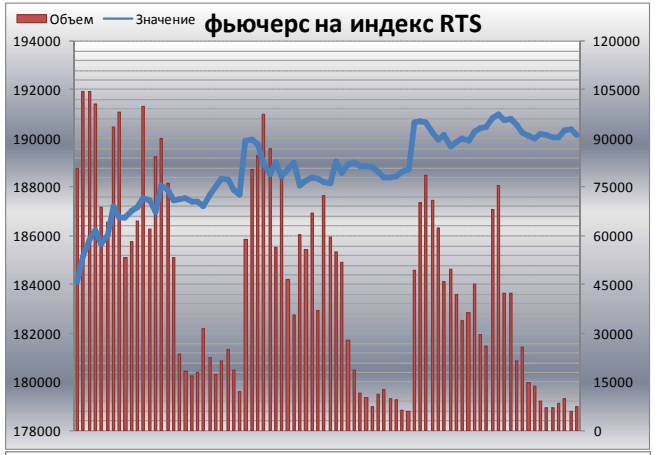
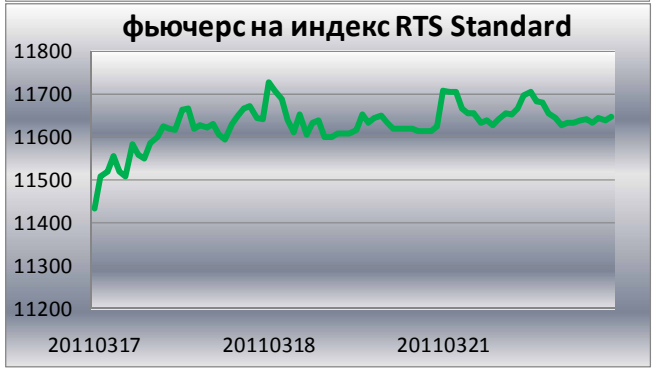
Дневной рост, вечерний боковик.

Российские площадки в понедельник в дневную сессию совершили рост, они находились во власти позитивных настроений, цены росли при поддержке мировых индексов, ближе к концу сессии цены продолжили рост на фоне открытия американских рынков в плюсе, в вечернюю сессию превалировали нейтральные настроения. В итоге американские индексы Dow-Jones и S&P изменились к закрытию на +1.50% и +1.50%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 1.01% до уровня в 1981,08 пункта.

На вечерних торгах господствовали в целом нейтральные тенденции. Июньский фьючерс на индекс РТС упал на 0,22%. Апрельские фьючерсы на Brent упали на 0.31%, так что котировкам нефтегазовых компаний былf оказано поддержки, что рынок воспринял слабым движением котировок, в результате произошло отрицательное движение котировок нефтегазовых компаний, июньские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,02% и -0,33%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в марте двинулись на +0,01% и +0,17%, на что было не обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.05% и +0.10%. Это произошло на фоне движения июньских контрактов на золото на -0.26%.





	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	190545	1905,45	-0,22	696 292	-4,05%	13 165 362 603	12,20%
ROSN-6.11	25582	255,82	-0,11	25 990	-0,57%	4 266 779	1,69%
LKOH-6.11	19812	1981,20	-0,33	155 088	-0,09%	26 505 058	2,90%
GAZR-6.11	22130	221,30	-0,02	386 694	-0,39%	156 921 691	2,77%
GMKR-6.11	71308	7130,80	-0,49	29 672	-0,46%	16 742 146	5,57%
SBRF-6.11	10090	100,90	-0,05	797 464	0,61%	311 263 475	3,98%
VTBR-6.11	9464	0,0946	0,10	148 062	0,04%	11 749 698	3,67%
GOLD-6.11	1436	1435,5000	-0,26	81 132	-4,29%	215 337 450	15,13%
Si-6.11	28462	28,46	0,01	862 684	-0,27%	297 155 375	3,15%
Eu-6.11	40340	40,34	0,17	95 112	-0,18%	11 229 827	2,35%
ED-6.11	1,42	1,42	0,18	196 926	-3,57%	2 000 215 542	36,33%
SBPR-6.11	6995	69,95	-0,07	111 354	-0,02%	1 887 107	1,47%
RTSS-6.11	11657	11657,00	-0,07	7 346	99,86%	13 510 415	5,67%
BR-4.11	115	115,13	-0,31	49 048	103,94%	350 982 951	15,42%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	66689,61	-0,28%	23:14:31
CAC 40	3904,45	2,47%	19:35:17
DAX 30	6816,12	2,28%	19:35:30
DJ Industrial	12036,53	1,50%	00:07:12
FTSE 100	5786,09	1,19%	19:35:12
Hang Seng	22858,35	0,76%	09:56:32
Nikkei 225	9608,32	4,36%	09:00:03
S&P 500	1298,38	1,50%	23:02:16
Brent Crude Oil 0411	110,62	0,00%	01:02:32
Gold	1427,63	0,06%	09:56:32
Palladium	742,5	-0,27%	09:56:34
Platinum	1737,25	-0,27%	09:56:32
RTSI	1 981,86	-0,01%	23:50:00
RTS_Standard	11 958,53	-0,15%	23:50:00
RTSI_DEREX	1981.08	1,01%	18:45:00

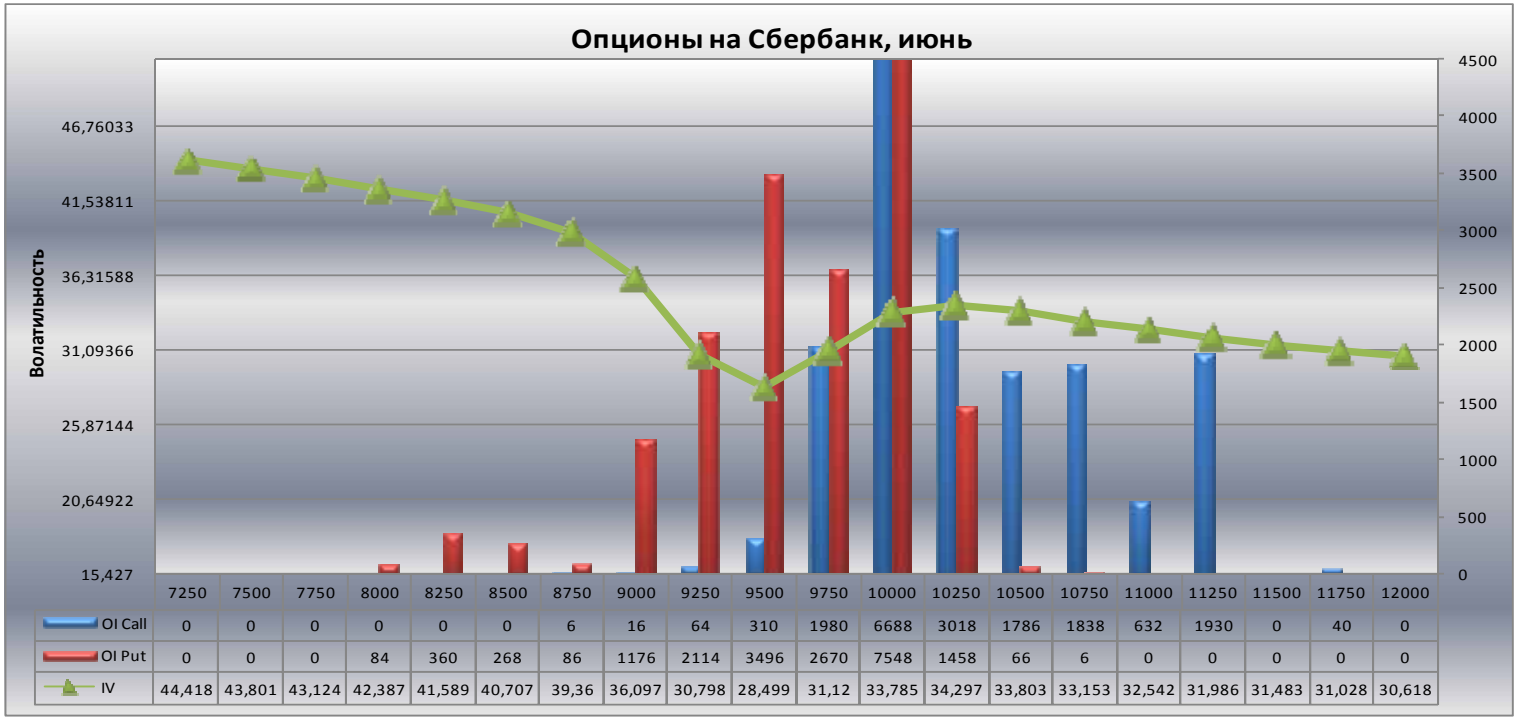
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	-0,22	696292	107916254628,68	190135
ROSN-6.11	-0,11	25990	252424747,00	25553
LKOH-6.11	-0,33	155088	913254039,00	19744
GAZR-6.11	-0,02	386694	5660177967,00	22125
GMKR-6.11	-0,49	29672	300843511,00	70960
SBRF-6.11	-0,05	797464	7811690516,00	10085
VTBR-6.11	0,1	148062	320386779,00	9473
GOLD-6.11	-0,26	81132	1423251084,54	1431,7
Si-6.11	0,01	862684	9434607914,00	28466
Eu-6.11	0,17	95112	478723579,00	40409
ED-6.11	0,18	196926	5505680301,36	1,4193
SBPR-6.11	-0,07	111354	128440162,00	6990
RTSS-6.11	-0,07	7346	238097760,00	11649
BR-4.11	-0,31	49048	2275927782,41	114,77

Дневная сессия

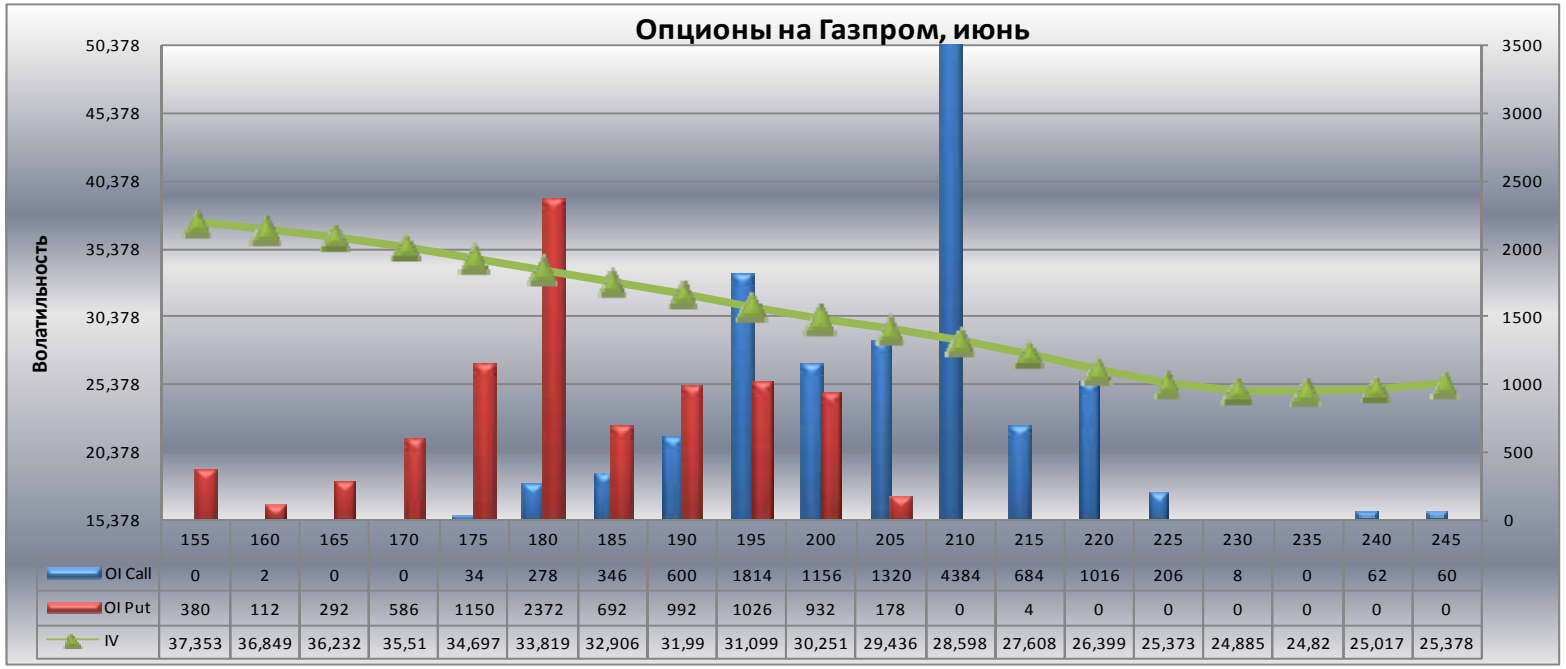
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,83	725670	13165362603	190545
ROSN-6.11	0,41	26138	4266779	25582
LKOH-6.11	0,12	155228	26505058	19812
GAZR-6.11	-0,69	388212	156921691	22130
GMKR-6.11	0,9	29808	16742146	71308
SBRF-6.11	0,31	792612	311263475	10090
VTBR-6.11	1,41	147998	11749698	9464
GOLD-6.11	0,71	84770	215337450,5	1435,5
Si-6.11	-0,84	865052	297155375	28462
Eu-6.11	-0,4	95280	11229827	40340
ED-6.11	0,38	204222	2000215542	1,4167
SBPR-6.11	1,07	111380	1887107	6995
RTSS-6.11	0,1	7356	13510415	11657
BR-4.11	0,47	47190	350982951,2	115,13


Опционы на индекс РТС, июнь
Волатильность
54,54
50,94
47,34
43,74
40,14
36,54
32,94
29,34
25,74
22,14
18,54
25000
20000
15000
10000
5000
0
155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000 250000 235000
OI Call 0 2 2 672 1120 2840 6158 12024 22842 21112 13914 11962 2668 5350 408 604 52 0 10 0 12
OI Put 3358 15498 37634 22232 26552 22128 24344 14540 4188 1562 210 84 2 6 0 0 0 0 0 0 0
IV 49,635 46,186 43,033 40,179 37,622 35,358 33,379 31,675 30,237 29,05 28,1 27,367 26,82 26,381 25,767 25,33 25,42 25,756 26,26 26,903 27,667

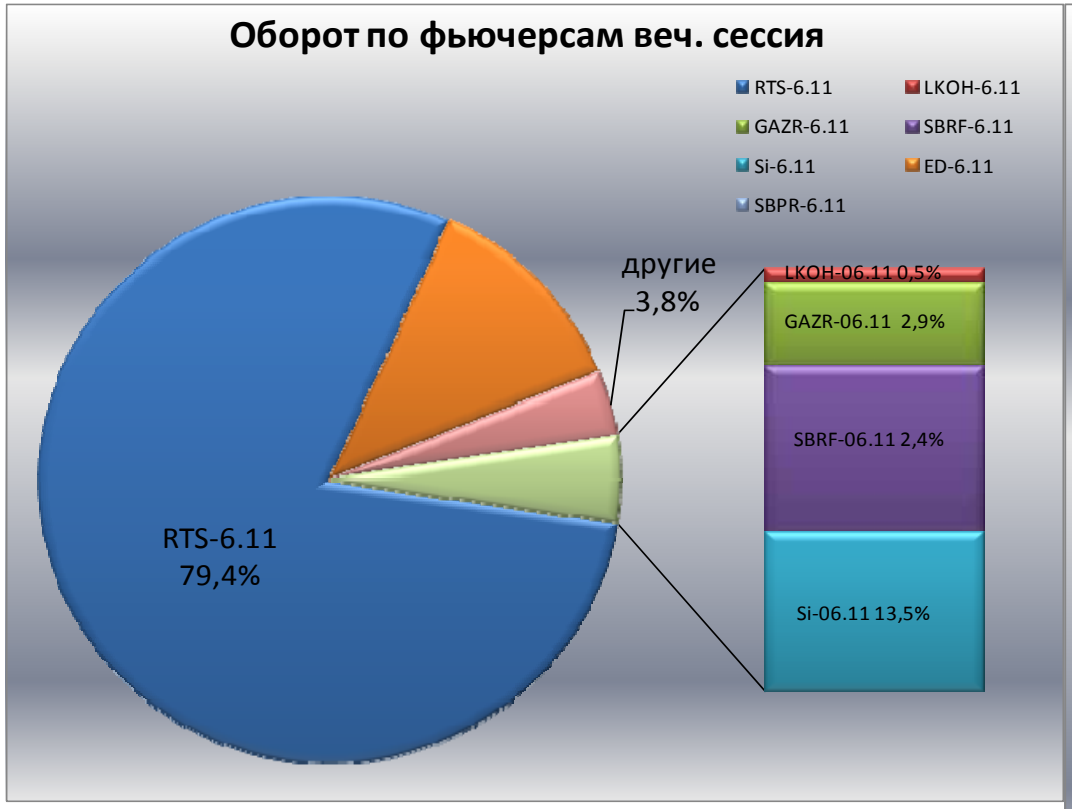

Опционы на Сбербанк, июнь
Волатильность
46,76033
41,53811
36,31588
31,09366
25,87144
20,64922
15,427
4500
4000
3500
3000
2500
2000
1500
1000
500
0
7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 0 0 6 16 64 310 1980 6688 3018 1786 1838 632 1930 0 40 0
OI Put 0 0 0 84 360 268 86 1176 2114 3496 2670 7548 1458 66 6 0 0 0 0 0
IV 44,418 43,801 43,124 42,387 41,589 40,707 39,36 36,097 30,798 28,499 31,12 33,785 34,297 33,803 33,153 32,542 31,986 31,483 31,028 30,618

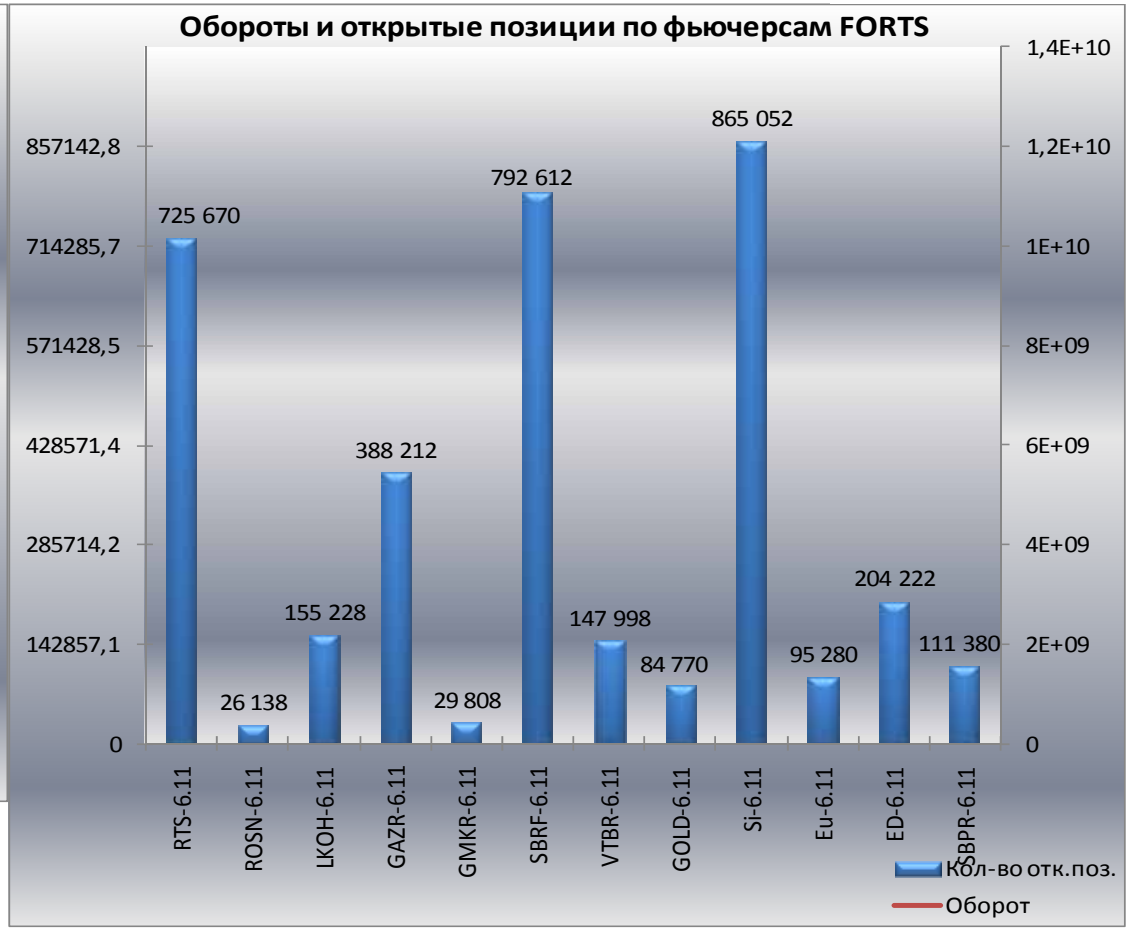


	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2150	2200	
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	14	10	0	234	368	3312	662	198	8	4	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	46	312	438	592	174	388	2	52	0	0	0
IV	44,347	41,405	38,752	36,385	34,299	32,486	30,935	29,634	28,571	27,726	27,076	26,573	26,075	25,445	25,245	25,419	25,805	26,348



	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240	245
OI Call	0	2	0	0	34	278	346	600	1814	1156	1320	4384	684	1016	206	8	0	62	60
OI Put	380	112	292	586	1150	2372	692	992	1026	932	178	0	4	0	0	0	0	0	0
IV	37,353	36,849	36,232	35,51	34,697	33,819	32,906	31,99	31,099	30,251	29,436	28,598	27,608	26,399	25,373	24,885	24,82	25,017	25,378


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
79,4%
другие
3,8%
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
857142,8
714285,7
571428,5
428571,4
285714,2
142857,1
0
1,4E+10
1,2E+10
1E+10
8E+09
6E+09
4E+09
2E+09
0
725 670
26 138
155 228
388 212
29 808
792 612
147 998
84 770
865 052
95 280
204 222
111 380
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