Дневное падение, вечерний рост.

Российские площадки в среду в дневную сессию находились во власти негативных настроений, но ближе к концу сессии цены немного скорректировались в связи с в целом положительной статистикой по безработице в США, в вечернюю сессию превалировали позитивные настроения. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы с открытия показали сначала небольшой рост, за которым последовала коррерция, оказавшись в небольшом плюсе к закрытию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на +0.09% и +0.44%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 1.53% до уровня в 1640,34 пункта.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,72%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.68%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказано поддержки, что рынок воспринял ростом котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на 0,61% и 0,37%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,24% и +0,38%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на 0.86% и 0.40%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +1.00%.





	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	165435	1654,35	0,72	395 576	-0,91%	17 117 185 293	16,07%
ROSN-12.10	22292	222,92	0,79	55 412	0,23%	135 995 510	7,58%
LKOH-12.10	17820	1782,00	0,37	153 406	-0,13%	447 567 690	48,20%
GAZR-12.10	17596	175,96	0,61	715 248	0,23%	1 809 021 890	60,08%
GMKR-12.10	60401	6040,10	0,43	48 836	0,11%	196 465 290	43,64%
SBRF-12.10	10168	101,68	0,86	863 636	-0,52%	5 580 494 790	65,65%
VTBR-12.10	10671	0,1067	0,40	114 046	0,21%	60 315 550	26,18%
GOLD-12.10	1407	1406,7000	1,00	55 794	0,14%	713 661 054	20,62%
Si-12.10	30715	30,72	-0,24	1 041 314	0,18%	516 949 610	2,52%
Eu-12.10	42349	42,35	0,38	177 374	-0,02%	35 097	0,64%
ED-12.10	1,38	1,38	0,58	273 654	-7,77%	2 795 275 138	10,28%
SBPR-12.10	7089	70,89	0,84	230 588	0,02%	21 561	1,69%
RTSS-12.10	10826	10825,50	0,52	13 860	-68,20%	2 734 002	1,09%
BR-12.10	89	89,32	0,68	43 576	215,40%	102 969 419	57,68%

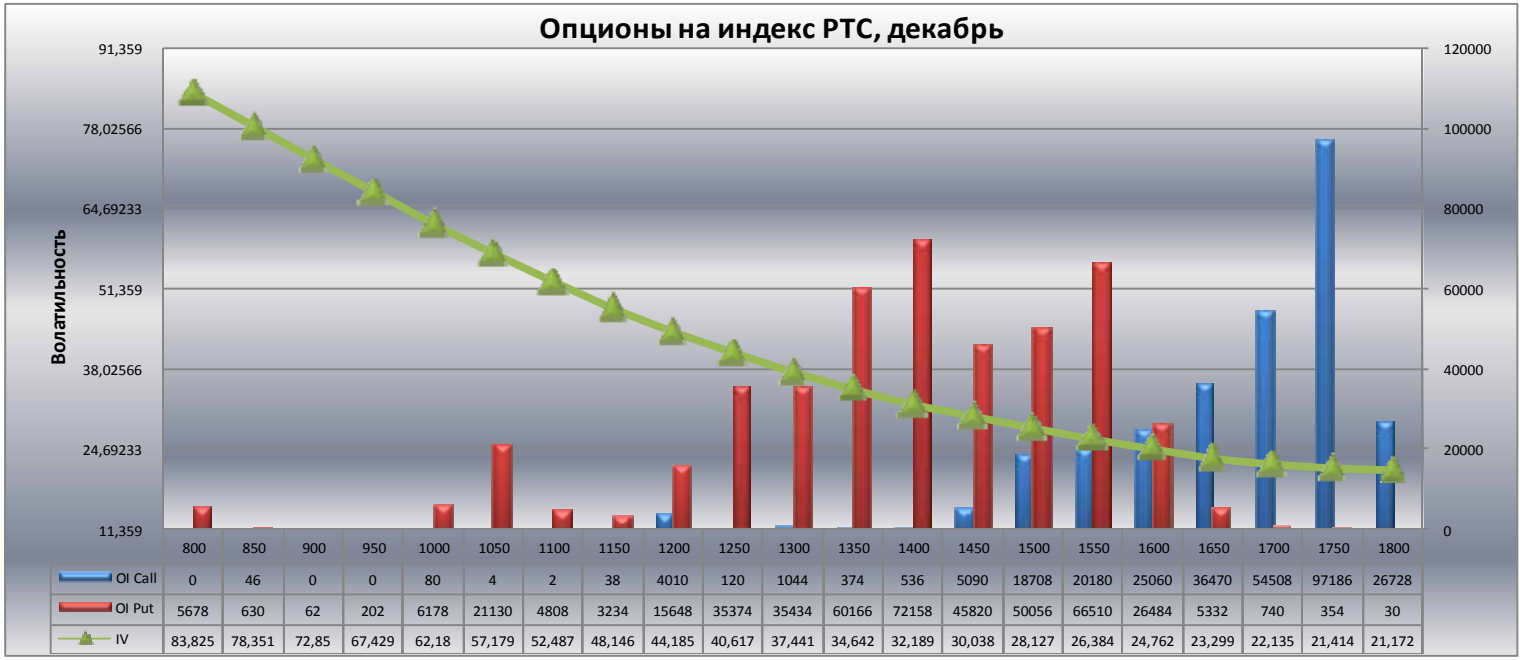
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	71638,38	-0,06%	23:12:30
CAC 40	3888,45	-1,45%	19:35:17
DAX 30	6719,84	-1,00%	19:35:31
DJ Industrial	11357,04	0,09%	00:41:02
FTSE 100	5816,94	-0,99%	19:35:30
Hang Seng	24821,27	1,31%	09:51:47
Nikkei 225	9861,46	0,31%	09:00:11
S&P 500	1218,71	0,44%	00:06:33
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1407,73	0,28%	09:51:48
Palladium	707,63	1,31%	09:51:09
Platinum	1754,75	1,23%	09:51:31
RTSI	1 649,85	0,78%	23:50:00
RTS_Standard	10 816,00	0,57%	23:50:00
RTSI_DEREX	1640,34	-1,53%	18:45:00

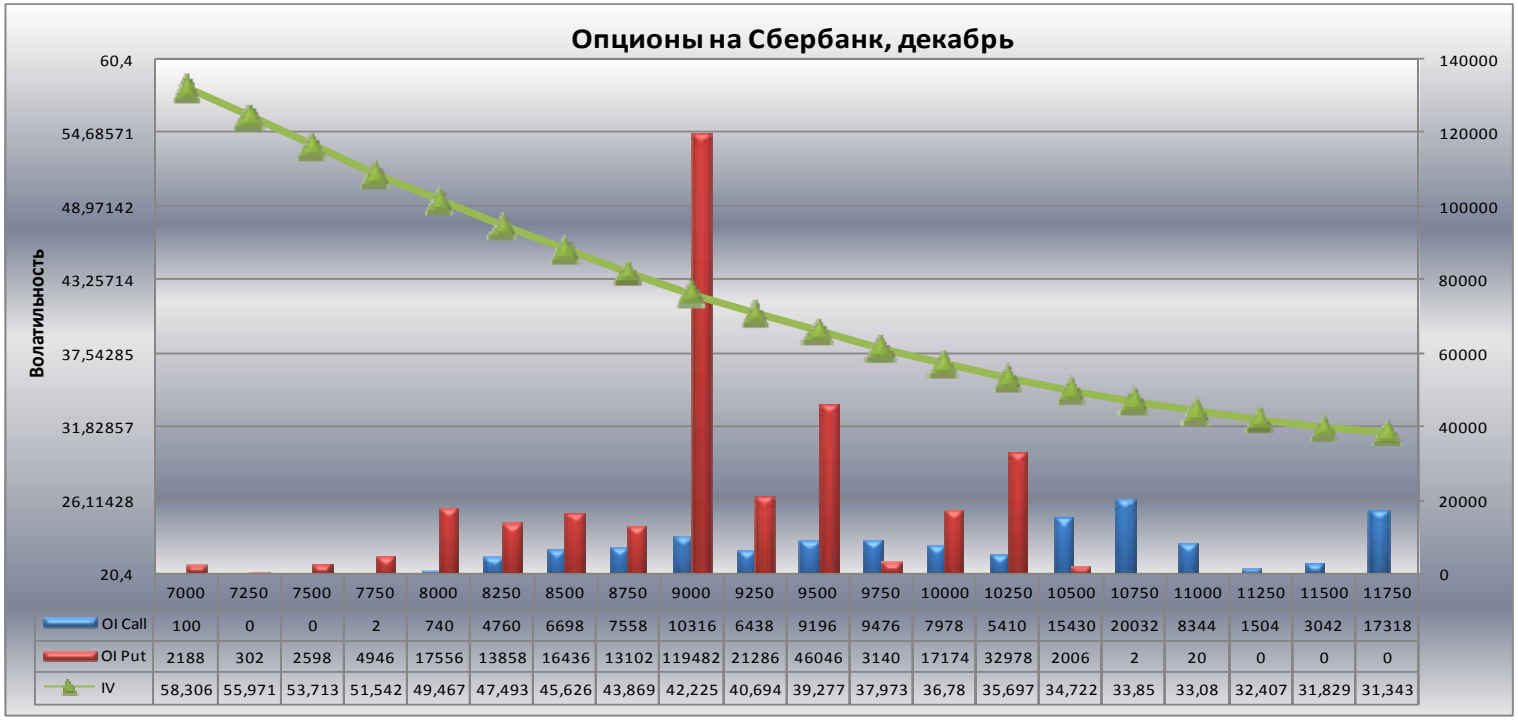
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,72	395576	17117185292,51	165435
ROSN-12.10	0,79	55412	135995510,00	22292
LKOH-12.10	0,37	153406	447567690,00	17820
GAZR-12.10	0,61	715248	1809021890,00	17596
GMKR-12.10	0,43	48836	196465290,00	60401
SBRF-12.10	0,86	863636	5580494790,00	10168
VTBR-12.10	0,4	114046	60315550,00	10671
GOLD-12.10	1	55794	713661053,58	1406,7
Si-12.10	-0,24	1041314	516949610,00	30715
Eu-12.10	0,38	177374	35096,57	42349
ED-12.10	0,58	273654	2795275138,42	1,3781
SBPR-12.10	0,84	230588	21560,68	7089
RTSS-12.10	0,52	13860	2734002,00	10825,5
BR-12.10	0,68	43576	102969418,61	89,32

Дневная сессия

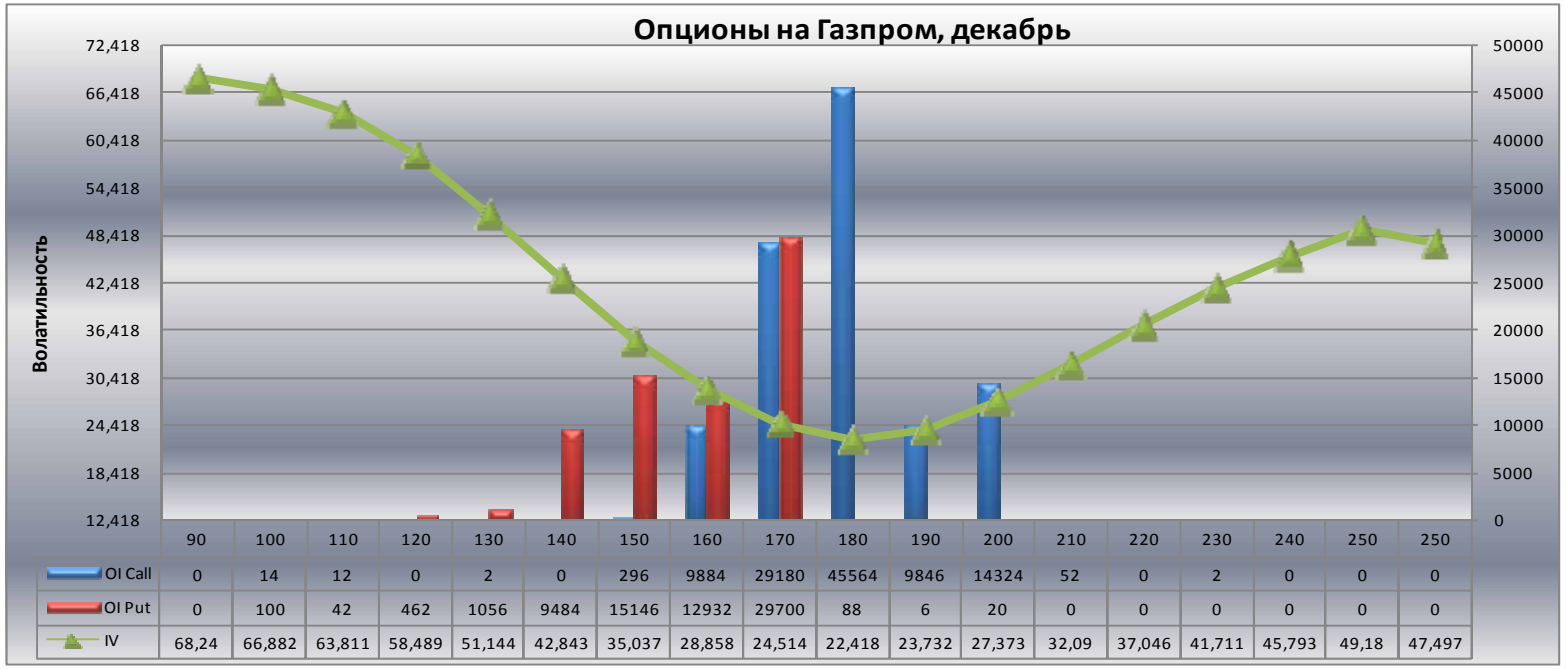
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,31	399214	106538082266,22	164265
ROSN-12.10	-1,08	55284	1793692010,00	22117
LKOH-12.10	-1,55	153604	928501009,00	17755
GAZR-12.10	-0,99	713606	3011055349,00	17490
GMKR-12.10	-0,6	48780	450230553,00	60140
SBRF-12.10	-3	868184	8500313046,00	10081
VTBR-12.10	-1,4	113802	230404847,00	10629
GOLD-12.10	-2,01	55714	3461802640,82	1392,8
Si-12.10	0,21	1039416	20540727736,00	30789
Eu-12.10	-1,29	177408	5459920,78	42188
ED-12.10	-1,45	296698	27186156555,09	1,3701
SBPR-12.10	-1,88	230550	1278631,14	7030
RTSS-12.10	-1,38	13816	178533656,50	10769,5
BR-12.10	-0,16	43580	250411190,17	88,72


Опционы на индекс РТС, декабрь
Волатильность
91,359
78,02566
64,69233
51,359
38,02566
24,69233
11,359
120000
100000
80000
60000
40000
20000
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 4010 120 1044 374 536 5090 18708 20180 25060 36470 54508 97186 26728
OI Put 5678 630 62 202 6178 21130 4808 3234 15648 35374 35434 60166 72158 45820 50056 66510 26484 5332 740 354 30
IV 83,825 78,351 72,85 67,429 62,18 57,179 52,487 48,146 44,185 40,617 37,441 34,642 32,189 30,038 28,127 26,384 24,762 23,299 22,135 21,414 21,172

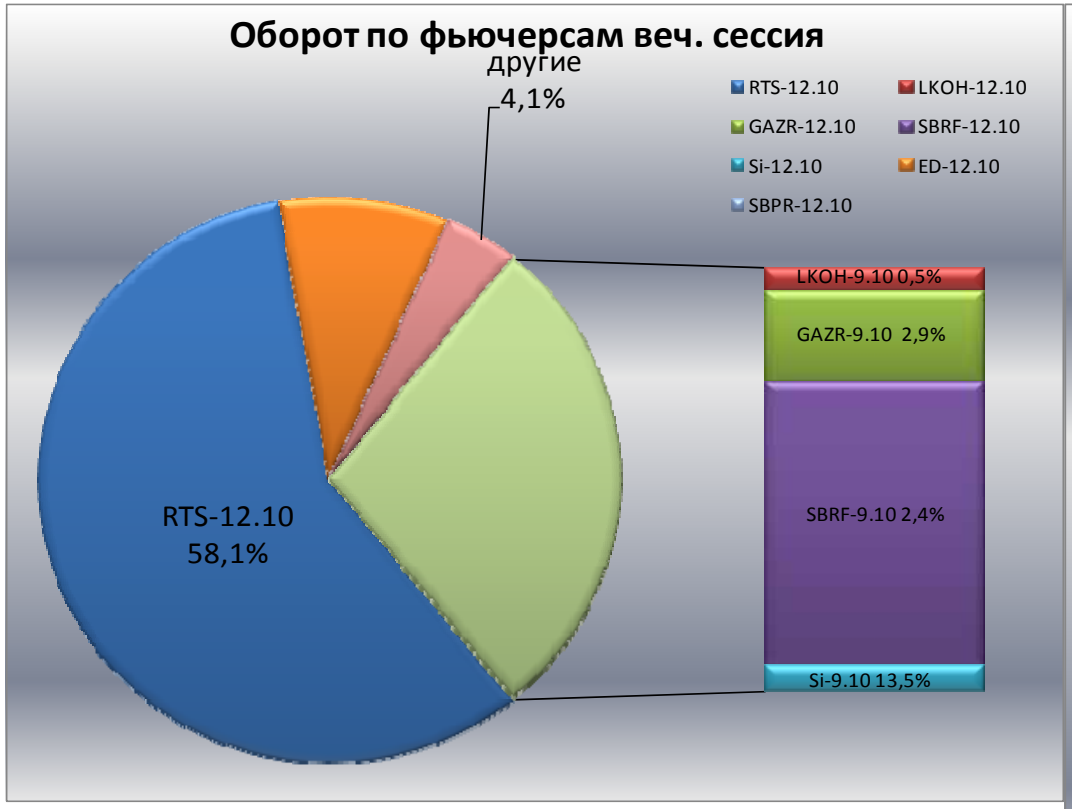

Опционы на Сбербанк, декабрь
Волатильность
60,4
54,68571
48,97142
43,25714
37,54285
31,82857
26,11428
20,4
140000
120000
100000
80000
60000
40000
20000
0
7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750 11000 11250 11500 11750
OI Call 100 0 0 2 740 4760 6698 7558 10316 6438 9196 9476 7978 5410 15430 20032 8344 1504 3042 17318
OI Put 2188 302 2598 4946 17556 13858 16436 13102 119482 21286 46046 3140 17174 32978 2006 2 20 0 0 0
IV 58,306 55,971 53,713 51,542 49,467 47,493 45,626 43,869 42,225 40,694 39,277 37,973 36,78 35,697 34,722 33,85 33,08 32,407 31,829 31,343

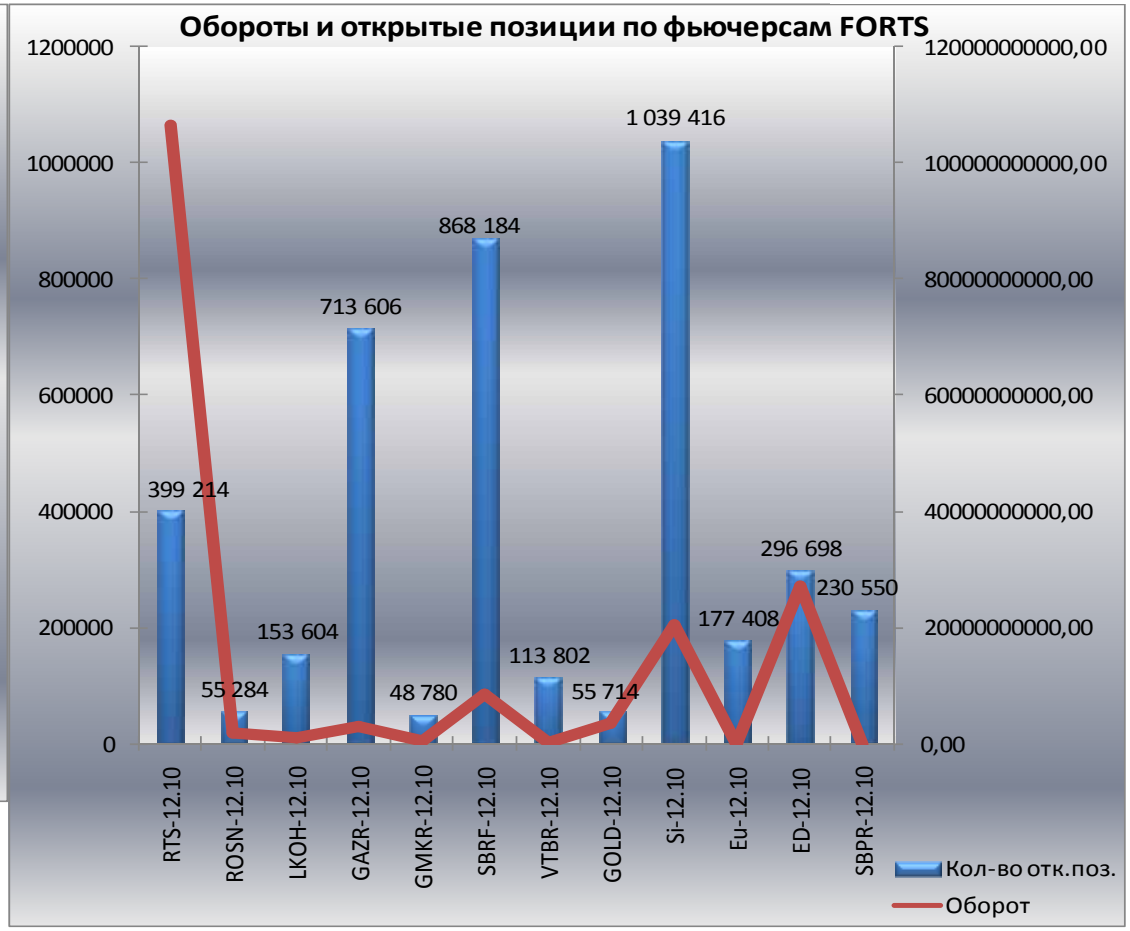


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	3212	17466	4414	468	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	174	3000	18074	7820	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	75,825	75,215	73,277	68,765	60,87	50,133	38,568	28,813	22,961	21,825	24,924	30,962	38,425	46,028	52,91	58,639	63,115	66,437



	90	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	250
OI Call	0	14	12	0	2	0	296	9884	29180	45564	9846	14324	52	0	2	0	0	0
OI Put	0	100	42	462	1056	9484	15146	12932	29700	88	6	20	0	0	0	0	0	0
IV	68,24	66,882	63,811	58,489	51,144	42,843	35,037	28,858	24,514	22,418	23,732	27,373	32,09	37,046	41,711	45,793	49,18	47,497


Оборот по фьючерсам веч. сессия
другие
4,1%
RTS-12.10
LKOH-12.10
GAZR-12.10
SBRF-12.10
Si-12.10
ED-12.10
SBPR-12.10
RTS-12.10
58,1%
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
1000000
800000
600000
400000
200000
0
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
399 214
55 284
153 604
713 606
48 780
868 184
113 802
55 714
1 039 416
177 408
296 698
230 550
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