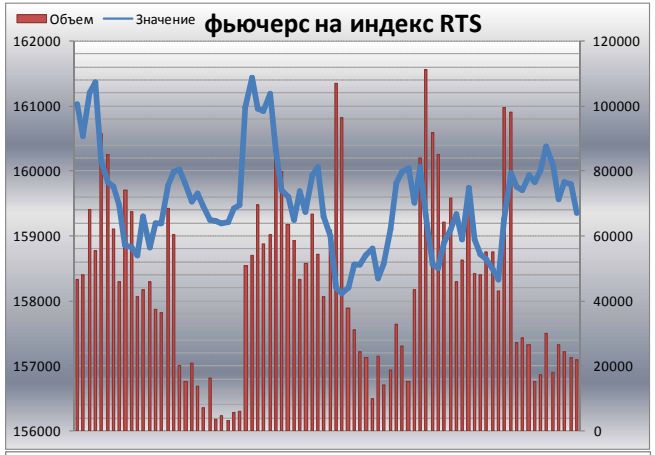
Дневной рост, вечерняя коррекция.

Российские площадки во вторник в дневную сессию находились во власти позитивных настроений, на фоне открытия американских рынков гэпом вниз рынок сначала скорректировался вверх, но впоследствии продолжил рост, в вечернюю сессию превалировали негативные настроения опять же на фоне негатива на американских рынках. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на –0.42% и –0.61%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов вырос на 0.26% до уровня в 1594,29 пункта.

На вечерних торгах господствовали негативные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС упал на 0,25%. Декабрьские фьючерсы на Brent упали на 1.51%, так что котировкам нефтегазовых компаний не было оказано поддержки, что рынок воспринял в целом непропорционально слабым движением котировок вниз, в результате произошло падение котировок нефтегазовых компаний, в результате чего декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на -0,18% и -0,18%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,06% и -0,17%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на -0.48% и +0.16%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +0.10%.









Вечерняя сессия

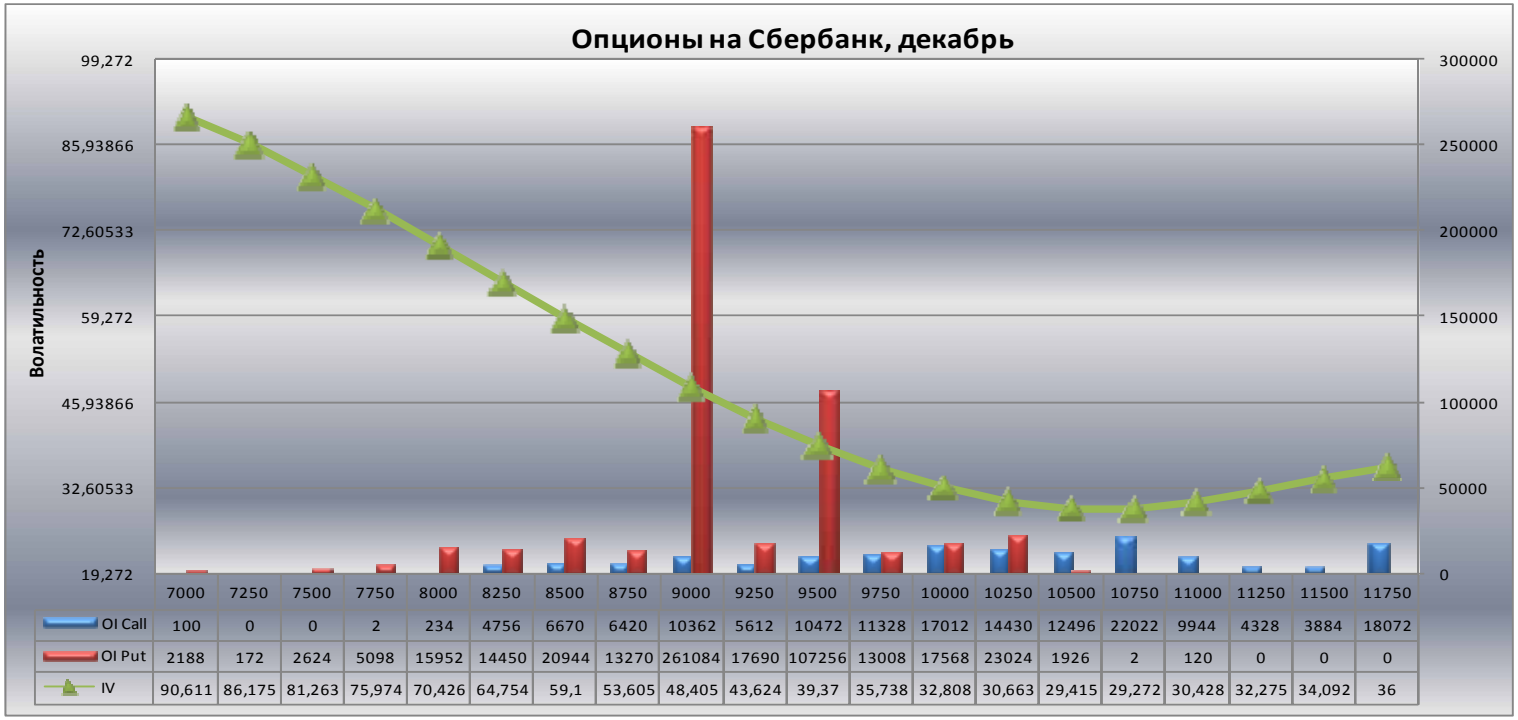


Дневная сессия





	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	20	12	122	1042	392	530	5128	18318	21718	41384	68712	130480	65084	30078
OI Put	5678	590	68	192	5980	21182	4750	3322	14802	36202	35430	87754	65254	108384	115078	78328	30190	5330	764	352	54
IV	106,59	99,942	92,787	85,338	77,81	70,404	63,302	56,656	50,587	45,176	40,472	36,479	33,159	30,409	28,039	25,842	23,999	23,108	23,284	24,286	25,898



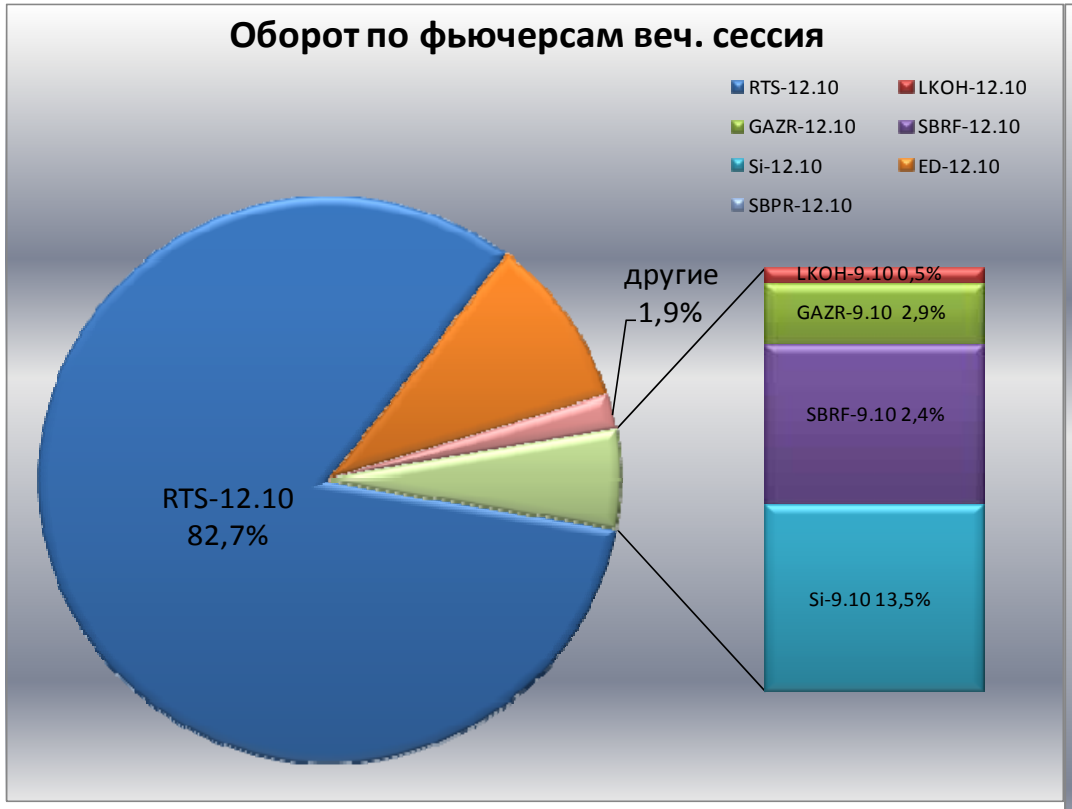
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	234	4756	6670	6420	10362	5612	10472	11328	17012	14430	12496	22022	9944	4328	3884	18072
OI Put	2188	172	2624	5098	15952	14450	20944	13270	261084	17690	107256	13008	17568	23024	1926	2	120	0	0	0
IV	90,611	86,175	81,263	75,974	70,426	64,754	59,1	53,605	48,405	43,624	39,37	35,738	32,808	30,663	29,415	29,272	30,428	32,275	34,092	36

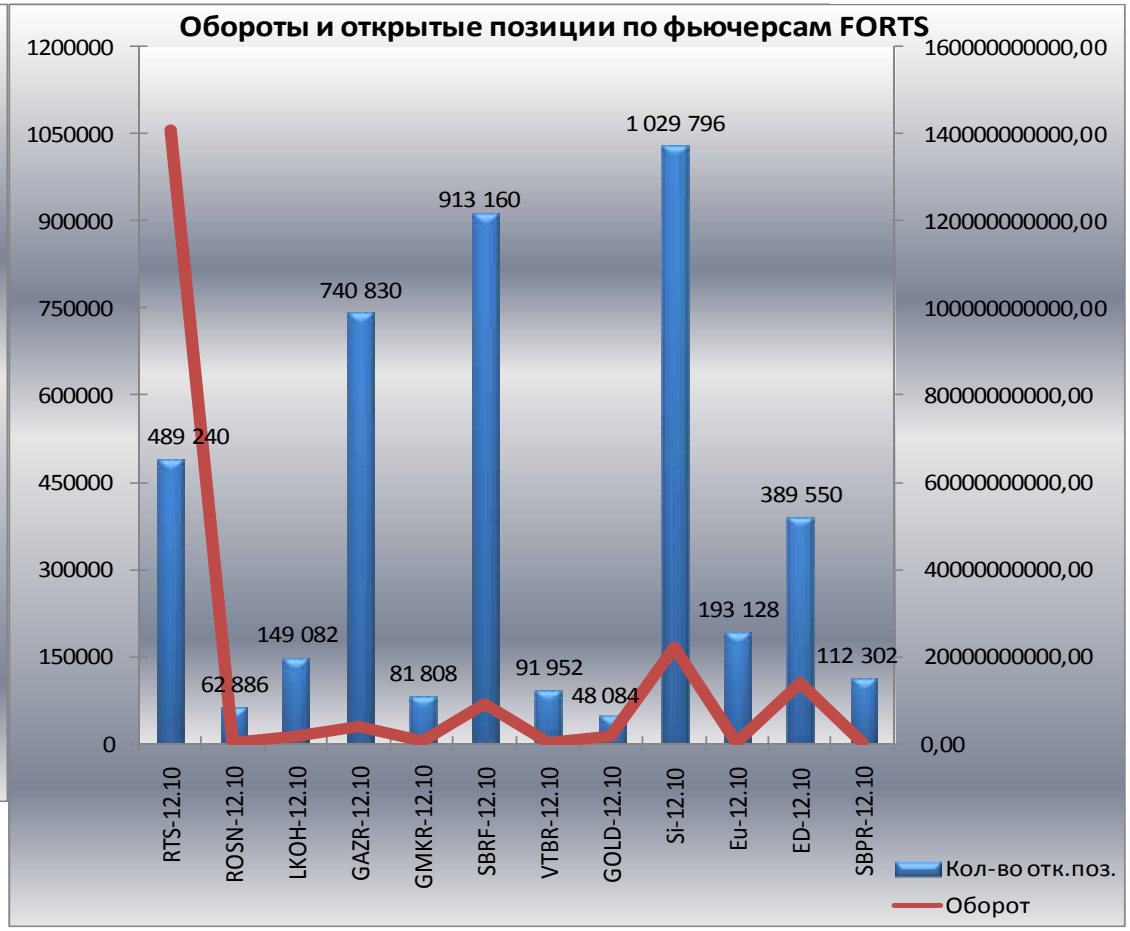


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	10	82	3466	19102	4596	462	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	200	3220	24332	13844	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	77,993	77,437	75,807	71,433	62,725	50,104	36,717	26,742	22,904	25,285	31,865	39,993	47,607	53,657	57,928	60,67	62,288	63,166



	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	9810	30922	58364	33116	14812	94	0	2	0	0
OI Put	0	100	42	462	1056	9558	37138	13410	28856	162	10	30	0	0	0	0	0
IV	111,055	105,534	96,203	83,307	68,338	53,465	40,723	31,499	26,478	25,741	28,705	34,292	41,325	48,819	56,07	62,649	68,339


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
82,7%
другие
1,9%
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
489 240
62 886
149 082
740 830
81 808
913 160
91 952
48 084
1 029 796
193 128
389 550
112 302
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