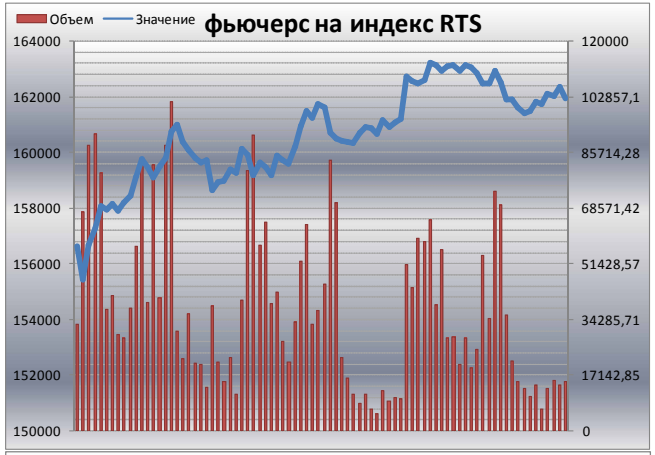
Дневной рост, вечерняя коррекция.

Российские площадки в понедельник всю дневную сессию находились во власти позитивных настроений, но ближе к концу сессии цены немного скорректировались, в вечернюю сессию превалировали негативные настроения но в целом рынок показал несильный рост. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали рост, оказавшись в неболоьшом плюсе, что способствовать росту котировок на российских рынках вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на 0.28% и 0.21%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 0.90% до уровня в 1619,32 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась падающая цена на нефть.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,02%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 0.52%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержка, что рынок воспринял нейтрально, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ изменились на -0,02% и 0,02%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,14% и 0,07%, на что отчасти было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.03% и -0.20%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на 0.15%.





	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	161950	1619,50	0,02	408 728	1,86%	13 638 297 990	15,49%
ROSN-12.10	21650	216,50	0,01	55 786	0,04%	5 510 972	3,71%
LKOH-12.10	17500	1750,00	0,02	179 510	0,00%	35 152 457	4,32%
GAZR-12.10	17010	170,10	-0,02	778 182	0,01%	174 734 589	5,18%
GMKR-12.10	56126	5612,60	0,15	32 160	0,06%	6 044 200	1,05%
SBRF-12.10	10255	102,55	-0,03	1 031 980	0,10%	355 601 935	5,36%
VTBR-12.10	10379	0,1038	-0,20	118 854	-0,83%	24 726 305	4,52%
GOLD-12.10	1340	1340,4000	0,15	61 044	1,71%	195 348 010	19,23%
Si-12.10	30448	30,45	0,14	891 926	0,86%	599 327 076	4,32%
Eu-12.10	42550	42,55	0,07	163 924	-0,11%	8 805 108	8,07%
ED-12.10	1,40	1,40	-0,14	326 872	0,52%	2 952 171 519	21,96%
SBPR-12.10	7106	71,06	-0,27	228 970	0,13%	3 958 000	2,75%
RTSS-12.10	10522	10522,00	0,00	17 166	246,93%	8 098 710	14,52%
BR-12.10	84	83,70	-0,52	4 886	-71,60%	1 567 450	0,16%

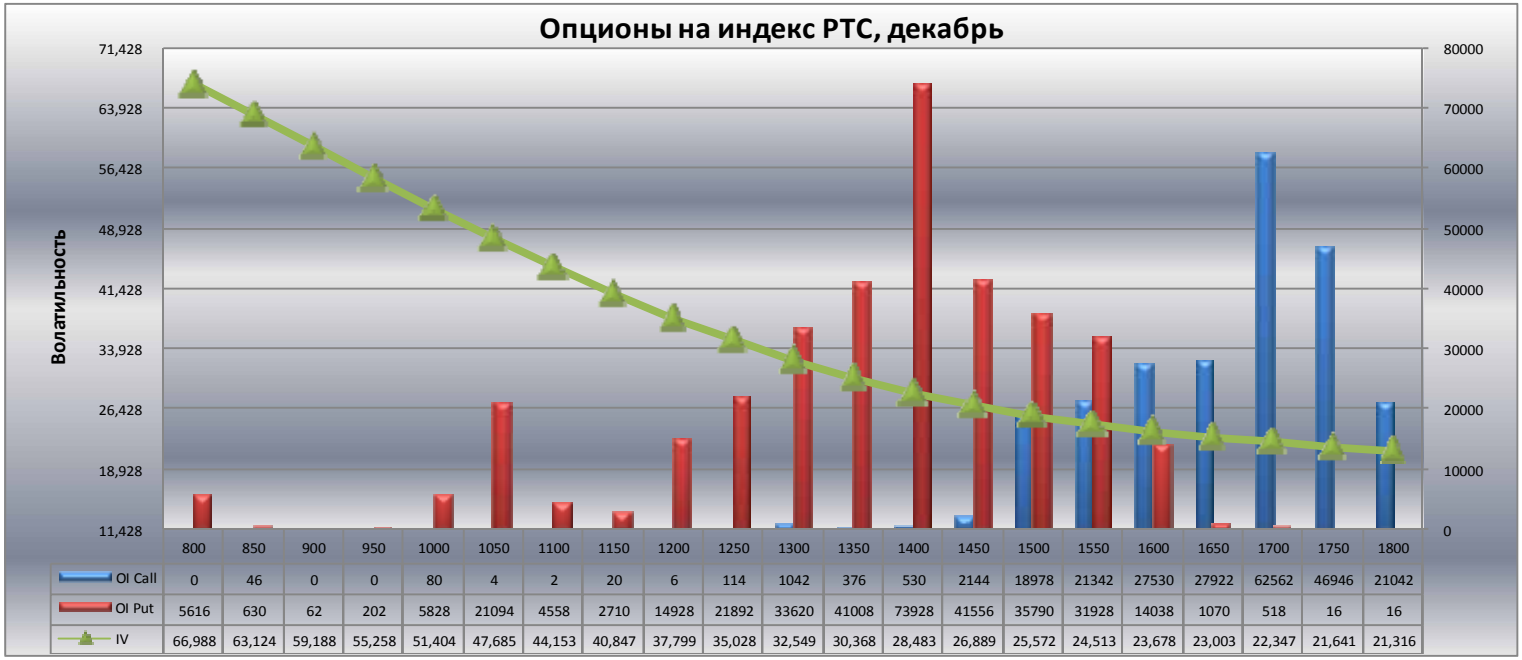
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69580,28	0,07%	06:00:34
CAC 40	3870	0,04%	05:35:05
DAX 30	6639,21	0,51%	06:27:44
DJ Industrial	11164,05	0,28%	00:37:22
FTSE 100	5751,98	0,18%	07:26:43
Hang Seng	23610,95	-0,07%	08:30:02
Nikkei 225	9377,38	-0,25%	10:06:36
S&P 500	1185,62	0,21%	09:49:08
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1338,53	0,04%	10:28:52
Palladium	610,85	0,68%	10:28:30
Platinum	1695,75	0,22%	10:28:30
RTSI	1 622,15	0,12%	23:50:00
RTS_Standard	10 534,37	0,14%	23:50:00
RTSI_DEREX	1619,32	0,90%	18:45:00

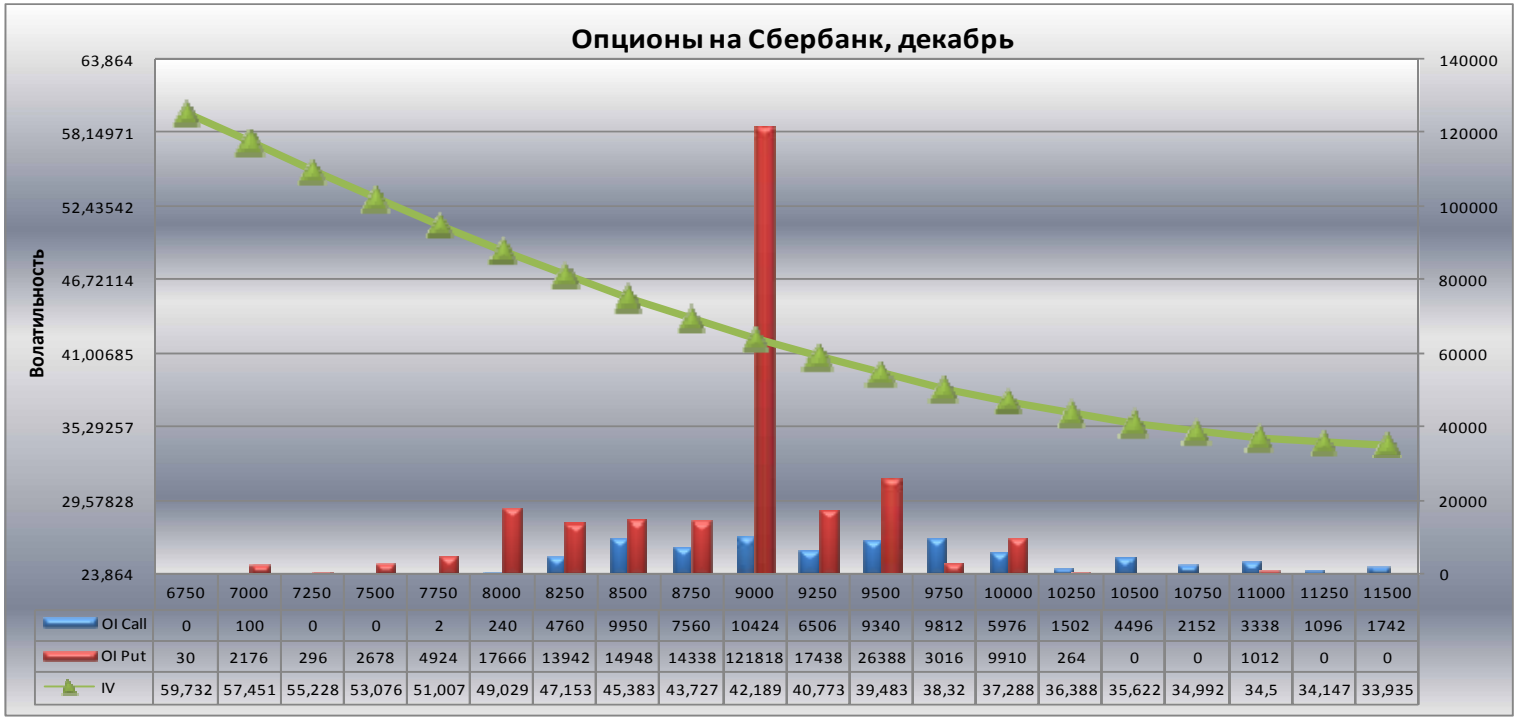
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,02	408728	13638297990,25	161950
ROSN-12.10	0,01	55786	5510972,00	21650
LKOH-12.10	0,02	179510	35152457,00	17500
GAZR-12.10	-0,02	778182	174734589,00	17010
GMKR-12.10	0,15	32160	6044200,00	56126
SBRF-12.10	-0,03	1031980	355601935,00	10255
VTBR-12.10	-0,2	118854	24726305,00	10379
GOLD-12.10	0,15	61044	195348009,51	1340,4
Si-12.10	0,14	891926	599327076,00	30448
Eu-12.10	0,07	163924	8805108,00	42550
ED-12.10	-0,14	326872	2952171518,65	1,3961
SBPR-12.10	-0,27	228970	3958000,00	7106
RTSS-12.10	0	17166	8098710,00	10522
BR-12.10	-0,52	4886	1567450,09	83,7

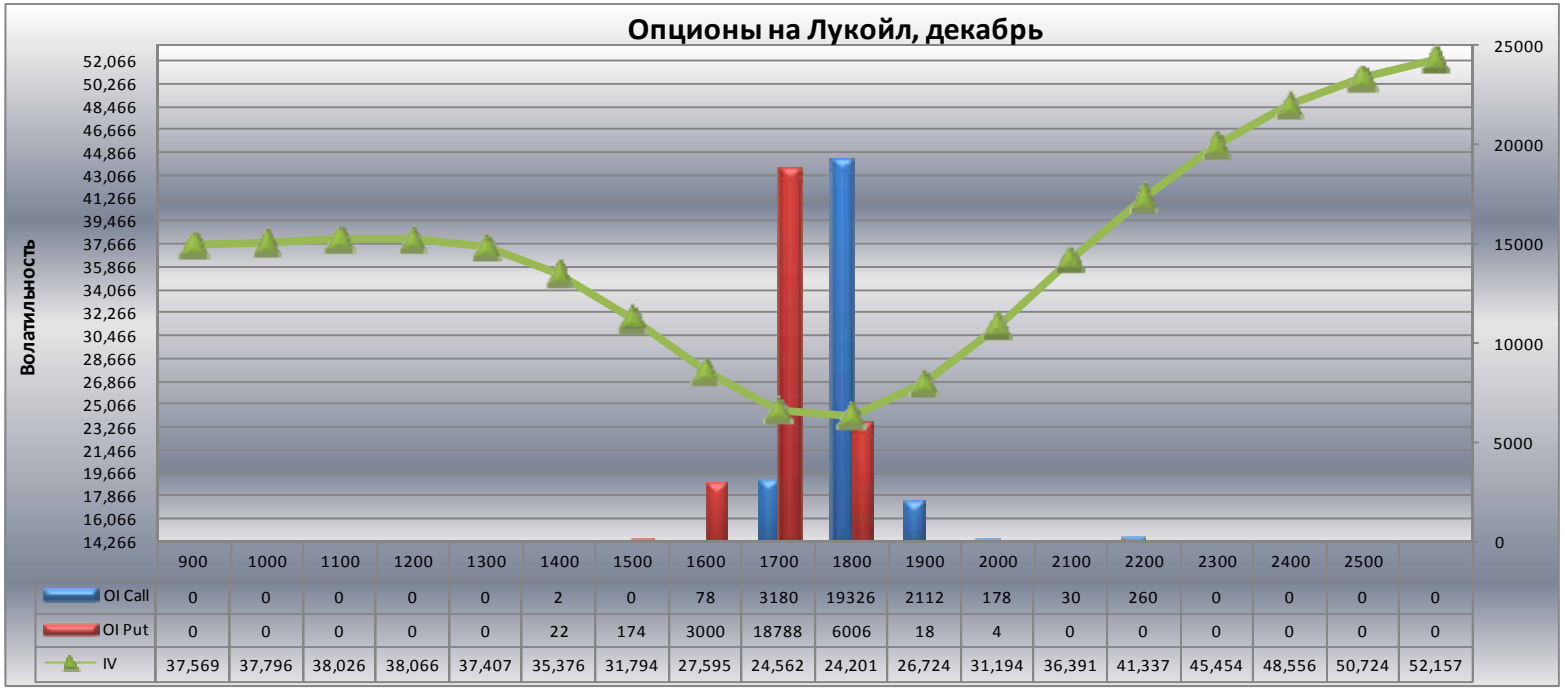
Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,92	401282	88031951400,30	161905
ROSN-12.10	-0,55	55766	148678666,00	21650
LKOH-12.10	0,52	179512	813497576,00	17497
GAZR-12.10	0,73	778072	3373072500,00	17014
GMKR-12.10	2,92	32140	574536269,00	56040
SBRF-12.10	0,35	1030912	6638818229,00	10258
VTBR-12.10	2,31	119852	547282593,00	10400
GOLD-12.10	1,02	60018	1015857490,30	1338,4
Si-12.10	-0,49	884296	13882494672,00	30404
Eu-12.10	-0,02	164098	109089110,00	42520
ED-12.10	0,52	325188	13440624561,21	1,3979
SBPR-12.10	0,07	228670	143888185,00	7125
RTSS-12.10	0,92	17202	986071690,00	10521,5
BR-12.10	1,59	4948	55766898,23	84,14


Опционы на индекс РТС, декабрь
Волатильность
71,428
63,928
56,428
48,928
41,428
33,928
26,428
18,928
11,428
80000
70000
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
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 20 6 114 1042 376 530 2144 18978 21342 27530 27922 62562 46946 21042
OI Put 5616 630 62 202 5828 21094 4558 2710 14928 21892 33620 41008 73928 41556 35790 31928 14038 1070 518 16 16
IV 66,988 63,124 59,188 55,258 51,404 47,685 44,153 40,847 37,799 35,028 32,549 30,368 28,483 26,889 25,572 24,513 23,678 23,003 22,347 21,641 21,316

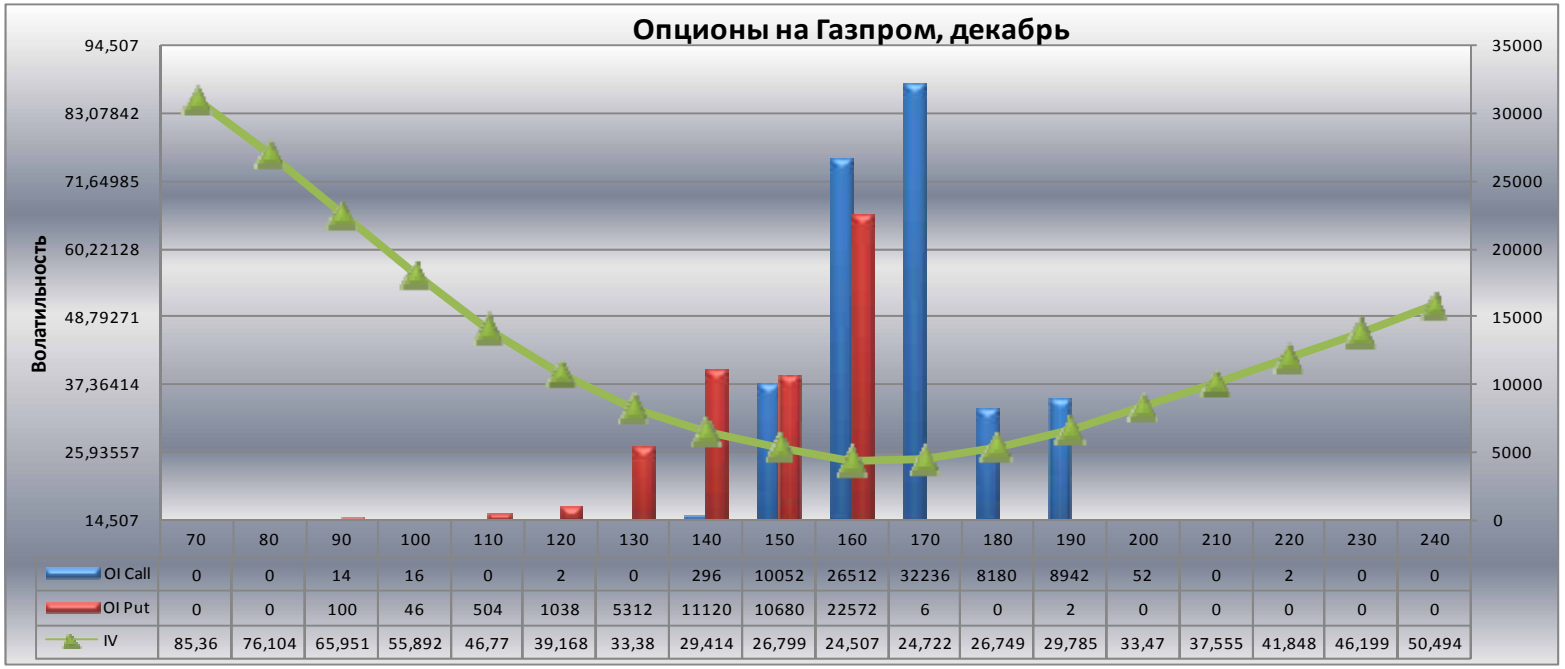

Опционы на Сбербанк, декабрь
Волатильность
63,864
58,14971
52,43542
46,72114
41,00685
35,29257
29,57828
23,864
140000
120000
100000
80000
60000
40000
20000
0
6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500
OI Call 0 100 0 0 2 240 4760 9950 7560 10424 6506 9340 9812 5976 1502 4496 2152 3338 1096 1742
OI Put 30 2176 296 2678 4924 17666 13942 14948 14338 121818 17438 26388 3016 9910 264 0 0 1012 0 0
IV 59,732 57,451 55,228 53,076 51,007 49,029 47,153 45,383 43,727 42,189 40,773 39,483 38,32 37,288 36,388 35,622 34,992 34,5 34,147 33,935

Опционы на Лукойл, декабрь

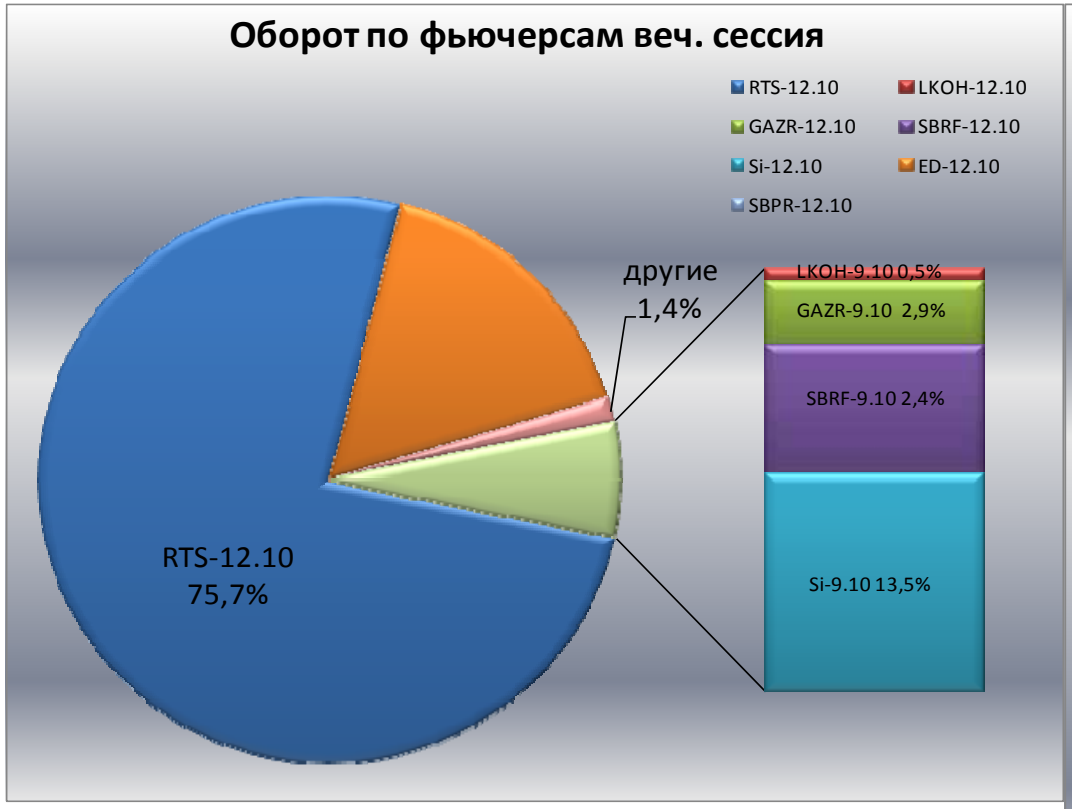


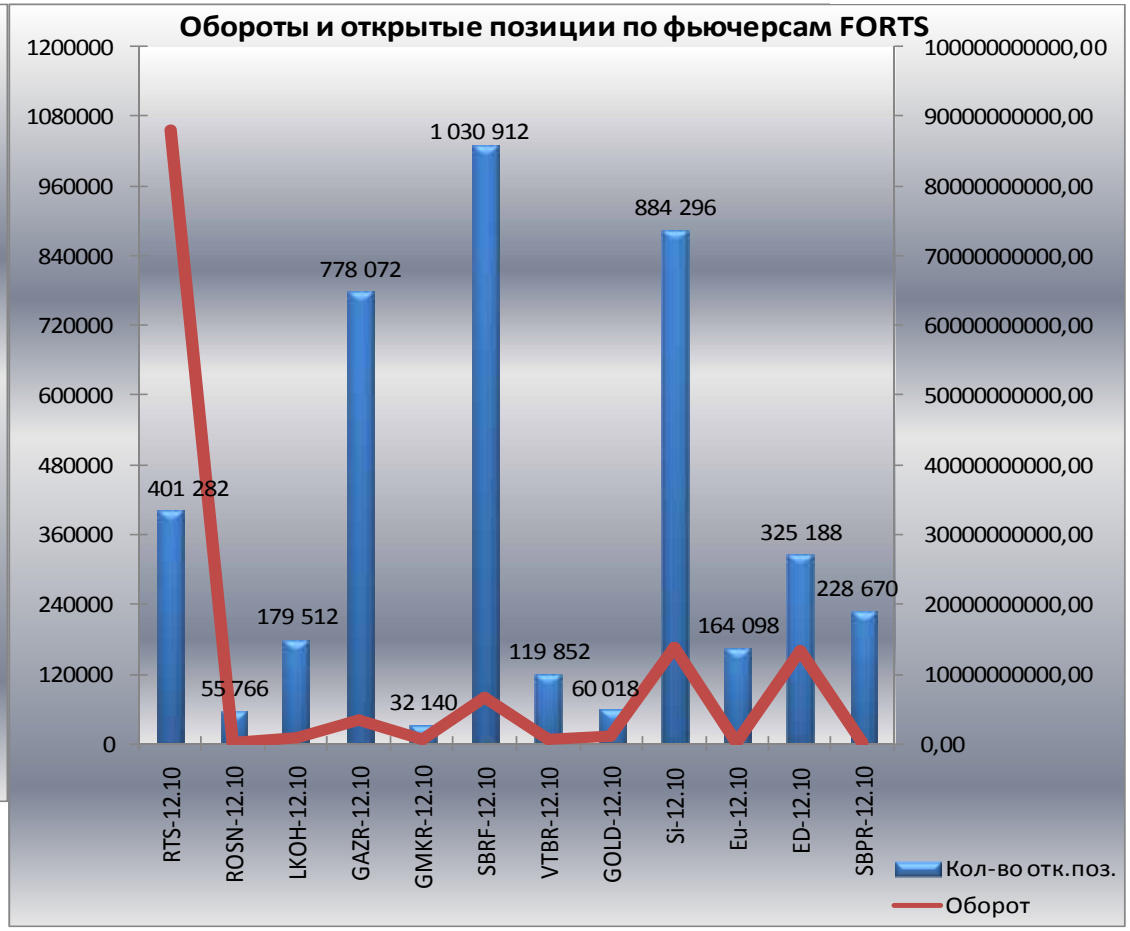
	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	3180	19326	2112	178	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	174	3000	18788	6006	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	37,569	37,796	38,026	38,066	37,407	35,376	31,794	27,595	24,562	24,201	26,724	31,194	36,391	41,337	45,454	48,556	50,724	52,157

Опционы на Газпром, декабрь



	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	296	10052	26512	32236	8180	8942	52	0	2	0	0
OI Put	0	0	100	46	504	1038	5312	11120	10680	22572	6	0	2	0	0	0	0	0
IV	85,36	76,104	65,951	55,892	46,77	39,168	33,38	29,414	26,799	24,507	24,722	26,749	29,785	33,47	37,555	41,848	46,199	50,494


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
1,4%
RTS-12.10
75,7%
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
401 282
55 766
179 512
778 072
32 140
1 030 912
119 852
60 018
884 296
164 098
325 188
228 670
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