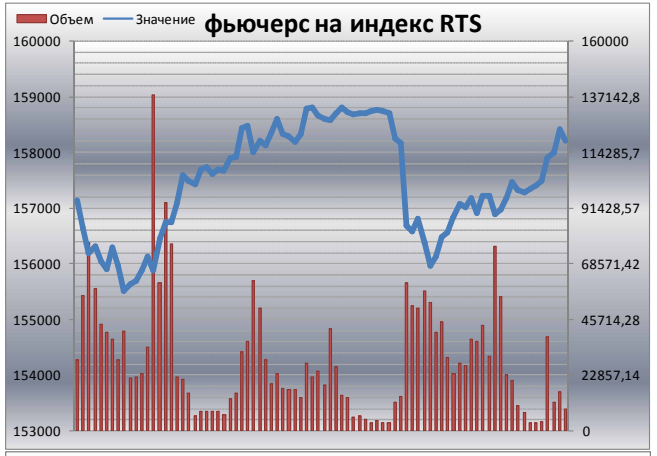
Дневное падение, вечерняя коррекция

Российские площадки во вторник всю дневную сессию находились во власти негативных настроений, в вечернюю сессию негативные настроения сменились позитивными и рынок показал неплохой рост. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы к закрытию показали неуверенный рост, оказавшись в небольшом плюсе, что, возможно, поспособствовало росту котировок на российских рынках в позднюю дневную сессию и усилило рост в вечернюю сессию. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на 0.09% и 0.38%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.80% до уровня в 1584,85 пункта. Фактором, повлиявшим на рынок в вечернюю сессию оказалась растущая цена на нефть и в целом позитивная статистика из США и России.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,65%. Октябрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.40%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок «принял к сведению», в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ изменились на +0,37% и +0,27%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,35% и 0,36%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.76% и +1.00%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +0.27%.





	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	158200	1582,00	0,65	435 194	0,57%	11 724 531 381	14,78%
ROSN-12.10	21421	214,21	0,34	36 942	0,07%	3 914 775	2,68%
LKOH-12.10	17703	1770,30	0,27	174 874	0,11%	30 296 133	4,20%
GAZR-12.10	16426	164,26	0,37	753 916	-0,04%	97 746 490	4,16%
GMKR-12.10	53846	5384,60	0,27	27 148	0,15%	10 494 475	3,51%
SBRF-12.10	9206	92,06	0,76	1 028 056	0,34%	307 382 886	5,92%
VTBR-12.10	9169	0,0917	1,00	84 690	0,05%	3 194 717	2,36%
GOLD-12.10	1356	1356,0000	0,27	64 948	1,15%	290 749 795	21,35%
Si-12.10	30170	30,17	-0,35	777 504	0,12%	819 792 770	5,58%
Eu-12.10	41972	41,97	0,36	125 866	-0,15%	13 583 095	9,29%
ED-12.10	1,39	1,39	0,54	248 224	3,92%	2 530 904 932	18,45%
SBPR-12.10	6486	64,86	0,60	208 032	0,29%	5 046 510	7,15%
RTSS-12.10	10153	10153,00	0,29	7 990	-81,85%	5 068 980	0,68%
BR-10.10	83	83,49	0,40	42 468	430,05%	174 601 566	28,28%

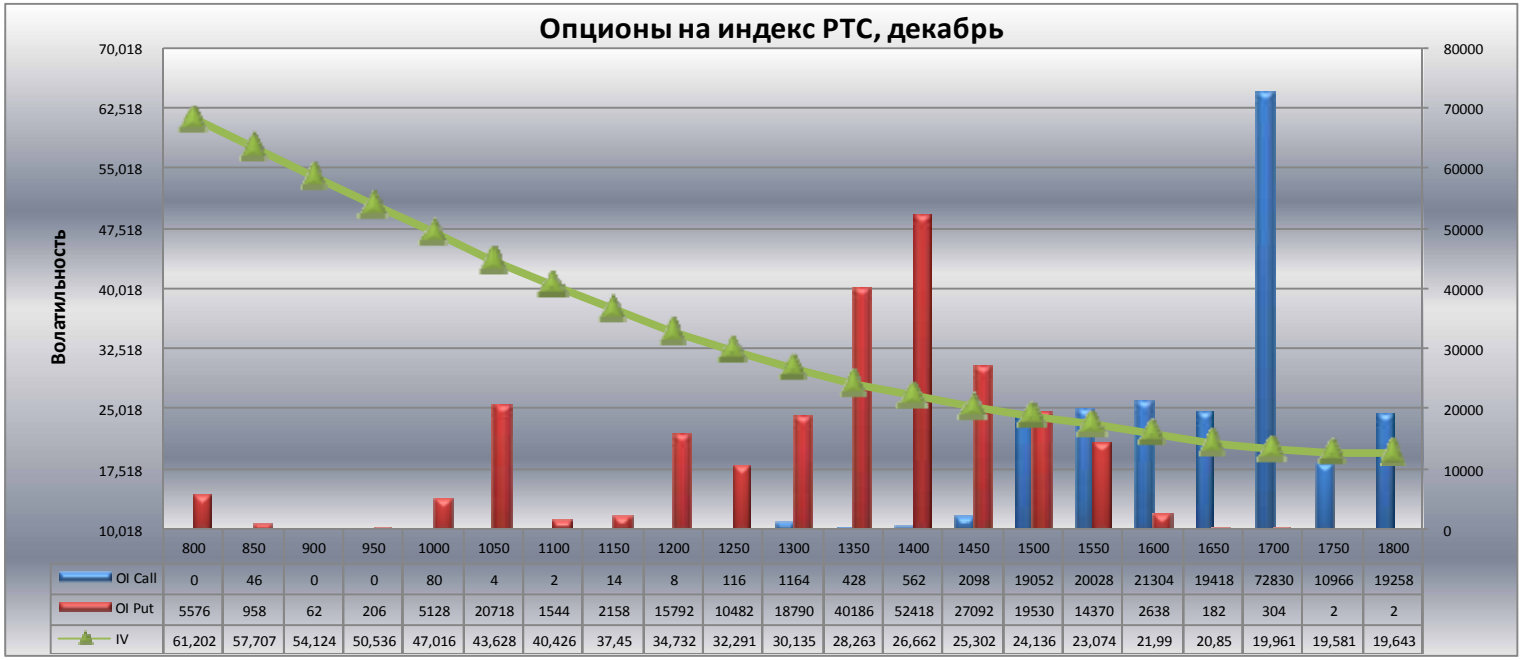
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	70946,49	0,19%	06:02:21
CAC 40	3748,86	-0,52%	05:42:44
DAX 30	6304,57	-0,08%	06:25:23
DJ Industrial	11020,4	0,09%	04:03:42
FTSE 100	5661,59	-0,19%	07:34:03
Hang Seng	23122,28	0,00%	08:30:04
Nikkei 225	9403,51	0,16%	10:00:06
S&P 500	1169,77	0,38%	09:43:50
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1356,28	0,58%	10:22:43
Palladium	587,5	1,34%	10:22:29
Platinum	1688,5	0,45%	10:22:29
RTSI	1 582,46	0,52%	23:50:00
RTS_Standard	10 137,90	0,33%	23:50:00
RTSI_DEREX	1584,85	-0,80%	18:45:00

Вечерняя сессия

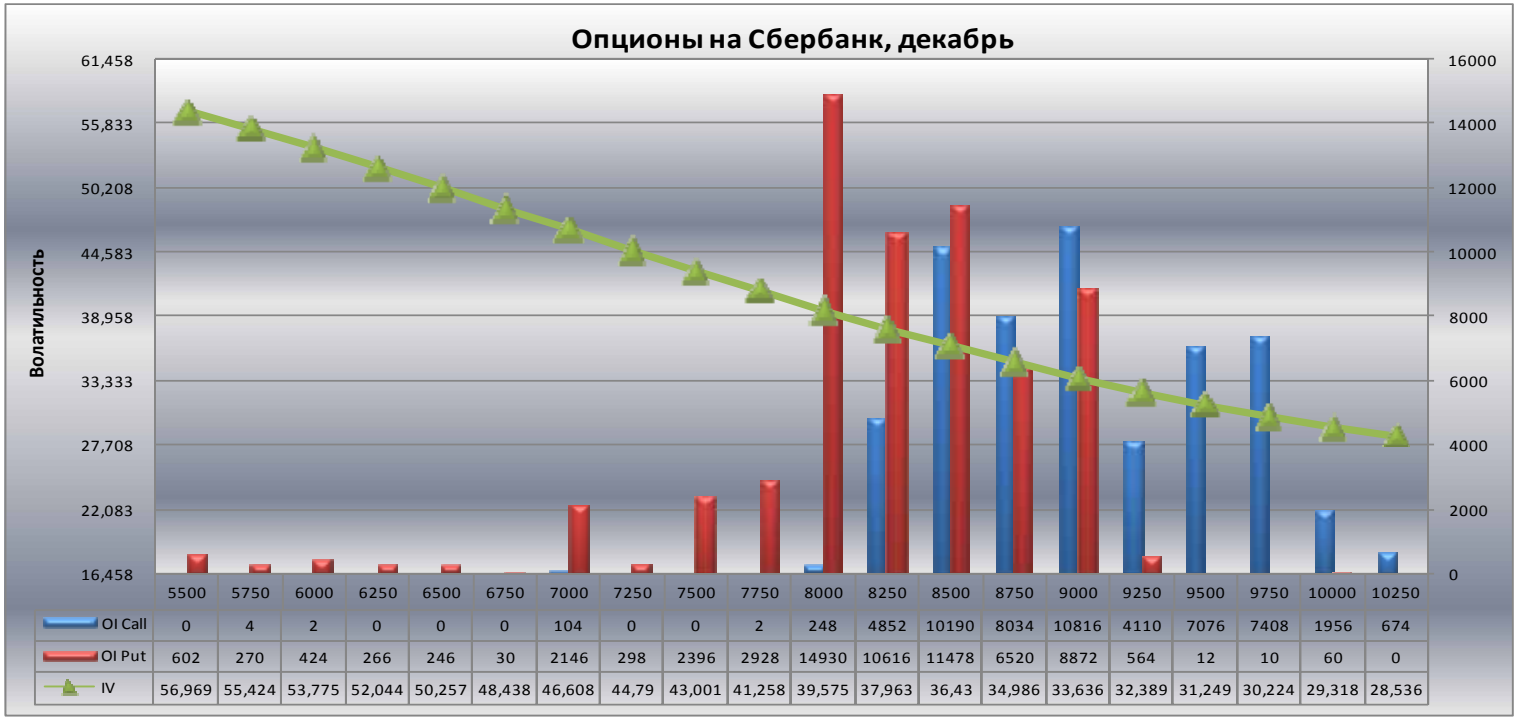
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,65	435194	11724531381,22	158200
ROSN-12.10	0,34	36942	3914775,00	21421
LKOH-12.10	0,27	174874	30296133,00	17703
GAZR-12.10	0,37	753916	97746490,00	16426
GMKR-12.10	0,27	27148	10494475,00	53846
SBRF-12.10	0,76	1028056	307382886,00	9206
VTBR-12.10	1	84690	3194717,00	9169
GOLD-12.10	0,27	64948	290749795,44	1356
Si-12.10	-0,35	777504	819792770,00	30170
Eu-12.10	0,36	125866	13583095,00	41972
ED-12.10	0,54	248224	2530904931,67	1,3904
SBPR-12.10	0,6	208032	5046510,00	6486
RTSS-12.10	0,29	7990	5068980,00	10153
BR-10.10	0,4	42468	174601566,00	83,49

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,02	432736	79352139567,83	157180
ROSN-12.10	0,31	36918	146220683,00	21349
LKOH-12.10	0,55	174676	721495798,00	17656
GAZR-12.10	-1,13	754218	2351646007,00	16365
GMKR-12.10	0,53	27108	298931419,00	53700
SBRF-12.10	-0,88	1024612	5195379304,00	9137
VTBR-12.10	-0,77	84648	135637770,00	9078
GOLD-12.10	-0,05	64208	1361956201,84	1352,3
Si-12.10	0,94	776592	14699304110,00	30276
Eu-12.10	0,27	126050	146146594,00	41823
ED-12.10	-0,61	238854	13718305386,96	1,383
SBPR-12.10	0,3	207432	70567565,00	6447
RTSS-12.10	-0,15	8012	617394070,00	10123,5
BR-10.10	-0,73	44018	750583913,18	83,16



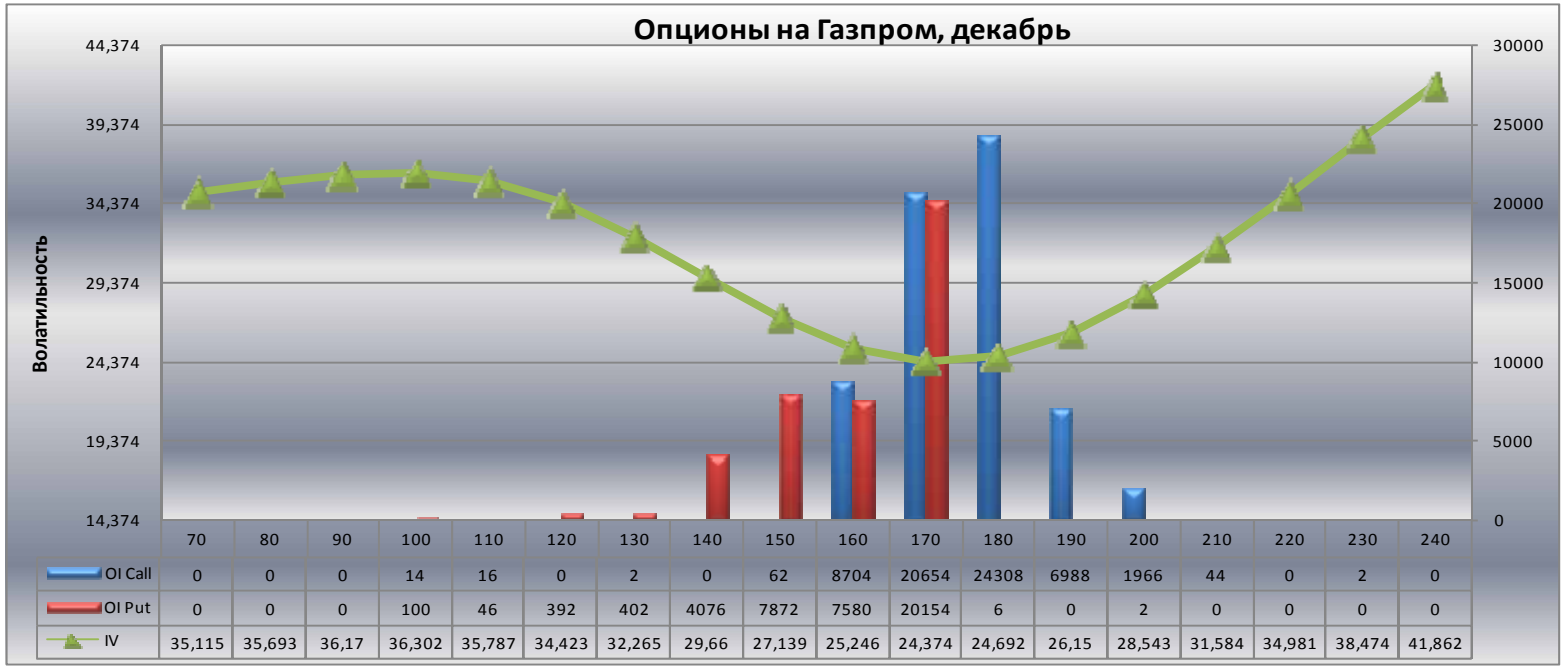
	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	2	14	8	116	1164	428	562	2098	19052	20028	21304	19418	72830	10966	19258
OI Put	5576	958	62	206	5128	20718	1544	2158	15792	10482	18790	40186	52418	27092	19530	14370	2638	182	304	2	2
IV	61,202	57,707	54,124	50,536	47,016	43,628	40,426	37,45	34,732	32,291	30,135	28,263	26,662	25,302	24,136	23,074	21,99	20,85	19,961	19,581	19,643



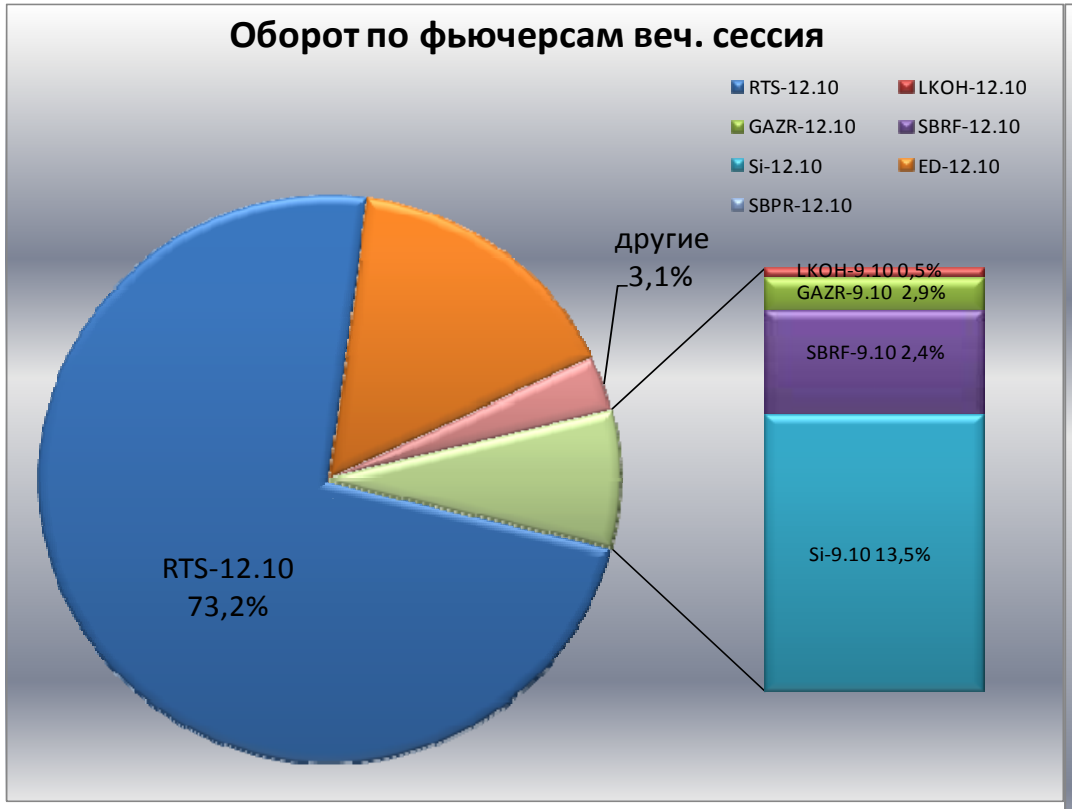
	5500	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250
OI Call	0	4	2	0	0	0	104	0	0	2	248	4852	10190	8034	10816	4110	7076	7408	1956	674
OI Put	602	270	424	266	246	30	2146	298	2396	2928	14930	10616	11478	6520	8872	564	12	10	60	0
IV	56,969	55,424	53,775	52,044	50,257	48,438	46,608	44,79	43,001	41,258	39,575	37,963	36,43	34,986	33,636	32,389	31,249	30,224	29,318	28,536



	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	2632	10530	1512	178	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	2	94	664	4264	1942	18	0	0	0	0	0	0	0
IV	57,079	48,859	41,947	36,378	32,092	28,954	26,735	24,923	22,843	22,226	22,918	24,289	26,102	28,231	30,588	33,104	35,726	38,409



	70	80	90	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240
OI Call	0	0	0	14	16	0	2	0	62	8704	20654	24308	6988	1966	44	0	2	0
OI Put	0	0	0	100	46	392	402	4076	7872	7580	20154	6	0	2	0	0	0	0
IV	35,115	35,693	36,17	36,302	35,787	34,423	32,265	29,66	27,139	25,246	24,374	24,692	26,15	28,543	31,584	34,981	38,474	41,862


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
3,1%
RTS-12.10
73,2%
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
1066666,
933333,3
800000
666666,6
533333,3
400000
266666,6
133333,3
0
90000000000,00
80000000000,00
70000000000,00
60000000000,00
50000000000,00
40000000000,00
30000000000,00
20000000000,00
10000000000,00
0,00
432 736
36 918
174 676
754 218
27 108
1 024 612
84 648
64 208
776 592
126 050
238 854
207 432
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