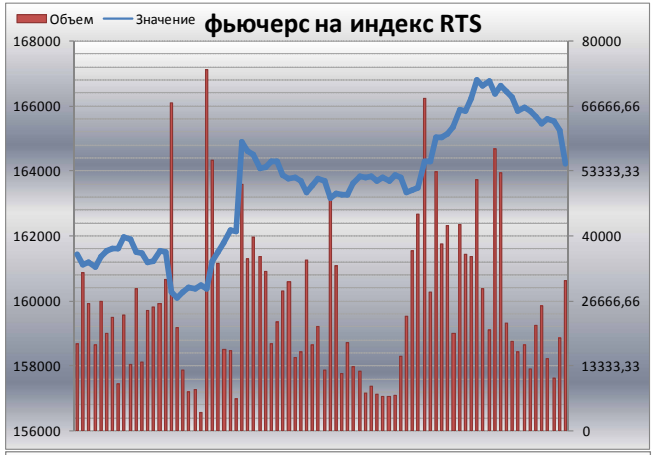
## Дневной рост, вечернее падение.

Российские площадки во вторник всю дневную сессию находились во власти позитивных настроений, но ближе к концу сессии цены немного скорректировались, в вечернюю сессию также превалировали негативные настроения. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы с открытия показали сначала небольшое падение, за которым последовал небольшой рост, после чего последовало дальнейшее падение, оказавшись в сильном плюсе к закрытию, что способствовало падению котировок на российских рынках в вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на -0.53% и -0.81%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 1.97% до уровня в 1662,79 пункта.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 1,33%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 1.50%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял сильным падением котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,71% и -0,95%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на +0,69% и -0,41%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.80% и -0.83%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на –2.41%.







| | 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 | 164235 | 1642,35 | -1,33 | 394 062 | -5,99% | 19 070 577 685 | 23,16% |
| ROSN-12.10 | 22190 | 221,90 | -0,71 | 54 634 | -0,03% | 53 290 | 2,81% |
| LKOH-12.10 | 17862 | 1786,20 | -0,95 | 157 086 | 1,18% | 668 889 | 5,58% |
| GAZR-12.10 | 17539 | 175,39 | -0,71 | 704 002 | -0,10% | 1 845 613 | 5,01% |
| GMKR-12.10 | 60050 | 6005,00 | -0,74 | 47 840 | -0,18% | 233 961 | 3,34% |
| SBRF-12.10 | 10310 | 103,10 | -0,80 | 787 944 | 0,27% | 4 018 179 | 6,16% |
| VTBR-12.10 | 10690 | 0,1069 | -0,83 | 109 722 | -0,15% | 154 201 | 4,85% |
| GOLD-12.10 | 1387 | 1387,1000 | -2,41 | 60 000 | -0,97% | 143 218 585 | 66,70% |
| Si-12.10 | 30937 | 30,94 | 0,69 | 1 099 024 | -0,11% | 6 879 633 | 3,62% |
| Eu-12.10 | 42562 | 42,56 | -0,41 | 179 250 | -0,24% | 864 630 | 60,47% |
| ED-12.10 | 1,38 | 1,38 | -1,03 | 293 878 | 31,00% | 436 679 868 | 20,26% |
| SBPR-12.10 | 7106 | 71,06 | -0,87 | 232 736 | 0,14% | 31 570 | 2,61% |
| RTSS-12.10 | 10848 | 10848,00 | -0,66 | 13 080 | -69,86% | 1 326 905 | 0,18% |
| BR-12.10 | 88 | 87,55 | -1,50 | 43 402 | 230,56% | 75 208 122 | 42,80% |

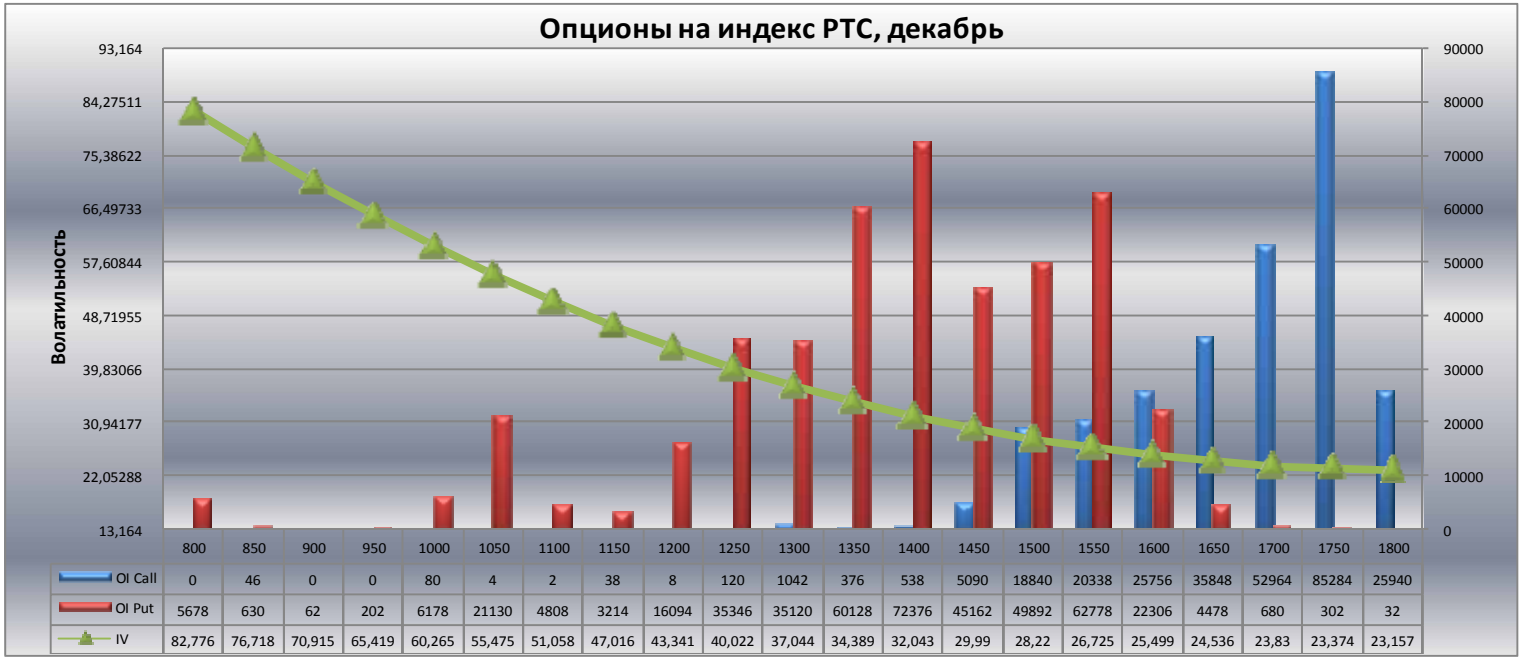
| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| BOVESPA Brazil | 71679,47 | -1,35% | 23:13:32 |
| CAC 40 | 3945,71 | 0,82% | 19:35:17 |
| DAX 30 | 6787,81 | 0,55% | 19:35:34 |
| DJ Industrial | 11346,75 | -0,53% | 00:41:00 |
| FTSE 100 | 5875,19 | 0,43% | 19:35:33 |
| Hang Seng | 24629,34 | -0,33% | 10:06:32 |
| Nikkei 225 | 9830,52 | 1,40% | 09:00:12 |
| S&P 500 | 1213,4 | -0,81% | 00:06:34 |
| Brent Crude Oil 0910 | 74,85 | -0,35% | 03:47:43 |
| Gold | 1397,75 | 0,35% | 10:06:32 |
| Palladium | 693,53 | 0,51% | 10:06:10 |
| Platinum | 1759,35 | 0,18% | 10:06:10 |
| RTSI | 1 646,71 | -0,77% | 23:50:00 |
| RTS_Standard | 10 847,11 | -0,54% | 23:50:00 |
| RTSI_DEREX | 1662,79 | 1,97% | 18:45:00 |

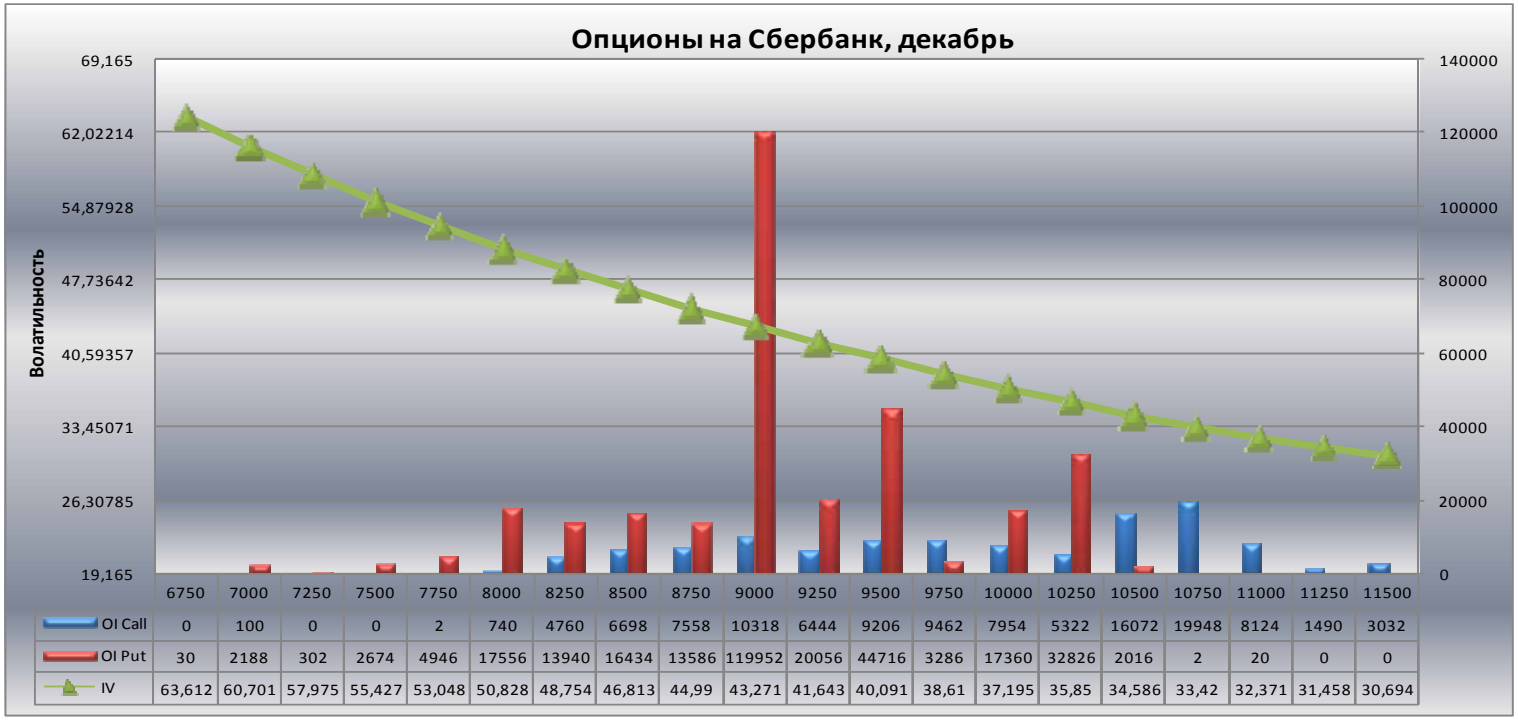
# Вечерняя сессия

| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | -1,33 | 394062 | 19070577684,95 | 164235 |
| ROSN-12.10 | -0,71 | 54634 | 53289,89 | 22190 |
| LKOH-12.10 | -0,95 | 157086 | 668888,62 | 17862 |
| GAZR-12.10 | -0,71 | 704002 | 1845613,05 | 17539 |
| GMKR-12.10 | -0,74 | 47840 | 233960,52 | 60050 |
| SBRF-12.10 | -0,8 | 787944 | 4018178,83 | 10310 |
| VTBR-12.10 | -0,83 | 109722 | 154201,22 | 10690 |
| GOLD-12.10 | -2,41 | 60000 | 143218585,48 | 1387,1 |
| Si-12.10 | 0,69 | 1099024 | 6879632,82 | 30937 |
| Eu-12.10 | -0,41 | 179250 | 864629,89 | 42562 |
| ED-12.10 | -1,03 | 293878 | 436679868,20 | 1,376 |
| SBPR-12.10 | -0,87 | 232736 | 31570,16 | 7106 |
| RTSS-12.10 | -0,66 | 13080 | 1326904,50 | 10848 |
| BR-12.10 | -1,5 | 43402 | 75208121,58 | 87,55 |

# Дневная сессия

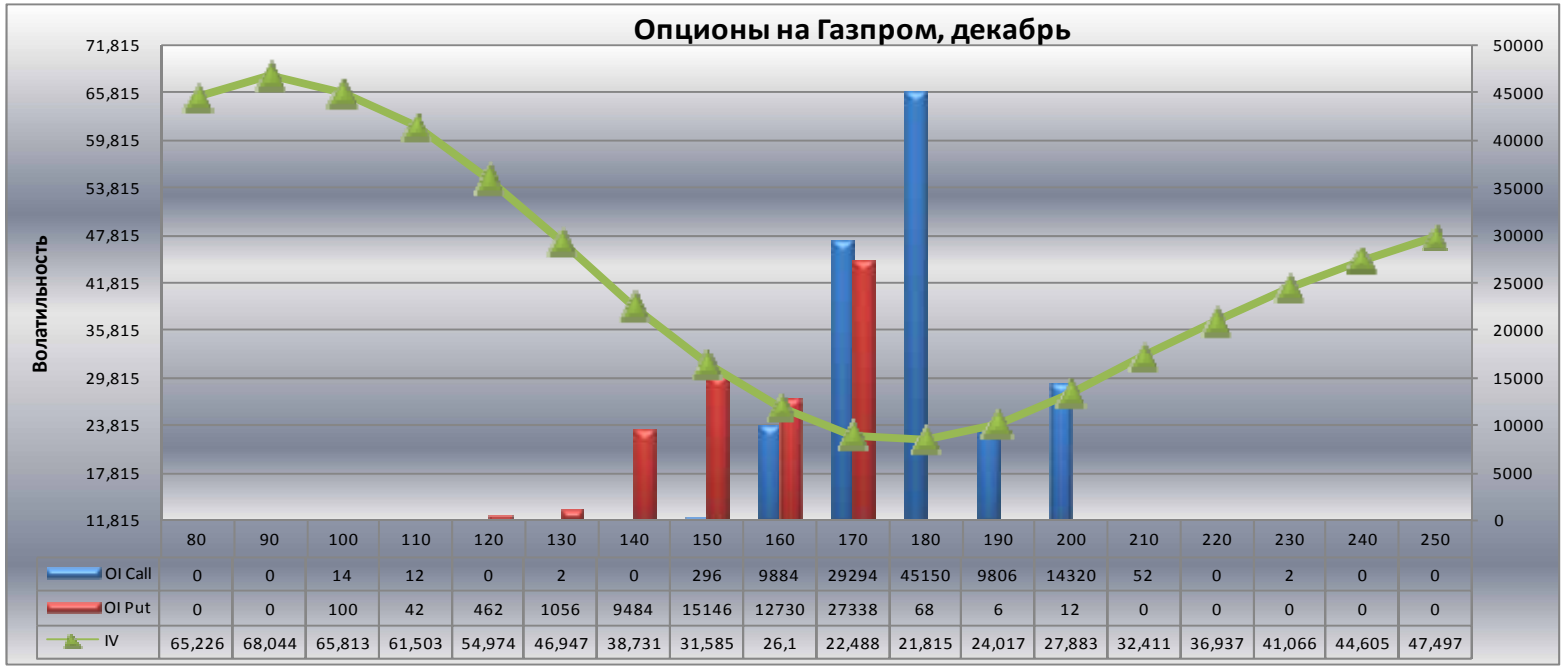
| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | 1,94 | 419162 | 82354279069,92 | 166450 |
| ROSN-12.10 | 1,2 | 54652 | 1899356,56 | 22358 |
| LKOH-12.10 | 1,5 | 155250 | 11996893,76 | 18034 |
| GAZR-12.10 | 1,17 | 704732 | 36860125,67 | 17664 |
| GMKR-12.10 | 3,12 | 47928 | 6994555,85 | 60500 |
| SBRF-12.10 | -0,31 | 785794 | 65209109,98 | 10393 |
| VTBR-12.10 | 1,03 | 109888 | 3179678,67 | 10780 |
| GOLD-12.10 | 1,88 | 60588 | 214705786,78 | 1421,3 |
| Si-12.10 | -0,6 | 1100184 | 190303990,06 | 30724 |
| Eu-12.10 | -0,5 | 179690 | 1429738,01 | 42739 |
| ED-12.10 | 0,03 | 224340 | 2155620521,00 | 1,3903 |
| SBPR-12.10 | 0,07 | 232420 | 1207834,13 | 7165 |
| RTSS-12.10 | 1,36 | 13130 | 175706155,00 | 10920,5 |
| BR-12.10 | 1,24 | 43404 | 749941695,44 | 88,86 |


Опционы на индекс РТС, декабрь
Волатильность
93,164
84,27511
75,38622
66,49733
57,60844
48,71955
39,83066
30,94177
22,05288
13,164
90000
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 38 8 120 1042 376 538 5090 18840 20338 25756 35848 52964 85284 25940
OI Put 5678 630 62 202 6178 21130 4808 3214 16094 35346 35120 60128 72376 45162 49892 62778 22306 4478 680 302 32
IV 82,776 76,718 70,915 65,419 60,265 55,475 51,058 47,016 43,341 40,022 37,044 34,389 32,043 29,99 28,22 26,725 25,499 24,536 23,83 23,374 23,157

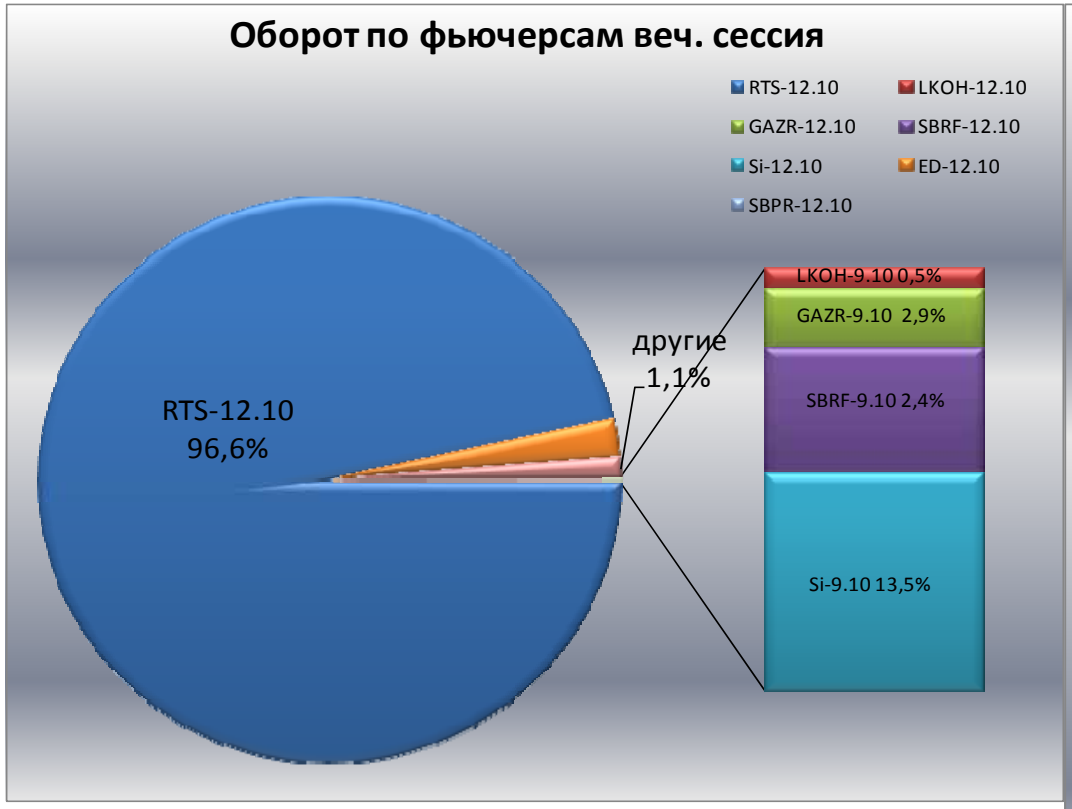

Опционы на Сбербанк, декабрь
Волатильность
69,165
62,02214
54,87928
47,73642
40,59357
33,45071
26,30785
19,165
140000
120000
100000
80000
60000
40000
20000
0
6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500
OI Call 0 100 0 0 2 740 4760 6698 7558 10318 6444 9206 9462 7954 5322 16072 19948 8124 1490 3032
OI Put 30 2188 302 2674 4946 17556 13940 16434 13586 119952 20056 44716 3286 17360 32826 2016 2 20 0 0
IV 63,612 60,701 57,975 55,427 53,048 50,828 48,754 46,813 44,99 43,271 41,643 40,091 38,61 37,195 35,85 34,586 33,42 32,371 31,458 30,694

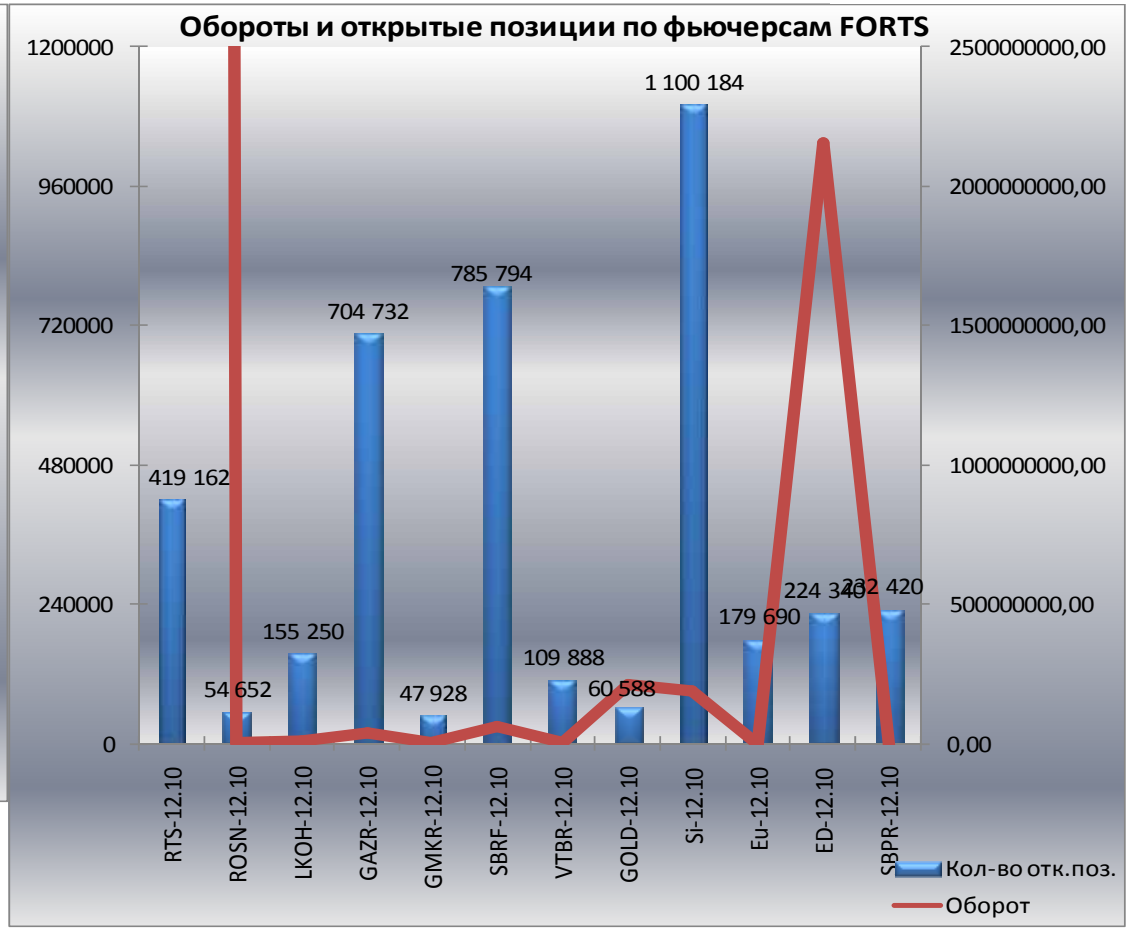



| | 900 | 1000 | 1100 | 1200 | 1300 | 1400 | 1500 | 1600 | 1700 | 1800 | 1900 | 2000 | 2100 | 2200 | 2300 | 2400 | 2500 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 | 0 | 78 | 3212 | 17316 | 4350 | 468 | 30 | 260 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| OI Put | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 22 | 174 | 3000 | 18074 | 5896 | 18 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| IV | 77,739 | 76,551 | 73,686 | 68,21 | 59,848 | 49,416 | 38,635 | 29,466 | 23,41 | 21,111 | 22,362 | 26,366 | 32,082 | 38,513 | 44,878 | 50,663 | 55,603 | 59,621 |




| | 80 | 90 | 100 | 110 | 120 | 130 | 140 | 150 | 160 | 170 | 180 | 190 | 200 | 210 | 220 | 230 | 240 | 250 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 0 | 14 | 12 | 0 | 2 | 0 | 296 | 9884 | 29294 | 45150 | 9806 | 14320 | 52 | 0 | 2 | 0 | 0 |
| OI Put | 0 | 0 | 100 | 42 | 462 | 1056 | 9484 | 15146 | 12730 | 27338 | 68 | 6 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| IV | 65,226 | 68,044 | 65,813 | 61,503 | 54,974 | 46,947 | 38,731 | 31,585 | 26,1 | 22,488 | 21,815 | 24,017 | 27,883 | 32,411 | 36,937 | 41,066 | 44,605 | 47,497 |


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
96,6%
другие
1,1%
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
960000
720000
480000
240000
0
2500000000,00
2000000000,00
1500000000,00
1000000000,00
500000000,00
0,00
419 162
54 652
155 250
704 732
47 928
785 794
109 888
60 588
1 100 184
179 690
224 340
232 420
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