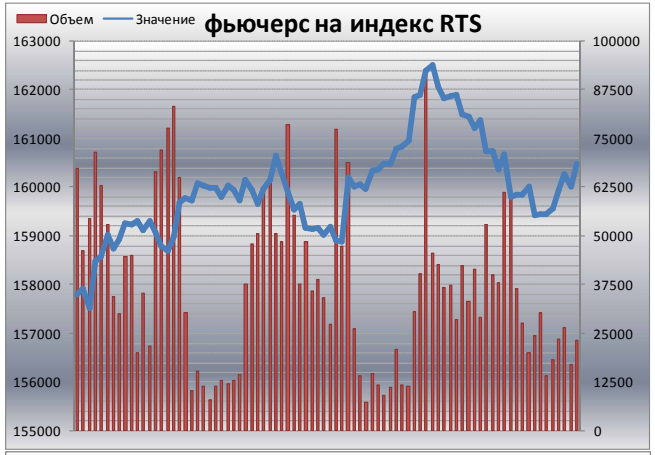
Дневное падение, вечерний рост.

Российские площадки в понедельник в дневную сессию находились во власти негативных настроений, ближе к концу сессии цены ускорили падение, и пребывали в относительно большом минусе. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы показали сначала резкое движение вниз, а впоследствии скорректировались вверх. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на -0.22% и –0.16%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.22% до уровня в 1597,34 пункта.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. Декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,39%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.13%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял ростом котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на +0,24% и +0,02%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,15% и -0,16%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.20% и +0.27%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +1.11%.





	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	160480	1604,80	0,39	544 380	-1,10%	22 369 562 777	24,18%
ROSN-12.10	21360	213,60	0,28	52 842	0,06%	9 689 298	5,80%
LKOH-12.10	17253	1725,30	0,02	163 780	0,53%	104 028 576	11,45%
GAZR-12.10	17060	170,60	0,24	770 786	-0,12%	181 493 462	6,01%
GMKR-12.10	59300	5930,00	0,46	76 710	-0,05%	11 819 157	2,20%
SBRF-12.10	9964	99,64	0,20	934 118	0,15%	491 654 335	7,42%
VTBR-12.10	10378	0,1038	0,27	148 216	0,23%	9 545 096	6,01%
GOLD-12.10	1370	1370,0000	1,11	69 692	0,45%	356 181 484	46,95%
Si-12.10	31157	31,16	-0,15	989 684	0,59%	774 175 764	5,56%
Eu-12.10	42450	42,45	-0,16	186 506	0,01%	5 646 506	2,84%
ED-12.10	1,36	1,36	0,01	274 314	0,89%	1 637 439 921	16,83%
SBPR-12.10	7122	71,22	0,04	136 892	-0,29%	4 345 923	3,63%
RTSS-12.10	10582	10581,50	0,23	14 256	-86,91%	29 260 725	2,16%
BR-12.10	84	84,00	0,13	117 664	728,15%	265 598 361	9,07%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69632,5	-1,78%	23:10:31
CAC 40	3818,89	-1,07%	19:35:16
DAX 30	6822,05	-0,31%	19:35:32
DJ Industrial	11178,58	-0,22%	01:05:21
FTSE 100	5680,83	-0,91%	19:35:30
Hang Seng	23024,3	-2,12%	09:33:02
Nikkei 225	10115,19	0,93%	09:00:03
S&P 500	1197,84	-0,16%	00:02:53
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1363,7	-0,22%	09:33:12
Palladium	684,5	-1,08%	09:33:09
Platinum	1657,5	-0,15%	09:32:45
RTSI	1 601,54	0,11%	23:50:00
RTS_Standard	10 570,31	0,10%	23:50:00
RTSI_DEREX	1597,34	-0,22%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,39	544380	22369562777,24	160480
ROSN-12.10	0,28	52842	9689298,00	21360
LKOH-12.10	0,02	163780	104028576,00	17253
GAZR-12.10	0,24	770786	181493462,00	17060
GMKR-12.10	0,46	76710	11819157,00	59300
SBRF-12.10	0,2	934118	491654335,00	9964
VTBR-12.10	0,27	148216	9545096,00	10378
GOLD-12.10	1,11	69692	356181484,38	1370
Si-12.10	-0,15	989684	774175764,00	31157
Eu-12.10	-0,16	186506	5646506,00	42450
ED-12.10	0,01	274314	1637439920,72	1,3623
SBPR-12.10	0,04	136892	4345923,00	7122
RTSS-12.10	0,23	14256	29260725,00	10581,5
BR-12.10	0,13	117664	265598360,71	84

Дневная сессия

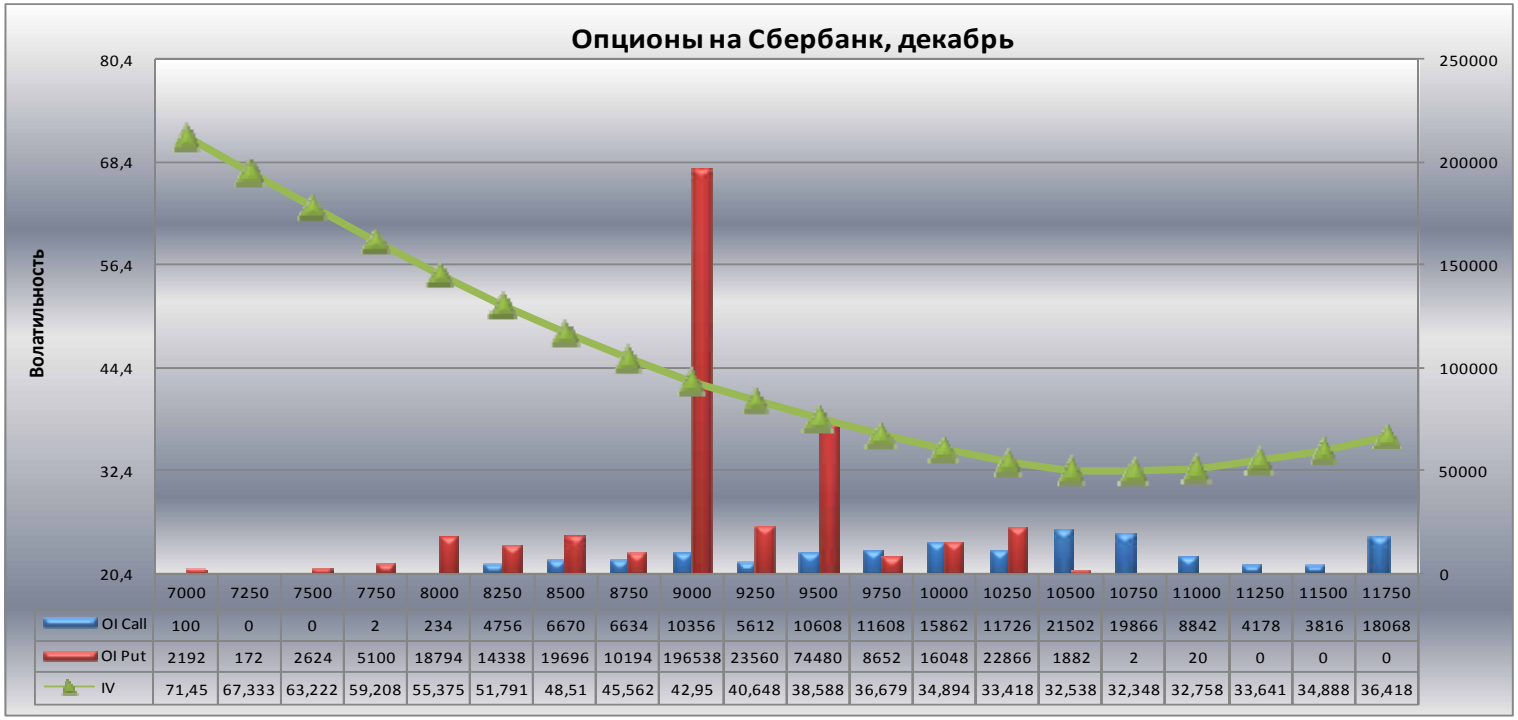
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,22	550456	92530788161,28	159850
ROSN-12.10	-0,94	52808	166971639,00	21300
LKOH-12.10	-1,33	162914	908405200,00	17249
GAZR-12.10	-1,28	771708	3021816155,00	17020
GMKR-12.10	-0,2	76746	537825953,00	59028
SBRF-12.10	0,62	932728	6627013709,00	9944
VTBR-12.10	-0,18	147882	158793174,00	10350
GOLD-12.10	-0,04	69380	758594521,11	1355
Si-12.10	0,14	983858	13933631726,00	31203
Eu-12.10	-0,11	186488	198874115,00	42520
ED-12.10	-0,31	271888	9730569637,11	1,3621
SBPR-12.10	-0,14	137284	119881533,00	7119
RTSS-12.10	-0,32	14208	2929836760,00	10557
BR-12.10	-1,01	108874	1354335623,38	83,89

Опционы на индекс РТС, декабрь

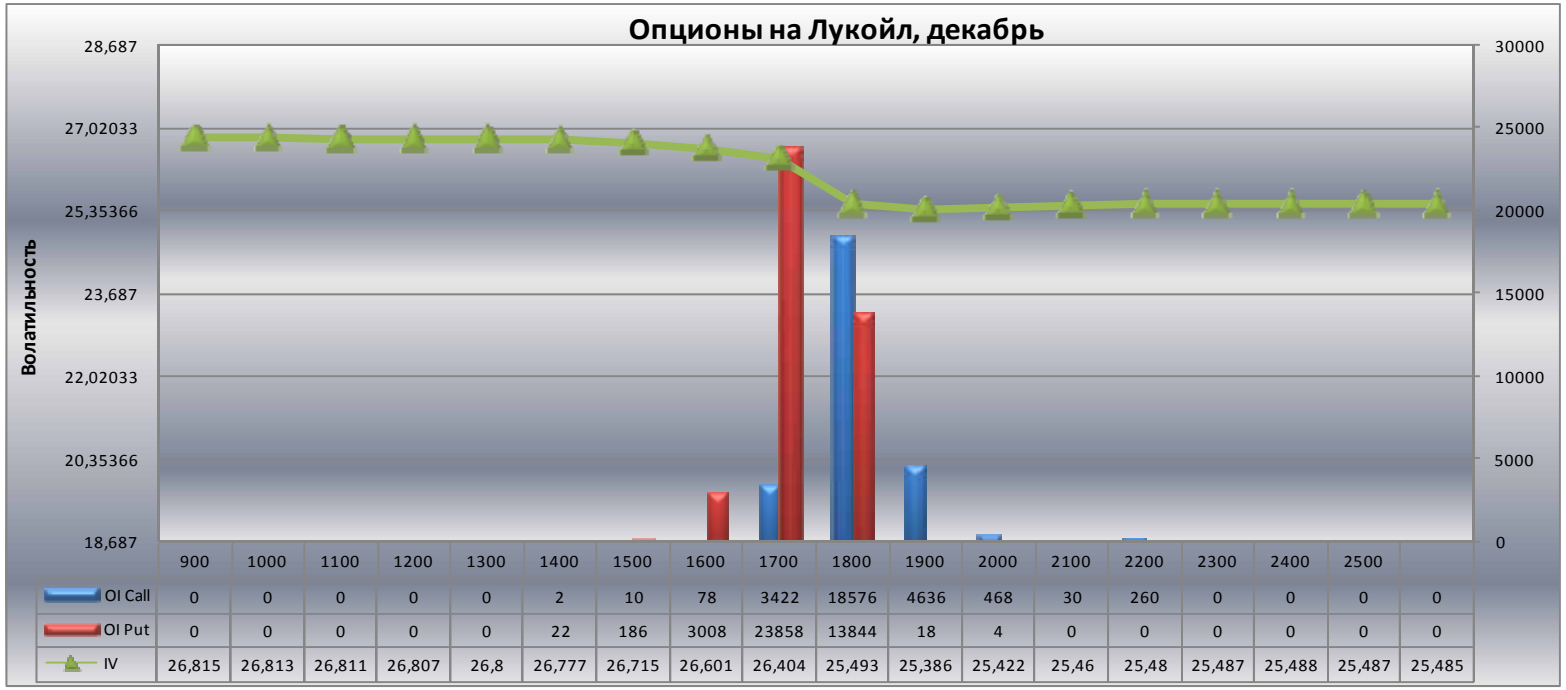


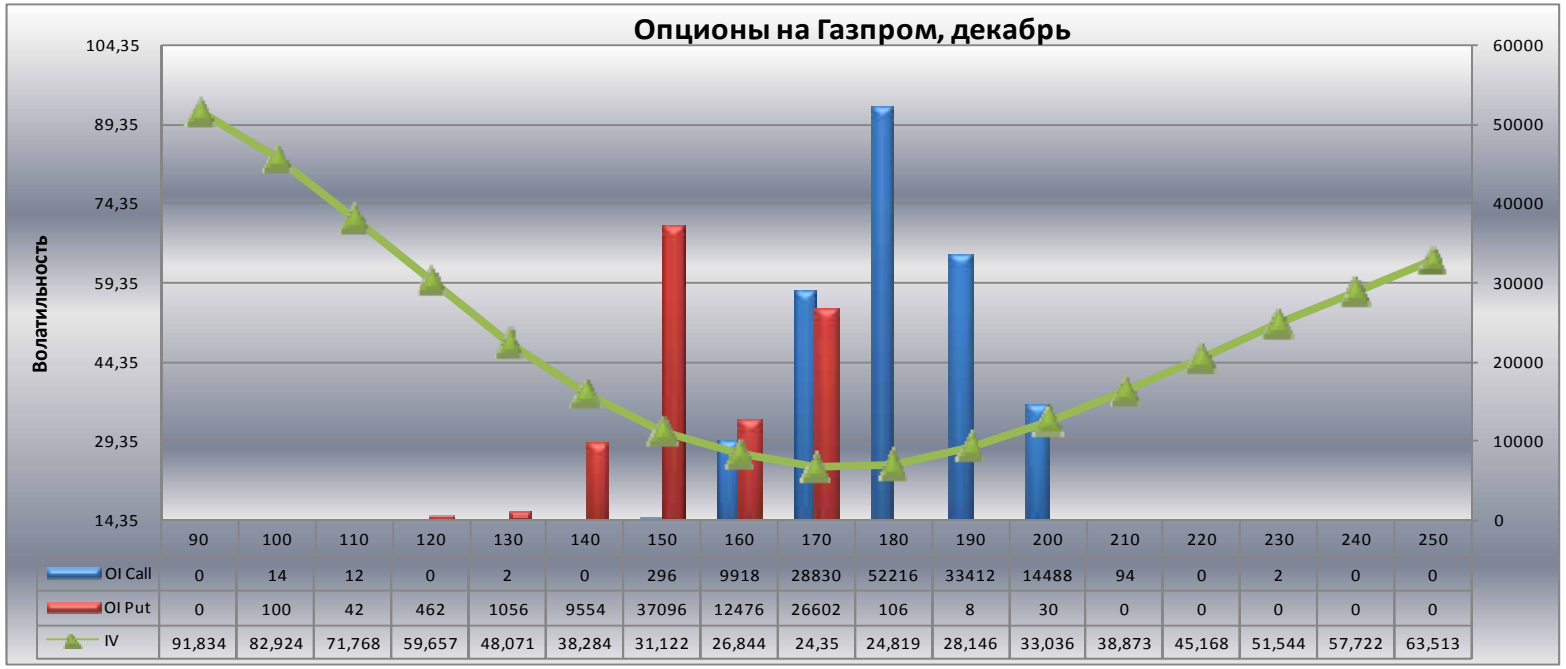
	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	8	20	10	120	1044	370	524	5154	18378	21472	37306	61514	94312	66066	30584
OI Put	5722	630	62	194	6122	21122	4998	3490	15688	37198	35694	87312	63256	89292	94240	79892	31156	5374	792	502	52
IV	93,925	86,834	79,854	73,123	66,749	60,813	55,371	50,449	46,047	42,143	38,686	35,602	32,801	30,208	27,827	25,792	24,299	23,469	23,286	23,667	24,511

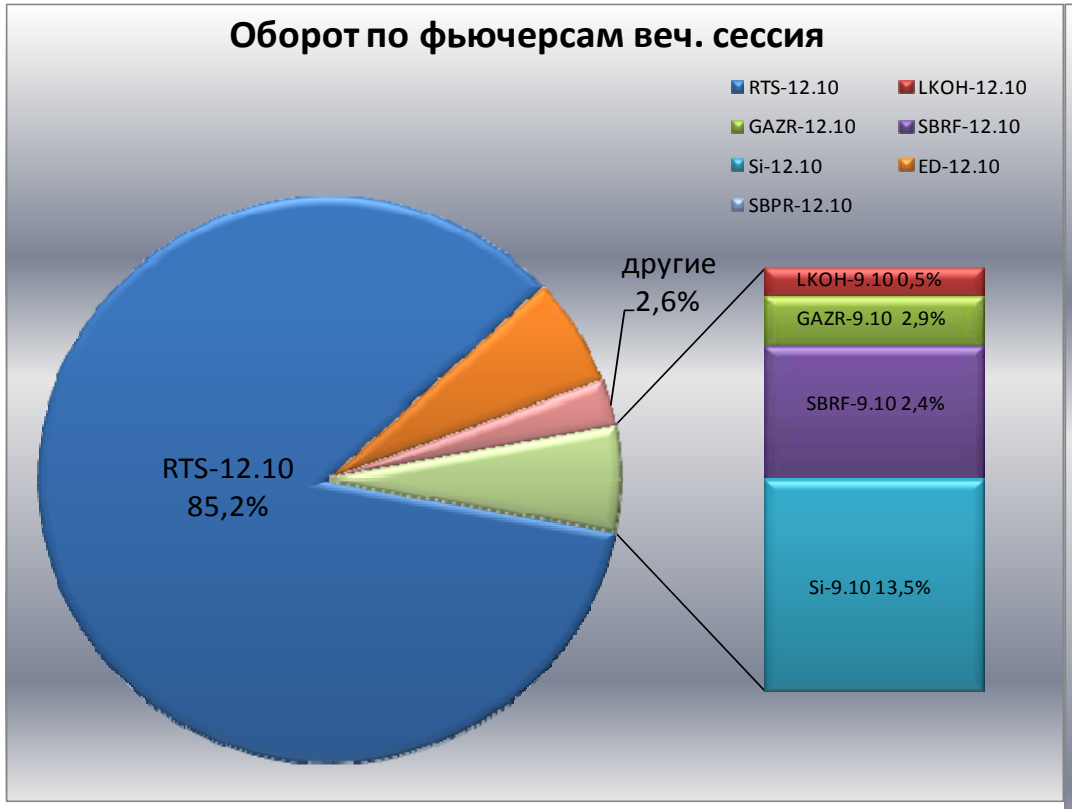
Опционы на Сбербанк, декабрь

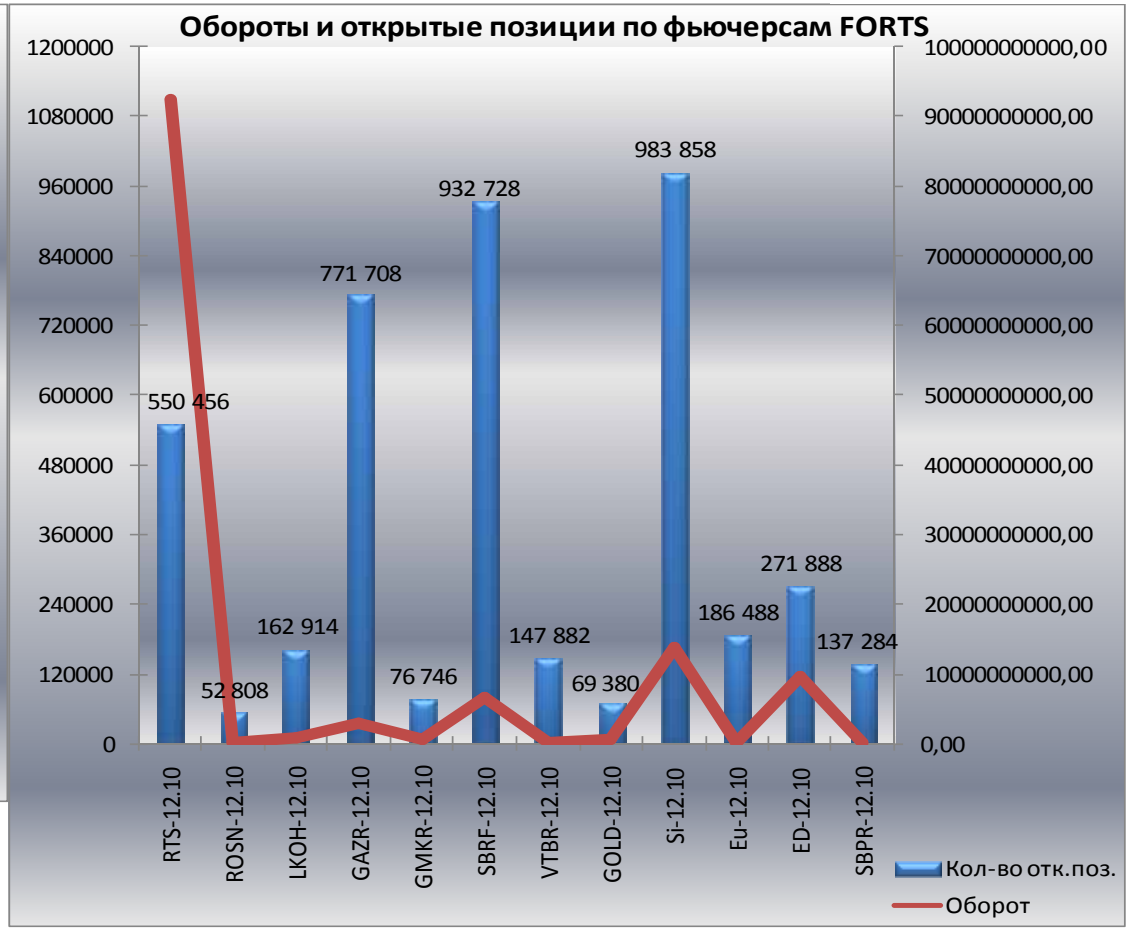


	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	234	4756	6670	6634	10356	5612	10608	11608	15862	11726	21502	19866	8842	4178	3816	18068
OI Put	2192	172	2624	5100	18794	14338	19696	10194	196538	23560	74480	8652	16048	22866	1882	2	20	0	0	0
IV	71,45	67,333	63,222	59,208	55,375	51,791	48,51	45,562	42,95	40,648	38,588	36,679	34,894	33,418	32,538	32,348	32,758	33,641	34,888	36,418


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
28,687
27,02033
25,35366
23,687
22,02033
20,35366
18,687
30000
25000
20000
15000
10000
5000
0
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 10 78 3422 18576 4636 468 30 260 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 22 186 3008 23858 13844 18 4 0 0 0 0 0 0
IV 26,815 26,813 26,811 26,807 26,8 26,777 26,715 26,601 26,404 25,493 25,386 25,422 25,46 25,48 25,487 25,488 25,487 25,485


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
104,35
89,35
74,35
59,35
44,35
29,35
14,35
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
90 100 110 120 130 140 150 160 170 180 190 200 210 220 230 240 250
OI Call 0 14 12 0 2 0 296 9918 28830 52216 33412 14488 94 0 2 0 0
OI Put 0 100 42 462 1056 9554 37096 12476 26602 106 8 30 0 0 0 0 0
IV 91,834 82,924 71,768 59,657 48,071 38,284 31,122 26,844 24,35 24,819 28,146 33,036 38,873 45,168 51,544 57,722 63,513


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
85,2%
другие
2,6%
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
550 456
52 808
162 914
771 708
76 746
932 728
147 882
69 380
983 858
186 488
271 888
137 284
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