Ещё один позитивный день на российском рынке

Российские площадки во вторник в дневную сессию оказались в сильном плюсе, цены росли при поддержке европейских рынков, в вечернюю сессию превалировали позитивные тенденции. В свою очередь, на американских рынках мы не могли наблюдать направленного движения.

На вечерних торгах был не большой откат после дневной активной бычьей сессии. Июньский фьючерс на индекс РТС упал всего на 0,24%. Июньские фьючерсы на Brent упал на 0,75% и это повлияло на Газпром он зафиксировал –0,63%, после очень мощного роста в дневную сессию на 4,12%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на —0,01% и -0,02%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанка и ВТБ изменились на +0.17% и -0.14%.





	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	189940	1899,40	-0,24	1 008 170	-6,54%	23 892 755 004	18,87%
ROSN-6.11	24384	243,84	-0,03	41 814	-0,43%	11 091 984	2,85%
LKOH-6.11	17850	1785,00	-0,63	165 284	0,41%	71 631 174	5,09%
GAZR-6.11	20482	204,82	-0,09	543 326	-0,99%	316 092 284	4,88%
GMKR-6.11	69892	6989,20	0,42	46 376	-1,00%	23 168 900	3,01%
SBRF-6.11	9654	96,54	0,17	1 007 526	-0,04%	346 502 496	7,90%
VTBR-6.11	8534	0,0853	-0,14	250 460	-1,26%	5 862 100	2,24%
GOLD-6.11	1548	1547,9000	0,11	71 280	-23,07%	361 853 666	44,50%
Si-6.11	27721	27,72	0,04	1 395 018	-4,47%	1 195 414 243	9,57%
Eu-6.11	40685	40,69	-0,02	91 154	0,00%	1 911 591	0,58%
ED-6.11	1,47	1,47	-0,01	169 548	-5,98%	742 543 930	12,39%
SBPR-6.11	7201	72,01	-0,57	182 084	-1,16%	9 864 696	2,16%
RTSS-6.11	11260	11260,00	-0,13	12 872	-0,26%	13 206 355	4,10%
BR-6.11	117	116,72	0,75	86 186	31,32%	870 015 540	19,81%

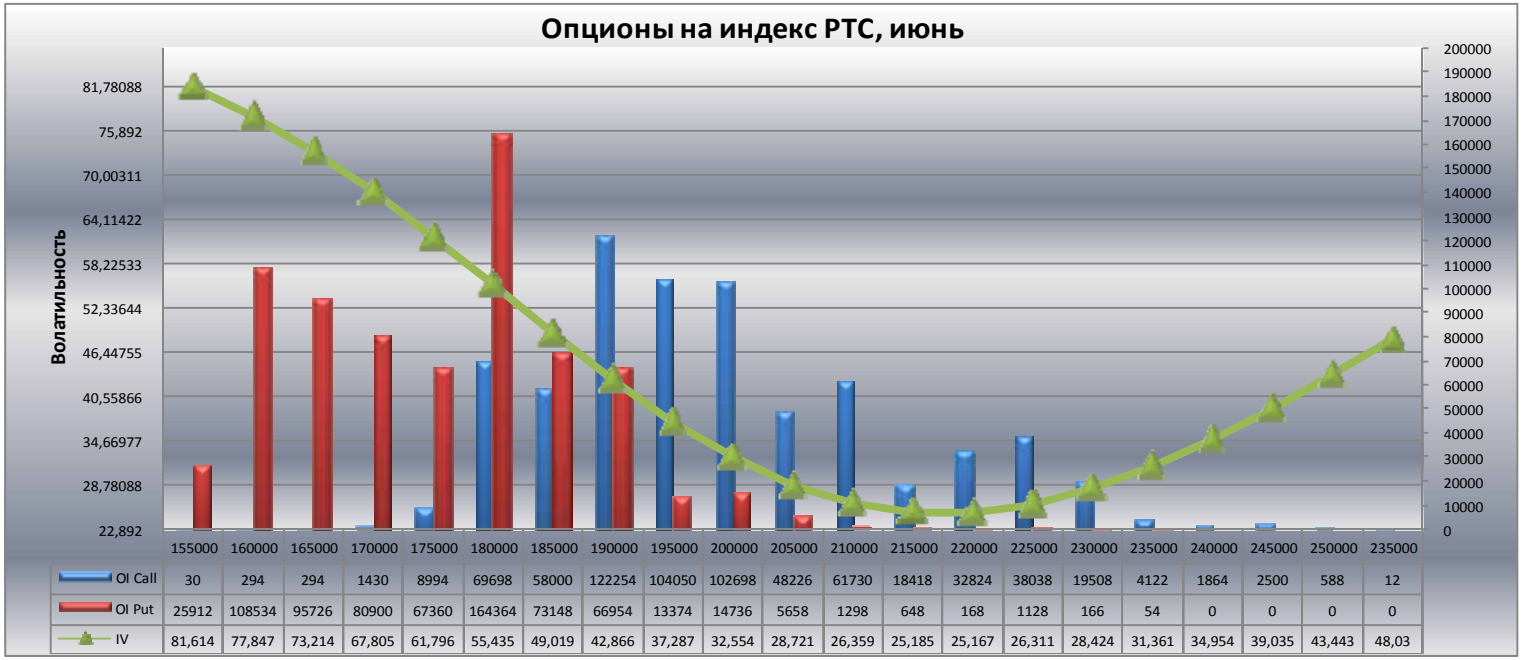
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	63217,85	0,24%	00:17:29
CAC 40	3871,92	0,22%	19:36:08
DAX 30	7103,25	0,26%	03:56:28
DJ Industrial	12070,81	-0,16%	00:50:51
FTSE 100	5864,65	0,03%	19:36:23
Hang Seng	22733,23	-0,59%	10:33:03
Nikkei 225	9449,46	0,07%	10:01:03
S&P 500	1284,94	-0,10%	00:07:13
Brent Crude Oil 0711	116,42	-0,31%	10:33:01
Gold	1541,23	-0,17%	10:32:52
Palladium	801	-0,48%	10:31:41
Platinum	1820,5	0,03%	10:31:15
RTSI	1 906,48	0,12%	23:50:00
RTS_Standard	11 277,94	0,14%	23:50:00
RTSI_DEREX	1906,15	2,24%	18:45:00

Вечерняя сессия

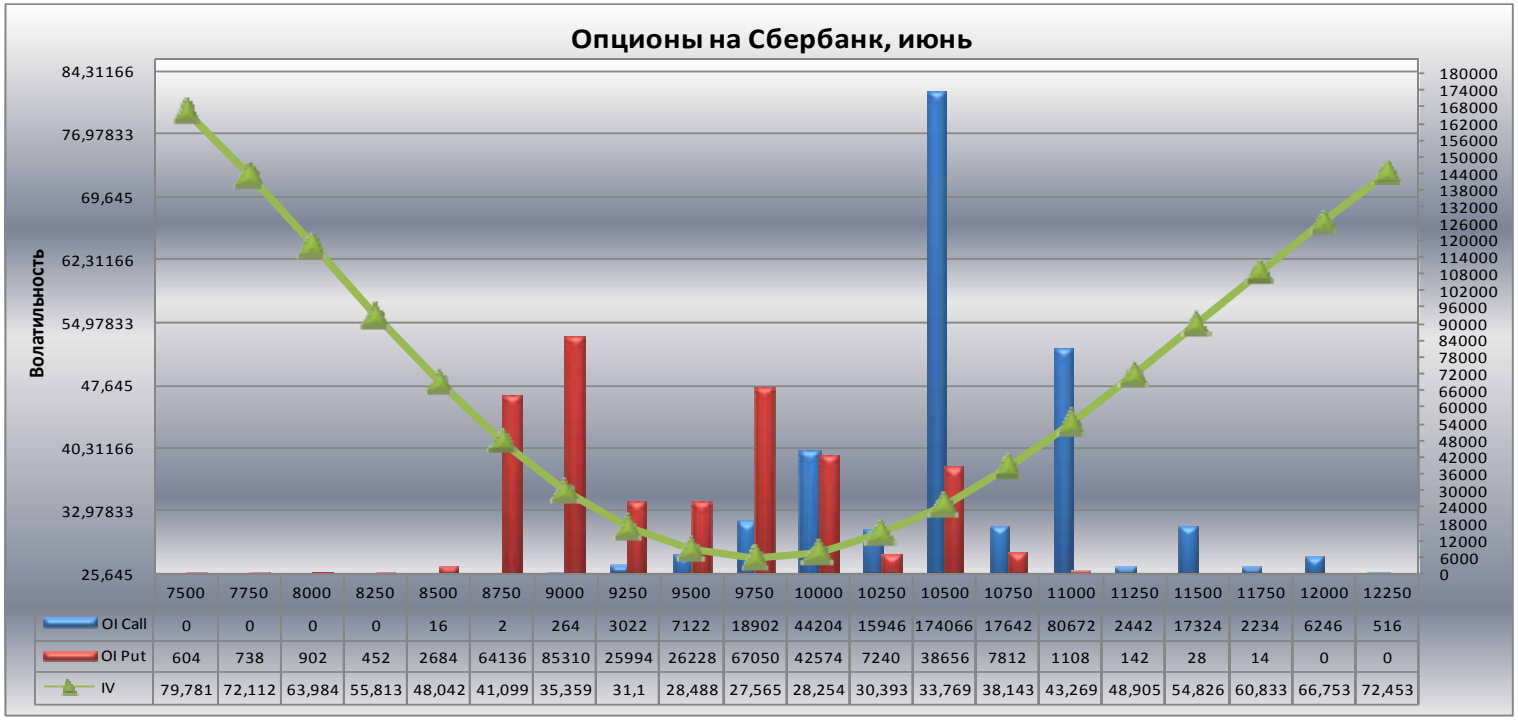
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	-0,24	1008170	23892755004,04	189940
ROSN-6.11	-0,03	41814	11091984,00	24384
LKOH-6.11	-0,63	165284	71631174,00	17850
GAZR-6.11	-0,09	543326	316092284,00	20482
GMKR-6.11	0,42	46376	23168900,00	69892
SBRF-6.11	0,17	1007526	346502496,00	9654
VTBR-6.11	-0,14	250460	5862100,00	8534
GOLD-6.11	0,11	71280	361853666,10	1547,9
Si-6.11	0,04	1395018	1195414243,00	27721
Eu-6.11	-0,02	91154	1911591,00	40685
ED-6.11	-0,01	169548	742543929,62	1,4679
SBPR-6.11	-0,57	182084	9864696,00	7201
RTSS-6.11	-0,13	12872	13206355,00	11260
BR-6.11	0,75	86186	870015539,54	116,72

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	1,94	1078714	126643460559,00	189190
ROSN-6.11	1,93	41994	389099454,00	24251
LKOH-6.11	1,56	164614	1406696295,00	17862
GAZR-6.11	3,76	548766	6478843553,00	20354
GMKR-6.11	1,17	46846	769000734,00	69164
SBRF-6.11	0,94	1007920	4386069272,00	9696
VTBR-6.11	0,63	253646	261304379,00	8499
GOLD-6.11	-0,4	92658	813154676,01	1546,6
Si-6.11	-0,42	1460344	12492661096,00	27742
Eu-6.11	0,07	91156	329501428,00	40690
ED-6.11	0,42	180336	5991931191,95	1,4664
SBPR-6.11	0,79	184218	456819895,00	7175
RTSS-6.11	1,52	12906	322071370,00	11225,5
BR-6.11	0,81	65630	4390969268,31	115,46



	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000	250000	235000
OI Call	30	294	294	1430	8994	69698	58000	122254	104050	102698	48226	61730	18418	32824	38038	19508	4122	1864	2500	588	12
OI Put	25912	108534	95726	80900	67360	164364	73148	66954	13374	14736	5658	1298	648	168	1128	166	54	0	0	0	0
IV	81,614	77,847	73,214	67,805	61,796	55,435	49,019	42,866	37,287	32,554	28,721	26,359	25,185	25,167	26,311	28,424	31,361	34,954	39,035	43,443	48,03



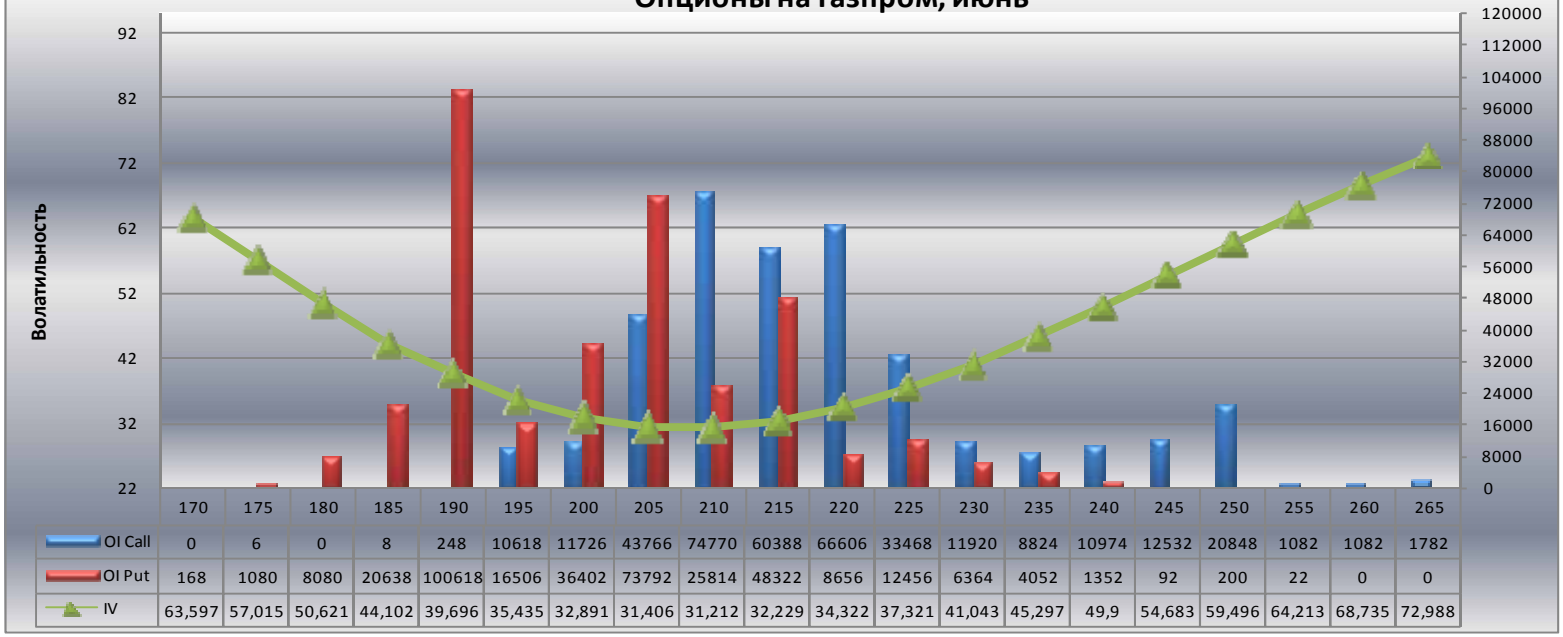
	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000	12250
OI Call	0	0	0	0	16	2	264	3022	7122	18902	44204	15946	174066	17642	80672	2442	17324	2234	6246	516
OI Put	604	738	902	452	2684	64136	85310	25994	26228	67050	42574	7240	38656	7812	1108	142	28	14	0	0
IV	79,781	72,112	63,984	55,813	48,042	41,099	35,359	31,1	28,488	27,565	28,254	30,393	33,769	38,143	43,269	48,905	54,826	60,833	66,753	72,453

Опционы на Лукойл, июнь

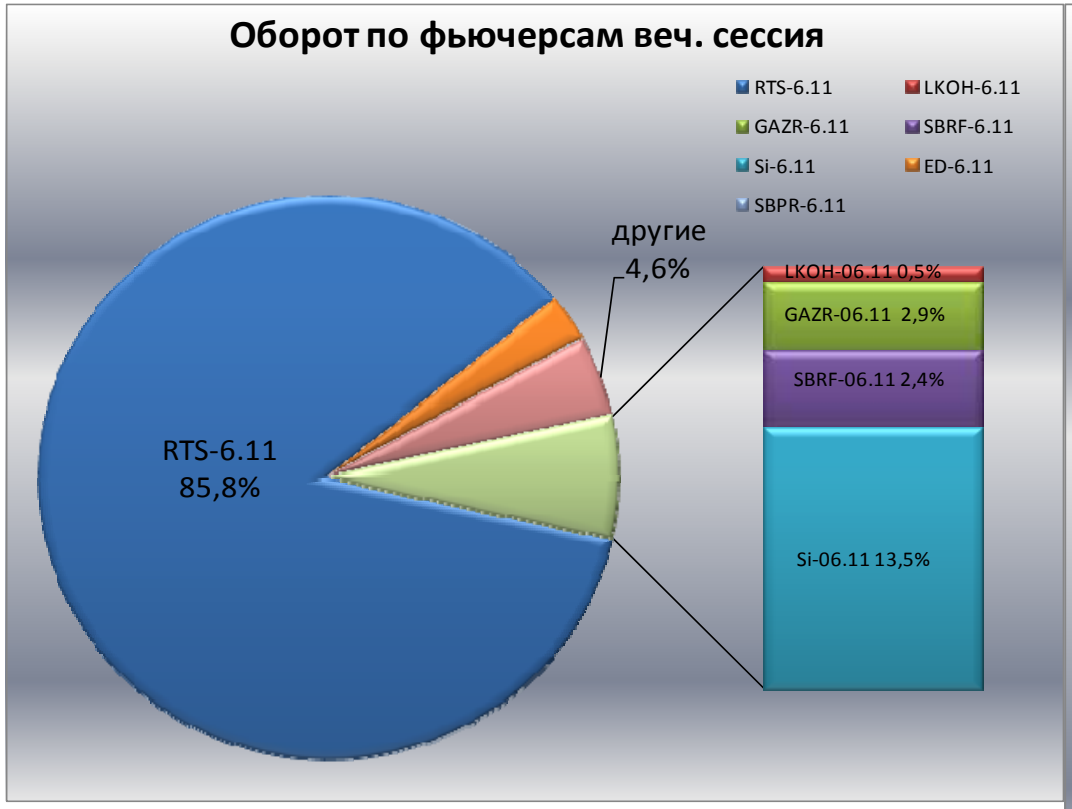


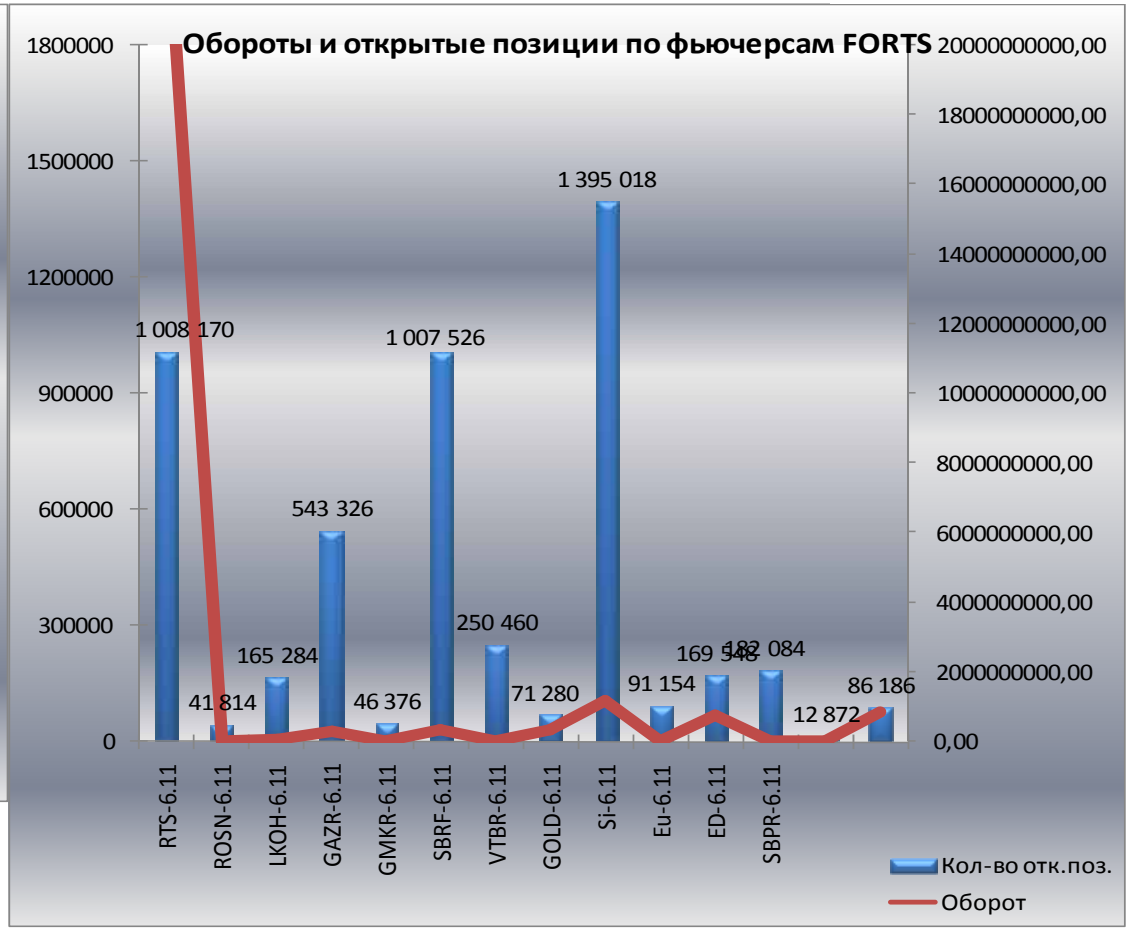
	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2150
OI Call	0	0	0	0	4	0	2	98	1738	7824	9760	2500	41744	4272	5106	2082	2078	1448
OI Put	0	0	1724	30	40	8	720	2532	4924	6490	11998	3688	61994	6682	6690	4168	36	0
IV	91,54	84,951	77,151	68,467	59,368	50,403	42,146	35,12	31	26,29	24,856	25,377	27,656	31,422	36,367	42,173	48,53	55,156

Опционы на Газпром, июнь



	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240	245	250	255	260	265
OI Call	0	6	0	8	248	10618	11726	43766	74770	60388	66606	33468	11920	8824	10974	12532	20848	1082	1082	1782
OI Put	168	1080	8080	20638	100618	16506	36402	73792	25814	48322	8656	12456	6364	4052	1352	92	200	22	0	0
IV	63,597	57,015	50,621	44,102	39,696	35,435	32,891	31,406	31,212	32,229	34,322	37,321	41,043	45,297	49,9	54,683	59,496	64,213	68,735	72,988


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
4,6%
RTS-6.11
85,8%
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
1800000
1500000
1200000
900000
600000
300000
0
20000000000,00
18000000000,00
16000000000,00
14000000000,00
12000000000,00
10000000000,00
8000000000,00
6000000000,00
4000000000,00
2000000000,00
0,00
1 008 170
41 814
165 284
543 326
46 376
1 007 526
250 460
71 280
1 395 018
91 154
169 348
182 084
12 872
86 186
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