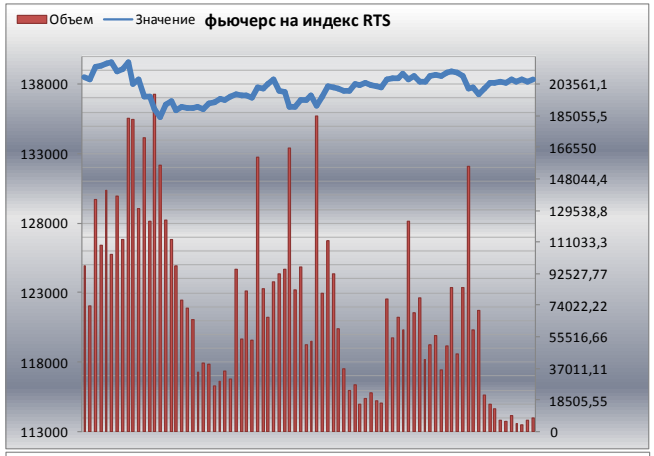
Конгресс США продлил срок действия льгот и дотаций еще на два месяца

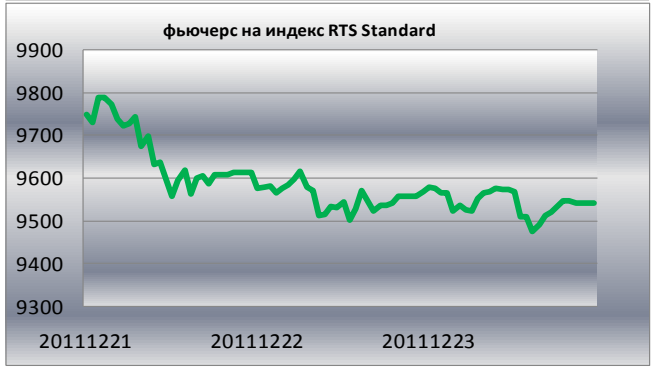
Инвесторы настроены крайне оптимистично в преддверие новогодних праздников: индекс фондовой волатильности VIX в США по итогам минувшей недели потерял около 15%, опустившись в район минимальных отметок за последние пять месяцев. Конгресс США утвердил законопроект о продлении на два месяца, до 29 февраля 2012 г., срока действия налоговых льгот по фондам заработной платы и периода предоставления ряда финансовых дотаций.

Вышла информация о сокращении коммерческих нефтяных запасов США. Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $107,96 за баррель. Золото же составило $1608,7 за тройскую унцию.

Российский рынок залег в боковик: индекс ММВБ вырос на +0,28% до 1379,98 пункта, индекс РТС вырос на +0,43% и достиг отметки 1400,14 пункта.

Лучше рынка выглядели бумаги Ростелекома (+2,49%), Акрона (+3,78%).





	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	138300	1383,00	0,74	888 284	0,06%	8 123 825 381	11,67%
ROSN-3.12	21287	212,87	0,46	18 916	0,12%	2 140 938	0,95%
LKOH-3.12	16690	1669,00	0,63	102 104	-1,13%	42 240 536	4,75%
GAZR-3.12	17300	173,00	0,47	344 862	0,20%	78 951 530	2,81%
GMKR-3.12	47819	4781,90	0,04	19 532	2,08%	22 343 557	6,47%
SBRF-3.12	8105	81,05	0,40	869 878	-0,33%	242 252 390	5,21%
VTBR-3.12	6047	0,0605	0,72	194 064	0,42%	8 638 523	3,14%
GOLD-3.12	1613	1612,5000	-0,01	69 912	-1,97%	106 938 197	11,82%
Si-3.12	31557	31,56	-0,13	1 946 302	0,17%	610 217 831	1,74%
Eu-3.12	41201	41,20	-0,12	55 184	0,06%	2 884 556	1,01%
ED-3.12	1,31	1,31	0,16	58 130	3,45%	249 686 657	7,81%
SBPR-3.12	6029	60,29	0,84	14 740	0,07%	126 318	0,42%
RTSS-3.12	9544	9544,00	0,71	29 160	0,10%	9 622 285	3,04%
BR-2.12	108	107,80	0,31	28 876	24793,10%	104 160 124	14921,81%

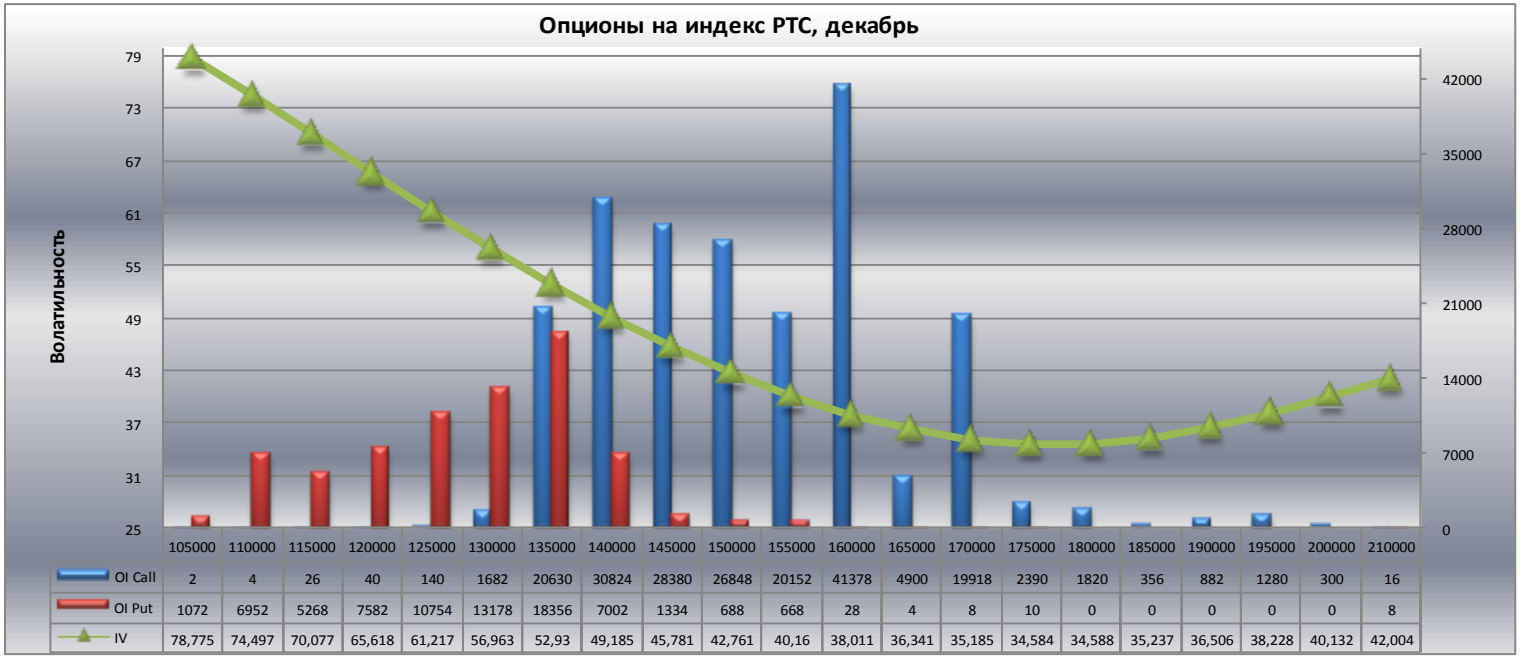
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57701,07	0,62%	00:12:30
CAC 40	3102,09	0,99%	19:35:18
DAX 30	5878,93	0,46%	19:35:31
DJ Industrial	12294	1,02%	00:42:54
FTSE 100	5512,7	1,02%	19:35:22
Hang Seng	18629,17	1,37%	10:19:17
Nikkei 225	8484,68	1,07%	09:00:03
S&P 500	1265,33	0,90%	00:02:19
Brent	107,96	0,07%	01:09:18
Gold	1608,7	-0,12%	10:19:18
Palladium	659,55	0,79%	10:19:25
Platinum	1430,2	0,41%	10:18:11
RTSI	1 400,14	0,43%	23:50:00
RTS_Standard	9 469,67	0,45%	23:50:00
RTSI_DEREX	1373,80	1,25%	18:45:00

Вечерняя сессия

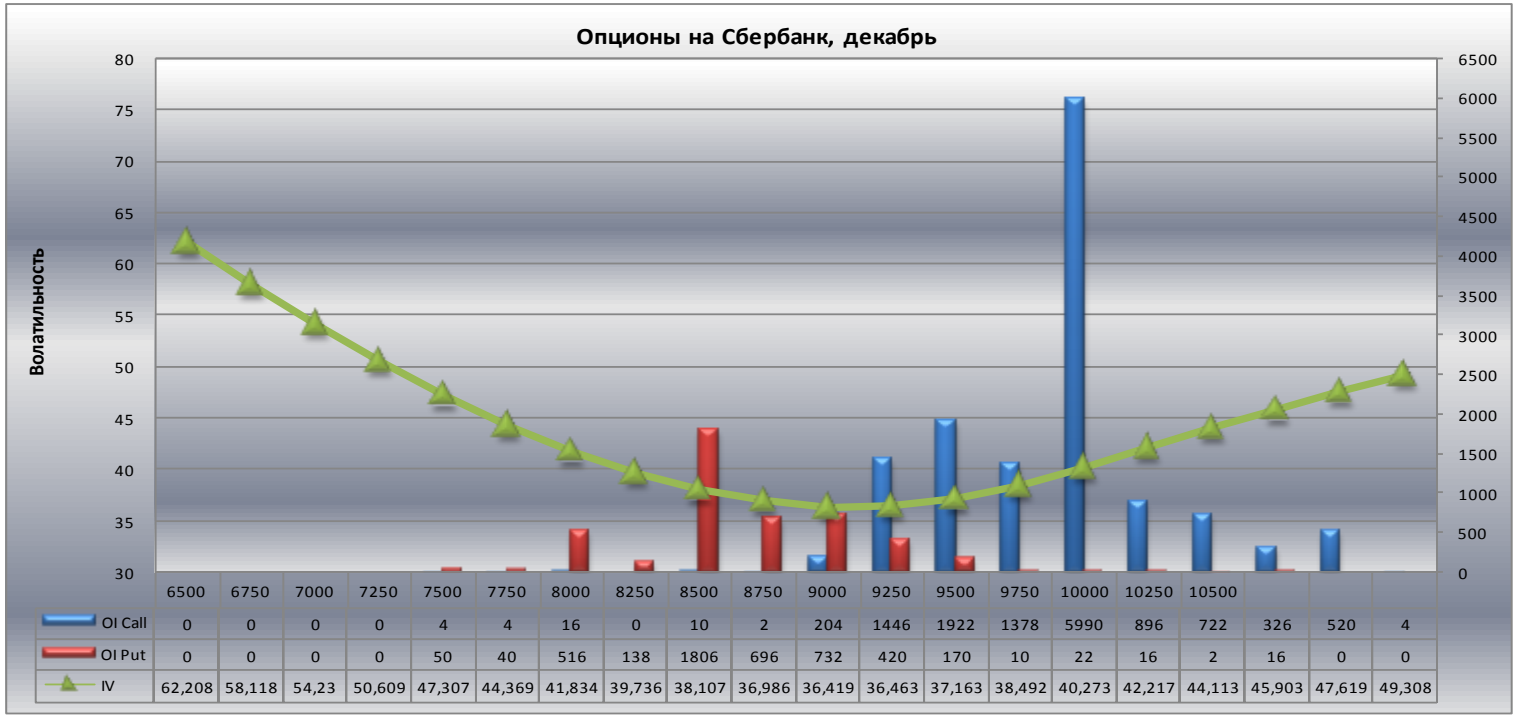
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-3.12	0,74	888284	8123825381,35	138300
ROSN-3.12	0,46	18916	2140938,00	21287
LKOH-3.12	0,63	102104	42240536,00	16690
GAZR-3.12	0,47	344862	78951530,00	17300
GMKR-3.12	0,04	19532	22343557,00	47819
SBRF-3.12	0,4	869878	242252390,00	8105
VTBR-3.12	0,72	194064	8638523,00	6047
GOLD-3.12	-0,01	69912	106938197,36	1612,5
Si-3.12	-0,13	1946302	610217831,00	31557
Eu-3.12	-0,12	55184	2884556,00	41201
ED-3.12	0,16	58130	249686656,57	1,3072
SBPR-3.12	0,84	14740	126318,00	6029
RTSS-3.12	0,71	29160	9622285,00	9544
BR-2.12	0,31	28 876	104160124,00	107,8

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-3.12	-0,42	887722	69590805482	137280
ROSN-3.12	-1,25	18894	224889277	21189
LKOH-3.12	0,39	103272	888654835	16586
GAZR-3.12	-0,6	344158	2806441411	17219
GMKR-3.12	-1,25	19134	345174277	47799
SBRF-3.12	-0,1	872742	4652451970	8073
VTBR-3.12	-2,06	193258	274762481	6004
GOLD-3.12	-0,31	71318	904535174,2	1612,6
Si-3.12	-0,63	1942976	35018924085	31599
Eu-3.12	-0,67	55150	284260921	41250
ED-3.12	-0,02	56190	3197199042	1,3051
SBPR-3.12	0,24	14730	30007093	5979
RTSS-3.12	-0,99	29132	316227785	9477
BR-2.12	-0,26	116	698039,25	106,38

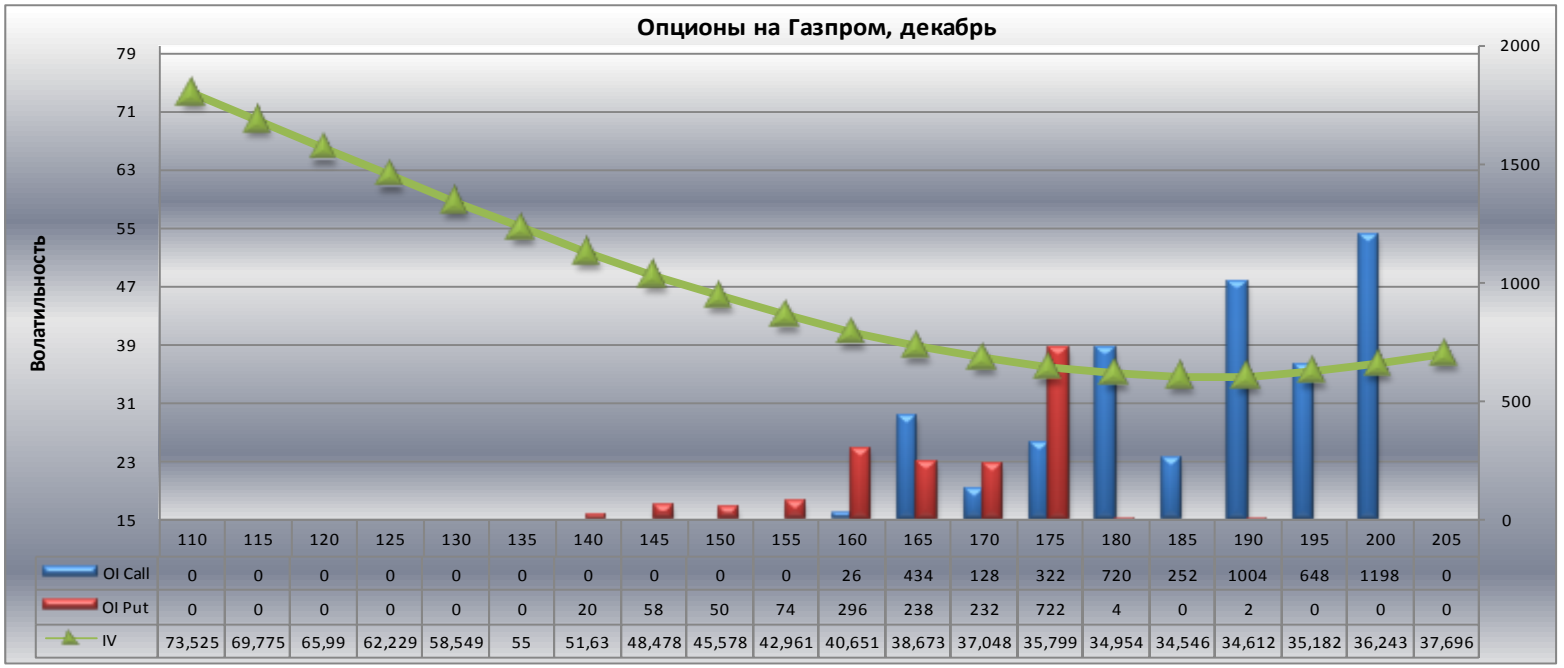


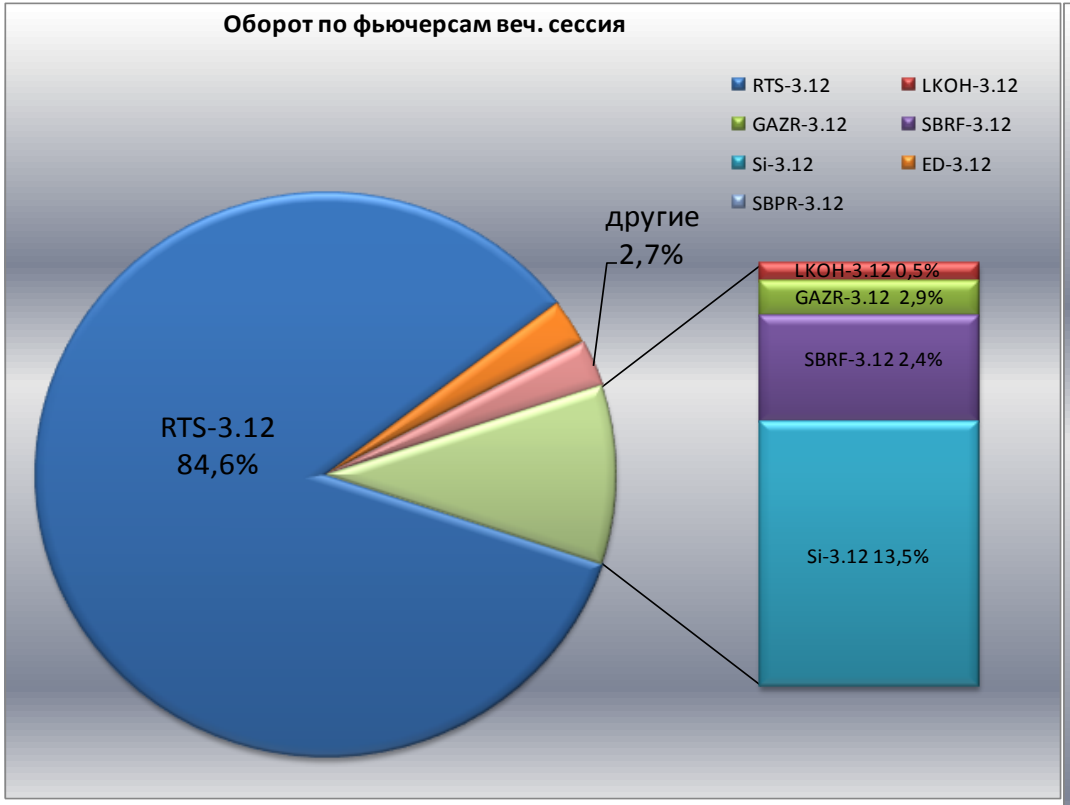
	105000	110000	115000	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	210000
OI Call	2	4	26	40	140	1682	20630	30824	28380	26848	20152	41378	4900	19918	2390	1820	356	882	1280	300	16
OI Put	1072	6952	5268	7582	10754	13178	18356	7002	1334	688	668	28	4	8	10	0	0	0	0	0	8
IV	78,775	74,497	70,077	65,618	61,217	56,963	52,93	49,185	45,781	42,761	40,16	38,011	36,341	35,185	34,584	34,588	35,237	36,506	38,228	40,132	42,004

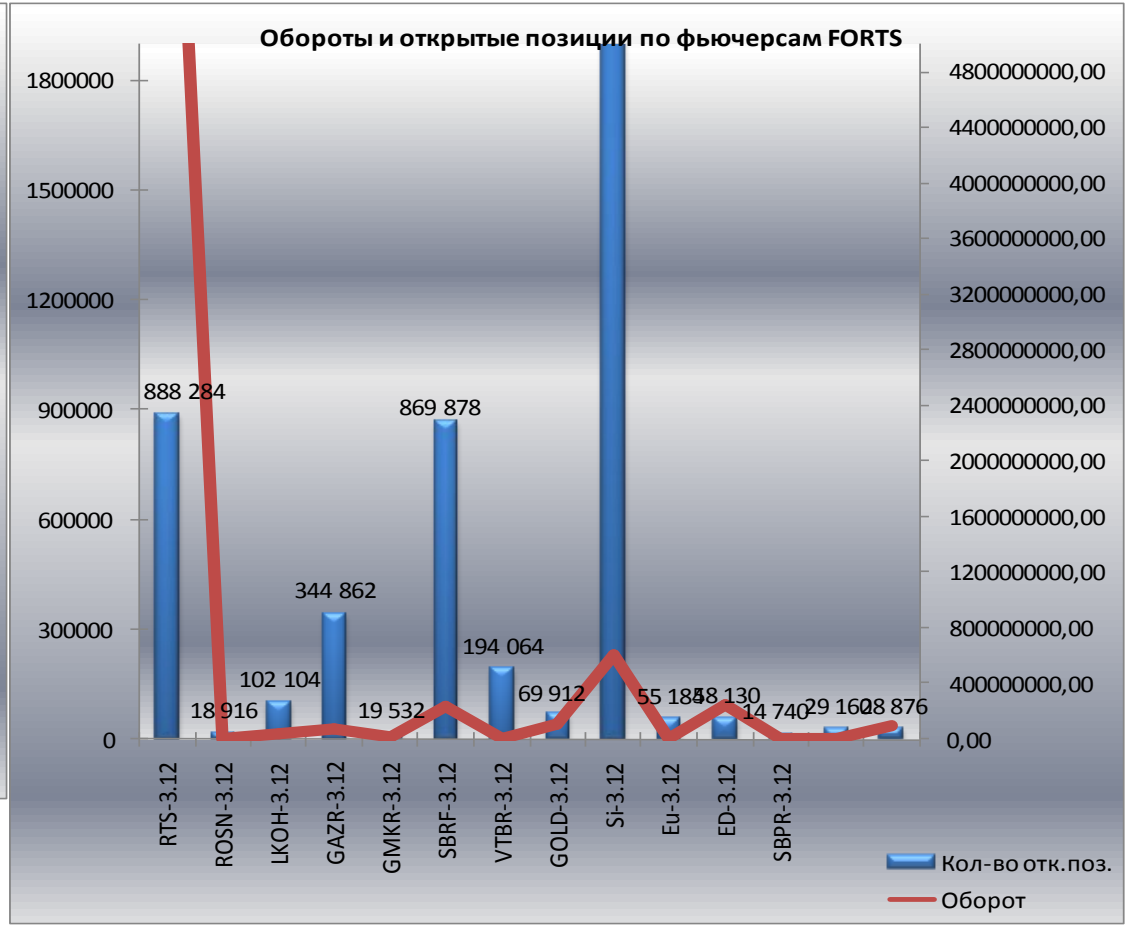


	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000	10250	10500			
OI Call	0	0	0	0	4	4	16	0	10	2	204	1446	1922	1378	5990	896	722	326	520	4
OI Put	0	0	0	0	50	40	516	138	1806	696	732	420	170	10	22	16	2	16	0	0
IV	62,208	58,118	54,23	50,609	47,307	44,369	41,834	39,736	38,107	36,986	36,419	36,463	37,163	38,492	40,273	42,217	44,113	45,903	47,619	49,308


Опционы на Лукойл, декабрь
Волатильность
70
64
58
52
46
40
34
28
22
16
10
300
250
200
150
100
50
0
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 22 50 208
OI Put 0 0 0 0 0 26 0 0 48 92 40 8 0
IV 64,776 60,747 56,779 52,937 49,279 45,856 42,711 39,881 37,399 35,292 33,586 32,311 31,5


Опционы на Газпром, декабрь
Волатильность
79
71
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 26 434 128 322 720 252 1004 648 1198 0
OI Put 0 0 0 0 0 0 20 58 50 74 296 238 232 722 4 0 2 0 0 0
IV 73,525 69,775 65,99 62,229 58,549 55 51,63 48,478 45,578 42,961 40,651 38,673 37,048 35,799 34,954 34,546 34,612 35,182 36,243 37,696


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
2,7%
RTS-3.12
84,6%
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
888 284
18 916
102 104
344 862
19 532
869 878
194 064
69 912
55 184
48 130
14 740
29 160
28 876
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