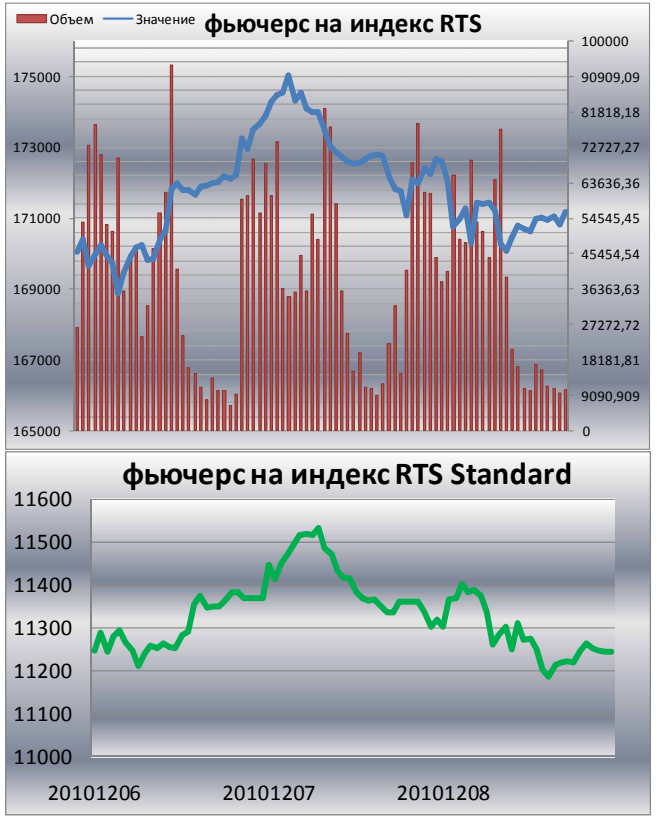
Дневное падение, вечерний рост.

Российские площадки в среду в дневную сессию находились во власти негативных настроений, ближе к концу цены продолжили стремительное падение на фоне выхода в целом нейтральной статистики и на фоне открытия американских рынков в минусе, в вечернюю сессию превалировали позитивные настроения. В итоге американские индексы DowJones и S&P изменились к закрытию на +0.12% и +0.37%. Индекс RTSI_Derex к концу дневных торгов упал на 1.73% до уровня в 1702,76 пункта.

На вечерних торгах господствовали позитивные тенденции. декабрьский фьючерс на индекс РТС вырос на 0,66%. Декабрьские фьючерсы на Brent выросли на 0.75%, так что котировкам нефтегазовых компаний была оказана поддержка, что рынок воспринял в целом непропорционально слабым движением котировок вверх, в результате произошел рост котировок нефтегазовых компаний, декабрьские фьючерсы на Газпром и ЛУКОЙЛ двинулись на 0,54% и 0,34%. Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль с поставкой в декабре двинулись на -0,14% и +0,18%, на что было обращено внимание на рынке: котировки ближних фьючерсов на об. акции Сбербанка и ВТБ изменились на +0.65% и +0.63%. Это произошло на фоне движения декабрьских контрактов на золото на +0.82%.



	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	171190	1711,90	0,66	484 972	0,03%	15 094 691 982	12,07%
ROSN-12.10	21770	217,70	0,31	50 898	-0,04%	5 831 283	2,05%
LKOH-12.10	17874	1787,40	0,34	126 082	-0,07%	54 562 148	4,66%
GAZR-12.10	19209	192,09	0,54	565 584	-0,09%	296 676 588	5,05%
GMKR-12.10	65009	6500,90	0,46	81 566	0,01%	8 430 392	0,87%
SBRF-12.10	10547	105,47	0,65	703 154	1,76%	484 730 020	4,50%
VTBR-12.10	10235	0,1024	0,63	65 302	0,26%	4 670 960	2,17%
GOLD-12.10	1385	1384,6000	0,82	45 582	-1,90%	373 117 670	18,78%
Si-12.10	31100	31,10	-0,14	624 982	-0,41%	549 886 392	2,86%
Eu-12.10	41228	41,23	0,18	72 878	-0,05%	3 831 238	2,04%
ED-12.10	1,33	1,33	0,33	187 052	-2,56%	1 708 663 711	15,68%
SBPR-12.10	7447	74,47	0,61	89 104	-0,04%	705 852	0,55%
RTSS-12.10	11244	11244,00	0,52	14 136	-76,94%	20 306 715	1,39%
BR-12.10	91	91,03	0,75	61 458	337,74%	314 547 152	16,32%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	68174,92	-1,68%	23:11:30
CAC 40	3831,98	0,56%	19:35:16
DAX 30	6975,87	-0,37%	19:35:32
DJ Industrial	11372,48	0,12%	01:05:20
FTSE 100	5794,53	-0,24%	19:35:30
Hang Seng	23132,72	0,17%	09:56:48
Nikkei 225	10285,88	0,52%	09:00:04
S&P 500	1228,28	0,37%	00:03:17
Brent Crude Oil 0211	91,57	0,66%	09:57:10
Gold	1386,5	0,33%	09:56:48
Palladium	729,83	0,87%	09:56:42
Platinum	1680,5	0,00%	09:57:09
RTSI	1 701,15	0,40%	23:50:00
RTS_Standard	11 209,83	0,38%	23:50:00
RTSI_DEREX	1702,76	-1,73%	18:45:00

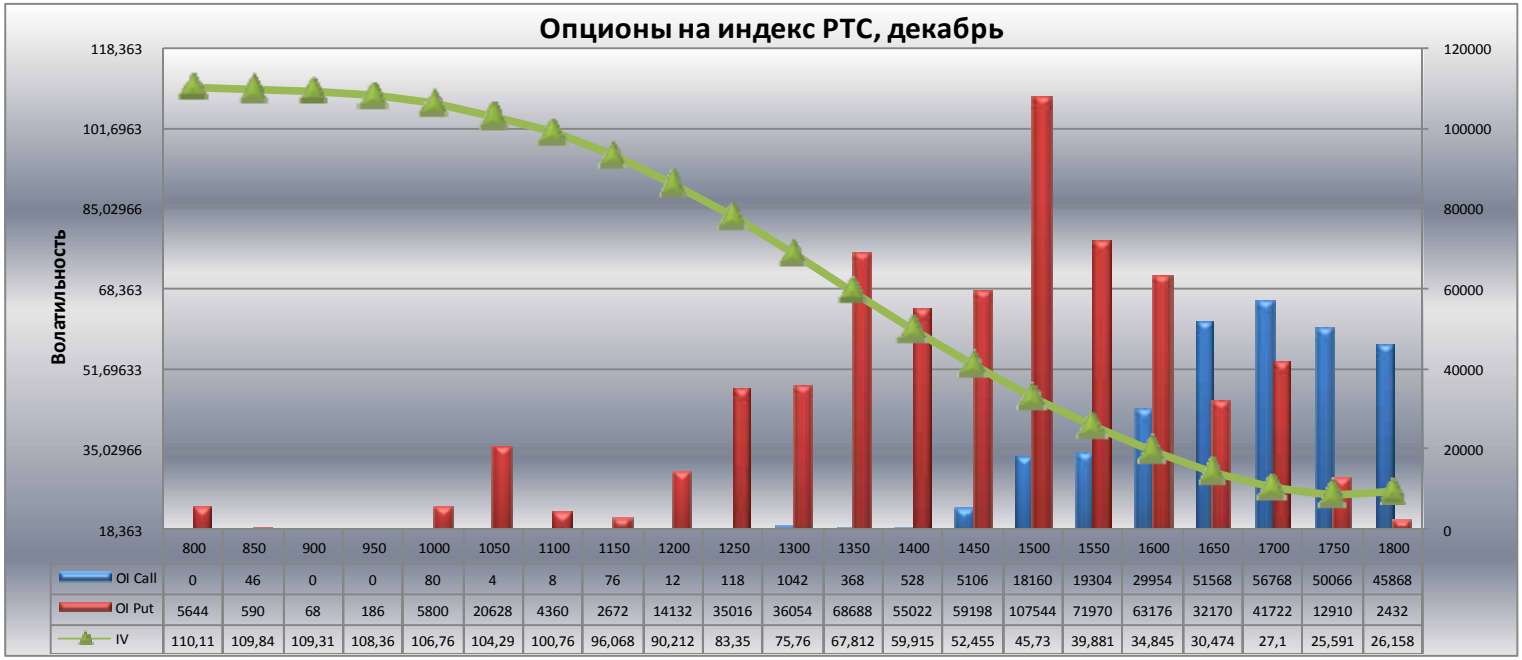
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	0,66	484972	15094691981,51	171190
ROSN-12.10	0,31	50898	5831283,00	21770
LKOH-12.10	0,34	126082	54562148,00	17874
GAZR-12.10	0,54	565584	296676588,00	19209
GMKR-12.10	0,46	81566	8430392,00	65009
SBRF-12.10	0,65	703154	484730020,00	10547
VTBR-12.10	0,63	65302	4670960,00	10235
GOLD-12.10	0,82	45582	373117669,71	1384,6
Si-12.10	-0,14	624982	549886392,00	31100
Eu-12.10	0,18	72878	3831238,00	41228
ED-12.10	0,33	187052	1708663710,80	1,3261
SBPR-12.10	0,61	89104	705852,00	7447
RTSS-12.10	0,52	14136	20306715,00	11244
BR-12.10	0,75	61458	314547152,40	91,03

Дневная сессия

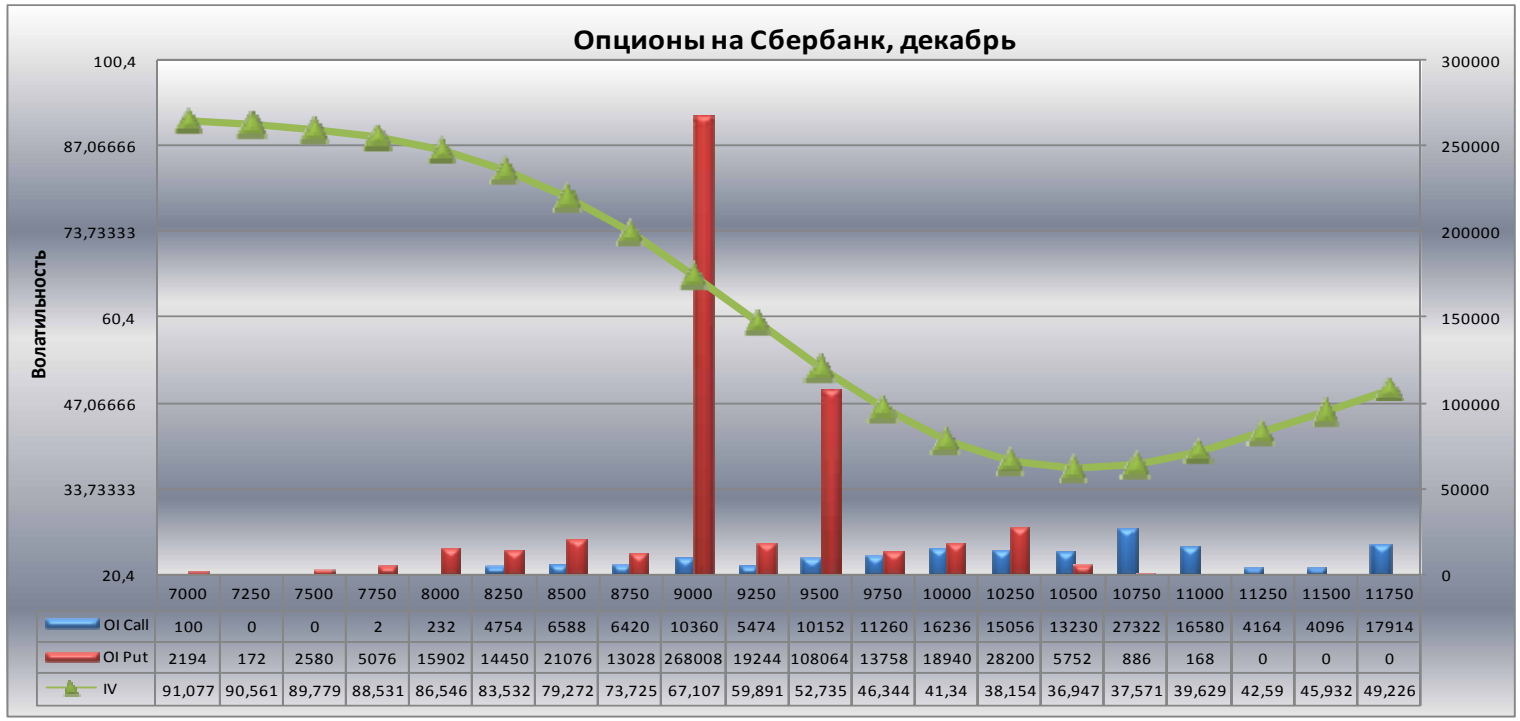
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.10	-1,54	484826	125107432267,09	170065
ROSN-12.10	-1,22	50916	284254243,00	21698
LKOH-12.10	-2	126176	1170469023,00	17814
GAZR-12.10	-0,95	566098	5877696763,00	19105
GMKR-12.10	-2,09	81560	964314173,00	64712
SBRF-12.10	-2,45	691000	10779930369,00	10479
VTBR-12.10	-2,29	65132	215674539,00	10171
GOLD-12.10	-2,73	46464	1986547623,87	1373,4
Si-12.10	0,17	627584	19229100368,00	31145
Eu-12.10	-0,76	72918	188205731,00	41154
ED-12.10	-0,87	191970	10899189344,51	1,3217
SBPR-12.10	-1,88	89142	128958885,00	7402
RTSS-12.10	-1,59	14040	1927545565,00	11186
BR-12.10	-1,02	61300	1460666854,09	90,35

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	76	12	118	1042	368	528	5106	18160	19304	29954	51568	56768	50066	45868
OI Put	5644	590	68	186	5800	20628	4360	2672	14132	35016	36054	68688	55022	59198	107544	71970	63176	32170	41722	12910	2432
IV	110,11	109,84	109,31	108,36	106,76	104,29	100,76	96,068	90,212	83,35	75,76	67,812	59,915	52,455	45,73	39,881	34,845	30,474	27,1	25,591	26,158

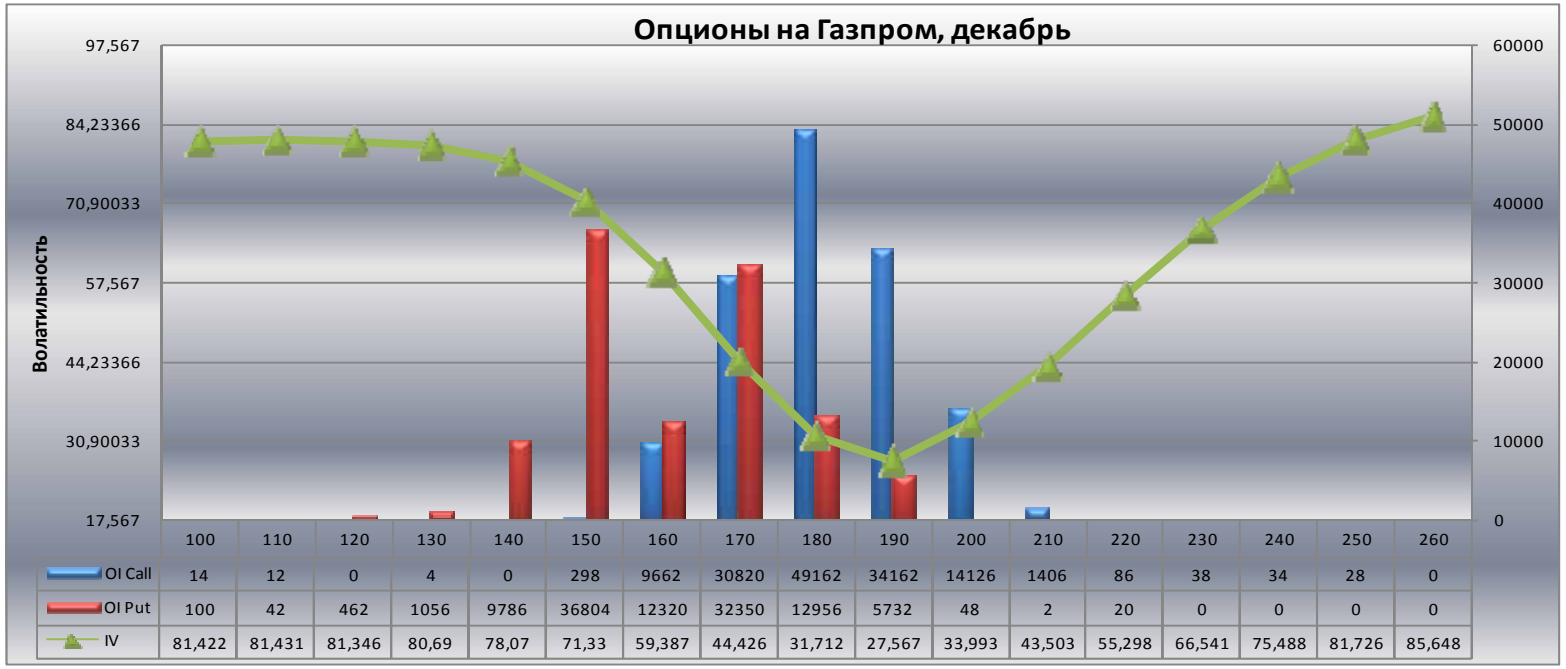
Опционы на Сбербанк, декабрь



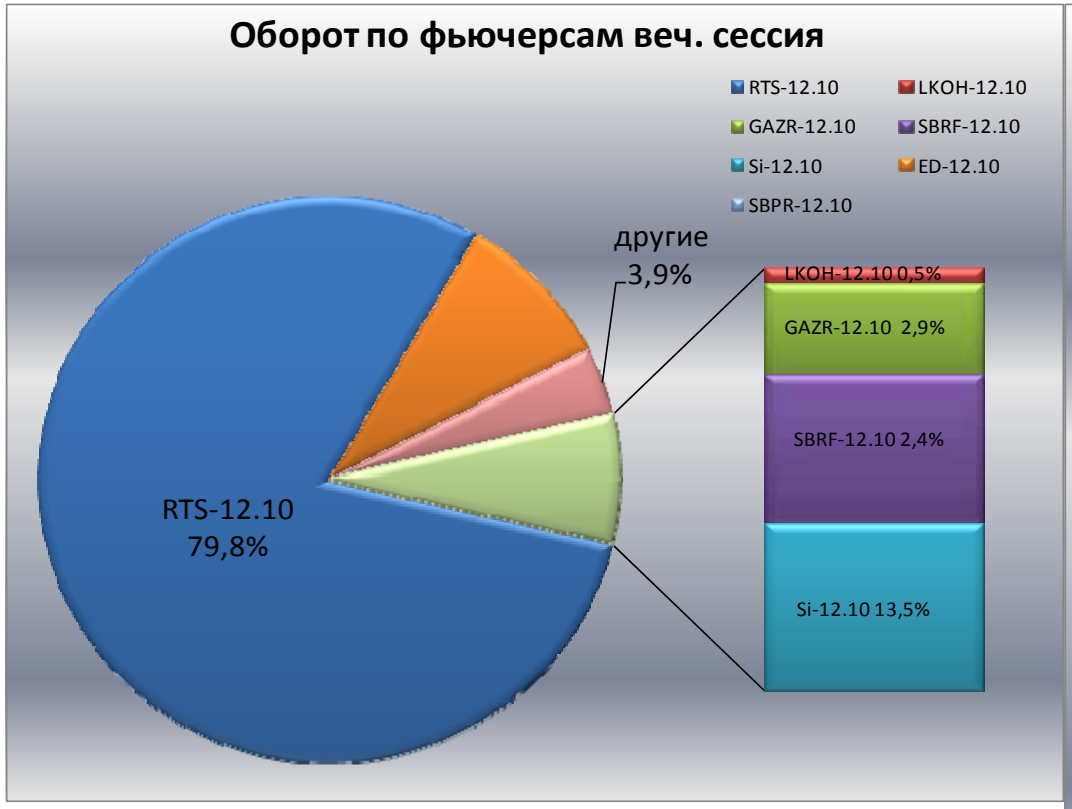
	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500	10750	11000	11250	11500	11750
OI Call	100	0	0	2	232	4754	6588	6420	10360	5474	10152	11260	16236	15056	13230	27322	16580	4164	4096	17914
OI Put	2194	172	2580	5076	15902	14450	21076	13028	268008	19244	108064	13758	18940	28200	5752	886	168	0	0	0
IV	91,077	90,561	89,779	88,531	86,546	83,532	79,272	73,725	67,107	59,891	52,735	46,344	41,34	38,154	36,947	37,571	39,629	42,59	45,932	49,226

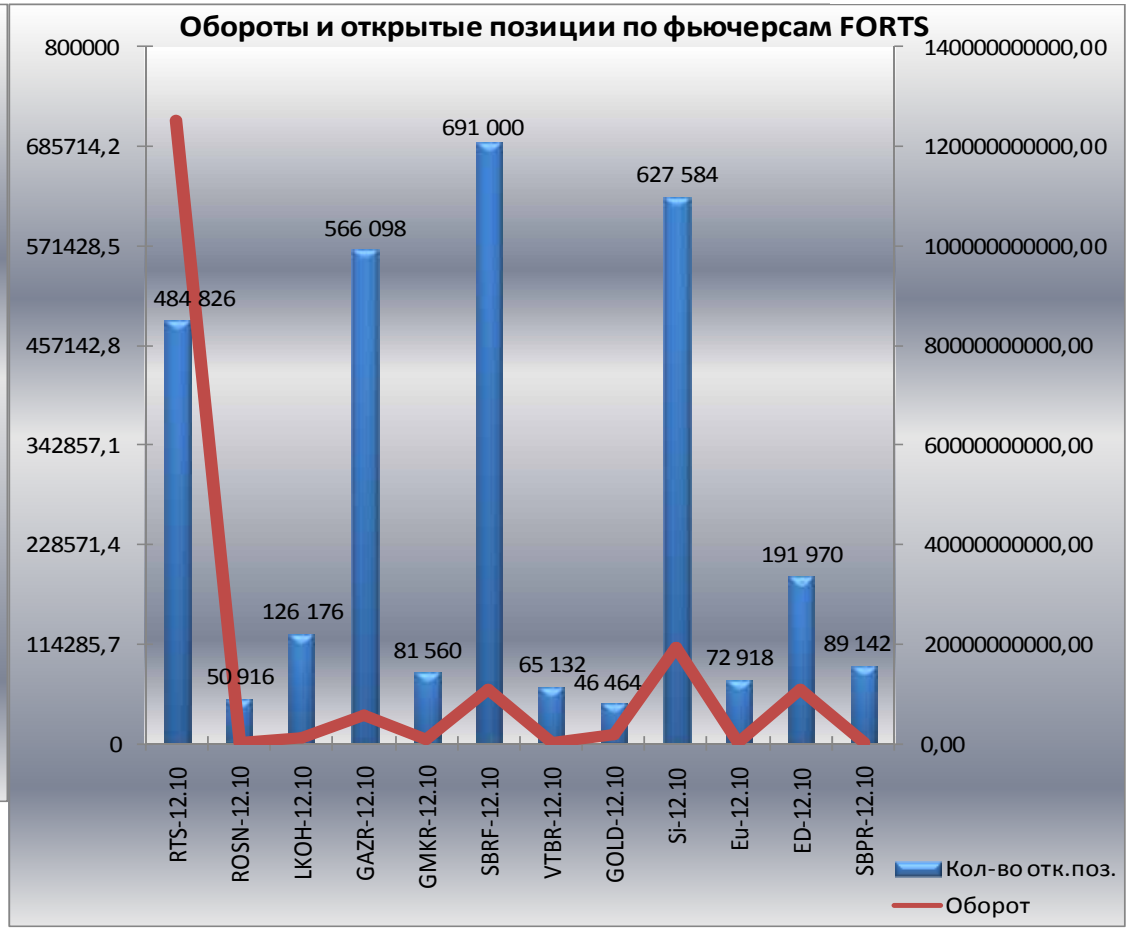


	900	1000	1100	1200	1300	1400	1500	1600	1700	1800	1900	2000	2100	2200	2300	2400	2500	
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	82	3560	17552	6012	650	30	260	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	22	206	2930	23604	13838	18	4	0	0	0	0	0	0
IV	125,323	124,111	119,993	110,379	94,056	73,073	52,361	37,011	27,868	27,294	36,992	50,829	65,403	78,599	89,405	97,613	103,493	107,508



	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260
OI Call	14	12	0	4	0	298	9662	30820	49162	34162	14126	1406	86	38	34	28	0
OI Put	100	42	462	1056	9786	36804	12320	32350	12956	5732	48	2	20	0	0	0	0
IV	81,422	81,431	81,346	80,69	78,07	71,33	59,387	44,426	31,712	27,567	33,993	43,503	55,298	66,541	75,488	81,726	85,648


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%
RTS-12.10
79,8%
LKOH-12.10 0,5%
GAZR-12.10 2,9%
SBRF-12.10 2,4%
Si-12.10 13,5%


Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
800000
685714,2
571428,5
457142,8
342857,1
228571,4
114285,7
0
140000000000,00
120000000000,00
100000000000,00
80000000000,00
60000000000,00
40000000000,00
20000000000,00
0,00
484 826
50 916
126 176
566 098
81 560
691 000
65 132
46 464
627 584
72 918
191 970
89 142
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