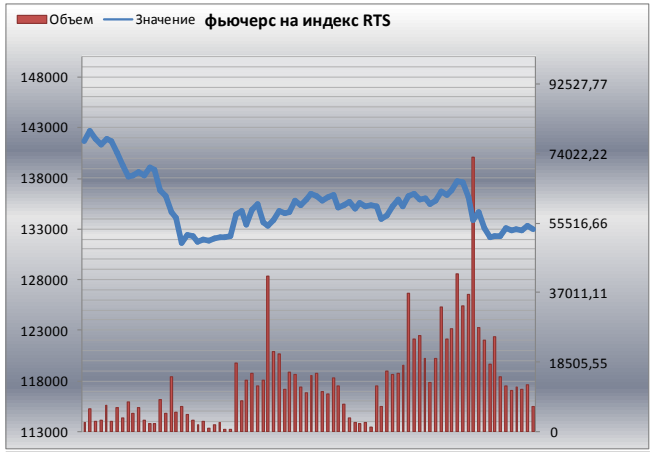
Рынки просели на фоне роста доходности бондов Италии и решения ФРС

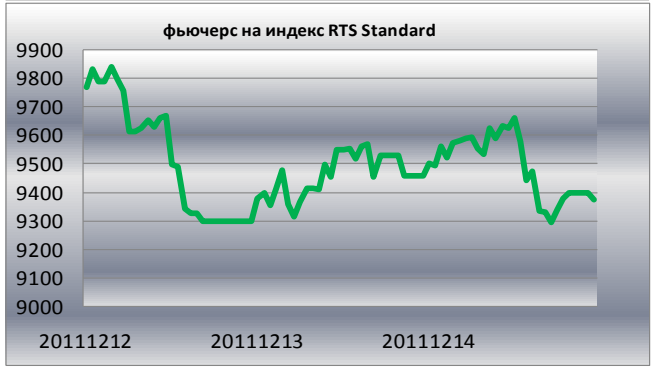
Как стало известно в минувшую среду, размещение итальянских бондов прошло не лучшим образом. Несмотря на то, что Италии удалось продать 5-летних бондов на запланированную сумму 3 млрд евро ($3,9 млрд), их доходность достигла максимальной величины с 1997 г. - 6,47%. Несколько позднее глава ФРС Бен Бернанке во время выступления перед сенаторами заявил, что ФРС не собирается предоставлять никакой помощи европейским банкам, из-за чего индексы попадали: FTSE100 -2,25%, DAX30 -1,72%, CAC40 -3,33%, DJ Industrial -1,10%, S&P500 -1,13%, Nasdaq -1,55%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $107,06 за баррель. Золото же составило $1657,69 за тройскую унцию.

Российский рынок также чувствует себя слабо: ММВБ -0,45% (1372,42 пунктов), РТС -1,26% (1369,65 пунктов).

Лучше рынка себя чувствовали акции компаний ИнтерРАО(+3,69%), ФСК ЕЭС(+5,30%), ОГК-3(+5,30%), ТГК-9(+23,50%), Новатэк(+2,23%).





	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	132950	1329,50	-1,23	468 796	-30,64%	14 546 079 627	7,87%
ROSN-12.11	20345	203,45	-1,36	8 982	-26,91%	25 009 236	7,51%
LKOH-12.11	16236	1623,60	-0,22	61 886	5,24%	135 029 196	11,73%
GAZR-12.11	16539	165,39	-1,34	290 328	2,61%	439 053 962	8,85%
GMKR-12.11	49599	4959,90	-0,68	8 298	2,17%	12 451 292	3,29%
SBRF-12.11	5996	59,96	-1,70	17 776	-97,30%	1 629 114	0,02%
VTBR-12.11	6100	0,0610	-1,55	135 752	6,35%	51 763 130	12,99%
GOLD-12.11	1585	1584,6000	-2,45	59 268	15,42%	783 736 780	24,84%
Si-12.11	32349	32,35	0,23	992 480	93,63%	1 162 046 341	4,93%
Eu-12.11	42122	42,12	0,31	30 590	25,30%	18 315 063	4,10%
ED-12.11	1,30	1,30	-0,03	55 388	-5,67%	902 725 357	10,35%
SBPR-12.11	9375	93,75	-1,04	8 368	-52,23%	9 754 220	13,93%
RTSS-12.11	9382	9382,00	0,00	32 256	0,01%	690 060 555	99,32%
BR-12.11	105	104,75	-2,20	15 652	0,37%	475 685 126	41,06%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56646,87	-1,48%	00:12:30
CAC 40	2976,17	-3,33%	
DAX 30	5675,14	-1,72%	19:35:31
DJ Industrial	11823,48	-1,10%	00:42:54
FTSE 100	5366,8	-2,25%	19:35:22
Hang Seng	17928,92	-2,32%	10:19:17
Nikkei 225	8380,13	-1,63%	09:00:03
S&P 500	1211,82	-1,14%	00:02:19
Brent	105,08	0,80%	01:09:18
Gold	1571,33	-0,98%	10:19:18
Palladium	615,5	-0,66%	10:19:25
Platinum	1385,27	-2,88%	10:18:11
RTSI	1 352,59	-1,25%	23:50:00
RTS_Standard	9 234,49	-1,41%	23:50:00
RTSI_DEREX	1356,43	-0,90%	18:45:00

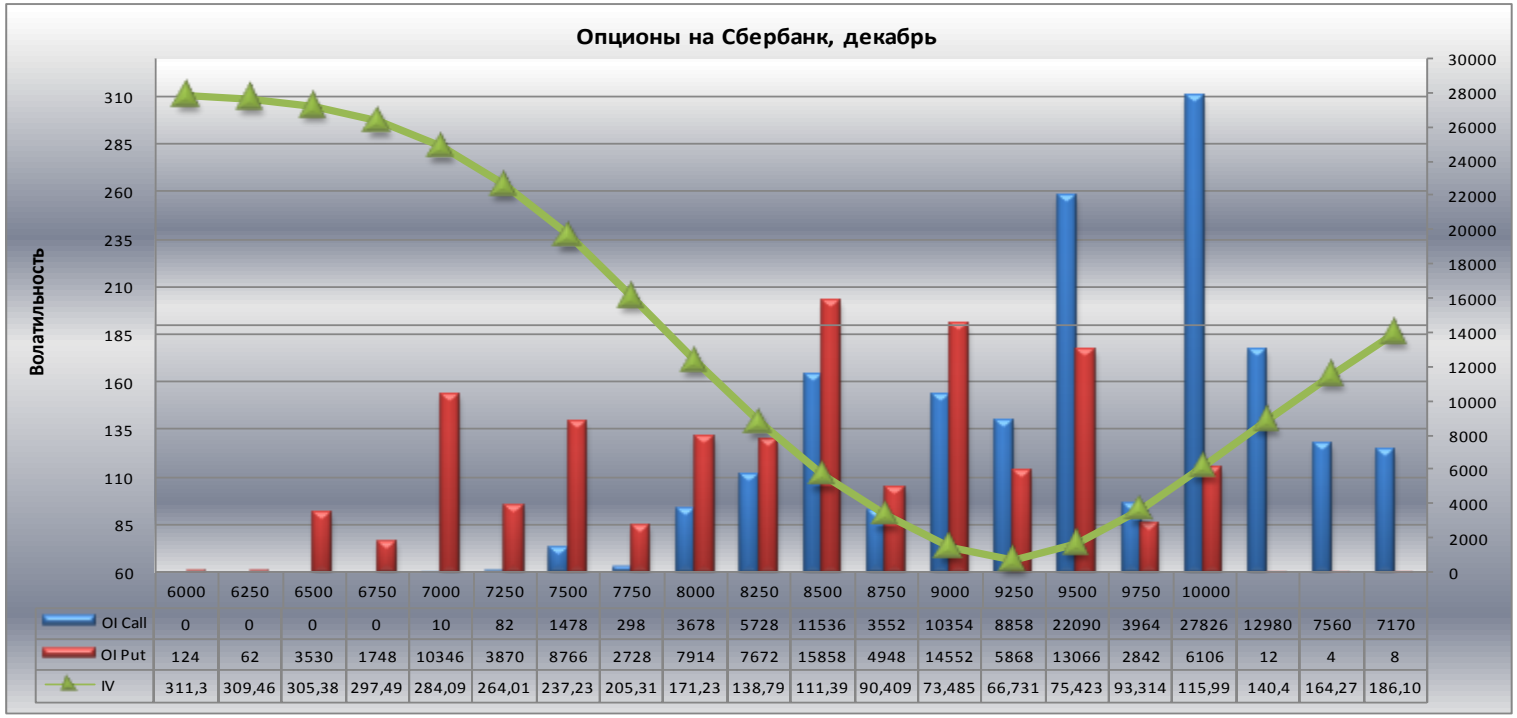
Вечерняя сессия

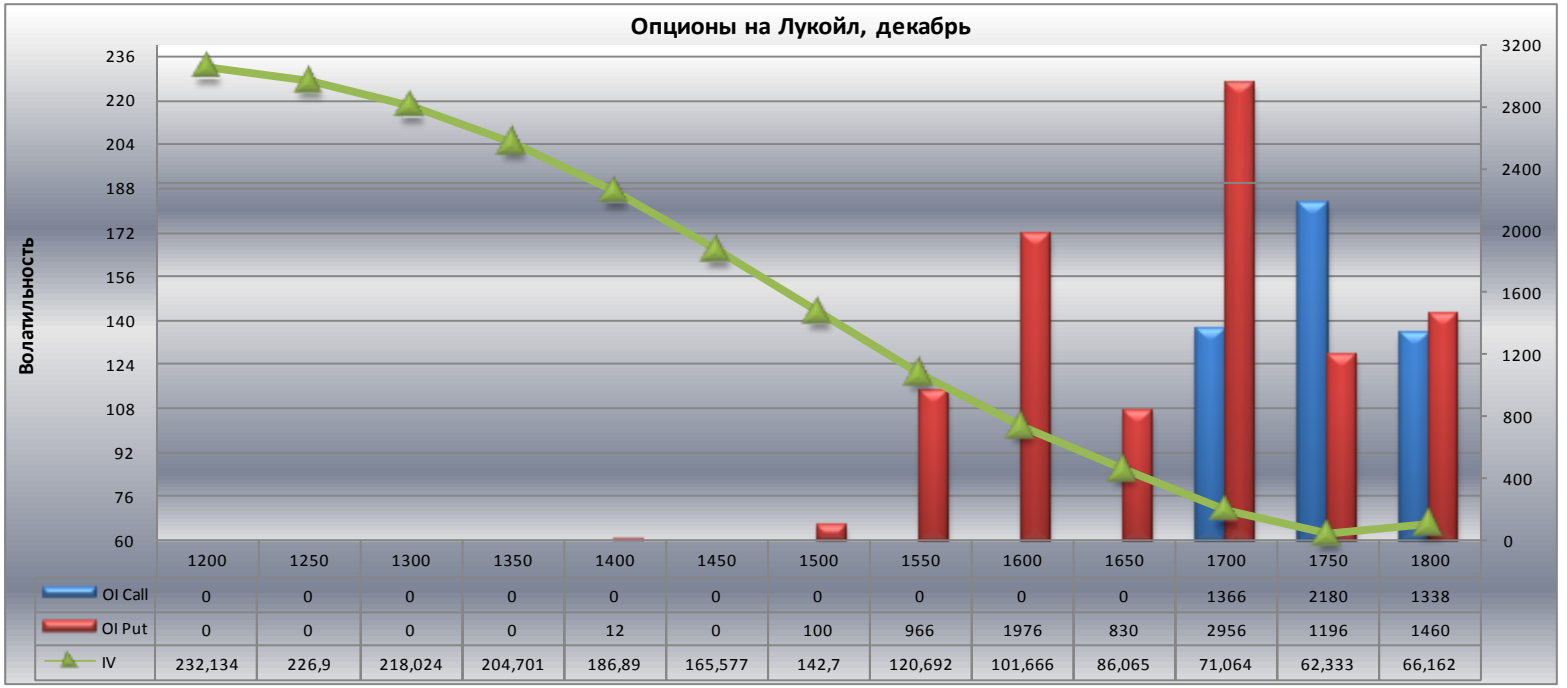
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,23	468796	14546079627,41	132950
ROSN-12.11	-1,36	8982	25009236,00	20345
LKOH-12.11	-0,22	61886	135029196,00	16236
GAZR-12.11	-1,34	290328	439053962,00	16539
GMKR-12.11	-0,68	8298	12451292,00	49599
SBRF-12.11	-1,7	17776	1629114,00	5996
VTBR-12.11	-1,55	135752	51763130,00	6100
GOLD-12.11	-2,45	59268	783736780,17	1584,6
Si-12.11	0,23	992480	1162046341,00	32349
Eu-12.11	0,31	30590	18315063,00	42122
ED-12.11	-0,03	55388	902725357,42	1,3007
SBPR-12.11	-1,04	8368	9754220,00	9375
RTSS-12.11	-0,48%	32 256	690060555,00	9 382
BR-12.11	-2,2	15 652	475685126,07	104,75

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,91	675908	1,84787E+11	136770
ROSN-12.11	-1,62	12 289	333005510	20440
LKOH-12.11	-0,68	58 804	1151495082	16089
GAZR-12.11	-0,85	282 946	4958782599	16517
GMKR-12.11	-0,47	8 122	378081317	49779
SBRF-12.11	-1,86	657 896	7376636758	8133
VTBR-12.11	-1,13	127 646	398468128	6127
GOLD-12.11	-3,31	51352	3155356834	1614,3
Si-12.11	0,59	512560	23582170503	31819
Eu-12.11	-0,96	24414	446189170	41330
ED-12.11	-1,55	58720	8722324423	1,299
SBPR-12.11	-1,38	17 516	70011592	6016
RTSS-12.11	-0,63	32254	694757335	9382
BR-12.11	-1,7	15594	1158610867	107,13


Опционы на индекс РТС, декабрь
Волатильность
215
199
183
167
151
135
119
103
87
71
55
105000
98000
91000
84000
77000
70000
63000
56000
49000
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
115000 120000 125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 210000
OI Call 56 1424 1834 37402 11556 46322 63620 76446 58508 63556 52020 58842 20942 78574 11740 11692 12588 5100 756 1444 16
OI Put 16822 103148 28458 60686 56408 43008 42836 29328 25922 8480 1950 2840 216 2190 58 38 86 142 2 0 8
IV 214,09 213,42 211,05 204,74 191,61 169,69 140 107,48 79,745 65,03 74,681 90,524 112,84 139,01 164,64 186,70 203,91 216,29 224,61 229,89 233,07

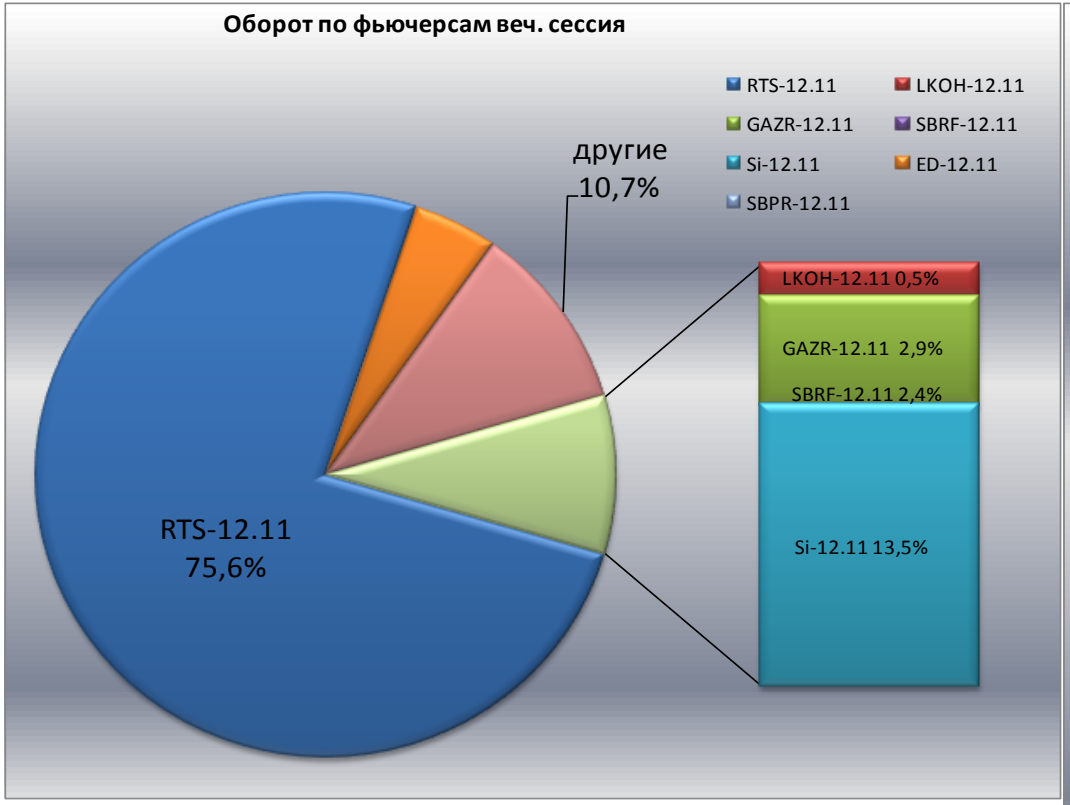

Опционы на Сбербанк, декабрь
Волатильность
310
285
260
235
210
185
160
135
110
85
60
30000
28000
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 10 82 1478 298 3678 5728 11536 3552 10354 8858 22090 3964 27826 12980 7560 7170
OI Put 124 62 3530 1748 10346 3870 8766 2728 7914 7672 15858 4948 14552 5868 13066 2842 6106 12 4 8
IV 311,3 309,46 305,38 297,49 284,09 264,01 237,23 205,31 171,23 138,79 111,39 90,409 73,485 66,731 75,423 93,314 115,99 140,4 164,27 186,10

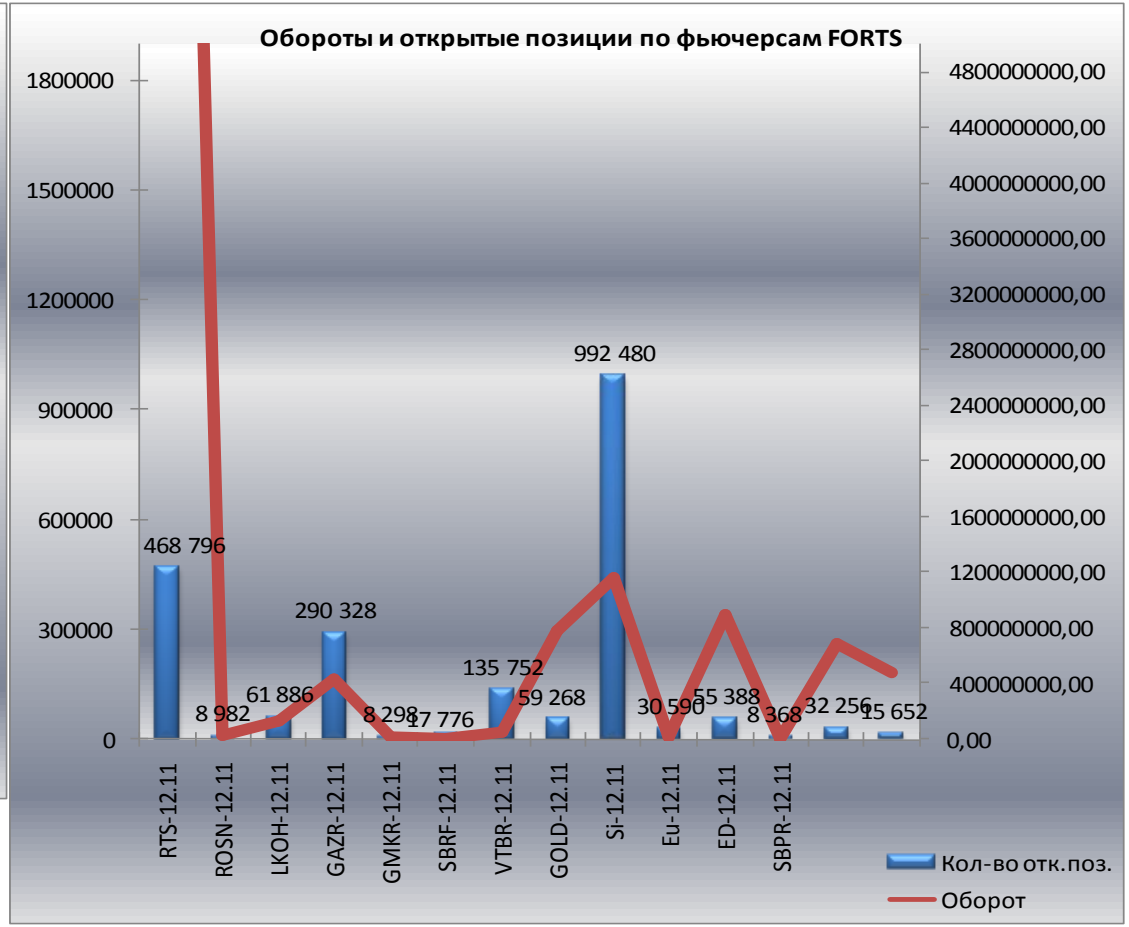


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1366	2180	1338
OI Put	0	0	0	0	12	0	100	966	1976	830	2956	1196	1460
IV	232,134	226,9	218,024	204,701	186,89	165,577	142,7	120,692	101,666	86,065	71,064	62,333	66,162



	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	10	2070	4786	3610	6368	48742	28028	14330	21324	30104	21952	95070	42168	73926	4512	3060	404
OI Put	1488	1368	19866	2092	12302	14492	10764	12854	32524	11528	9608	3534	1082	4	0	8	0	0	0	0
IV	229,87	215,87	192,84	161,91	128,08	98,234	76,265	66,036	75,672	97,331	122,78	146,43	165,41	179,06	187,99	193,39	196,41	197,98	198,73	199,06


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
другие
10,7%
RTS-12.11
75,6%
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
468 796
8 982
61 886
290 328
8 298
17 776
135 752
59 268
992 480
30 590
55 388
8 368
32 256
15 652
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