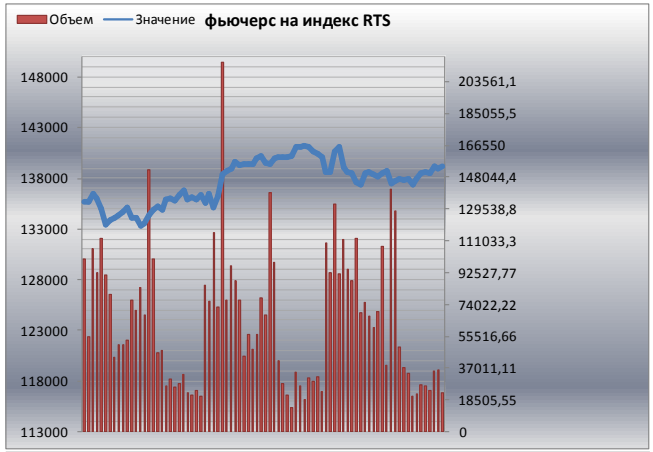
Индексы ушли в минус в связи с резкой критикой ЕЦБ

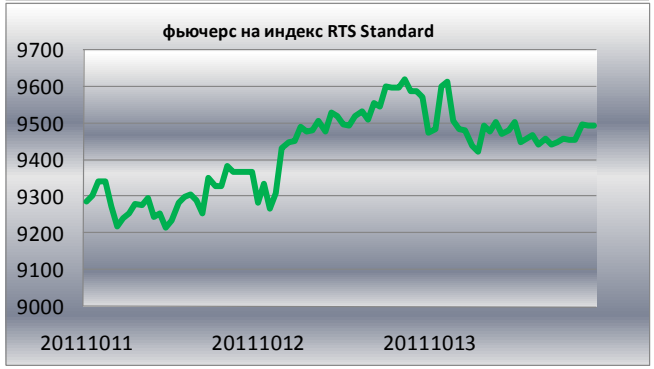
ЕЦБ заявил, что любые виды списаний по государственным долгам приведут к потерям в частном секторе и нанесут ущерб как европейским банкам, так и единой валюте, списания в частном секторе могут негативно отразиться на репутации евро и еще сильнее увеличить волатильность на валютном рынке. Тем не менее, парламент Словакии наконец одобрил расширение полномочий Европейского фонда финансовой стабильности (EFSF), а значит, теперь план расширения функций EFSF ратифицирован всеми 17 странами еврозоны и может вступить в силу.

Агентство Fitch понизило кредитный рейтинг 3 крупнейших банков: рейтинг швейцарского банка UBS был понижен с A+ до A, у английских Lloyds Banking Group и Royal Bank of Scotland Group были понижены с AA- до A.

По итогам вечерней сессии фьючерс на нефть сорта Brent закрылся на отметке $109,326 (неплохой рост за неделю). Цена на фьючерсы на золото с поставкой в декабре по итогам торгов на COMEX составила 1671,06 долларов за тройскую унцию.

Индекс RTS за время вечерней сессии вырос на 0,94% до отметки 1391,1 пункта, а RTS Standard на 0,31% до 9478,03 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	139150	1391,50	0,94	781 356	-0,30%	24 567 891 462	14,95%
ROSN-12.11	19728	197,28	0,17	105 308	0,11%	13 426 992	2,63%
LKOH-12.11	16859	1685,90	0,23	162 150	0,26%	85 249 640	3,99%
GAZR-12.11	16095	160,95	0,80	343 054	-0,46%	234 548 842	3,76%
GMKR-12.11	63801	6380,10	0,42	107 468	0,06%	14 766 393	1,46%
SBRF-12.11	7627	76,27	0,87	782 280	0,93%	527 732 019	4,80%
VTBR-12.11	6600	0,0660	0,53	83 512	0,40%	5 617 183	1,85%
GOLD-12.11	1674	1674,0000	0,52	81 134	3,62%	535 300 114	13,98%
Si-12.11	31394	31,39	-0,55	1 136 718	-0,84%	1 540 712 391	4,51%
Eu-12.11	43245	43,25	0,02	118 068	-0,19%	15 352 078	16,35%
ED-12.11	1,38	1,38	0,57	77 580	8,45%	1 464 118 704	22,83%
SBPR-12.11	5636	56,36	1,09	26 480	0,48%	1 097 951	2,29%
RTSS-12.11	9493	9493,00	0,27	40 642	0,02%	8 149 095	0,57%
BR-12.11	107	107,43	1,20	2 308	1,85%	1 510 235	3,76%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54601,07	1,42%	00:12:30
CAC 40	3186,94	-1,33%	19:35:18
DAX 30	5914,84	-1,33%	19:35:31
DJ Industrial	11478,13	-0,35%	00:42:54
FTSE 100	5403,38	-0,71%	19:35:22
Hang Seng	18548,19	-1,12%	10:19:17
Nikkei 225	8744,39	-0,89%	09:00:03
S&P 500	1203,66	-0,30%	00:02:19
Brent 12.11	109,32559	0,12%	01:09:18
Gold	1671,06	0,15%	10:19:18
Palladium	598	0,66%	10:19:25
Platinum	1541	0,56%	10:18:11
RTSI	1 399,90	0,26%	23:50:00
RTS_Standard	9 478,03	0,31%	23:50:00
RTSI_DEREX	1389,80	-0,61%	18:45:00

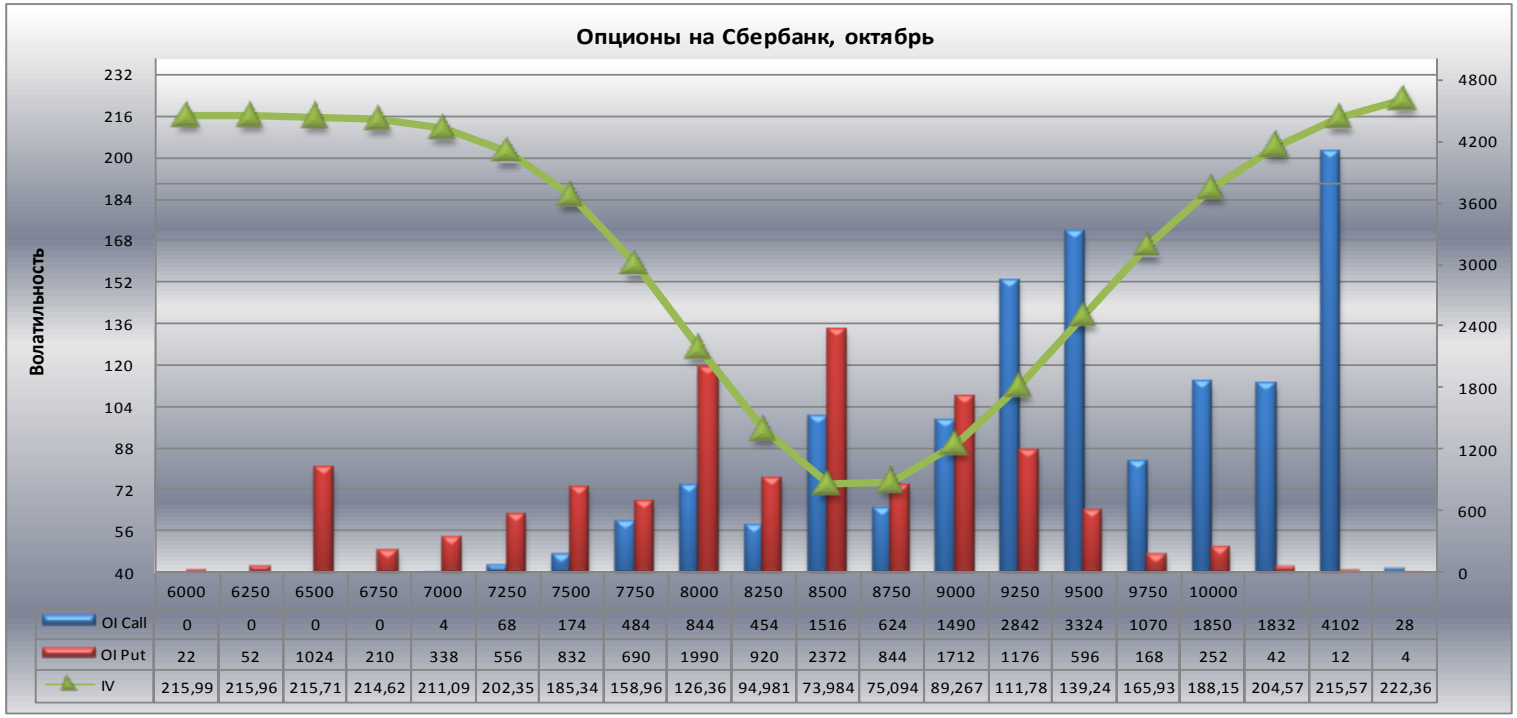
Вечерняя сессия

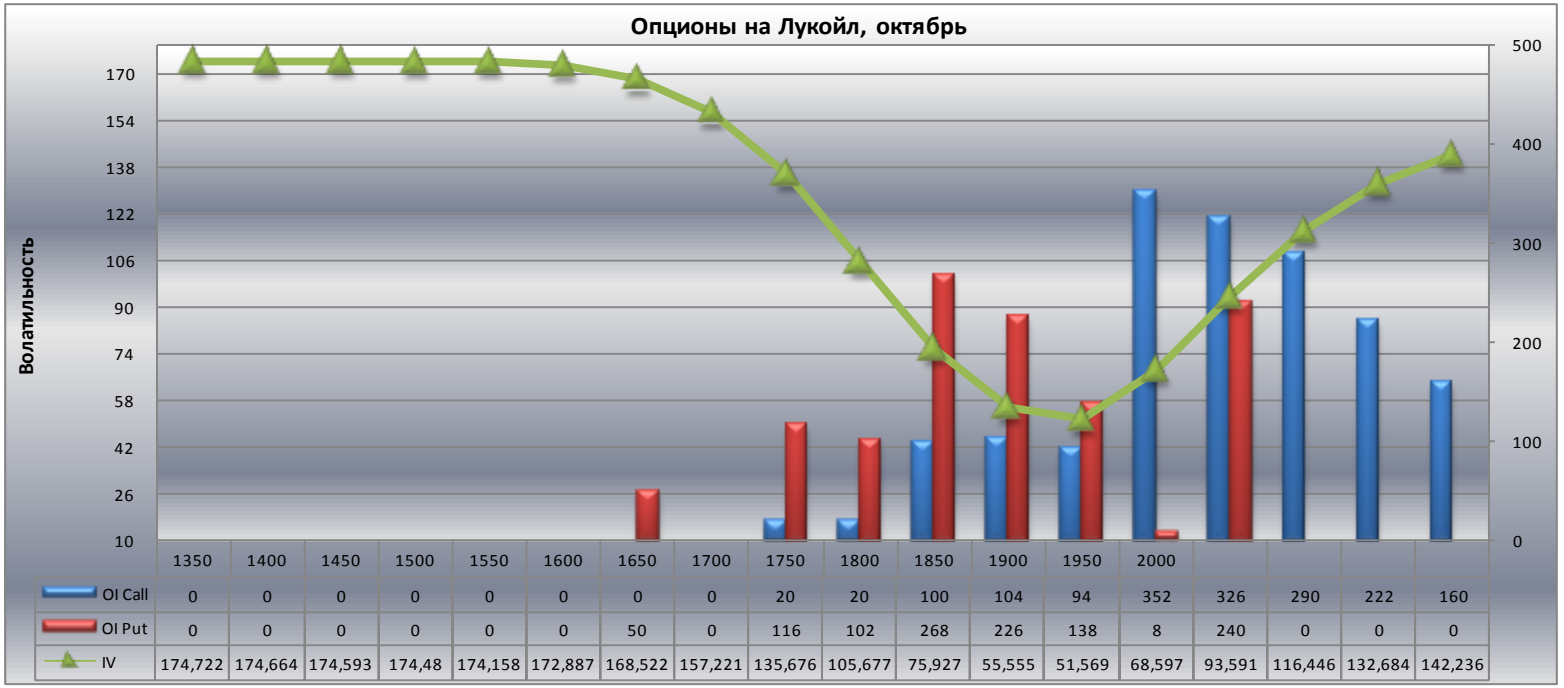
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,94	781356	24567891461,91	139150
ROSN-12.11	0,17	105308	13426992,00	19728
LKOH-12.11	0,23	162150	85249640,00	16859
GAZR-12.11	0,8	343054	234548842,00	16095
GMKR-12.11	0,42	107468	14766393,00	63801
SBRF-12.11	0,87	782280	527732019,00	7627
VTBR-12.11	0,53	83512	5617183,00	6600
GOLD-12.11	0,52	81134	535300114,04	1674
Si-12.11	-0,55	1136718	1540712391,00	31394
Eu-12.11	0,02	118068	15352078,00	43245
ED-12.11	0,57	77580	1464118703,75	1,3772
SBPR-12.11	1,09	26480	1097951,00	5636
RTSS-12.11	0,27	40642	8149095,00	9493
BR-12.11	1,2	2 308	1510234,97	107,43

Дневная сессия

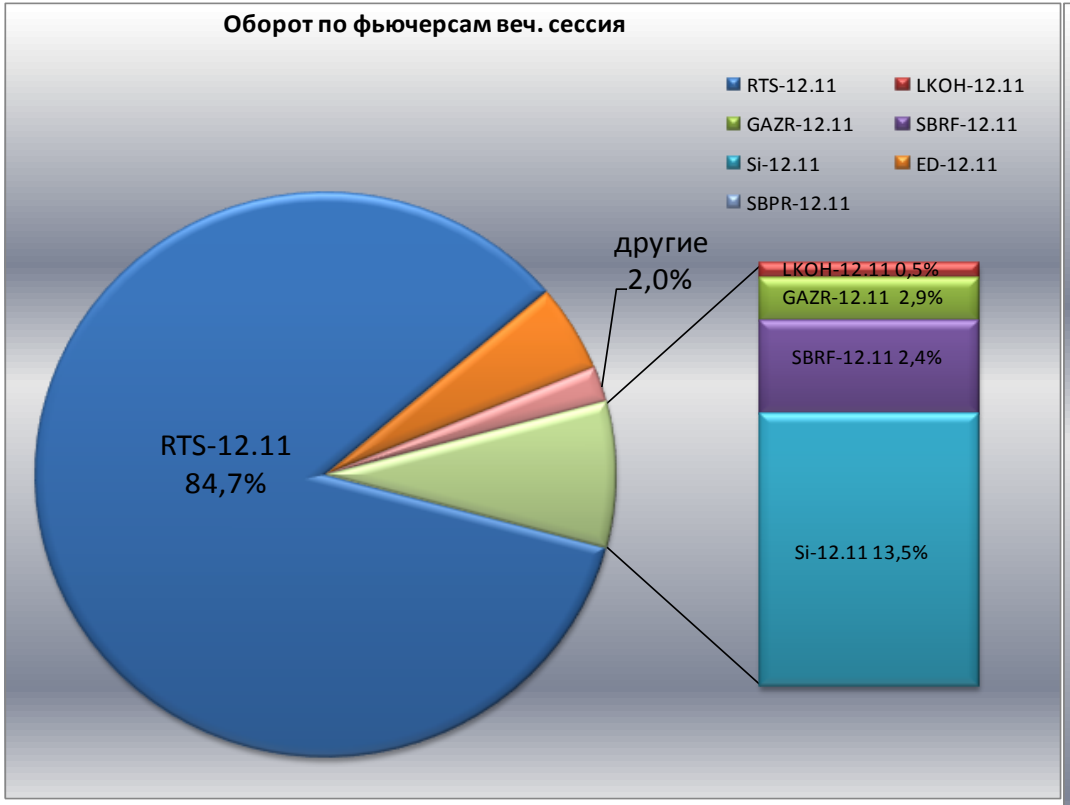
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,6	783682	164375305798,72	137870
ROSN-12.11	-1,53	105188	510653437,00	19694
LKOH-12.11	-0,97	161728	2138050213,00	16820
GAZR-12.11	-2	344632	6233498917,00	15970
GMKR-12.11	3,49	107402	1008858277,00	63536
SBRF-12.11	1,08	775068	10987581835,00	7561
VTBR-12.11	-2,35	83176	303719690,00	6557
GOLD-12.11	-1,16	78302	3828995655,87	1665,4
Si-12.11	0,57	1146306	34188292262,00	31562
Eu-12.11	-0,02	118298	93871088,00	43235
ED-12.11	-0,68	71534	6412610634,41	1,3694
SBPR-12.11	-0,45	26354	47969175,00	5575
RTSS-12.11	-0,69	40634	1426783135,00	9467,5
BR-12.11	-1,88	2 266	40164789,61	106,16

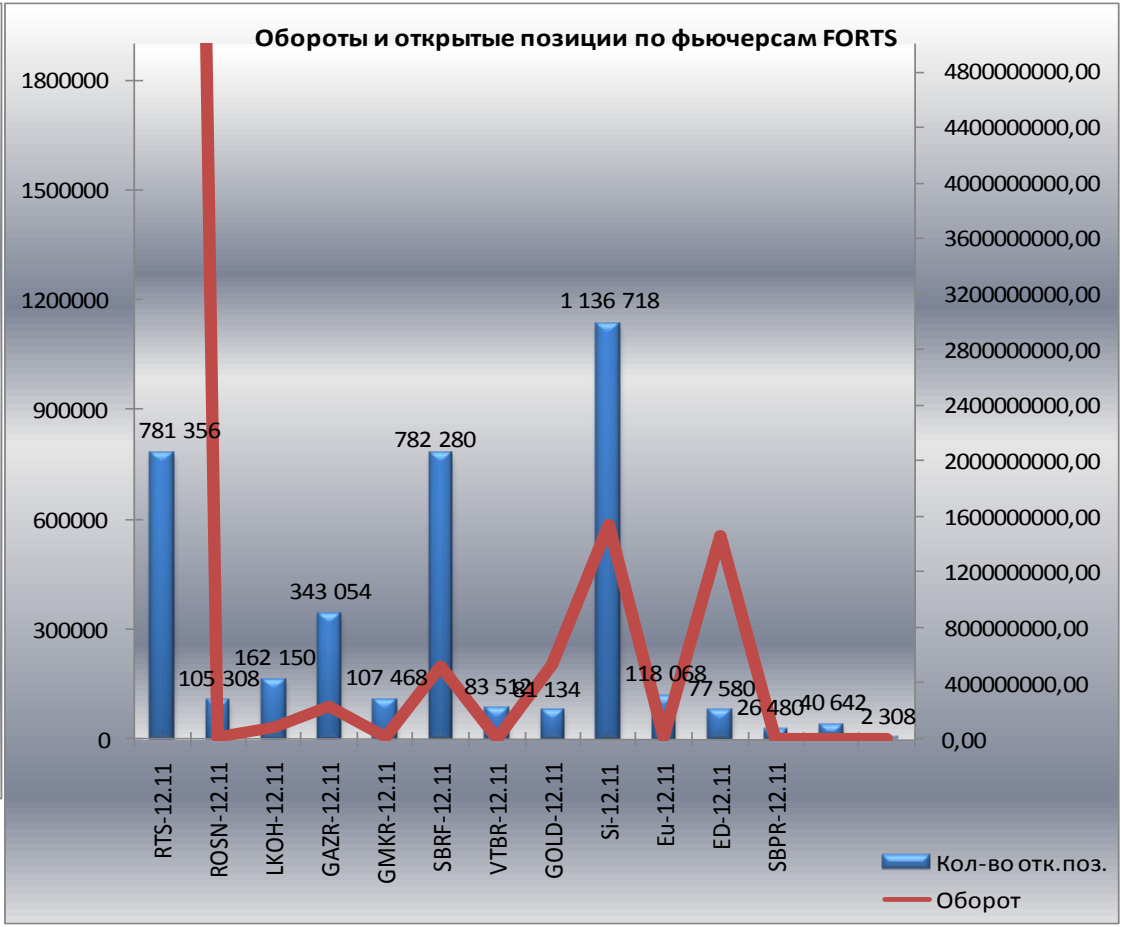

Опционы на индекс РТС, октябрь
Волатильность
135
125
115
105
95
85
75
65
55
45
35
52800
48000
43200
38400
33600
28800
24000
19200
14400
9600
4800
0
125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 205000 210000
OI Call 7650 13442 22992 43968 44186 40726 21528 40886 8314 22888 15216 8868 5346 2990 792 740 90 16 228 106 16
OI Put 27776 42432 38556 39152 28280 19598 9446 2272 548 50 50 94 16 6 2 10 0 8 4 0 8
IV 126,66 112,94 98,231 83,619 70,171 58,65 49,317 42,015 37,287 36,535 39,667 45,574 53,22 61,799 70,692 79,436 87,704 95,287 102,06 108,00 113,10


Опционы на Сбербанк, октябрь
Волатильность
232
216
200
184
168
152
136
120
104
88
72
56
40
4800
4200
3600
3000
2400
1800
1200
600
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 4 68 174 484 844 454 1516 624 1490 2842 3324 1070 1850 1832 4102 28
OI Put 22 52 1024 210 338 556 832 690 1990 920 2372 844 1712 1176 596 168 252 42 12 4
IV 215,99 215,96 215,71 214,62 211,09 202,35 185,34 158,96 126,36 94,981 73,984 75,094 89,267 111,78 139,24 165,93 188,15 204,57 215,57 222,36


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 20 100 104 94 352 326 290 222 160
OI Put 0 0 0 0 0 0 50 0 116 102 268 226 138 8 240 0 0 0
IV 174,722 174,664 174,593 174,48 174,158 172,887 168,522 157,221 135,676 105,677 75,927 55,555 51,569 68,597 93,591 116,446 132,684 142,236


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
206
190
174
158
142
126
110
94
78
62
46
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 36 202 372 374 556 2384 14980 1684 228 296 14 2076
OI Put 0 0 0 10 4 72 86 172 340 514 2870 2982 3020 260 94 56 0 0 0 22
IV 220,34 220,27 220,20 220,08 219,81 218,71 214,60 203,12 179,83 145,93 111,38 87,439 82,685 102,66 131,41 157,02 174,61 184,54 189,29 191,24


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
84,7%
другие
2,0%
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
781 356
105 308
162 150
343 054
107 468
782 280
83 512
81 134
1 136 718
118 068
77 580
26 480
40 642
2 308
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