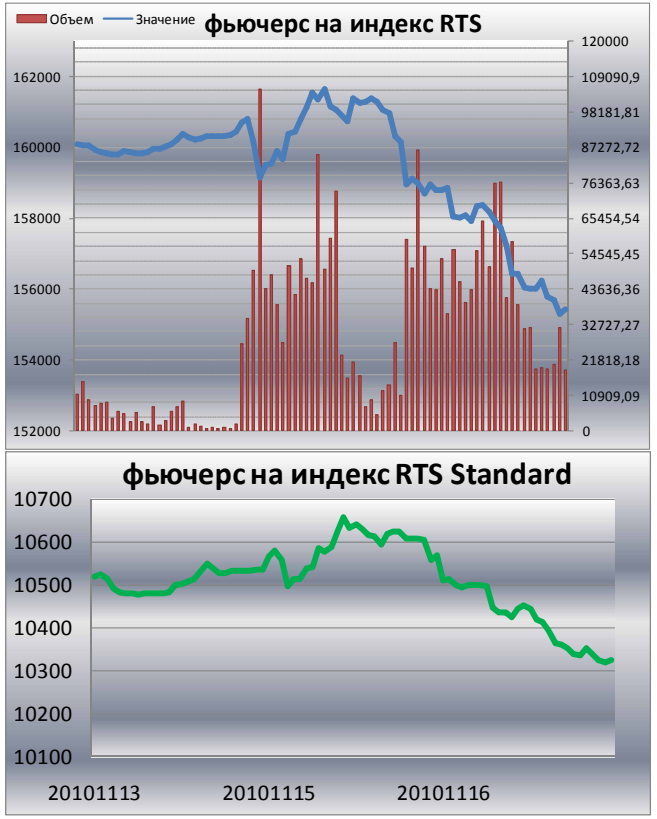
Дневное падение, вечернее падение.

Российские площадки во вторник находились в негативных настроениях. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы показали с открытия сильное движение вниз. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –1.59% и –1.62%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 2.5% до уровня в 1570,11 пункта.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 1,16%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 1.05%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял падением котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,88% и -0,68%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на +0,37% и +0,02%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на –0.74% и –1.09%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на –0.56%.



	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	155420	1554,20	-1,16	444 162	3,46%	28 174 166 059	25,48%
ROSN-12.10	21060	210,60	-0,79	48 106	0,43%	15 050 051	5,29%
LKOH-12.10	17120	1712,00	-0,68	150 764	0,41%	61 406 802	8,45%
GAZR-12.10	16836	168,36	-0,88	748 694	-0,06%	188 860 859	7,54%
GMKR-12.10	56601	5660,10	-1,22	70 064	0,07%	20 000 605	2,77%
SBRF-12.10	9480	94,80	-0,74	929 538	-1,84%	832 761 866	10,09%
VTBR-12.10	10122	0,1012	-1,09	140 940	0,10%	32 357 375	11,45%
GOLD-12.10	1344	1344,0000	-0,56	69 030	-1,46%	973 788 583	37,85%
Si-12.10	31360	31,36	0,37	1 034 124	0,98%	785 397 476	5,13%
Eu-12.10	42325	42,33	0,02	183 182	0,41%	35 953 289	33,36%
ED-12.10	1,35	1,35	-0,54	332 362	1,06%	4 412 622 894	24,66%
SBPR-12.10	6750	67,50	-1,07	205 776	-0,16%	8 306 403	4,28%
RTSS-12.10	10327	10327,00	-0,66	15 302	-80,50%	25 175 985	3,49%
BR-12.10	85	84,60	-1,05	82 426	437,47%	307 422 908	22,72%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69192,41	-1,67%	23:13:31
CAC 40	3762,47	-2,63%	19:35:17
DAX 30	6663,24	-1,87%	19:35:33
DJ Industrial	11023,5	-1,59%	00:41:09
FTSE 100	5681,9	-2,38%	19:35:29
Hang Seng	23446,61	-1,04%	10:01:47
Nikkei 225	9811,66	0,15%	09:00:03
S&P 500	1178,34	-1,62%	00:03:38
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1336,69	-0,21%	10:01:48
Palladium	634,5	-0,63%	09:53:08
Platinum	1634,5	-0,21%	10:01:10
RTSI	1 558,20	-0,63%	23:50:00
RTS_Standard	10 289,77	-0,76%	23:50:00
RTSI_DEREX	1570,11	-2,50%	18:45:00

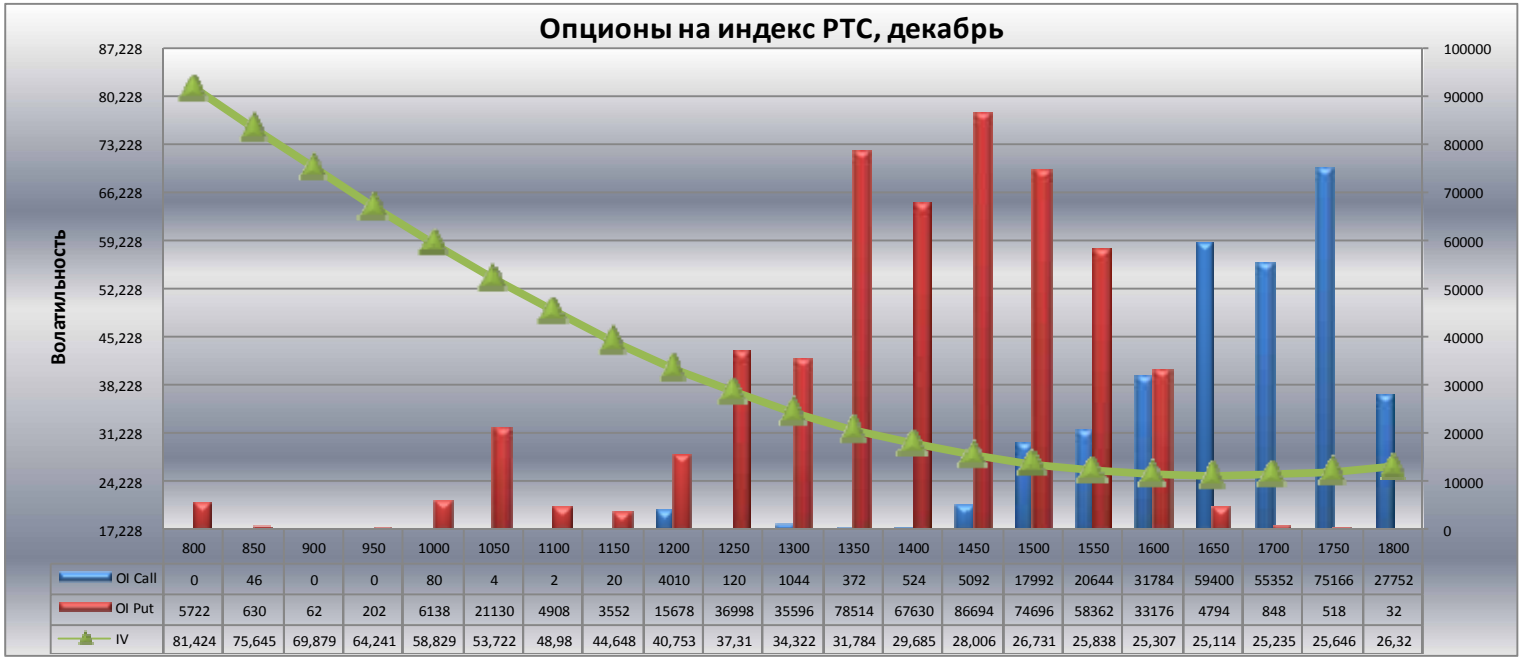
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,16	444162	28174166059,10	155420
ROSN-12.10	-0,79	48106	15050051,00	21060
LKOH-12.10	-0,68	150764	61406802,00	17120
GAZR-12.10	-0,88	748694	188860859,00	16836
GMKR-12.10	-1,22	70064	20000605,00	56601
SBRF-12.10	-0,74	929538	832761866,00	9480
VTBR-12.10	-1,09	140940	32357375,00	10122
GOLD-12.10	-0,56	69030	973788583,17	1344
Si-12.10	0,37	1034124	785397476,00	31360
Eu-12.10	0,02	183182	35953289,00	42325
ED-12.10	-0,54	332362	4412622893,61	1,3477
SBPR-12.10	-1,07	205776	8306403,00	6750
RTSS-12.10	-0,66	15302	25175985,00	10327
BR-12.10	-1,05	82426	307422907,63	84,6

Дневная сессия

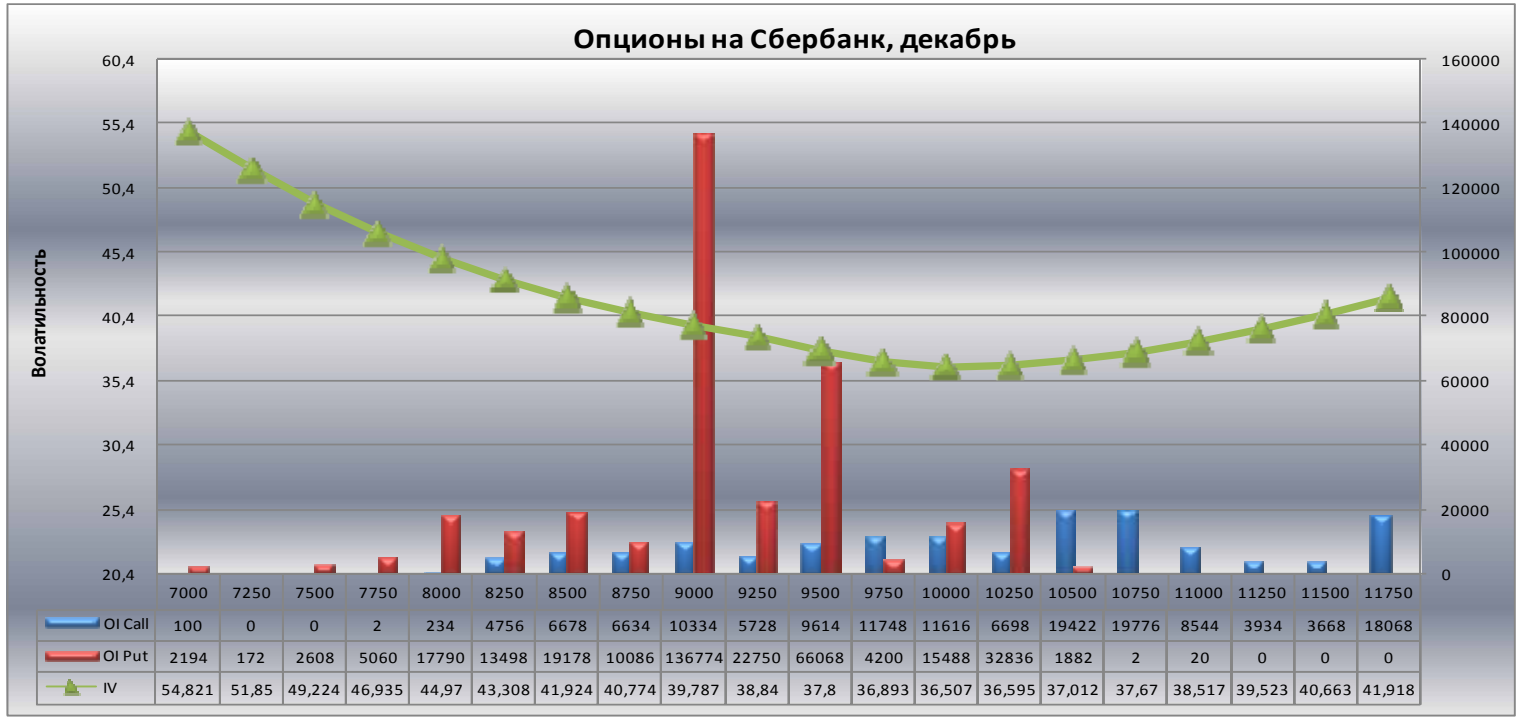
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-2,26	429300	110563682586,67	157250
ROSN-12.10	-2,78	47902	284693561,00	21228
LKOH-12.10	-1,56	150154	726428520,00	17238
GAZR-12.10	-1,34	749176	2505386551,00	16986
GMKR-12.10	-3,12	70016	721154399,00	57300
SBRF-12.10	-4	946988	8251961072,00	9551
VTBR-12.10	-2,99	140804	282491417,00	10234
GOLD-12.10	-1,77	70052	2572553324,00	1351,6
Si-12.10	0,63	1024052	15301337295,00	31244
Eu-12.10	0,21	182428	107777948,00	42318
ED-12.10	-0,39	328868	17892861749,33	1,355
SBPR-12.10	-3,37	206102	194140404,00	6823
RTSS-12.10	-2,05	15336	1352941455,00	10396
BR-12.10	-1,79	78460	721181558,72	85,5

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	2	20	4010	120	1044	372	524	5092	17992	20644	31784	59400	55352	75166	27752
OI Put	5722	630	62	202	6138	21130	4908	3552	15678	36998	35596	78514	67630	86694	74696	58362	33176	4794	848	518	32
IV	81,424	75,645	69,879	64,241	58,829	53,722	48,98	44,648	40,753	37,31	34,322	31,784	29,685	28,006	26,731	25,838	25,307	25,114	25,235	25,646	26,32

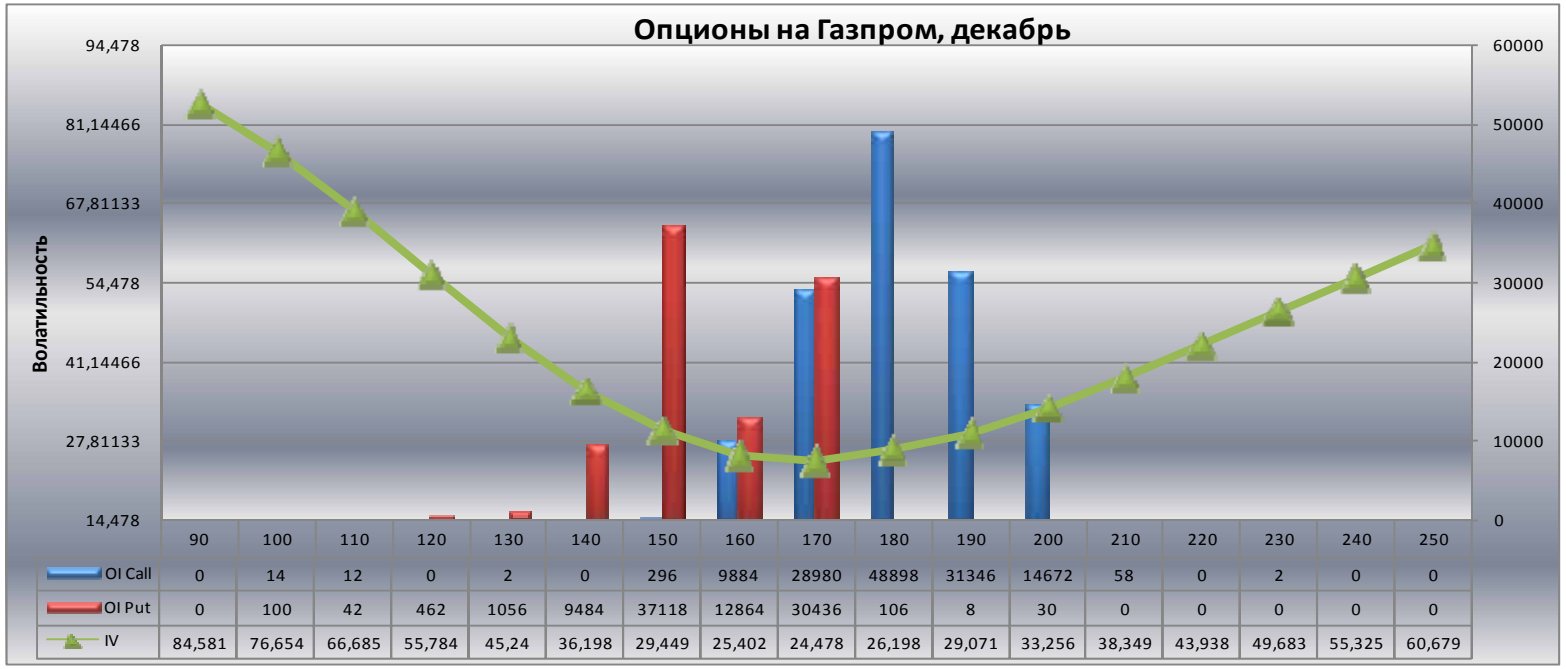
Опционы на Сбербанк, декабрь



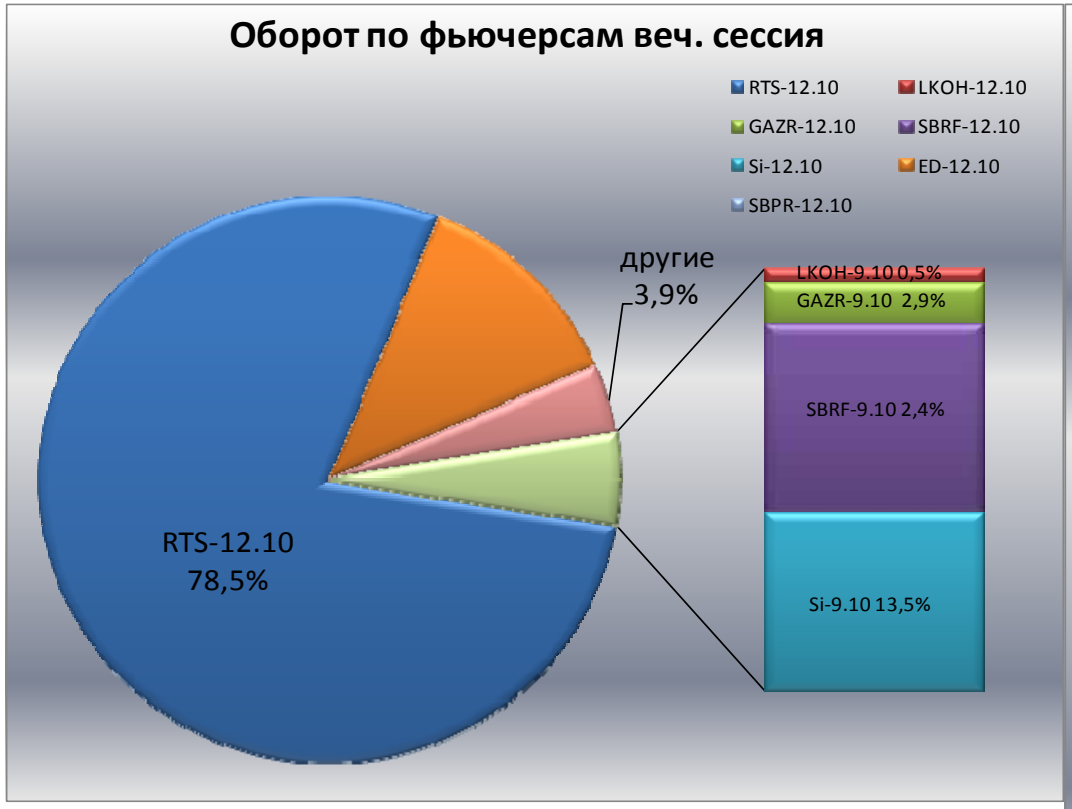
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	234	4756	6678	6634	10334	5728	9614	11748	11616	6698	19422	19776	8544	3934	3668	18068
OI Put	2194	172	2608	5060	17790	13498	19178	10086	136774	22750	66068	4200	15488	32836	1882	2	20	0	0	0
IV	54,821	51,85	49,224	46,935	44,97	43,308	41,924	40,774	39,787	38,84	37,8	36,893	36,507	36,595	37,012	37,67	38,517	39,523	40,663	41,918

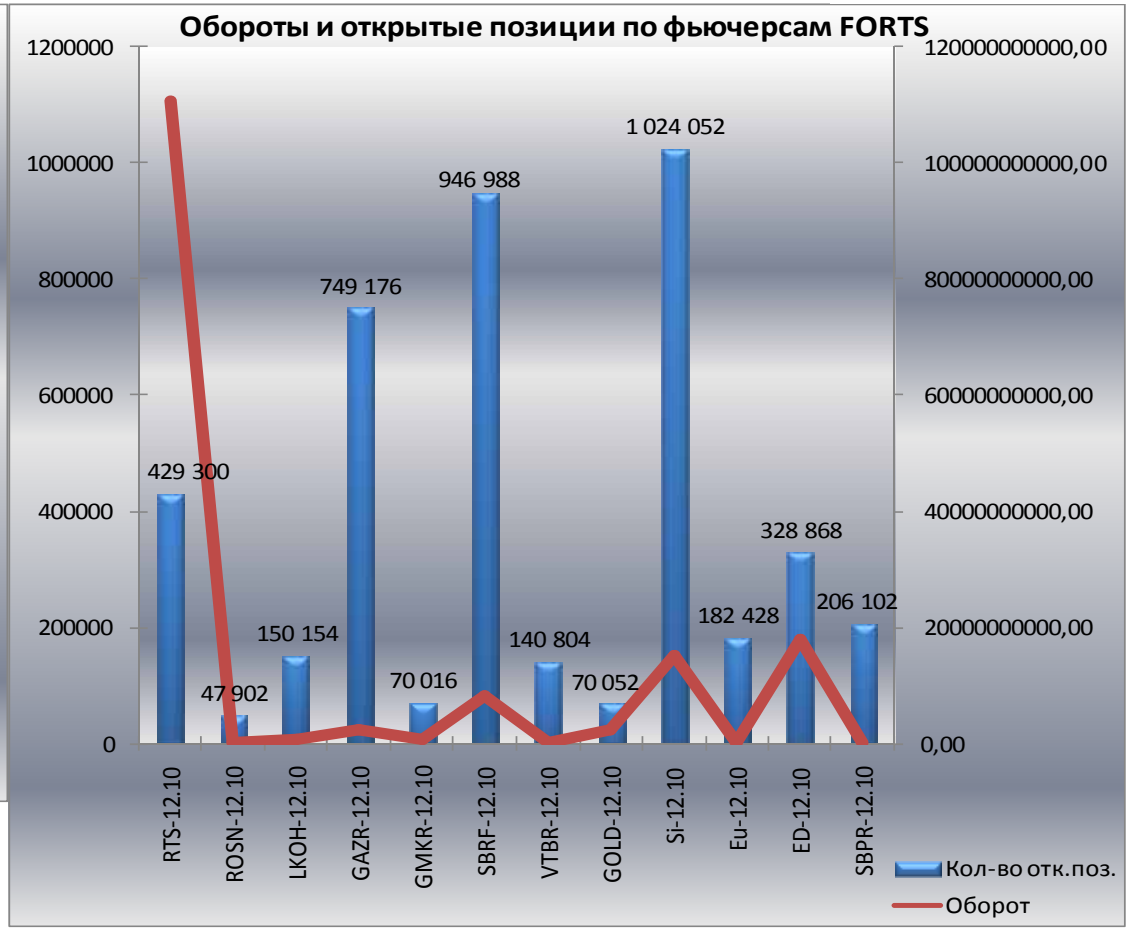


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	78	3260	16914	4552	468	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	176	2668	17834	7834	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	34,935	35,188	35,477	35,729	35,637	34,631	32,371	29,439	27,241	26,992	28,859	32,051	35,507	38,471	40,657	42,112	43,023	43,584



	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	9884	28980	48898	31346	14672	58	0	2	0	0
OI Put	0	100	42	462	1056	9484	37118	12864	30436	106	8	30	0	0	0	0	0
IV	84,581	76,654	66,685	55,784	45,24	36,198	29,449	25,402	24,478	26,198	29,071	33,256	38,349	43,938	49,683	55,325	60,679


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
3,9%
LKOH-9.10 0,5%
GAZR-9.10 2,9%
SBRF-9.10 2,4%
Si-9.10 13,5%
RTS-12.10
78,5%


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
429 300
47 902
150 154
749 176
70 016
946 988
140 804
70 052
1 024 052
182 428
328 868
206 102
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