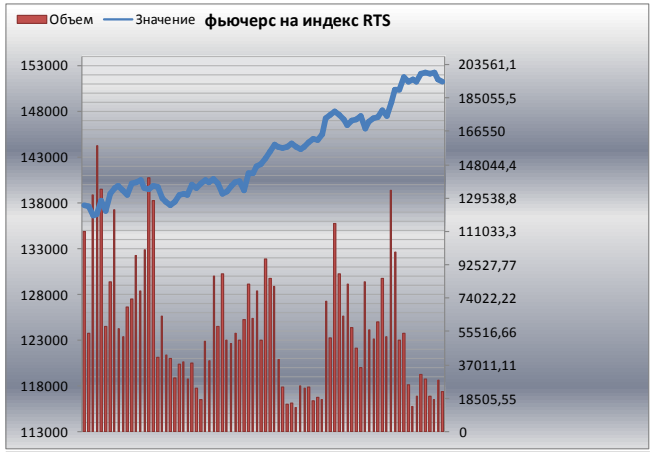
Агентство Moody's понизило кредитный рейтинг российским банкам

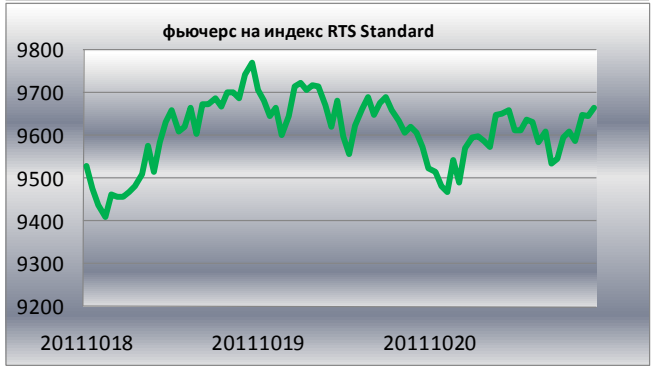
В понедельник рынки позитивно отреагировали на саммит ЕС, несмотря на то, что страны блока, в общем и целом согласовали план по рекапитализации банков, несмотря на то, что вопрос о повышении стабфонда даже не рассматривался.
Как европейские, так и американские индексы завершили торговую сессию с повышением: FTSE100 +1,08%, DAX +1,41%, CAC40 +1,55% и DowJones +0,89%, SnP500 +1,29%, Nasdaq +2,35%, соответственно.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу дня упал составил $111,203 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1658,01 за тройскую унцию.

Понижение агентством Moody's прогноза рейтинга российской банковской системы со "стабильного" до "негативного" оказало сдержанное неблагоприятное влияние на акции российских банков.

Пара доллар\рубль закрылась вчера на отметке 30,77 руб, следующим ориентиром будет снижение ниже уровня 30,5 руб.





	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	151270	1512,70	0,57	1 019 940	-0,45%	24 411 192 330	18,14%
ROSN-12.11	21102	211,02	0,49	106 230	-0,08%	15 106 061	4,93%
LKOH-12.11	17890	1789,00	0,08	166 276	-0,01%	61 862 467	3,66%
GAZR-12.11	17163	171,63	0,38	398 608	0,21%	239 262 012	5,28%
GMKR-12.11	64931	6493,10	0,51	138 576	0,31%	28 255 872	5,41%
SBRF-12.11	8494	84,94	0,15	930 158	0,27%	817 774 481	10,28%
VTBR-12.11	7190	0,0719	0,28	103 024	-3,67%	11 379 635	3,23%
GOLD-12.11	1655	1655,0000	-0,10	80 232	-2,50%	372 189 227	17,81%
Si-12.11	30773	30,77	-0,30	1 254 588	0,65%	1 563 487 272	4,44%
Eu-12.11	42776	42,78	-0,17	116 980	-0,16%	9 127 366	8,01%
ED-12.11	1,39	1,39	0,27	78 222	6,51%	784 923 944	16,38%
SBPR-12.11	6389	63,89	0,52	28 046	0,66%	2 084 903	3,66%
RTSS-12.11	10151	10150,50	0,72	64 934	0,07%	21 151 370	3,78%
BR-12.11	110	109,94	0,57	8 776	-10,56%	18 786 255	57,50%

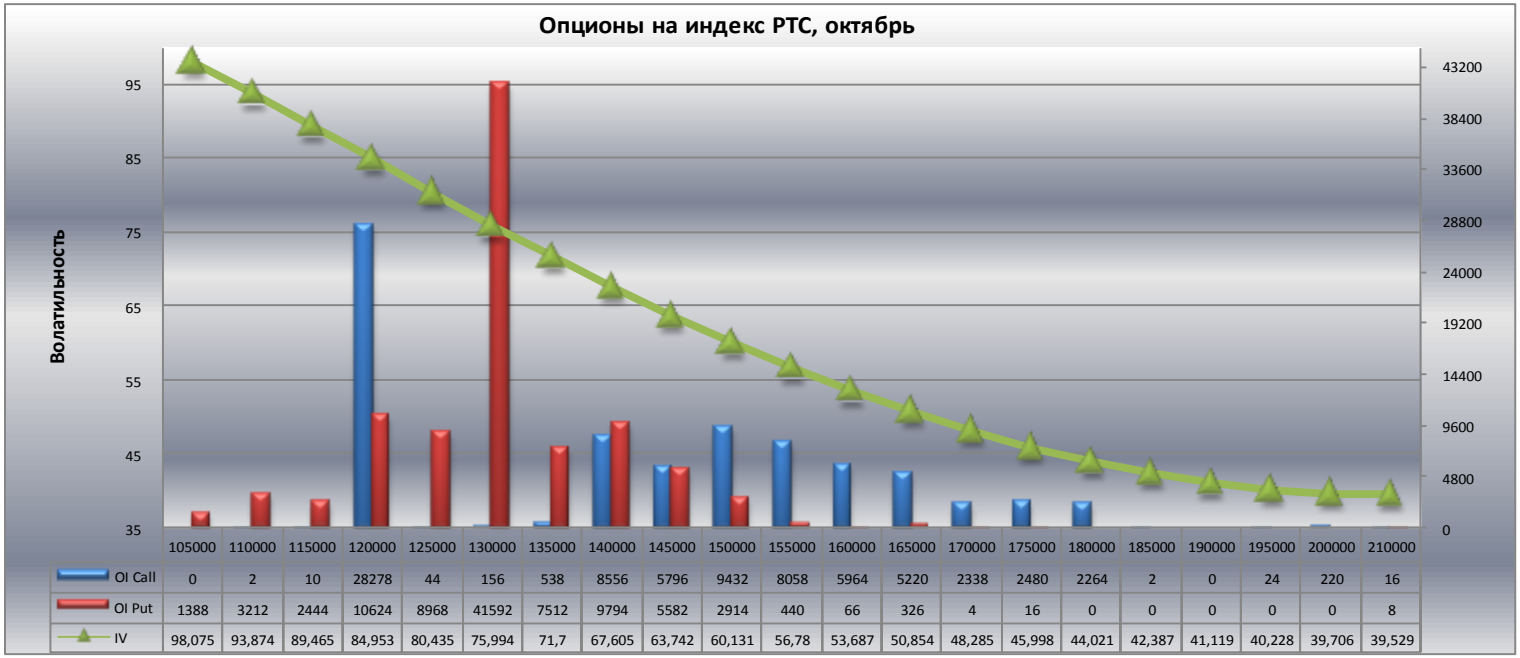
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56891,97	2,96%	00:12:30
CAC 40	3220,46	1,55%	19:35:18
DAX 30	6055,27	1,41%	19:35:31
DJ Industrial	11913,62	0,89%	00:42:54
FTSE 100	5548,06	1,08%	19:35:22
Hang Seng	18834,88	0,34%	10:19:17
Nikkei 225	8762,89	-0,92%	09:00:03
S&P 500	1254,19	1,29%	00:02:19
Brent 12.11	111,20304	-0,22%	01:09:18
Gold	1658,01	0,35%	10:19:18
Palladium	645,3	1,07%	10:19:25
Platinum	1558,6	1,08%	10:18:11
RTSI	1 515,63	0,45%	23:50:00
RTS_Standard	10 086,46	0,32%	23:50:00
RTSI_DEREX	1511,81	2,85%	18:45:00

Вечерняя сессия

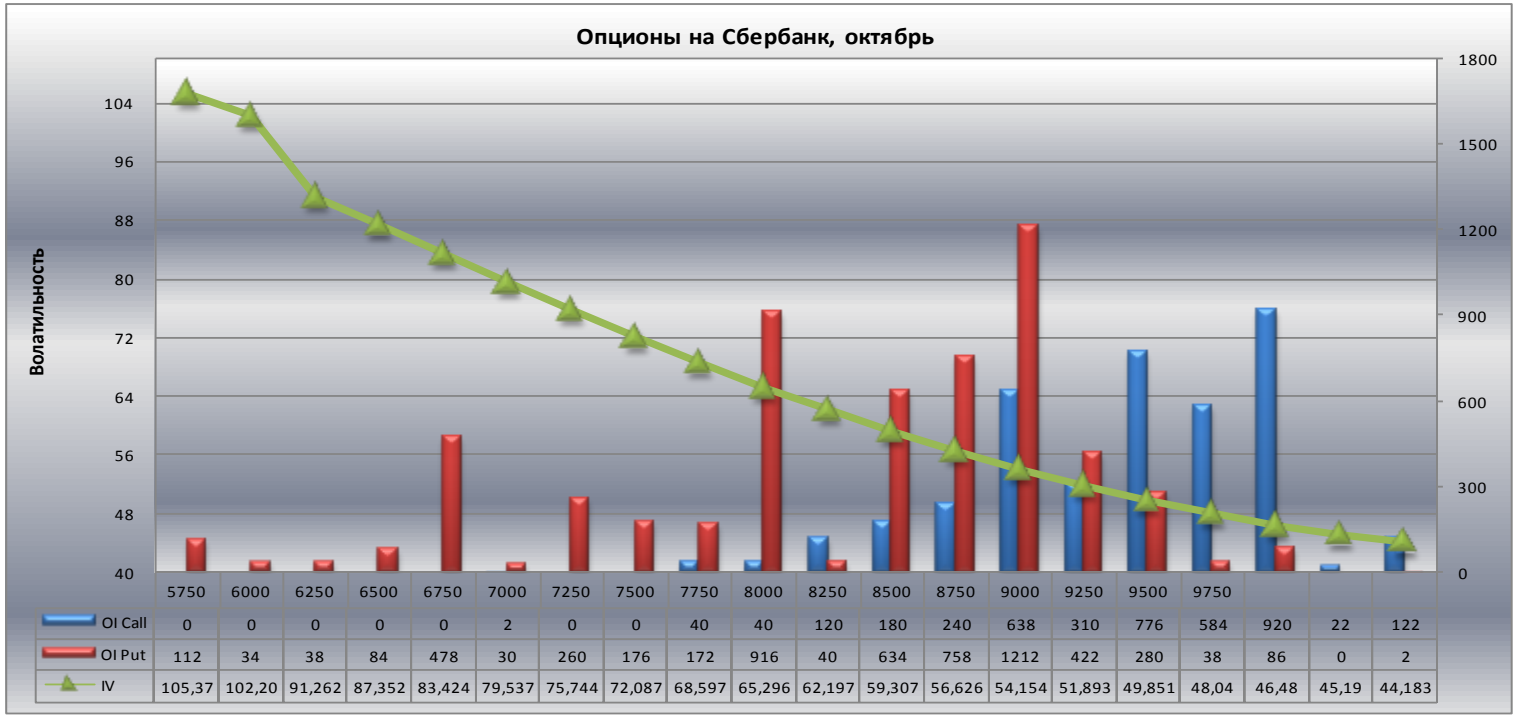
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,57	1019940	24411192329,70	151270
ROSN-12.11	0,49	106230	15106061,00	21102
LKOH-12.11	0,08	166276	61862467,00	17890
GAZR-12.11	0,38	398608	239262012,00	17163
GMKR-12.11	0,51	138576	28255872,00	64931
SBRF-12.11	0,15	930158	817774481,00	8494
VTBR-12.11	0,28	103024	11379635,00	7190
GOLD-12.11	-0,1	80232	372189227,42	1655
Si-12.11	-0,3	1254588	1563487272,00	30773
Eu-12.11	-0,17	116980	9127366,00	42776
ED-12.11	0,27	78222	784923944,33	1,3909
SBPR-12.11	0,52	28046	2084903,00	6389
RTSS-12.11	0,72	64934	21151370,00	10150,5
BR-12.11	0,57	8 776	18786254,79	109,94

Дневная сессия

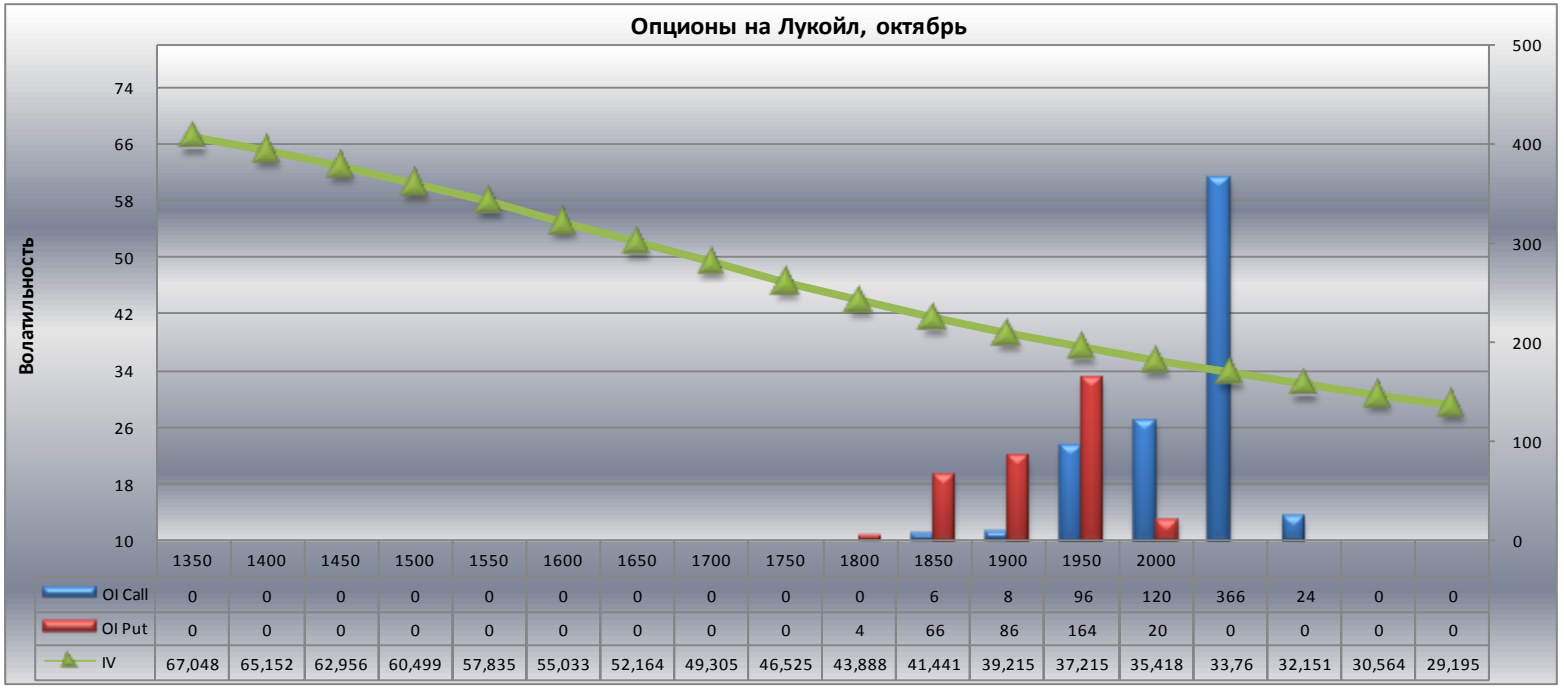
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	4,42	1024544	134597768786,67	150415
ROSN-12.11	4	106318	306122096,00	21000
LKOH-12.11	1,84	166286	1689714387,00	17882
GAZR-12.11	2,26	397786	4530266728,00	17100
GMKR-12.11	0,75	138142	522435171,00	64555
SBRF-12.11	2,82	927620	7958816441,00	8481
VTBR-12.11	-1,08	106944	352373234,00	6569
GOLD-12.11	0,82	82288	2090247144,33	1656,4
Si-12.11	-1,65	1246490	35214659384,00	30866
Eu-12.11	-1,45	117172	113879664,00	42846
ED-12.11	0,12	73442	4791483277,42	1,387
SBPR-12.11	1,74	27862	56973910,00	6356
RTSS-12.11	2,51	64886	559750505,00	10078
BR-12.11	-0,47	9 812	32668961,36	109,32



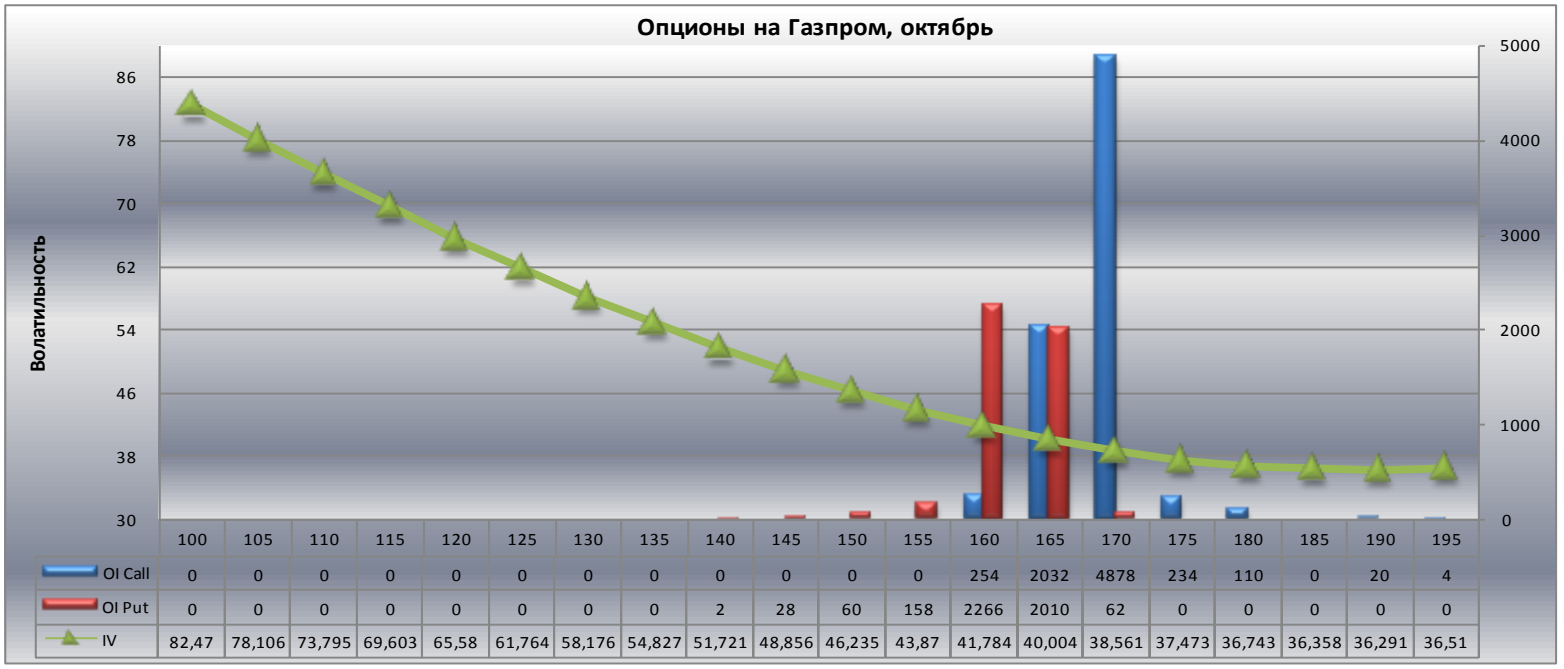
	105000	110000	115000	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	210000
OI Call	0	2	10	28278	44	156	538	8556	5796	9432	8058	5964	5220	2338	2480	2264	2	0	24	220	16
OI Put	1388	3212	2444	10624	8968	41592	7512	9794	5582	2914	440	66	326	4	16	0	0	0	0	0	8
IV	98,075	93,874	89,465	84,953	80,435	75,994	71,7	67,605	63,742	60,131	56,78	53,687	50,854	48,285	45,998	44,021	42,387	41,119	40,228	39,706	39,529



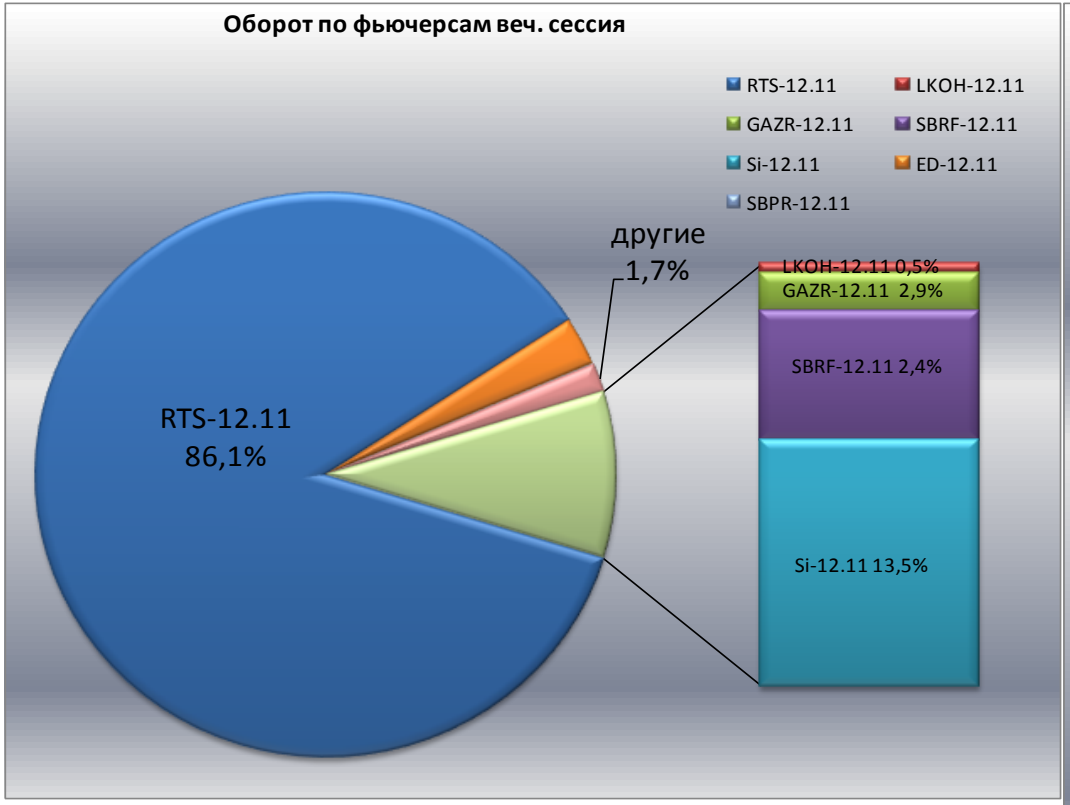
	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750			
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	0	40	40	120	180	240	638	310	776	584	920	22	122
OI Put	112	34	38	84	478	30	260	176	172	916	40	634	758	1212	422	280	38	86	0	2
IV	105,37	102,20	91,262	87,352	83,424	79,537	75,744	72,087	68,597	65,296	62,197	59,307	56,626	54,154	51,893	49,851	48,04	46,48	45,19	44,183

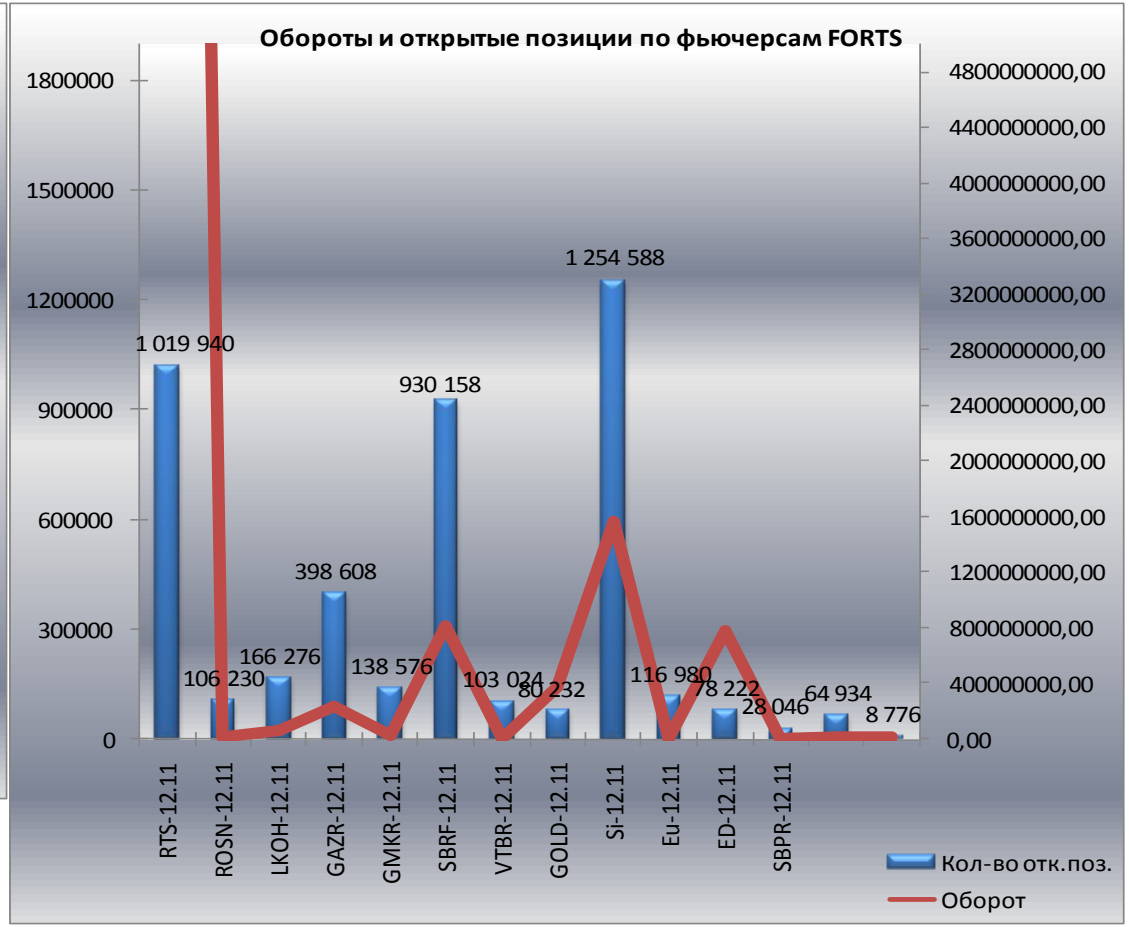


	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000				
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6	8	96	120	366	24	0	0
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4	66	86	164	20	0	0	0	0
IV	67,048	65,152	62,956	60,499	57,835	55,033	52,164	49,305	46,525	43,888	41,441	39,215	37,215	35,418	33,76	32,151	30,564	29,195



	100	105	110	115	120	125	130	135	140	145	150	155	160	165	170	175	180	185	190	195
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	254	2032	4878	234	110	0	20	4
OI Put	0	0	0	0	0	0	0	0	2	28	60	158	2266	2010	62	0	0	0	0	0
IV	82,47	78,106	73,795	69,603	65,58	61,764	58,176	54,827	51,721	48,856	46,235	43,87	41,784	40,004	38,561	37,473	36,743	36,358	36,291	36,51


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
1,7%
RTS-12.11
86,1%
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
1 019 940
106 230
166 276
398 608
138 576
930 158
103 024
80 232
1 254 588
116 980
78 222
28 046
64 934
8 776
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