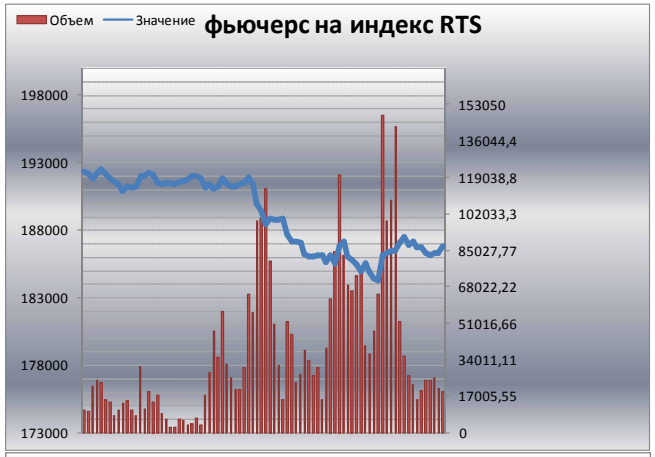
На Российском фондовом рынке коррекция.

На российских площадках в четверг медведи были гораздо сильнее быков. По техническому анализу, рынок начал формировать второй горб. К концу торговой сессии, быки собрались с силами и отыграли почти половину нисходящего движения рынка. Фьючерс РТС в течение дневной сессию упал на—0,94%.

На вечерних торгах никакой аномальной волатильности не наблюдалось, рынок еще немного просел вниз. Фьючерс РТС упал 0,28%. В Америке, в это время, было боковое движение рынка. Фьючерс SPX вырос на 0,17%.
По итогам вечерних торгов в четверг можно видеть, что июльский фьючерс на Brent вырос на 0,25%, в свою очередь Лукойл упал на –0,28%, а Газпром упал –0,22%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в июне двинулись на -0,08% и +0,10%, акции ведущих банковских компаний таких, как Сбербанка и ВТБ изменились на –0,27% и -0.16%.





	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-9.11	186770	1867,70	-0,15	583 294	0,44%	24 667 562 968	13,62%
ROSN-9.11	24896	248,96	-0,35	24 234	-0,11%	7 148 573	1,85%
LKOH-9.11	17820	1782,00	-0,28	94 876	0,87%	60 509 156	4,93%
GAZR-9.11	20618	206,18	-0,22	401 836	0,45%	335 436 773	4,92%
GMKR-9.11	70377	7037,70	-0,27	16 854	-0,17%	6 909 357	1,15%
SBRF-9.11	9775	97,75	-0,27	576 478	-0,80%	473 516 692	7,50%
VTBR-9.11	8900	0,0890	-0,16	155 876	0,09%	6 189 482	1,99%
GOLD-9.11	1535	1534,5000	0,05	89 040	1,19%	206 608 894	10,81%
Si-9.11	28400	28,40	-0,08	1 183 882	-0,04%	933 446 982	3,86%
Eu-9.11	40200	40,20	0,10	101 290	0,02%	2 972 348	4,54%
ED-9.11	1,42	1,42	0,16	174 544	-0,38%	1 751 180 439	15,71%
SBPR-9.11	7252	72,52	-0,29	126 130	0,26%	2 698 608	3,44%
RTSS-9.11	11380	11379,50	-0,13	7 528	-0,16%	19 127 220	3,51%
BR-7.11	114	114,08	0,25	48 306	13,35%	825 438 470	21,85%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	60880,62	-1,17%	00:13:46
CAC 40	3792,31	-0,38%	19:35:26
DAX 30	7110,2	-0,07%	19:35:39
DJ Industrial	11961,52	0,54%	00:50:31
FTSE 100	5698,81	-0,76%	19:35:39
Hang Seng	21876,32	-0,35%	08:00:17
Nikkei 225	9334,1	-0,82%	09:15:01
S&P 500	1267,64	0,18%	00:03:44
Brent Crude Oil 0711	117,1	0,00%	01:04:57
Gold	1526,45	-0,16%	09:15:01
Palladium	757	0,54%	09:15:07
Platinum	1762,25	0,57%	09:15:07
RTSI	1 891,86	-0,26%	23:50:00
RTS_Standard	11 318,96	-0,28%	23:50:00
RTSI_DEREX	1929,83	-0,94%	18:45:00

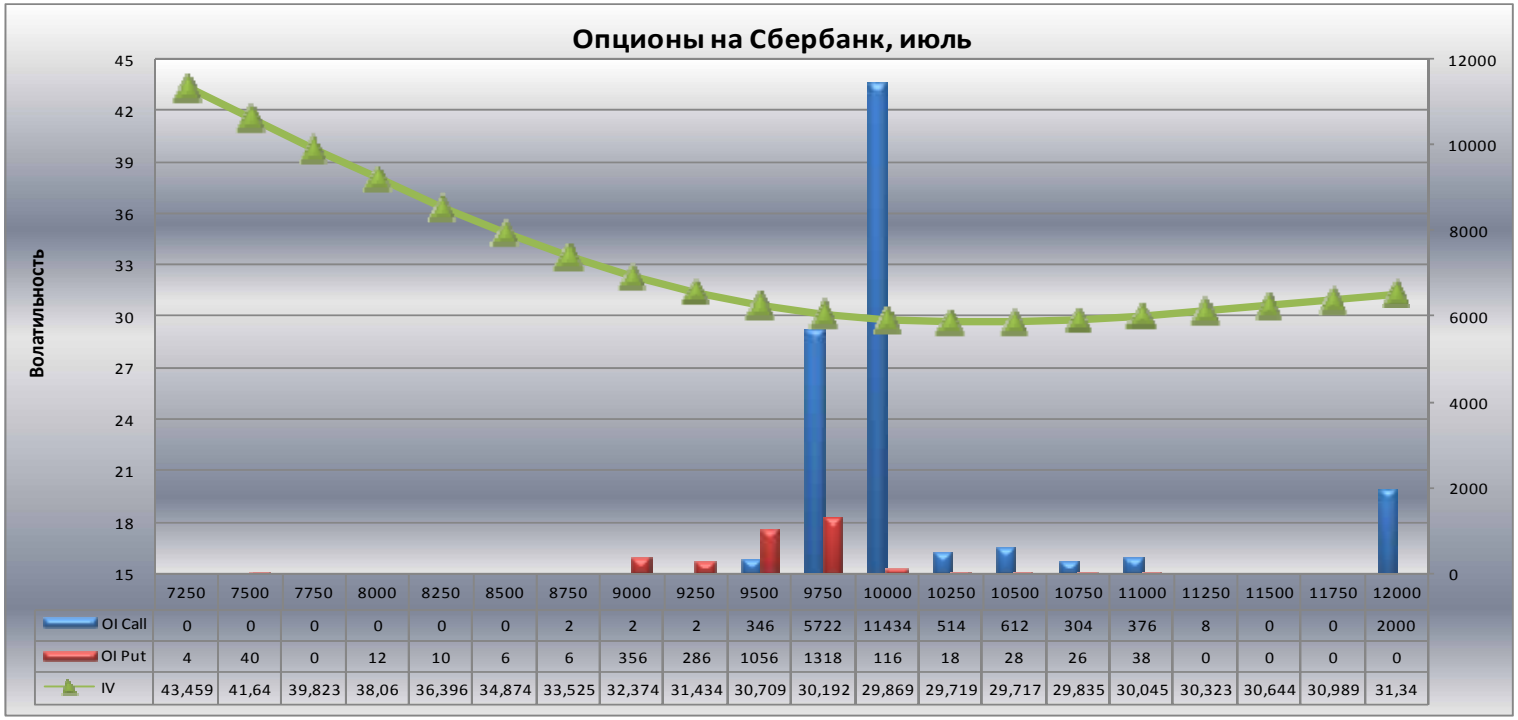
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,15	583294	24667562968,07	186770
ROSN-9.11	-0,35	24234	7148573,00	24896
LKOH-9.11	-0,28	94876	60509156,00	17820
GAZR-9.11	-0,22	401836	335436773,00	20618
GMKR-9.11	-0,27	16854	6909357,00	70377
SBRF-9.11	-0,27	576478	473516692,00	9775
VTBR-9.11	-0,16	155876	6189482,00	8900
GOLD-9.11	0,05	89040	206608894,23	1534,5
Si-9.11	-0,08	1183882	933446982,00	28400
Eu-9.11	0,1	101290	2972348,00	40200
ED-9.11	0,16	174544	1751180439,13	1,4153
SBPR-9.11	-0,29	126130	2698608,00	7252
RTSS-9.11	-0,13	7528	19127220,00	11379,5
BR-7.11	0,25	48306	825438469,53	114,08

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-9.11	-0,89	580738	181049990009,67	187045
ROSN-9.11	0,63	24260	386989268,00	24983
LKOH-9.11	-0,11	94056	1226408698,00	17870
GAZR-9.11	-0,83	400028	6816384424,00	20664
GMKR-9.11	-0,28	16882	599397489,00	70558
SBRF-9.11	-0,72	581146	6311548270,00	9801
VTBR-9.11	0,08	155732	310595375,00	8914
GOLD-9.11	-0,18	87996	1910546456,13	1533,7
Si-9.11	0,67	1184362	24175440597,00	28422
Eu-9.11	-0,1	101266	65421432,00	40158
ED-9.11	-0,76	175208	11149327968,93	1,413
SBPR-9.11	-0,11	125808	78504143,00	7273
RTSS-9.11	-0,54	7540	545678365,00	11394,5
BR-7.11	-2,98	42616	3777699073,61	113,8


Опционы на индекс РТС, июль
Волатильность
57,892
52,892
47,892
42,892
37,892
32,892
27,892
22,892
60000
48000
36000
24000
12000
0
145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 225000 230000 235000 240000 245000
OI Call 0 4 12 4 4 6 200 748 6318 58756 23286 29644 12188 22836 1616 386 242 0 0 0 0
OI Put 184 1964 436 15096 15780 20534 13238 58550 12586 6956 776 80 34 24 2 0 2 0 0 0 0
IV 48,16 42,954 41,333 39,574 37,727 35,848 33,994 32,219 30,572 29,093 27,812 26,749 25,912 25,299 24,897 24,686 24,638 24,725 24,917 25,186 25,507

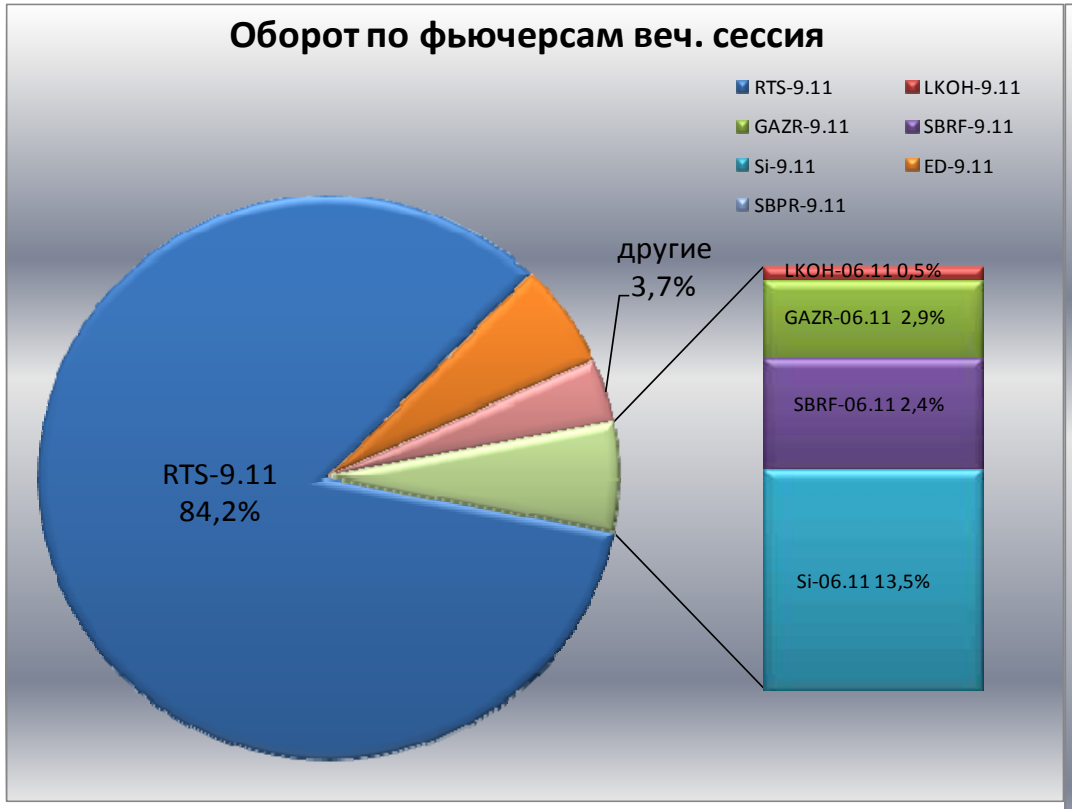

Опционы на Сбербанк, июль
Волатильность
45
42
39
36
33
30
27
24
21
18
15
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750 12000
OI Call 0 0 0 0 0 0 2 2 2 346 5722 11434 514 612 304 376 8 0 0 2000
OI Put 4 40 0 12 10 6 6 356 286 1056 1318 116 18 28 26 38 0 0 0 0
IV 43,459 41,64 39,823 38,06 36,396 34,874 33,525 32,374 31,434 30,709 30,192 29,869 29,719 29,717 29,835 30,045 30,323 30,644 30,989 31,34

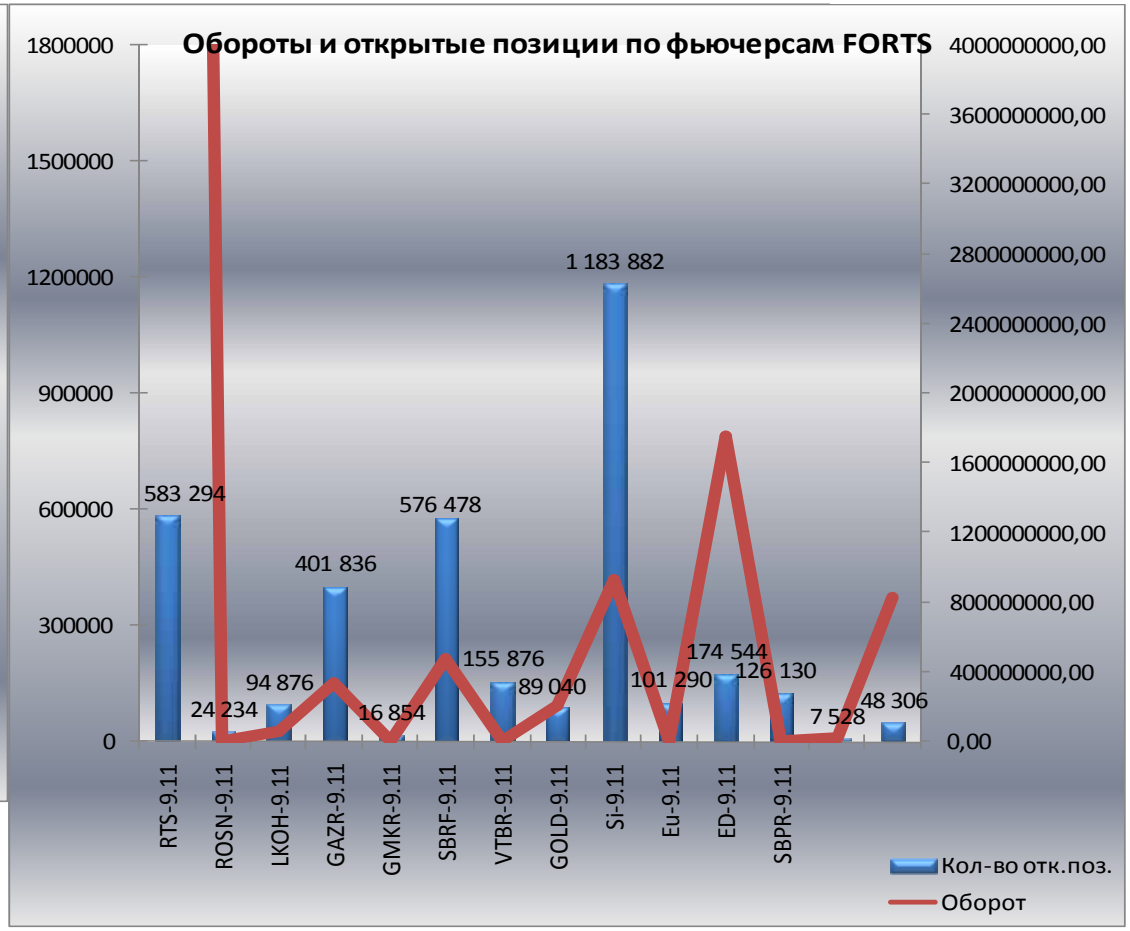


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	60	100	208	162	208	8	2	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	114	90	184	444	274	116	20	12	0	2	0
IV	40,667	38,649	36,553	34,459	32,447	30,587	28,935	27,536	26,415	25,579	25,02	24,712	24,623	24,71	24,931	25,246	25,619	26,02



	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225	230	235	240	245
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	2	0	4	398	512	12374	822	888	590	56	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	10	18	114	106	336	12876	642	132	42	88	10	14	0	0	0
IV	39,579	37,645	35,784	34,046	32,474	31,101	29,952	29,037	28,358	27,904	27,657	27,593	27,681	27,891	28,194	28,56	28,966	29,39	29,815	30,228


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-9.11
LKOH-9.11
GAZR-9.11
SBRF-9.11
Si-9.11
ED-9.11
SBPR-9.11
другие
3,7%
RTS-9.11
84,2%
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
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
583 294
24 234
94 876
401 836
16 854
576 478
155 876
89 040
1 183 882
101 290
174 544
126 130
7 528
48 306
RTS-9.11
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