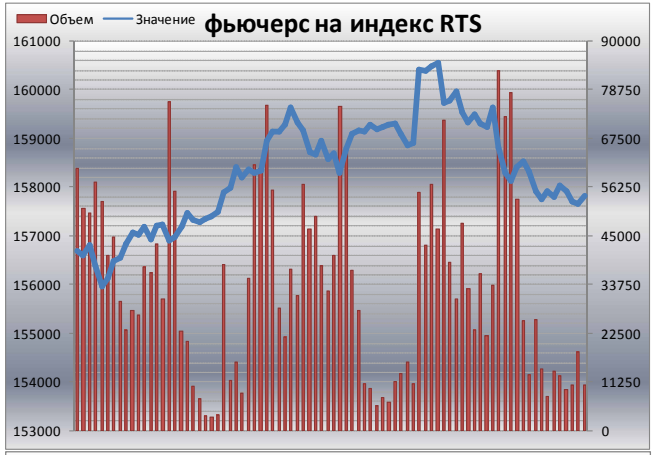
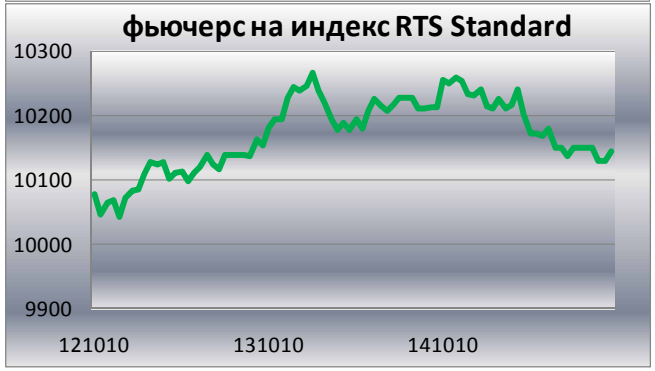
Падение в обе сессии.

Российские площадки в четверг начало дневной сессии находились во власти позитивных настроений, но в середине сессии негативные настроения возобладали, в вечернюю сессию также возобладали негативные настроения и рынок показал несильное падение. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали падение, оказавшись в умеренном минусе, что способствовать 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 -0.01% и -0.36%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.19% до уровня в 1584,88 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась падающая цена на нефть и негативные данные по безработице в США.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,45%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 0.73%, 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 -0,31% и -0,32%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,12% и 0,12%, на что отчасти было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.77% и –0.56%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на 0.22%.





	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	157825	1578,25	-0,45	459 040	1,24%	12 954 032 928	13,85%
ROSN-12.10	21053	210,53	-0,54	37 092	-0,10%	5 872 181	1,88%
LKOH-12.10	17935	1793,50	-0,32	176 012	-0,54%	46 212 566	5,20%
GAZR-12.10	16225	162,25	-0,31	771 192	-0,54%	172 949 214	6,12%
GMKR-12.10	53940	5394,00	-0,26	31 668	1,35%	27 246 385	7,05%
SBRF-12.10	9110	91,10	-0,77	1 043 538	0,41%	491 673 649	8,52%
VTBR-12.10	9090	0,0909	-0,56	84 440	-0,04%	1 646 132	1,87%
GOLD-12.10	1384	1384,1000	0,22	64 954	1,90%	266 518 144	11,75%
Si-12.10	30202	30,20	0,12	756 104	-0,11%	334 153 009	2,27%
Eu-12.10	42500	42,50	0,12	134 906	0,16%	14 306 958	5,46%
ED-12.10	1,41	1,41	-0,08	217 182	-0,77%	1 367 231 753	11,24%
SBPR-12.10	6525	65,25	-0,62	213 770	-0,27%	6 779 067	5,72%
RTSS-12.10	10144	10144,00	-0,37	7 984	103,26%	2 232 145	42,15%
BR-12.10	85	84,55	-0,73	3 898	-51,14%	5 490 602	0,91%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	71692,29	0,02%	06:02:48
CAC 40	3819,17	-0,24%	19:35:15
DAX 30	6455,27	0,32%	07:06:56
DJ Industrial	11094,57	-0,01%	00:51:03
FTSE 100	5727,21	-0,35%	07:54:46
Hang Seng	23747,36	-0,44%	08:30:03
Nikkei 225	9502,26	-0,85%	09:56:03
S&P 500	1173,81	-0,36%	09:44:25
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1380,75	0,06%	09:56:14
Palladium	597,25	-0,12%	09:56:11
Platinum	1703,25	-0,05%	09:56:11
RTSI	1 580,49	-0,41%	23:50:00
RTS_Standard	10 112,47	-0,44%	23:50:00
RTSI_DEREX	1584,88	-0,19%	18:45:00

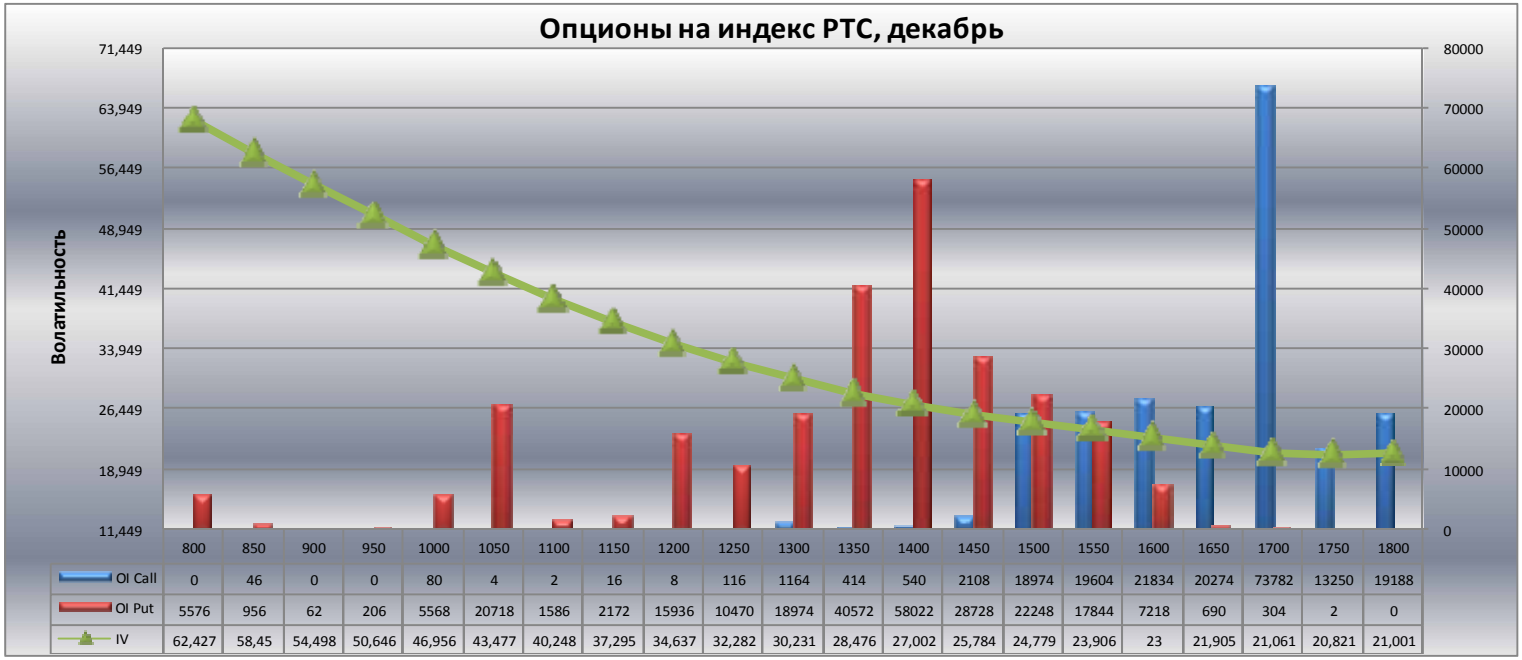
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,45	459040	12954032928,23	157825
ROSN-12.10	-0,54	37092	5872181,00	21053
LKOH-12.10	-0,32	176012	46212566,00	17935
GAZR-12.10	-0,31	771192	172949214,00	16225
GMKR-12.10	-0,26	31668	27246385,00	53940
SBRF-12.10	-0,77	1043538	491673649,00	9110
VTBR-12.10	-0,56	84440	1646132,00	9090
GOLD-12.10	0,22	64954	266518144,08	1384,1
Si-12.10	0,12	756104	334153009,00	30202
Eu-12.10	0,12	134906	14306958,00	42500
ED-12.10	-0,08	217182	1367231752,68	1,406
SBPR-12.10	-0,62	213770	6779067,00	6525
RTSS-12.10	-0,37	7984	2232145,00	10144
BR-12.10	-0,73	3898	5490602,05	84,55

Дневная сессия

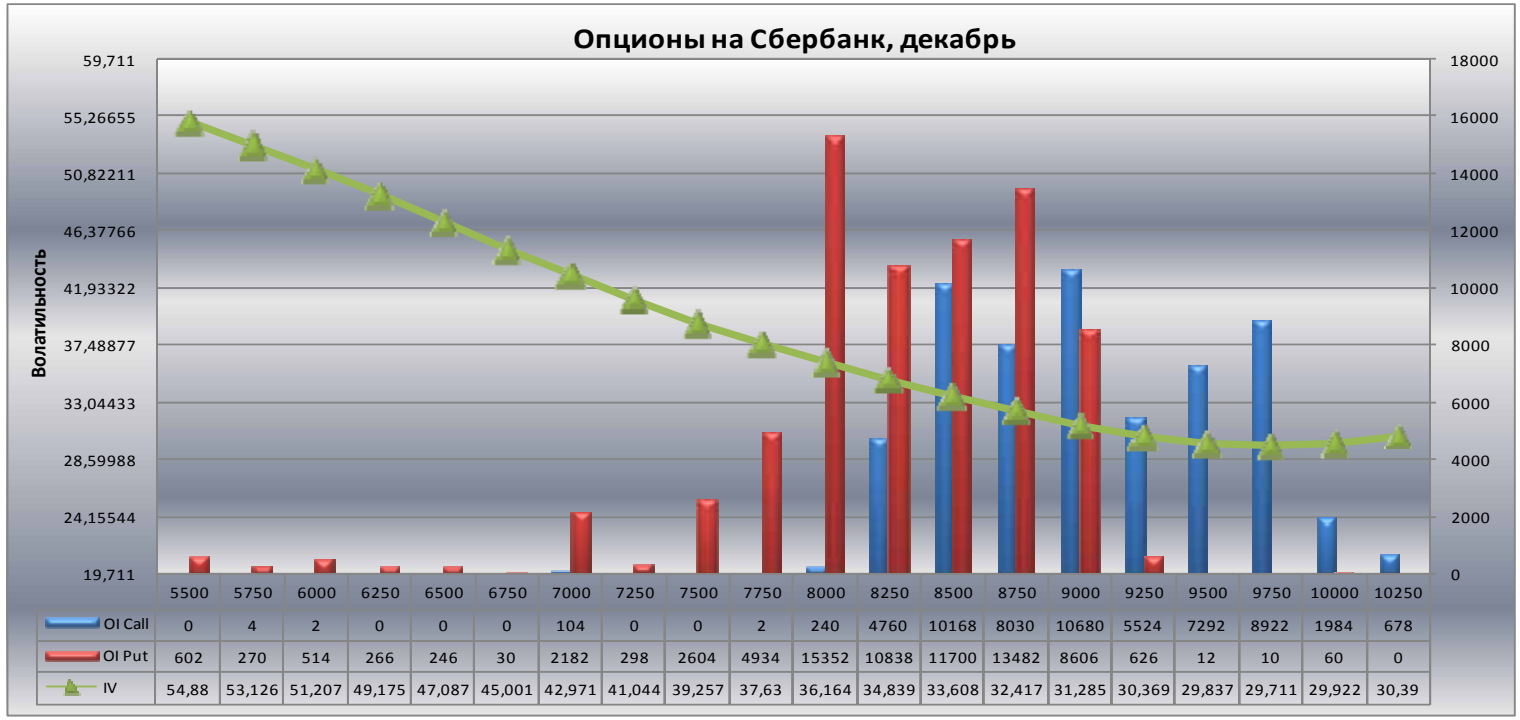
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,36	453428	93523793315,38	158530
ROSN-12.10	-0,65	37130	312075094,00	21167
LKOH-12.10	0,44	176966	888227475,00	17991
GAZR-12.10	-1,6	775342	2824684326,00	16275
GMKR-12.10	0,52	31246	386208818,00	54080
SBRF-12.10	0,04	1039298	5772155468,00	9181
VTBR-12.10	-0,87	84476	88157898,00	9141
GOLD-12.10	0,31	63746	2268439077,05	1381
Si-12.10	-0,17	756910	14727832559,00	30166
Eu-12.10	0,71	134690	262031381,00	42450
ED-12.10	1,01	218870	12164639708,47	1,4071
SBPR-12.10	-0,32	214354	118442910,00	6566
RTSS-12.10	-0,44	7978	603513215,00	10182
BR-12.10	0,26	3928	5295513,83	85,17

Опционы на индекс РТС, декабрь

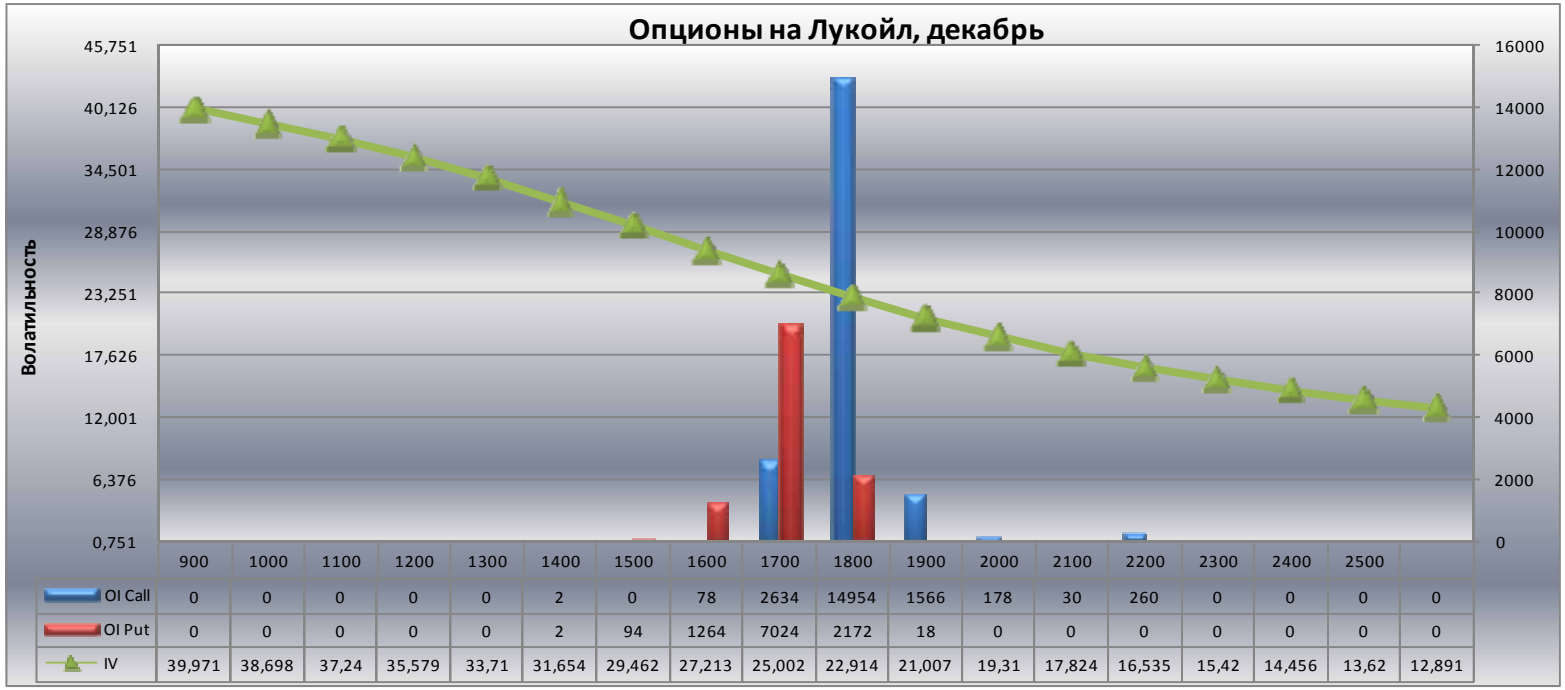


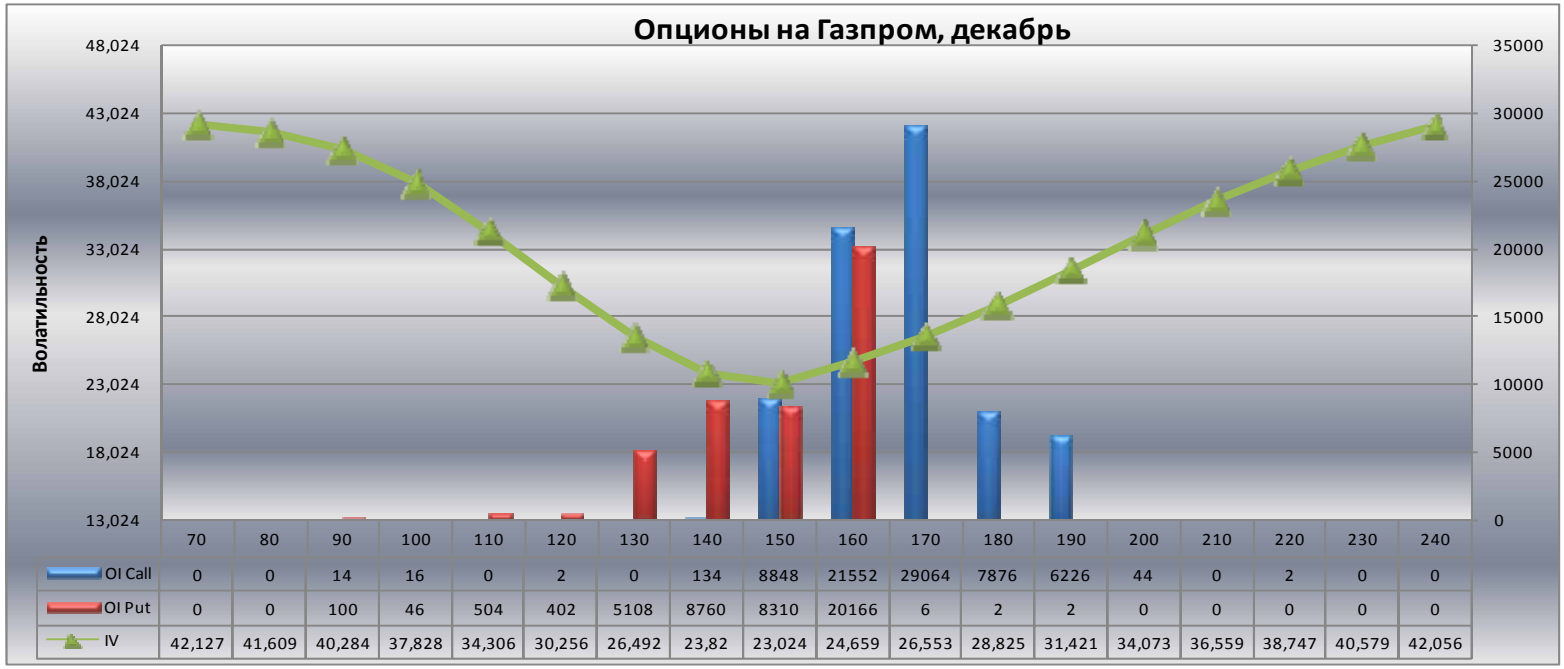
	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	2	16	8	116	1164	414	540	2108	18974	19604	21834	20274	73782	13250	19188
OI Put	5576	956	62	206	5568	20718	1586	2172	15936	10470	18974	40572	58022	28728	22248	17844	7218	690	304	2	0
IV	62,427	58,45	54,498	50,646	46,956	43,477	40,248	37,295	34,637	32,282	30,231	28,476	27,002	25,784	24,779	23,906	23	21,905	21,061	20,821	21,001

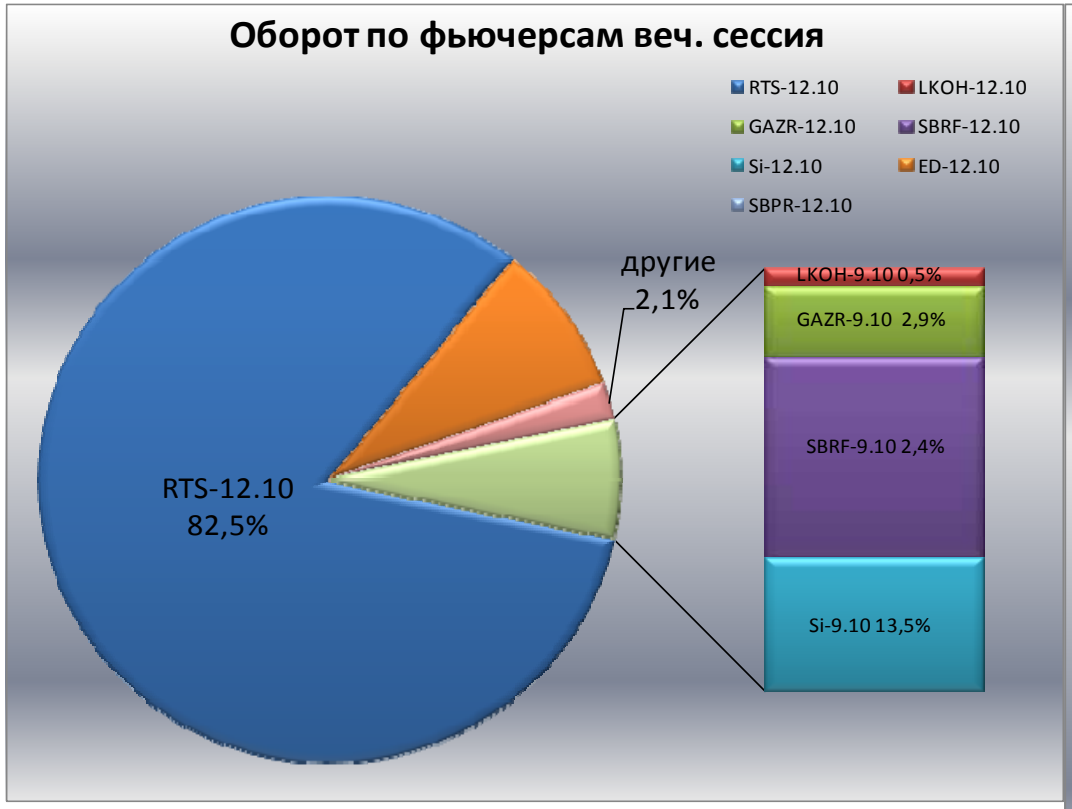
Опционы на Сбербанк, декабрь

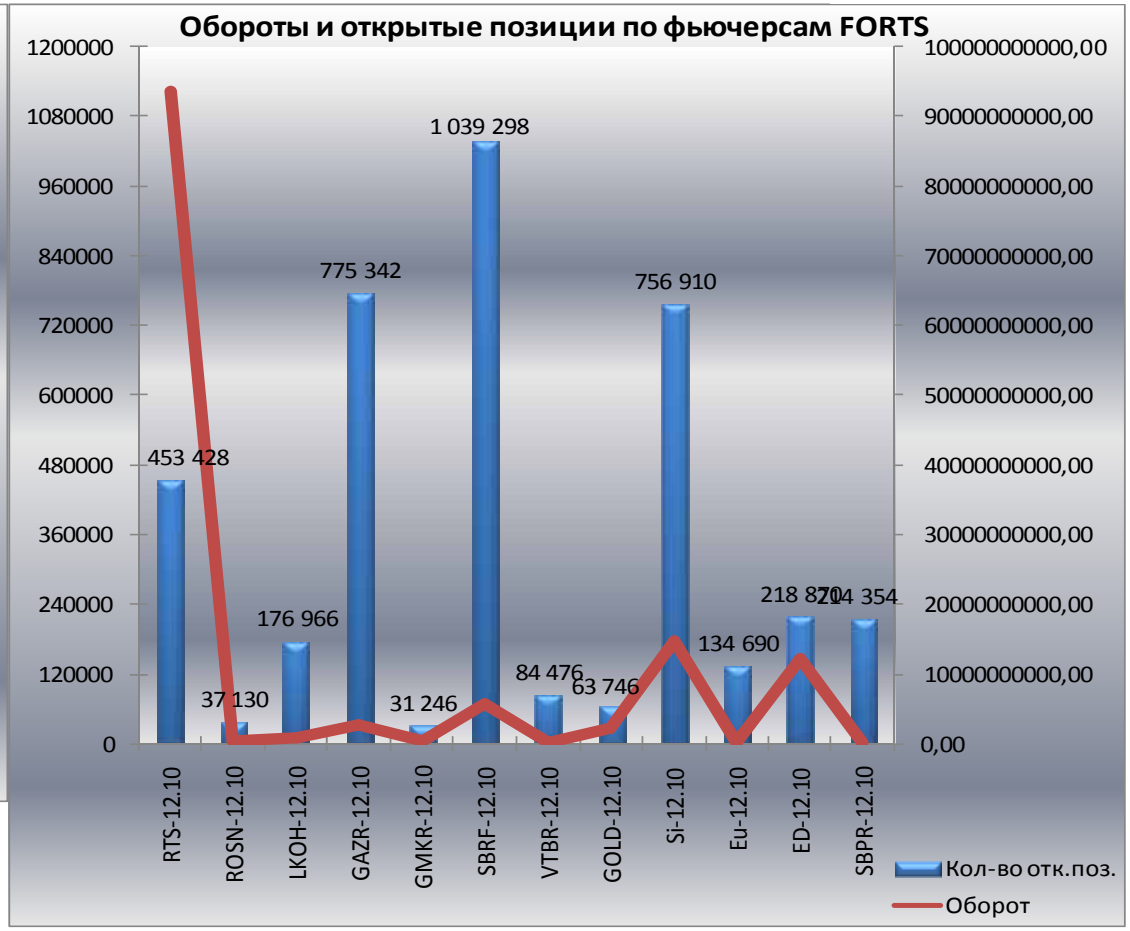


	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250
OI Call	0	4	2	0	0	0	104	0	0	2	240	4760	10168	8030	10680	5524	7292	8922	1984	678
OI Put	602	270	514	266	246	30	2182	298	2604	4934	15352	10838	11700	13482	8606	626	12	10	60	0
IV	54,88	53,126	51,207	49,175	47,087	45,001	42,971	41,044	39,257	37,63	36,164	34,839	33,608	32,417	31,285	30,369	29,837	29,711	29,922	30,39


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
45,751
40,126
34,501
28,876
23,251
17,626
12,001
6,376
0,751
16000
14000
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 2634 14954 1566 178 30 260 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 2 94 1264 7024 2172 18 0 0 0 0 0 0 0
IV 39,971 38,698 37,24 35,579 33,71 31,654 29,462 27,213 25,002 22,914 21,007 19,31 17,824 16,535 15,42 14,456 13,62 12,891


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
48,024
43,024
38,024
33,024
28,024
23,024
18,024
13,024
35000
30000
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 14 16 0 2 0 134 8848 21552 29064 7876 6226 44 0 2 0 0
OI Put 0 0 100 46 504 402 5108 8760 8310 20166 6 2 2 0 0 0 0 0
IV 42,127 41,609 40,284 37,828 34,306 30,256 26,492 23,82 23,024 24,659 26,553 28,825 31,421 34,073 36,559 38,747 40,579 42,056


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
RTS-12.10
82,5%
другие
2,1%
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
453 428
37 130
176 966
775 342
31 246
1 039 298
84 476
63 746
756 910
134 690
218 870
204 354
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