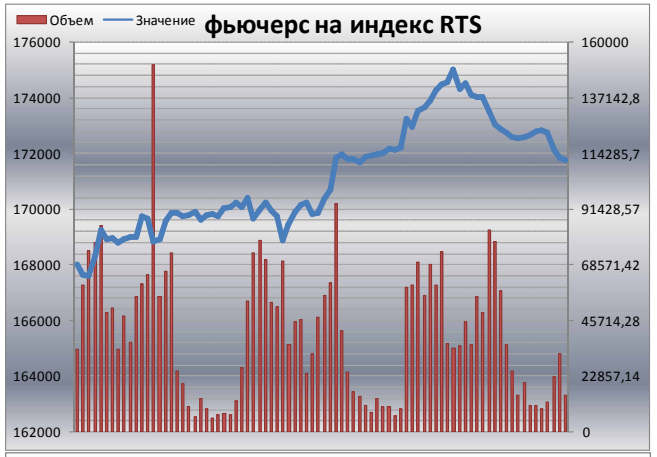
## Дневной рост, вечерняя коррекция.

Российские площадки во вторник в дневную сессию находились во власти позитивных настроений, ближе к концу цены скорректировались вниз на фоне открытия американских рынков в целом около закрытия предыдущего дня, в вечернюю сессию также превалировали позитивные настроения. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –0.03% и +0.05%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 1.17% до уровня в 1732,66 пункта.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,57%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 0.31%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял движением котировок вниз, в результате произошло падение котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,59% и -0,37%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на 0,15% и -0,42%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.48% и +0.02%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на -0.65%.







| | 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 | 171750 | 1717,50 | -0,57 | 485 570 | 0,01% | 18 506 453 155 | 15,27% |
| ROSN-12.10 | 21849 | 218,49 | -0,54 | 53 226 | 0,09% | 5 473 045 | 1,76% |
| LKOH-12.10 | 18110 | 1811,00 | -0,37 | 126 008 | -0,52% | 57 903 449 | 4,13% |
| GAZR-12.10 | 19176 | 191,76 | -0,59 | 563 542 | 0,11% | 188 900 790 | 3,18% |
| GMKR-12.10 | 65738 | 6573,80 | -0,55 | 85 396 | 0,08% | 10 542 518 | 1,33% |
| SBRF-12.10 | 10690 | 106,90 | -0,48 | 735 430 | -1,27% | 491 714 132 | 4,31% |
| VTBR-12.10 | 10400 | 0,1040 | 0,02 | 65 452 | -0,21% | 9 105 251 | 1,64% |
| GOLD-12.10 | 1403 | 1402,8000 | -0,65 | 54 520 | 0,18% | 610 992 884 | 34,96% |
| Si-12.10 | 31139 | 31,14 | 0,15 | 648 920 | 0,95% | 538 153 265 | 2,60% |
| Eu-12.10 | 41295 | 41,30 | -0,42 | 76 136 | 0,06% | 15 138 297 | 0,57% |
| ED-12.10 | 1,33 | 1,33 | -0,47 | 161 488 | 1,21% | 1 778 340 666 | 20,84% |
| SBPR-12.10 | 7531 | 75,31 | -0,16 | 88 218 | 0,22% | 1 965 232 | 0,19% |
| RTSS-12.10 | 11319 | 11319,00 | -0,42 | 15 620 | -76,68% | 10 776 670 | 0,68% |
| BR-12.10 | 91 | 91,00 | -0,31 | 66 458 | 326,56% | 349 321 312 | 13,97% |

| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| BOVESPA Brazil | 69337,64 | -0,31% | 23:14:32 |
| CAC 40 | 3810,5 | 1,63% | 19:35:18 |
| DAX 30 | 7001,91 | 0,68% | 19:35:32 |
| DJ Industrial | 11359,16 | -0,03% | 01:05:19 |
| FTSE 100 | 5808,45 | 0,66% | 19:35:30 |
| Hang Seng | 23074,22 | -1,51% | 09:55:33 |
| Nikkei 225 | 10232,33 | 0,90% | 09:00:04 |
| S&P 500 | 1223,75 | 0,05% | 00:03:24 |
| Brent Crude Oil 0211 | 90,68 | -0,95% | 09:55:29 |
| Gold | 1391,73 | -0,71% | 09:55:36 |
| Palladium | 726 | -0,48% | 09:55:34 |
| Platinum | 1678,75 | -0,42% | 09:55:28 |
| RTSI | 1 717,79 | -0,24% | 23:50:00 |
| RTS_Standard | 11 320,58 | -0,39% | 23:50:00 |
| RTSI_DEREX | 1732,66 | 1,17% | 18:45:00 |

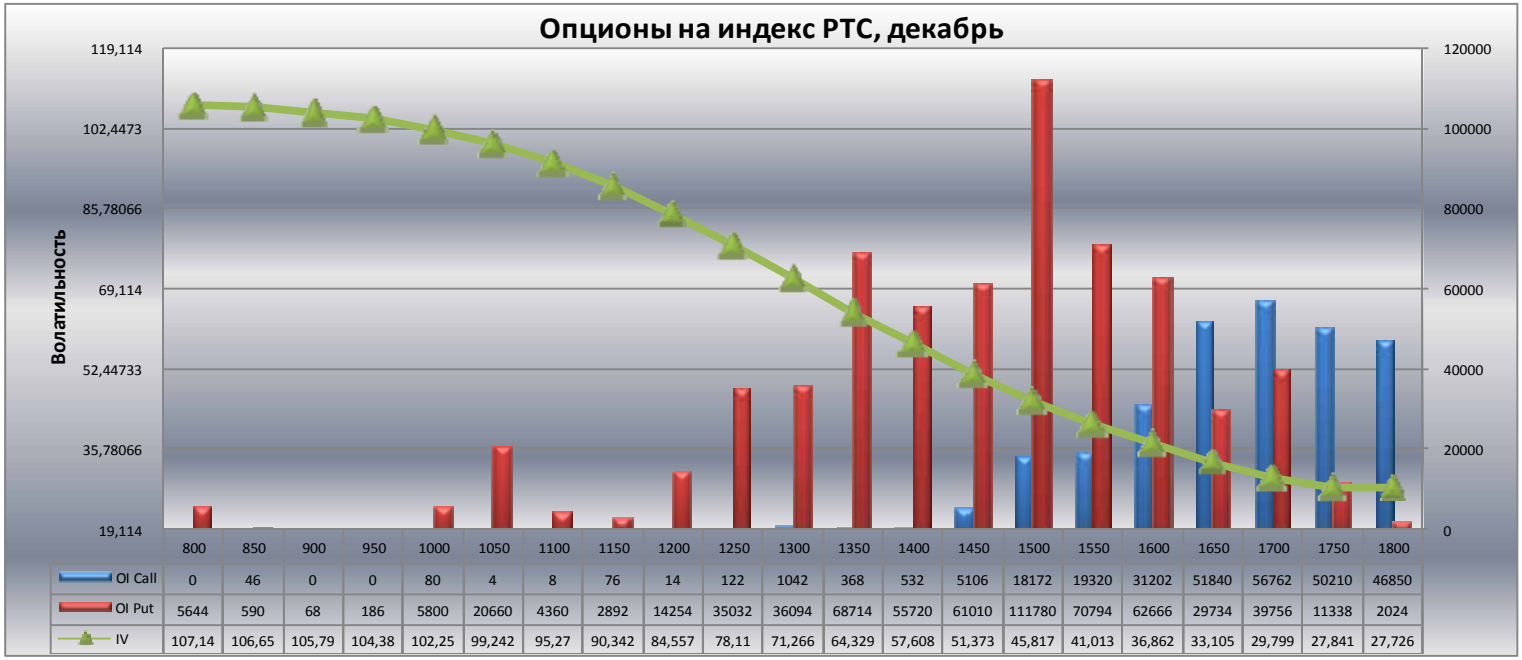
# Вечерняя сессия

| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | -0,57 | 485570 | 18506453155,07 | 171750 |
| ROSN-12.10 | -0,54 | 53226 | 5473045,00 | 21849 |
| LKOH-12.10 | -0,37 | 126008 | 57903449,00 | 18110 |
| GAZR-12.10 | -0,59 | 563542 | 188900790,00 | 19176 |
| GMKR-12.10 | -0,55 | 85396 | 10542518,00 | 65738 |
| SBRF-12.10 | -0,48 | 735430 | 491714132,00 | 10690 |
| VTBR-12.10 | 0,02 | 65452 | 9105251,00 | 10400 |
| GOLD-12.10 | -0,65 | 54520 | 610992884,36 | 1402,8 |
| Si-12.10 | 0,15 | 648920 | 538153265,00 | 31139 |
| Eu-12.10 | -0,42 | 76136 | 15138297,00 | 41295 |
| ED-12.10 | -0,47 | 161488 | 1778340666,37 | 1,3271 |
| SBPR-12.10 | -0,16 | 88218 | 1965232,00 | 7531 |
| RTSS-12.10 | -0,42 | 15620 | 10776670,00 | 11319 |
| BR-12.10 | -0,31 | 66458 | 349321312,07 | 91 |

# Дневная сессия

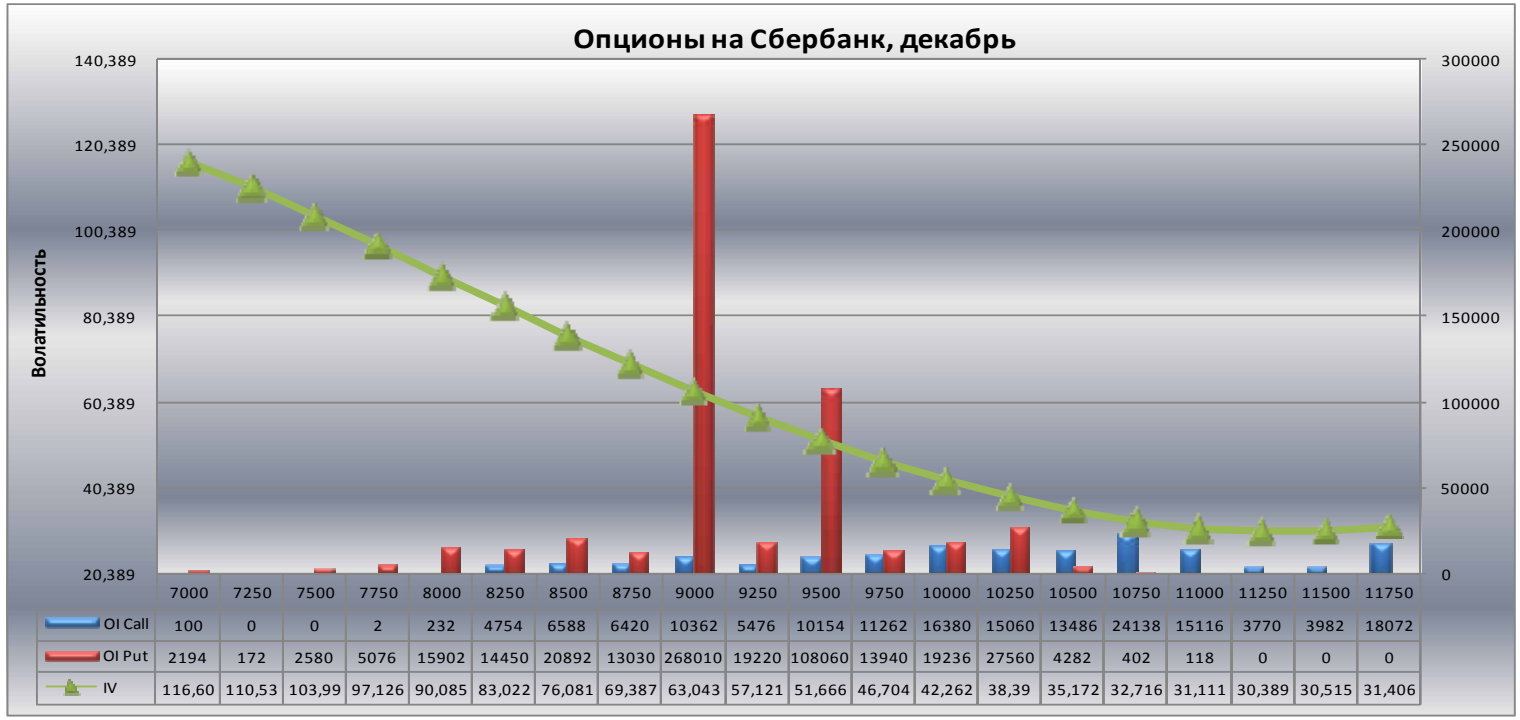
| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.10 | 0,44 | 485514 | 121226811785,96 | 172730 |
| ROSN-12.10 | -0,03 | 53178 | 310520513,00 | 21967 |
| LKOH-12.10 | -1,55 | 126666 | 1403674137,00 | 18178 |
| GAZR-12.10 | -0,78 | 562922 | 5945808154,00 | 19289 |
| GMKR-12.10 | -0,53 | 85332 | 790902924,00 | 66095 |
| SBRF-12.10 | 1,57 | 744868 | 11407983323,00 | 10742 |
| VTBR-12.10 | 1,35 | 65588 | 554202678,00 | 10398 |
| GOLD-12.10 | -0,29 | 54424 | 1747775711,29 | 1412 |
| Si-12.10 | -0,52 | 642832 | 20718923899,00 | 31092 |
| Eu-12.10 | -0,13 | 76092 | 2645321294,00 | 41470 |
| ED-12.10 | 0,42 | 159560 | 8531840539,95 | 1,3333 |
| SBPR-12.10 | 0,33 | 88020 | 1033815271,00 | 7543 |
| RTSS-12.10 | -0,07 | 15580 | 2500970425,00 | 11367 |
| BR-12.10 | 0,07 | 66972 | 1581971251,68 | 91,28 |

## Опционы на индекс РТС, декабрь



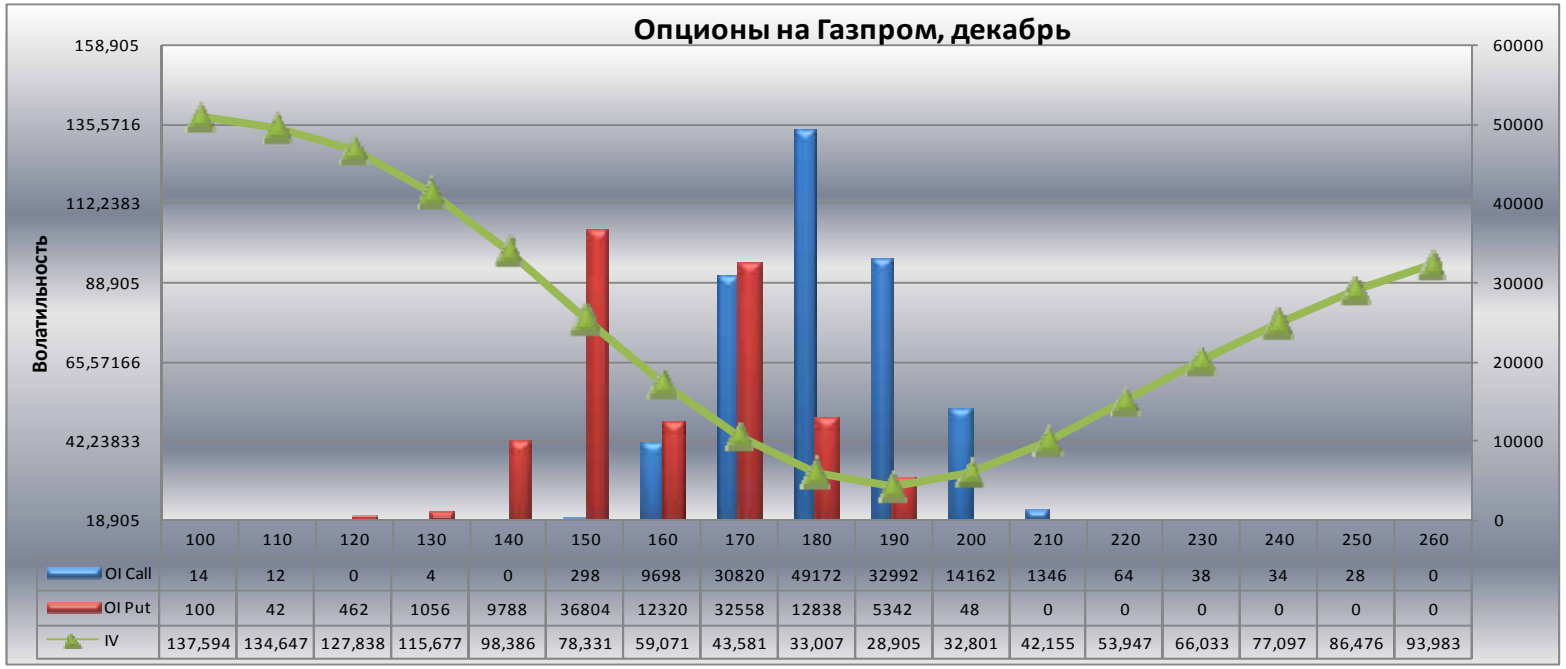

| | 800 | 850 | 900 | 950 | 1000 | 1050 | 1100 | 1150 | 1200 | 1250 | 1300 | 1350 | 1400 | 1450 | 1500 | 1550 | 1600 | 1650 | 1700 | 1750 | 1800 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 46 | 0 | 0 | 80 | 4 | 8 | 76 | 14 | 122 | 1042 | 368 | 532 | 5106 | 18172 | 19320 | 31202 | 51840 | 56762 | 50210 | 46850 |
| OI Put | 5644 | 590 | 68 | 186 | 5800 | 20660 | 4360 | 2892 | 14254 | 35032 | 36094 | 68714 | 55720 | 61010 | 111780 | 70794 | 62666 | 29734 | 39756 | 11338 | 2024 |
| IV | 107,14 | 106,65 | 105,79 | 104,38 | 102,25 | 99,242 | 95,27 | 90,342 | 84,557 | 78,11 | 71,266 | 64,329 | 57,608 | 51,373 | 45,817 | 41,013 | 36,862 | 33,105 | 29,799 | 27,841 | 27,726 |

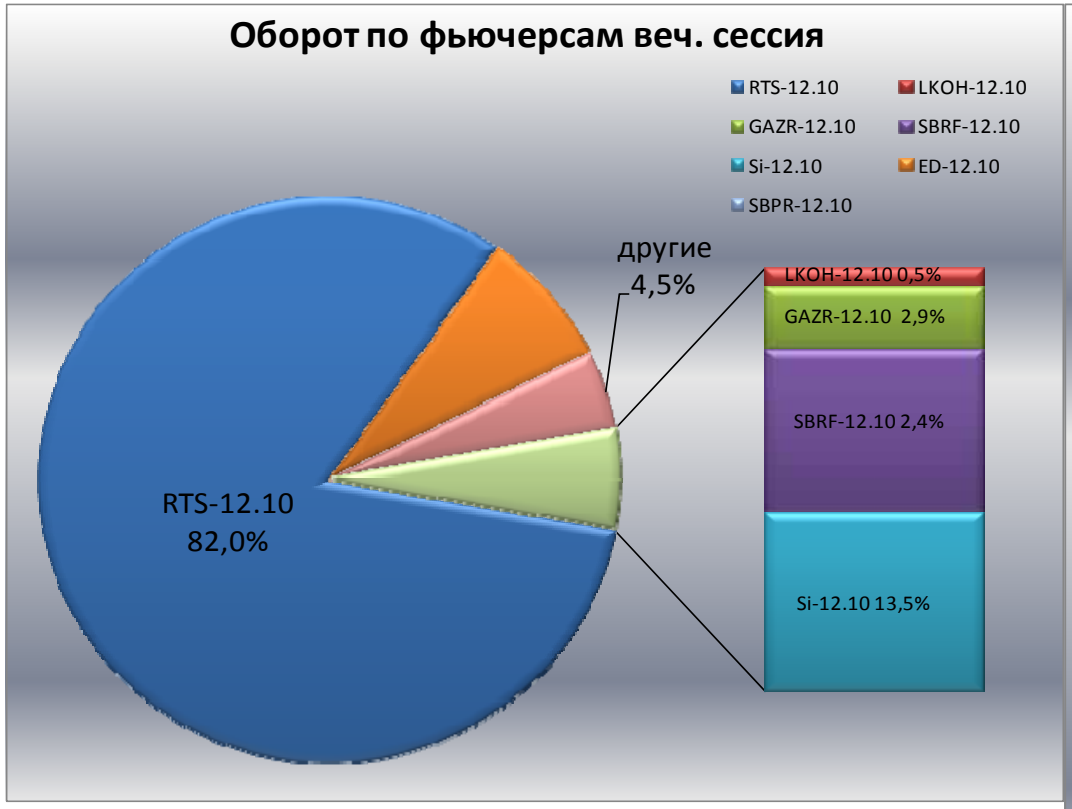
## Опционы на Сбербанк, декабрь

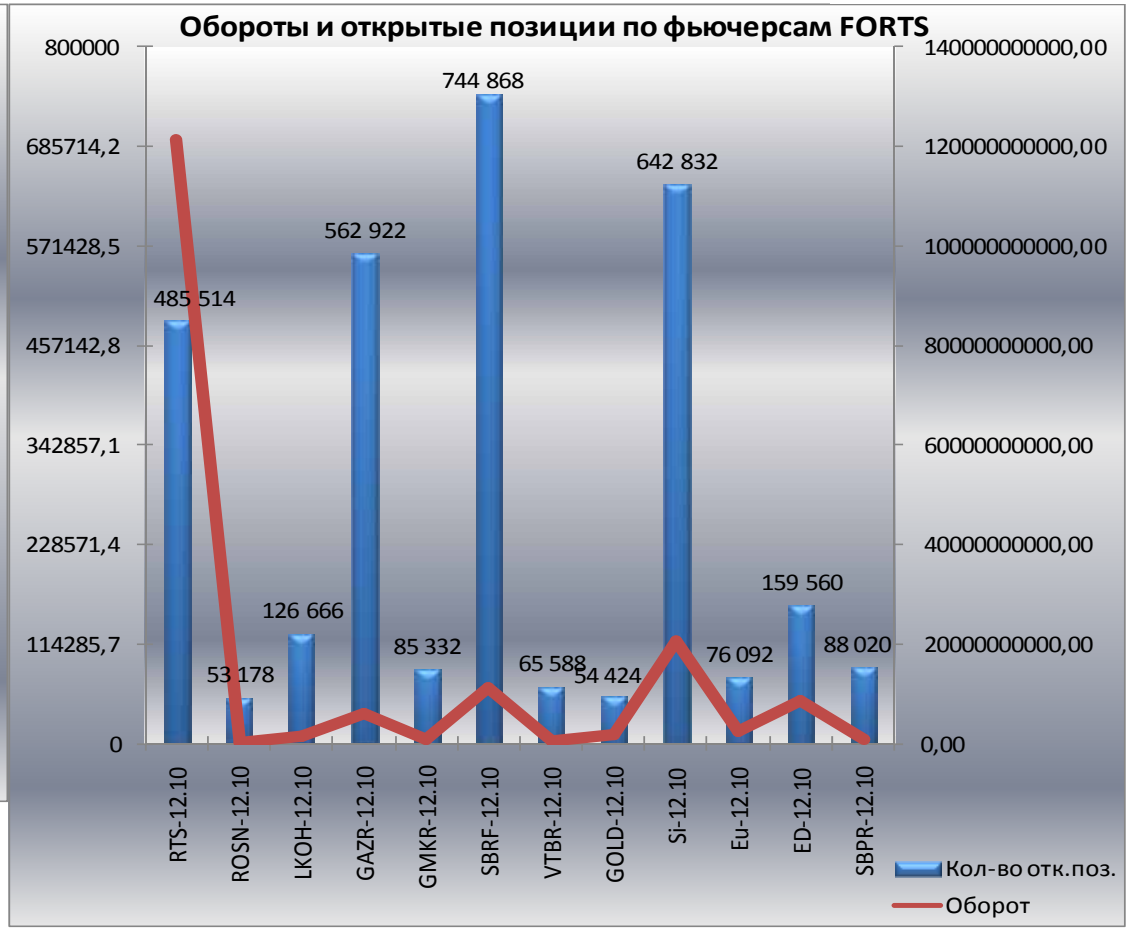



| | 7000 | 7250 | 7500 | 7750 | 8000 | 8250 | 8500 | 8750 | 9000 | 9250 | 9500 | 9750 | 10000 | 10250 | 10500 | 10750 | 11000 | 11250 | 11500 | 11750 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 100 | 0 | 0 | 2 | 232 | 4754 | 6588 | 6420 | 10362 | 5476 | 10154 | 11262 | 16380 | 15060 | 13486 | 24138 | 15116 | 3770 | 3982 | 18072 |
| OI Put | 2194 | 172 | 2580 | 5076 | 15902 | 14450 | 20892 | 13030 | 268010 | 19220 | 108060 | 13940 | 19236 | 27560 | 4282 | 402 | 118 | 0 | 0 | 0 |
| IV | 116,60 | 110,53 | 103,99 | 97,126 | 90,085 | 83,022 | 76,081 | 69,387 | 63,043 | 57,121 | 51,666 | 46,704 | 42,262 | 38,39 | 35,172 | 32,716 | 31,111 | 30,389 | 30,515 | 31,406 |


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
117,0203
103,687
90,35366
77,02033
63,687
50,35366
37,02033
23,687
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 0 82 3560 17192 5998 650 30 260 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 22 206 2930 23924 13758 18 4 0 0 0 0 0 0
IV 114,69 114,04 111,52 104,88 92,345 74,539 55,136 39,022 29,356 27,24 33,742 45,34 58,531 70,974 81,42 89,48 95,305 99,299


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
158,905
135,5716
112,2383
88,905
65,57166
42,23833
18,905
60000
50000
40000
30000
20000
10000
0
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 9698 30820 49172 32992 14162 1346 64 38 34 28 0
OI Put 100 42 462 1056 9788 36804 12320 32558 12838 5342 48 0 0 0 0 0 0
IV 137,594 134,647 127,838 115,677 98,386 78,331 59,071 43,581 33,007 28,905 32,801 42,155 53,947 66,033 77,097 86,476 93,983


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
4,5%
RTS-12.10
82,0%
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
800000
685714,2
571428,5
457142,8
342857,1
228571,4
114285,7
0
140000000000,00
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
485 514
53 178
126 666
562 922
85 332
744 868
65 588
54 424
642 832
76 092
159 560
88 020
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