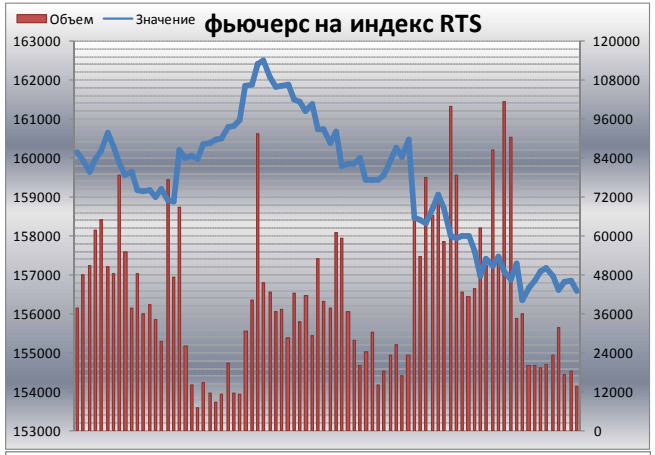
Дневное падение, вечернее падение.

Российские площадки во вторник в дневную сессию находились во власти негативных настроений, но ближе к концу цены продолжили стремительное падение вниз на фоне открытия американских рынков, в вечернюю сессию также превалировали негативные настроения. Как можно видеть, это произошло на фоне того, что американские индексы показали стремительное падение. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –1.27% и –1.42%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 1.53% до уровня в 1572,98 пункта. Вероятно это произошло из-за появления новостей из Кореи о военных столкновениях, а также из-за сопутствующей негативной динамики на мировых площадках.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,44%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.51%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок проигнорировал из-за более сильного сигнала на падение от американских площадок и произошло падение котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,18% и -0,25%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на +0,02% и -0,31%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.47% и -0.12%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на –0.13%.





	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	156600	1566,00	-0,44	544 792	-1,05%	21 617 620 224	15,55%
ROSN-12.10	20980	209,80	-0,20	54 086	-0,04%	2 414 894	0,90%
LKOH-12.10	17000	1700,00	-0,25	166 592	0,29%	44 922 923	4,24%
GAZR-12.10	16765	167,65	-0,18	755 592	0,10%	127 599 984	4,24%
GMKR-12.10	58489	5848,90	-0,12	77 016	0,02%	9 062 320	1,85%
SBRF-12.10	9822	98,22	-0,47	945 522	0,24%	474 766 538	4,40%
VTBR-12.10	10113	0,1011	-0,12	127 948	-0,23%	17 722 908	4,37%
GOLD-12.10	1378	1377,9000	-0,13	63 674	-0,75%	422 830 689	19,16%
Si-12.10	31399	31,40	0,02	1 021 390	-0,04%	694 804 336	2,99%
Eu-12.10	42002	42,00	-0,31	186 460	0,46%	23 711 848	14,01%
ED-12.10	1,34	1,34	-0,32	293 642	4,38%	2 631 588 793	13,90%
SBPR-12.10	6992	69,92	-0,37	130 046	0,02%	1 729 134	1,74%
RTSS-12.10	10440	10440,00	-0,09	14 926	-86,35%	13 043 825	1,18%
BR-12.10	83	83,42	0,51	103 580	588,51%	273 200 811	9,45%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	67952,55	-2,41%	23:12:30
CAC 40	3724,42	-2,47%	19:35:18
DAX 30	6705	-1,72%	19:35:32
DJ Industrial	11036,37	-1,27%	01:05:21
FTSE 100	5581,28	-1,75%	19:35:29
Hang Seng	23103,22	0,90%	09:48:32
Nikkei 225	10030,11	-0,84%	09:00:03
S&P 500	1181	-1,42%	08:40:33
Brent Crude Oil 0910	74,85	-0,35%	03:47:43
Gold	1377,85	0,10%	09:48:40
Palladium	698	1,82%	09:48:27
Platinum	1658,5	0,55%	09:47:54
RTSI	1 571,66	-0,09%	23:50:00
RTS_Standard	10 438,94	-0,07%	23:50:00
RTSI_DEREX	1572,98	-1,53%	18:45:00

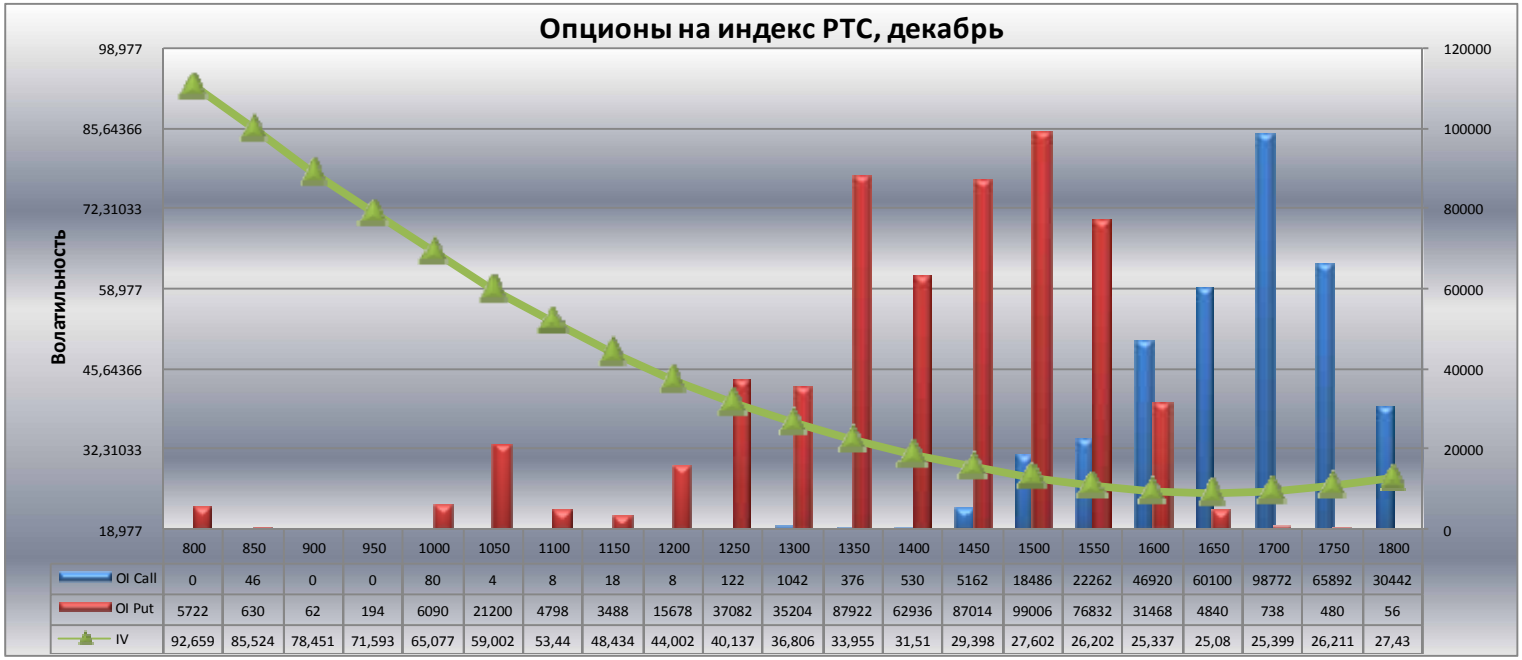
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-0,44	544792	21617620223,53	156600
ROSN-12.10	-0,2	54086	2414894,00	20980
LKOH-12.10	-0,25	166592	44922923,00	17000
GAZR-12.10	-0,18	755592	127599984,00	16765
GMKR-12.10	-0,12	77016	9062320,00	58489
SBRF-12.10	-0,47	945522	474766538,00	9822
VTBR-12.10	-0,12	127948	17722908,00	10113
GOLD-12.10	-0,13	63674	422830689,27	1377,9
Si-12.10	0,02	1021390	694804336,00	31399
Eu-12.10	-0,31	186460	23711848,00	42002
ED-12.10	-0,32	293642	2631588792,52	1,3372
SBPR-12.10	-0,37	130046	1729134,00	6992
RTSS-12.10	-0,09	14926	13043825,00	10440
BR-12.10	0,51	103580	273200811,24	83,42

Дневная сессия

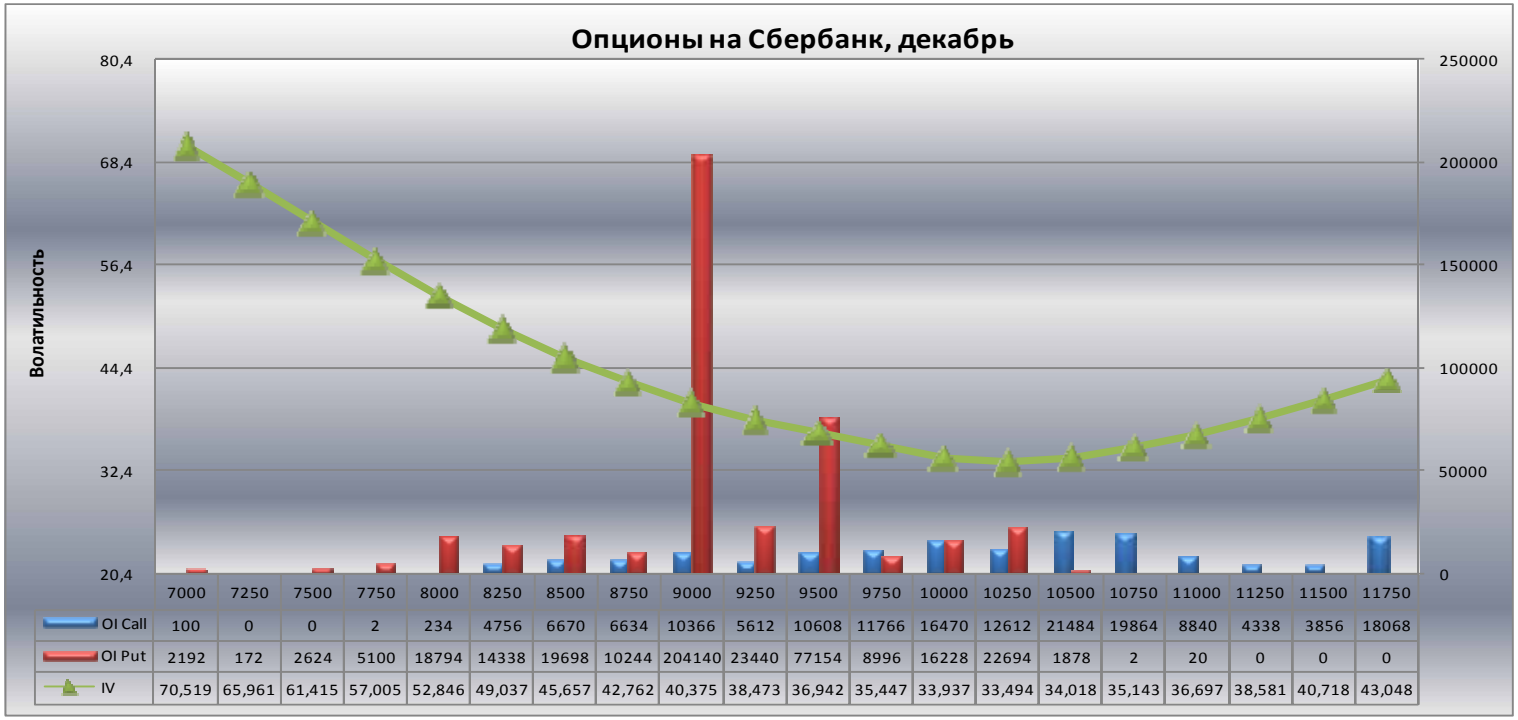
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,6	550558	139001696134,00	157295
ROSN-12.10	-1,31	54106	268693012,00	21022
LKOH-12.10	-1,2	166116	1059721511,00	17042
GAZR-12.10	-1,3	754866	3011955655,00	16796
GMKR-12.10	-0,69	77004	489158442,00	58620
SBRF-12.10	-0,76	943304	10784991091,00	9868
VTBR-12.10	-2,17	128238	405116232,00	10125
GOLD-12.10	1,82	64158	2206773149,33	1379,7
Si-12.10	0,61	1021780	23245018307,00	31394
Eu-12.10	-0,91	185604	169263567,00	42133
ED-12.10	-1,51	281308	18927744590,14	1,3415
SBPR-12.10	-1,42	130026	99223335,00	7018
RTSS-12.10	-1,02	15044	2890344375,00	10449
BR-12.10	-1,06	109342	1103364696,82	83

Опционы на индекс РТС, декабрь

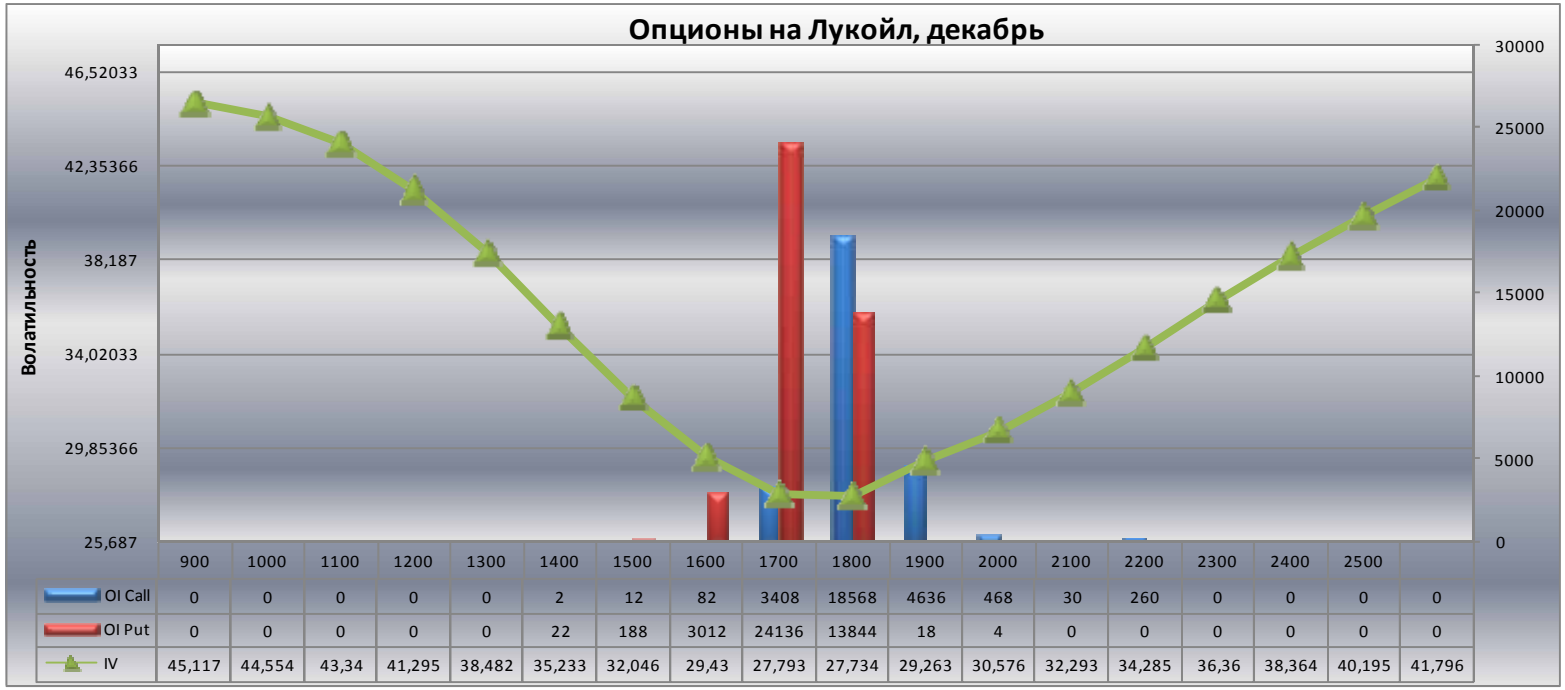


	800	850	900	950	1000	1050	1100	1150	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	46	0	0	80	4	8	18	8	122	1042	376	530	5162	18486	22262	46920	60100	98772	65892	30442
OI Put	5722	630	62	194	6090	21200	4798	3488	15678	37082	35204	87922	62936	87014	99006	76832	31468	4840	738	480	56
IV	92,659	85,524	78,451	71,593	65,077	59,002	53,44	48,434	44,002	40,137	36,806	33,955	31,51	29,398	27,602	26,202	25,337	25,08	25,399	26,211	27,43

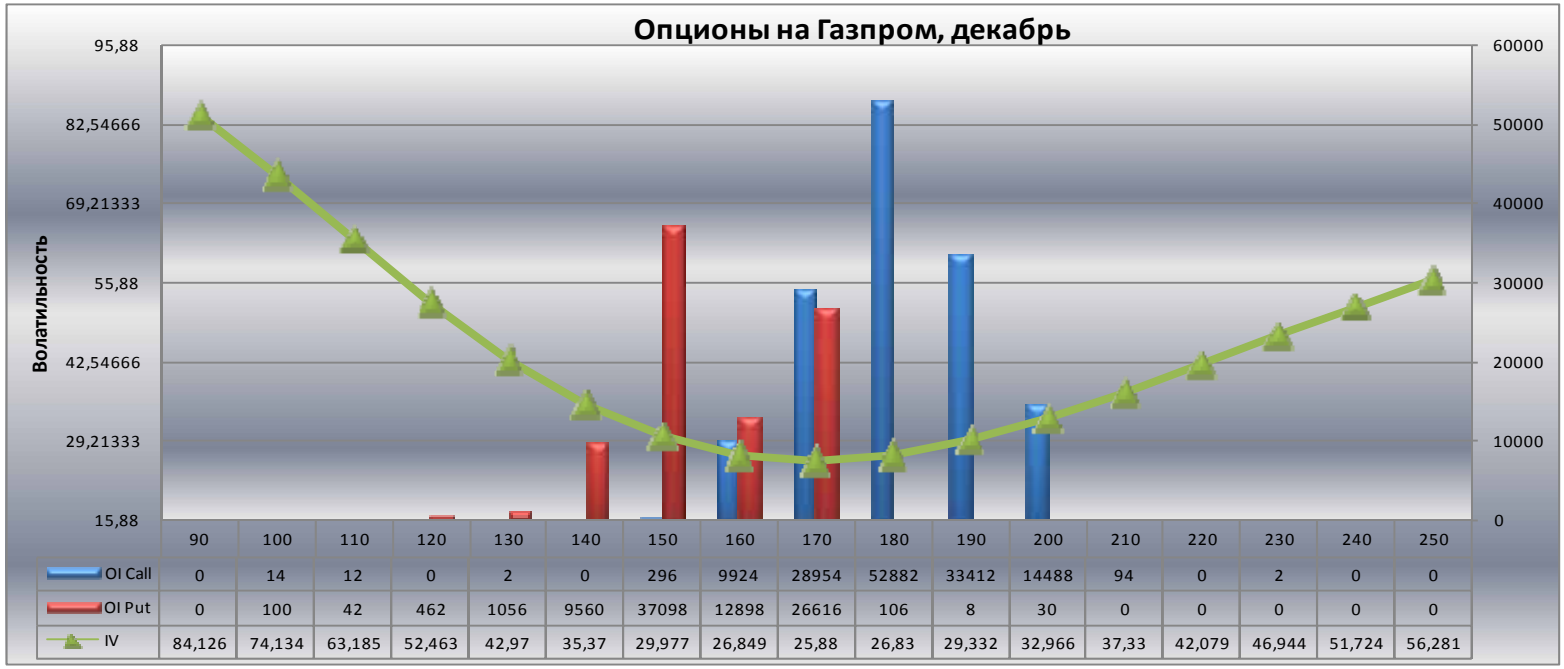
Опционы на Сбербанк, декабрь



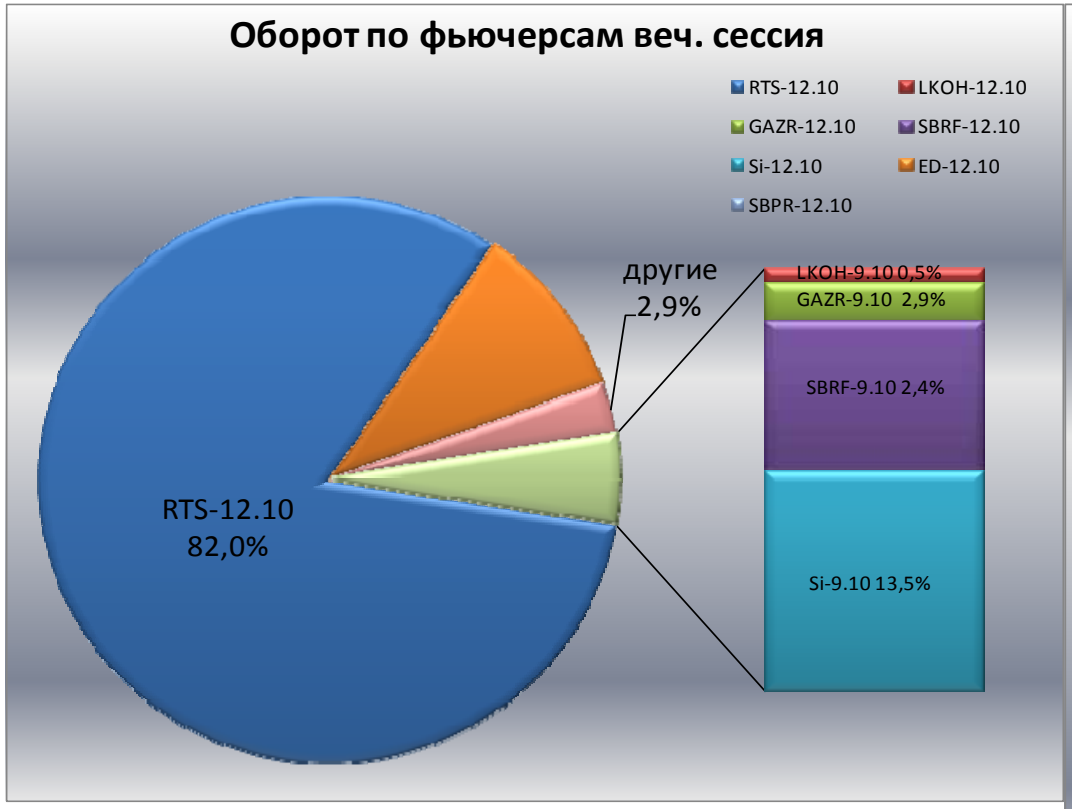
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	234	4756	6670	6634	10366	5612	10608	11766	16470	12612	21484	19864	8840	4338	3856	18068
OI Put	2192	172	2624	5100	18794	14338	19698	10244	204140	23440	77154	8996	16228	22694	1878	2	20	0	0	0
IV	70,519	65,961	61,415	57,005	52,846	49,037	45,657	42,762	40,375	38,473	36,942	35,447	33,937	33,494	34,018	35,143	36,697	38,581	40,718	43,048

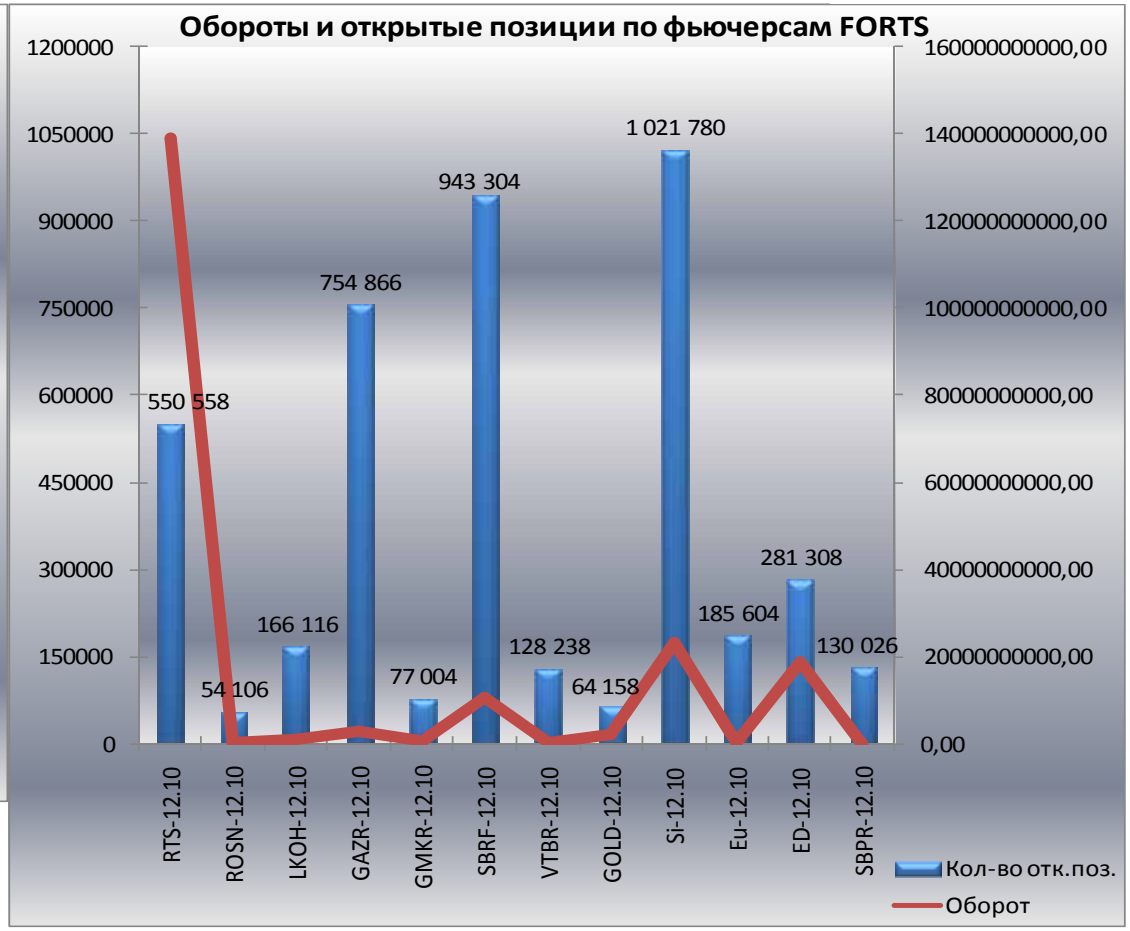


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	12	82	3408	18568	4636	468	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	188	3012	24136	13844	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	45,117	44,554	43,34	41,295	38,482	35,233	32,046	29,43	27,793	27,734	29,263	30,576	32,293	34,285	36,36	38,364	40,195	41,796



	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	9924	28954	52882	33412	14488	94	0	2	0	0
OI Put	0	100	42	462	1056	9560	37098	12898	26616	106	8	30	0	0	0	0	0
IV	84,126	74,134	63,185	52,463	42,97	35,37	29,977	26,849	25,88	26,83	29,332	32,966	37,33	42,079	46,944	51,724	56,281


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
RTS-12.10
82,0%
другие
2,9%
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
550 558
54 106
166 116
754 866
77 004
943 304
128 238
64 158
1 021 780
185 604
281 308
130 026
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