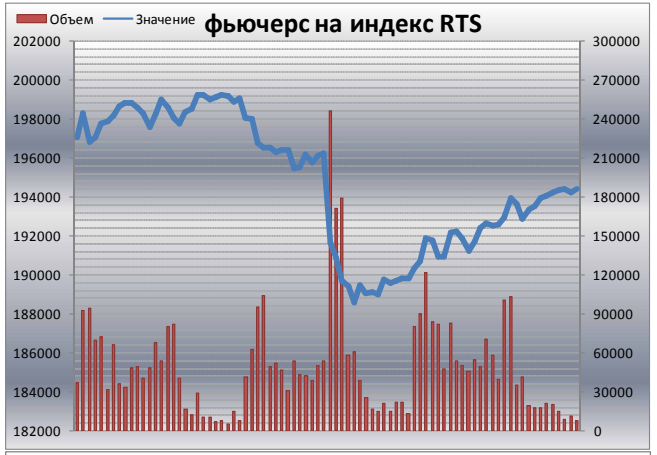
Восстановление после падения

Российские площадки во вторник в дневную и вечернюю сессии подросли на значительную величину, почти отыграв падение понедельника, вызванное понижением S&P кредитного рейтинга США. Во вторник цены росли при поддержке американских да и в целом мировых рынков. Американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на +0.53% и +0.57%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 2.04% до уровня в 1976,54 пункта.

На вечерних торгах господствовали в целом позитивные тенденции. Июньский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,38%. Майские фьючерсы на Brent подросли на 0.88%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял несильным движением котировок нефтегазовых компаний вверх вместе с рынком, июньские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на +0,39% и +0,24%. Контракты на валютные пары доллар -рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на +0,38% и -0,14%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.29% и +0.16%. Но в целом данную зеленую зону вечерней сессии можно назвать лишь дополнительной коррекцией последующей за дневным ростом и падением предыдущего дня Это произошло на фоне движения июньских контрактов на золото на +0.36%.





	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	194390	1943,90	0,38	735 106	-2,62%	20 499 161 024	12,52%
ROSN-6.11	25204	252,04	1,85	42 288	4,50%	73 879 002	8,04%
LKOH-6.11	19058	1905,80	0,24	180 100	0,55%	65 372 319	4,32%
GAZR-6.11	22483	224,83	0,39	442 674	0,24%	306 115 907	4,00%
GMKR-6.11	74530	7453,00	0,17	42 370	-0,38%	20 745 761	2,10%
SBRF-6.11	10255	102,55	0,29	839 950	-0,25%	356 684 767	4,68%
VTBR-6.11	9257	0,0926	0,16	215 720	-0,10%	29 356 084	8,12%
GOLD-6.11	1501	1500,8000	0,35	129 162	3,44%	321 593 888	35,46%
Si-6.11	28450	28,45	-0,14	1 058 856	0,00%	522 656 420	2,31%
Eu-6.11	40740	40,74	0,12	106 006	-0,06%	14 694 370	19,70%
ED-6.11	1,43	1,43	0,25	182 660	-0,11%	758 896 225	9,39%
SBPR-6.11	6918	69,18	0,38	292 702	0,09%	9 080 274	3,40%
RTSS-6.11	11852	11851,50	0,12	8 652	-0,67%	19 970 060	5,92%
BR-5.11	121	121,26	0,88	83 194	-1,76%	1 189 271 829	43,82%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	66158,09	1,14%	00:15:31
CAC 40	3908,58	0,70%	19:35:19
DAX 30	7039,31	0,18%	19:35:32
DJ Industrial	12266,75	0,53%	01:07:24
FTSE 100	5896,87	0,46%	19:35:32
Hang Seng	23738,25	0,93%	10:00:02
Nikkei 225	9606,82	1,76%	10:00:03
S&P 500	1312,62	0,57%	00:03:48
Brent Crude Oil 0511	122,36	0,00%	01:03:45
Gold	1499,84	0,33%	10:00:08
Palladium	739,75	1,69%	10:00:07
Platinum	1784	1,28%	09:59:16
RTSI	1 991,38	0,16%	23:50:00
RTS_Standard	11 996,75	0,16%	23:50:00
RTSI_DEREX	1976.54	2,04%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,38	735106	20499161024,32	194390
ROSN-6.11	1,85	42288	73879002,00	25204
LKOH-6.11	0,24	180100	65372319,00	19058
GAZR-6.11	0,39	442674	306115907,00	22483
GMKR-6.11	0,17	42370	20745761,00	74530
SBRF-6.11	0,29	839950	356684767,00	10255
VTBR-6.11	0,16	215720	29356084,00	9257
GOLD-6.11	0,35	129162	321593887,87	1500,8
Si-6.11	-0,14	1058856	522656420,00	28450
Eu-6.11	0,12	106006	14694370,00	40740
ED-6.11	0,25	182660	758896225,39	1,4322
SBPR-6.11	0,38	292702	9080274,00	6918
RTSS-6.11	0,12	8652	19970060,00	11851,5
BR-5.11	0,88	83194	1189271828,83	121,26

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	2,22	754878	163751219407,16	193620
ROSN-6.11	4,48	40466	919416843,00	24770
LKOH-6.11	2,06	179120	1512825826,00	19004
GAZR-6.11	2,45	441620	7648857810,00	22381
GMKR-6.11	1,66	42532	989742888,00	74331
SBRF-6.11	1,08	842072	7620464247,00	10215
VTBR-6.11	0,72	215940	361706750,00	9235
GOLD-6.11	0,08	124870	906957527,96	1494,7
Si-6.11	-0,14	1058804	22597308447,00	28486
Eu-6.11	0,21	106070	74580180,00	40690
ED-6.11	0,31	182854	8080348695,37	1,4283
SBPR-6.11	0,89	292440	266794229,00	6889
RTSS-6.11	2,15	8710	337233725,00	11829
BR-5.11	-1,2	84684	2714015327,91	120,09

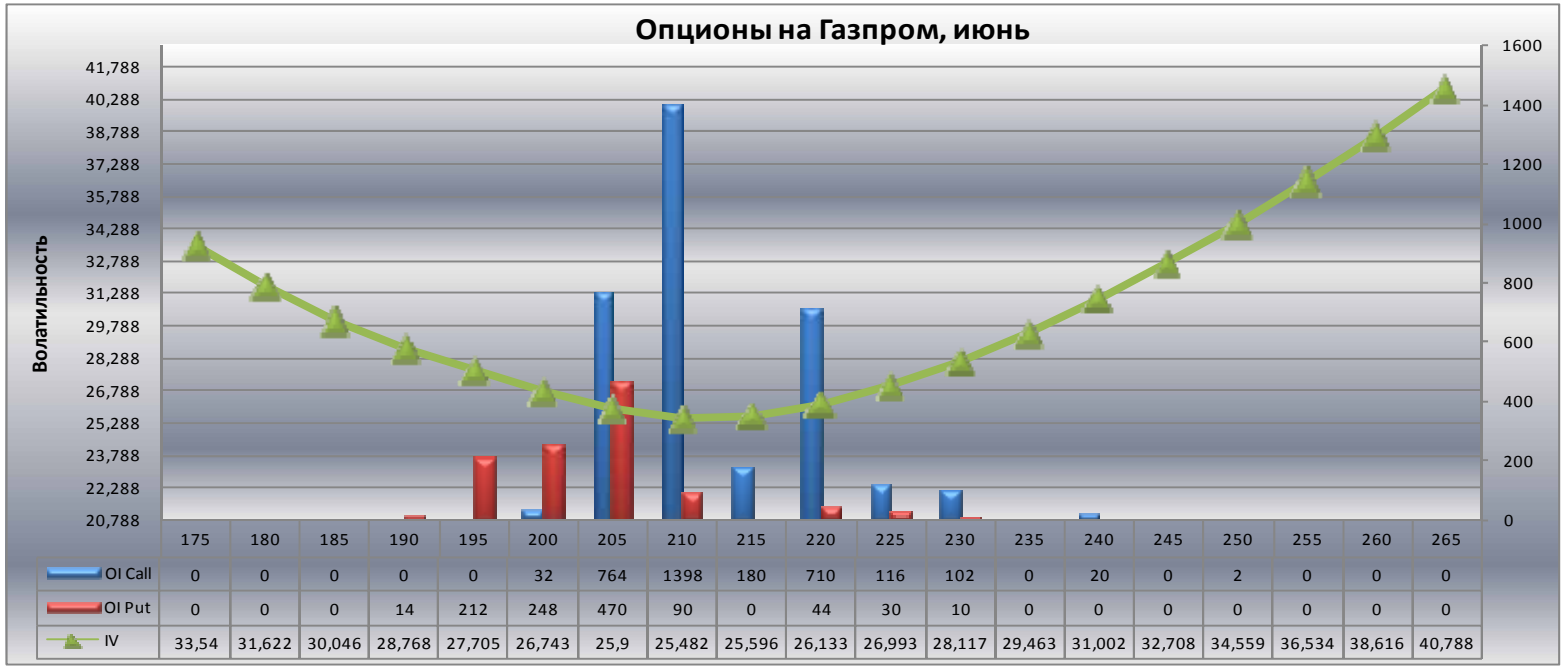


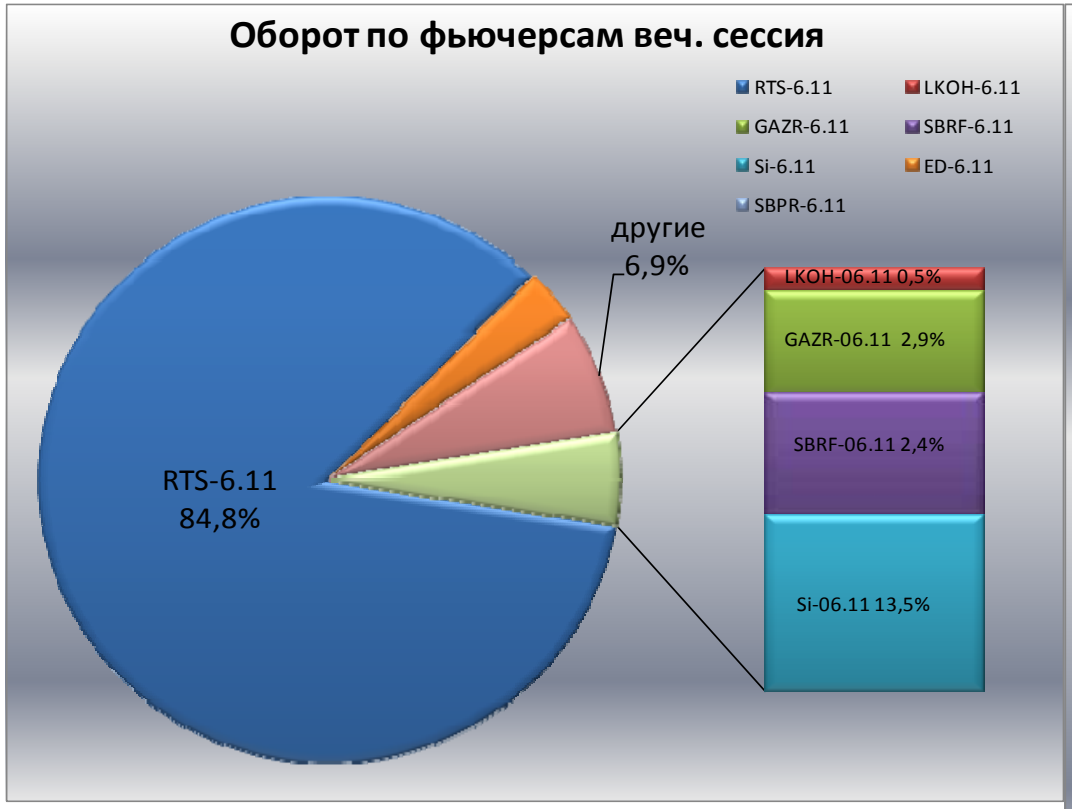
	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000	250000	255000	260000	235000
OI Call	0	0	8	54	388	3146	8524	12774	11980	8624	7800	2138	682	288	44	38	0	4	0	0	12
OI Put	3010	5118	5454	15340	26498	22600	4984	7198	130	62	4	20	0	0	0	0	0	0	0	0	0
IV	44,934	41,75	38,903	36,383	34,18	32,279	30,662	29,308	28,187	27,253	26,432	25,598	24,716	24,114	23,977	24,194	24,663	25,324	26,142	27,095	28,165

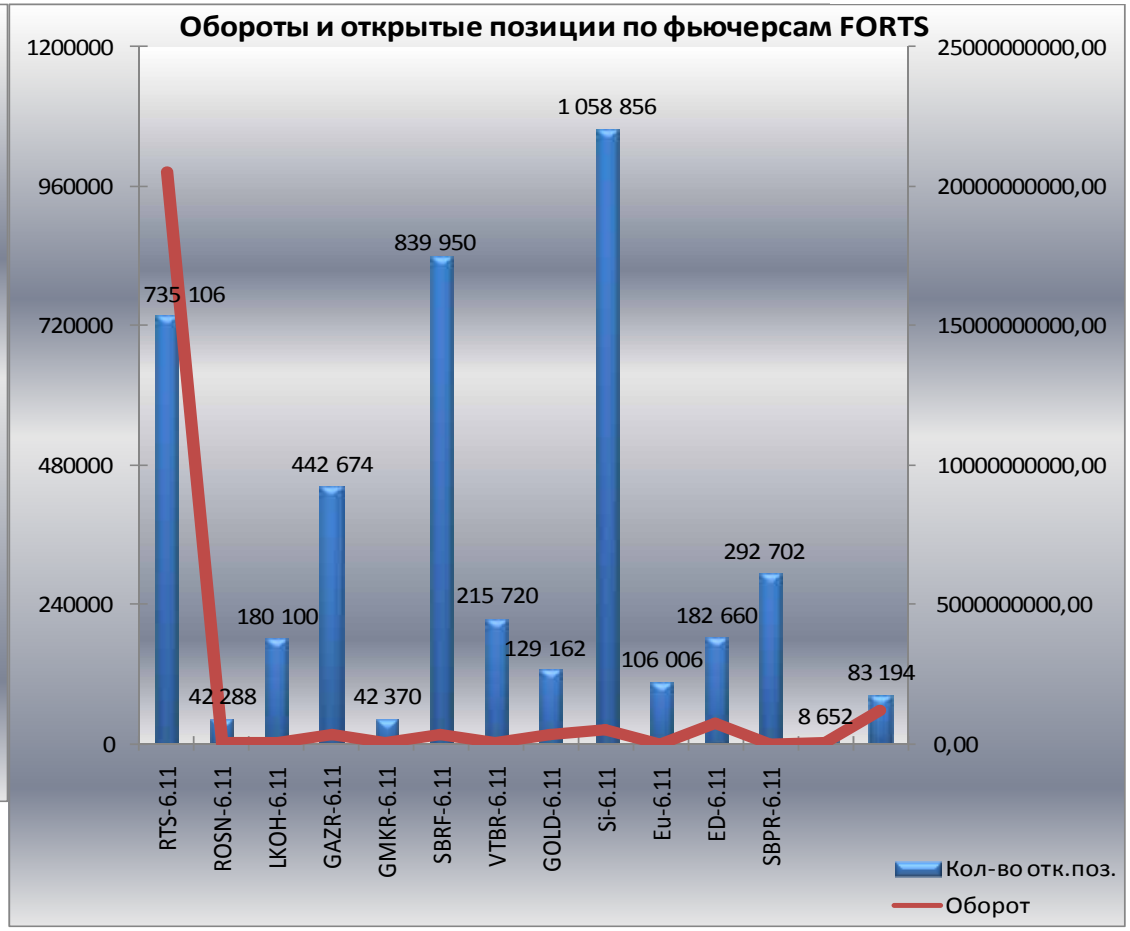


	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000	12250	12500	12750
OI Call	0	0	0	0	0	30	0	8	274	972	816	778	168	228	136	210	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	8	94	2530	930	2710	1006	1066	46	30	0	0	0	0	0	0
IV	37,75	35,135	32,89	31,002	29,458	28,239	27,322	26,672	26,247	26,043	26,128	26,505	27,129	27,964	28,985	30,172	31,506	32,971	34,551	36,757


Опционы на Лукойл, июнь
Волатильность
46,159
43,034
39,909
36,784
33,659
30,534
27,409
24,284
21,159
400
350
300
250
200
150
100
50
0
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 0 4 52 126 274 62 60 20 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 0 10 18 12 370 168 4 22 2 0 0 0 0
IV 40,544 37,7 35,228 33,09 31,23 29,567 27,984 26,354 24,693 23,321 22,538 22,344 22,611 23,227 24,114 25,218 26,502 27,935


Опционы на Газпром, июнь
Волатильность
41,788
40,288
38,788
37,288
35,788
34,288
32,788
31,288
29,788
28,288
26,788
25,288
23,788
22,288
20,788
1600
1400
1200
1000
800
600
400
200
0
175 180 185 190 195 200 205 210 215 220 225 230 235 240 245 250 255 260 265
OI Call 0 0 0 0 0 32 764 1398 180 710 116 102 0 20 0 2 0 0 0
OI Put 0 0 0 14 212 248 470 90 0 44 30 10 0 0 0 0 0 0 0
IV 33,54 31,622 30,046 28,768 27,705 26,743 25,9 25,482 25,596 26,133 26,993 28,117 29,463 31,002 32,708 34,559 36,534 38,616 40,788


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
другие
6,9%
RTS-6.11
84,8%
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
1200000
960000
720000
480000
240000
0
25000000000,00
20000000000,00
15000000000,00
10000000000,00
5000000000,00
0,00
735 106
42 288
180 100
442 674
42 370
839 950
215 720
129 162
1 058 856
106 006
182 660
292 702
8 652
83 194
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