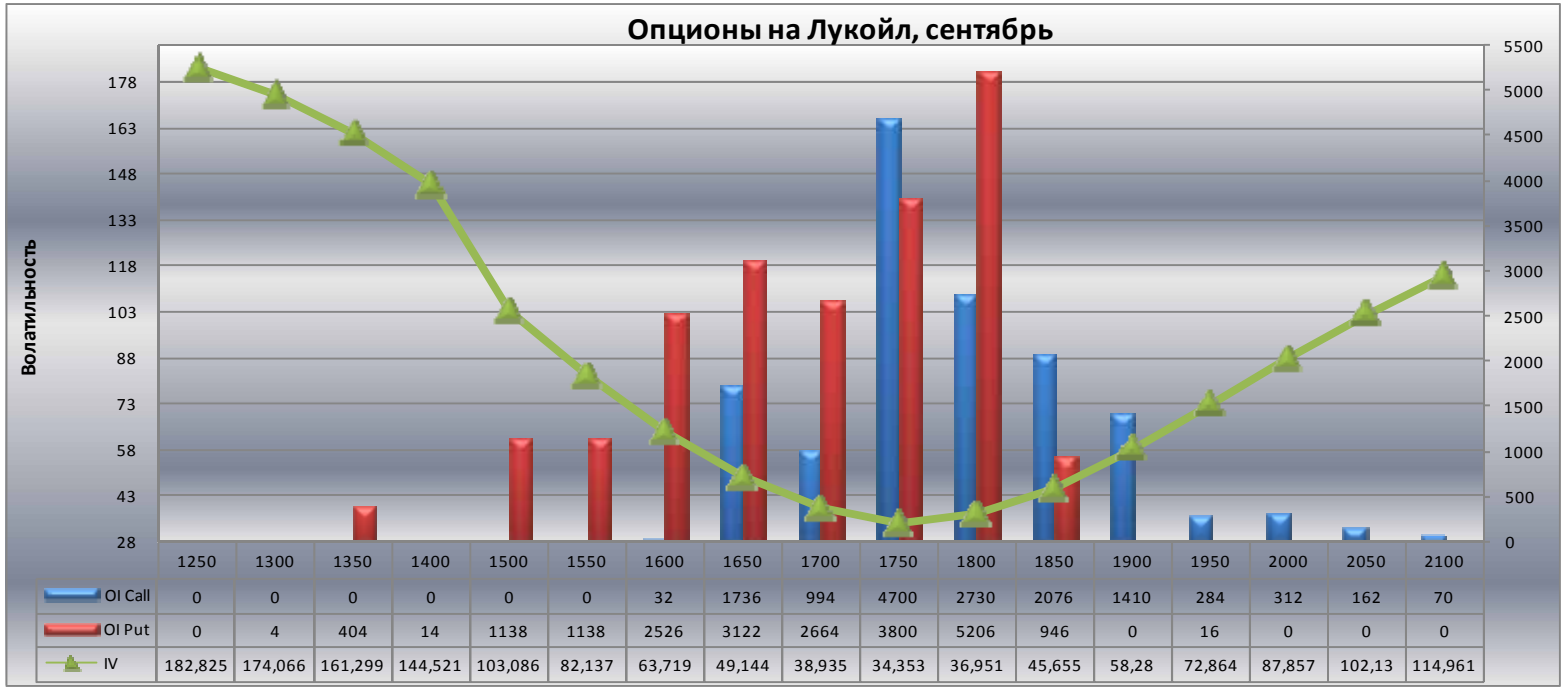
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-2,03	1170452	1,79625E+11	156885
ROSN-9.11	-1,4	33522	874897261	21819
LKOH-9.11	-0,38	103022	2005221496	17205
GAZR-9.11	-2,11	542836	6795863346	16547
GMKR-9.11	2,18	49124	619916098	75500
SBRF-9.11	-4,27	975784	9013051575	7963
VTBR-9.11	-2,26	163110	308705663	7306
GOLD-9.11	-0,76	105368	5081065406	1835,9
Si-9.11	1,17	961076	33659735415	30283
Eu-9.11	0,42	105874	360501301	41255
ED-9.11	-0,69	127776	8927943426	1,3628
SBPR-9.11	-4,53	92084	361222610	6644
RTSS-9.11	-1,47	39742	655299135	10141
BR-7.11	-0,64	49308	1745011376	111,98



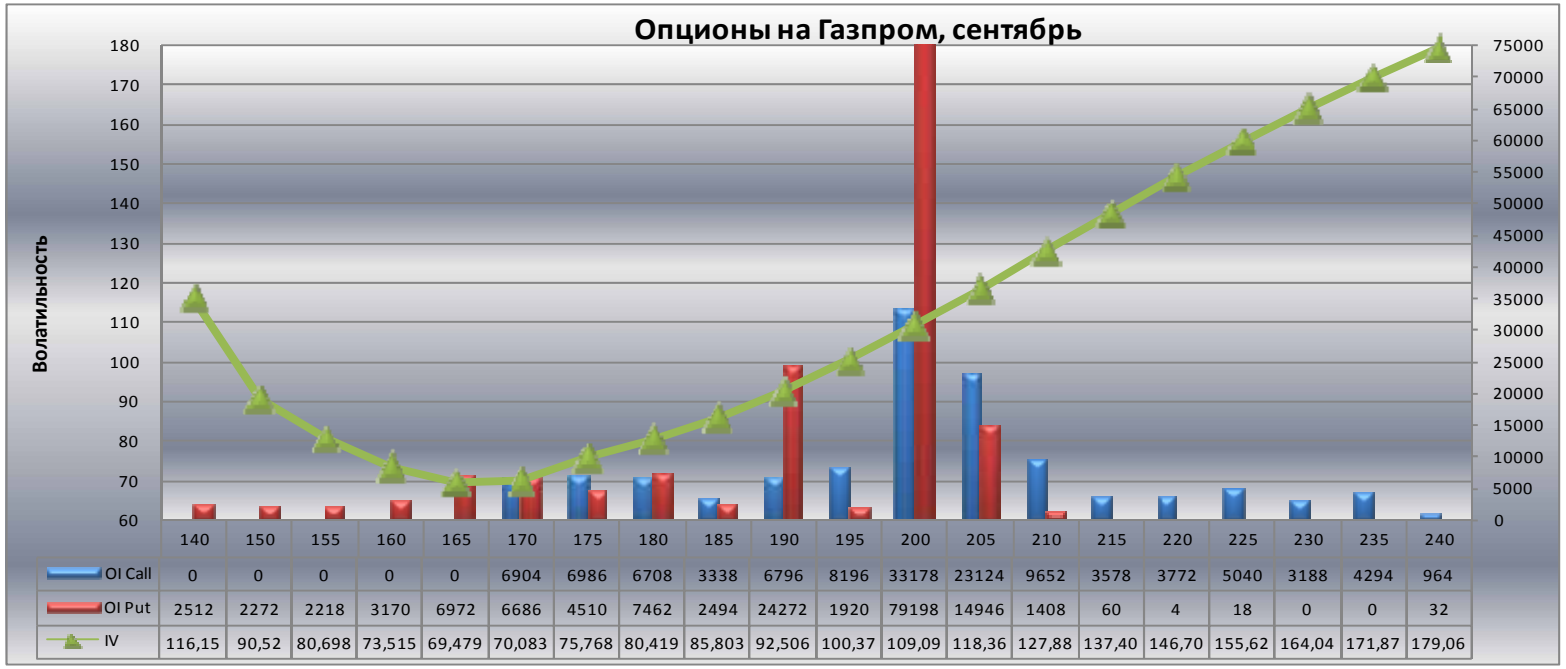
	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000
OI Call	5714	8344	33924	39016	68388	53236	49610	77164	60316	74410	36730	33074	16908	24036	20466	9978	2678	0	0	0	0
OI Put	69812	78670	59332	47230	42256	48242	30530	55722	13878	50270	16550	4276	2868	194	14	112	2	0	0	0	0
IV	129,01	114,96	100,44	86,405	73,645	62,662	53,664	47,005	43,55	43,84	47,428	53,412	60,908	69,176	77,641	85,876	93,584	100,58	106,77	112,13	116,70



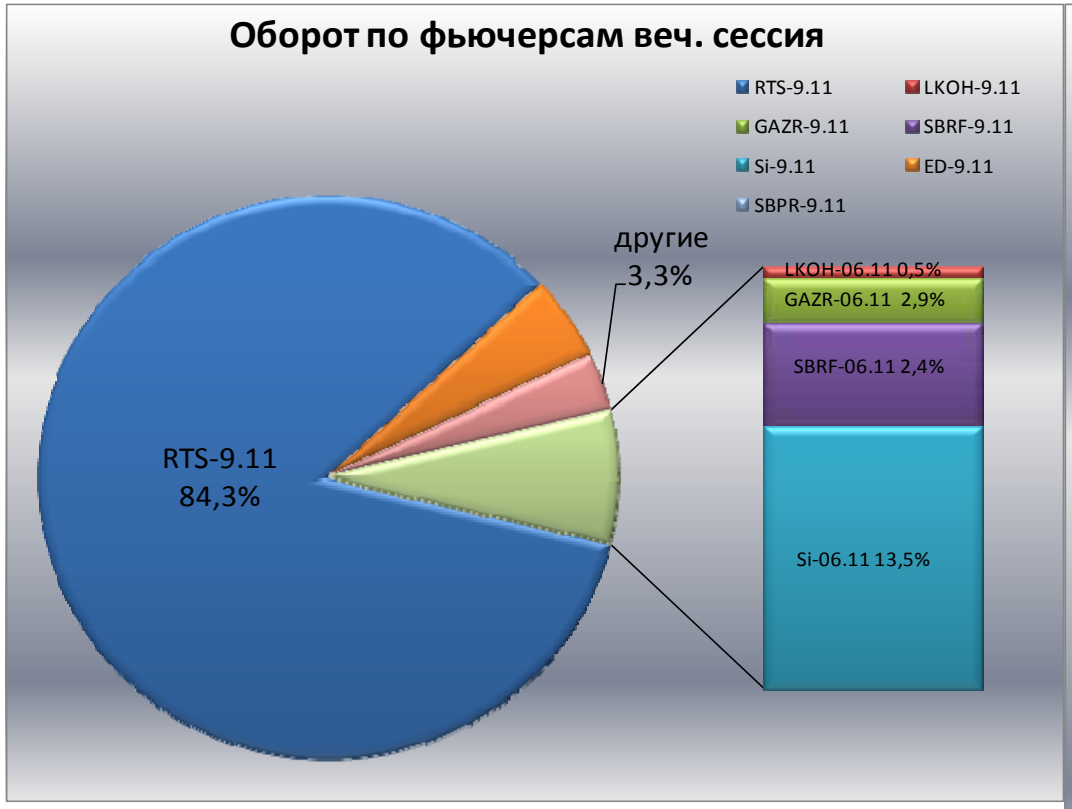
	7000	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	28720	39946	18334	30706	231682	16994	8416	15086	16432	16816	9378	11166	4104	15340	1538	1374
OI Put	6164	10088	6784	17776	14678	30762	4228	6374	38180	5996	4930	17906	6352	4822	534	38	344	168	2	0
IV	117,22	78,583	64,146	53,707	48,809	52,47	62,482	75,943	90,655	105,02	117,99	129,06	137,94	144,86	150,02	153,75	156,37	158,15	159,33	160,09

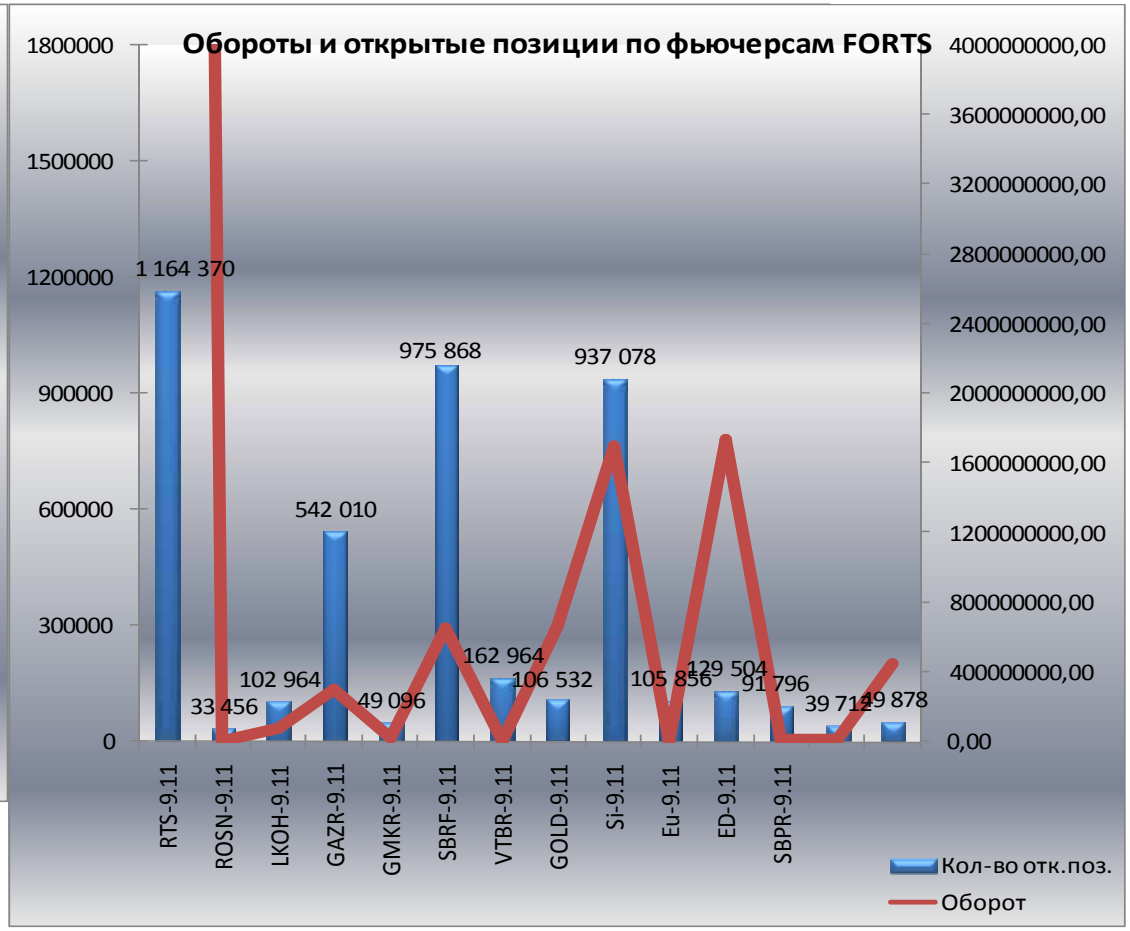


	1250	1300	1350	1400	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100
OI Call	0	0	0	0	0	0	32	1736	994	4700	2730	2076	1410	284	312	162	70
OI Put	0	4	404	14	1138	1138	2526	3122	2664	3800	5206	946	0	16	0	0	0
IV	182,825	174,066	161,299	144,521	103,086	82,137	63,719	49,144	38,935	34,353	36,951	45,655	58,28	72,864	87,857	102,13	114,961



	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	6904	6986	6708	3338	6796	8196	33178	23124	9652	3578	3772	5040	3188	4294	964
OI Put	2512	2272	2218	3170	6972	6686	4510	7462	2494	24272	1920	79198	14946	1408	60	4	18	0	0	32
IV	116,15	90,52	80,698	73,515	69,479	70,083	75,768	80,419	85,803	92,506	100,37	109,09	118,36	127,88	137,40	146,70	155,62	164,04	171,87	179,06


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
3,3%
RTS-9.11
84,3%
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
1 164 370
33 456
102 964
542 010
49 096
975 868
162 964
106 532
937 078
105 856
129 504
91 796
39 712
49 878
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