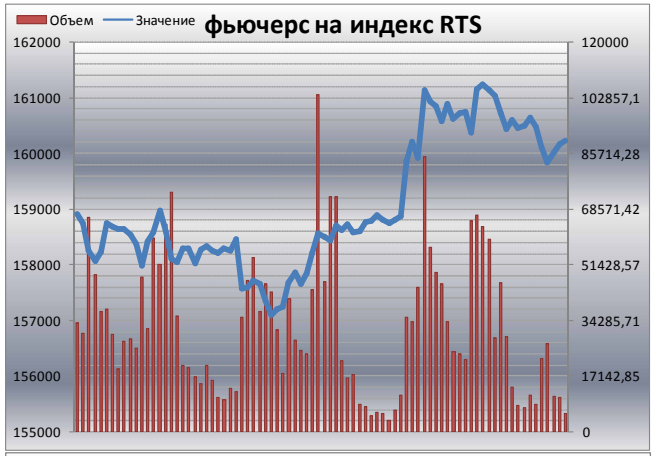
Дневной рост, вечерняя коррекция.

Российские площадки в понедельник всю дневную сессию находились во власти позитивных настроений, но ближе к концу сессии цены немного скорректировались, в вечернюю сессию превалировали разнонаправленные, но в целом негативные настроения. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали небольшой рост, оказавшись в умеренном плюсе к закрытию, что должно было способствовать росту котировок на российских рынках в вечернюю сессию. В итоге американские индексы Dow-Jones и S&P изменились к закрытию на 0.06% и 0.09%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 0.95% до уровня в 1599,04 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась падающая цена на нефть.

Несмотря на рост американских индексов, на вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,12%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 0.32%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял падением котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ упали на 0,10% и 0,10%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,07% и 0,23%, на что не было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на 0.06% и 0.05%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на 0.03%.





	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	160220	1602,20	-0,12	410 798	-1,70%	12 365 386 988	13,90%
ROSN-12.10	21766	217,66	-0,11	52 676	-0,76%	3 045 135	2,26%
LKOH-12.10	17534	1753,40	-0,10	168 922	-1,88%	24 327 262	3,75%
GAZR-12.10	17017	170,17	-0,10	772 140	0,50%	84 369 745	3,50%
GMKR-12.10	55900	5590,00	-0,12	41 148	4,78%	6 771 223	1,77%
SBRF-12.10	10223	102,23	0,06	1 082 208	-1,13%	351 718 426	4,73%
VTBR-12.10	10380	0,1038	0,05	101 532	2,81%	8 202 593	4,05%
GOLD-12.10	1353	1353,0000	0,03	58 738	-5,31%	66 091 435	9,50%
Si-12.10	30925	30,93	0,07	920 422	-1,04%	277 387 091	2,36%
Eu-12.10	42930	42,93	0,23	175 262	-1,42%	6 782 146	2,89%
ED-12.10	1,39	1,39	0,14	204 448	-36,12%	616 739 619	3,28%
SBPR-12.10	7088	70,88	-0,03	246 840	14,51%	1 655 231	0,69%
RTSS-12.10	10553	10552,50	-0,02	16 110	83,03%	5 693 030	5,51%
BR-12.10	85	84,57	-0,32	6 984	-54,36%	6 717 232	0,37%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	71560,93	1,26%	23:12:30
CAC 40	3841,11	0,20%	19:35:16
DAX 30	6604,86	0,05%	19:35:32
DJ Industrial	11124,62	0,06%	23:37:26
FTSE 100	5694,62	0,34%	19:35:31
Hang Seng	23662,64	0,04%	09:59:46
Nikkei 225	9159,98	0,06%	09:00:03
S&P 500	1184,38	0,09%	23:03:39
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1355,83	0,39%	09:59:55
Palladium	650,2	0,26%	09:58:10
Platinum	1708,85	0,11%	09:58:10
RTSI	1 599,37	-0,06%	23:50:00
RTS_Standard	10 532,48	-0,16%	23:50:00
RTSI_DEREX	1599,04	0,95%	18:45:00

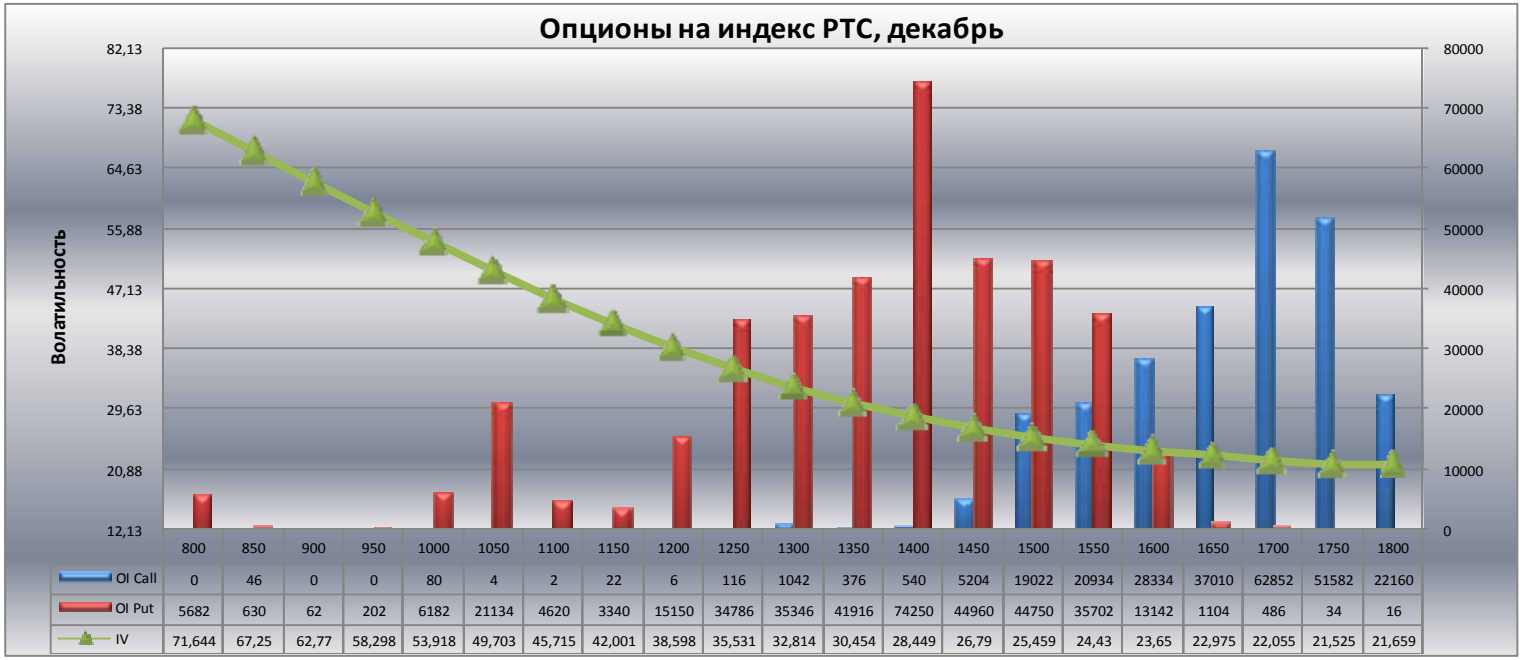
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,12	410798	12365386987,77	160220
ROSN-12.10	-0,11	52676	3045135,00	21766
LKOH-12.10	-0,1	168922	24327262,00	17534
GAZR-12.10	-0,1	772140	84369745,00	17017
GMKR-12.10	-0,12	41148	6771223,00	55900
SBRF-12.10	0,06	1082208	351718426,00	10223
VTBR-12.10	0,05	101532	8202593,00	10380
GOLD-12.10	0,03	58738	66091435,35	1353
Si-12.10	0,07	920422	277387091,00	30925
Eu-12.10	0,23	175262	6782146,00	42930
ED-12.10	0,14	204448	616739619,07	1,3882
SBPR-12.10	-0,03	246840	1655231,00	7088
RTSS-12.10	-0,02	16110	5693030,00	10552,5
BR-12.10	-0,32	6984	6717231,82	84,57

Дневная сессия

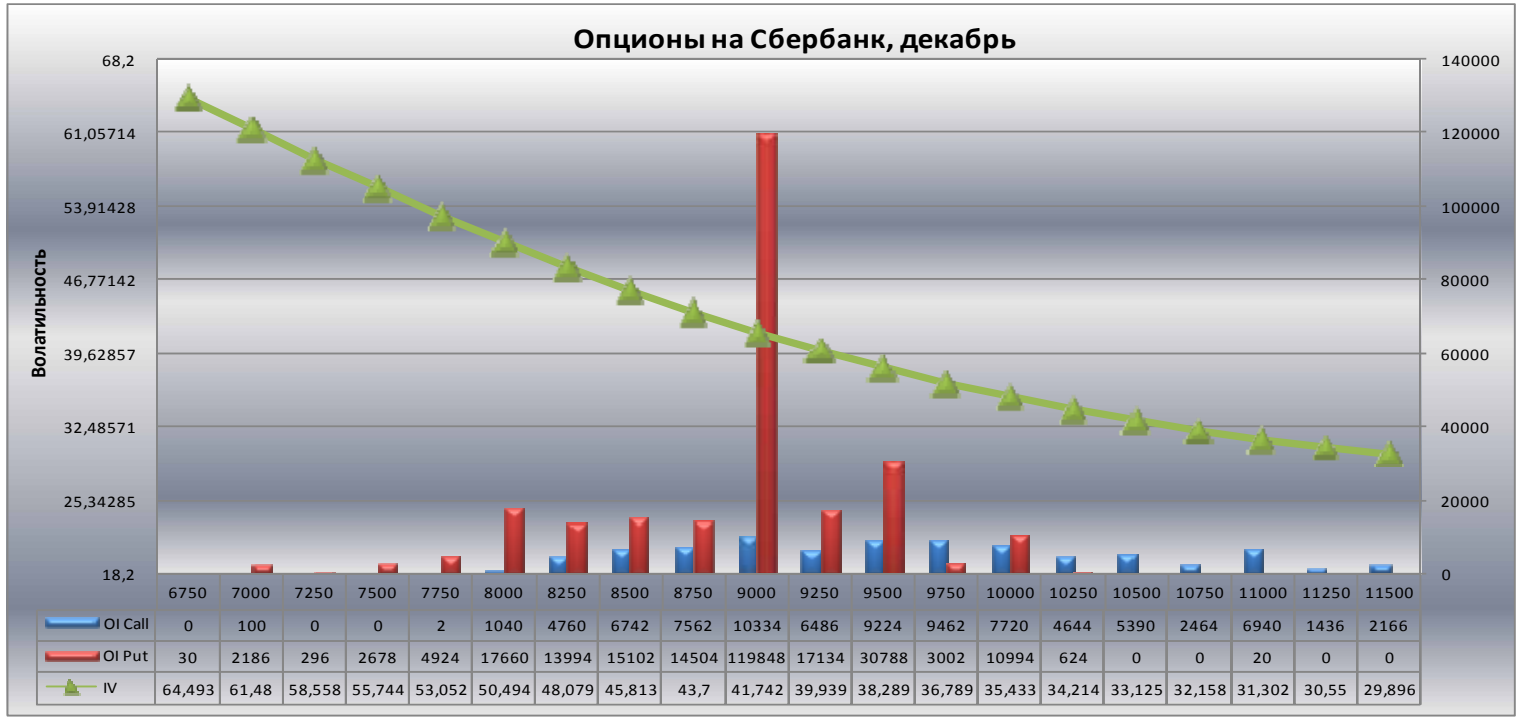
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,06	417904	88980967873,25	158040
ROSN-12.10	0	53082	134793073,00	21390
LKOH-12.10	-1,14	172166	649338086,00	17153
GAZR-12.10	-0,06	768296	2411967509,00	16748
GMKR-12.10	1,11	39270	381497910,00	55550
SBRF-12.10	-0,47	1094540	7434901576,00	9973
VTBR-12.10	-0,25	98760	202731673,00	10023
GOLD-12.10	0,35	62034	695357547,55	1332,3
Si-12.10	-0,19	930132	11739029677,00	30765
Eu-12.10	0,63	177786	234658639,00	42738
ED-12.10	0,72	320030	18787921820,35	1,3886
SBPR-12.10	0,14	215570	240080996,00	6945
RTSS-12.10	-0,06	15302	1804310005,00	10363
BR-12.10	0,75	8802	103255007,88	83,52

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	22	6	116	1042	376	540	5204	19022	20934	28334	37010	62852	51582	22160
OI Put	5682	630	62	202	6182	21134	4620	3340	15150	34786	35346	41916	74250	44960	44750	35702	13142	1104	486	34	16
IV	71,644	67,25	62,77	58,298	53,918	49,703	45,715	42,001	38,598	35,531	32,814	30,454	28,449	26,79	25,459	24,43	23,65	22,975	22,055	21,525	21,659

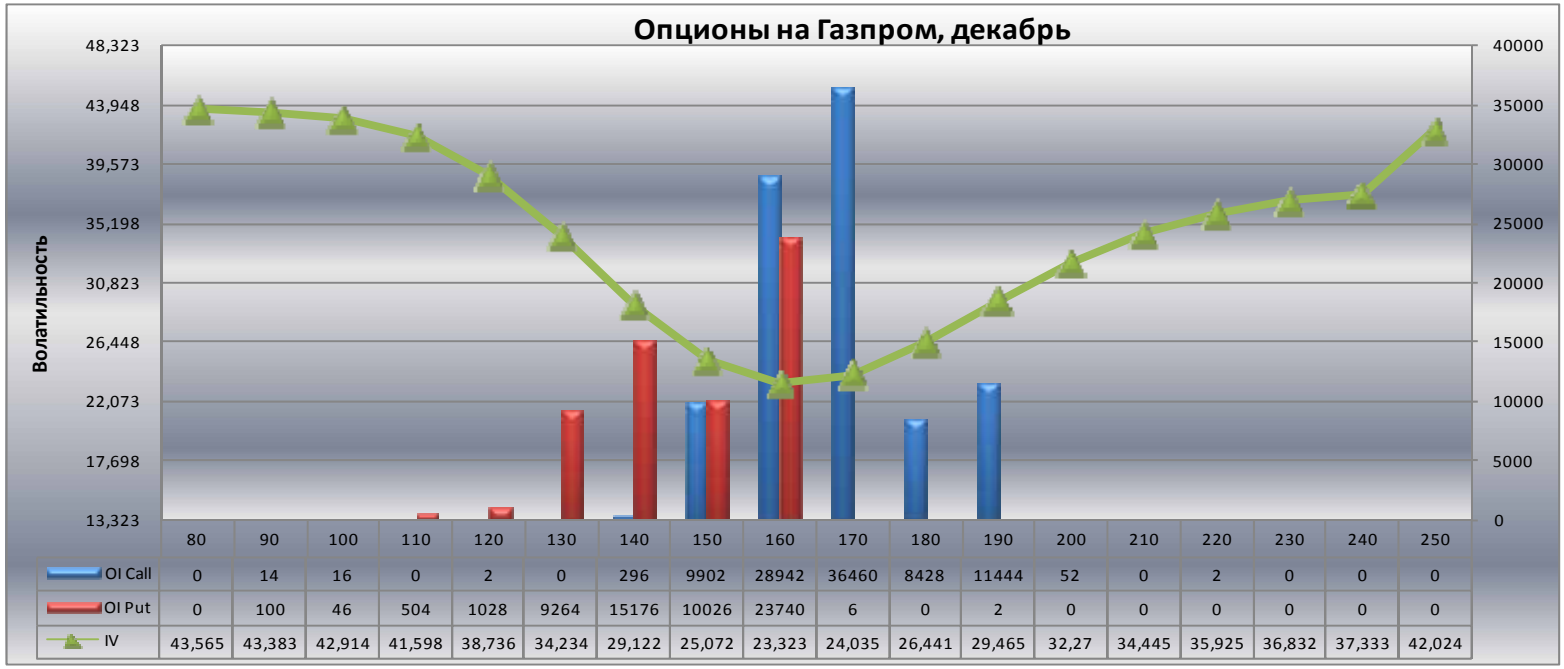
Опционы на Сбербанк, декабрь



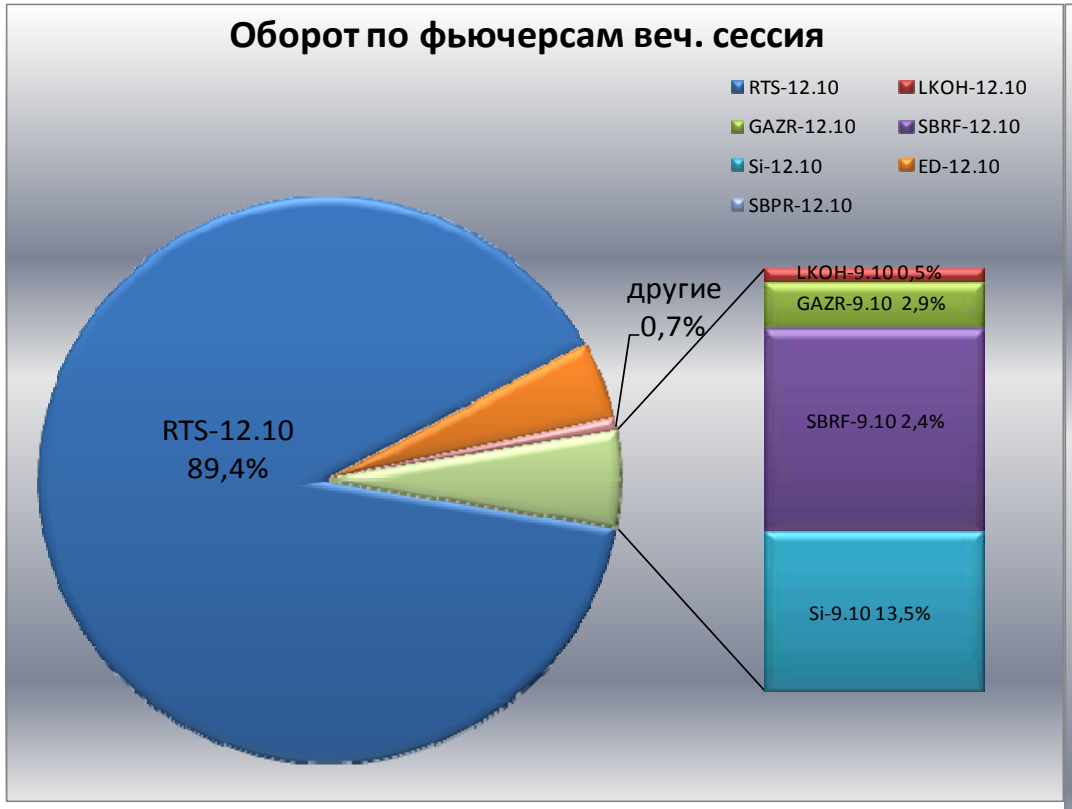
	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500
OI Call	0	100	0	0	2	1040	4760	6742	7562	10334	6486	9224	9462	7720	4644	5390	2464	6940	1436	2166
OI Put	30	2186	296	2678	4924	17660	13994	15102	14504	119848	17134	30788	3002	10994	624	0	0	20	0	0
IV	64,493	61,48	58,558	55,744	53,052	50,494	48,079	45,813	43,7	41,742	39,939	38,289	36,789	35,433	34,214	33,125	32,158	31,302	30,55	29,896

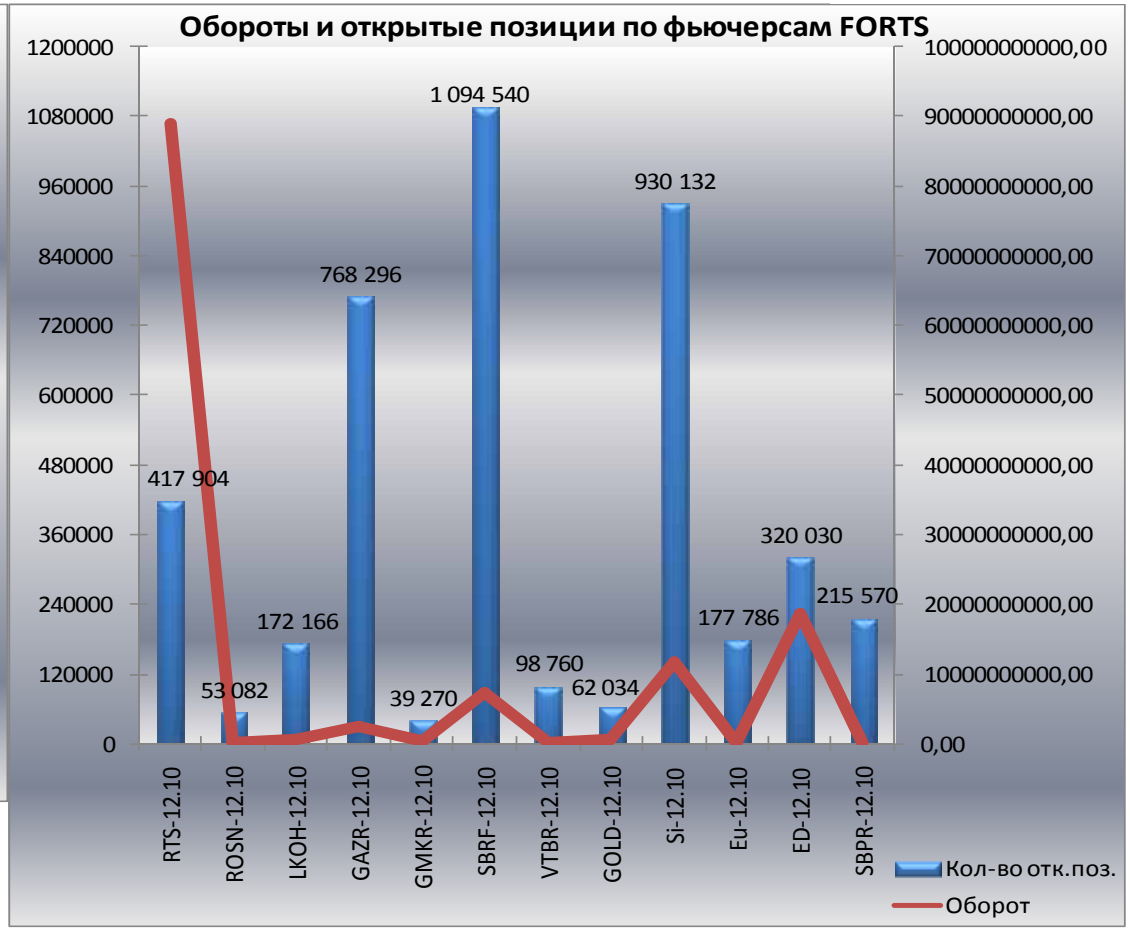


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	3202	18746	2146	182	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	174	3020	18394	6016	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	82,278	71,503	61,071	51,481	43,076	36,06	30,536	26,545	24,13	23,441	24,69	27,066	29,424	31,853	34,541	37,519	40,749	44,173



	80	90	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250
OI Call	0	14	16	0	2	0	296	9902	28942	36460	8428	11444	52	0	2	0	0	0
OI Put	0	100	46	504	1028	9264	15176	10026	23740	6	0	2	0	0	0	0	0	0
IV	43,565	43,383	42,914	41,598	38,736	34,234	29,122	25,072	23,323	24,035	26,441	29,465	32,27	34,445	35,925	36,832	37,333	42,024


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
89,4%
другие
0,7%
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
417 904
53 082
172 166
768 296
39 270
1 094 540
98 760
62 034
930 132
177 786
320 030
215 570
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