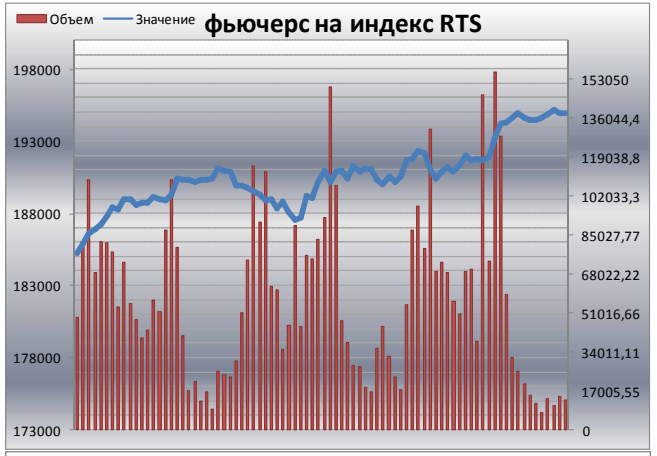
## Третий день подряд на рынке преобладает бычье настроение.

Российские площадки в четверг снова торговались в зеленой зоне. Фьючерс РТС в течение дневной сессию вырос на 1,65%. Российский рынок в росте поддержали европейские площадки, а за ними и Америка выросла на 1,26%.

На вечерних торгах рост российского рынка продолжился. Европейские площадки ожидали новости по процентной ставке в Банка Англии и Европейского центрального банка. Ожидания аналитиков оправдались и ставка в Англии осталась на прежнем рекордно низком уровне 0.5%, а в ЕЦБ—1.25%. Эти новости принесли положительное настроение на фондовые рынки Европы. В Америке по техническому анализу началась коррекция после сильного падения, есть большая вероятность, что волатильность на рынках снизится.
По итогам вечерних торгов в четверг можно видеть, что июньские фьючерсы на Brent вырос на +0,96%, в свою очередь Газпром прибавил +0,29%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на -0,12% и -0,08%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанка и ВТБ изменились на +0.04% и +0.11%.







| | 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 | 194950 | 1949,50 | 0,32 | 1 001 112 | 166,69% | 17 826 919 789 | 52,88% |
| ROSN-6.11 | 25120 | 251,20 | 0,07 | 27 960 | -19,17% | 8 014 263 | 4,22% |
| LKOH-6.11 | 18097 | 1809,70 | 0,47 | 152 354 | 101,30% | 74 818 496 | 7,86% |
| GAZR-6.11 | 21282 | 212,82 | 0,29 | 471 342 | 15,11% | 266 276 737 | 5,64% |
| GMKR-6.11 | 70515 | 7051,50 | 0,23 | 46 624 | 191,80% | 13 889 704 | 8,24% |
| SBRF-6.11 | 9942 | 99,42 | 0,04 | 886 844 | 7,29% | 380 649 424 | 14,64% |
| VTBR-6.11 | 8750 | 0,0875 | 0,11 | 212 200 | 2439,49% | 9 697 686 | 14,51% |
| GOLD-6.11 | 1546 | 1546,0000 | 0,39 | 75 778 | 30,14% | 433 956 447 | 1313,56% |
| Si-6.11 | 27737 | 27,74 | -0,12 | 1 228 616 | 7434,75% | 450 529 281 | 770,86% |
| Eu-6.11 | 40270 | 40,27 | -0,08 | 84 962 | -81,84% | 11 557 205 | 0,29% |
| ED-6.11 | 1,45 | 1,45 | -0,06 | 145 202 | 506,63% | 1 363 204 272 | 7345,63% |
| SBPR-6.11 | 7444 | 74,44 | 0,17 | 89 092 | -58,57% | 4 277 192 | 0,36% |
| RTSS-6.11 | 11550 | 11550,00 | 0,26 | 10 510 | -79,18% | 16 859 870 | 3,07% |
| BR-6.11 | 119 | 119,43 | 0,96 | 173 432 | 419,51% | 816 870 358 | 8747,14% |

| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| BOVESPA Brazil | 63468,82 | 0,69% | 00:12:34 |
| CAC 40 | 3878,65 | 1,06% | 19:35:19 |
| DAX 30 | 7159,66 | 1,41% | 19:35:34 |
| DJ Industrial | 12124,36 | 0,63% | 00:03:03 |
| FTSE 100 | 5856,34 | 0,82% | 19:35:33 |
| Hang Seng | 22609,83 | -0,23% | 12:01:19 |
| Nikkei 225 | 9467,15 | 0,19% | 10:00:19 |
| S&P 500 | 1289 | 0,74% | 00:04:34 |
| Brent Crude Oil 0711 | 119,59 | 1,48% | 00:43:46 |
| Gold | 1544,1 | 0,55% | 00:44:02 |
| Palladium | 813,25 | 1,70% | 00:37:54 |
| Platinum | 1836,75 | 0,99% | 00:40:23 |
| RTSI | 1 944,09 | 0,21% | 23:50:00 |
| RTS_Standard | 11 547,09 | 0,21% | 23:50:00 |
| RTSI_DEREX | 1908,67 | 1,65% | 18:45:00 |

# Вечерняя сессия

| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-6.11 | 0,32 | 1001112 | 17826919788,65 | 194950 |
| ROSN-6.11 | 0,07 | 27960 | 8014263,00 | 25120 |
| LKOH-6.11 | 0,47 | 152354 | 74818496,00 | 18097 |
| GAZR-6.11 | 0,29 | 471342 | 266276737,00 | 21282 |
| GMKR-6.11 | 0,23 | 46624 | 13889704,00 | 70515 |
| SBRF-6.11 | 0,04 | 886844 | 380649424,00 | 9942 |
| VTBR-6.11 | 0,11 | 212200 | 9697686,00 | 8750 |
| GOLD-6.11 | 0,39 | 75778 | 433956447,19 | 1546 |
| Si-6.11 | -0,12 | 1228616 | 450529281,00 | 27737 |
| Eu-6.11 | -0,08 | 84962 | 11557205,00 | 40270 |
| ED-6.11 | -0,06 | 145202 | 1363204271,84 | 1,4504 |
| SBPR-6.11 | 0,17 | 89092 | 4277192,00 | 7444 |
| RTSS-6.11 | 0,26 | 10510 | 16859870,00 | 11550 |
| BR-6.11 | 0,96 | 173432 | 816870357,99 | 119,43 |

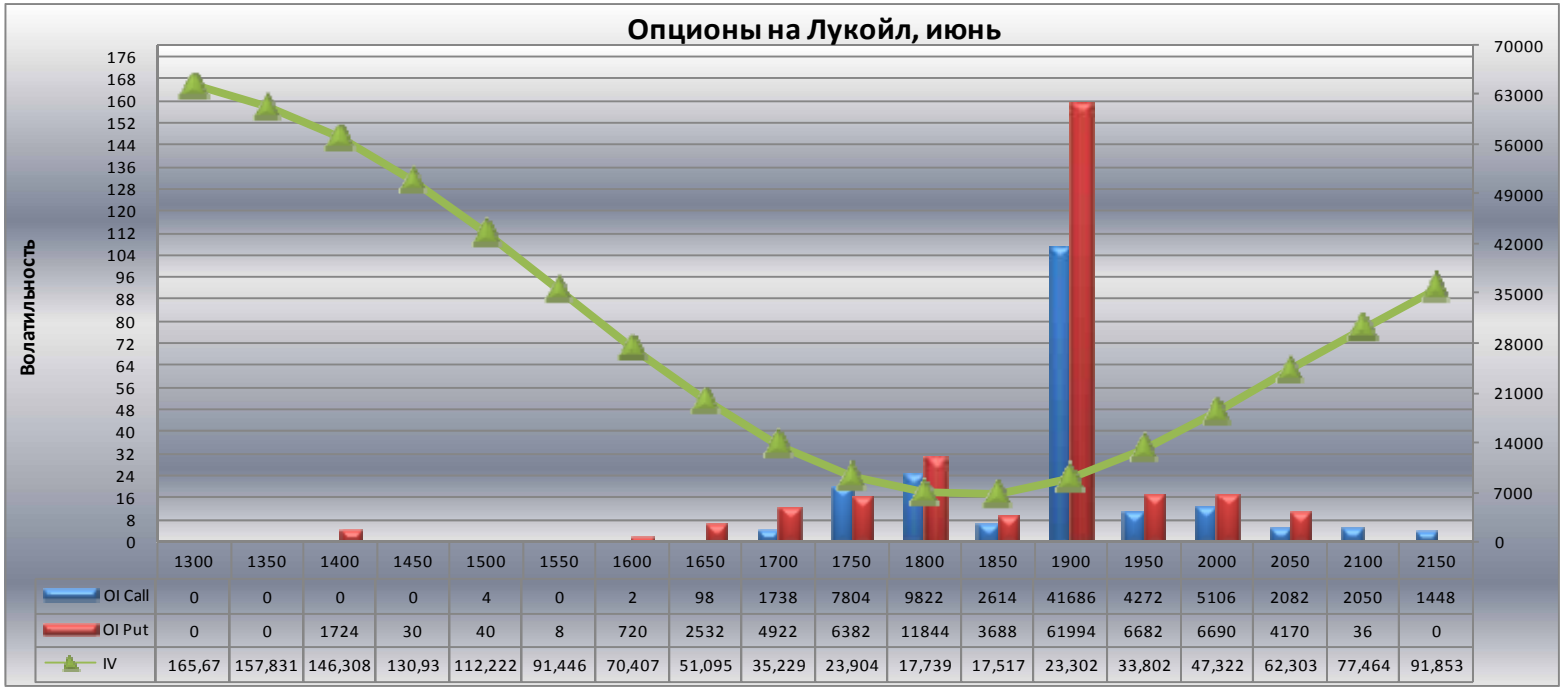
# Дневная сессия

| | % 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
Волатильность
97,44444
91,55555
85,66666
79,77777
73,88888
68
62,11111
56,22222
50,33333
44,44444
38,55555
32,66666
26,77777
20,88888
15
180000
170000
160000
150000
140000
130000
120000
110000
100000
90000
80000
70000
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000 250000 235000
OI Call 30 160 264 1412 8712 68440 47948 118438 84954 124564 50776 61142 18096 32606 37384 19286 4122 1864 2500 588 12
OI Put 25782 110968 92892 76006 61830 155116 66964 77502 24904 14208 5558 1298 618 168 1128 166 54 0 0 0 0
IV 93,418 90,8 87,042 82,028 75,79 68,529 60,607 52,498 44,714 37,706 31,783 27,071 23,686 22,051 22,53 24,919 28,72 33,44 38,655 44,022 49,276

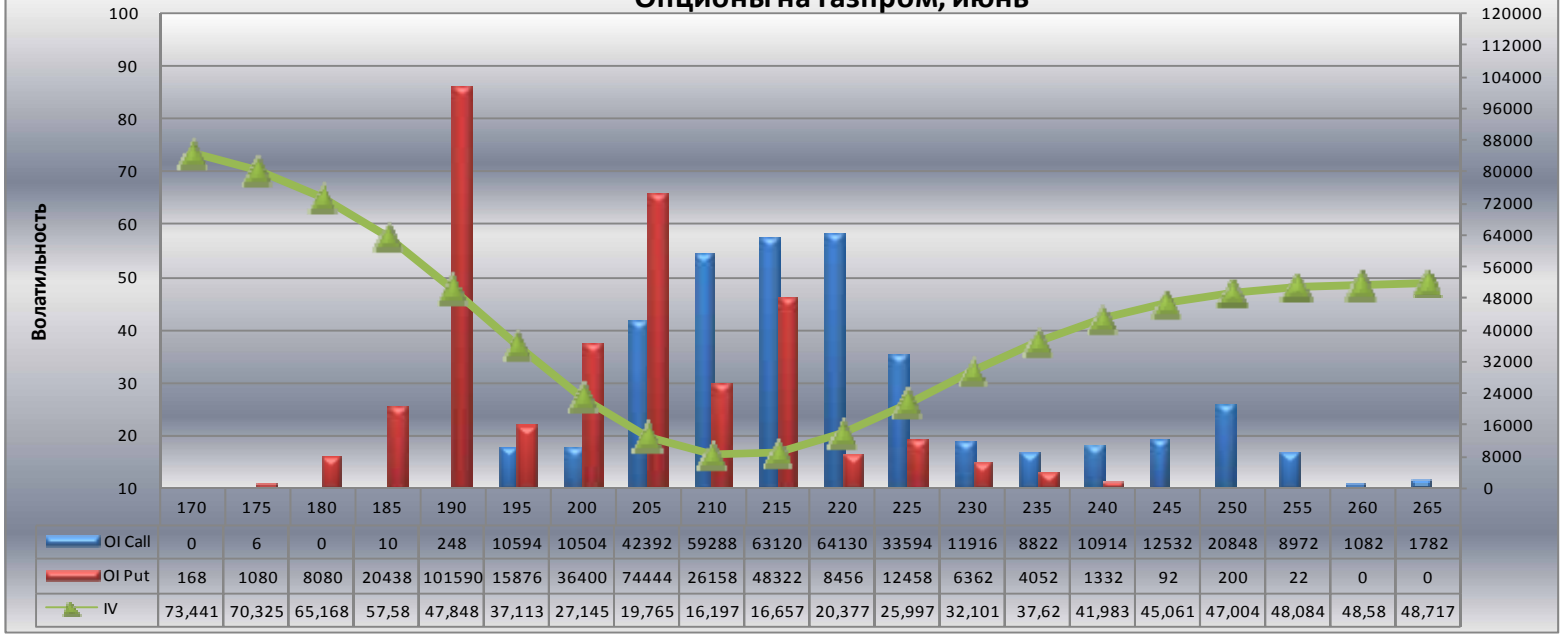

Опционы на Сбербанк, июнь
Волатильность
117,6666
110,3333
103
95,66666
88,33333
81
73,66666
66,33333
59
51,66666
44,33333
37
29,66666
22,33333
15
180000
174000
168000
162000
156000
150000
144000
138000
132000
126000
120000
114000
108000
102000
96000
90000
84000
78000
72000
66000
60000
54000
48000
42000
36000
30000
24000
18000
12000
6000
0
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 8676 24048 44372 16362 174026 17600 80660 2442 17324 2234 6246 516
OI Put 604 738 9570 492 3540 64486 89296 25516 28552 67784 42506 7218 38654 7808 1096 142 28 14 0 0
IV 107,55 96,011 84,117 72,292 60,975 50,589 41,527 34,141 28,746 25,612 24,91 26,522 29,893 34,383 39,676 45,685 52,346 59,557 67,187 75,091

## Опционы на Лукойл, июнь

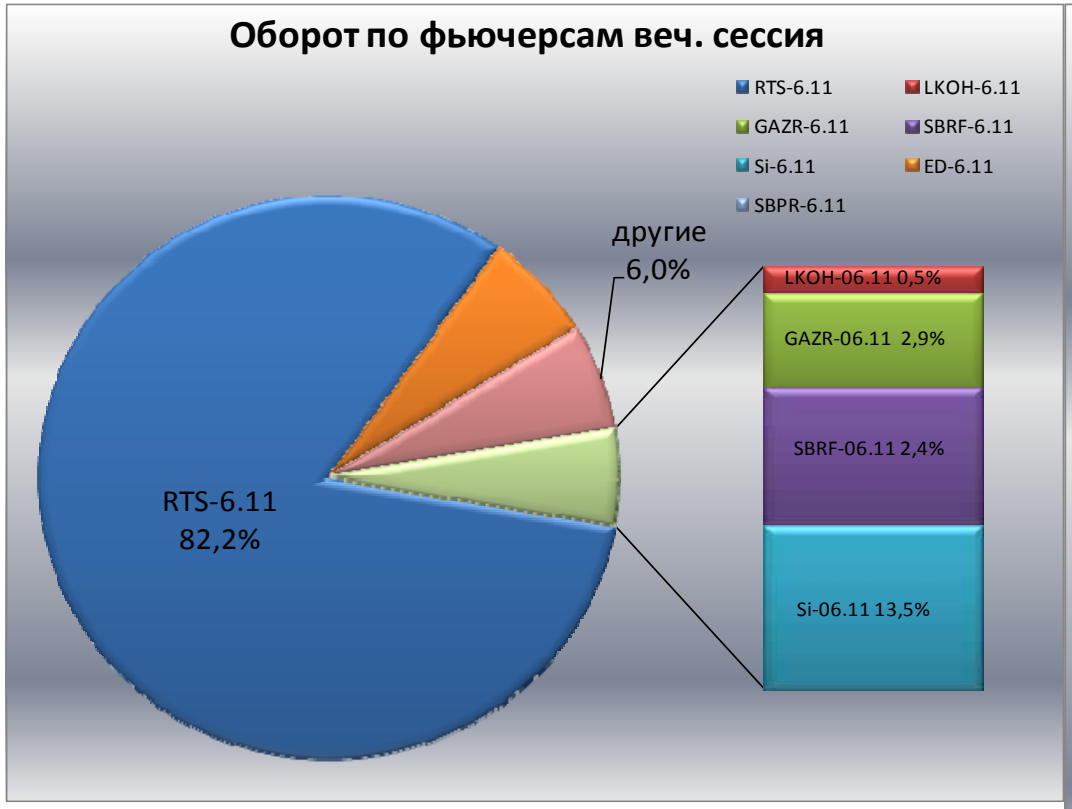


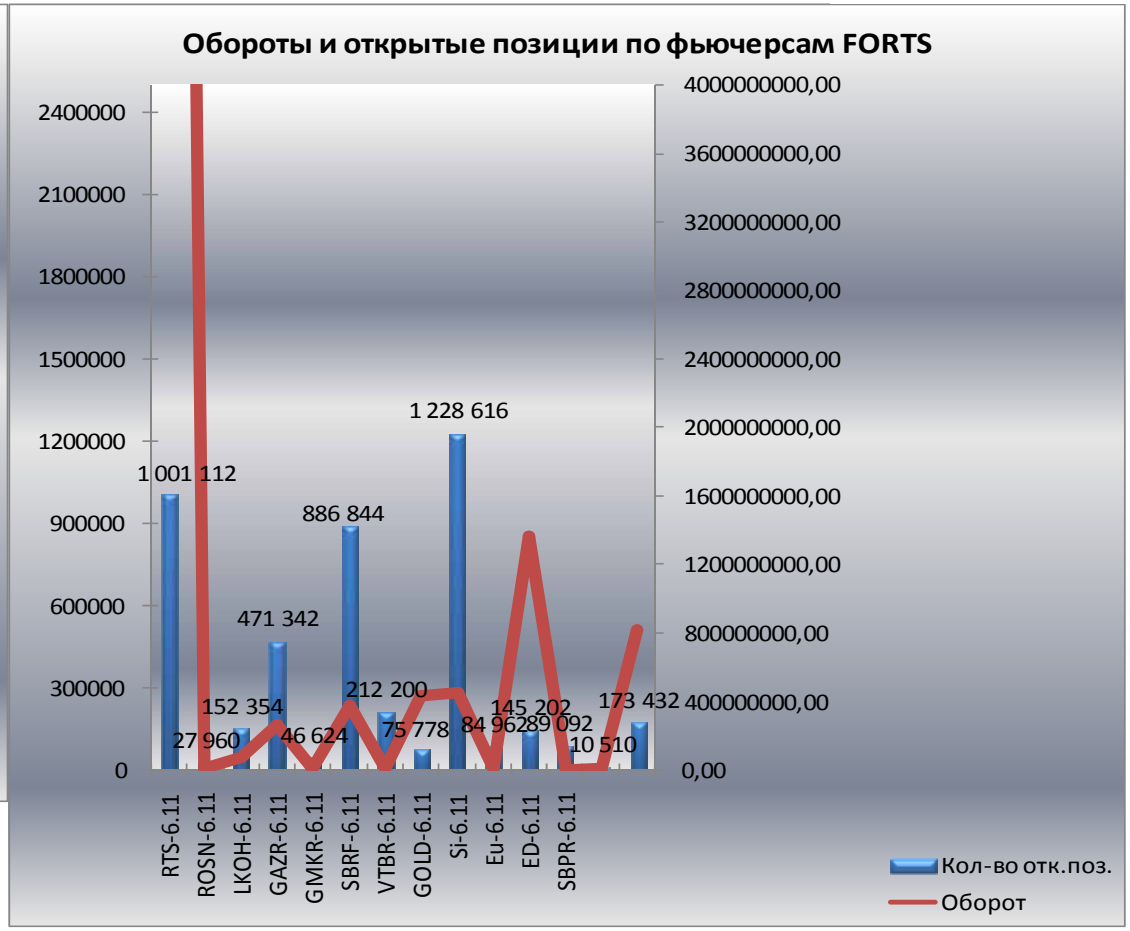

| | 1300 | 1350 | 1400 | 1450 | 1500 | 1550 | 1600 | 1650 | 1700 | 1750 | 1800 | 1850 | 1900 | 1950 | 2000 | 2050 | 2100 | 2150 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 0 | 0 | 0 | 4 | 0 | 2 | 98 | 1738 | 7804 | 9822 | 2614 | 41686 | 4272 | 5106 | 2082 | 2050 | 1448 |
| OI Put | 0 | 0 | 1724 | 30 | 40 | 8 | 720 | 2532 | 4922 | 6382 | 11844 | 3688 | 61994 | 6682 | 6690 | 4170 | 36 | 0 |
| IV | 165,67 | 157,831 | 146,308 | 130,93 | 112,222 | 91,446 | 70,407 | 51,095 | 35,229 | 23,904 | 17,739 | 17,517 | 23,302 | 33,802 | 47,322 | 62,303 | 77,464 | 91,853 |

## 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 | 10 | 248 | 10594 | 10504 | 42392 | 59288 | 63120 | 64130 | 33594 | 11916 | 8822 | 10914 | 12532 | 20848 | 8972 | 1082 | 1782 |
| OI Put | 168 | 1080 | 8080 | 20438 | 101590 | 15876 | 36400 | 74444 | 26158 | 48322 | 8456 | 12458 | 6362 | 4052 | 1332 | 92 | 200 | 22 | 0 | 0 |
| IV | 73,441 | 70,325 | 65,168 | 57,58 | 47,848 | 37,113 | 27,145 | 19,765 | 16,197 | 16,657 | 20,377 | 25,997 | 32,101 | 37,62 | 41,983 | 45,061 | 47,004 | 48,084 | 48,58 | 48,717 |


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
6,0%
RTS-6.11
82,2%
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
2400000
2100000
1800000
1500000
1200000
900000
600000
300000
0
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
1 001 112
27 960
152 354
471 342
46 624
886 844
212 200
75 778
1 228 616
84 962
145 202
89 092
10 510
173 432
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