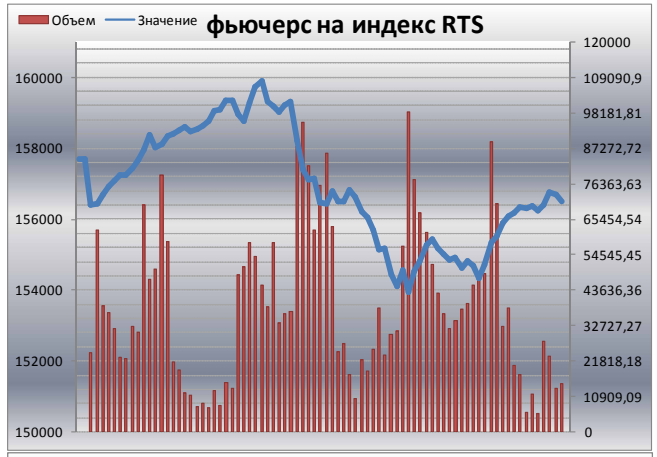
## Дневное падение, вечерняя коррекция.

Российские площадки в среду в начале дневной сессии находились во власти позитивных настроений, но в середине сессии негативные настроения возобладали, в вечернюю сессию превалировали позитивные настроения и рынок показал несильный рост. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали рост, оказавшись в хорошем плюсе, что способствовать росту котировок на российских рынках в раннюю вечернюю сессию и усилило рост в позднюю вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на 1.15% и 1.05%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.73% до уровня в 1549,94 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась растущая цена на нефть.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,38%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.60%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок «принял к сведению», в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ изменились на 0,40% и 0,41%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,06% и -0,12%, на что отчасти было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на 0.39% и 0.61%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на -0.10%.







| | 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 | 156495 | 1564,95 | 0,38 | 398 318 | -7,10% | 17 257 726 439 | 14,85% |
| ROSN-12.10 | 21000 | 210,00 | 0,33 | 50 846 | 0,16% | 6 218 925 | 3,00% |
| LKOH-12.10 | 17562 | 1756,20 | 0,41 | 182 452 | 0,75% | 54 812 316 | 6,39% |
| GAZR-12.10 | 16308 | 163,08 | 0,40 | 754 708 | 0,14% | 97 258 227 | 3,85% |
| GMKR-12.10 | 54745 | 5474,50 | 0,32 | 33 658 | -0,08% | 12 988 922 | 4,93% |
| SBRF-12.10 | 9840 | 98,40 | 0,39 | 1 072 896 | -0,23% | 682 468 912 | 7,56% |
| VTBR-12.10 | 9437 | 0,0944 | 0,61 | 93 682 | -0,75% | 19 321 188 | 6,62% |
| GOLD-12.10 | 1347 | 1347,0000 | -0,10 | 63 102 | 4,05% | 170 921 475 | 12,72% |
| Si-12.10 | 30848 | 30,85 | -0,06 | 894 764 | -0,90% | 860 555 840 | 4,45% |
| Eu-12.10 | 42972 | 42,97 | -0,12 | 147 614 | 0,01% | 12 128 232 | 7,99% |
| ED-12.10 | 1,39 | 1,39 | 0,12 | 256 930 | 2,46% | 3 798 445 845 | 29,86% |
| SBPR-12.10 | 6870 | 68,70 | 0,39 | 215 352 | 0,28% | 7 068 828 | 4,18% |
| RTSS-12.10 | 10265 | 10265,00 | 0,36 | 10 194 | 118,10% | 32 144 085 | 57,14% |
| BR-12.10 | 84 | 83,76 | 0,60 | 4 552 | -54,65% | 5 081 991 | 0,17% |

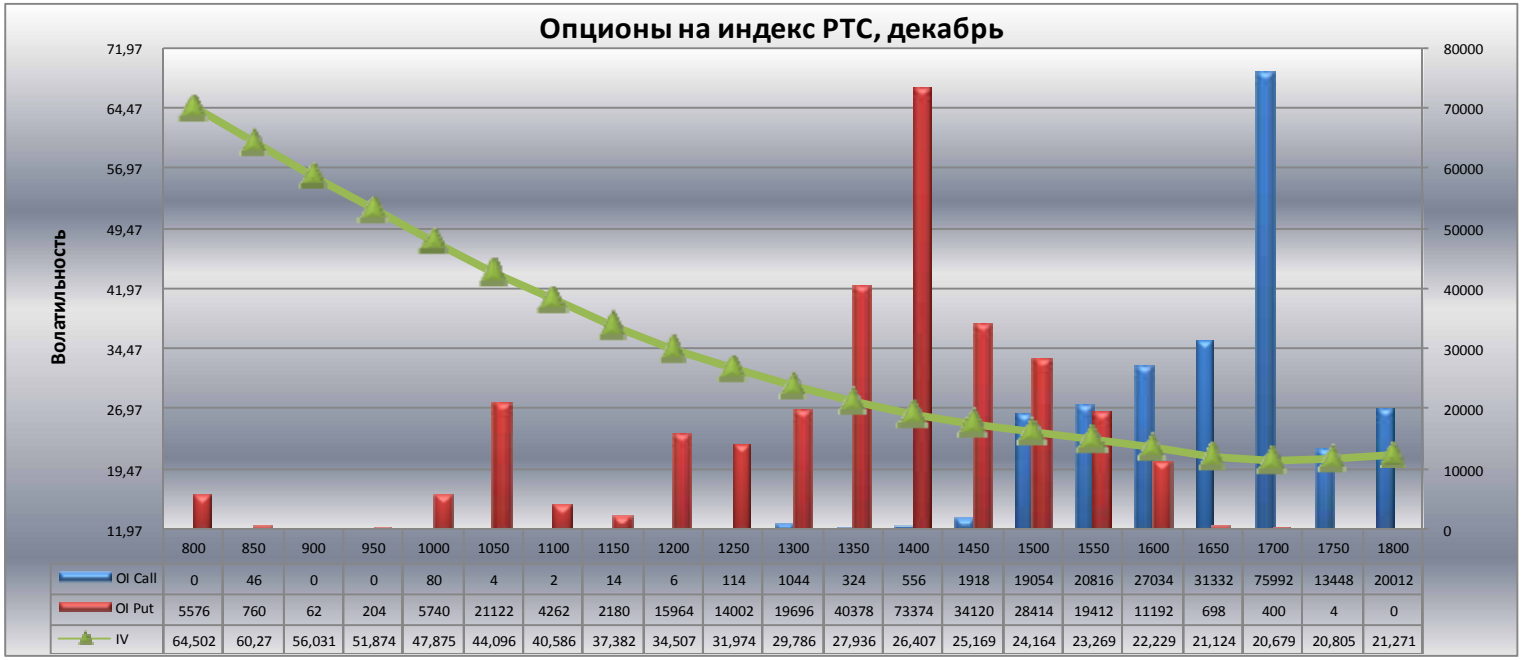
| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| BOVESPA Brazil | 70404,68 | 0,77% | 06:00:37 |
| CAC 40 | 3828,15 | 0,55% | 05:34:56 |
| DAX 30 | 6524,55 | 0,52% | 07:06:22 |
| DJ Industrial | 11107,97 | 1,18% | 00:37:22 |
| FTSE 100 | 5728,93 | 0,44% | 07:26:41 |
| Hang Seng | 23539,79 | -0,07% | 08:30:02 |
| Nikkei 225 | 9376,48 | -0,05% | 10:00:04 |
| S&P 500 | 1178,17 | 1,05% | 09:49:19 |
| Brent Crude Oil 0910 | 74,85 | -0,35% | 03:47:43 |
| Gold | 1344,58 | 0,04% | 10:27:18 |
| Palladium | 585,5 | 0,05% | 10:27:11 |
| Platinum | 1676 | -0,17% | 10:27:10 |
| RTSI | 1 561,92 | 0,24% | 23:50:00 |
| RTS_Standard | 10 251,46 | 0,41% | 23:50:00 |
| RTSI_DEREX | 1549,94 | -0,73% | 18:45:00 |

# Вечерняя сессия

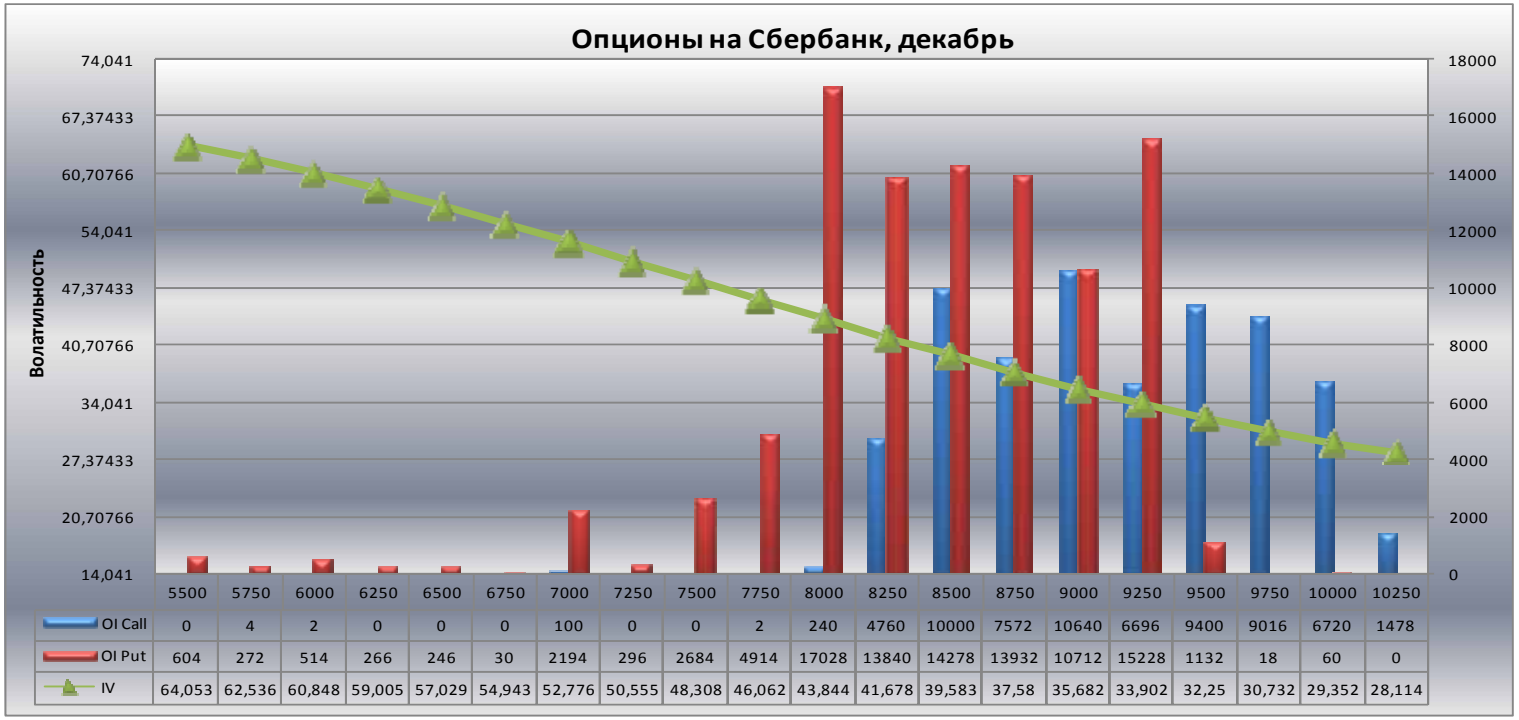
| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | 0,38 | 398318 | 17257726438,64 | 156495 |
| ROSN-12.10 | 0,33 | 50846 | 6218925,00 | 21000 |
| LKOH-12.10 | 0,41 | 182452 | 54812316,00 | 17562 |
| GAZR-12.10 | 0,4 | 754708 | 97258227,00 | 16308 |
| GMKR-12.10 | 0,32 | 33658 | 12988922,00 | 54745 |
| SBRF-12.10 | 0,39 | 1072896 | 682468912,00 | 9840 |
| VTBR-12.10 | 0,61 | 93682 | 19321188,00 | 9437 |
| GOLD-12.10 | -0,1 | 63102 | 170921474,81 | 1347 |
| Si-12.10 | -0,06 | 894764 | 860555840,00 | 30848 |
| Eu-12.10 | -0,12 | 147614 | 12128232,00 | 42972 |
| ED-12.10 | 0,12 | 256930 | 3798445845,02 | 1,3948 |
| SBPR-12.10 | 0,39 | 215352 | 7068828,00 | 6870 |
| RTSS-12.10 | 0,36 | 10194 | 32144085,00 | 10265 |
| BR-12.10 | 0,6 | 4552 | 5081990,60 | 83,76 |

# Дневная сессия

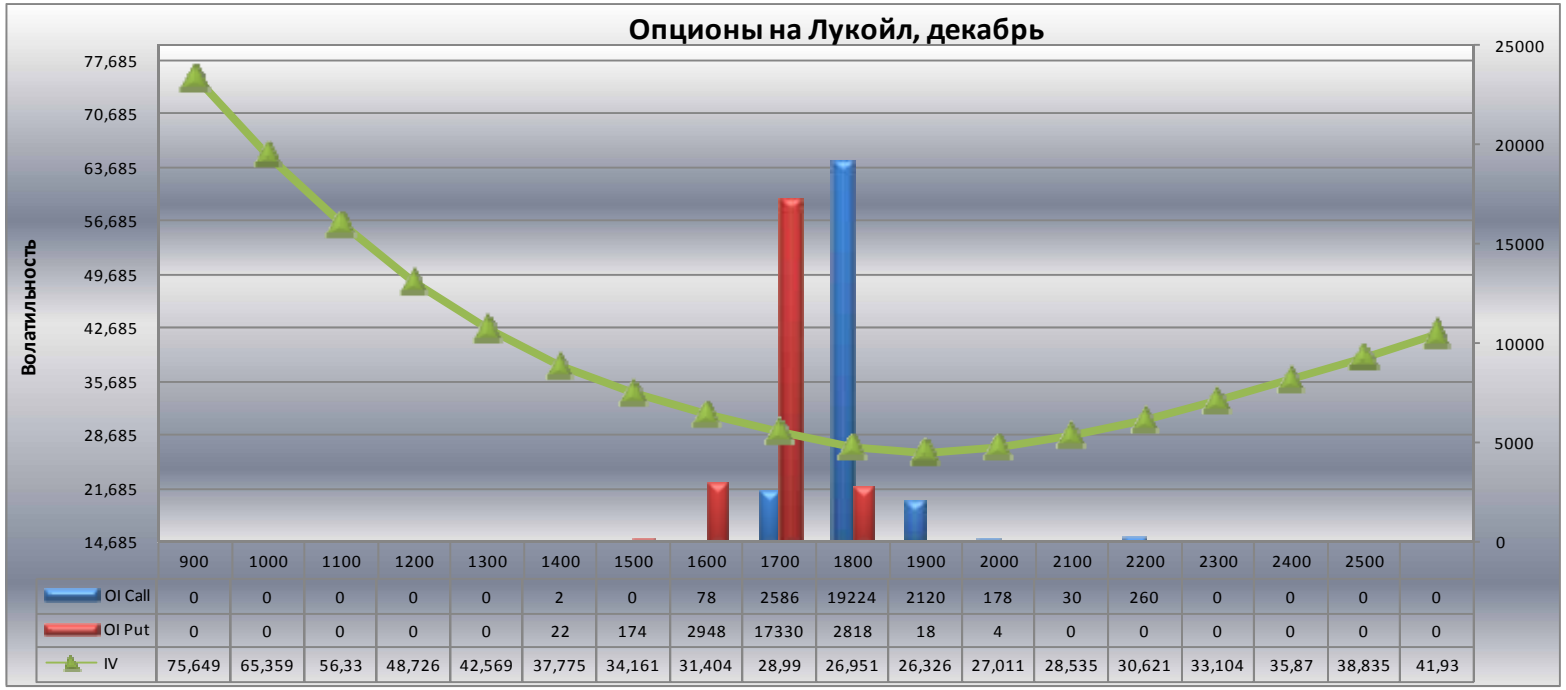
| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | -0,39 | 428762 | 116250693493,60 | 155895 |
| ROSN-12.10 | 0,29 | 50766 | 207362511,00 | 20930 |
| LKOH-12.10 | -0,48 | 181086 | 858072468,00 | 17490 |
| GAZR-12.10 | -0,22 | 753622 | 2528821493,00 | 16243 |
| GMKR-12.10 | 0,96 | 33686 | 263560699,00 | 54568 |
| SBRF-12.10 | 2,47 | 1075346 | 9021549674,00 | 9796 |
| VTBR-12.10 | 0,84 | 94392 | 292050607,00 | 9380 |
| GOLD-12.10 | 0,29 | 60648 | 1343785083,79 | 1348,3 |
| Si-12.10 | 0,39 | 902932 | 19320356376,00 | 30866 |
| Eu-12.10 | 1,4 | 147602 | 151774659,00 | 43025 |
| ED-12.10 | 1,05 | 250766 | 12718958938,32 | 1,3931 |
| SBPR-12.10 | 1,45 | 214744 | 169289241,00 | 6843 |
| RTSS-12.10 | 0,16 | 10038 | 2938337195,00 | 10228,5 |
| BR-12.10 | -0,04 | 4674 | 56253911,32 | 83,26 |

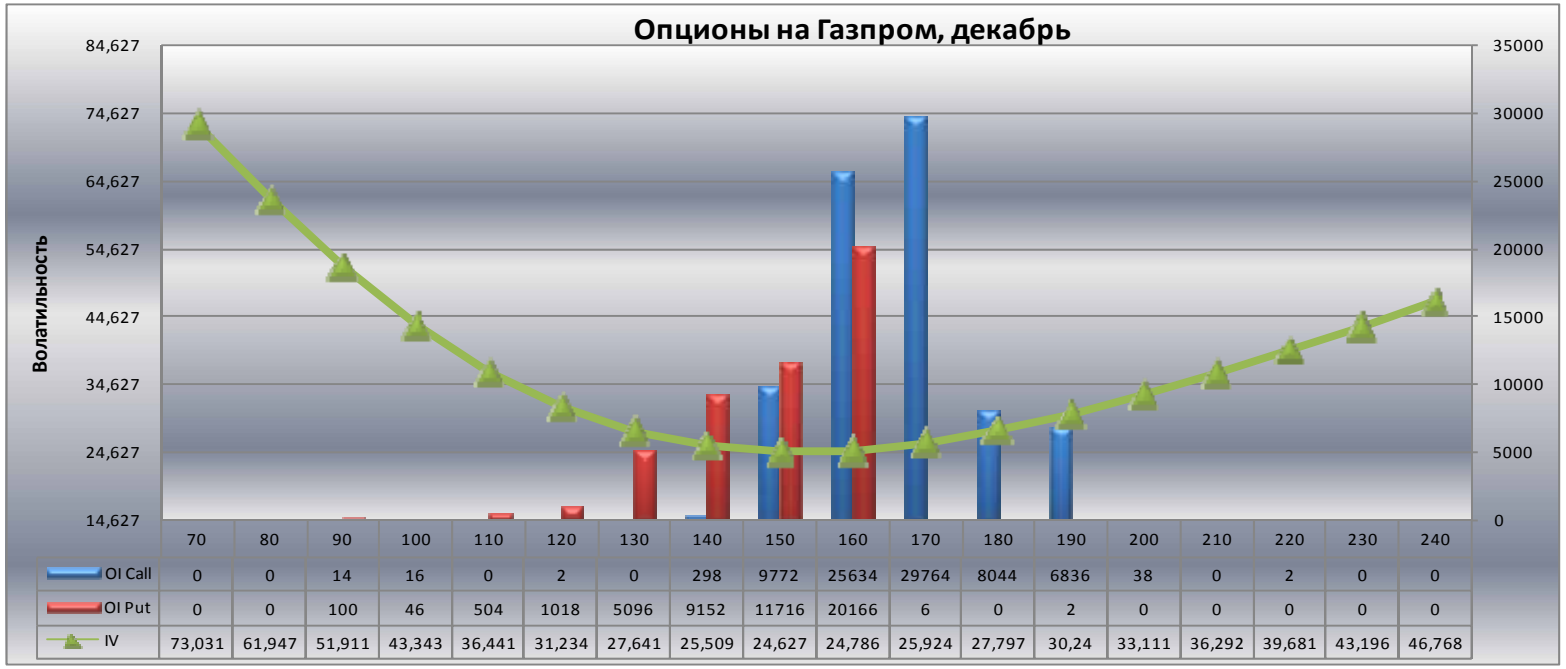


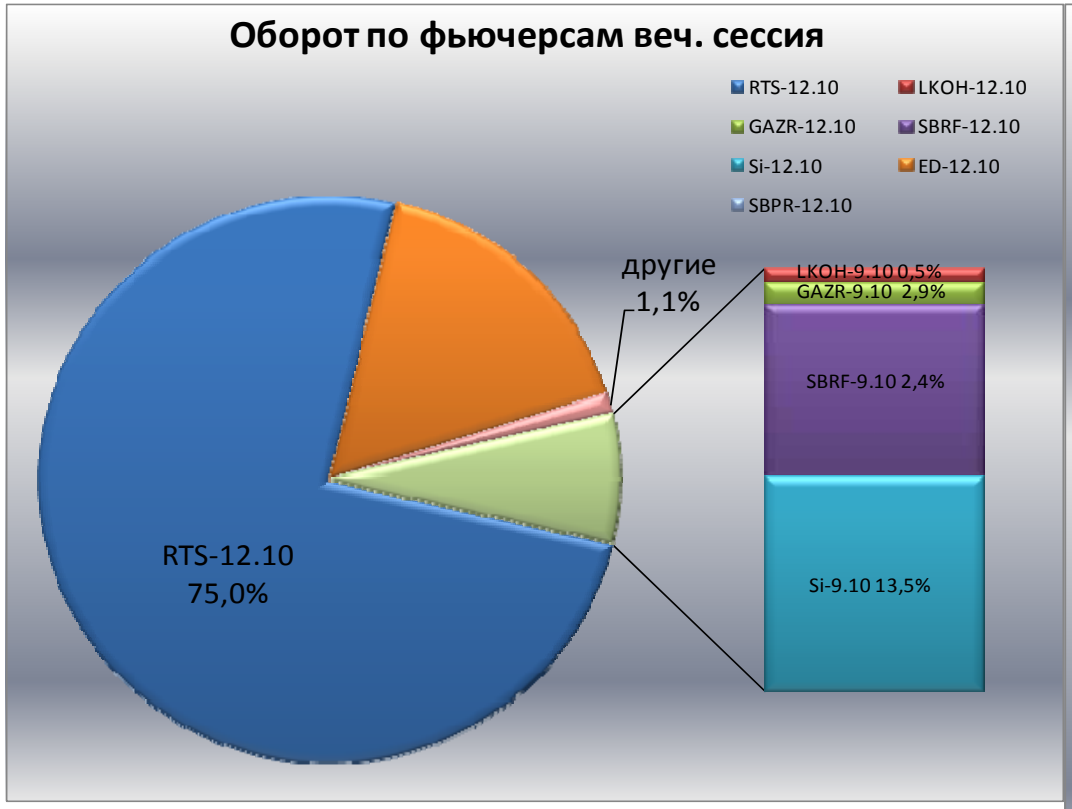

| | 800 | 850 | 900 | 950 | 1000 | 1050 | 1100 | 1150 | 1200 | 1250 | 1300 | 1350 | 1400 | 1450 | 1500 | 1550 | 1600 | 1650 | 1700 | 1750 | 1800 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 46 | 0 | 0 | 80 | 4 | 2 | 14 | 6 | 114 | 1044 | 324 | 556 | 1918 | 19054 | 20816 | 27034 | 31332 | 75992 | 13448 | 20012 |
| OI Put | 5576 | 760 | 62 | 204 | 5740 | 21122 | 4262 | 2180 | 15964 | 14002 | 19696 | 40378 | 73374 | 34120 | 28414 | 19412 | 11192 | 698 | 400 | 4 | 0 |
| IV | 64,502 | 60,27 | 56,031 | 51,874 | 47,875 | 44,096 | 40,586 | 37,382 | 34,507 | 31,974 | 29,786 | 27,936 | 26,407 | 25,169 | 24,164 | 23,269 | 22,229 | 21,124 | 20,679 | 20,805 | 21,271 |

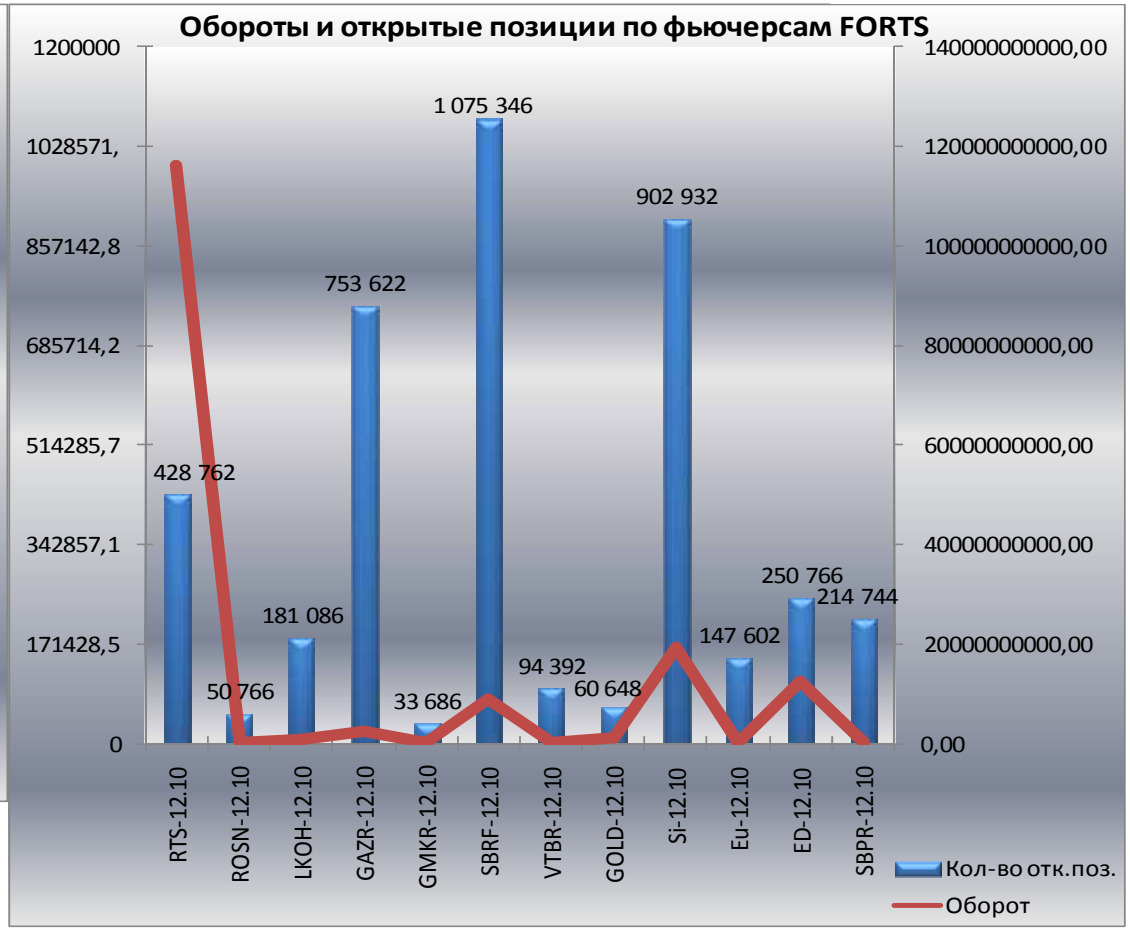



| | 5500 | 5750 | 6000 | 6250 | 6500 | 6750 | 7000 | 7250 | 7500 | 7750 | 8000 | 8250 | 8500 | 8750 | 9000 | 9250 | 9500 | 9750 | 10000 | 10250 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 4 | 2 | 0 | 0 | 0 | 100 | 0 | 0 | 2 | 240 | 4760 | 10000 | 7572 | 10640 | 6696 | 9400 | 9016 | 6720 | 1478 |
| OI Put | 604 | 272 | 514 | 266 | 246 | 30 | 2194 | 296 | 2684 | 4914 | 17028 | 13840 | 14278 | 13932 | 10712 | 15228 | 1132 | 18 | 60 | 0 |
| IV | 64,053 | 62,536 | 60,848 | 59,005 | 57,029 | 54,943 | 52,776 | 50,555 | 48,308 | 46,062 | 43,844 | 41,678 | 39,583 | 37,58 | 35,682 | 33,902 | 32,25 | 30,732 | 29,352 | 28,114 |


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
77,685
70,685
63,685
56,685
49,685
42,685
35,685
28,685
21,685
14,685
25000
20000
15000
10000
5000
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 2586 19224 2120 178 30 260 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 22 174 2948 17330 2818 18 4 0 0 0 0 0 0
IV 75,649 65,359 56,33 48,726 42,569 37,775 34,161 31,404 28,99 26,951 26,326 27,011 28,535 30,621 33,104 35,87 38,835 41,93


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
84,627
74,627
64,627
54,627
44,627
34,627
24,627
14,627
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 0 298 9772 25634 29764 8044 6836 38 0 2 0 0
OI Put 0 0 100 46 504 1018 5096 9152 11716 20166 6 0 2 0 0 0 0 0
IV 73,031 61,947 51,911 43,343 36,441 31,234 27,641 25,509 24,627 24,786 25,924 27,797 30,24 33,111 36,292 39,681 43,196 46,768


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
1,1%
RTS-12.10
75,0%
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
1028571,
857142,8
685714,2
514285,7
342857,1
171428,5
0
140000000000,00
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
428 762
50 766
181 086
753 622
33 686
1 075 346
94 392
60 648
902 932
147 602
250 766
214 744
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