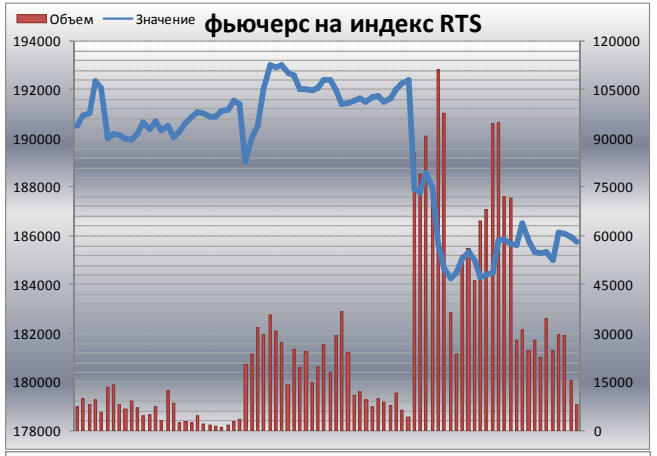
Дневное падение, вечерний боковик.

Российские площадки во вторник в дневную сессию совершили падение, они находились во власти негативных настроений, цены падали при поддержке мировых индексов, ближе к концу сессии цены продолжили падение на фоне открытия американских рынков в минусе, в вечернюю сессию превалировали нейтральные настроения. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –1.15% и –1.12%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 2.59% до уровня в 1888,20 пункта.

На вечерних торгах господствовали в целом нейтральные тенденции. Июньский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,09%. Апрельские фьючерсы на Brent упали на 0.96%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял слабым движением котировок, в результате произошло положительное движение котировок нефтегазовых компаний, июньские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на +0,19% и +0,71%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в марте двинулись на -0,09% и +0,31%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.09% и +0.32%. Это произошло на фоне движения мартовских контрактов на золото на +0.04%.





	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-6.11	185770	1857,70	0,09	425 802	-10,89%	26 635 030 228	19,95%
ROSN-6.11	25000	250,00	0,24	19 610	-46,85%	11 098 387	3,25%
LKOH-6.11	19110	1911,00	0,71	129 632	103,74%	98 758 591	8,29%
GAZR-6.11	21743	217,43	0,19	393 096	42,27%	666 011 813	10,94%
GMKR-6.11	69627	6962,70	0,39	27 794	1,38%	33 100 950	4,02%
SBRF-6.11	9570	95,70	-0,09	710 620	33,93%	533 274 300	9,00%
VTBR-6.11	9200	0,0920	0,32	118 626	23,81%	18 364 858	5,36%
GOLD-6.11	1398	1398,1000	0,04	82 166	533,12%	324 328 788	15,60%
Si-6.11	28960	28,96	-0,09	730 084	450,38%	663 383 530	4,66%
Eu-6.11	40494	40,49	0,31	94 854	185,69%	12 134 717	3,59%
ED-6.11	1,40	1,40	0,29	142 536	111,66%	1 122 926 958	17,72%
SBPR-6.11	6616	66,16	-0,06	111 920	56,55%	2 953 955	1,32%
RTSS-6.11	11537	11536,50	0,06	5 236	144,72%	22 344 590	5,35%
BR-4.11	109	108,99	-0,96	22 794	65,67%	455 075 466	25,53%

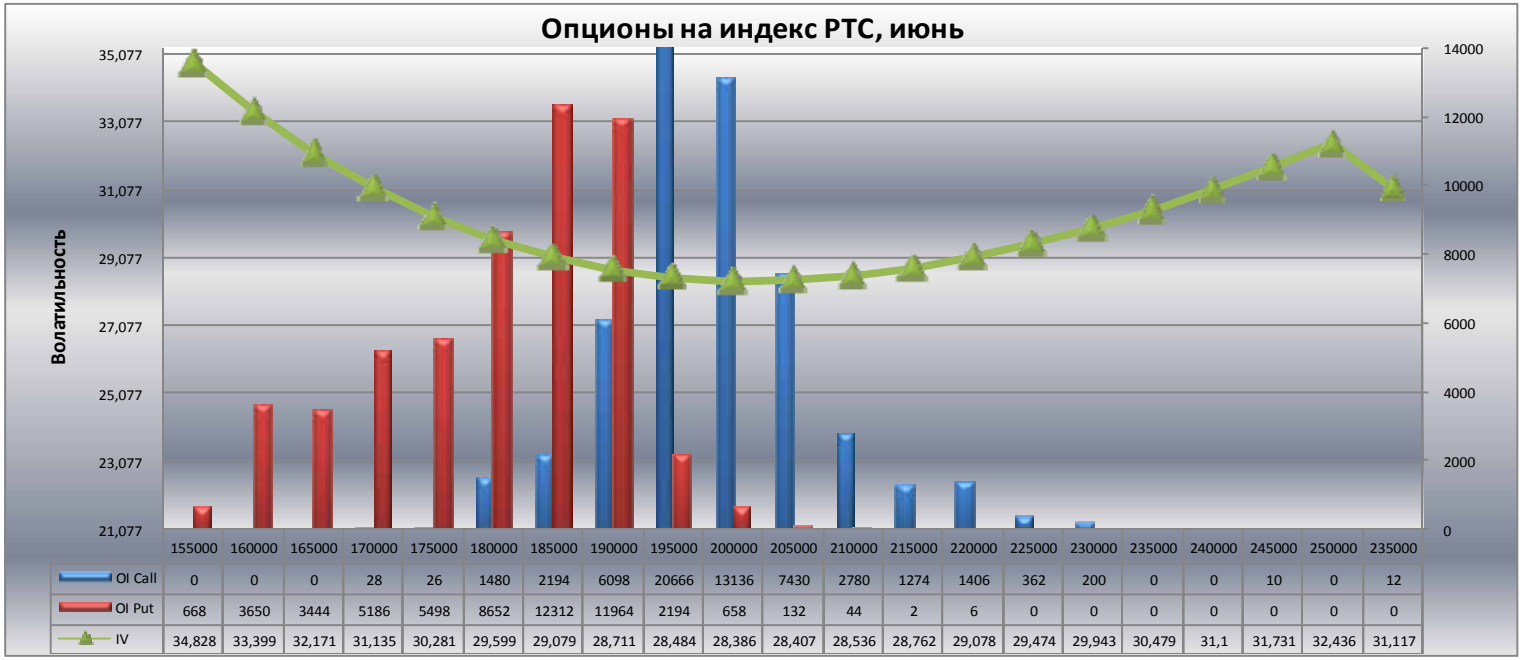
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	67005,22	-0,24%	23:13:31
CAC 40	3780,85	-2,51%	19:35:17
DAX 30	6647,66	-3,19%	19:35:32
DJ Industrial	11855,42	-1,15%	23:44:03
FTSE 100	5695,28	-1,38%	19:35:12
Hang Seng	22725,79	0,21%	10:21:02
Nikkei 225	9093,72	5,68%	09:00:06
S&P 500	1281,87	-1,12%	23:02:49
Brent Crude Oil 0411	109,43	0,84%	10:21:03
Gold	1401,63	0,44%	10:21:08
Palladium	707	0,43%	10:19:05
Platinum	1690,5	-0,16%	10:20:54
RTSI	1 912,34	0,29%	23:50:00
RTS_Standard	11 661,03	0,27%	23:50:00
RTSI_DEREX	1888.20	-2,59%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,09	425802	26635030227,92	185770
ROSN-6.11	0,24	19610	11098387,00	25000
LKOH-6.11	0,71	129632	98758591,00	19110
GAZR-6.11	0,19	393096	666011813,00	21743
GMKR-6.11	0,39	27794	33100950,00	69627
SBRF-6.11	-0,09	710620	533274300,00	9570
VTBR-6.11	0,32	118626	18364858,00	9200
GOLD-6.11	0,04	82166	324328788,38	1398,1
Si-6.11	-0,09	730084	663383530,00	28960
Eu-6.11	0,31	94854	12134717,00	40494
ED-6.11	0,29	142536	1122926957,70	1,3971
SBPR-6.11	-0,06	111920	2953955,00	6616
RTSS-6.11	0,06	5236	22344590,00	11536,5
BR-4.11	-0,96	22794	455075466,09	108,99

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-3.11	0,81	477844	133477501945,65	193500
ROSN-3.11	0,68	36894	341572150,00	25605
LKOH-3.11	-0,85	63626	1192010205,00	19799
GAZR-3.11	3,35	276294	6089206429,00	21622
GMKR-3.11	1,93	27416	823061977,00	68966
SBRF-3.11	-1,73	530598	5925110887,00	9695
VTBR-3.11	-1,41	95816	342598661,00	9298
GOLD-3.11	0,81	12978	2079522676,26	1426,8
Si-3.11	-0,52	132652	14224747887,00	28538
Eu-3.11	0,38	33202	338262527,00	39860
ED-3.11	1	67342	6336023940,15	1,397
SBPR-3.11	-1,37	71490	223148409,00	6691
RTSS-3.11	0,37	3618	418031990,00	11769,5
BR-3.11	-0,72	34712	1782498866,15	113,22

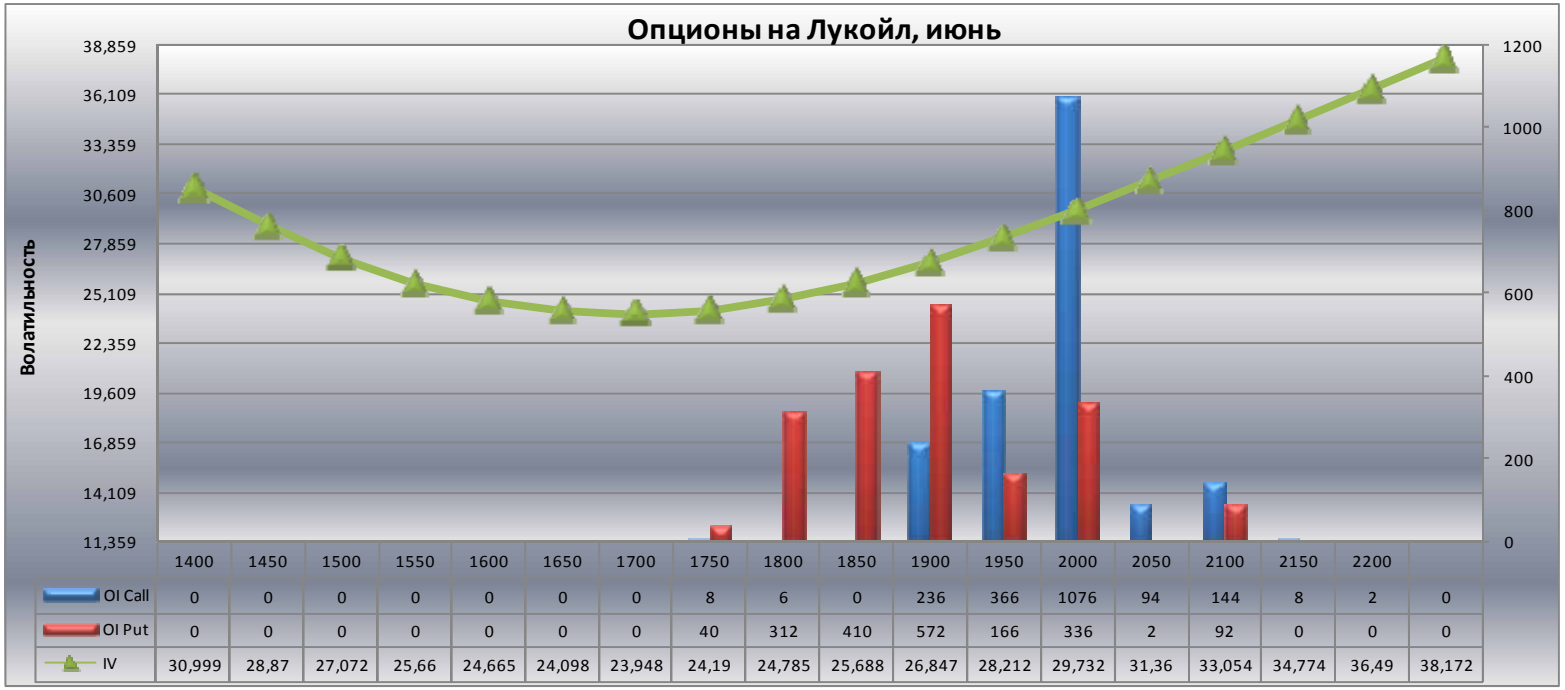


	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000	250000	235000
OI Call	0	0	0	28	26	1480	2194	6098	20666	13136	7430	2780	1274	1406	362	200	0	0	10	0	12
OI Put	668	3650	3444	5186	5498	8652	12312	11964	2194	658	132	44	2	6	0	0	0	0	0	0	0
IV	34,828	33,399	32,171	31,135	30,281	29,599	29,079	28,711	28,484	28,386	28,407	28,536	28,762	29,078	29,474	29,943	30,479	31,1	31,731	32,436	31,117



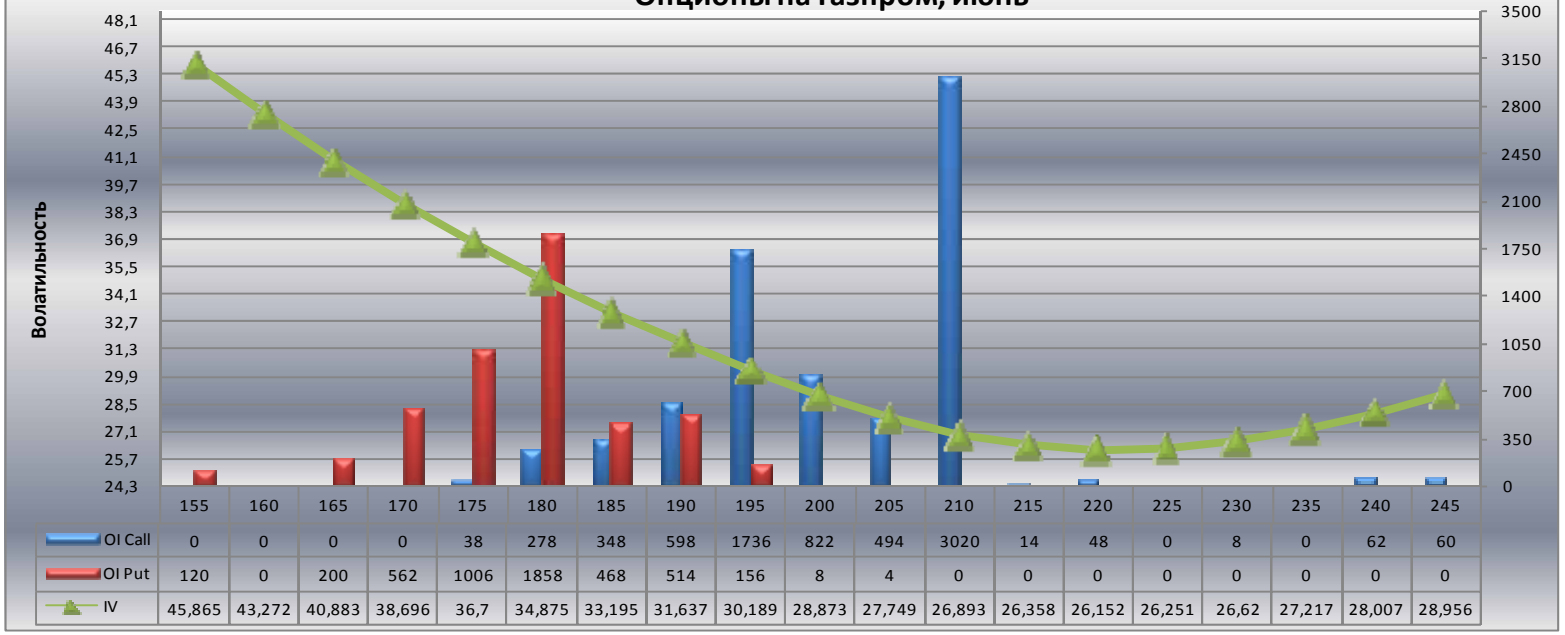
	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	4	34	40	466	3850	834	1048	1234	332	1904	0	0	0
OI Put	0	0	0	82	100	18	22	710	676	1274	1646	3950	1444	38	4	0	0	0	0	0
IV	39,322	39,238	39,151	39,063	38,971	38,877	38,78	38,68	38,577	38,47	38,36	38,246	38,128	38,005	37,878	37,747	37,61	37,469	37,321	37,168

Опционы на Лукойл, июнь

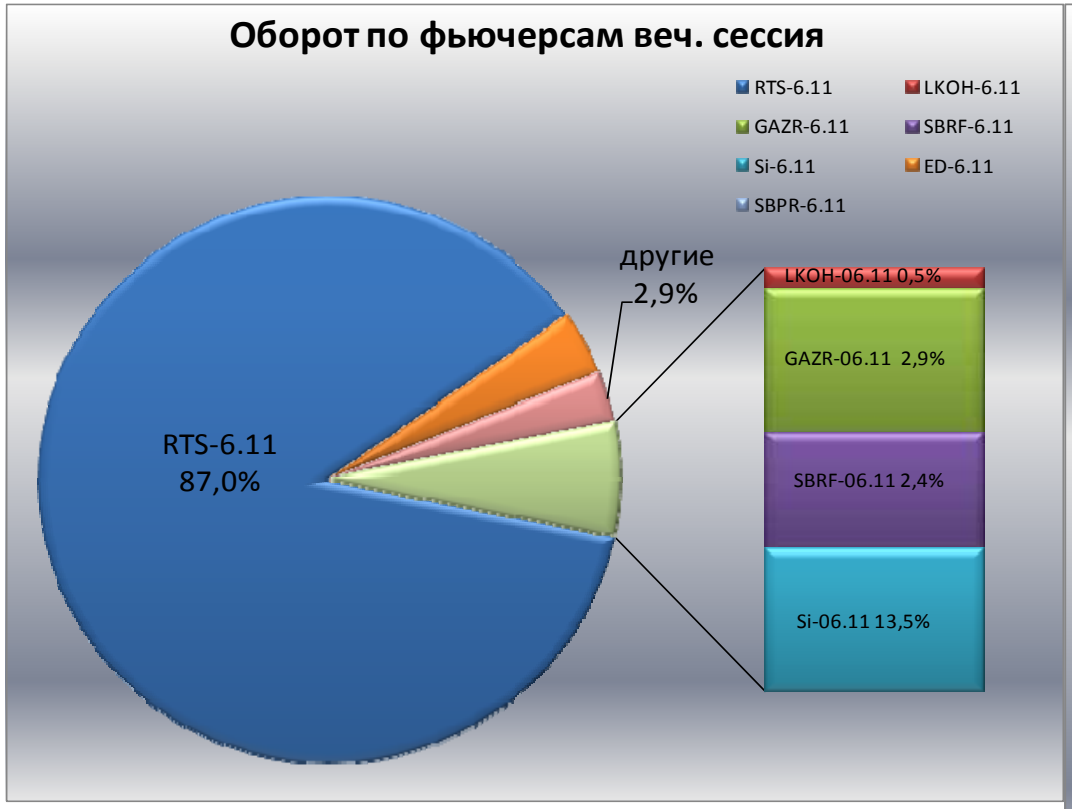


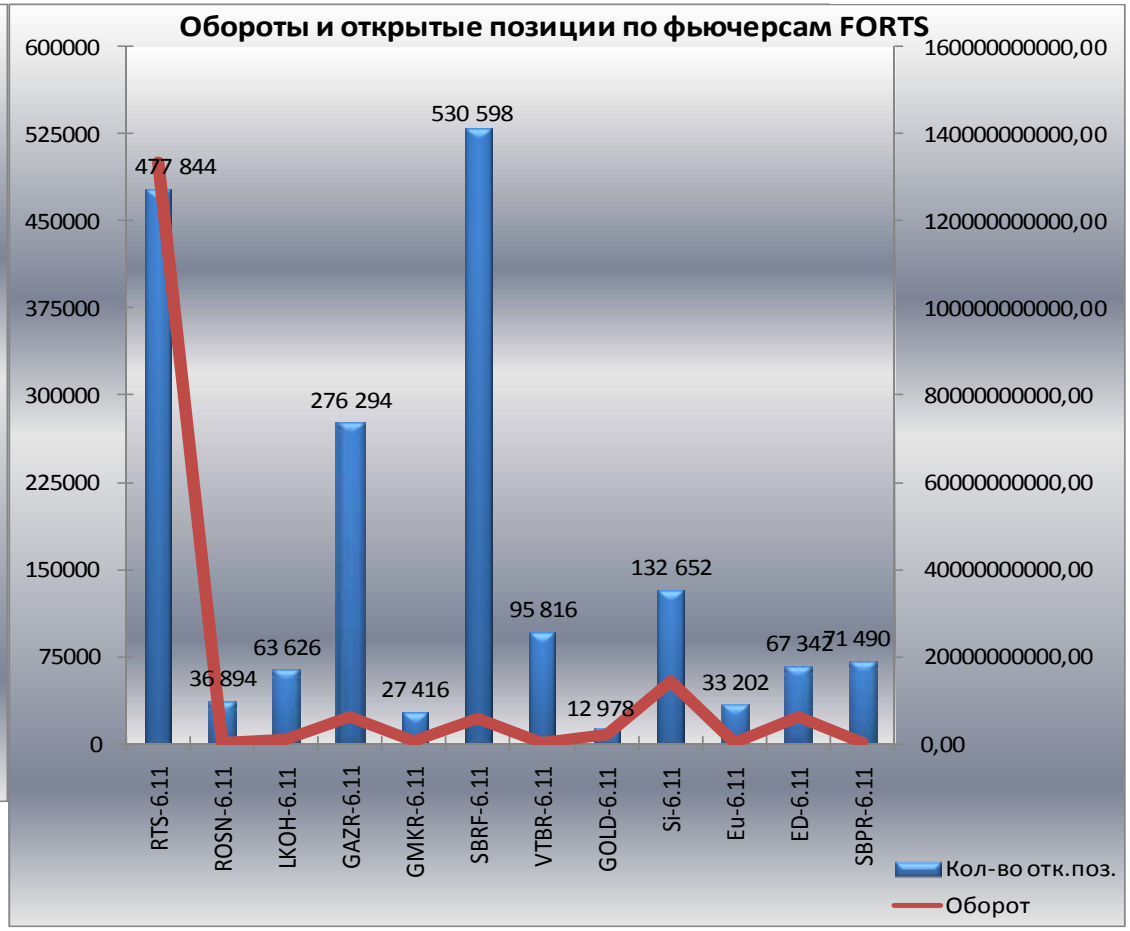
	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2150	2200	
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	8	6	0	236	366	1076	94	144	8	2	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	40	312	410	572	166	336	2	92	0	0	0
IV	30,999	28,87	27,072	25,66	24,665	24,098	23,948	24,19	24,785	25,688	26,847	28,212	29,732	31,36	33,054	34,774	36,49	38,172

Опционы на Газпром, июнь



	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240	245
OI Call	0	0	0	0	38	278	348	598	1736	822	494	3020	14	48	0	8	0	62	60
OI Put	120	0	200	562	1006	1858	468	514	156	8	4	0	0	0	0	0	0	0	0
IV	45,865	43,272	40,883	38,696	36,7	34,875	33,195	31,637	30,189	28,873	27,749	26,893	26,358	26,152	26,251	26,62	27,217	28,007	28,956


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-6.11
LKOH-6.11
GAZR-6.11
SBRF-6.11
Si-6.11
ED-6.11
SBPR-6.11
RTS-6.11
87,0%
другие
2,9%
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
600000
525000
450000
375000
300000
225000
150000
75000
0
160000000000,00
140000000000,00
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
477 844
36 894
63 626
276 294
27 416
530 598
95 816
12 978
132 652
33 202
67 342
71 490
RTS-6.11
ROSN-6.11
LKOH-6.11
GAZR-6.11
GMKR-6.11
SBRF-6.11
VTBR-6.11
GOLD-6.11
Si-6.11
Eu-6.11
ED-6.11
SBPR-6.11
Кол-во отк.поз.
Оборот