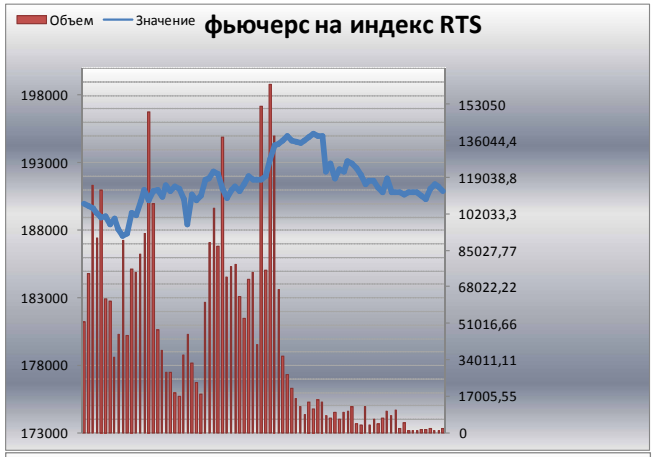
Рынок думает: «Куда идти дальше?»

Российские площадки во вторник оказались необычно вялыми, в то время когда Америка начала отыгрывать свое падения, да и европейские рынки прибавили 1,69%. Фьючерс РТС в течение дневной сессию вырос на 0,12%.

На вечерних торгах никакой аномальной волатильности не наблюдалось, рынок отыграл эту сессию в том же ритме, что и весь торговый день. Фьючерс РТС вырос 0,10%. Хотя, Америка в это время «нащупала» уровень сопротивления и оттолкнулась вверх. Фьючерс SPX вырос на 1,29%.

По итогам вечерних торгов во вторник можно видеть, что июльский фьючерс на Brent упал на -0,18%, в свою очередь Газпром прибавил +0,47%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на -0,10% и -0,13%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанка и ВТБ изменились на +0.08% и +0.06%.





	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	193085	1930,85	0,10	844 216	-0,21%	11 321 119 382	9,29%
ROSN-9.11	25050	250,50	0,00	21 146	238,88%	7 271 789	2,33%
LKOH-9.11	17913	1791,30	0,29	84 078	26,76%	55 311 377	3,01%
GAZR-9.11	21165	211,65	0,47	331 570	-6,19%	202 994 561	3,24%
GMKR-9.11	71101	7110,10	0,16	11 366	-64,48%	14 610 659	1,81%
SBRF-9.11	9902	99,02	0,08	546 692	-13,95%	239 745 734	5,46%
VTBR-9.11	8921	0,0892	0,06	141 010	38,25%	6 306 880	1,18%
GOLD-9.11	1532	1531,6000	0,30	59 444	-6,26%	164 322 468	47,40%
Si-9.11	28057	28,06	-0,10	824 014	18,03%	436 756 888	189,27%
Eu-9.11	40511	40,51	-0,13	94 006	182,10%	6 527 045	522,90%
ED-9.11	1,44	1,44	-0,19	131 618	28,28%	208 573 412	37,61%
SBPR-9.11	7391	73,91	-0,12	118 762	169,84%	2 285 787	1,40%
RTSS-9.11	11500	11500,00	0,06	2 116	-49,26%	4 476 435	39,54%
BR-7.11	119	119,15	-0,18	28 496	-82,82%	131 366 578	97,84%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	62204,83	0,29%	00:11:38
CAC 40	3864,58	1,50%	19:35:20
DAX 30	7204,79	1,69%	19:35:35
DJ Industrial	12076,11	1,03%	00:02:41
FTSE 100	5803,13	0,51%	19:35:35
Hang Seng	22496	-0,05%	12:01:15
Nikkei 225	9547,79	1,05%	10:00:02
S&P 500	1287,87	1,26%	00:03:08
Brent Crude Oil 0711	120,33	1,03%	00:40:47
Gold	1523,95	0,62%	00:42:05
Palladium	790,5	0,03%	00:40:04
Platinum	1791,07	-0,01%	00:42:08
RTSI	1 927,90	0,12%	23:50:00
RTS_Standard	11 452,42	0,14%	23:50:00
RTSI_DEREX	1923,44	-0,12%	18:45:00

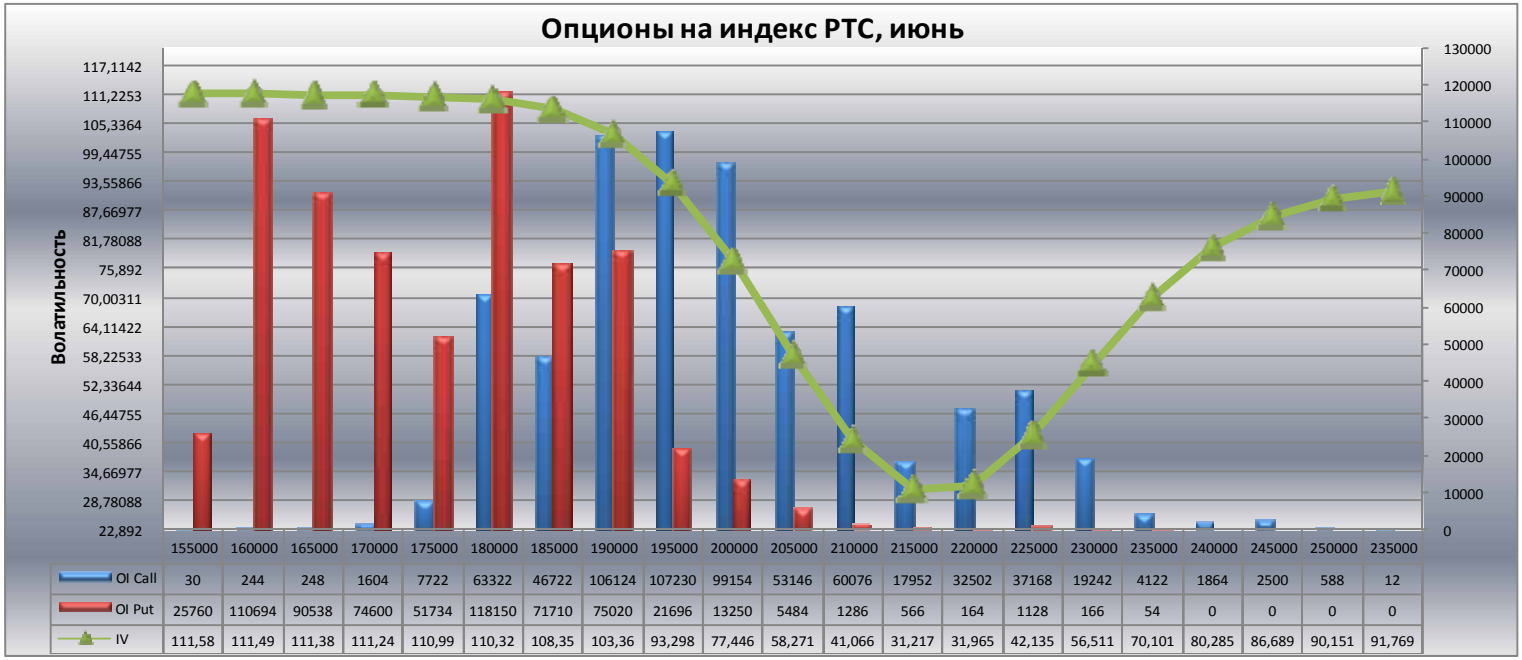
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,1	844216	11321119381,97	193085
ROSN-9.11	0	21146	7271789,00	25050
LKOH-9.11	0,29	84078	55311377,00	17913
GAZR-9.11	0,47	331570	202994561,00	21165
GMKR-9.11	0,16	11366	14610659,00	71101
SBRF-9.11	0,08	546692	239745734,00	9902
VTBR-9.11	0,06	141010	6306880,00	8921
GOLD-9.11	0,3	59444	164322467,54	1531,6
Si-9.11	-0,1	824014	436756888,00	28057
Eu-9.11	-0,13	94006	6527045,00	40511
ED-9.11	-0,19	131618	208573411,77	1,4413
SBPR-9.11	-0,12	118762	2285787,00	7391
RTSS-9.11	0,06	2116	4476435,00	11500
BR-7.11	-0,18	28496	131366577,96	119,15

Дневная сессия

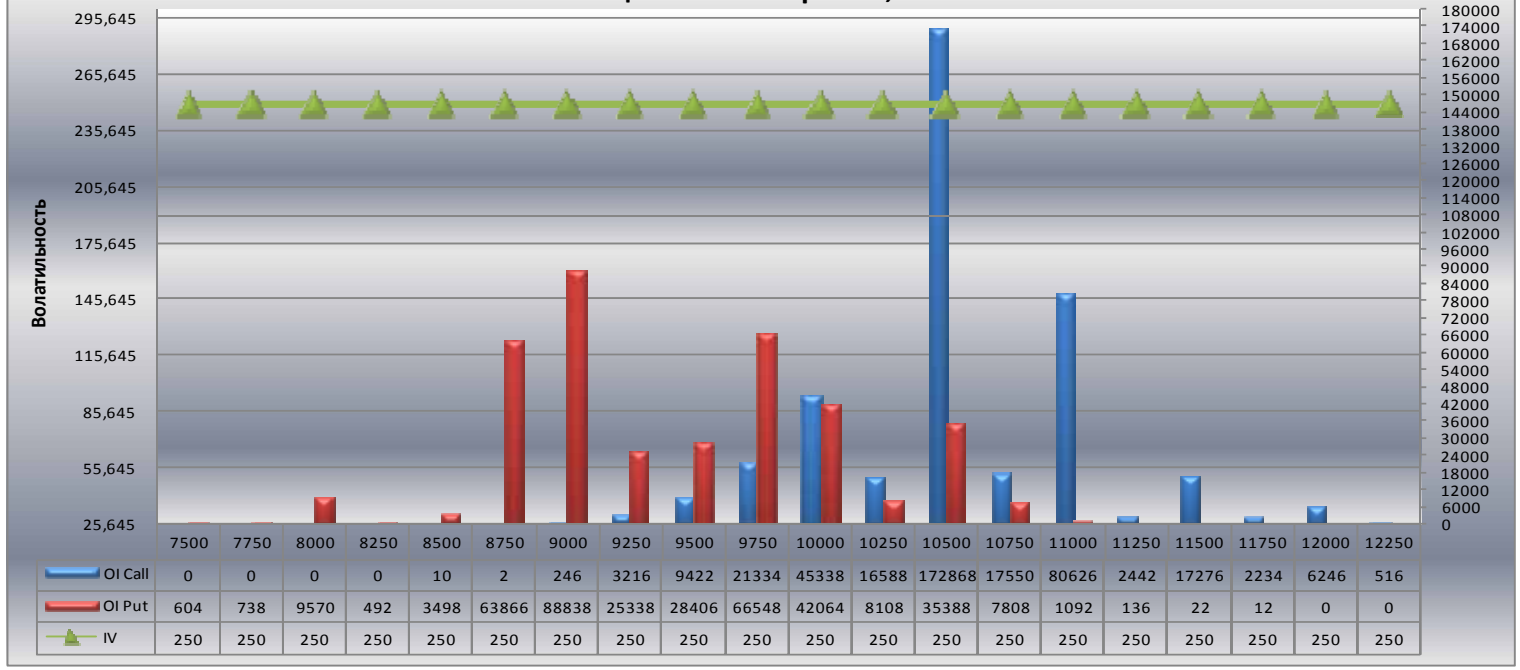
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-6.11	0,45	845994	121799139891,00	192890
ROSN-6.11	-0,01	6240	312163856,00	24840
LKOH-6.11	-0,91	66330	1839094624,00	17736
GAZR-6.11	-0,28	353458	6261299559,00	20837
GMKR-6.11	-0,97	32000	807408159,00	70460
SBRF-6.11	0,05	635316	4392117976,00	9770
VTBR-6.11	-0,54	101996	532421550,00	8830
GOLD-6.11	0,27	63412	346640659,18	1526,2
Si-6.11	0	698128	230755858,00	27818
Eu-6.11	-0,19	33324	1248228,00	40200
ED-6.11	-0,18	102602	554501816,01	1,4456
SBPR-6.11	0,71	44012	163043842,00	7329
RTSS-6.11	0,13	4170	11321750,00	11445
BR-6.11	-0,21	165886	134267810,30	119,91

Опционы на индекс РТС, июнь

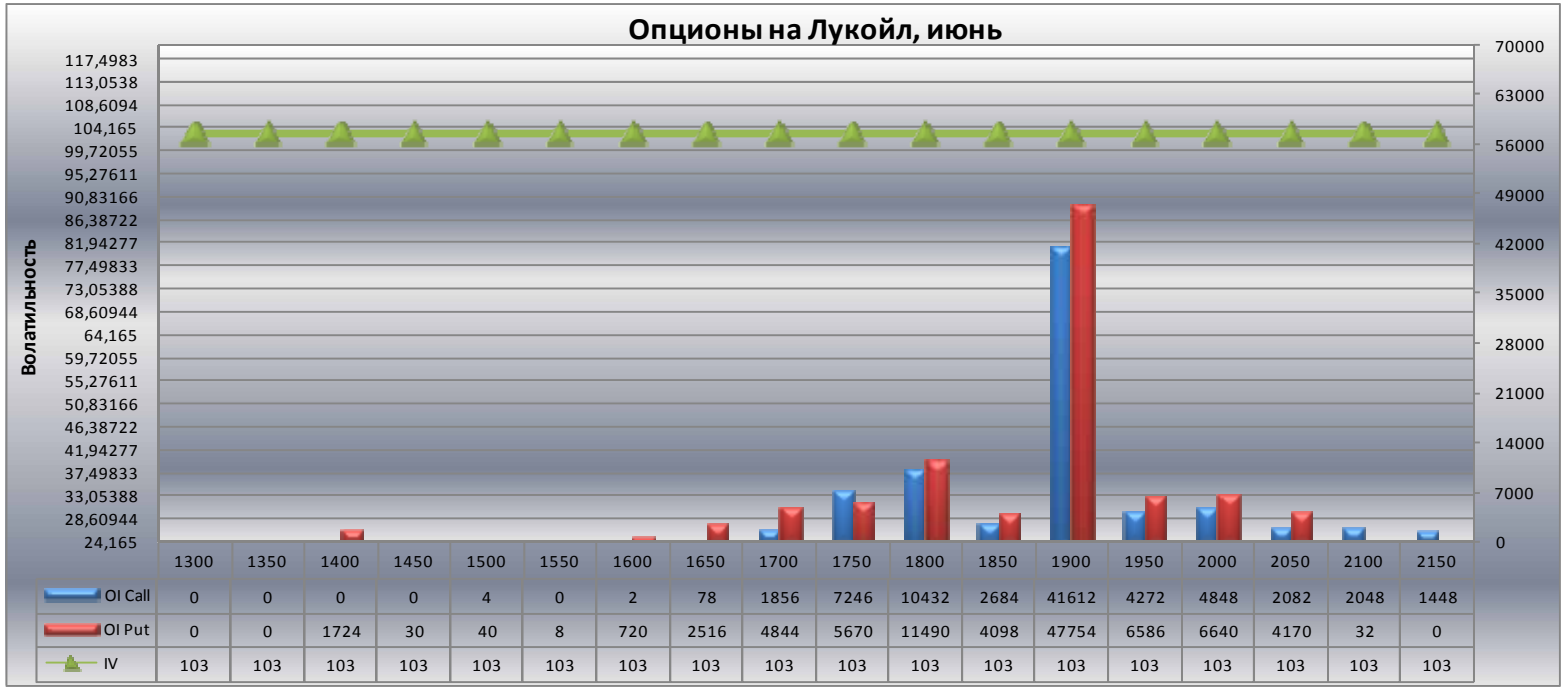


	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	225000	230000	235000	240000	245000	250000	235000
OI Call	30	244	248	1604	7722	63322	46722	106124	107230	99154	53146	60076	17952	32502	37168	19242	4122	1864	2500	588	12
OI Put	25760	110694	90538	74600	51734	118150	71710	75020	21696	13250	5484	1286	566	164	1128	166	54	0	0	0	0
IV	111,58	111,49	111,38	111,24	110,99	110,32	108,35	103,36	93,298	77,446	58,271	41,066	31,217	31,965	42,135	56,511	70,101	80,285	86,689	90,151	91,769

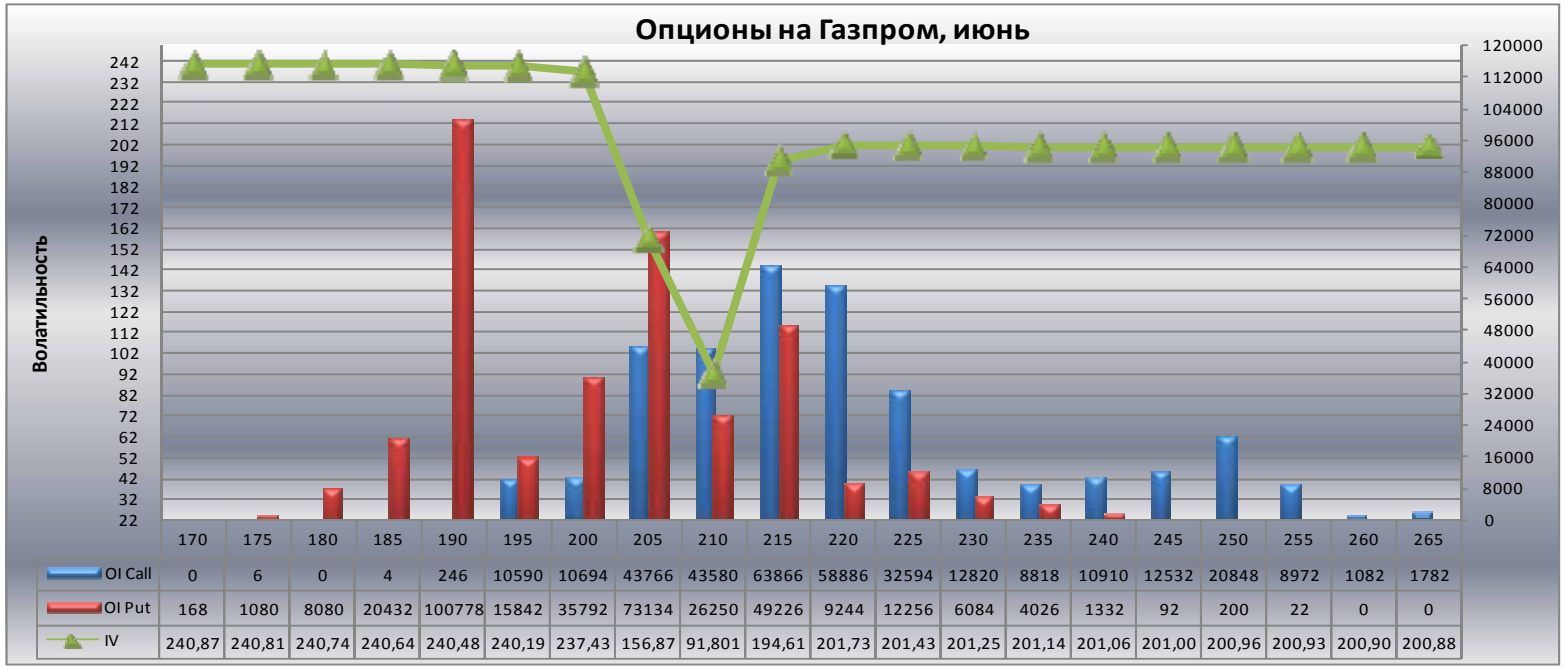
Опционы на Сбербанк, июнь



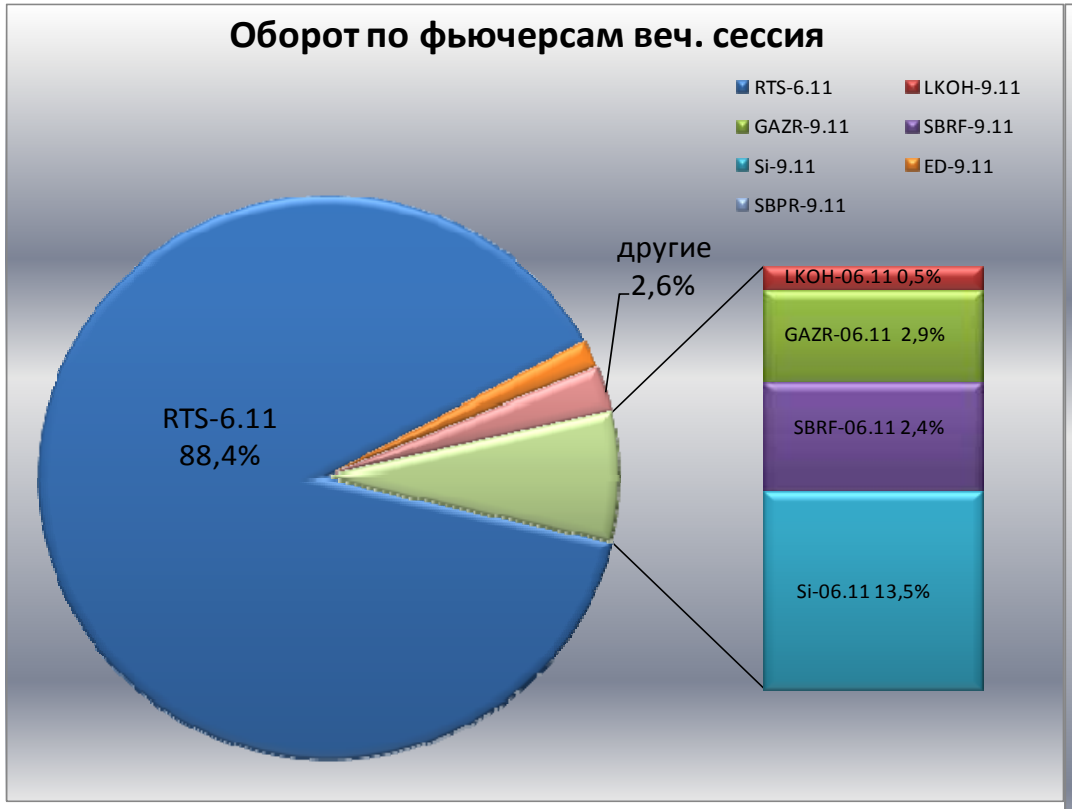
	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750	12000	12250
OI Call	0	0	0	0	10	2	246	3216	9422	21334	45338	16588	172868	17550	80626	2442	17276	2234	6246	516
OI Put	604	738	9570	492	3498	63866	88838	25338	28406	66548	42064	8108	35388	7808	1092	136	22	12	0	0
IV	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250	250

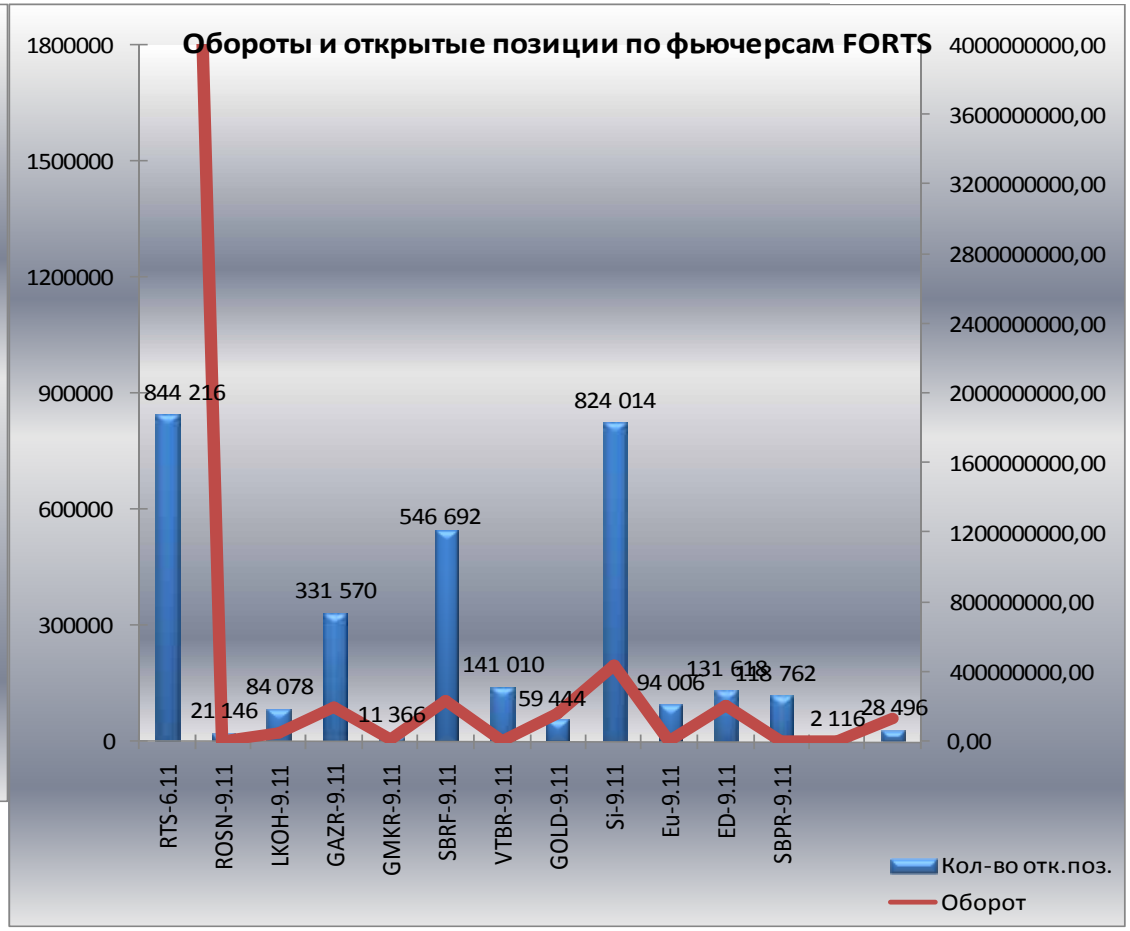


	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100	2150
OI Call	0	0	0	0	4	0	2	78	1856	7246	10432	2684	41612	4272	4848	2082	2048	1448
OI Put	0	0	1724	30	40	8	720	2516	4844	5670	11490	4098	47754	6586	6640	4170	32	0
IV	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103	103



	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	4	246	10590	10694	43766	43580	63866	58886	32594	12820	8818	10910	12532	20848	8972	1082	1782
OI Put	168	1080	8080	20432	100778	15842	35792	73134	26250	49226	9244	12256	6084	4026	1332	92	200	22	0	0
IV	240,87	240,81	240,74	240,64	240,48	240,19	237,43	156,87	91,801	194,61	201,73	201,43	201,25	201,14	201,06	201,00	200,96	200,93	200,90	200,88


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-6.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
SBRF-9.11
Si-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11
другие
2,6%
RTS-6.11
88,4%
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
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
844 216
21 146
84 078
331 570
11 366
546 692
141 010
59 444
824 014
94 006
131 618
118 762
2 116
28 496
RTS-6.11
ROSN-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
GMKR-9.11
SBRF-9.11
VTBR-9.11
GOLD-9.11
Si-9.11
Eu-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11
Кол-во отк.поз.
Оборот