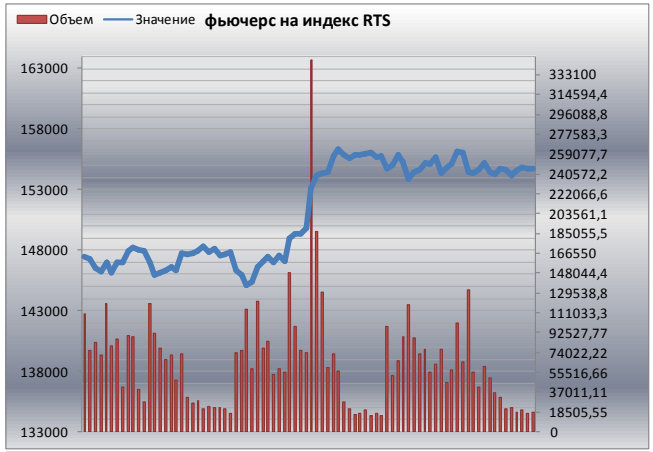
«Боковик»: сдержанно-оптимистичные настроения на рынках

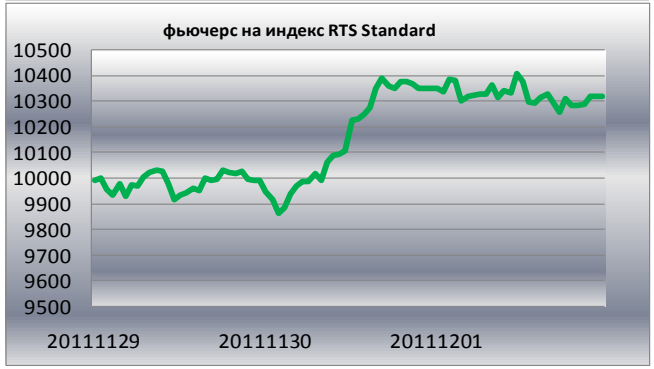
Президент Франции Н. Саркози сообщил, что в понедельник, 5 декабря, он намерен представить совместные с канцлером Германии предложения по модификации Лиссабонского соглашения. Также стали известны результаты размещения еврооблигаций Франции и Испании: для Испании доходность по бумагам превысила 5%, размещение Франции было заявлено на 4,65 млрд. евро, а размещено было - на 4,35 млрд. евро, доходность десятилетних бумаг снизилась до 3,18% против 3,22% неделей ранее.

Цена на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составила $109,39 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1748 за тройскую унцию. Доллар подешевел на 56,62 копейки, закрывшись на отметке 30,7885 руб.

К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1505,27 пункта, изменившись на +0,38%, РТС остановился на уровне 1546,70 пункта (+0,38%).

Акции "АвтоВАЗа" и "КАМАЗа" показали рост на фоне информации о существенном приращении прибыли группы "КАМАЗ" в начале IV кв., а также на фоне запуска производства новой ВАЗовской модели LADA Granta. Также резко подросли акции Газпрома на фоне заявлений Гюнтера, также ведутся переговоры с Турцией о поставках газа.





	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-12.11	154755	1547,55	0,10	888 620	-1,23%	28 027 336 393	17,99%
ROSN-12.11	22411	224,11	0,69	104 422	0,06%	24 642 096	8,70%
LKOH-12.11	17000	1700,00	-0,46	183 492	0,13%	100 183 642	5,42%
GAZR-12.11	18256	182,56	0,37	367 760	0,30%	422 671 873	5,28%
GMKR-12.11	55101	5510,10	-0,07	124 524	-0,05%	12 317 391	2,11%
SBRF-12.11	8832	88,32	0,42	1 041 970	0,87%	690 180 694	5,74%
VTBR-12.11	6921	0,0692	0,67	213 306	-0,59%	19 686 820	5,61%
GOLD-12.11	1747	1746,8000	-0,09	82 974	0,78%	381 901 374	31,06%
Si-12.11	30822	30,82	0,06	1 332 674	0,19%	1 241 305 099	4,41%
Eu-12.11	41505	41,51	-0,10	68 928	0,55%	17 555 355	18,00%
ED-12.11	1,35	1,35	-0,03	87 234	-2,20%	1 878 621 954	21,08%
SBPR-12.11	6825	68,25	0,26	60 964	0,63%	2 425 671	2,57%
RTSS-12.11	10320	10320,00	0,09	45 964	0,00%	8 867 720	1,98%
BR-12.11	109	109,02	-0,86	34 658	12,26%	334 518 868	29,67%

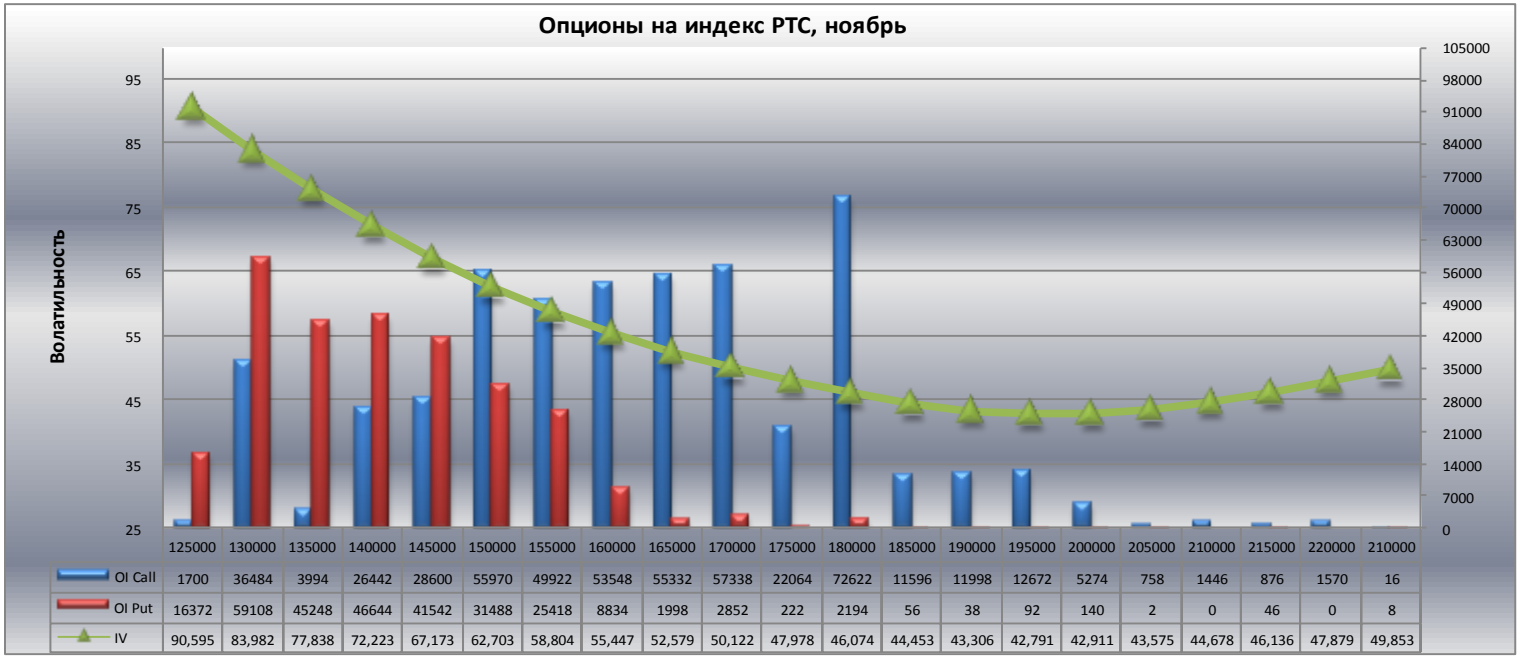
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58143,42	2,23%	00:12:30
CAC 40	3129,95	-0,78%	19:35:18
DAX 30	6035,88	-0,87%	19:35:31
DJ Industrial	12020,03	-0,21%	00:42:54
FTSE 100	5489,34	-0,29%	19:35:22
Hang Seng	18931,25	-0,37%	10:19:17
Nikkei 225	8618,36	0,24%	09:00:03
S&P 500	1244,58	-0,19%	00:02:19
Brent	109,39	0,37%	01:09:18
Gold	1748	0,47%	10:19:18
Palladium	634,05	0,61%	10:19:25
Platinum	1556	-0,08%	10:18:11
RTSI	1 547,85	0,06%	23:50:00
RTS_Standard	10 291,75	0,02%	23:50:00
RTSI_DEREX	1537,08	0,68%	18:45:00

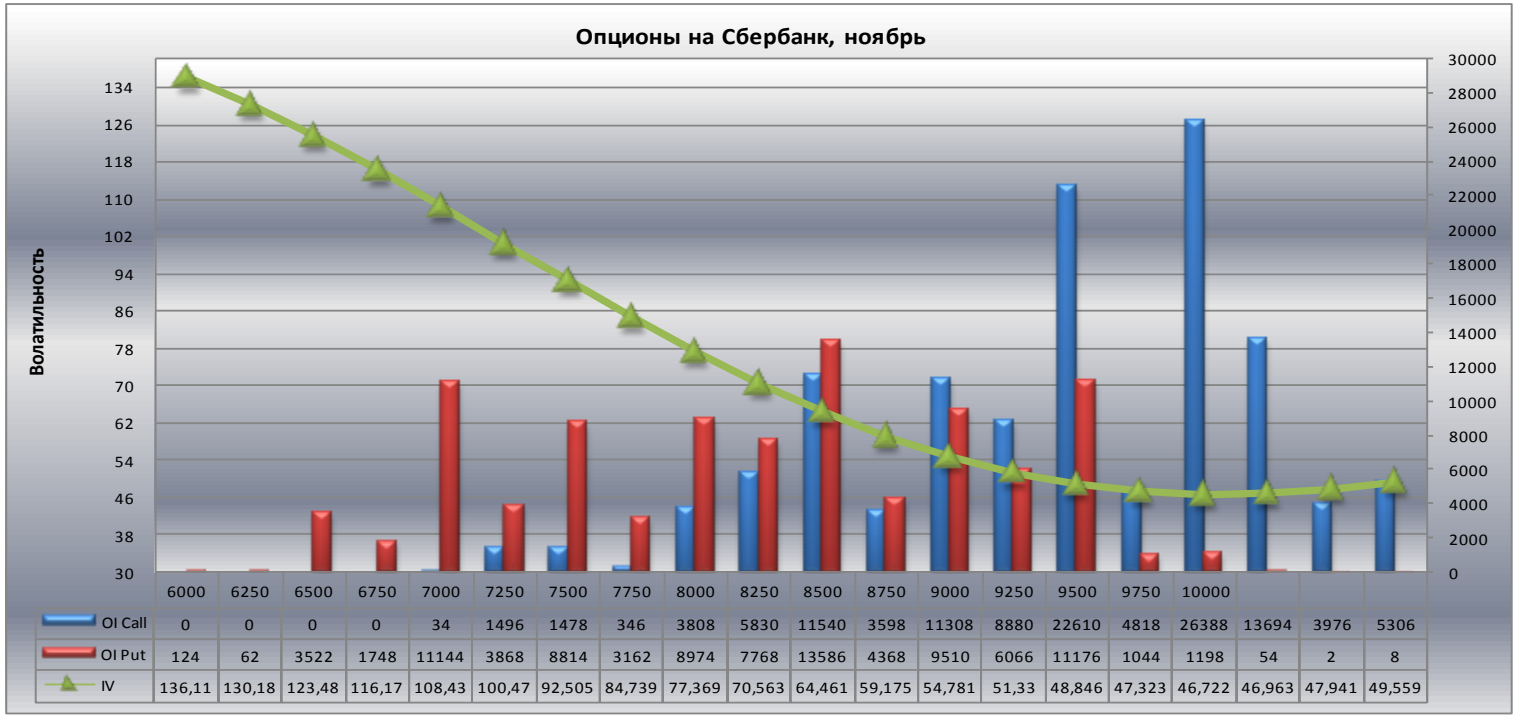
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,1	888620	28027336393,35	154755
ROSN-12.11	0,69	104422	24642096,00	22411
LKOH-12.11	-0,46	183492	100183642,00	17000
GAZR-12.11	0,37	367760	422671873,00	18256
GMKR-12.11	-0,07	124524	12317391,00	55101
SBRF-12.11	0,42	1041970	690180694,00	8832
VTBR-12.11	0,67	213306	19686820,00	6921
GOLD-12.11	-0,09	82974	381901374,29	1746,8
Si-12.11	0,06	1332674	1241305099,00	30822
Eu-12.11	-0,1	68928	17555355,00	41505
ED-12.11	-0,03	87234	1878621953,90	1,3477
SBPR-12.11	0,26	60964	2425671,00	6825
RTSS-12.11	0,09	45964	8867720,00	10320
BR-12.11	-0,86	34 658	334518867,66	109,02

Дневная сессия

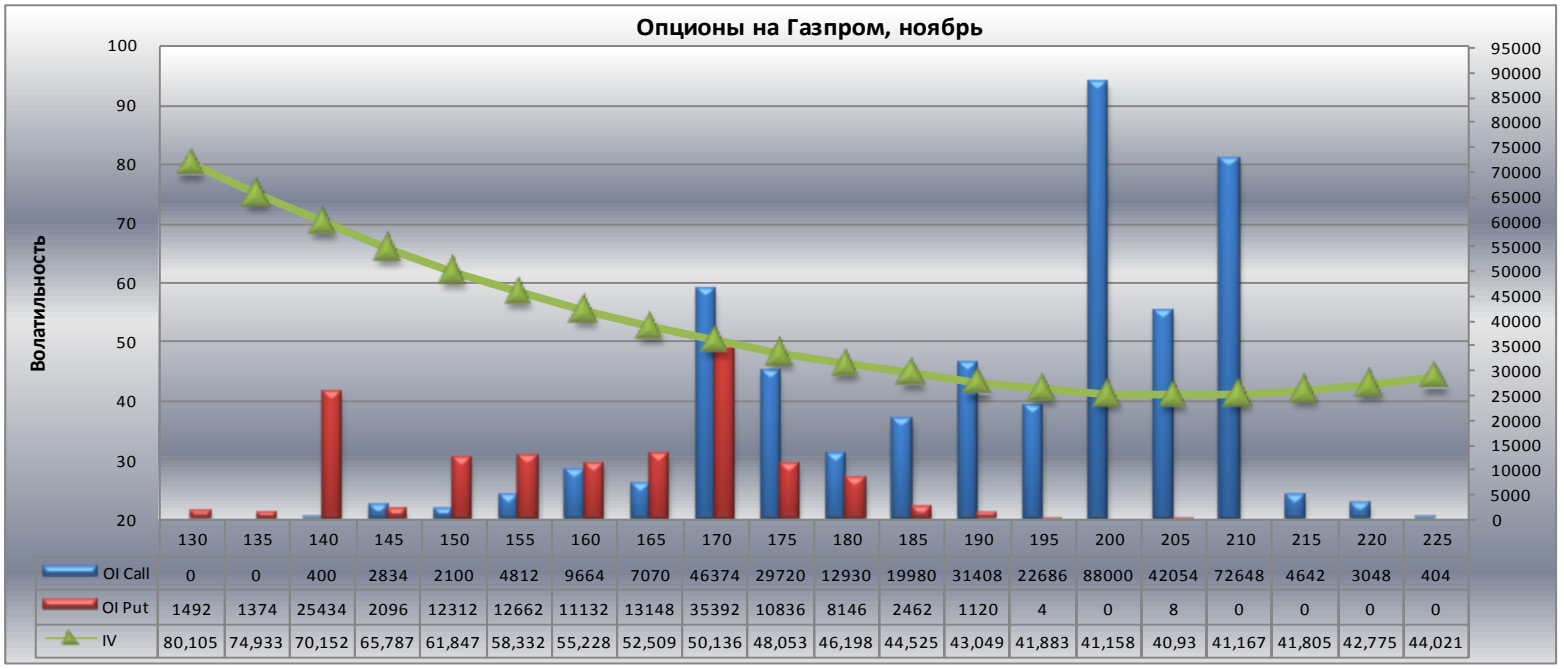
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,09	899662	1,55818E+11	154600
ROSN-12.11	-0,82	104356	283112423	22263
LKOH-12.11	-1,1	183248	1846892674	17079
GAZR-12.11	3,39	366652	8005704127	18190
GMKR-12.11	1,26	124584	583946142	55142
SBRF-12.11	0,17	1033010	12019247333	8796
VTBR-12.11	1,31	214578	350773524	6875
GOLD-12.11	-0,16	82334	1229554274	1748,4
Si-12.11	0,08	1330114	28120699607	30804
Eu-12.11	0,06	68548	97544896	41548
ED-12.11	-0,05	89196	8913311370	1,3481
SBPR-12.11	0,53	60584	94336182	6807
RTSS-12.11	0,38	45964	447321260	10314
BR-12.11	-1,61	30872	1127411165	109,97


Опционы на индекс РТС, ноябрь
Волатильность
95
85
75
65
55
45
35
25
105000
98000
91000
84000
77000
70000
63000
56000
49000
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 210000
OI Call 1700 36484 3994 26442 28600 55970 49922 53548 55332 57338 22064 72622 11596 11998 12672 5274 758 1446 876 1570 16
OI Put 16372 59108 45248 46644 41542 31488 25418 8834 1998 2852 222 2194 56 38 92 140 2 0 46 0 8
IV 90,595 83,982 77,838 72,223 67,173 62,703 58,804 55,447 52,579 50,122 47,978 46,074 44,453 43,306 42,791 42,911 43,575 44,678 46,136 47,879 49,853

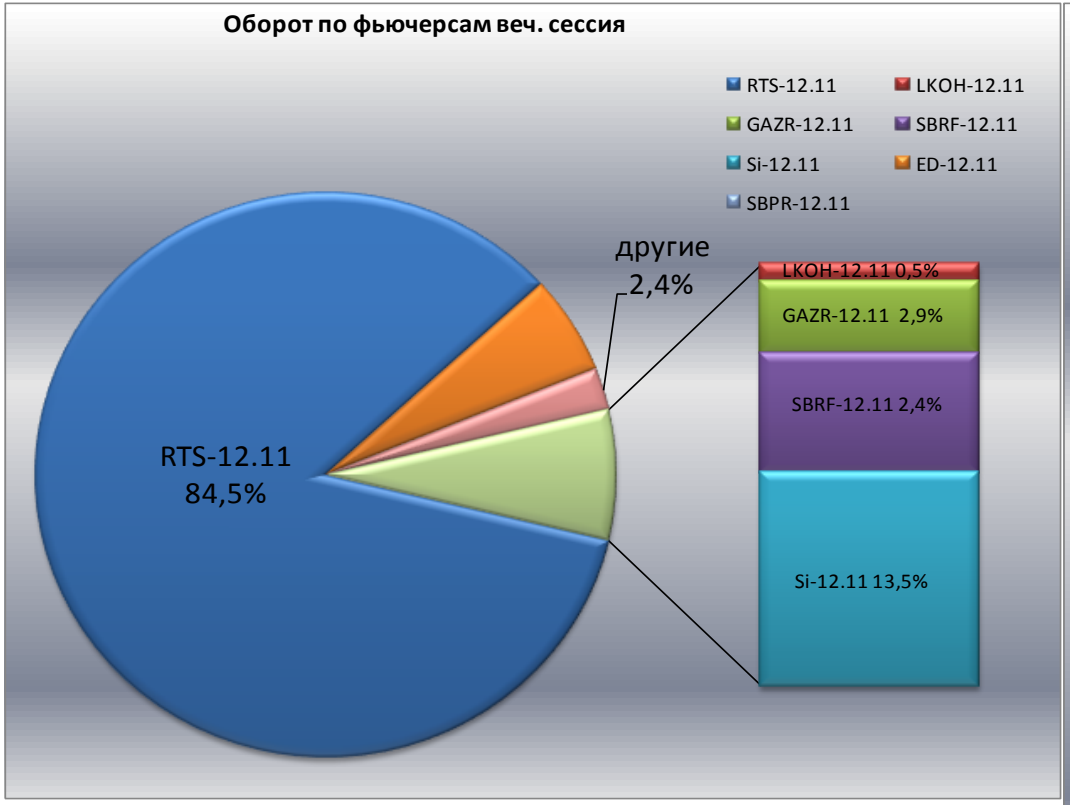

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
134
126
118
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
30000
28000
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 34 1496 1478 346 3808 5830 11540 3598 11308 8880 22610 4818 26388 13694 3976 5306
OI Put 124 62 3522 1748 11144 3868 8814 3162 8974 7768 13586 4368 9510 6066 11176 1044 1198 54 2 8
IV 136,11 130,18 123,48 116,17 108,43 100,47 92,505 84,739 77,369 70,563 64,461 59,175 54,781 51,33 48,846 47,323 46,722 46,963 47,941 49,559

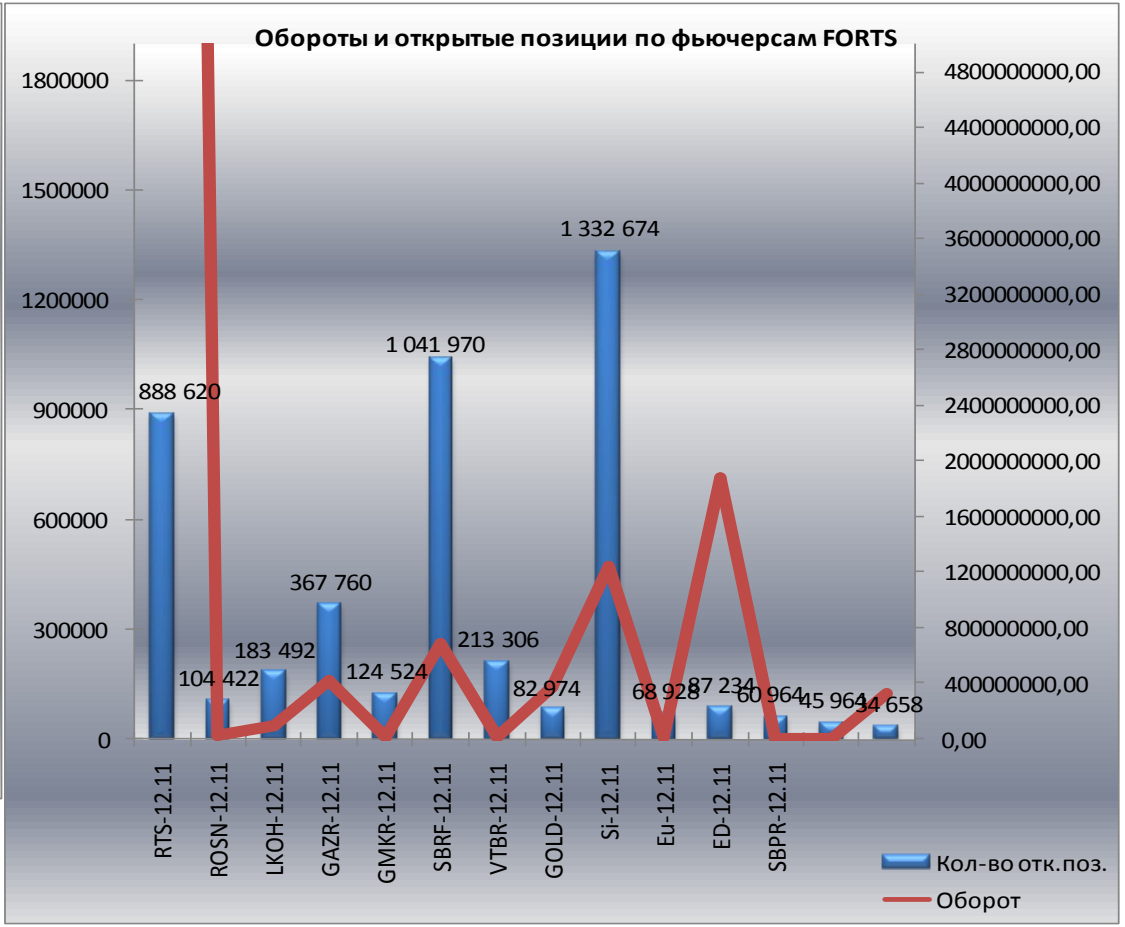


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1330	1872	1354
OI Put	0	0	0	0	12	0	100	566	1280	824	2876	1338	1454
IV	0	78,907	73,168	67,936	63,236	59,078	55,451	52,321	49,636	47,316	45,273	43,454	41,935



	130	135	140	145	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215	220	225
OI Call	0	0	400	2834	2100	4812	9664	7070	46374	29720	12930	19980	31408	22686	88000	42054	72648	4642	3048	404
OI Put	1492	1374	25434	2096	12312	12662	11132	13148	35392	10836	8146	2462	1120	4	0	8	0	0	0	0
IV	80,105	74,933	70,152	65,787	61,847	58,332	55,228	52,509	50,136	48,053	46,198	44,525	43,049	41,883	41,158	40,93	41,167	41,805	42,775	44,021


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-12.11
LKOH-12.11
GAZR-12.11
SBRF-12.11
Si-12.11
ED-12.11
SBPR-12.11
RTS-12.11
84,5%
другие
2,4%
LKOH-12.11 0,5%
GAZR-12.11 2,9%
SBRF-12.11 2,4%
Si-12.11 13,5%


Обороты и открытые позиции по фьючерсам FORTS
1800000
1500000
1200000
900000
600000
300000
0
4800000000,00
4400000000,00
4000000000,00
3600000000,00
3200000000,00
2800000000,00
2400000000,00
2000000000,00
1600000000,00
1200000000,00
800000000,00
400000000,00
0,00
888 620
104 422
183 492
367 760
124 524
1 041 970
213 306
82 974
1 332 674
68 928
87 234
60 964
45 964
34 658
RTS-12.11
ROSN-12.11
LKOH-12.11
GAZR-12.11
GMKR-12.11
SBRF-12.11
VTBR-12.11
GOLD-12.11
Si-12.11
Eu-12.11
ED-12.11
SBPR-12.11
Кол-во отк.поз.
Оборот