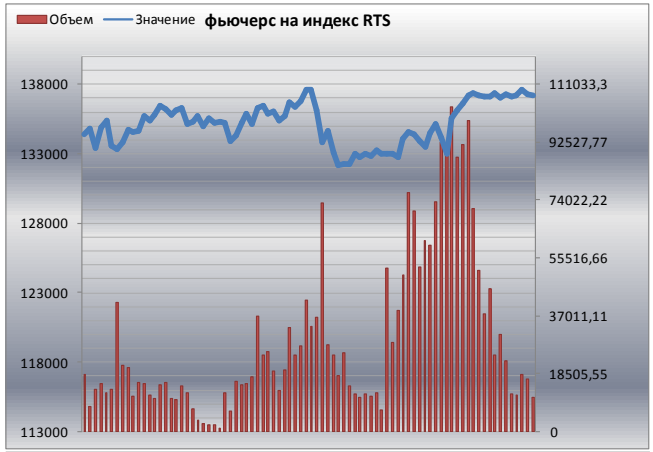
Российский рынок начал восстанавливать свои позиции

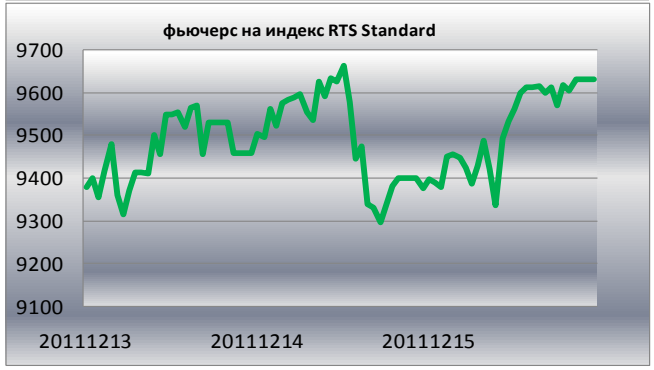
Конгресс США одобрил в четверг промежуточный бюджет, позволяющий финансировать правительство до конца 2012 финансового года. Принятие промежуточного бюджета, позволит продолжить финансирование американского правительства, государственных программ и военных расходов до октября 2012 г. Что касается еврозоны, Кристин Лагард заявила, что кризис находится на стадии обострения, и его преодоление не может быть осуществлено посредством участия лишь одной группы стран.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $104,23 за баррель. Золото же составило $1589,22 за тройскую унцию.

Российский рынок завершил торговую сессию со следующими значениями: ММВБ +1,544% (1393,61 пунктов), РТС +0,090% (1396,57 пункта).

Акции "Газпрома" оказались в лидерах повышения на фоне информации о том, что правительство Республики Молдова планирует погасить часть исторического долга страны за потребленный российский газ, продав российской компании газопроводы среднего давления.





	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-3.12	137150	1371,50	-0,03	650 002	0,99%	20 117 225 789	15,63%
ROSN-3.12	20795	207,95	-0,92	15 692	6,52%	29 263 821	8,97%
LKOH-3.12	16505	1650,50	0,15	73 430	1,85%	60 967 023	4,68%
GAZR-3.12	17320	173,20	-0,25	303 326	0,50%	254 837 001	4,18%
GMKR-3.12	50552	5055,20	-0,78	8 998	4,12%	29 714 646	9,86%
SBRF-3.12	8344	83,44	0,46	693 742	0,16%	543 355 351	5,93%
VTBR-3.12	6270	0,0627	-0,48	142 232	2,78%	26 346 072	10,32%
GOLD-3.12	1577	1576,6000	-1,15	78 834	10,74%	490 988 308	15,35%
Si-3.12	32289	32,29	0,11	1 186 116	0,35%	1 097 726 656	4,30%
Eu-3.12	42060	42,06	-0,01	43 748	1,28%	14 794 010	2,96%
ED-3.12	1,30	1,30	-0,11	55 850	-15,57%	1 329 087 408	19,58%
SBPR-3.12	6151	61,51	0,02	18 930	-0,33%	2 135 460	3,19%
RTSS-3.12	9632	9631,50	0,19	13 930	-0,91%	14 275 345	2,67%
BR-2.12	104	104,36	0,01	2	-99,82%	33 253	0,44%

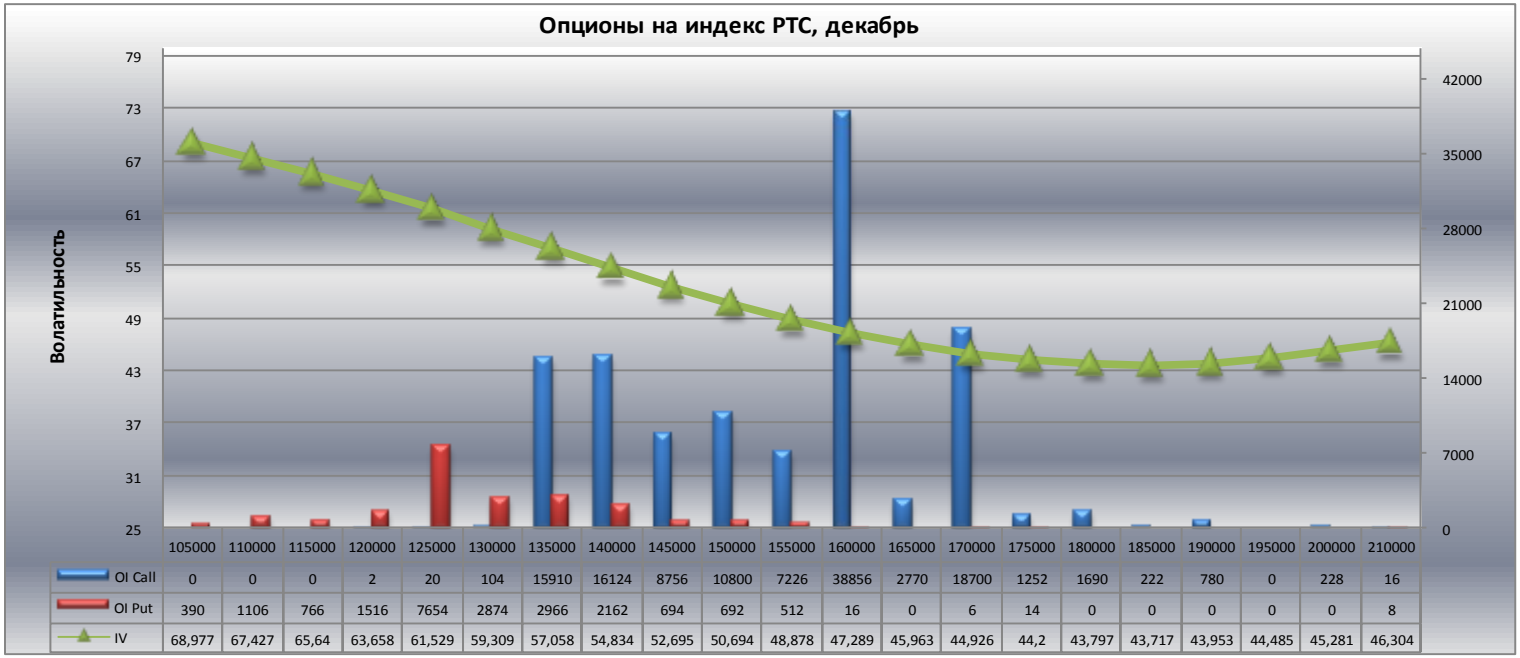
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56331,15	-0,56%	00:12:30
CAC 40	2998,73	0,76%	19:35:18
DAX 30	5730,62	0,98%	19:35:31
DJ Industrial	11868,81	0,38%	00:42:54
FTSE 100	5400,85	0,63%	19:35:22
Hang Seng	18099,2	0,40%	10:19:17
Nikkei 225	8410,32	0,39%	09:00:03
S&P 500	1215,75	0,32%	00:02:19
Brent	104,23	0,61%	01:09:18
Gold	1589,22	0,76%	10:19:18
Palladium	625,5	0,78%	10:19:25
Platinum	1418,53	0,82%	10:18:11
RTSI	1 396,57	0,09%	23:50:00
RTS_Standard	9 552,61	0,16%	23:50:00
RTSI_DEREX	1378,77	2,10%	18:45:00

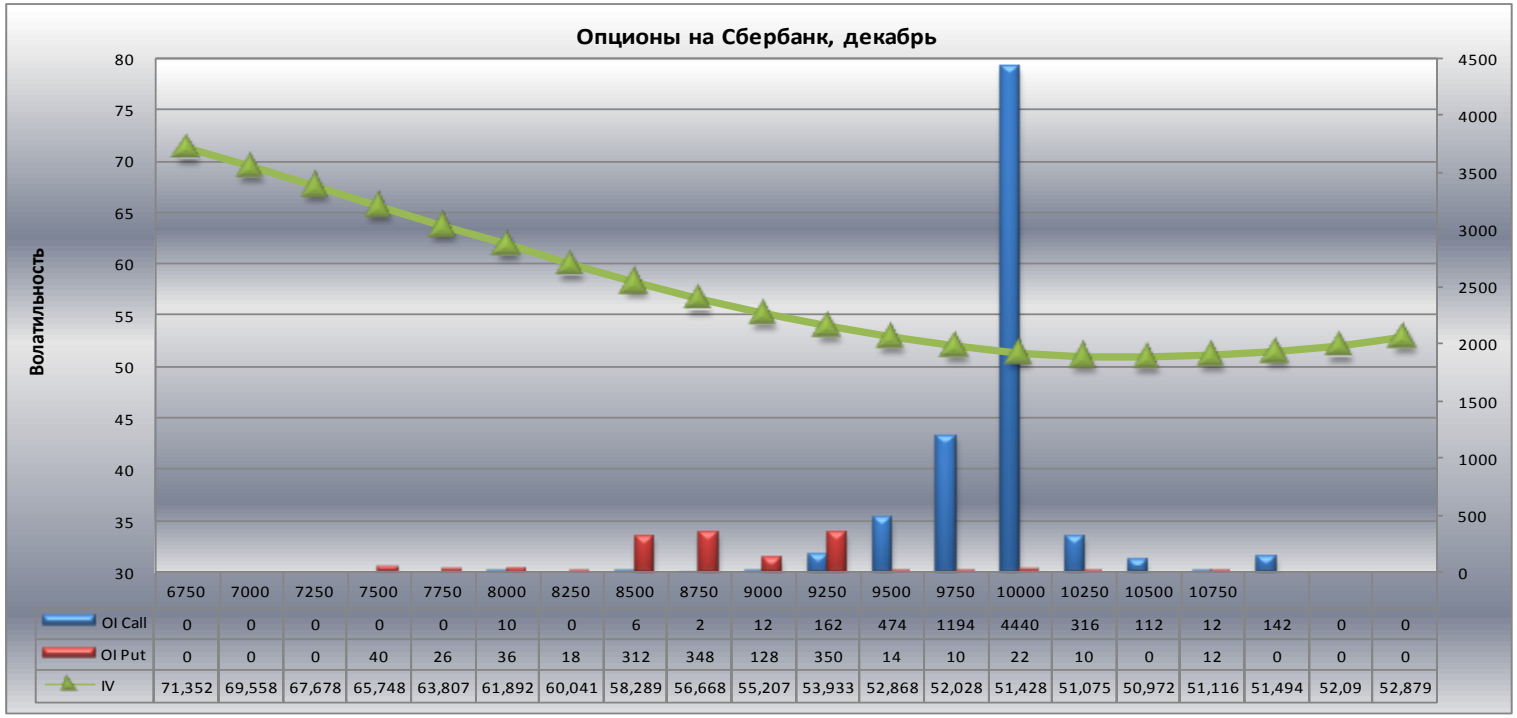
Вечерняя сессия

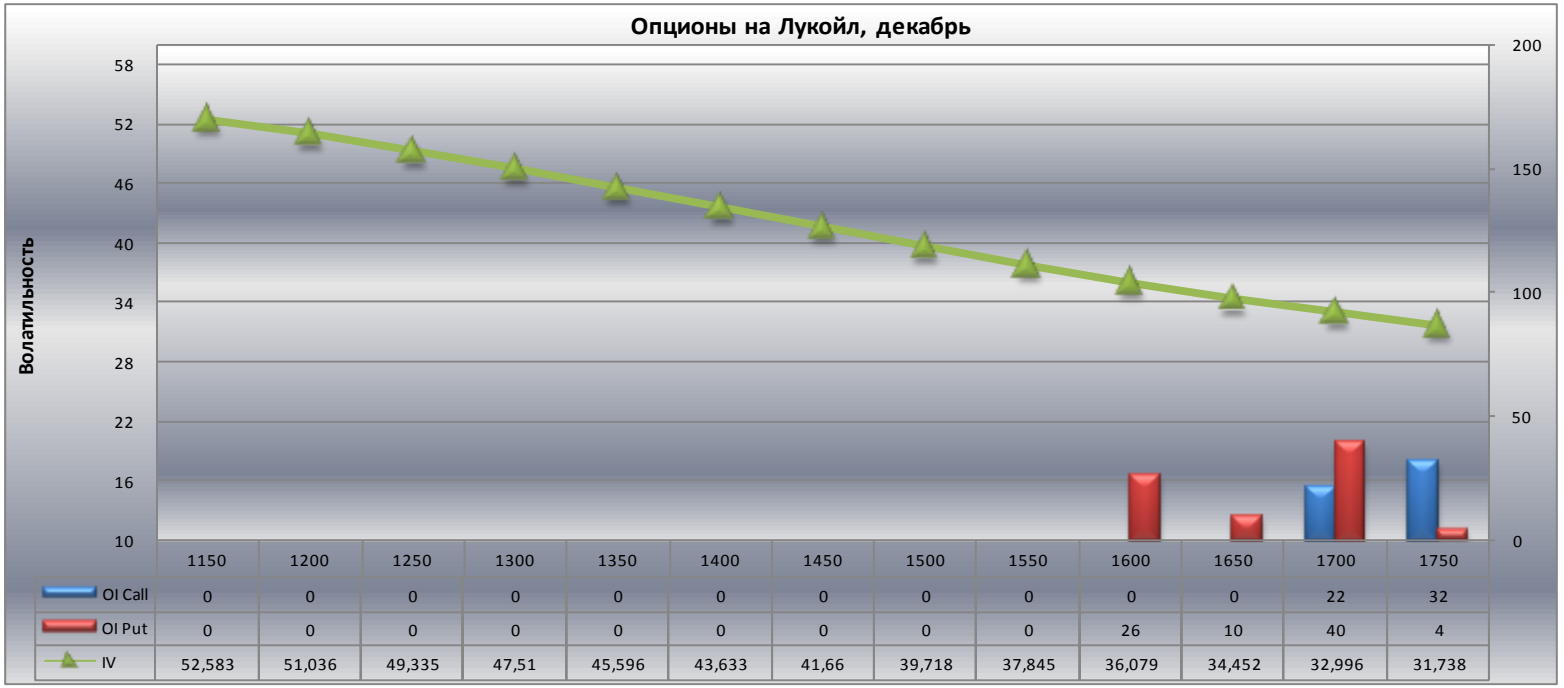
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-3.12	-0,03	650002	20117225789,49	137150
ROSN-3.12	-0,92	15692	29263821,00	20795
LKOH-3.12	0,15	73430	60967023,00	16505
GAZR-3.12	-0,25	303326	254837001,00	17320
GMKR-3.12	-0,78	8998	29714646,00	50552
SBRF-3.12	0,46	693742	543355351,00	8344
VTBR-3.12	-0,48	142232	26346072,00	6270
GOLD-3.12	-1,15	78834	490988308,38	1576,6
Si-3.12	0,11	1186116	1097726656,00	32289
Eu-3.12	-0,01	43748	14794010,00	42060
ED-3.12	-0,11	55850	1329087408,36	1,3025
SBPR-3.12	0,02	18930	2135460,00	6151
RTSS-3.12	0,19	13 930	14275345,00	9 632
BR-2.12	0,01	2	33253,37	104,36

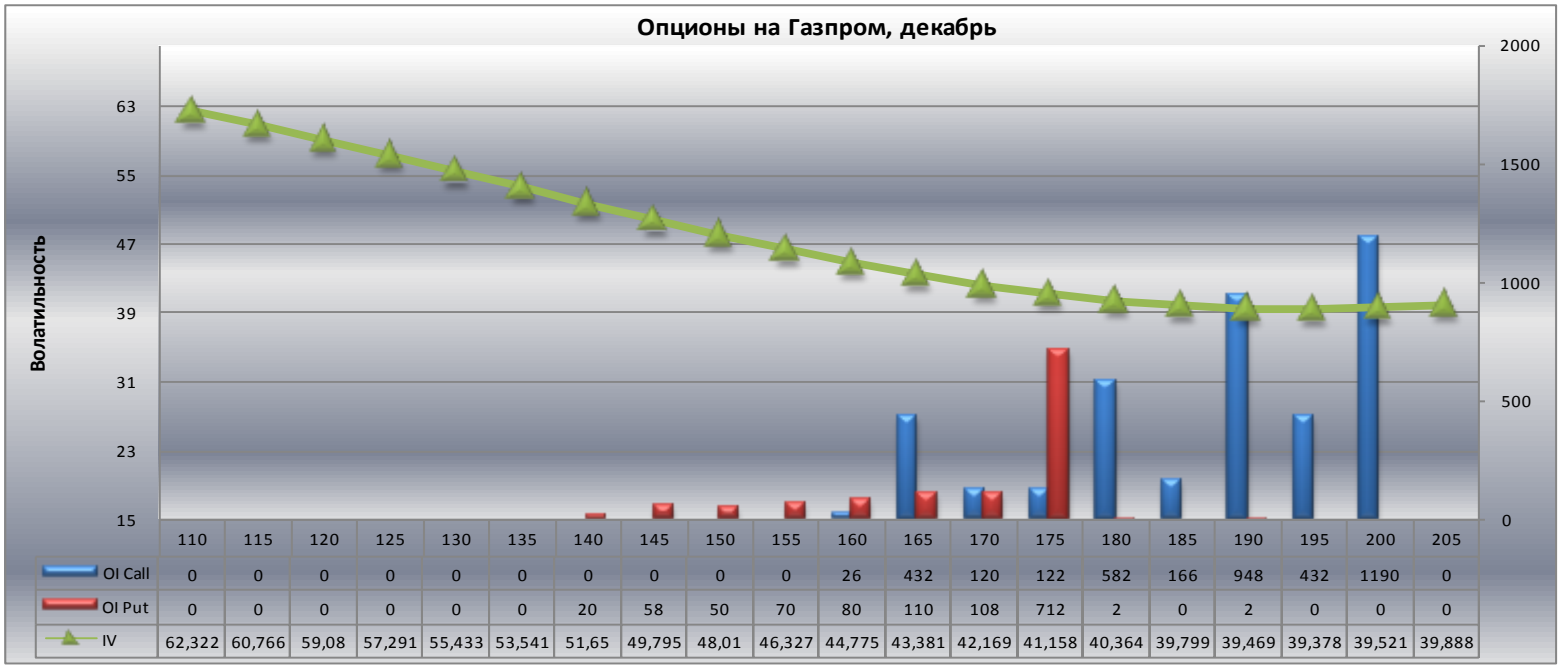
Дневная сессия

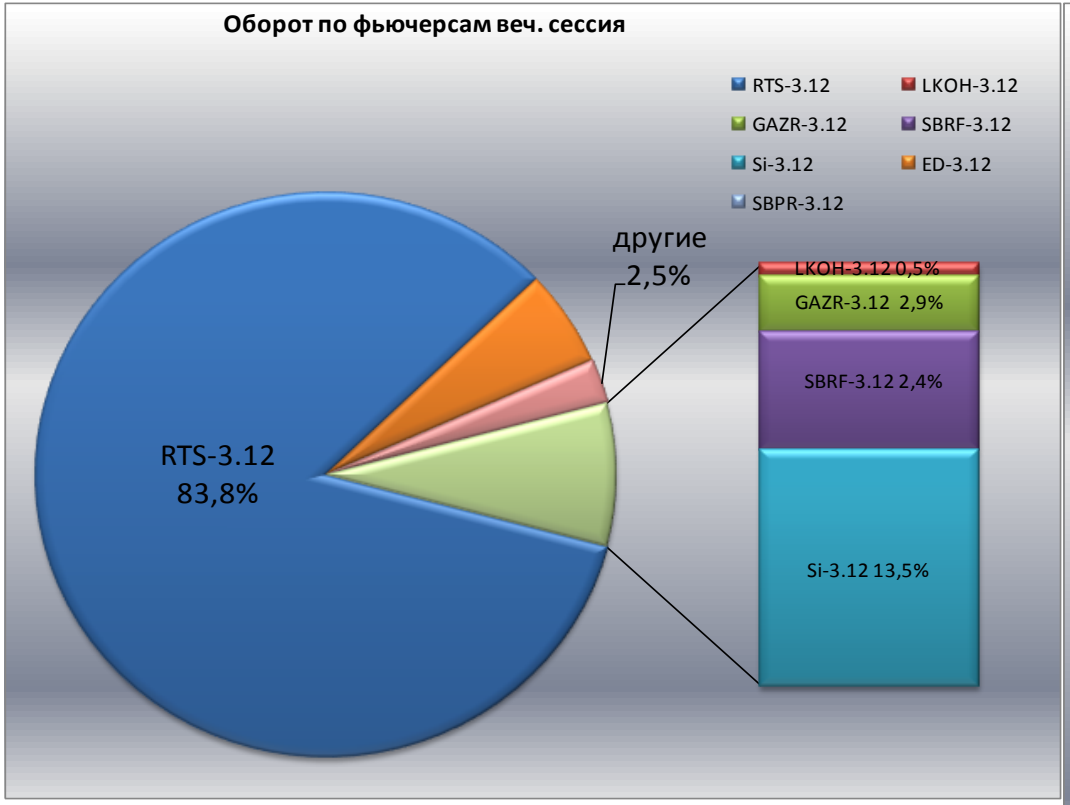
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-3.12	1,92	643616	1,28722E+11	137190
ROSN-3.12	1,62	14 732	326150442	20988
LKOH-3.12	1,28	72 094	1303207014	16481
GAZR-3.12	3,57	301 812	6100203578	17363
GMKR-3.12	1,48	8 642	301231494	50951
SBRF-3.12	0,89	692 658	9160484133	8306
VTBR-3.12	1,68	138 388	255347339	6300
GOLD-3.12	-1,81	71188	3199161453	1595
Si-3.12	-0,07	1182022	25523838449	32252
Eu-3.12	0,18	43196	499716326	42065
ED-3.12	0,22	66150	6788544034	1,3039
SBPR-3.12	0,82	18 992	66979109	6150
RTSS-3.12	1,47	14058	535508320	9613,5
BR-2.12	-0,92	1106	7604941,22	104,93

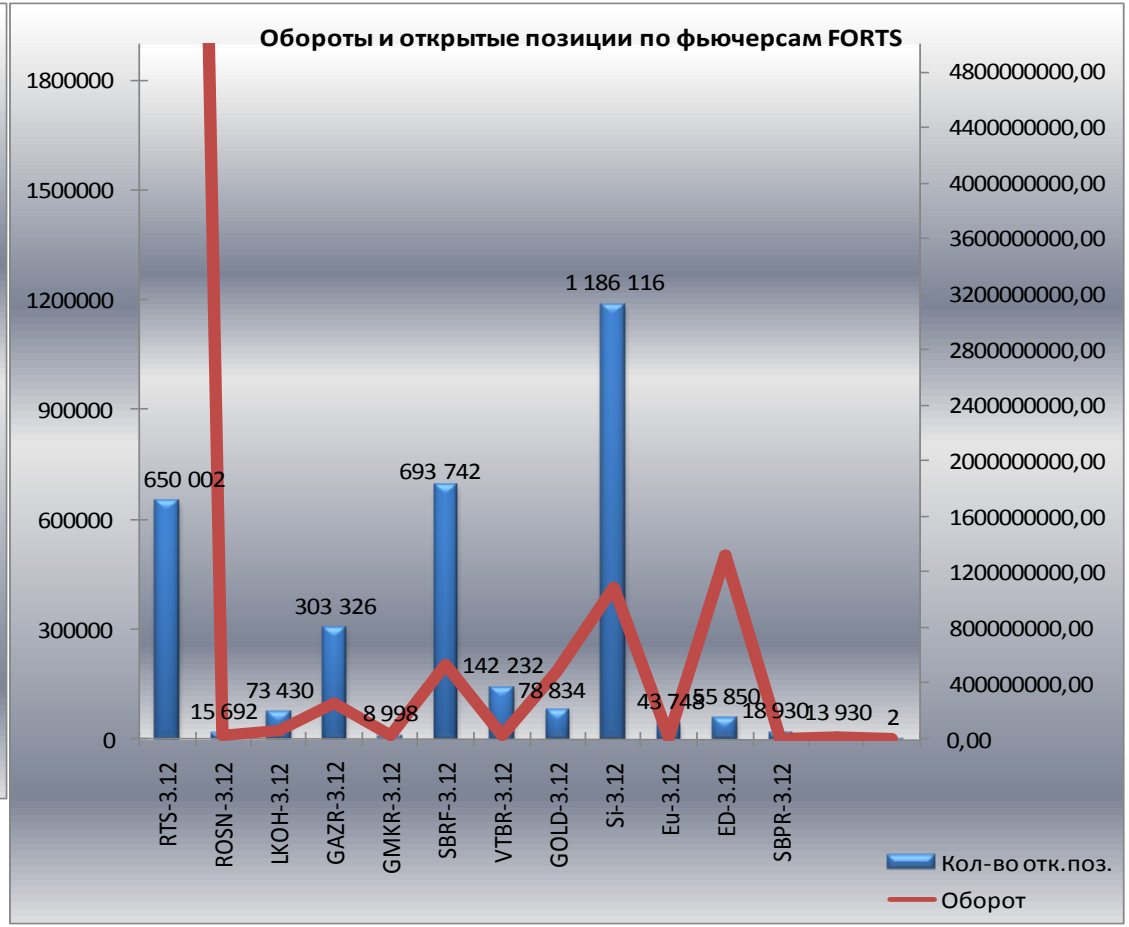

Опционы на индекс РТС, декабрь
Волатильность
79
73
67
61
55
49
43
37
31
25
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
105000 110000 115000 120000 125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 210000
OI Call 0 0 0 2 20 104 15910 16124 8756 10800 7226 38856 2770 18700 1252 1690 222 780 0 228 16
OI Put 390 1106 766 1516 7654 2874 2966 2162 694 692 512 16 0 6 14 0 0 0 0 0 8
IV 68,977 67,427 65,64 63,658 61,529 59,309 57,058 54,834 52,695 50,694 48,878 47,289 45,963 44,926 44,2 43,797 43,717 43,953 44,485 45,281 46,304


Опционы на Сбербанк, декабрь
Волатильность
80
75
70
65
60
55
50
45
40
35
30
4500
4000
3500
3000
2500
2000
1500
1000
500
0
6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000 10250 10500 10750
OI Call 0 0 0 0 0 10 0 6 2 12 162 474 1194 4440 316 112 12 142 0 0
OI Put 0 0 0 40 26 36 18 312 348 128 350 14 10 22 10 0 12 0 0 0
IV 71,352 69,558 67,678 65,748 63,807 61,892 60,041 58,289 56,668 55,207 53,933 52,868 52,028 51,428 51,075 50,972 51,116 51,494 52,09 52,879


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
58
52
46
40
34
28
22
16
10
200
150
100
50
0
1150 1200 1250 1300 1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 22 32
OI Put 0 0 0 0 0 0 0 0 0 26 10 40 4
IV 52,583 51,036 49,335 47,51 45,596 43,633 41,66 39,718 37,845 36,079 34,452 32,996 31,738


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
63
55
47
39
31
23
15
2000
1500
1000
500
0
110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200 205
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 26 432 120 122 582 166 948 432 1190 0
OI Put 0 0 0 0 0 0 20 58 50 70 80 110 108 712 2 0 2 0 0 0
IV 62,322 60,766 59,08 57,291 55,433 53,541 51,65 49,795 48,01 46,327 44,775 43,381 42,169 41,158 40,364 39,799 39,469 39,378 39,521 39,888


Оборот по фьючерсам веч. сессия
RTS-3.12
LKOH-3.12
GAZR-3.12
SBRF-3.12
Si-3.12
ED-3.12
SBPR-3.12
другие
2,5%
RTS-3.12
83,8%
LKOH-3.12 0,5%
GAZR-3.12 2,9%
SBRF-3.12 2,4%
Si-3.12 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
650 002
15 692
73 430
303 326
8 998
693 742
142 232
78 834
1 186 116
43 748
55 850
18 930
13 930
2
RTS-3.12
ROSN-3.12
LKOH-3.12
GAZR-3.12
GMKR-3.12
SBRF-3.12
VTBR-3.12
GOLD-3.12
Si-3.12
Eu-3.12
ED-3.12
SBPR-3.12
Кол-во отк.поз.
Оборот