Дневной рост, вечерний рост

Российские площадки в четверг всю вторую половину дневной сессии находились во власти негативных настроений, в вечернюю сессию негативные настроения тоже одержали верх. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы показали уверенное падение, оказавшись в последствии в небольшом минусе к закрытию, что способствовало падению котировок на российских рынках в позднюю дневную сессию и усилило падение в вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –0.17% и –0.16%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 0.22% до уровня в 1586,7 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок оказалась падающая цена на нефть и в целом негативная статистика из США.

На вечерних торгах господствовали в негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,29%. Октябрьские фьючерсы на Brent упали на 1.47%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок «принял к сведению», в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ изменились на -0,28% и -0,26%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,12% и -0,07%, на что не было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.50% и –0.86%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на -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-12.10	157185	1571,85	-0,29	477 302	-0,49%	14 388 534 123	15,41%
ROSN-12.10	20845	208,45	0,07	35 682	0,15%	5 122 556	1,59%
LKOH-12.10	17443	1744,30	-0,26	161 946	0,02%	27 443 783	3,41%
GAZR-12.10	16260	162,60	-0,28	728 976	-0,22%	150 964 547	5,72%
GMKR-12.10	53000	5300,00	-0,60	25 718	0,30%	8 617 279	2,33%
SBRF-12.10	9043	90,43	-0,50	976 462	-0,98%	450 767 740	7,56%
VTBR-12.10	9011	0,0901	-0,86	76 604	0,22%	10 057 669	15,27%
GOLD-12.10	1339	1338,9000	-0,16	62 476	0,00%	861 687 986	34,20%
Si-12.10	29999	30,00	0,12	605 944	-2,91%	789 971 878	5,03%
Eu-12.10	41669	41,67	-0,07	129 870	0,00%	2 209 876	1,40%
ED-12.10	1,39	1,39	-0,12	253 778	0,62%	1 138 209 212	8,87%
SBPR-12.10	6365	63,65	-0,30	204 558	-0,05%	3 327 085	2,14%
RTSS-12.10	10030	10030,00	-0,16	7 694	-85,14%	17 664 595	0,94%
BR-10.10	83	83,03	-1,47	52 620	590,01%	601 280 621	63,59%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69918,4	-0,88%	06:02:34
CAC 40	3770,47	0,15%	19:35:16
DAX 30	6276,25	0,09%	06:24:40
DJ Industrial	10948,58	-0,17%	00:50:58
FTSE 100	5662,13	-0,34%	07:27:29
Hang Seng	23056,69	0,75%	08:30:02
Nikkei 225	9588,88	-0,99%	10:00:03
S&P 500	1158,06	-0,16%	09:42:01
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1332,45	-0,04%	10:05:20
Palladium	583	0,58%	10:05:10
Platinum	1691,25	-0,02%	10:05:10
RTSI	1 582,23	-0,13%	23:50:00
RTS_Standard	10 022,35	-0,16%	23:50:00
RTSI_DEREX	1586,7	0,22%	18:45:00

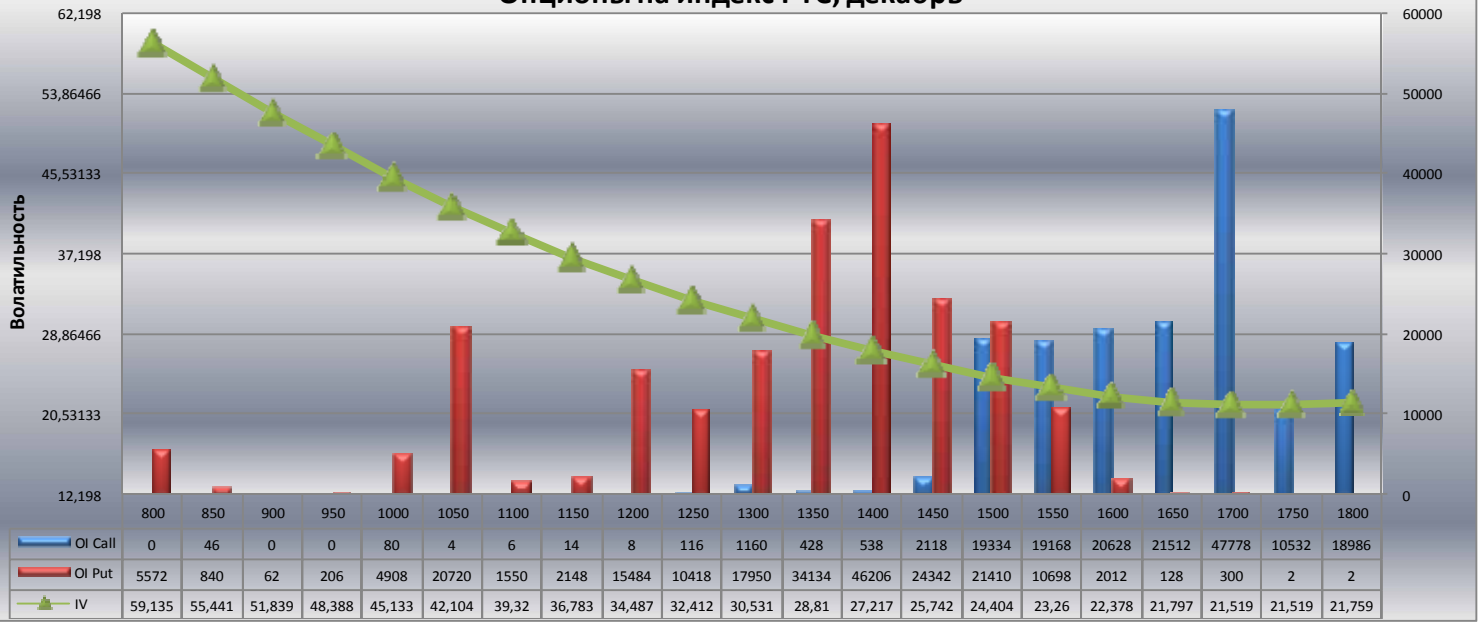
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,29	477302	14388534122,73	157185
ROSN-12.10	0,07	35682	5122556,00	20845
LKOH-12.10	-0,26	161946	27443783,00	17443
GAZR-12.10	-0,28	728976	150964547,00	16260
GMKR-12.10	-0,6	25718	8617279,00	53000
SBRF-12.10	-0,5	976462	450767740,00	9043
VTBR-12.10	-0,86	76604	10057669,00	9011
GOLD-12.10	-0,16	62476	861687986,10	1338,9
Si-12.10	0,12	605944	789971878,00	29999
Eu-12.10	-0,07	129870	2209876,00	41669
ED-12.10	-0,12	253778	1138209212,14	1,3905
SBPR-12.10	-0,3	204558	3327085,00	6365
RTSS-12.10	-0,16	7694	17664595,00	10030
BR-10.10	-1,47	52620	601280621,02	83,03

Дневная сессия

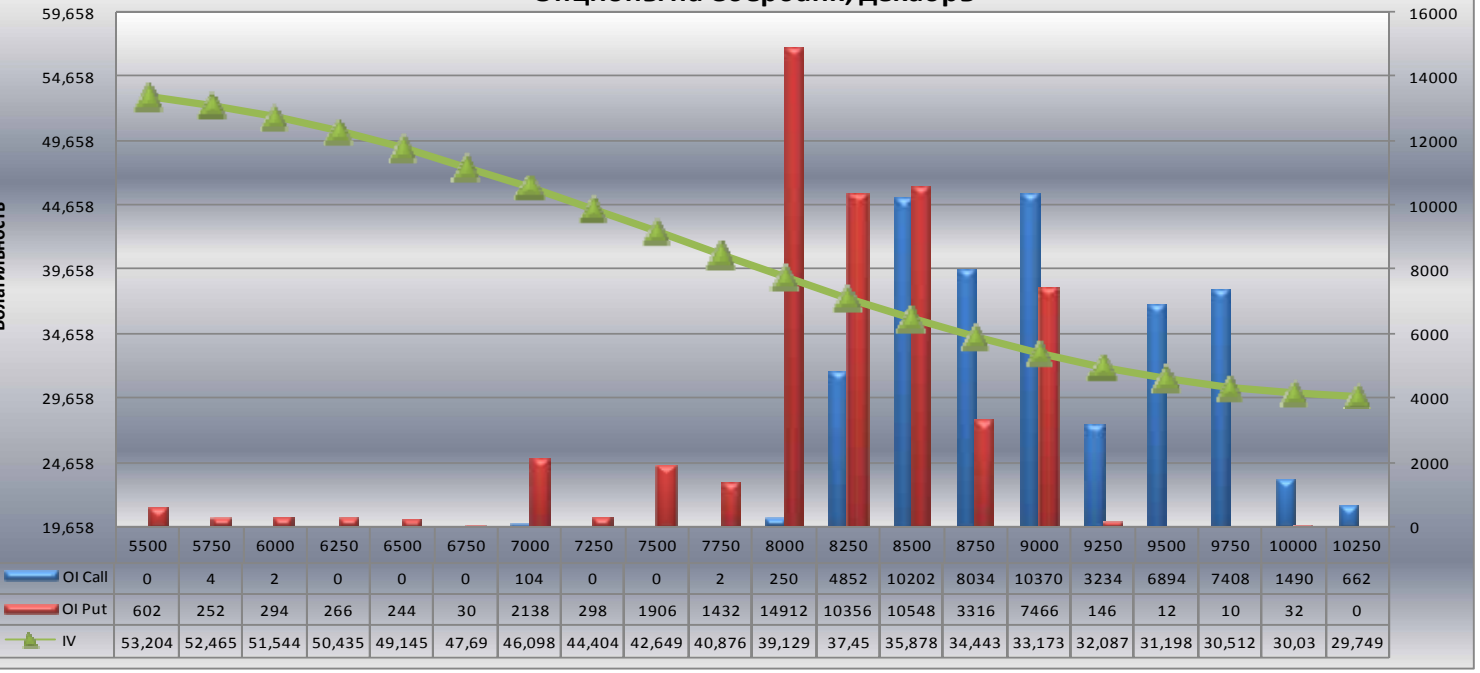
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,28	479670	93351697789,58	157645
ROSN-12.10	-1,2	35630	321557389,00	20831
LKOH-12.10	-0,99	161916	805424352,00	17489
GAZR-12.10	-0,46	730582	2640879481,00	16305
GMKR-12.10	0,54	25640	369808597,00	53319
SBRF-12.10	-0,74	986172	5962013266,00	9088
VTBR-12.10	-0,48	76436	65886701,00	9089
GOLD-12.10	-0,75	62476	2519414756,11	1341,1
Si-12.10	0,07	624128	15700189088,00	29963
Eu-12.10	0,34	129868	157889575,00	41700
ED-12.10	0,3	252208	12836532839,72	1,3922
SBPR-12.10	0,06	204660	155648807,00	6384
RTSS-12.10	-0,38	7626	945523495,00	10046
BR-10.10	-0,89	51768	1887169486,19	84,27

Опционы на индекс РТС, декабрь



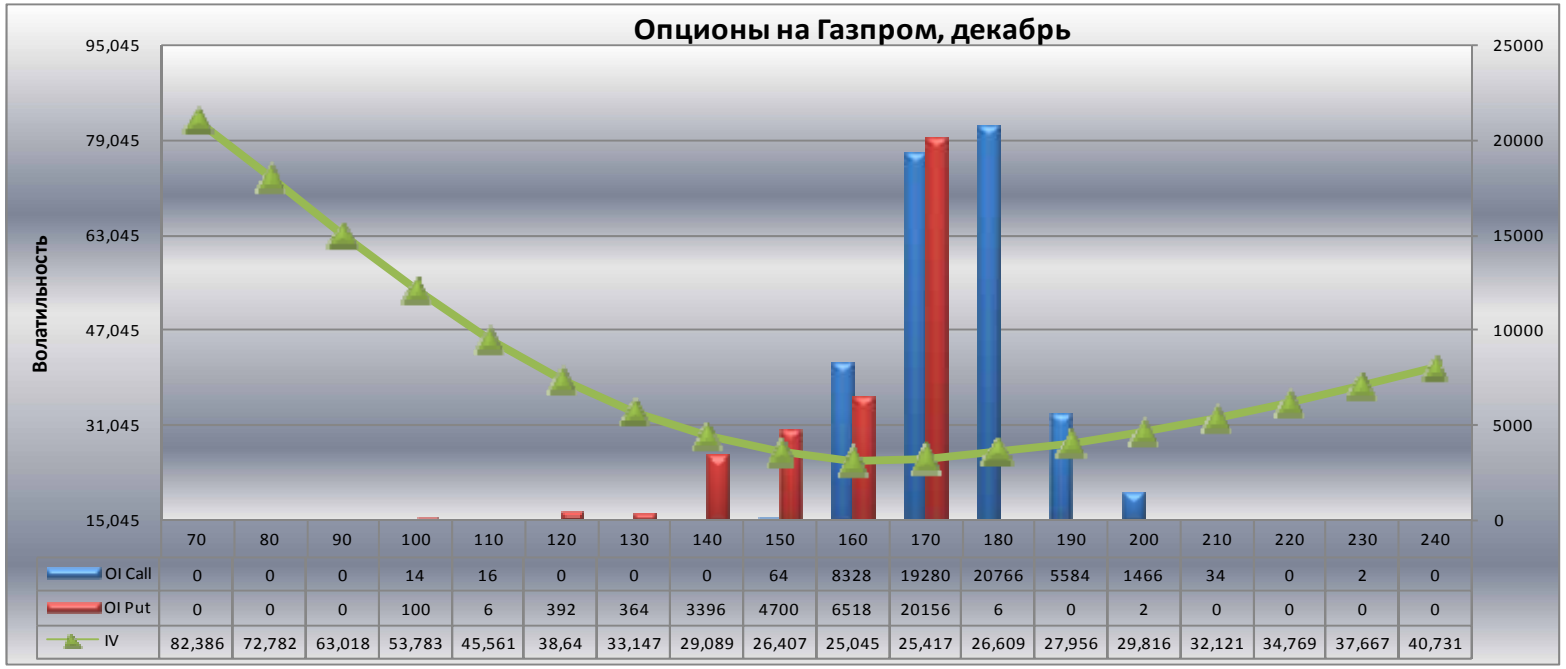
	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	6	14	8	116	1160	428	538	2118	19334	19168	20628	21512	47778	10532	18986
OI Put	5572	840	62	206	4908	20720	1550	2148	15484	10418	17950	34134	46206	24342	21410	10698	2012	128	300	2	2
IV	59,135	55,441	51,839	48,388	45,133	42,104	39,32	36,783	34,487	32,412	30,531	28,81	27,217	25,742	24,404	23,26	22,378	21,797	21,519	21,519	21,759

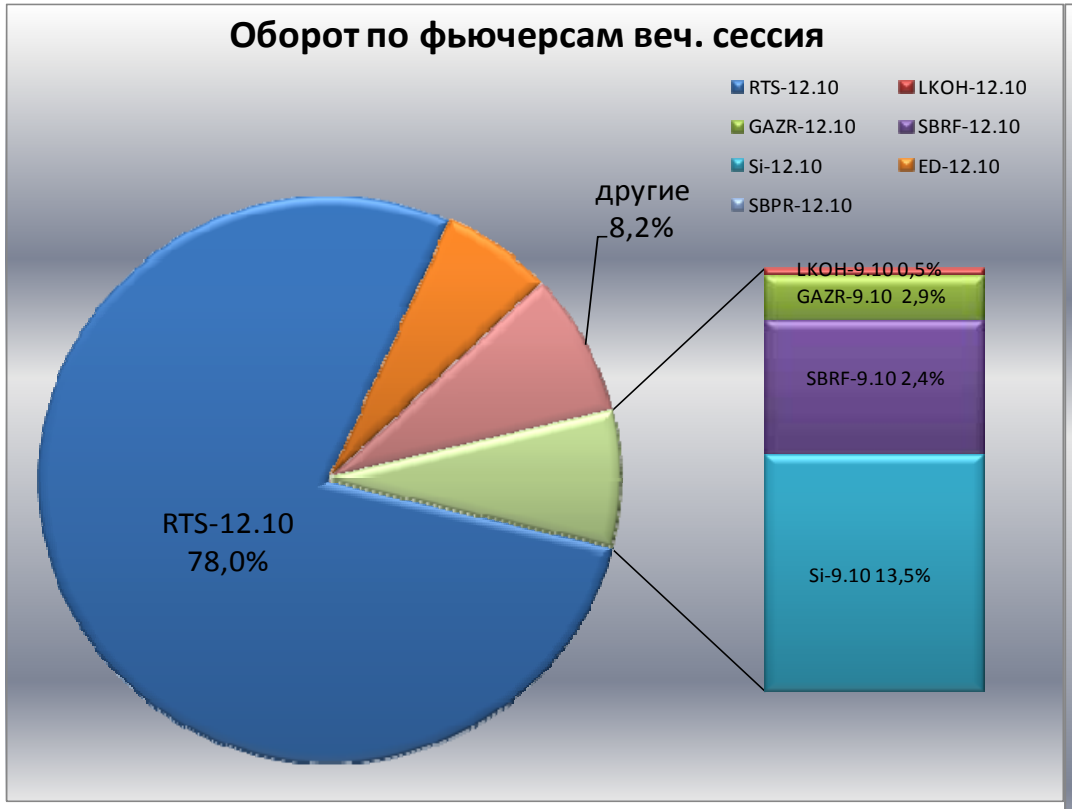
Опционы на Сбербанк, декабрь

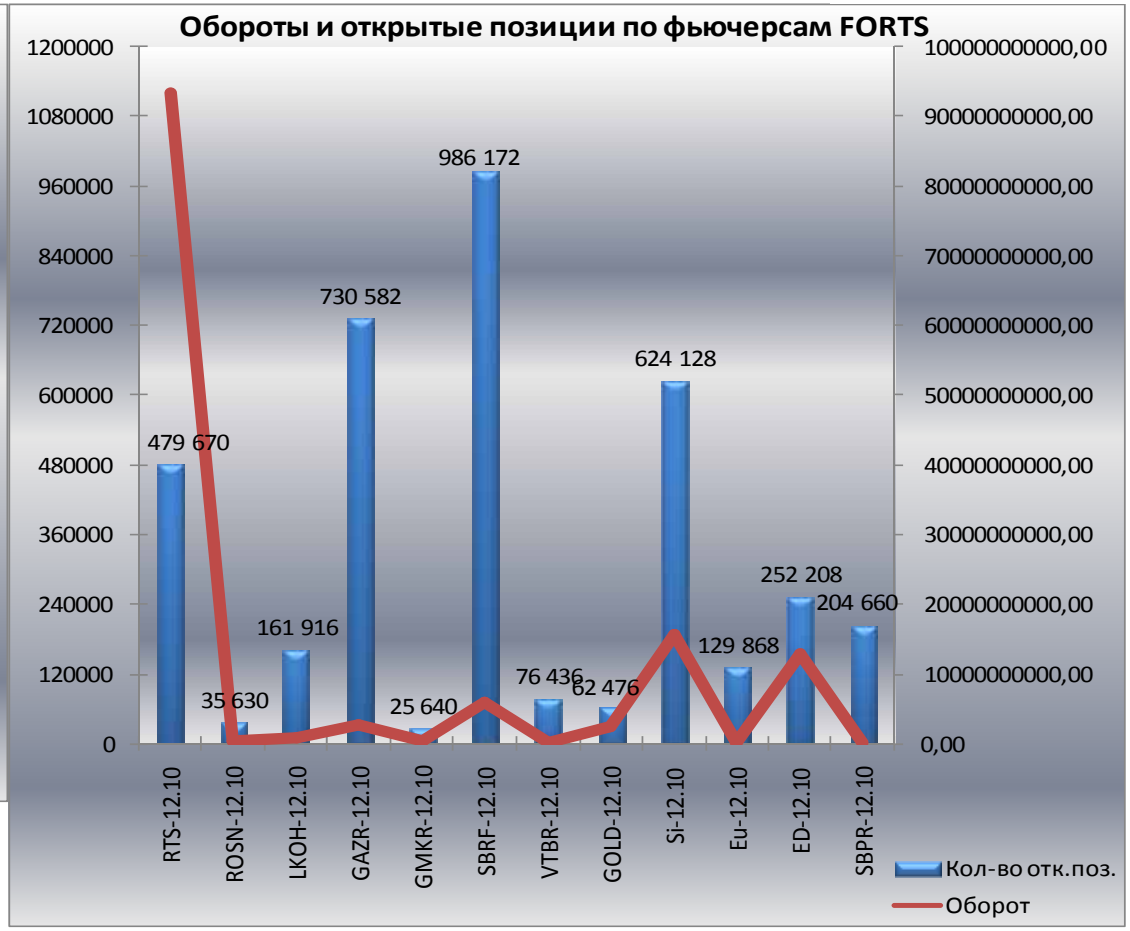


	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250
OI Call	0	4	2	0	0	0	104	0	0	2	250	4852	10202	8034	10370	3234	6894	7408	1490	662
OI Put	602	252	294	266	244	30	2138	298	1906	1432	14912	10356	10548	3316	7466	146	12	10	32	0
IV	53,204	52,465	51,544	50,435	49,145	47,69	46,098	44,404	42,649	40,876	39,129	37,45	35,878	34,443	33,173	32,087	31,198	30,512	30,03	29,749


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
39,698
37,03133
34,36466
31,698
29,03133
26,36466
23,698
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
900 1000 1100 1200 1300 1400 1500 1600 1700 1800 1900 2000 2100 2200 2300 2400 2500
OI Call 0 0 0 0 0 2 0 78 2310 10984 1512 180 30 260 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 2 94 602 4010 1942 18 0 0 0 0 0 0 0
IV 34,993 33,279 30,951 28,013 25,92 24,981 24,7 24,774 25,058 25,479 25,994 26,577 27,209 27,877 28,572 29,286 30,014 30,751


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
95,045
79,045
63,045
47,045
31,045
15,045
25000
20000
15000
10000
5000
0
70 80 90 100 110 120 130 140 150 160 170 180 190 200 210 220 230 240
OI Call 0 0 0 14 16 0 0 0 64 8328 19280 20766 5584 1466 34 0 2 0
OI Put 0 0 0 100 6 392 364 3396 4700 6518 20156 6 0 2 0 0 0 0
IV 82,386 72,782 63,018 53,783 45,561 38,64 33,147 29,089 26,407 25,045 25,417 26,609 27,956 29,816 32,121 34,769 37,667 40,731


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-12.10
LKOH-12.10
GAZR-12.10
SBRF-12.10
Si-12.10
ED-12.10
SBPR-12.10
другие
8,2%
RTS-12.10
78,0%
LKOH-9.10 0,5%
GAZR-9.10 2,9%
SBRF-9.10 2,4%
Si-9.10 13,5%


Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
1200000
1080000
960000
840000
720000
600000
480000
360000
240000
120000
0
100000000000,00
90000000000,00
80000000000,00
70000000000,00
60000000000,00
50000000000,00
40000000000,00
30000000000,00
20000000000,00
10000000000,00
0,00
479 670
35 630
161 916
730 582
25 640
986 172
76 436
62 476
624 128
129 868
252 208
204 660
RTS-12.10
ROSN-12.10
LKOH-12.10
GAZR-12.10
GMKR-12.10
SBRF-12.10
VTBR-12.10
GOLD-12.10
Si-12.10
Eu-12.10
ED-12.10
SBPR-12.10
Кол-во отк.поз.
Оборот