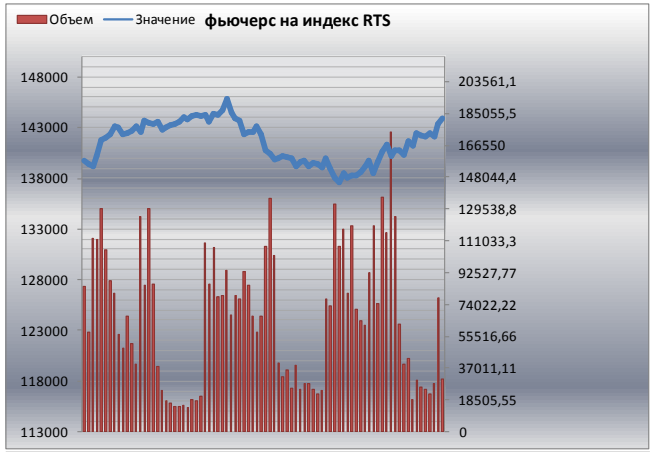
Возможно понижение кредитного рейтинга Франции

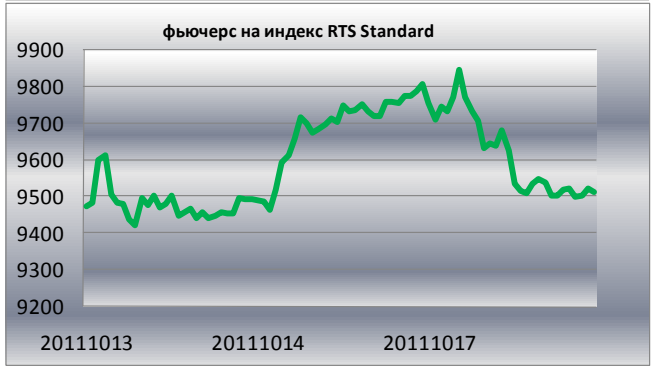
Во вторник, 18 октября, фондовые рынки завершили торговую сессию значительным ростом основных индексов, с некоторым замедлением во время вечерней сессии.

Дело в том, что агентство Moody's заявило о том, что будет обсуждать возможность понижения прогноза рейтинга Франции до "негативного" со "стабильного", ссылаясь на слабый кредитный портфель и возможность повышения долговой нагрузки в связи с оказанием помощи страдающим от долгового кризиса странам ЕС. Напоним, уже произошло снижение кредитного рейтинга Испании на две ступени до уровня А1

Фьючерс на нефть марки Brent к концу дня достиг уровня $111,36. Цена на фьючерсы на золото по итогам торгов на COMEX составила 1661,75 долларов за тройскую унцию.

По итогам дня основные индикаторы находились в отрицательной территории: ММВБ +1,58%, 1425,24 пункта), РТС (2,22%, 1438,6 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	143860	1438,60	2,22	777 994	0,19%	30 051 768 122	16,37%
ROSN-12.11	20135	201,35	0,93	110 618	0,18%	26 809 898	6,44%
LKOH-12.11	17397	1739,70	0,28	171 776	0,75%	147 352 155	7,85%
GAZR-12.11	16544	165,44	1,43	361 160	2,59%	399 585 805	7,12%
GMKR-12.11	65796	6579,60	1,07	119 266	0,11%	25 940 808	3,48%
SBRF-12.11	8051	80,51	2,29	895 144	-0,15%	1 020 237 973	7,93%
VTBR-12.11	6760	0,0676	1,94	108 618	0,64%	20 469 459	5,14%
GOLD-12.11	1670	1669,5000	1,55	72 408	-4,48%	1 045 663 360	23,06%
Si-12.11	31300	31,30	-0,97	1 260 232	0,98%	2 269 698 936	5,95%
Eu-12.11	43240	43,24	0,01	117 138	-0,05%	2 201 267	2,78%
ED-12.11	1,38	1,38	0,82	72 646	2,55%	1 824 657 502	30,65%
SBPR-12.11	6030	60,30	1,77	21 022	0,40%	3 225 299	2,53%
RTSS-12.11	9772	9772,00	1,09	55 818	0,44%	41 954 185	4,70%
BR-12.11	110	110,21	1,90	7 606	1,41%	20 502 141	50,95%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55031,93	2,08%	00:12:30
CAC 40	3141,1	-0,79%	19:35:18
DAX 30	5877,41	0,31%	19:35:31
DJ Industrial	11577,05	1,58%	00:42:54
FTSE 100	5410,35	-0,49%	19:35:22
Hang Seng	18353,46	1,53%	10:19:17
Nikkei 225	8765,29	0,27%	09:00:03
S&P 500	1225,38	2,04%	00:02:19
Brent 12.11	111,36	0,19%	01:09:18
Gold	1661,75	0,54%	10:19:18
Palladium	626,43	1,05%	10:19:25
Platinum	1548,1	0,48%	10:18:11
RTSI	1 442,01	1,03%	23:50:00
RTS_Standard	9 739,27	0,82%	23:50:00
RTSI_DEREX	1423,04	0,30%	18:45:00

Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	2,22	777994	30051768122,08	143860
ROSN-12.11	0,93	110618	26809898,00	20135
LKOH-12.11	0,28	171776	147352155,00	17397
GAZR-12.11	1,43	361160	399585805,00	16544
GMKR-12.11	1,07	119266	25940808,00	65796
SBRF-12.11	2,29	895144	1020237973,00	8051
VTBR-12.11	1,94	108618	20469459,00	6760
GOLD-12.11	1,55	72408	1045663359,61	1669,5
Si-12.11	-0,97	1260232	2269698936,00	31300
Eu-12.11	0,01	117138	2201267,00	43240
ED-12.11	0,82	72646	1824657501,67	1,379
SBPR-12.11	1,77	21022	3225299,00	6030
RTSS-12.11	1,09	55818	41954185,00	9772
BR-12.11	1,9	7 606	20502140,52	110,21

Дневная сессия

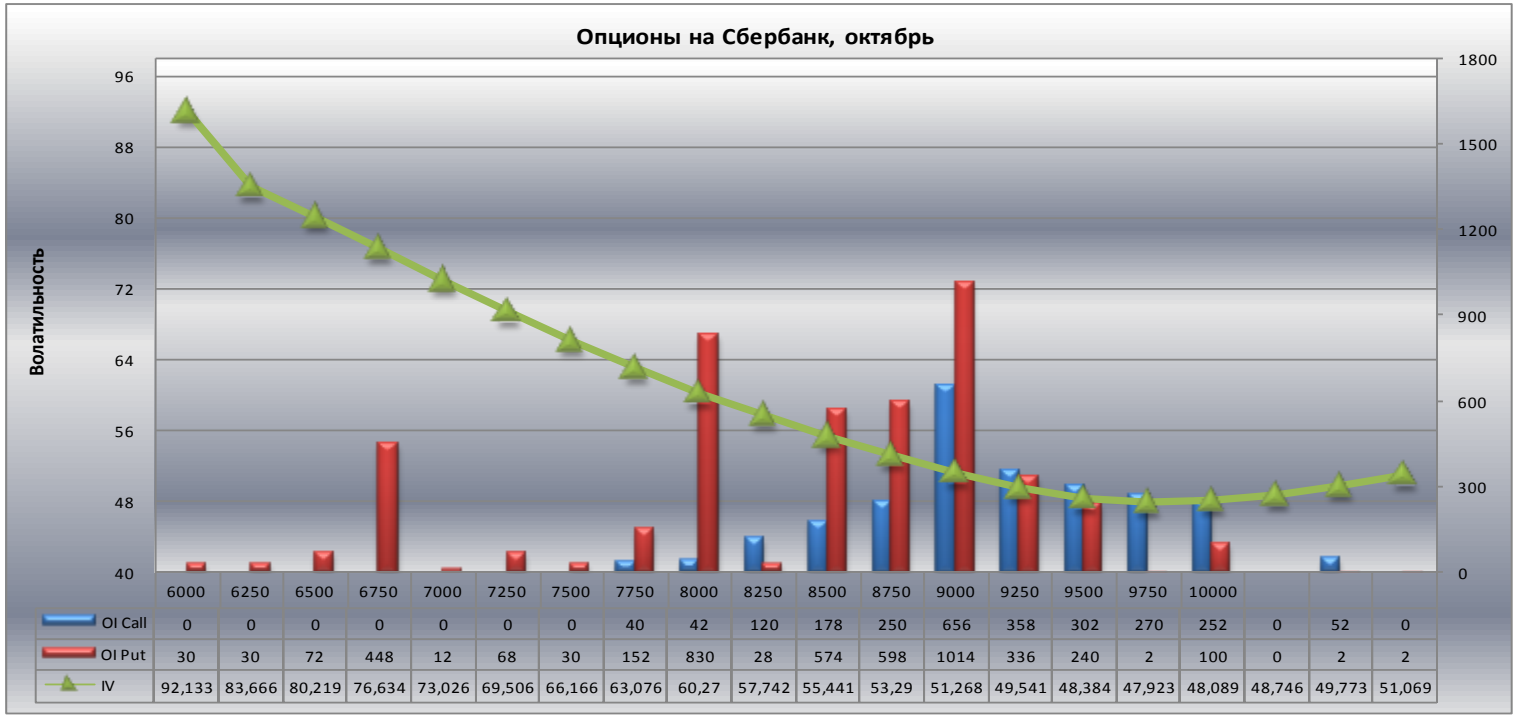
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,59	776536	183601708844,22	140730
ROSN-12.11	1,39	110416	416518089,00	19944
LKOH-12.11	2,82	170502	1878054154,00	17350
GAZR-12.11	0,9	352044	5611559847,00	16310
GMKR-12.11	2,96	119138	745354825,00	65099
SBRF-12.11	-1,02	896510	12862898652,00	7871
VTBR-12.11	0,5	107926	397991972,00	6635
GOLD-12.11	-2,5	75802	4534998470,35	1644
Si-12.11	1,16	1248042	38166011763,00	31607
Eu-12.11	0,76	117200	79202377,00	43245
ED-12.11	-0,44	70842	5953535395,56	1,3678
SBPR-12.11	0,7	20938	127688210,00	5925
RTSS-12.11	1,37	55576	892178265,00	9666,5
BR-12.11	-1,31	7 500	40239880,02	108,04

Опционы на индекс РТС, октябрь

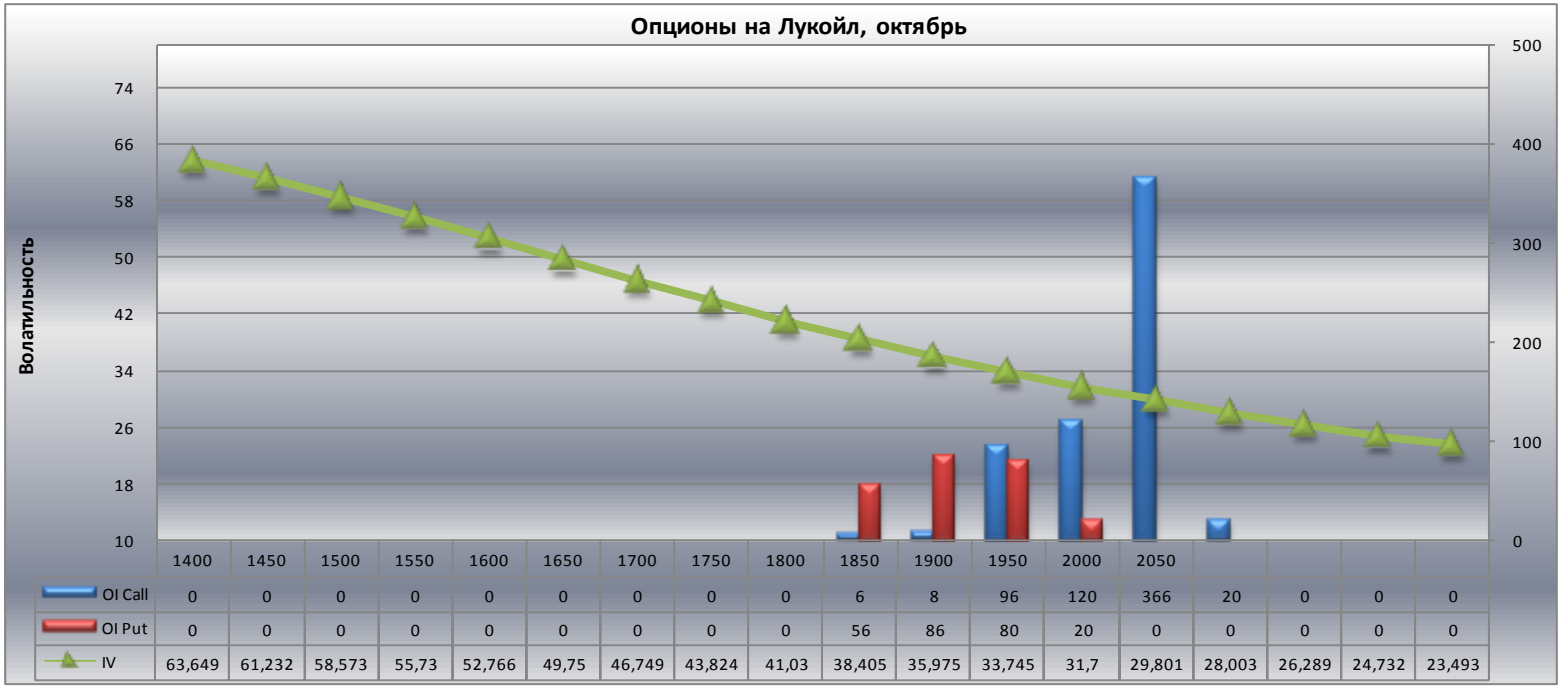


	110000	115000	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000
OI Call	0	0	28234	42	126	290	6016	3350	3110	3876	2274	1732	656	656	1016	0	0	0	0	106	16
OI Put	2202	1058	5376	6650	24690	4598	2562	400	54	20	32	4	0	0	0	0	0	0	0	0	8
IV	83,99	81,732	79,025	75,931	72,539	68,961	65,317	61,723	58,283	55,076	52,151	49,515	47,133	44,93	42,851	40,989	39,613	38,921	38,892	39,402	40,318

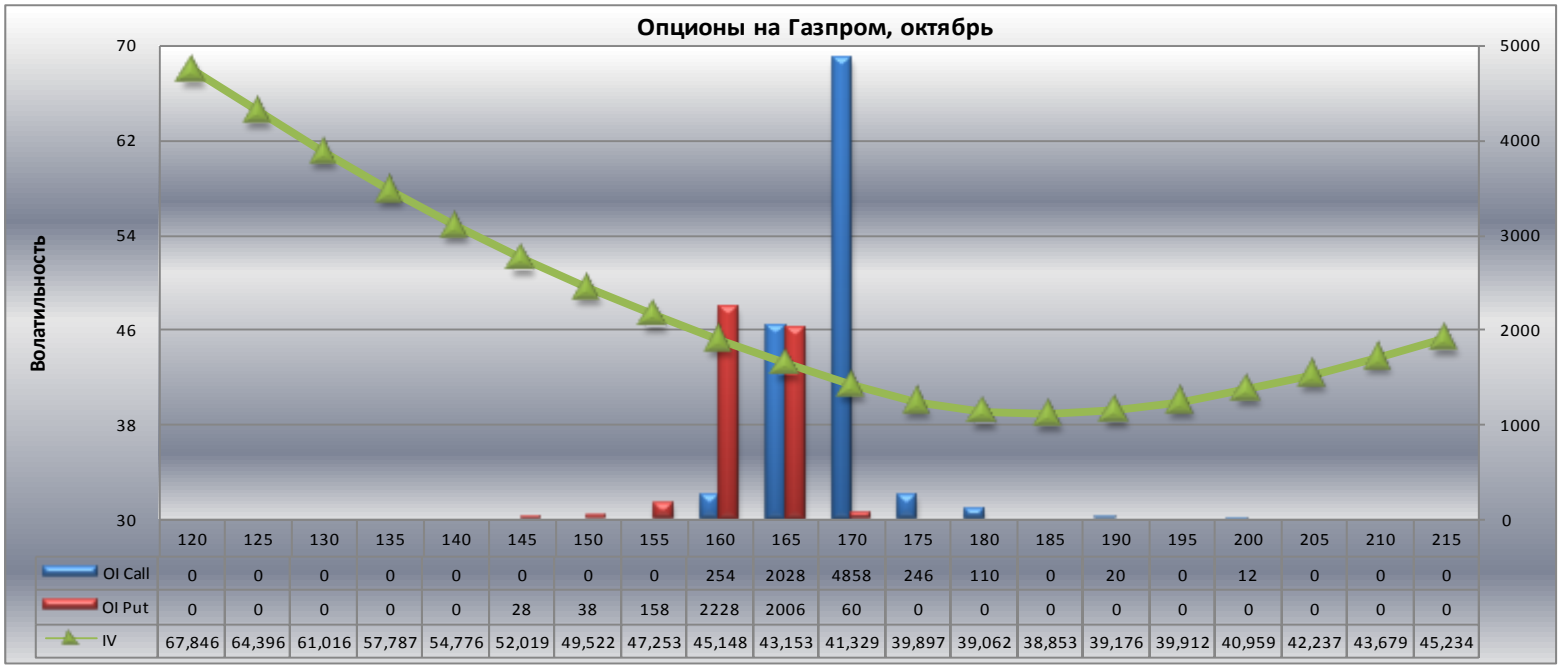
Опционы на Сбербанк, октябрь



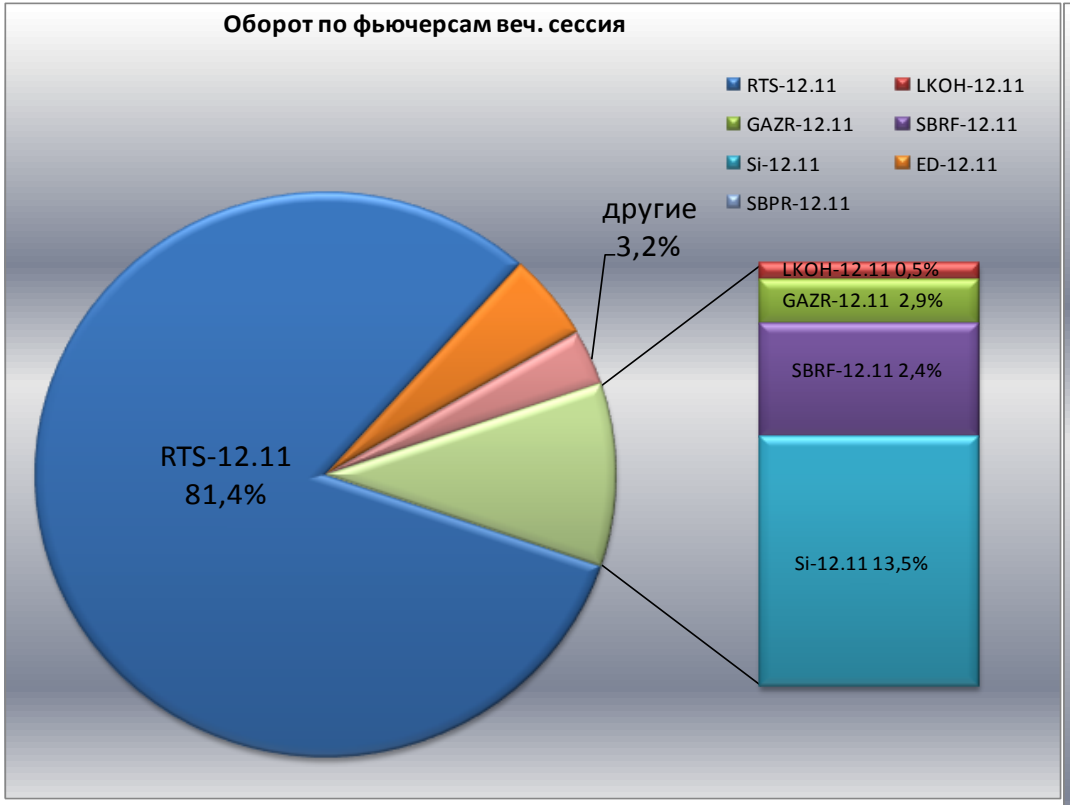
	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	40	42	120	178	250	656	358	302	270	252	0	52	0
OI Put	30	30	72	448	12	68	30	152	830	28	574	598	1014	336	240	2	100	0	2	2
IV	92,133	83,666	80,219	76,634	73,026	69,506	66,166	63,076	60,27	57,742	55,441	53,29	51,268	49,541	48,384	47,923	48,089	48,746	49,773	51,069

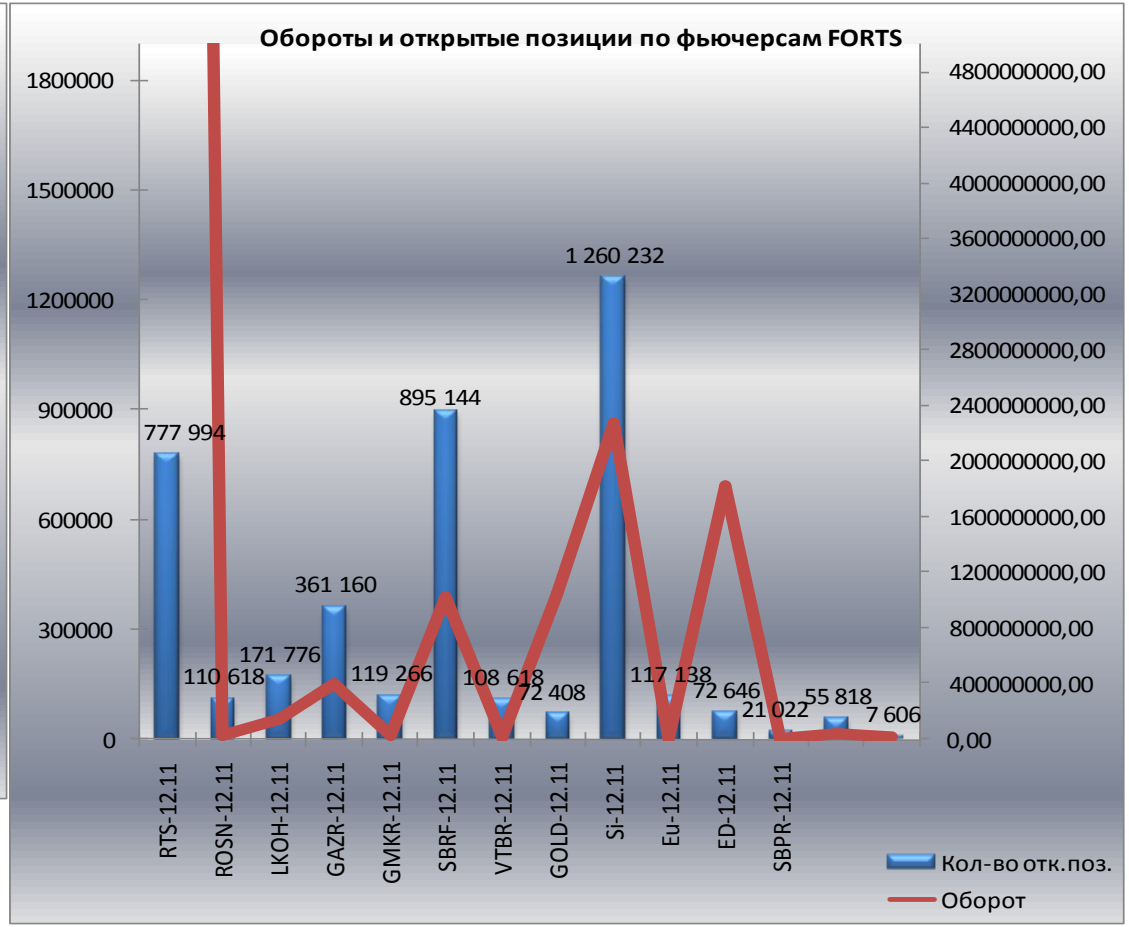


	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050				
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6	8	96	120	366	20	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	0	0	56	86	80	20	0	0	0	0	0
IV	63,649	61,232	58,573	55,73	52,766	49,75	46,749	43,824	41,03	38,405	35,975	33,745	31,7	29,801	28,003	26,289	24,732	23,493



	120	125	130	135	140	145	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195	200	205	210	215
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	254	2028	4858	246	110	0	20	0	12	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	28	38	158	2228	2006	60	0	0	0	0	0	0	0	0	0
IV	67,846	64,396	61,016	57,787	54,776	52,019	49,522	47,253	45,148	43,153	41,329	39,897	39,062	38,853	39,176	39,912	40,959	42,237	43,679	45,234


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
3,2%
RTS-12.11
81,4%
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
777 994
110 618
171 776
361 160
119 266
895 144
108 618
72 408
1 260 232
117 138
72 646
21 022
55 818
7 606
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