Ещё один позитивный день на российском рынке

Российские площадки в среду в вечернюю сессию начали делать не большой откат после хороших двух дневных ростов, хотя Америка в это время продолжала свое падение в низ.

На вечерних торгах был не большой откат после дневной активной бычьей сессии. Июньский фьючерс на индекс РТС упал всего на 0,21%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на 0,04% и 0,17%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанка и ВТБ изменились на +0.74% и 0,39% соответственно.





	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	191715	1917,15	0,38	955 276	154,48%	35 753 213 630	106,05%
ROSN-6.11	24774	247,74	0,16	32 262	-6,73%	19 161 106	10,09%
LKOH-6.11	18039	1803,90	0,76	157 208	107,72%	130 890 074	13,74%
GAZR-6.11	20801	208,01	0,27	506 932	23,80%	567 902 530	12,03%
GMKR-6.11	70322	7032,20	0,38	46 876	193,38%	21 191 852	12,58%
SBRF-6.11	9678	96,78	0,74	959 346	16,06%	648 686 553	24,96%
VTBR-6.11	8563	0,0856	0,39	242 210	2798,64%	20 090 265	30,06%
GOLD-6.11	1536	1536,0000	-0,17	75 326	29,36%	257 880 473	780,59%
Si-6.11	27741	27,74	0,12	1 331 452	8065,41%	1 618 096 354	2768,56%
Eu-6.11	40560	40,56	0,17	86 638	-81,48%	2 511 579	0,06%
ED-6.11	1,46	1,46	0,04	128 496	436,83%	1 813 830 533	9773,83%
SBPR-6.11	7375	73,75	0,14	150 276	-30,12%	8 754 464	0,74%
RTSS-6.11	11366	11366,00	0,44	11 492	-77,24%	31 603 030	5,76%
BR-6.11	118	118,18	0,23	180 794	441,56%	553 209 637	5923,83%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	63032,97	-0,29%	00:18:07
CAC 40	3837,98	-0,88%	19:35:28
DAX 30	7060,23	-0,61%	19:35:39
DJ Industrial	12048,94	-0,18%	00:50:38
FTSE 100	5808,89	-0,95%	19:35:41
Hang Seng	22387,06	-1,21%	10:46:32
Nikkei 225	9467,15	0,19%	10:00:19
S&P 500	1279,56	-0,42%	00:04:46
Brent Crude Oil 0711	117,94	0,08%	10:46:39
Gold	1534,23	-0,10%	10:46:28
Palladium	801,25	0,20%	10:43:03
Platinum	1813,5	-0,29%	10:46:38
RTSI	1 909,41	-0,21%	23:50:00
RTS_Standard	11 295,59	-0,13%	23:50:00
RTSI_DEREX	1908,67	0,13%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,38	955276	35753213630,25	191715
ROSN-6.11	0,16	32262	19161106,00	24774
LKOH-6.11	0,76	157208	130890074,00	18039
GAZR-6.11	0,27	506932	567902530,00	20801
GMKR-6.11	0,38	46876	21191852,00	70322
SBRF-6.11	0,74	959346	648686553,00	9678
VTBR-6.11	0,39	242210	20090265,00	8563
GOLD-6.11	-0,17	75326	257880472,58	1536
Si-6.11	0,12	1331452	1618096354,00	27741
Eu-6.11	0,17	86638	2511579,00	40560
ED-6.11	0,04	128496	1813830533,18	1,4617
SBPR-6.11	0,14	150276	8754464,00	7375
RTSS-6.11	0,44	11492	31603030,00	11366
BR-6.11	0,23	180794	553209637,46	118,18

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.09	1,42	375378	33712923752,00	106500
ROSN-9.09	1,45	34590	189953759,00	20140
LKOH-9.09	1,18	75684	952454903,00	16002
GAZR-9.09	0,25	409478	4720165290,00	16427
GMKR-9.09	1,1	15978	168466309,00	34223
SBRF-9.09	3,72	826566	2599351513,00	4923
SNGR-9.09	-0,94	8356	66832296,00	25786
VTBR-9.09	1,12	58230	33036662,00	4390
GOLD-9.09	0,6	16306	58445322,80	955,2
Si-9.09	0,03	467760	3969232519,00	31929
Eu-9.09	-0,31	23936	18558032,00	45660
ED-9.09	-0,17	215036	1186585721,79	1,4317
BR-9.09	1,34	50492	549103769,14	70,64
SBPR-9.09	2,83	33384	9338717,00	2866

Опционы на индекс РТС, июнь

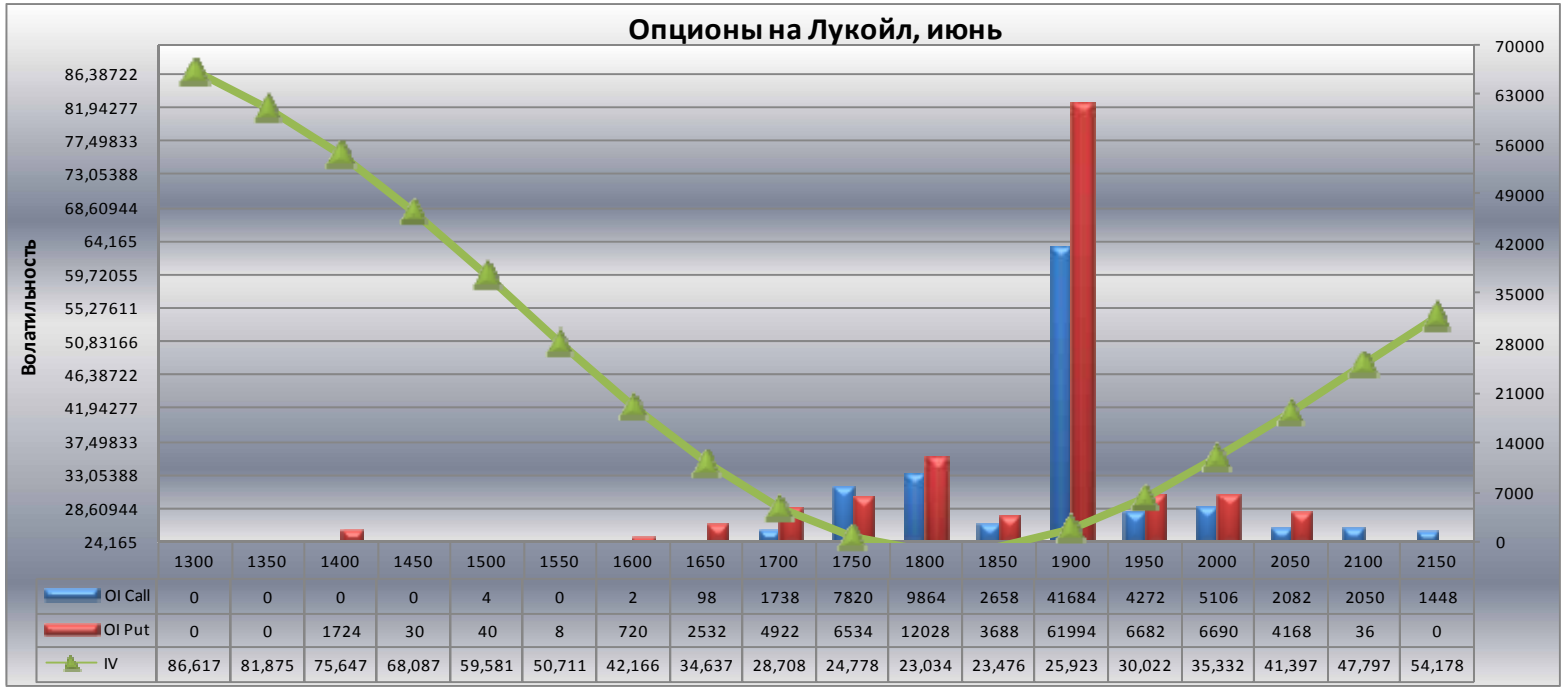


	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000	250000	235000
OI Call	30	160	274	1416	8938	69378	49748	123982	105184	109296	50434	61144	18448	32668	37484	19486	4122	1864	2500	588	12
OI Put	26018	111424	93760	79650	66526	161216	72306	75398	14028	14348	5502	1298	618	168	1128	166	54	0	0	0	0
IV	89,473	86,377	82,18	76,853	70,501	63,365	55,807	48,264	41,199	35,039	30,133	26,715	24,901	24,7	26,025	28,692	32,442	36,989	42,051	47,365	52,709

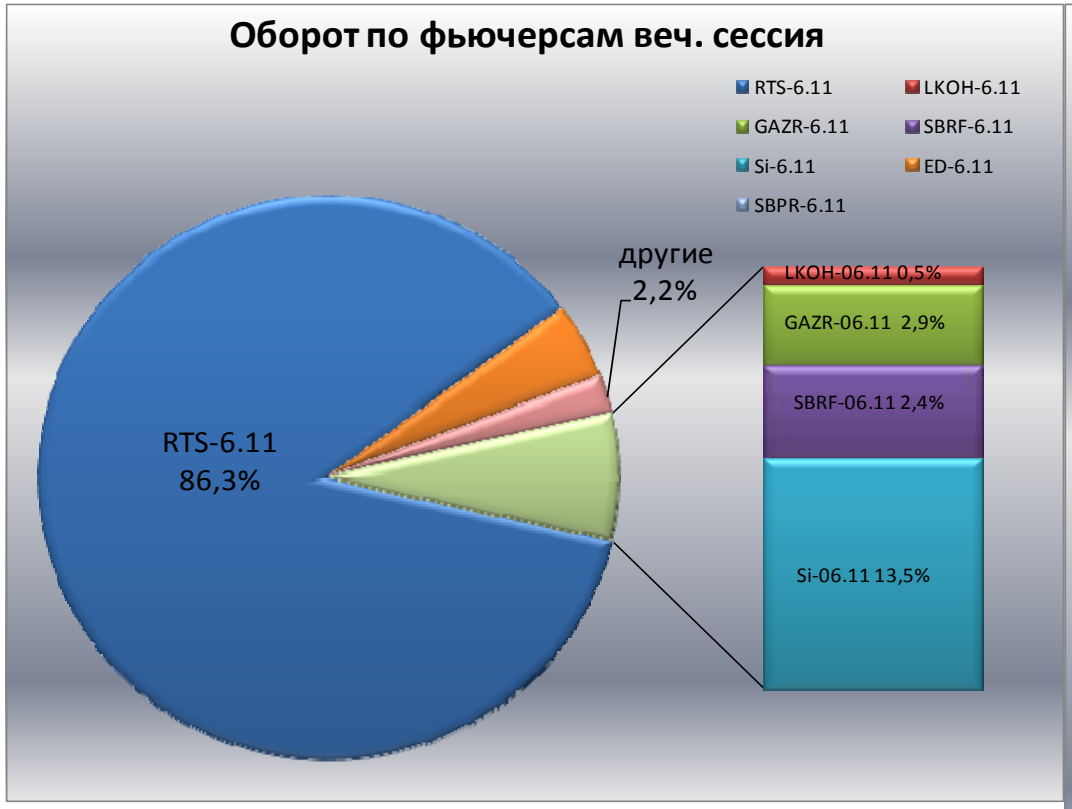
Опционы на Сбербанк, июнь

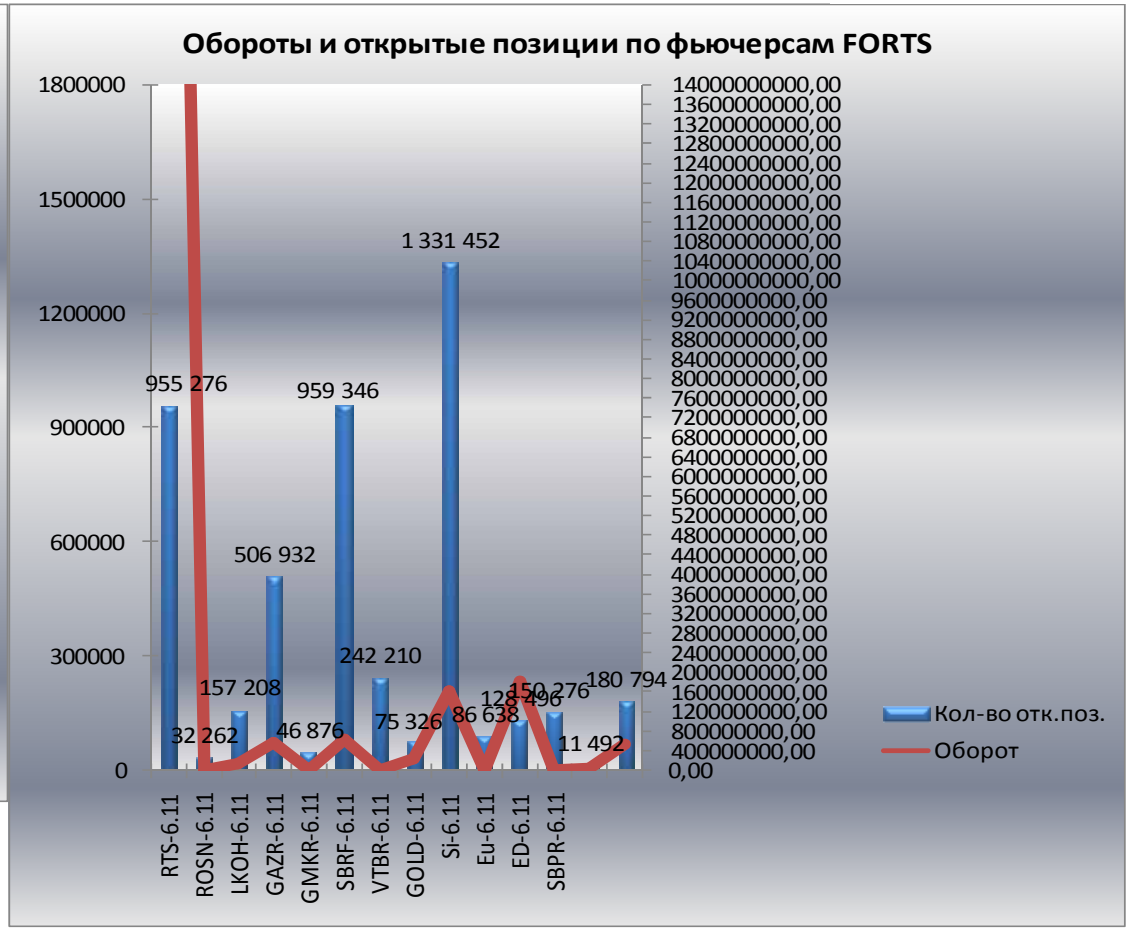


	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000	12250
OI Call	0	0	0	0	16	2	264	3022	8056	20572	44330	15928	174050	17606	80672	2442	17324	2234	6246	516
OI Put	604	738	9992	492	2784	65040	89062	28216	27924	67626	42584	7242	38656	7812	1108	142	28	14	0	0
IV	106,91	97,415	86,545	74,867	63,098	52,008	42,303	34,534	29,05	26,052	25,684	27,92	32,425	38,671	46,094	54,168	62,44	70,544	78,206	85,24


Опционы на Лукойл, июнь
Волатильность
86,38722
81,94277
77,49833
73,05388
68,60944
64,165
59,72055
55,27611
50,83166
46,38722
41,94277
37,49833
33,05388
28,60944
24,165
70000
63000
56000
49000
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
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 7820 9864 2658 41684 4272 5106 2082 2050 1448
OI Put 0 0 1724 30 40 8 720 2532 4922 6534 12028 3688 61994 6682 6690 4168 36 0
IV 86,617 81,875 75,647 68,087 59,581 50,711 42,166 34,637 28,708 24,778 23,034 23,476 25,923 30,022 35,332 41,397 47,797 54,178


Опционы на Газпром, июнь
Волатильность
92
82
72
62
52
42
32
22
120000
112000
104000
96000
88000
80000
72000
64000
56000
48000
40000
32000
24000
16000
8000
0
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 10596 10618 40632 67328 61208 64802 33468 11918 8822 10954 12532 20848 8972 1082 1782
OI Put 168 1080 8080 20640 101600 15866 36514 73970 25784 48322 8460 12456 6364 4052 1332 92 200 22 0 0
IV 73,033 65,843 58,296 50,809 43,82 37,738 32,897 29,527 27,743 27,563 28,911 31,609 35,41 40,031 45,189 50,622 56,102 61,44 66,493 71,161


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
86,3%
другие
2,2%
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
955 276
32 262
157 208
506 932
46 876
959 346
242 210
75 326
1 331 452
86 638
128 496
150 276
11 492
180 794
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