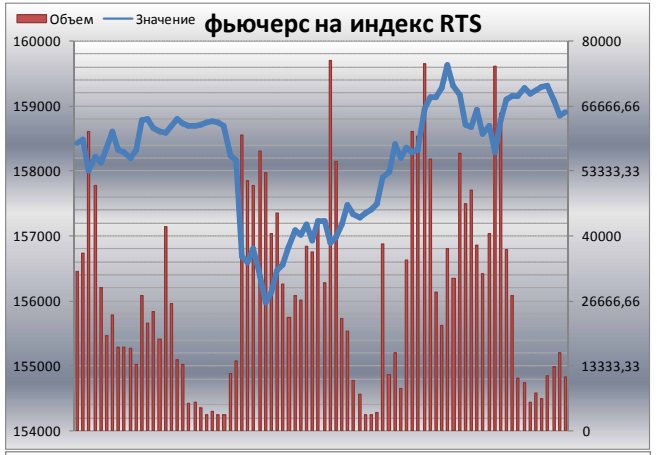
Дневной рост, вечерняя коррекция

Российские площадки в среду всю дневную сессию находились во власти позитивных настроений, в вечернюю сессию позитивные настроения сменились негативными и рынок показал слабое падение. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали рост, оказавшись в умеренном плюсе, что должно было способствовать росту котировок на российских рынках в позднюю дневную сессию и усилить рост в вечернюю сессию, чего не произошло. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на 0.69% и 0.71%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 1.00% до уровня в 1587,86 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась растущая цена на нефть.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,13%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.14%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок «не принял к сведению», в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ изменились на -0,12% и -0,11%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,01% и -0,02%, на что отчасти было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.04% и –0.20%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на -0.12%.





	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	158900	1589,00	-0,13	468 230	1,15%	11 490 249 098	12,27%
ROSN-12.10	21350	213,50	0,21	37 262	0,80%	11 906 660	5,95%
LKOH-12.10	17891	1789,10	-0,12	170 414	-0,02%	26 410 629	2,46%
GAZR-12.10	16522	165,22	-0,11	752 700	0,23%	118 193 360	4,33%
GMKR-12.10	53808	5380,80	0,01	28 326	-0,20%	6 571 051	2,58%
SBRF-12.10	9180	91,80	0,04	1 045 382	-0,20%	303 115 719	4,81%
VTBR-12.10	9204	0,0920	-0,20	88 826	0,18%	2 261 848	2,13%
GOLD-12.10	1375	1375,1000	-0,12	58 136	-13,70%	397 922 289	22,11%
Si-12.10	30222	30,22	0,01	843 212	-0,34%	422 168 327	2,50%
Eu-12.10	42140	42,14	-0,02	128 204	-0,02%	5 353 721	1,69%
ED-12.10	1,40	1,40	0,19	246 262	6,45%	2 342 524 557	24,36%
SBPR-12.10	6598	65,98	0,17	220 456	0,09%	2 765 209	1,25%
RTSS-12.10	10212	10212,00	-0,13	8 454	118,79%	4 083 705	64,69%
BR-12.10	85	85,05	0,14	3 892	-54,05%	1 102 461	0,14%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	71674,9	1,03%	06:02:43
CAC 40	3828,34	2,12%	05:34:53
DAX 30	6434,52	2,06%	06:24:26
DJ Industrial	11096,08	0,69%	00:50:57
FTSE 100	5747,35	1,51%	04:01:58
Hang Seng	23704,7	1,05%	08:30:02
Nikkei 225	9583,51	1,91%	10:08:01
S&P 500	1178,1	0,71%	09:41:49
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1379,37	0,54%	10:12:36
Palladium	598,25	1,24%	10:12:29
Platinum	1708	0,34%	10:12:29
RTSI	1 590,58	0,11%	23:50:00
RTS_Standard	10 205,28	0,02%	23:50:00
RTSI_DEREX	1587,86	1,00%	18:45:00

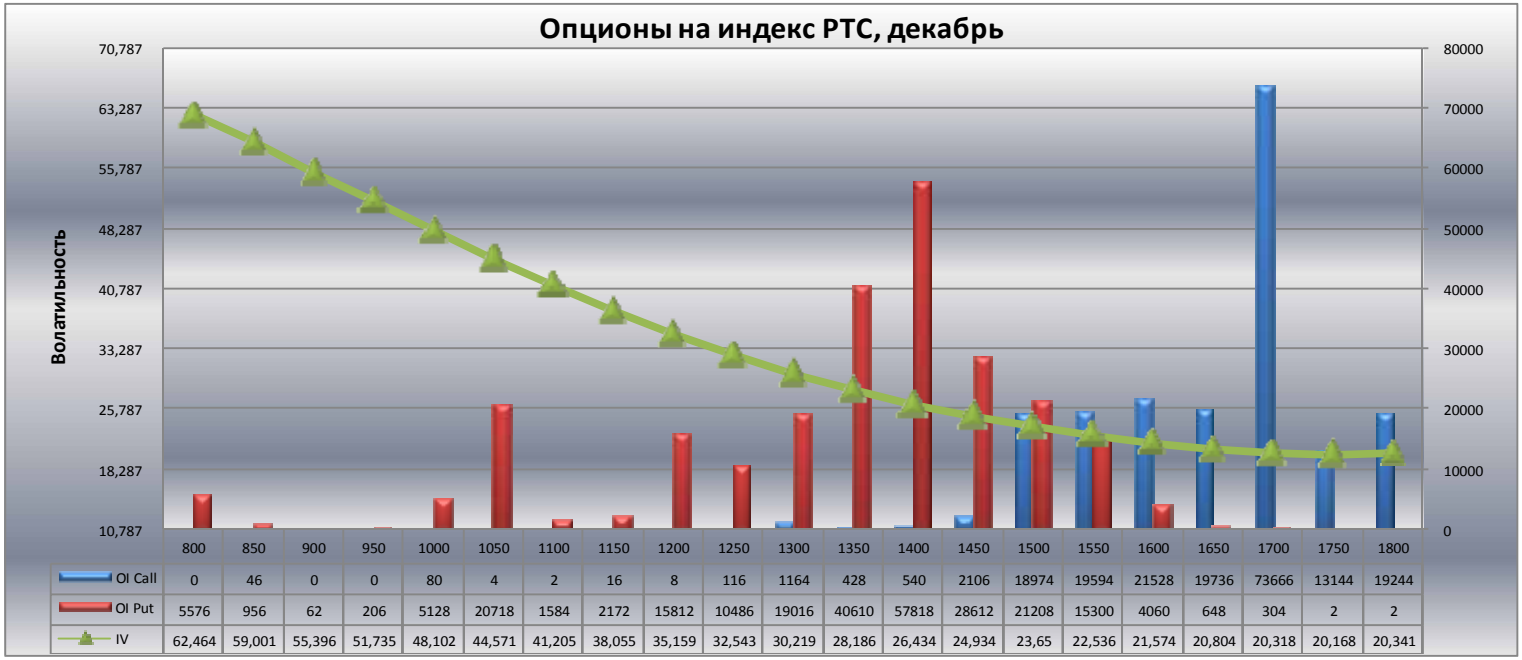
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,13	468230	11490249098,20	158900
ROSN-12.10	0,21	37262	11906660,00	21350
LKOH-12.10	-0,12	170414	26410629,00	17891
GAZR-12.10	-0,11	752700	118193360,00	16522
GMKR-12.10	0,01	28326	6571051,00	53808
SBRF-12.10	0,04	1045382	303115719,00	9180
VTBR-12.10	-0,2	88826	2261848,00	9204
GOLD-12.10	-0,12	58136	397922289,32	1375,1
Si-12.10	0,01	843212	422168327,00	30222
Eu-12.10	-0,02	128204	5353721,00	42140
ED-12.10	0,19	246262	2342524557,10	1,3956
SBPR-12.10	0,17	220456	2765209,00	6598
RTSS-12.10	-0,13	8454	4083705,00	10212
BR-12.10	0,14	3892	1102460,65	85,05

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	1,22	462914	93639256432,47	159100
ROSN-12.10	-0,21	36966	200254061,00	21305
LKOH-12.10	1,46	170448	1071452305,00	17913
GAZR-12.10	1,09	750976	2731548691,00	16540
GMKR-12.10	0,19	28382	254918170,00	53800
SBRF-12.10	0,43	1047454	6303360228,00	9176
VTBR-12.10	1,58	88670	106014605,00	9221
GOLD-12.10	1,81	67362	1799332738,26	1376,8
Si-12.10	-0,19	846088	16888356555,00	30218
Eu-12.10	0,78	128232	317189427,00	42150
ED-12.10	0,72	231344	9617014400,79	1,393
SBPR-12.10	2,17	220266	222057434,00	6587
RTSS-12.10	1,01	8470	764855355,00	10225,5
BR-12.10	1,24	3864	6313037,52	84,93

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	2	16	8	116	1164	428	540	2106	18974	19594	21528	19736	73666	13144	19244
OI Put	5576	956	62	206	5128	20718	1584	2172	15812	10486	19016	40610	57818	28612	21208	15300	4060	648	304	2	2
IV	62,464	59,001	55,396	51,735	48,102	44,571	41,205	38,055	35,159	32,543	30,219	28,186	26,434	24,934	23,65	22,536	21,574	20,804	20,318	20,168	20,341

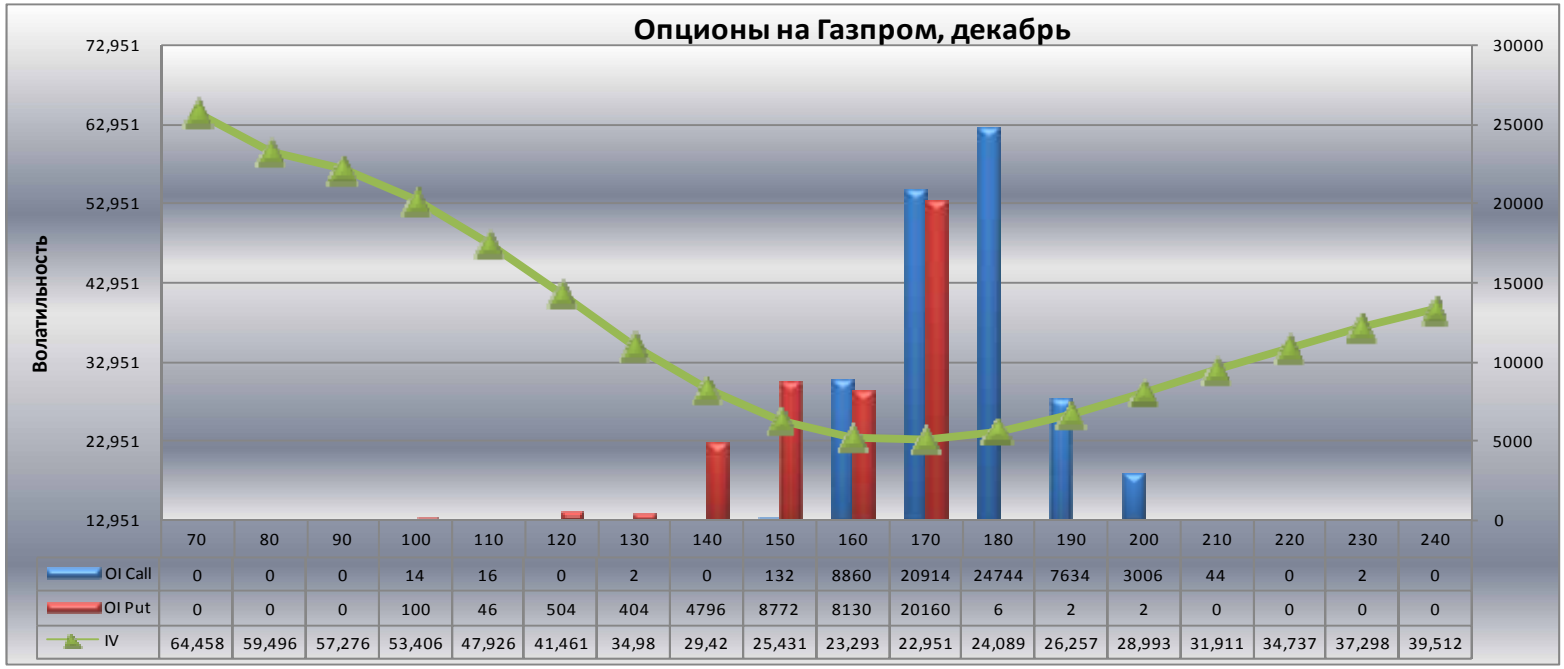
Опционы на Сбербанк, декабрь



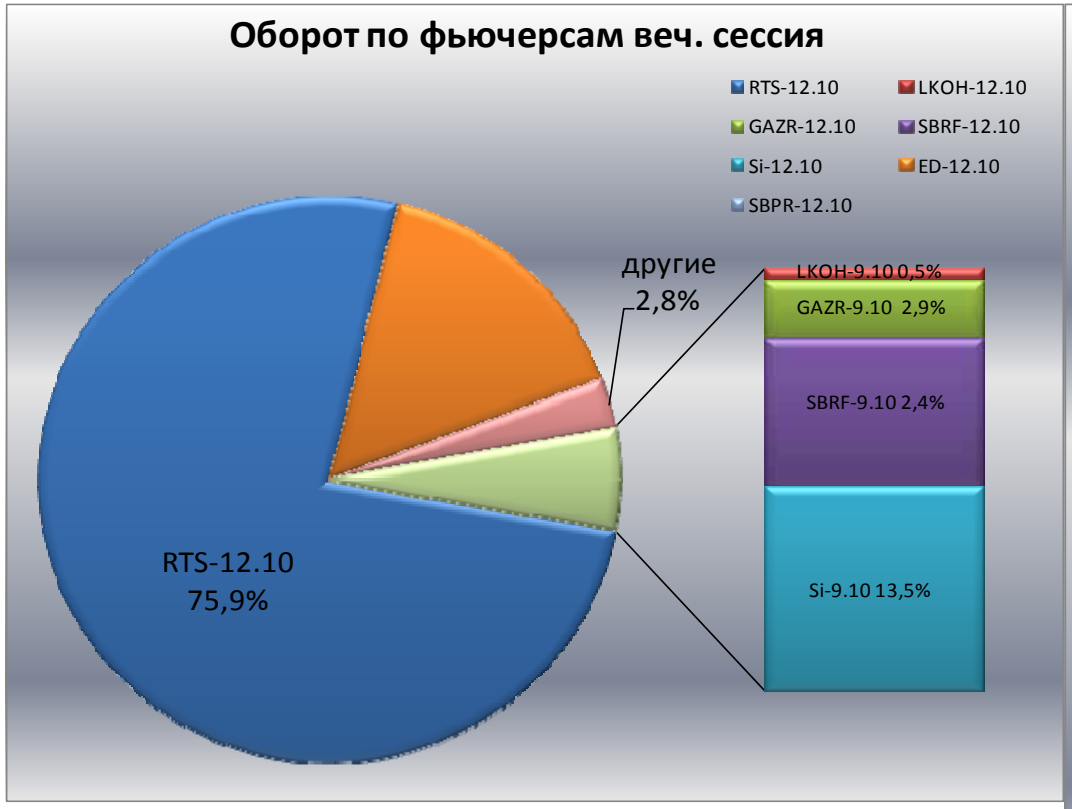
	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250
OI Call	0	4	2	0	0	0	104	0	0	2	248	4852	10182	8034	10760	4538	7084	8922	1984	678
OI Put	602	270	514	266	246	30	2168	298	2604	3096	14932	10748	11732	13678	8272	594	12	10	60	0
IV	56,915	54,896	52,715	50,431	48,103	45,788	43,54	41,4	39,399	37,55	35,852	34,291	32,852	31,543	30,417	29,559	29,034	28,853	28,981	29,369

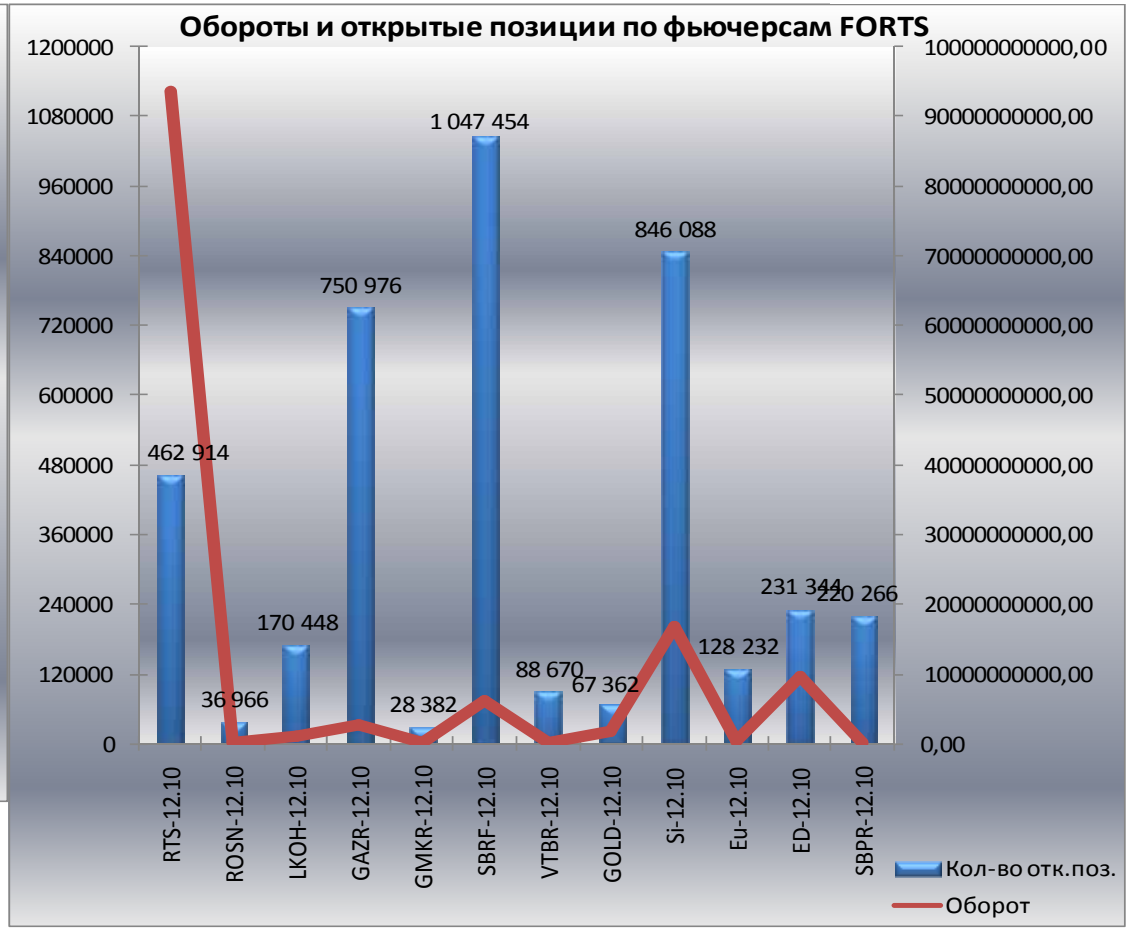


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	2636	14796	1562	178	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	2	94	964	6984	2162	18	0	0	0	0	0	0	0
IV	74,067	65,246	57,217	50,063	43,791	38,367	33,737	29,853	26,679	24,188	22,354	21,143	20,505	20,378	20,693	21,38	22,374	23,613



	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	2	0	132	8860	20914	24744	7634	3006	44	0	2	0
OI Put	0	0	0	100	46	504	404	4796	8772	8130	20160	6	2	2	0	0	0	0
IV	64,458	59,496	57,276	53,406	47,926	41,461	34,98	29,42	25,431	23,293	22,951	24,089	26,257	28,993	31,911	34,737	37,298	39,512


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
2,8%
RTS-12.10
75,9%
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
462 914
36 966
170 448
750 976
28 382
1 047 454
88 670
67 362
846 088
128 232
231 344
220 266
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