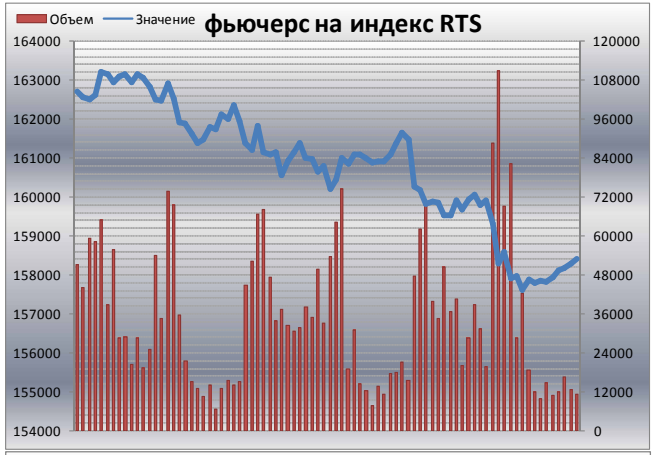
Дневное падение, вечерняя коррекция.

Российские площадки в среду всю дневную сессию находились во власти негативных настроений, но ближе к концу сессии цены немного скорректировались, в вечернюю сессию превалировали слабые позитивные настроения но в целом рынок показал несильный рост. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали небольшое падение, оказавшись в умеренном минусе к закрытию, что должно было способствовать падению котировок на российских рынках в вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на -0.39% и -0.27%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на –1.96% до уровня в 1577,58 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась растущая цена на нефть.

Несмотря на падение американских индексов, на вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,29%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 1.01%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял ростом котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ выросли на 0,33% и 0,42%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,12% и -0,11%, на что отчасти было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на 0.37% и 0.23%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на 0.17%.





	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	158405	1584,05	0,29	414 392	-3,26%	15 668 061 179	15,06%
ROSN-12.10	21424	214,24	0,15	56 000	-0,06%	3 655 015	1,54%
LKOH-12.10	17424	1742,40	0,42	180 368	-0,38%	57 240 441	8,43%
GAZR-12.10	16814	168,14	0,33	775 168	0,19%	125 872 627	5,64%
GMKR-12.10	55095	5509,50	0,28	35 238	-0,24%	7 355 877	1,92%
SBRF-12.10	10053	100,53	0,37	1 107 784	-0,56%	642 488 258	7,88%
VTBR-12.10	10071	0,1007	0,23	103 310	-0,26%	16 733 601	8,94%
GOLD-12.10	1330	1329,8000	0,17	57 528	2,05%	214 869 454	25,68%
Si-12.10	30786	30,79	-0,12	919 044	0,18%	658 516 740	4,43%
Eu-12.10	42424	42,42	-0,11	176 474	1,10%	42 450 511	13,41%
ED-12.10	1,38	1,38	-0,21	414 604	-0,01%	3 805 863 756	20,39%
SBPR-12.10	6950	69,50	0,22	205 746	0,01%	11 225 766	7,19%
RTSS-12.10	10377	10377,00	0,07	14 996	379,72%	36 236 155	54,23%
BR-12.10	84	83,70	1,01	5 088	-66,87%	36 856 353	2,38%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	70568,94	-0,24%	00:13:30
CAC 40	3815,77	-0,96%	19:35:18
DAX 30	6568	-0,69%	19:35:33
DJ Industrial	11126,28	-0,39%	00:53:44
FTSE 100	5646,02	-1,07%	19:35:32
Hang Seng	23228,79	0,28%	08:30:02
Nikkei 225	9372,99	-0,15%	09:44:02
S&P 500	1182,45	-0,27%	00:03:03
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1327,2	0,25%	09:44:00
Palladium	614,8	0,27%	09:44:10
Platinum	1673,75	0,10%	09:44:10
RTSI	1 587,73	0,29%	23:50:00
RTS_Standard	10 396,34	0,38%	23:50:00
RTSI_DEREX	1577,58	-1,96%	18:45:00

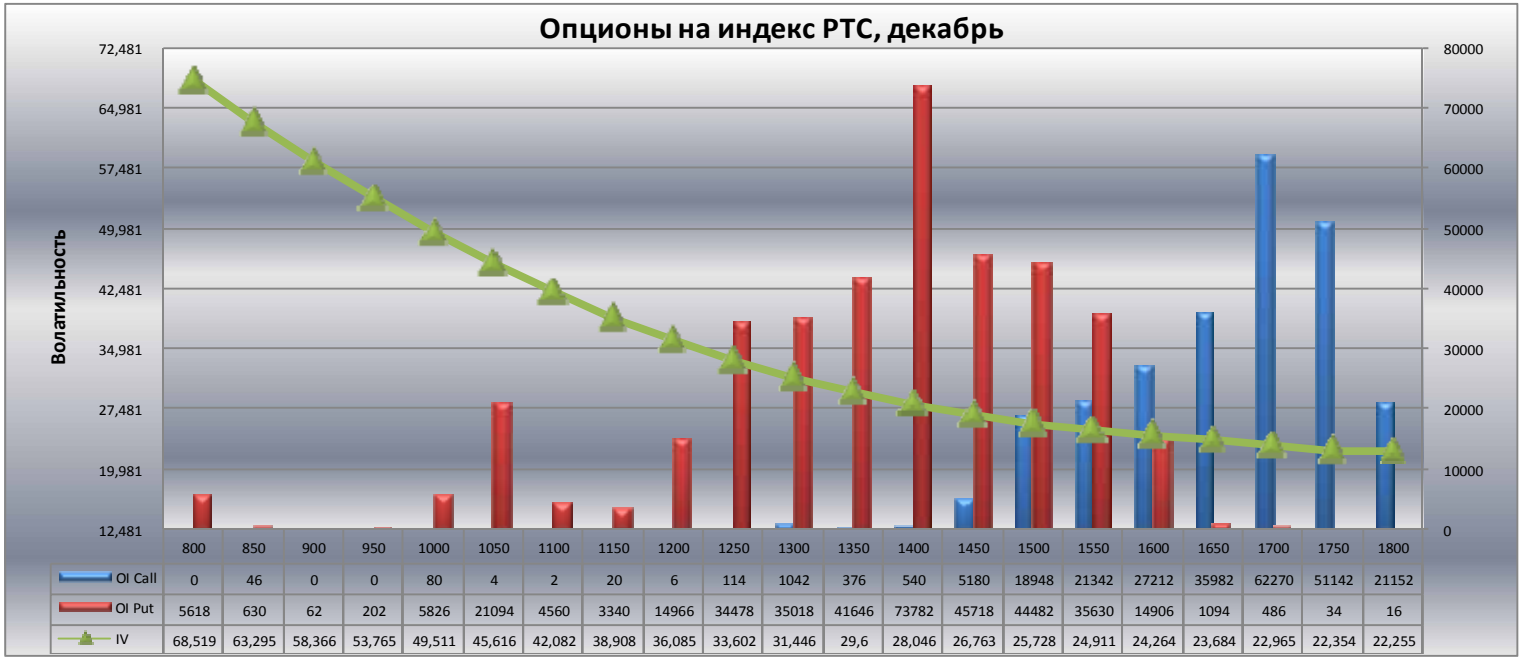
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,29	414392	15668061179,22	158405
ROSN-12.10	0,15	56000	3655015,00	21424
LKOH-12.10	0,42	180368	57240441,00	17424
GAZR-12.10	0,33	775168	125872627,00	16814
GMKR-12.10	0,28	35238	7355877,00	55095
SBRF-12.10	0,37	1107784	642488258,00	10053
VTBR-12.10	0,23	103310	16733601,00	10071
GOLD-12.10	0,17	57528	214869454,46	1329,8
Si-12.10	-0,12	919044	658516740,00	30786
Eu-12.10	-0,11	176474	42450511,00	42424
ED-12.10	-0,21	414604	3805863755,99	1,3758
SBPR-12.10	0,22	205746	11225766,00	6950
RTSS-12.10	0,07	14996	36236155,00	10377
BR-12.10	1,01	5088	36856352,64	83,7

Дневная сессия

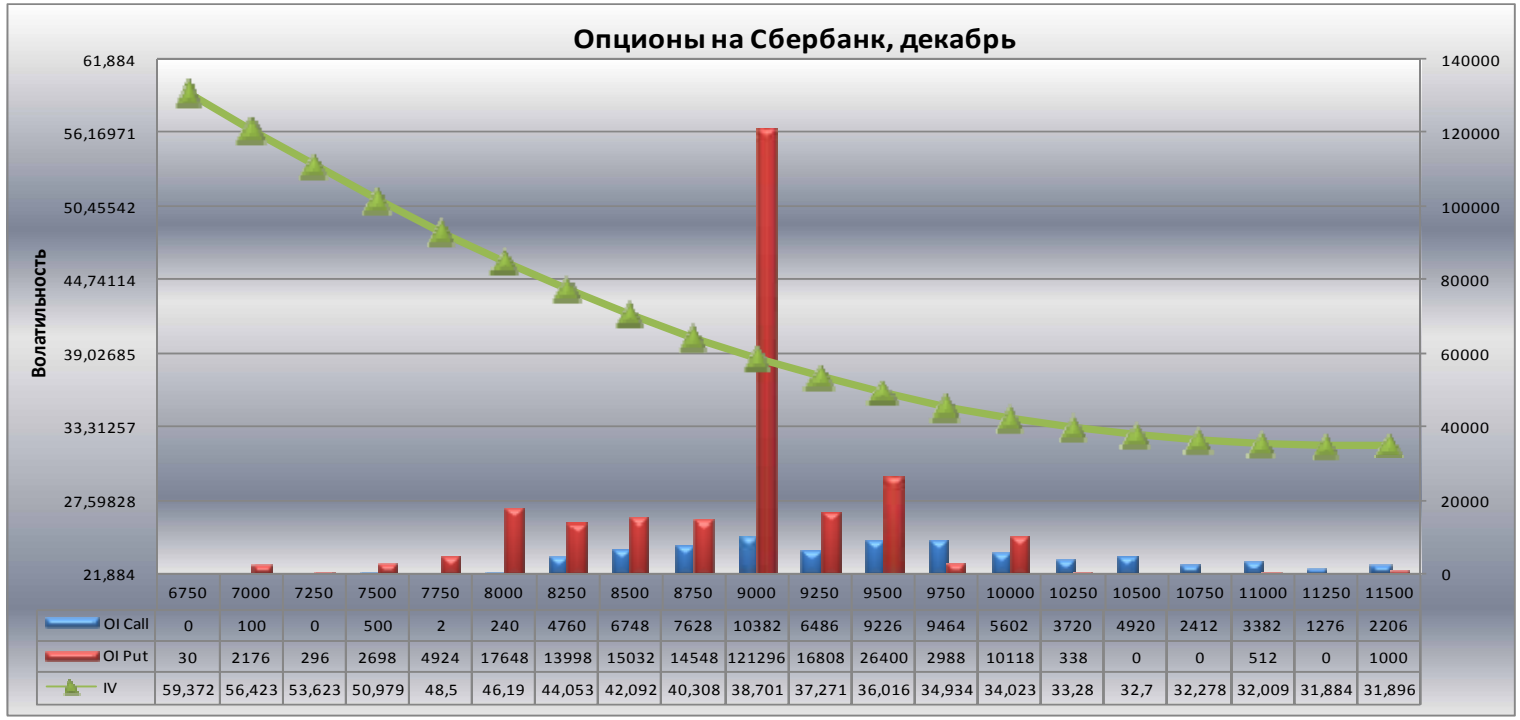
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,8	428338	104004898777,18	157955
ROSN-12.10	-2,01	56036	237220394,00	21391
LKOH-12.10	-0,58	181052	679234506,00	17351
GAZR-12.10	-0,83	773676	2232234359,00	16759
GMKR-12.10	-0,94	35324	383471644,00	54940
SBRF-12.10	-1,64	1113990	8155621018,00	10016
VTBR-12.10	-2,08	103578	187128304,00	10048
GOLD-12.10	-0,77	56374	836651770,06	1327,6
Si-12.10	0,87	917368	14874499539,00	30824
Eu-12.10	0,09	174560	316562498,00	42470
ED-12.10	-0,56	414636	18666901704,64	1,3787
SBPR-12.10	-1,42	205728	156224570,00	6935
RTSS-12.10	-0,99	15356	1549285905,00	10369,5
BR-12.10	-1,12	3126	66817439,37	82,86

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	20	6	114	1042	376	540	5180	18948	21342	27212	35982	62270	51142	21152
OI Put	5618	630	62	202	5826	21094	4560	3340	14966	34478	35018	41646	73782	45718	44482	35630	14906	1094	486	34	16
IV	68,519	63,295	58,366	53,765	49,511	45,616	42,082	38,908	36,085	33,602	31,446	29,6	28,046	26,763	25,728	24,911	24,264	23,684	22,965	22,354	22,255

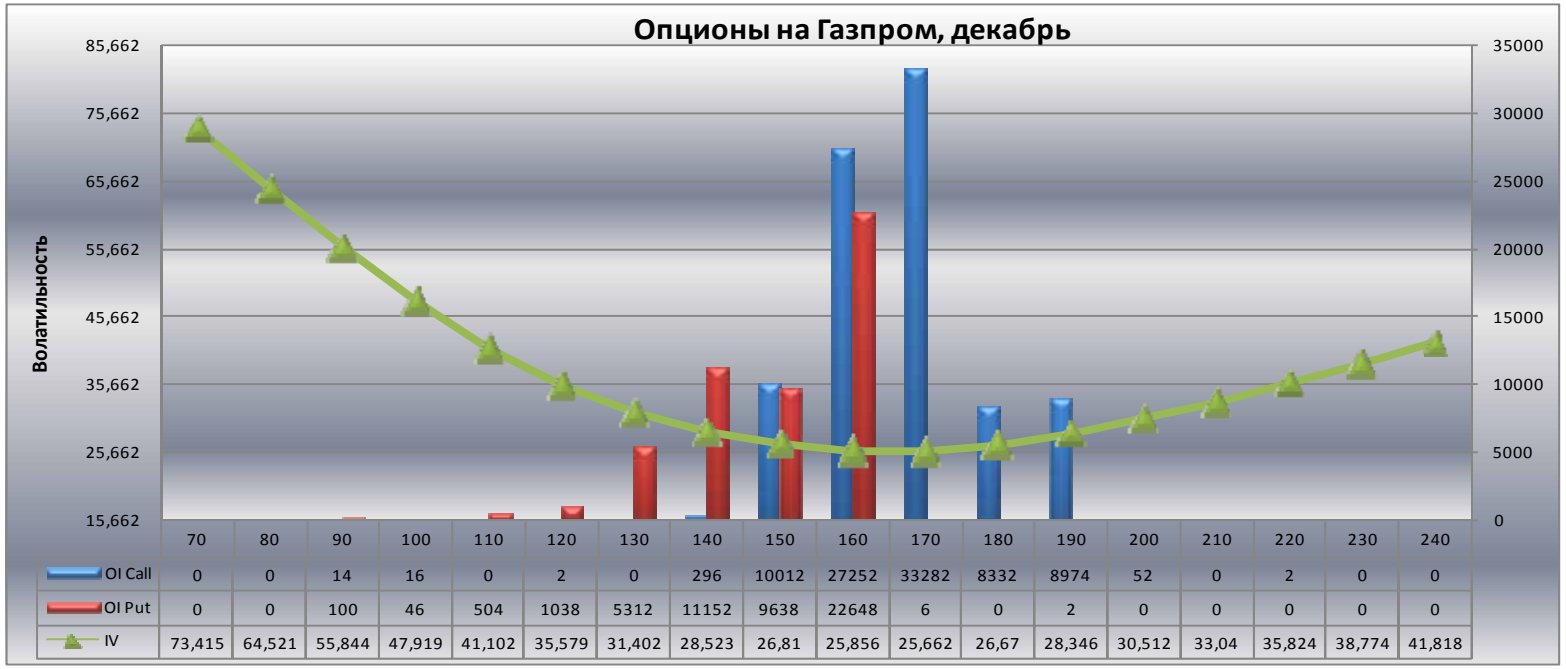
Опционы на Сбербанк, декабрь



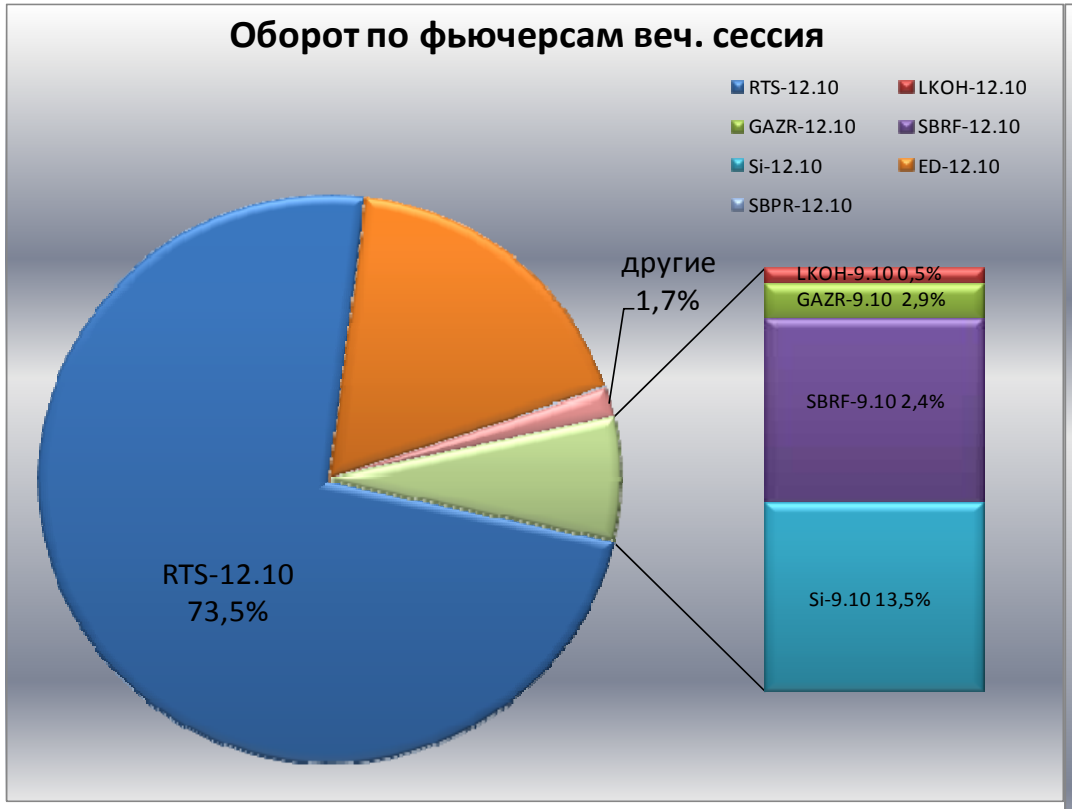
	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500
OI Call	0	100	0	500	2	240	4760	6748	7628	10382	6486	9226	9464	5602	3720	4920	2412	3382	1276	2206
OI Put	30	2176	296	2698	4924	17648	13998	15032	14548	121296	16808	26400	2988	10118	338	0	0	512	0	1000
IV	59,372	56,423	53,623	50,979	48,5	46,19	44,053	42,092	40,308	38,701	37,271	36,016	34,934	34,023	33,28	32,7	32,278	32,009	31,884	31,896

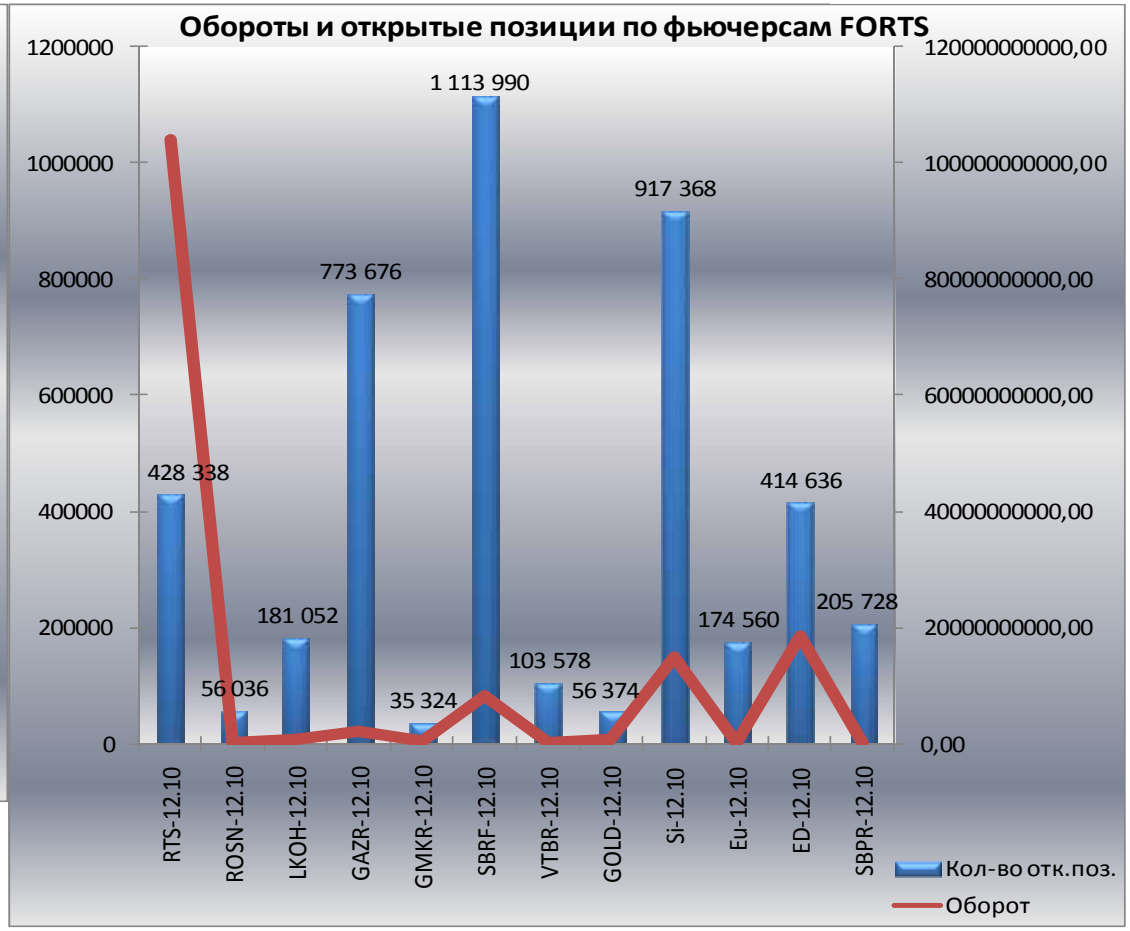


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	3184	19094	2112	178	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	174	3002	18788	6018	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	66,62	59,326	51,436	43,677	36,681	30,908	26,634	24,022	23,397	25,258	27,152	29,36	32,1	35,262	38,699	42,274	45,876	49,417



	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	10012	27252	33282	8332	8974	52	0	2	0	0
OI Put	0	0	100	46	504	1038	5312	11152	9638	22648	6	0	2	0	0	0	0	0
IV	73,415	64,521	55,844	47,919	41,102	35,579	31,402	28,523	26,81	25,856	25,662	26,67	28,346	30,512	33,04	35,824	38,774	41,818


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
1,7%
RTS-12.10
73,5%
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
1000000
800000
600000
400000
200000
0
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
428 338
56 036
181 052
773 676
35 324
1 113 990
103 578
56 374
917 368
174 560
414 636
205 728
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