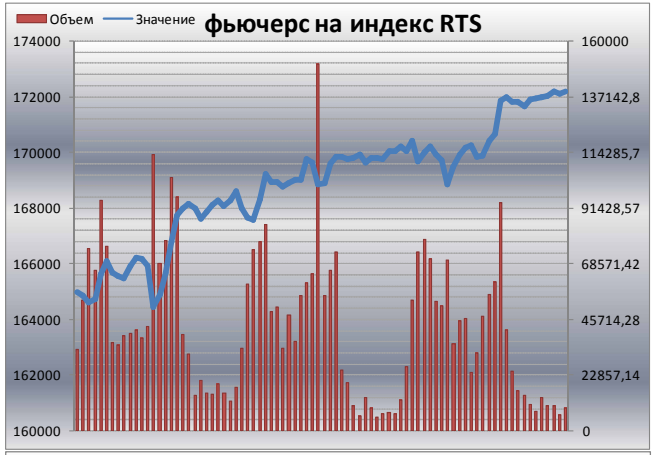
Дневной боковик, вечерний рост.

Российские площадки в понедельник в дневную сессию находились во власти в целом негативных настроений, ближе к концу цены показали стремительный рост на фоне открытия американских рынков и в целом положительной динамики торгов, в вечернюю сессию превалировали позитивные настроения, опять же связанные с ростом на американских рынках. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –0.17% и -1-0.13%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 0.01% до уровня в 1712,68 пункта.

На вечерних торгах господствовали нейтральные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,13%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.04%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял в целом боковым движением котировок, в результате произошло разнонаправленное движение котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на –0,15% и 0,14%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,01% и +0,23%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.09% и +0.10%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +0.35%.





	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	172200	1722,00	0,13	534 574	0,12%	13 332 401 934	11,81%
ROSN-12.10	21975	219,75	0,00	56 222	0,04%	6 512 028	3,19%
LKOH-12.10	18491	1849,10	0,14	132 078	-0,16%	31 916 847	2,58%
GAZR-12.10	19411	194,11	-0,15	604 854	-0,04%	272 204 157	4,12%
GMKR-12.10	66552	6655,20	0,16	86 326	-0,03%	12 826 308	1,70%
SBRF-12.10	10585	105,85	0,09	859 858	-0,35%	255 113 864	2,89%
VTBR-12.10	10270	0,1027	0,10	105 594	0,41%	11 816 714	6,49%
GOLD-12.10	1421	1421,0000	0,35	55 154	8,43%	452 397 576	53,34%
Si-12.10	31251	31,25	-0,01	802 584	0,18%	406 887 949	2,78%
Eu-12.10	41617	41,62	0,23	189 052	-0,04%	2 535 635	0,45%
ED-12.10	1,33	1,33	0,32	150 372	-0,45%	1 233 952 275	12,75%
SBPR-12.10	7555	75,55	0,49	130 272	0,38%	5 374 915	1,36%
RTSS-12.10	11376	11376,00	-0,07	19 448	-74,89%	3 182 135	0,23%
BR-12.10	91	91,29	0,04	78 432	303,00%	169 553 395	8,51%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69551,81	-0,31%	23:12:31
CAC 40	3749,23	-0,04%	19:35:16
DAX 30	6954,38	0,10%	19:35:33
DJ Industrial	11362,19	-0,17%	00:40:54
FTSE 100	5770,28	0,43%	19:35:30
Hang Seng	23404,92	0,72%	09:55:32
Nikkei 225	10141,1	-0,26%	09:00:03
S&P 500	1223,12	-0,13%	00:03:53
Brent Crude Oil 0211	91,25	-0,31%	09:55:22
Gold	1421,2	-0,16%	09:55:33
Palladium	757,25	0,30%	09:55:30
Platinum	1713,25	-0,17%	09:54:51
RTSI	1 709,93	-0,09%	23:50:00
RTS_Standard	11 365,16	-0,06%	23:50:00
RTSI_DEREX	1712,68	0,01%	18:45:00

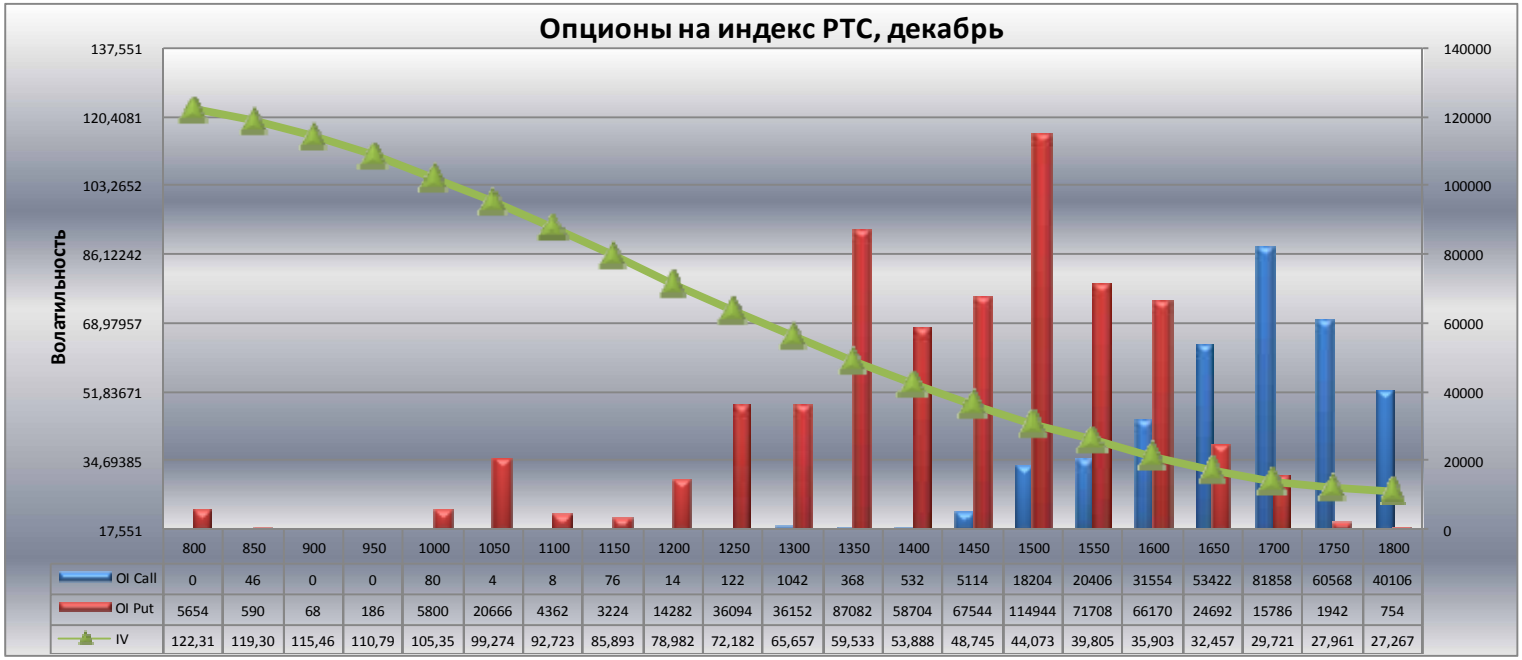
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,13	534574	13332401934,37	172200
ROSN-12.10	0	56222	6512028,00	21975
LKOH-12.10	0,14	132078	31916847,00	18491
GAZR-12.10	-0,15	604854	272204157,00	19411
GMKR-12.10	0,16	86326	12826308,00	66552
SBRF-12.10	0,09	859858	255113864,00	10585
VTBR-12.10	0,1	105594	11816714,00	10270
GOLD-12.10	0,35	55154	452397576,22	1421
Si-12.10	-0,01	802584	406887949,00	31251
Eu-12.10	0,23	189052	2535635,00	41617
ED-12.10	0,32	150372	1233952275,45	1,332
SBPR-12.10	0,49	130272	5374915,00	7555
RTSS-12.10	-0,07	19448	3182135,00	11376
BR-12.10	0,04	78432	169553395,03	91,29

Дневная сессия

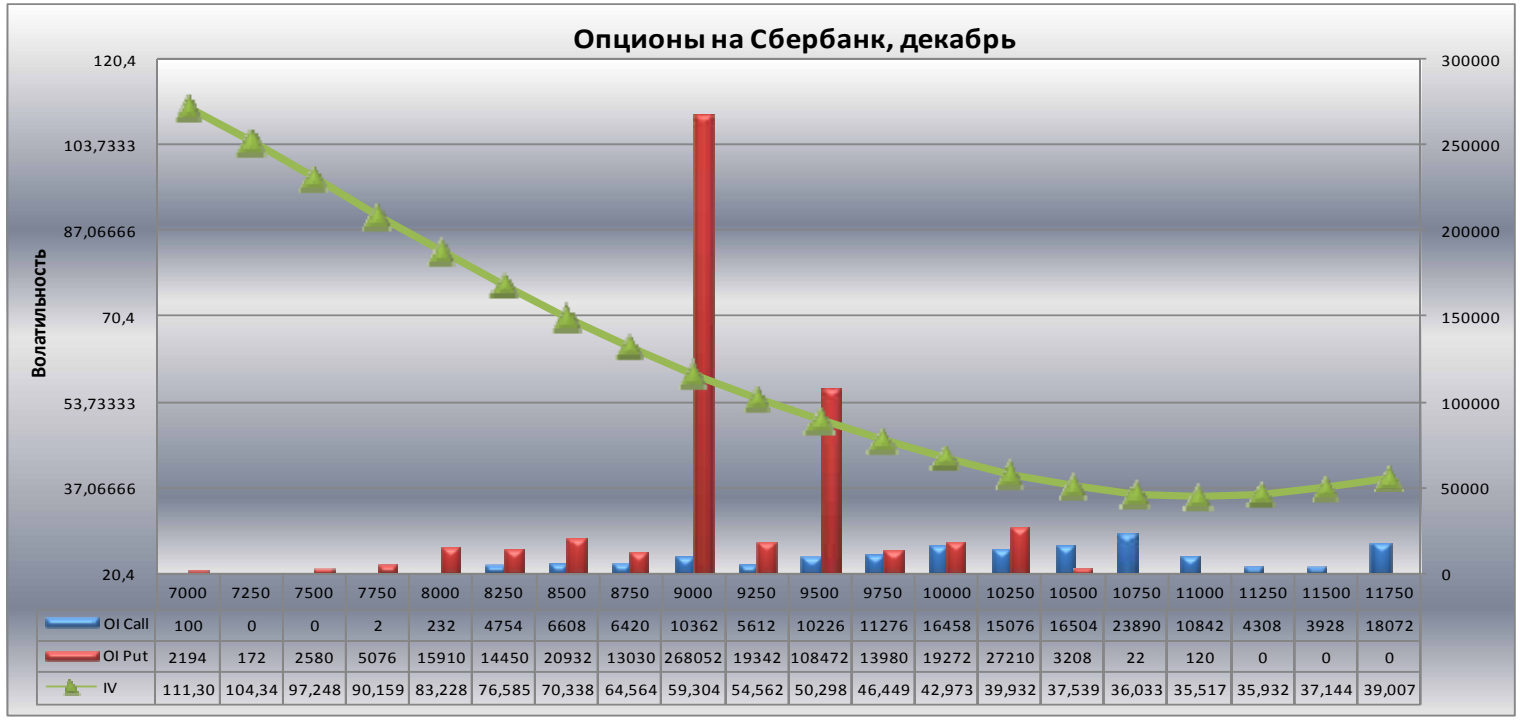
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	1,25	533936	112932299996,87	171975
ROSN-12.10	0,88	56200	204331510,00	21974
LKOH-12.10	1,89	132290	1234787743,00	18465
GAZR-12.10	1,67	605102	6608684962,00	19441
GMKR-12.10	-0,27	86356	752556223,00	66446
SBRF-12.10	2,45	862862	8828962780,00	10575
VTBR-12.10	1,58	105168	182146573,00	10260
GOLD-12.10	0,5	50868	848164902,35	1416,1
Si-12.10	0,07	801132	14649906831,00	31255
Eu-12.10	-0,42	189130	565594765,00	41522
ED-12.10	-0,57	151048	9675079960,36	1,3277
SBPR-12.10	-0,01	129776	394720507,00	7518
RTSS-12.10	1,43	19462	1991277595,00	11375,5
BR-12.10	0,51	77458	1396209662,80	91,25

Опционы на индекс РТС, декабрь



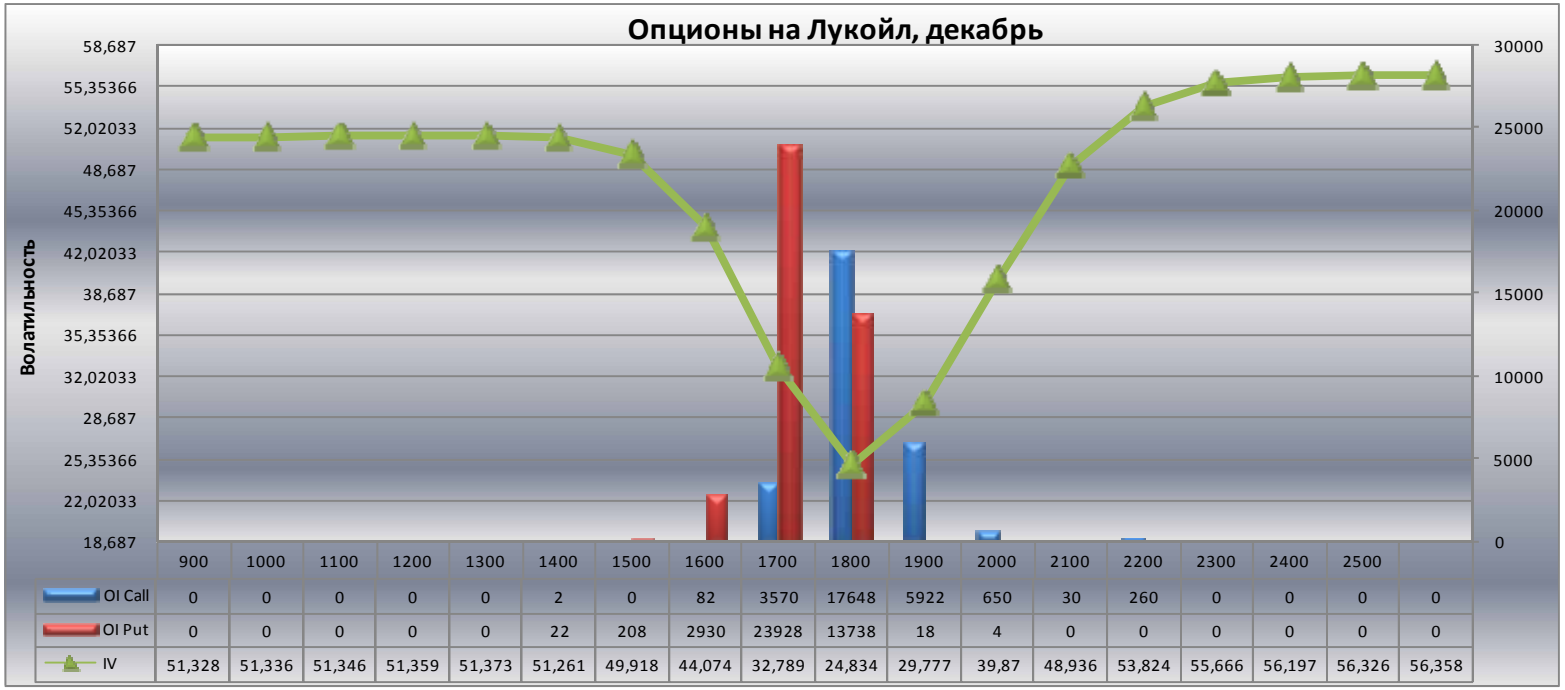
	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	8	76	14	122	1042	368	532	5114	18204	20406	31554	53422	81858	60568	40106
OI Put	5654	590	68	186	5800	20666	4362	3224	14282	36094	36152	87082	58704	67544	114944	71708	66170	24692	15786	1942	754
IV	122,31	119,30	115,46	110,79	105,35	99,274	92,723	85,893	78,982	72,182	65,657	59,533	53,888	48,745	44,073	39,805	35,903	32,457	29,721	27,961	27,267

Опционы на Сбербанк, декабрь



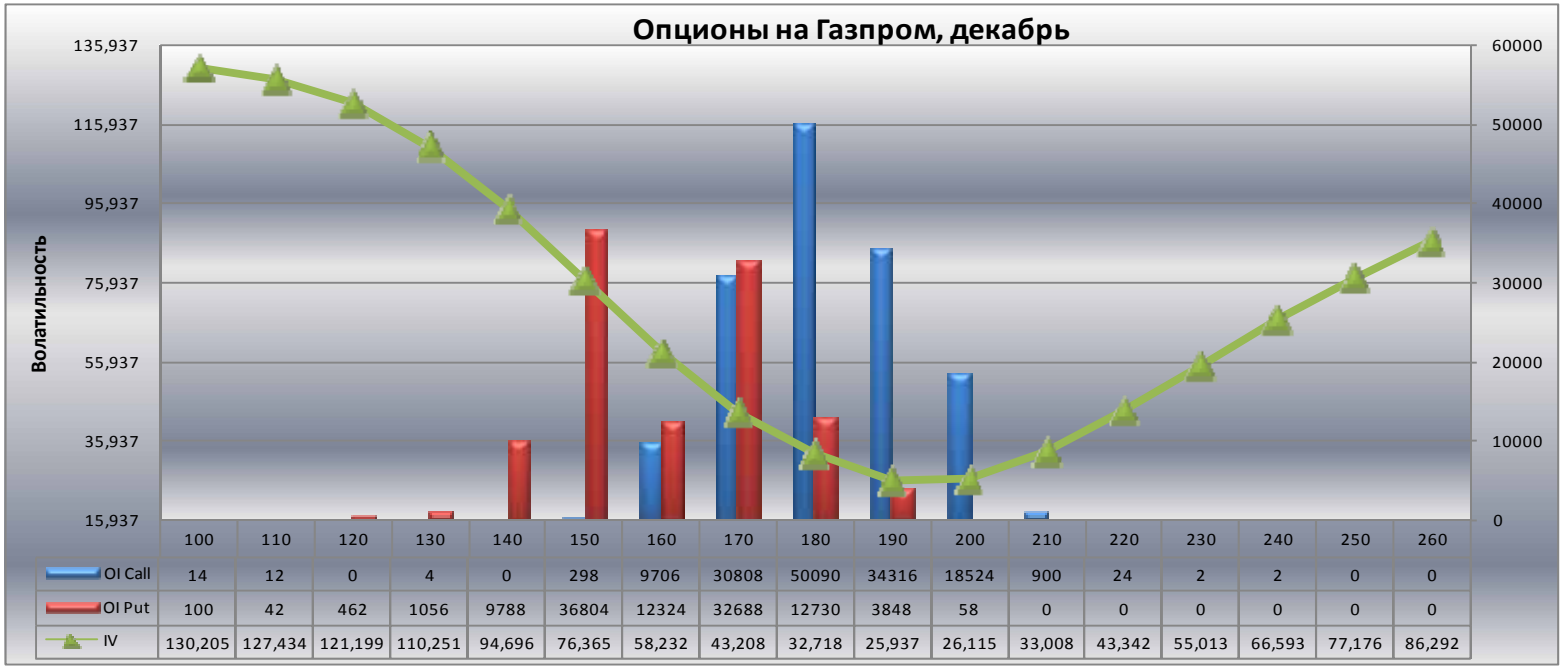
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	232	4754	6608	6420	10362	5612	10226	11276	16458	15076	16504	23890	10842	4308	3928	18072
OI Put	2194	172	2580	5076	15910	14450	20932	13030	268052	19342	108472	13980	19272	27210	3208	22	120	0	0	0
IV	111,30	104,34	97,248	90,159	83,228	76,585	70,338	64,564	59,304	54,562	50,298	46,449	42,973	39,932	37,539	36,033	35,517	35,932	37,144	39,007

Опционы на Лукойл, декабрь

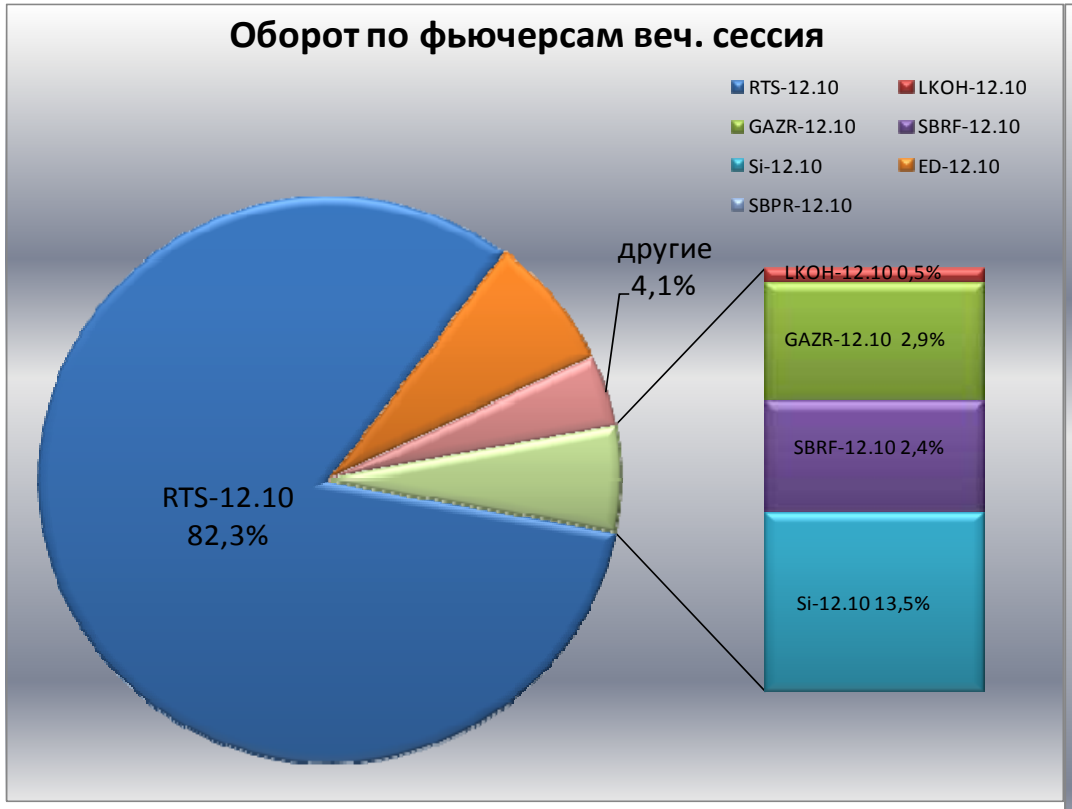


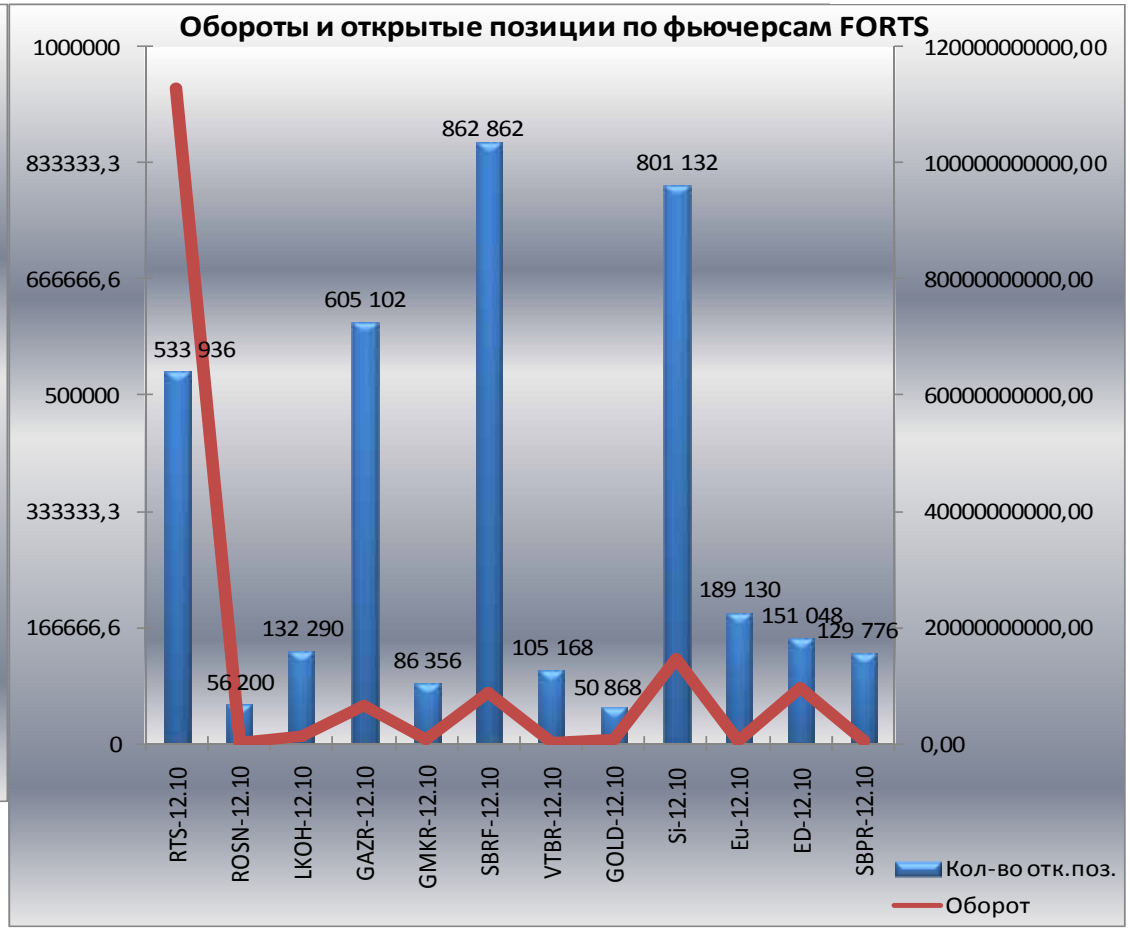
	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	82	3570	17648	5922	650	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	208	2930	23928	13738	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	51,328	51,336	51,346	51,359	51,373	51,261	49,918	44,074	32,789	24,834	29,777	39,87	48,936	53,824	55,666	56,197	56,326	56,358

Опционы на Газпром, декабрь



	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260
OI Call	14	12	0	4	0	298	9706	30808	50090	34316	18524	900	24	2	2	0	0
OI Put	100	42	462	1056	9788	36804	12324	32688	12730	3848	58	0	0	0	0	0	0
IV	130,205	127,434	121,199	110,251	94,696	76,365	58,232	43,208	32,718	25,937	26,115	33,008	43,342	55,013	66,593	77,176	86,292


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
4,1%
RTS-12.10
82,3%
LKOH-12.10 0,5%
GAZR-12.10 2,9%
SBRF-12.10 2,4%
Si-12.10 13,5%


Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
1000000
833333,3
666666,6
500000
333333,3
166666,6
0
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
533 936
56 200
132 290
605 102
86 356
862 862
105 168
50 868
801 132
189 130
151 048
129 776
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