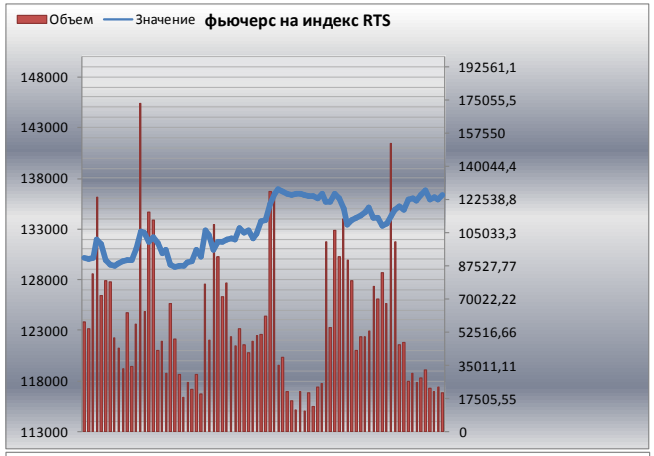
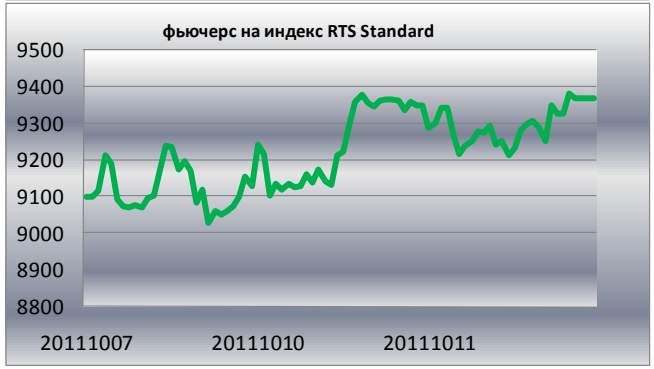
Умеренно-негативный внешний фон: заявления Трише и итоги голосования

Комментарии председателя ЕЦБ Жан-Клода Трише на тему того, что долговой кризис является серьезной угрозой для финансовой системы региона, смогли поубавить вчерашние позитивные ожидания. Вдобавок агентство S&P сообщило, что ожидается продолжающийся рост проблемных активов, как в следующем, так и, возможно, в начале 2013 г. Более того, Словакия проголосовала против расширения европейского стабилизационного фонда, а для одобрения плана требуется согласие всех стран ЕС.

По итогам вечерней сессии фьючерс на нефть сорта Brent закрылся на отметке $108,05. Цена на фьючерсы на золото с поставкой в декабре по итогам торгов на COMEX выросла на +0,45% до значения 1668,45 долларов за тройскую унцию.

Индекс РТС за время вечерней торговой сессии остановился на отметке в 1362,90 пунктов. Газпром за вечернюю сессию вырос на +0,30%, составив 155,00 пунктов, Лукойл на +0,36% остановившись на отметке 1681,50 пунктов, Роснефть на +0,56% (194,66 пунктов). Контракты на валютные пары доллар-рубль и евро-рубль сдвинулись на -0,30% (31,78 пункта) и +0,15% (43,43 пункта).





	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	136290	1362,90	0,82	734 996	-0,82%	23 883 907 872	16,98%
ROSN-12.11	19466	194,66	0,56	98 524	0,26%	26 650 732	5,31%
LKOH-12.11	16815	1681,50	0,36	141 578	-0,09%	97 724 608	5,53%
GAZR-12.11	15500	155,00	0,30	356 488	-2,03%	271 507 300	6,11%
GMKR-12.11	62250	6225,00	0,66	92 542	0,08%	14 143 486	3,17%
SBRF-12.11	7139	71,39	0,80	833 090	-0,08%	581 190 806	7,61%
VTBR-12.11	6644	0,0664	0,27	85 914	-0,19%	5 828 766	1,95%
GOLD-12.11	1672	1672,4000	-0,04	77 232	-4,82%	388 271 658	11,02%
Si-12.11	31778	31,78	-0,30	1 085 808	-0,02%	1 201 684 564	3,44%
Eu-12.11	43434	43,43	0,15	119 528	0,18%	15 942 675	10,06%
ED-12.11	1,37	1,37	0,40	84 932	9,78%	1 380 043 313	18,80%
SBPR-12.11	5425	54,25	1,10	27 220	0,64%	3 432 053	8,31%
RTSS-12.11	9369	9368,50	0,67	20 926	0,02%	3 263 825	0,86%
BR-12.11	107	106,65	1,33	2 930	30,45%	21 113 007	404,67%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	53838,47	1,06%	00:12:30
CAC 40	3153,52	-0,25%	19:35:18
DAX 30	5865,01	0,30%	19:35:31
DJ Industrial	11416,3	-0,15%	00:42:54
FTSE 100	5395,7	-0,06%	19:35:22
Hang Seng	18326,44	1,02%	10:19:17
Nikkei 225	8746,89	-0,31%	09:00:03
S&P 500	1195,54	0,05%	00:02:19
Brent 12.11	108,04619	0,00%	01:09:18
Gold	1668,45	0,45%	10:19:18
Palladium	608,2	0,65%	10:19:25
Platinum	1532,21	0,88%	10:18:11
RTSI	1 361,50	0,46%	23:50:00
RTS_Standard	9 301,02	0,52%	23:50:00
RTSI_DEREX	1350,11	-1,48%	18:45:00

Вечерняя сессия

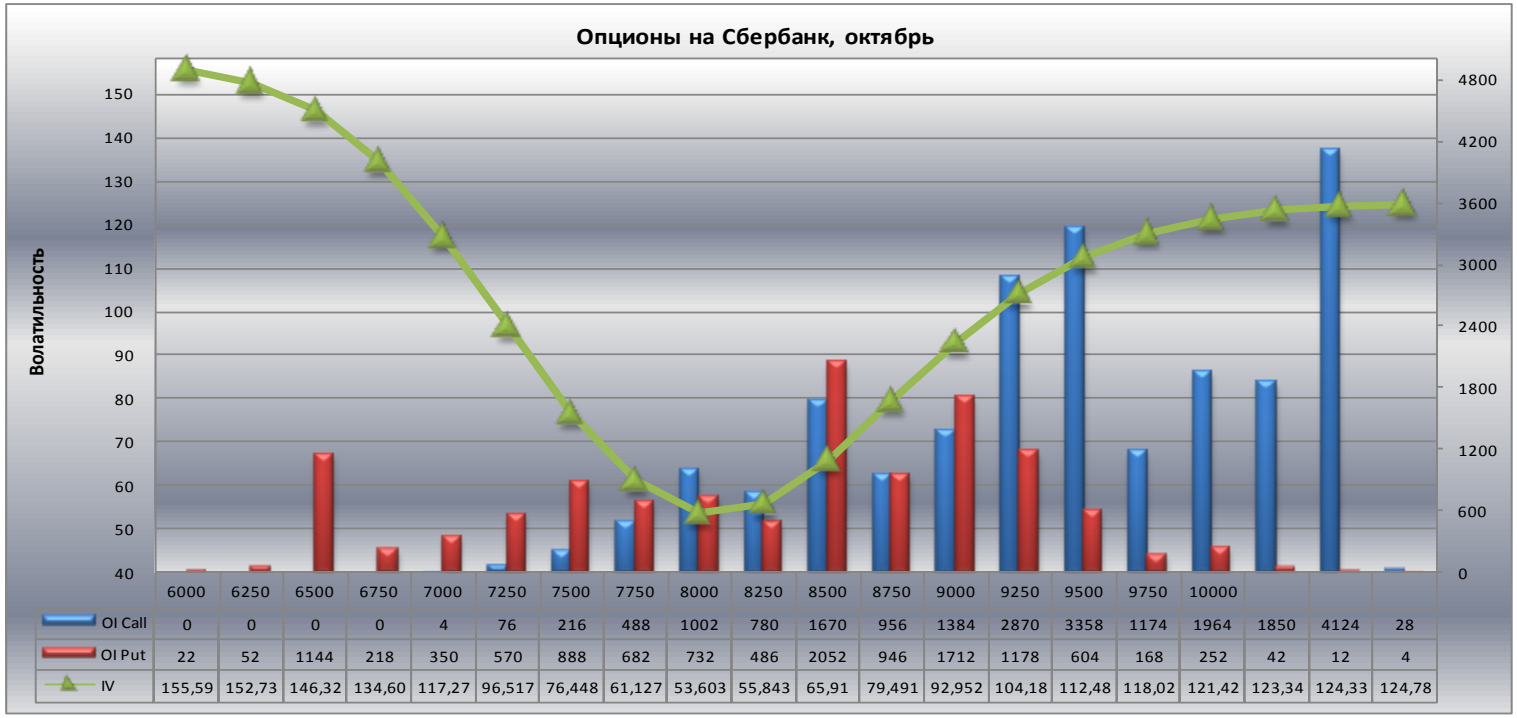
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,82	734996	23883907872,31	136290
ROSN-12.11	0,56	98524	26650732,00	19466
LKOH-12.11	0,36	141578	97724608,00	16815
GAZR-12.11	0,3	356488	271507300,00	15500
GMKR-12.11	0,66	92542	14143486,00	62250
SBRF-12.11	0,8	833090	581190806,00	7139
VTBR-12.11	0,27	85914	5828766,00	6644
GOLD-12.11	-0,04	77232	388271658,14	1672,4
Si-12.11	-0,3	1085808	1201684564,00	31778
Eu-12.11	0,15	119528	15942675,00	43434
ED-12.11	0,4	84932	1380043313,00	1,3667
SBPR-12.11	1,1	27220	3432053,00	5425
RTSS-12.11	0,67	20926	3263825,00	9368,5
BR-12.11	1,33	2 930	21113007,27	106,65

Дневная сессия

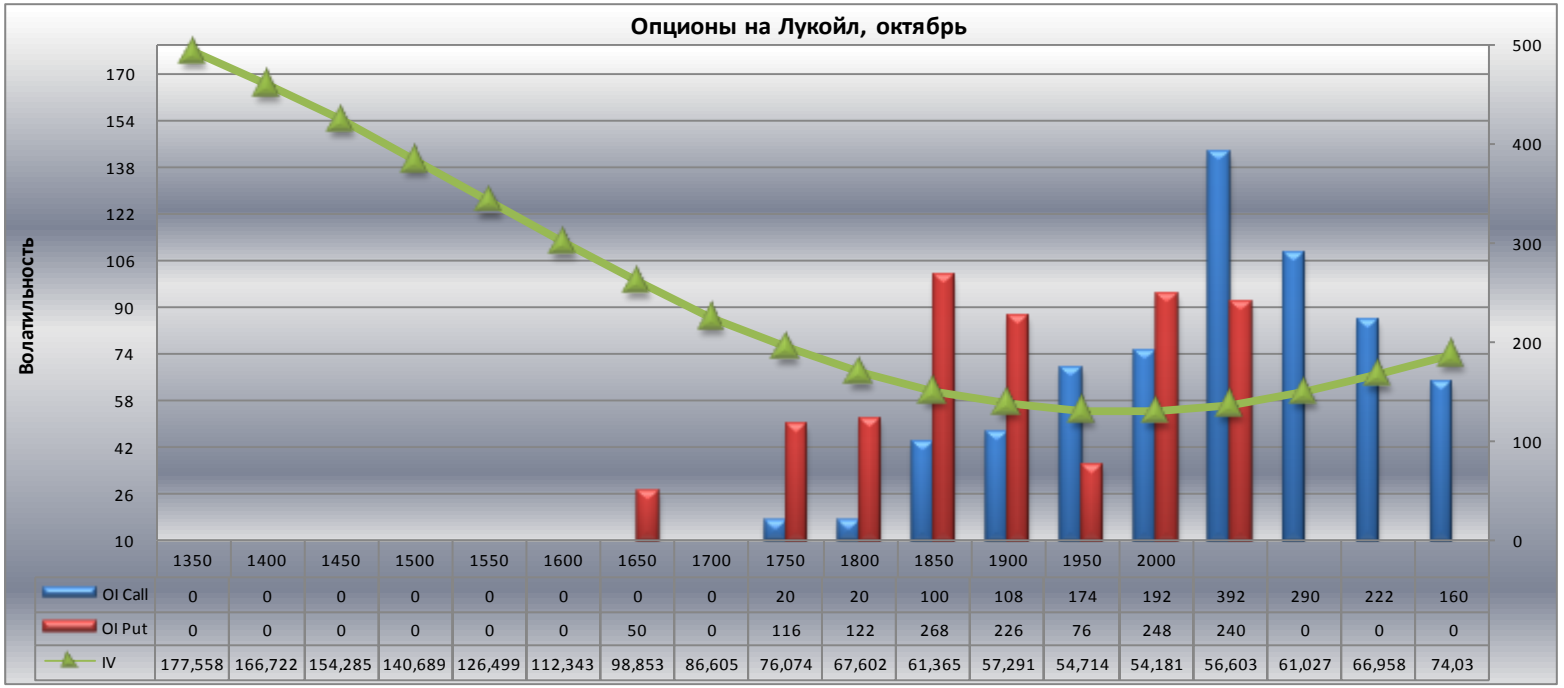
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,21	741072	140626722001,49	135195
ROSN-12.11	-3,29	98266	502310951,00	19358
LKOH-12.11	-0,42	141704	1766504948,00	16754
GAZR-12.11	-0,92	363862	4440995053,00	15452
GMKR-12.11	0,09	92466	446329669,00	61841
SBRF-12.11	-0,38	833750	7635258666,00	7082
VTBR-12.11	-3,36	86076	299583447,00	6626
GOLD-12.11	0,22	81146	3523704637,29	1673,1
Si-12.11	0,12	1086036	34905928362,00	31873
Eu-12.11	-0,11	119318	158409046,00	43371
ED-12.11	-0,18	77364	7341518586,91	1,3613
SBPR-12.11	1,02	27048	41286517,00	5366
RTSS-12.11	-0,79	20922	380029200,00	9306
BR-12.11	-0,39	2 246	5217383,13	105

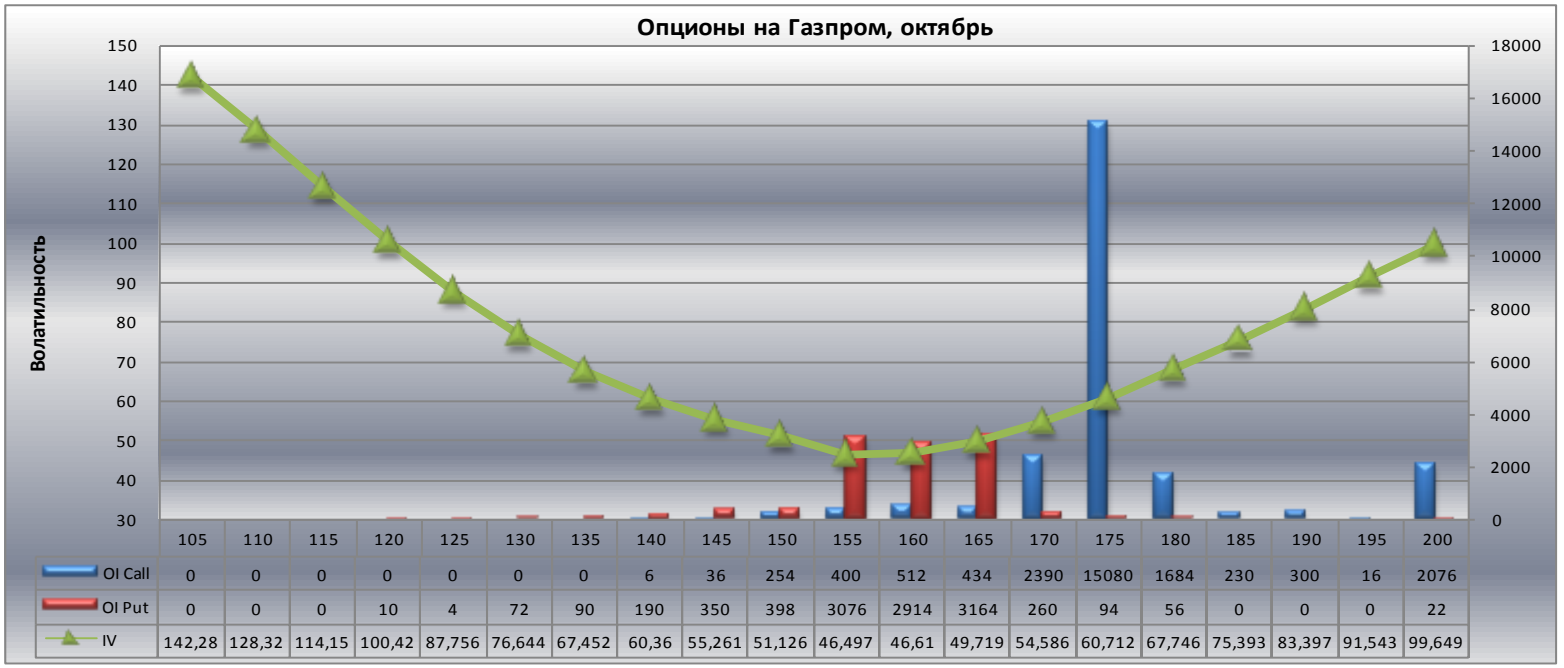


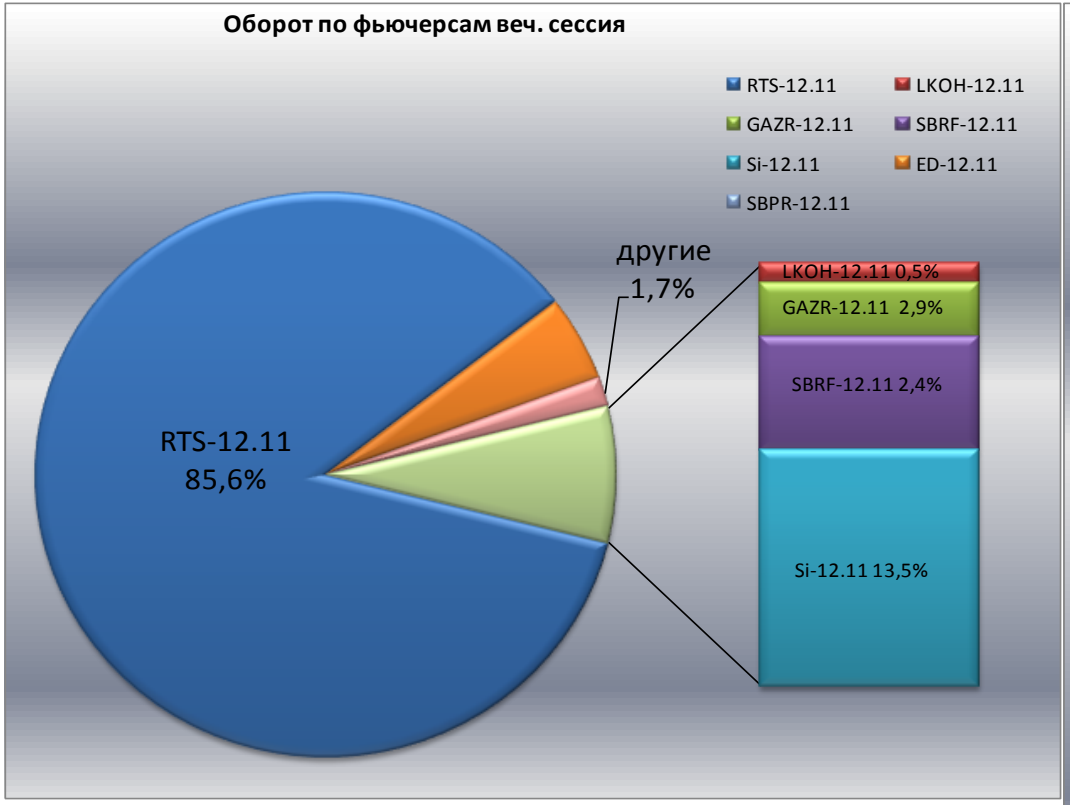
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	205000	210000
OI Call	8182	14742	23504	35314	35856	47520	21832	43512	8818	24180	15516	8900	5388	3028	792	740	90	16	228	106	16
OI Put	36106	25522	23160	35648	28404	19786	9372	2274	548	50	50	102	16	6	2	10	0	8	4	0	8
IV	103,9	91,74	81,027	71,932	64,521	58,749	54,379	50,631	45,901	43,583	44,548	47,229	51,047	55,713	61,025	66,823	72,968	79,343	85,845	92,389	98,901

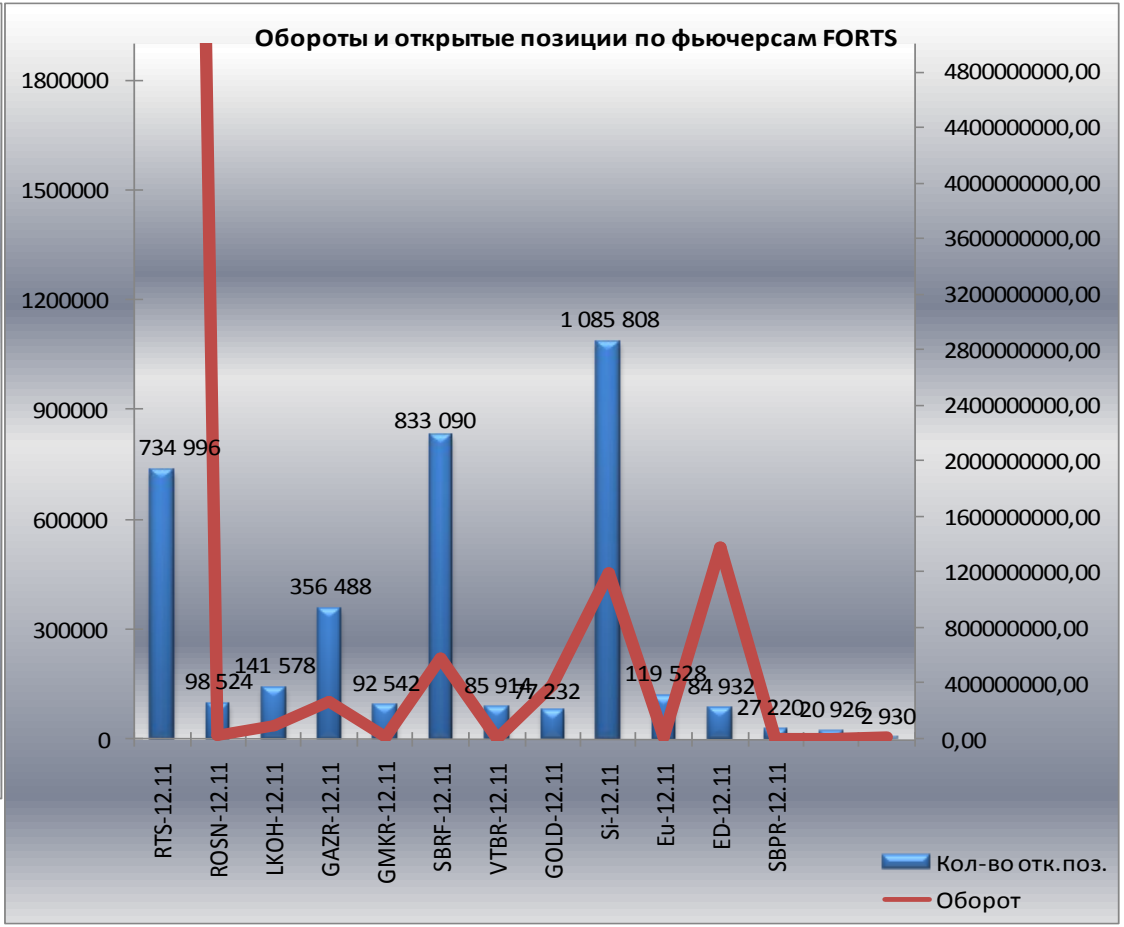


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	4	76	216	488	1002	780	1670	956	1384	2870	3358	1174	1964	1850	4124	28
OI Put	22	52	1144	218	350	570	888	682	732	486	2052	946	1712	1178	604	168	252	42	12	4
IV	155,59	152,73	146,32	134,60	117,27	96,517	76,448	61,127	53,603	55,843	65,91	79,491	92,952	104,18	112,48	118,02	121,42	123,34	124,33	124,78


Опционы на Лукойл, октябрь
Волатильность
170
154
138
122
106
90
74
58
42
26
10
500
400
300
200
100
0
1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800 1850 1900 1950 2000
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 20 20 100 108 174 192 392 290 222 160
OI Put 0 0 0 0 0 0 50 0 116 122 268 226 76 248 240 0 0 0
IV 177,558 166,722 154,285 140,689 126,499 112,343 98,853 86,605 76,074 67,602 61,365 57,291 54,714 54,181 56,603 61,027 66,958 74,03


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
150
140
130
120
110
100
90
80
70
60
50
40
30
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
105 110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 6 36 254 400 512 434 2390 15080 1684 230 300 16 2076
OI Put 0 0 0 10 4 72 90 190 350 398 3076 2914 3164 260 94 56 0 0 0 22
IV 142,28 128,32 114,15 100,42 87,756 76,644 67,452 60,36 55,261 51,126 46,497 46,61 49,719 54,586 60,712 67,746 75,393 83,397 91,543 99,649


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
85,6%
другие
1,7%
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
734 996
98 524
141 578
356 488
92 542
833 090
85 914
77 232
1 085 808
119 528
84 932
27 220
20 926
2 930
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