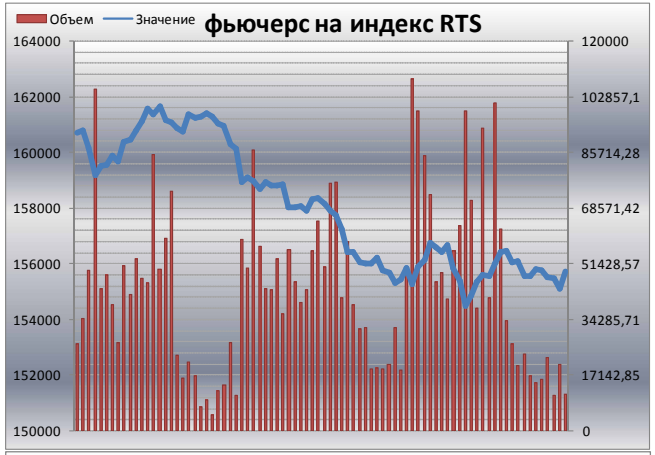
Дневное падение, вечернее падение.

Российские площадки в среду находились в негативных настроениях. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы показали с открытия небольшое движение вниз. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –0.14% и 0.02%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 0.36% до уровня в 1564,42 пункта.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции: декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,47%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 1.77%, 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 -0,77% и -0,68%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на +0,18% и +0,06%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на –0.55% и –0.62%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на –0.54%.





	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	155735	1557,35	-0,47	503 930	-1,23%	17 847 314 832	12,22%
ROSN-12.10	21169	211,69	-0,39	51 182	0,68%	12 723 265	3,22%
LKOH-12.10	17152	1715,20	-0,68	158 396	-0,09%	44 298 763	4,32%
GAZR-12.10	16805	168,05	-0,77	758 724	0,37%	165 966 394	6,40%
GMKR-12.10	57498	5749,80	-0,29	73 224	0,10%	17 559 903	2,41%
SBRF-12.10	9701	97,01	-0,55	948 200	0,29%	538 221 968	5,05%
VTBR-12.10	10256	0,1026	-0,62	144 192	1,20%	17 449 241	5,10%
GOLD-12.10	1339	1338,7000	-0,54	69 138	3,51%	289 296 758	13,81%
Si-12.10	31421	31,42	0,18	1 088 552	-0,23%	440 578 620	2,39%
Eu-12.10	42475	42,48	0,06	187 240	-0,17%	11 186 130	3,57%
ED-12.10	1,35	1,35	-0,14	310 454	3,36%	2 848 359 692	19,54%
SBPR-12.10	6940	69,40	-0,43	204 840	0,04%	3 799 877	0,81%
RTSS-12.10	10399	10399,00	-0,36	14 484	-84,48%	18 705 585	1,31%
BR-12.10	83	83,35	-1,77	93 426	547,89%	624 417 268	21,30%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	69708,63	0,75%	23:22:30
CAC 40	3792,35	0,79%	19:35:16
DAX 30	6700,07	0,55%	19:35:33
DJ Industrial	11007,88	-0,14%	00:41:10
FTSE 100	5692,56	0,19%	19:35:32
Hang Seng	23619,44	1,74%	09:56:17
Nikkei 225	10013,63	2,06%	09:00:02
S&P 500	1178,59	0,02%	00:04:21
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1352,48	1,23%	09:56:20
Palladium	675	2,31%	09:55:51
Platinum	1648	0,81%	09:55:32
RTSI	1 562,77	-0,49%	23:50:00
RTS_Standard	10 377,90	-0,58%	23:50:00
RTSI_DEREX	1564,42	-0,36%	18:45:00

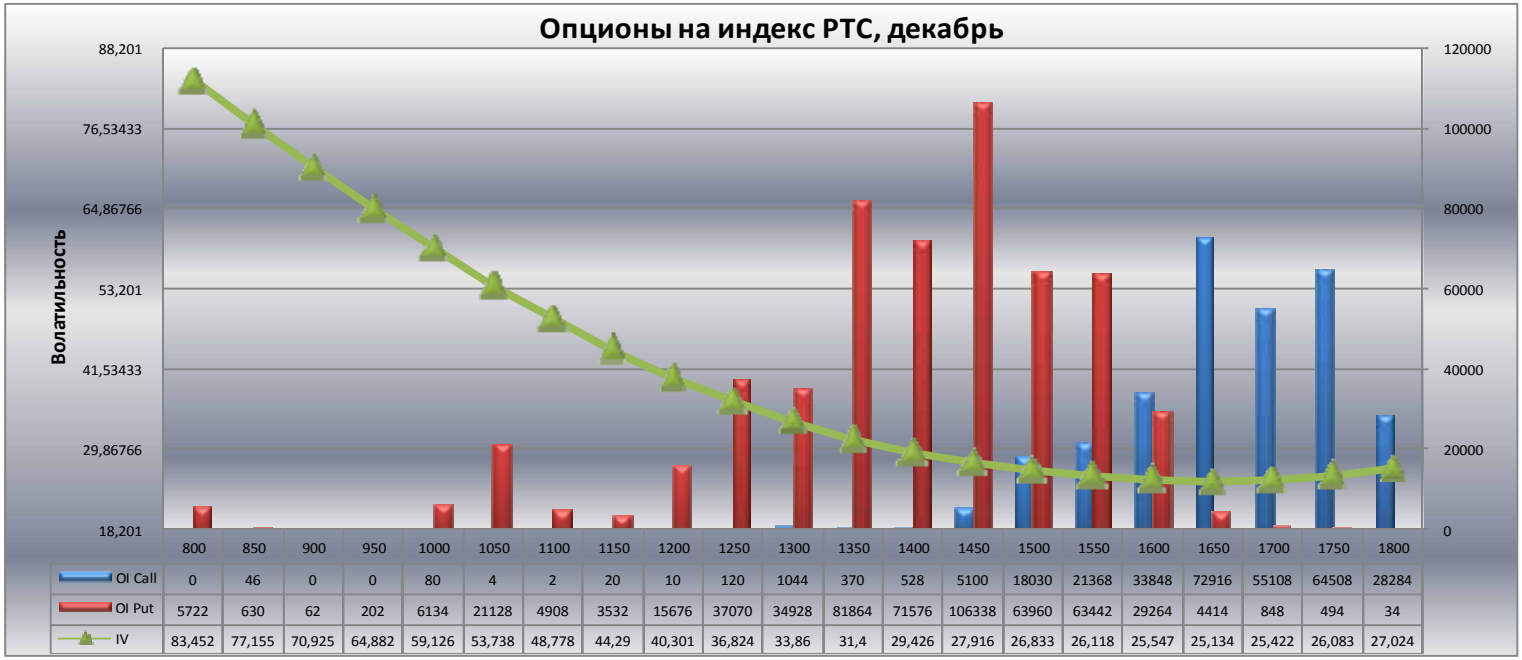
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,47	503930	17847314831,50	155735
ROSN-12.10	-0,39	51182	12723265,00	21169
LKOH-12.10	-0,68	158396	44298763,00	17152
GAZR-12.10	-0,77	758724	165966394,00	16805
GMKR-12.10	-0,29	73224	17559903,00	57498
SBRF-12.10	-0,55	948200	538221968,00	9701
VTBR-12.10	-0,62	144192	17449241,00	10256
GOLD-12.10	-0,54	69138	289296757,90	1338,7
Si-12.10	0,18	1088552	440578620,00	31421
Eu-12.10	0,06	187240	11186130,00	42475
ED-12.10	-0,14	310454	2848359692,13	1,3521
SBPR-12.10	-0,43	204840	3799877,00	6940
RTSS-12.10	-0,36	14484	18705585,00	10399
BR-12.10	-1,77	93426	624417268,17	83,35

Дневная сессия

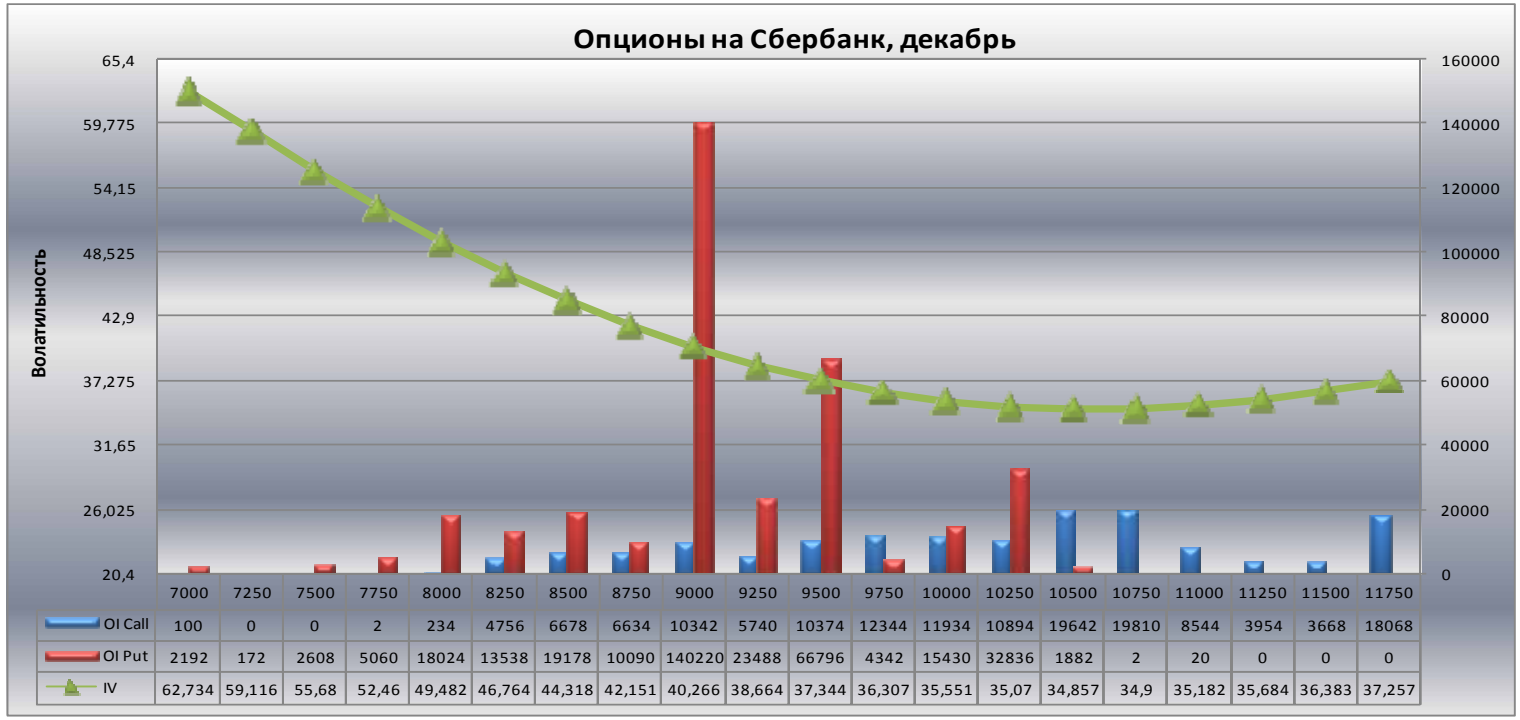
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,52	510182	146005569570,31	156435
ROSN-12.10	0,19	50834	394808280,00	21269
LKOH-12.10	0,19	158532	1026262871,00	17270
GAZR-12.10	-0,39	755900	2591820794,00	16919
GMKR-12.10	0,7	73150	728147423,00	57700
SBRF-12.10	2,08	945492	10659195629,00	9750
VTBR-12.10	0,64	142478	341962007,00	10302
GOLD-12.10	-0,45	66792	2094877696,70	1345,6
Si-12.10	0,41	1091026	18426403644,00	31371
Eu-12.10	0,31	187562	313687477,00	42451
ED-12.10	-0,1	300368	14578002495,09	1,3536
SBPR-12.10	2,24	204756	470515138,00	6976
RTSS-12.10	0,34	14420	2931616170,00	10431
BR-12.10	-0,71	93352	1425766839,19	84,89

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	2	20	10	120	1044	370	528	5100	18030	21368	33848	72916	55108	64508	28284
OI Put	5722	630	62	202	6134	21128	4908	3532	15676	37070	34928	81864	71576	106338	63960	63442	29264	4414	848	494	34
IV	83,452	77,155	70,925	64,882	59,126	53,738	48,778	44,29	40,301	36,824	33,86	31,4	29,426	27,916	26,833	26,118	25,547	25,134	25,422	26,083	27,024

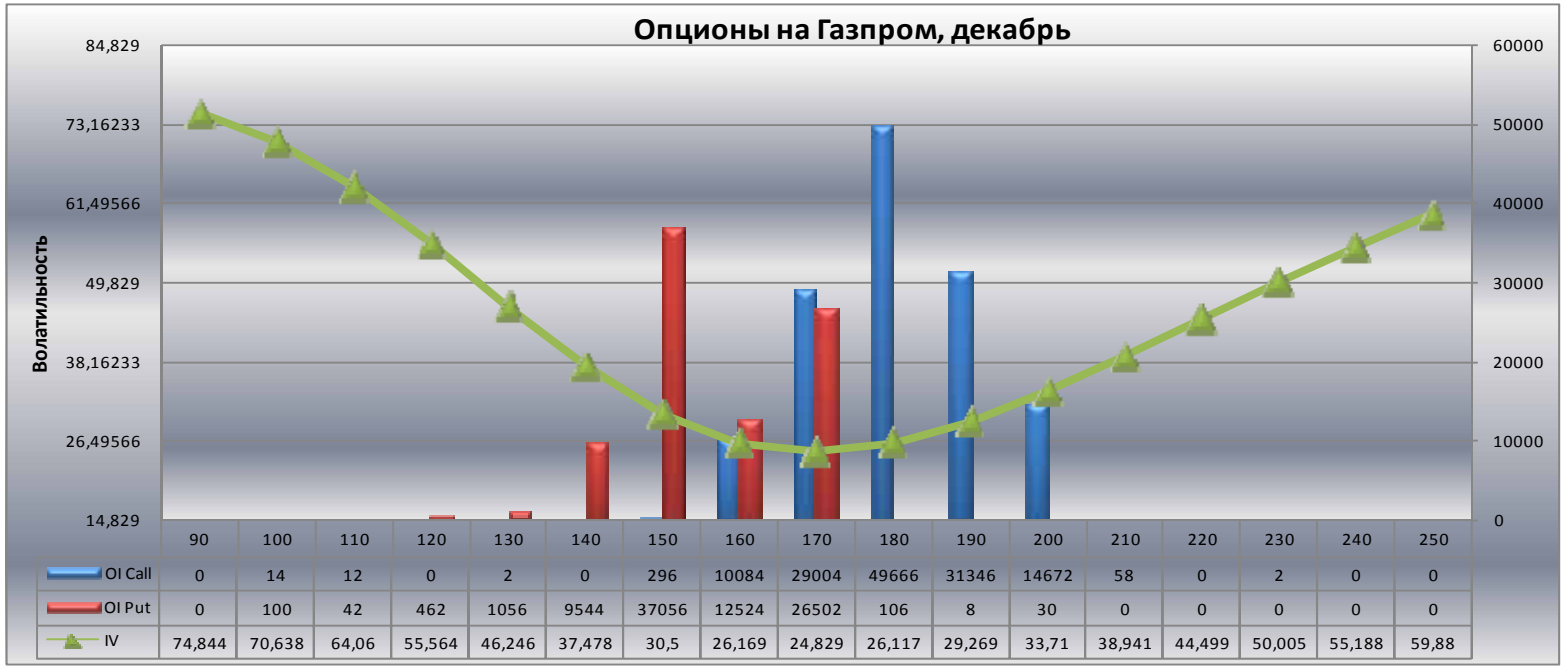
Опционы на Сбербанк, декабрь



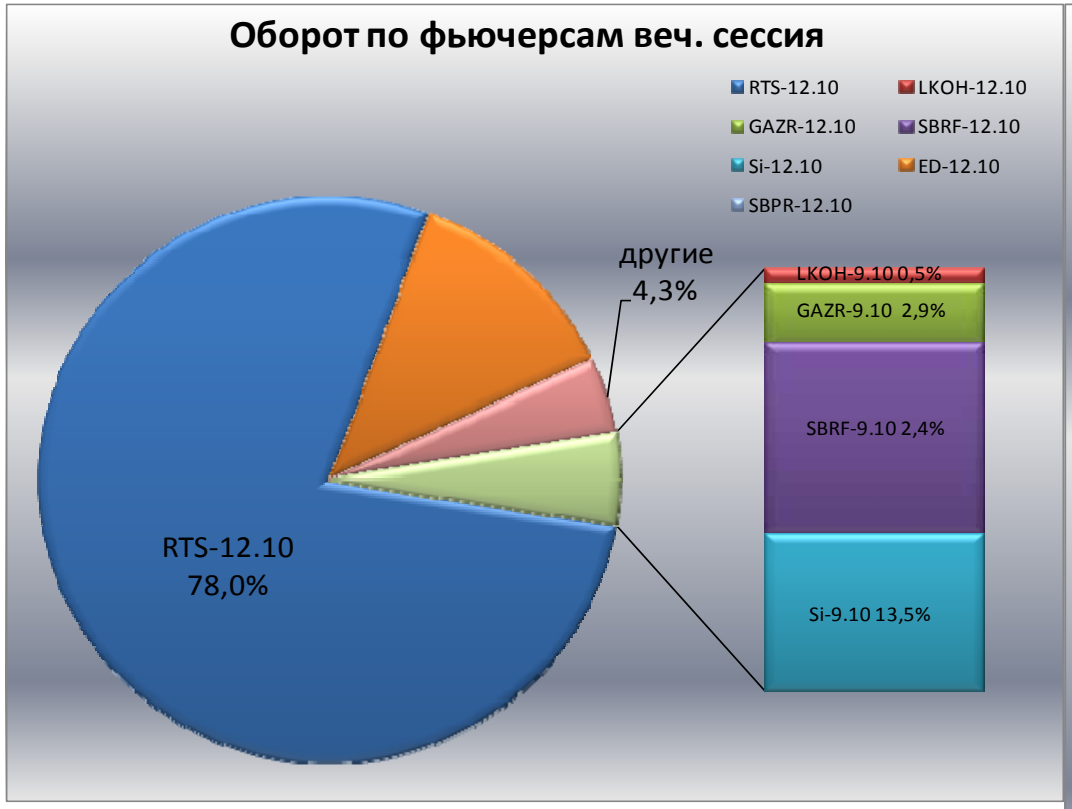
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	234	4756	6678	6634	10342	5740	10374	12344	11934	10894	19642	19810	8544	3954	3668	18068
OI Put	2192	172	2608	5060	18024	13538	19178	10090	140220	23488	66796	4342	15430	32836	1882	2	20	0	0	0
IV	62,734	59,116	55,68	52,46	49,482	46,764	44,318	42,151	40,266	38,664	37,344	36,307	35,551	35,07	34,857	34,9	35,182	35,684	36,383	37,257

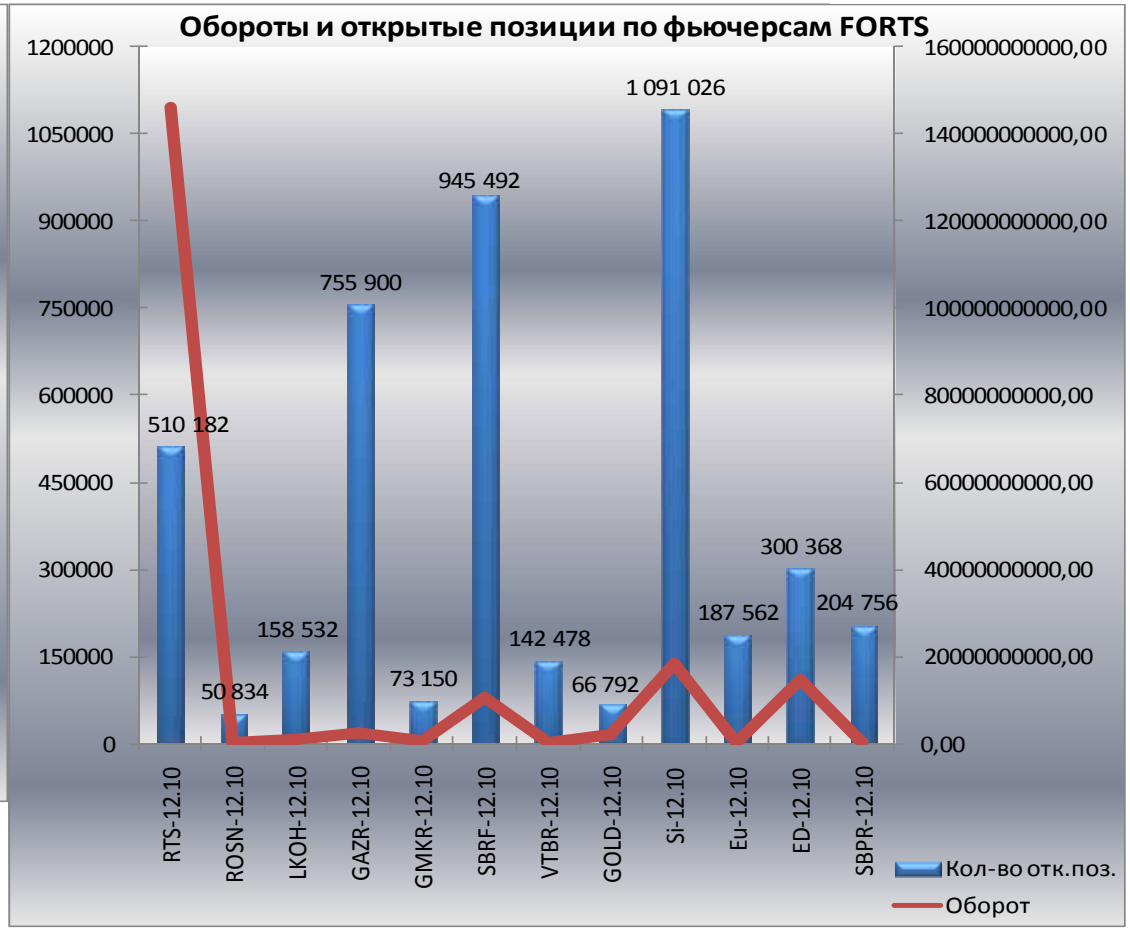


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	10	78	3408	16846	4558	468	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	186	2728	17866	7834	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	94,294	85,93	75,338	63,672	52,301	42,451	34,965	30,204	27,683	27,032	29,607	33,875	39,212	45,136	51,265	57,31	63,065	68,398



	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	10084	29004	49666	31346	14672	58	0	2	0	0
OI Put	0	100	42	462	1056	9544	37056	12524	26502	106	8	30	0	0	0	0	0
IV	74,844	70,638	64,06	55,564	46,246	37,478	30,5	26,169	24,829	26,117	29,269	33,71	38,941	44,499	50,005	55,188	59,88


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
4,3%
RTS-12.10
78,0%
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
1050000
900000
750000
600000
450000
300000
150000
0
160000000000,00
140000000000,00
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
510 182
50 834
158 532
755 900
73 150
945 492
142 478
66 792
1 091 026
187 562
300 368
204 756
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