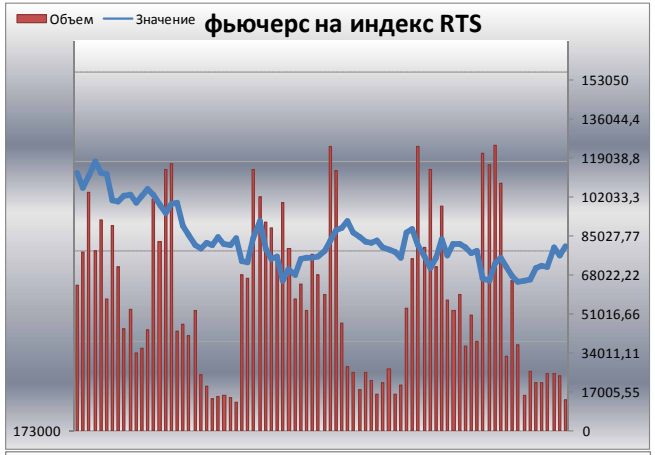
Дневное падение, вечерняя коррекция

Российские площадки во вторник в дневную сессию оказались в небольшом минусе, цены падали при поддержке американских рынков, в вечернюю сессию превалировали позитивные тенденции. Американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на -0.55% и -0.04%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.94% до уровня в 1814,27 пункта.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. Июньский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,6%. Майские фьючерсы на Brent подросли на 0.55%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял позитивно, за чем последовало слабое движение котировок нефтегазовых компаний вверх направлениях, июньские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на +0,56% и +0,56%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на -0,15% и +0,17%, что повлекло за собой движение цен на бумаги банков: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.65% и +0.50%. Это произошло на фоне движения июньских контрактов на золото на +0.19%.





	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	182495	1824,95	0,60	780 058	-0,69%	28 224 164 362	16,66%
ROSN-6.11	23075	230,75	0,83	42 958	-0,05%	9 895 776	2,57%
LKOH-6.11	17535	1753,50	0,56	162 164	0,39%	85 031 340	4,24%
GAZR-6.11	20011	200,11	0,56	542 122	0,26%	520 712 362	6,62%
GMKR-6.11	70600	7060,00	0,67	46 872	-0,20%	16 443 700	2,93%
SBRF-6.11	9718	97,18	0,65	1 185 696	-0,44%	632 920 413	7,92%
VTBR-6.11	8383	0,0838	0,50	312 032	-0,03%	13 139 753	2,53%
GOLD-6.11	1485	1485,0000	0,19	86 260	-4,06%	1 016 290 748	54,47%
Si-6.11	28220	28,22	-0,15	1 472 734	-0,62%	1 133 338 283	4,84%
Eu-6.11	40116	40,12	0,17	108 920	0,00%	12 519 124	8,57%
ED-6.11	1,42	1,42	0,38	127 302	-3,25%	1 860 198 515	21,07%
SBPR-6.11	6630	66,30	0,42	265 566	0,05%	15 236 355	21,17%
RTSS-6.11	11020	11020,00	0,50	9 256	0,13%	17 448 455	5,96%
BR-6.11	110	110,30	0,55	117 966	218,40%	3 945 673 869	90,31%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	63673,34	1,34%	00:14:30
CAC 40	3941,58	-1,21%	19:35:21
DAX 30	7256,65	-1,77%	19:35:33
DJ Industrial	12479,58	-0,55%	00:46:28
FTSE 100	5861	-1,06%	19:35:33
Hang Seng	23004,49	0,45%	10:34:02
Nikkei 225	9662,08	0,99%	10:00:04
S&P 500	1328,98	-0,04%	00:02:07
Brent Crude Oil 0611	112,73	0,00%	01:04:17
Gold	1489,65	0,22%	10:34:02
Palladium	724,5	1,03%	10:33:30
Platinum	1769	0,50%	10:33:30
RTSI	1830,63	0,15%	23:50:00
RTS_Standard	10 976,84	0,13%	23:50:00
RTSI_DEREX	1814,27	-0,94%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,6	780058	28224164361,50	182495
ROSN-6.11	0,83	42958	9895776,00	23075
LKOH-6.11	0,56	162164	85031340,00	17535
GAZR-6.11	0,56	542122	520712362,00	20011
GMKR-6.11	0,67	46872	16443700,00	70600
SBRF-6.11	0,65	1185696	632920413,00	9718
VTBR-6.11	0,5	312032	13139753,00	8383
GOLD-6.11	0,19	86260	1016290747,84	1485
Si-6.11	-0,15	1472734	1133338283,00	28220
Eu-6.11	0,17	108920	12519124,00	40116
ED-6.11	0,38	127302	1860198515,32	1,4219
SBPR-6.11	0,42	265566	15236355,00	6630
RTSS-6.11	0,5	9256	17448455,00	11020
BR-6.11	0,55	117966	3945673869,01	110,3

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	-1,07	785488	169401351476,23	181415
ROSN-6.11	-0,97	42978	384945011,00	22885
LKOH-6.11	0,2	161540	2003472669,00	17438
GAZR-6.11	-0,08	540714	7863400700,00	19899
GMKR-6.11	0	46968	562050054,00	70129
SBRF-6.11	-1,98	1190914	7995811784,00	9655
VTBR-6.11	0,7	312132	519713078,00	8342
GOLD-6.11	-1,36	89910	1865781384,43	1482,2
Si-6.11	0,49	1481930	23417247796,00	28263
Eu-6.11	0,25	108918	146052296,00	40046
ED-6.11	-0,25	131572	8828832293,37	1,4165
SBPR-6.11	-1,42	265424	71958735,00	6602
RTSS-6.11	-0,56	9244	292716070,00	10965
BR-6.11	-2,81	37050	4368896070,38	109,7


Опционы на индекс РТС, июнь
Волатильность
50,892
48,00311
45,11422
42,22533
39,33644
36,44755
33,55866
30,66977
27,78088
24,892
90000
80000
70000
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000 250000 255000 260000 235000
OI Call 44 228 958 19014 23666 61374 48028 41750 38792 43344 18810 26846 37888 20176 4070 1866 2500 1344 0 0 12
OI Put 95196 84362 30854 62236 31170 25470 14606 15444 5658 1340 606 168 1128 166 54 0 0 0 0 0 0
IV 52,297 46,692 41,754 37,514 33,987 31,179 29,092 27,74 27,167 27,41 28,214 29,296 30,673 32,38 34,408 36,731 39,314 42,121 45,116 48,264 51,532

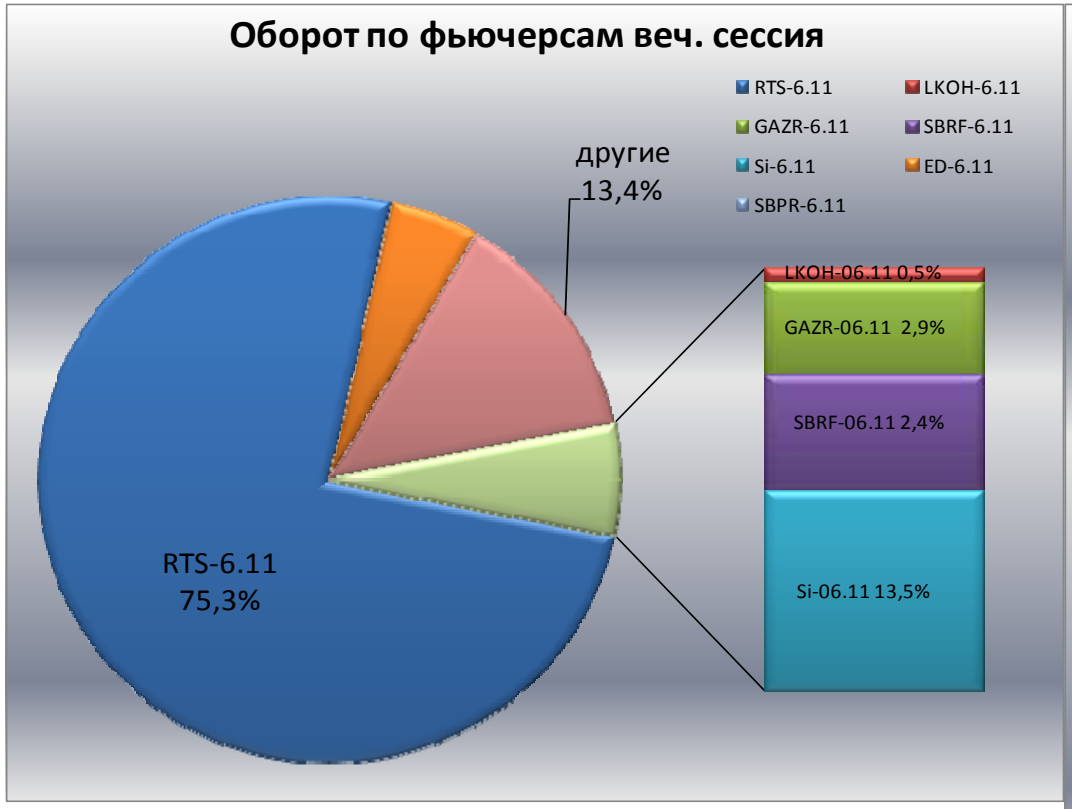

Опционы на Сбербанк, июнь
Волатильность
98,645
85,31166
71,97833
58,645
45,31166
31,97833
18,645
42000
36000
30000
24000
18000
12000
6000
0
8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000 12250
OI Call 0 0 0 0 2 102 1818 7006 12058 10926 17558 15446 15638 2552 17680 2234 6736 516
OI Put 1006 446 3336 4506 38108 10228 18498 12050 41598 7314 38838 7834 1102 132 30 4 0 0
IV 94,131 79,571 66,105 54,367 44,836 37,76 32,994 29,965 29,88 33,164 38,858 46,319 55,047 64,603 74,596 84,692 94,613 104,14

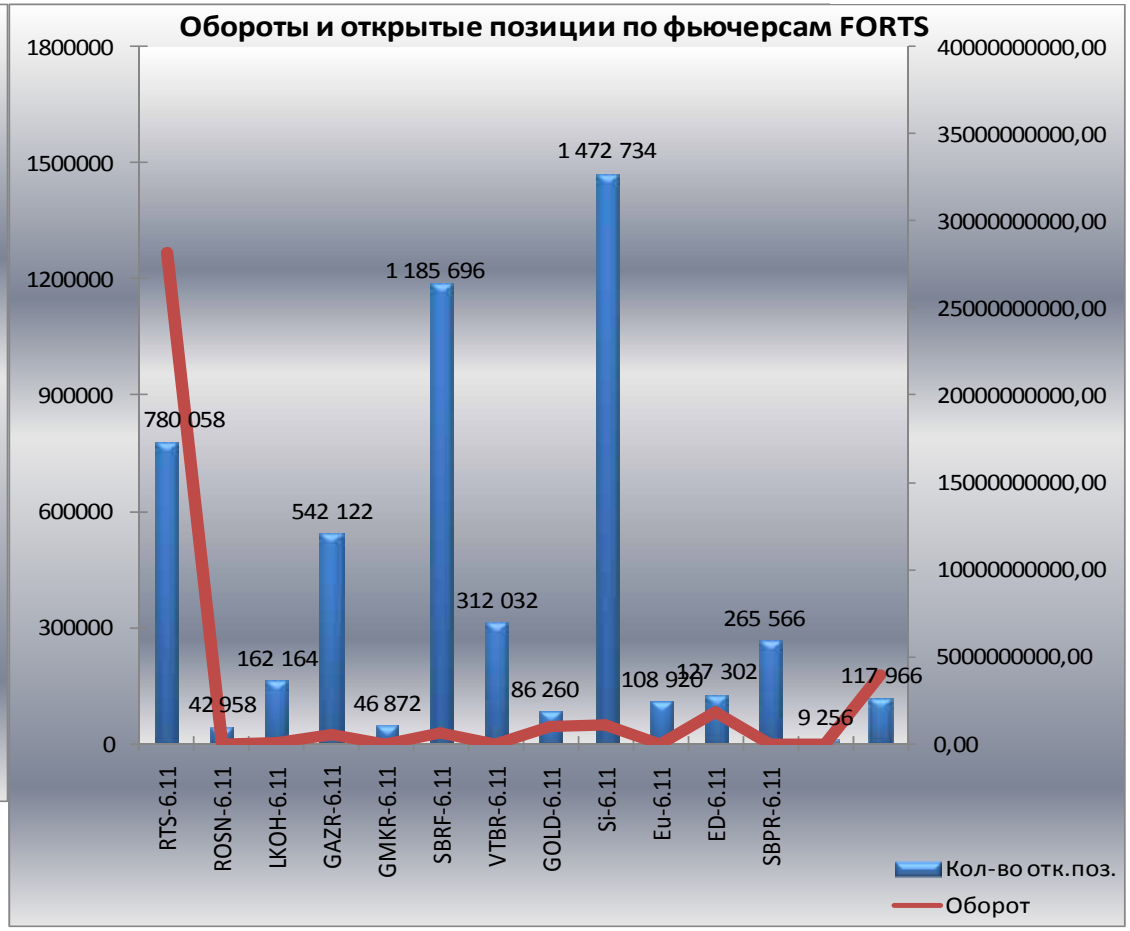


	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2150	2200	
OI Call	0	0	0	0	4	108	620	1856	1742	1122	30268	4342	5210	2082	2078	1448	460	20
OI Put	1634	0	0	6	320	1386	2438	5436	11626	3712	61994	6688	6690	4170	36	0	0	0
IV	56,722	50,584	45,436	41,325	38,279	36,33	35,56	36,027	37,206	38,832	40,989	43,673	46,832	50,395	54,289	58,444	62,793	67,275



	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240	245	250	255	260
OI Call	58	0	27062	13598	40912	77480	13436	11992	8886	11294	12556	0	8922	1034	1782	1032	0	0
OI Put	4378	32820	71692	25664	48372	8722	12456	6362	4054	1318	108	44	22	0	0	0	0	0
IV	30,071	29,027	29,312	30,693	32,715	35,148	37,988	41,25	44,916	48,939	53,259	57,812	62,536	67,369	72,256	77,147	81,999	86,775


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
13,4%
RTS-6.11
75,3%
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
40000000000,00
35000000000,00
30000000000,00
25000000000,00
20000000000,00
15000000000,00
10000000000,00
5000000000,00
0,00
780 058
42 958
162 164
542 122
46 872
1 185 696
312 032
86 260
1 472 734
108 920
127 302
265 566
9 256
117 966
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