Пятничные торги прошли спокойно

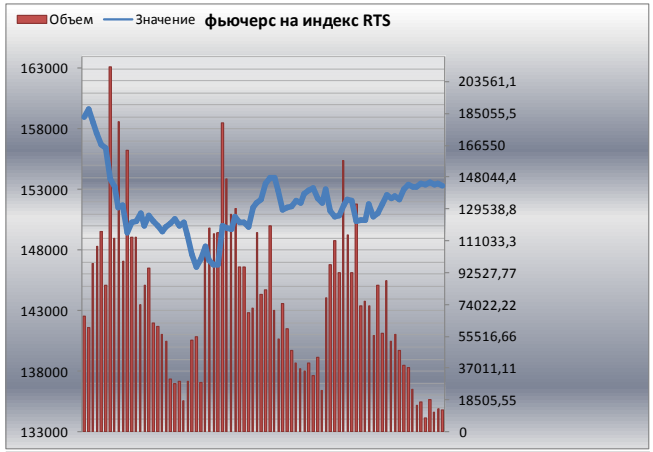
В прошедшую пятницу торги проходили довольно спокойно: волатильность заметно уменьшилась, индексы закрыли вечернюю торговую сессию с некоторым ростом. Понижение рейтинга Франции международным агентством S&P было признано ошибочным, а верхняя палата парламента Италии одобрила закон о финансовой стабильности, к тому же бонды немного «подешевели».

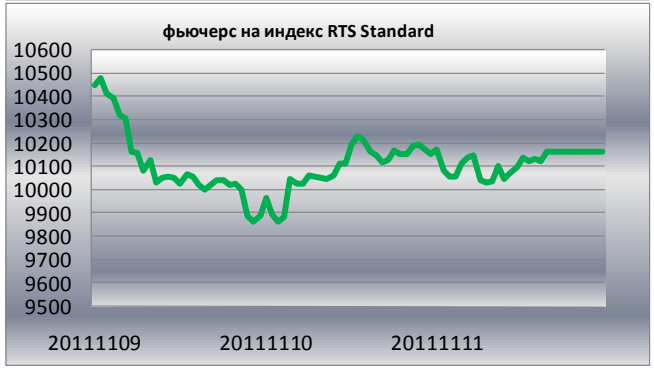
Фьючерс на нефть марки Brent колеблется возле отметки в $115 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1794,38 за тройскую унцию

По итогам торговой сессии 11 ноября индекс ММВБ понизился на 0,31% - до 1484,97 пункта, РТС вырос на 0,06% и достиг отметки 1530,7 пункта.

При росте цен на нефть акции ведущих компаний российского нефтегазового сектора, за исключением Газпрома (+0,29%), немного упали в цене.

Лучше рынка выглядели бумаги электроэнергетики, такие как ФСК ЕЭС, Иркутскэнерго (+2,77,%) и Э.ОНРоссия (+2,74%), а также акции Северстали(+3,56%).





	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	153305	1533,05	0,75	862 068	0,18%	18 262 140 412	9,98%
ROSN-12.11	22057	220,57	0,40	102 484	-0,26%	10 734 661	2,07%
LKOH-12.11	17454	1745,40	0,28	166 660	-0,84%	80 910 261	3,33%
GAZR-12.11	18481	184,81	0,25	341 294	-0,68%	195 826 630	3,62%
GMKR-12.11	55500	5550,00	0,34	137 496	0,15%	20 463 134	5,18%
SBRF-12.11	8197	81,97	0,84	1 025 386	-0,30%	676 421 654	6,67%
VTBR-12.11	7270	0,0727	0,55	96 484	0,74%	9 919 986	4,73%
GOLD-12.11	1793	1793,4000	0,67	80 612	-3,39%	259 283 065	25,77%
Si-12.11	30525	30,53	-0,33	1 592 250	0,74%	1 822 640 151	5,94%
Eu-12.11	42015	42,02	0,17	120 968	0,09%	6 292 819	3,09%
ED-12.11	1,38	1,38	0,54	69 808	-6,20%	942 898 693	24,21%
SBPR-12.11	6458	64,58	0,39	59 306	0,08%	678 493	1,85%
RTSS-12.11	10163	10162,50	0,38	72 550	0,00%	304 850	0,12%
BR-12.11	108	107,80	2,80	3 222	-51,56%	32 770 034	29,04%

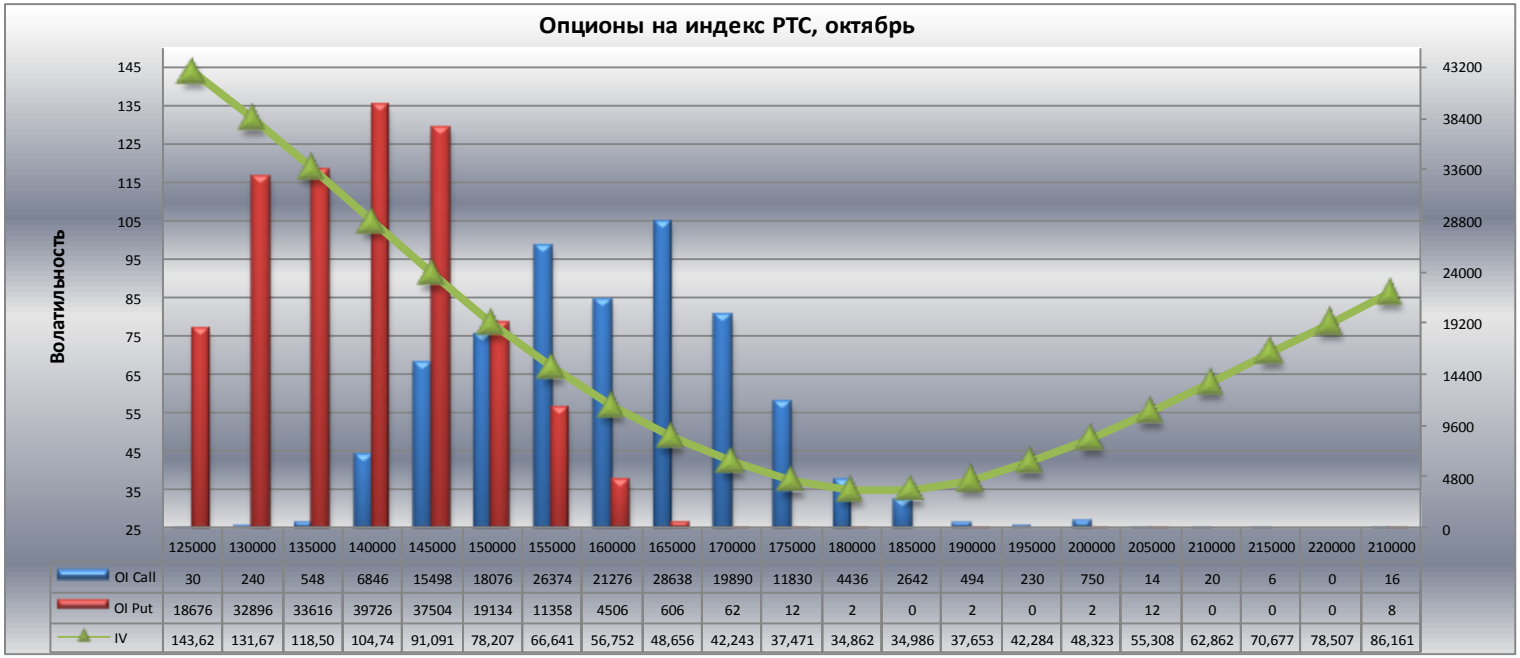
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58546,97	2,14%	00:12:30
CAC 40	3149,38	2,76%	19:35:18
DAX 30	6057,03	3,23%	19:35:31
DJ Industrial	12153,68	2,19%	00:42:54
FTSE 100	5545,38	1,85%	19:35:22
Hang Seng	19579,79	2,31%	10:19:17
Nikkei 225	8616,82	1,20%	09:00:03
S&P 500	1263,85	1,95%	00:02:19
Brent 12.11	114,4425	0,25%	01:09:18
Gold	1794,38	0,35%	10:19:18
Palladium	665,2	0,36%	10:19:25
Platinum	1658,94	0,74%	10:18:11
RTSI	1 538,16	0,44%	23:50:00
RTS_Standard	10 132,59	0,27%	23:50:00
RTSI_DEREX	1524,43	-0,20%	18:45:00

Вечерняя сессия

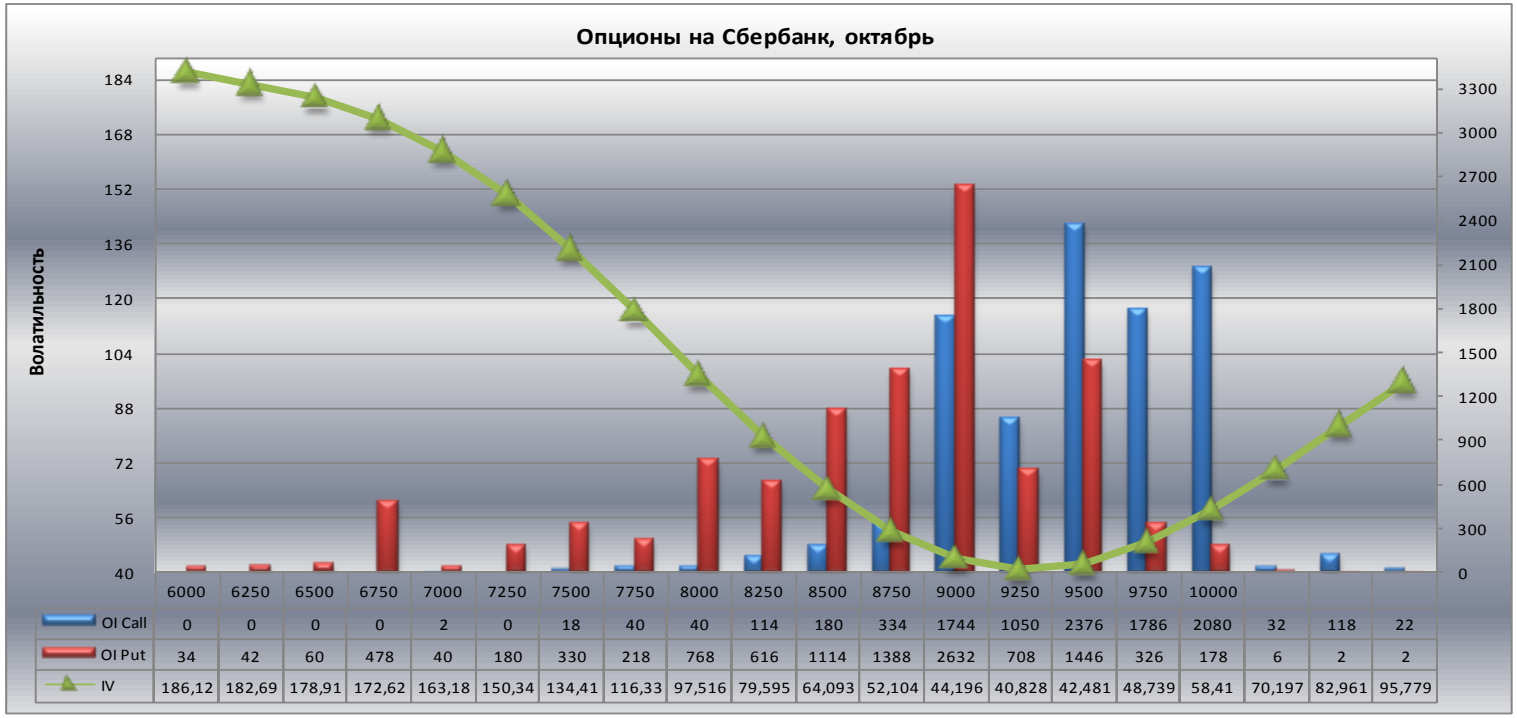
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,75	862068	18262140411,75	153305
ROSN-12.11	0,4	102484	10734661,00	22057
LKOH-12.11	0,28	166660	80910261,00	17454
GAZR-12.11	0,25	341294	195826630,00	18481
GMKR-12.11	0,34	137496	20463134,00	55500
SBRF-12.11	0,84	1025386	676421654,00	8197
VTBR-12.11	0,55	96484	9919986,00	7270
GOLD-12.11	0,67	80612	259283064,96	1793,4
Si-12.11	-0,33	1592250	1822640151,00	30525
Eu-12.11	0,17	120968	6292819,00	42015
ED-12.11	0,54	69808	942898692,73	1,377
SBPR-12.11	0,39	59306	678493,00	6458
RTSS-12.11	0,38	72550	304850,00	10162,5
BR-12.11	2,8	3 222	32770034,49	107,8

Дневная сессия

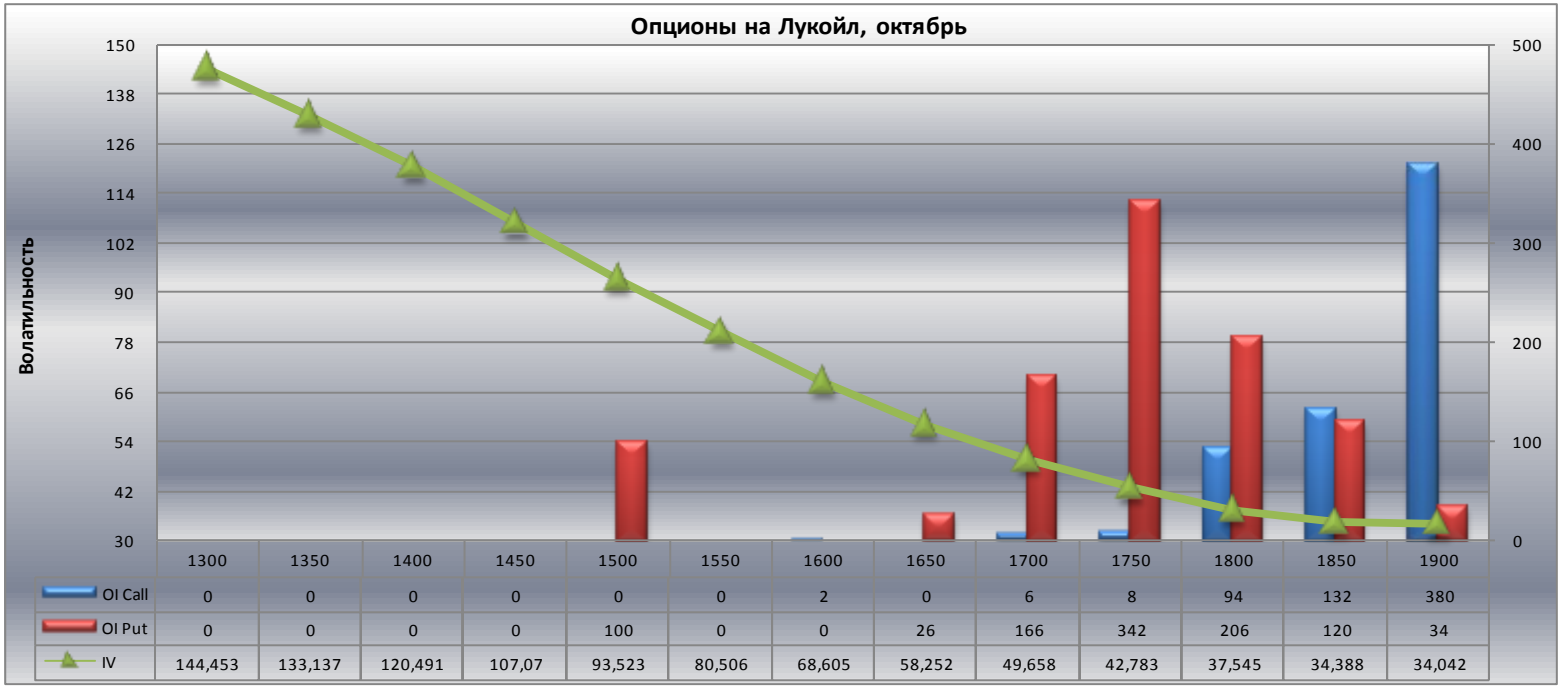
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,49	860504	182899439341,31	152160
ROSN-12.11	-1,14	102748	517412510,00	21969
LKOH-12.11	-2,85	168076	2431599576,00	17404
GAZR-12.11	0,07	343642	5406435927,00	18433
GMKR-12.11	-2,07	137294	395377344,00	55313
SBRF-12.11	0,62	1028498	10138974964,00	8129
VTBR-12.11	-1,09	95780	209605325,00	7230
GOLD-12.11	0,5	83438	1006025375,45	1781,4
Si-12.11	-0,2	1580536	30693497742,00	30627
Eu-12.11	0,51	120854	203775942,00	41944
ED-12.11	0,56	74420	3894827898,52	1,3696
SBPR-12.11	1,07	59260	36692714,00	6438
RTSS-12.11	-0,38	72550	265014230,00	10125
BR-12.11	0,89	6 652	112828245,94	112,94



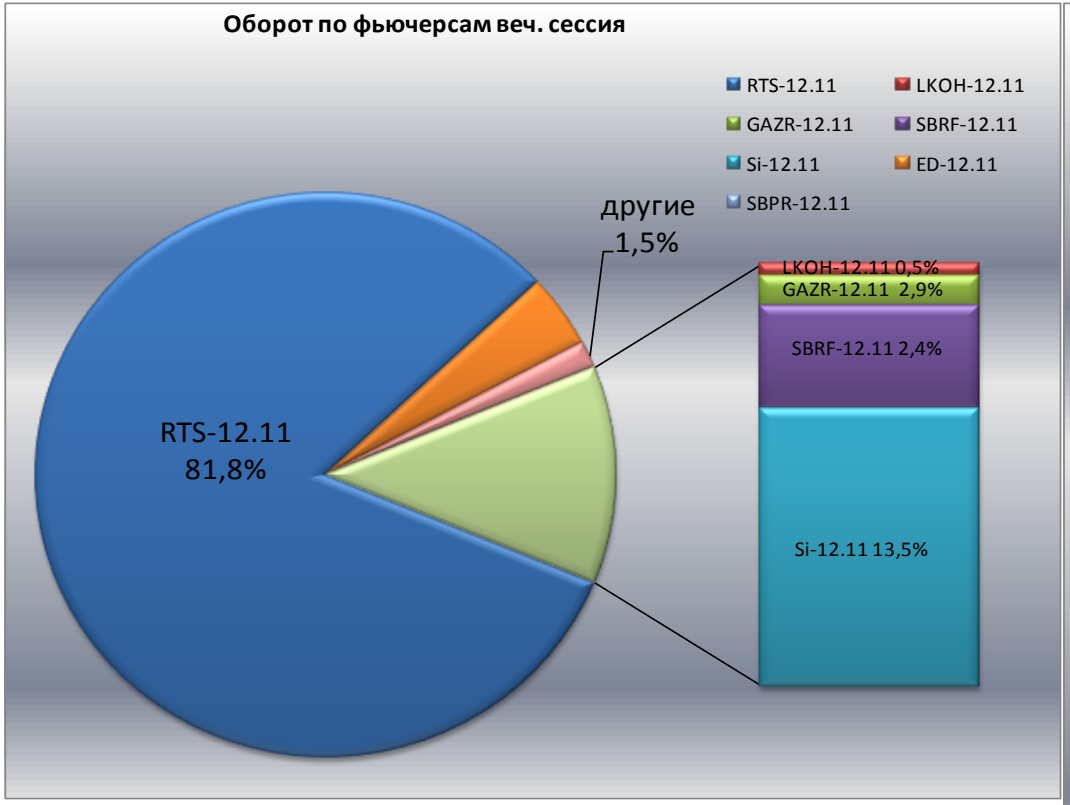
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	30	240	548	6846	15498	18076	26374	21276	28638	19890	11830	4436	2642	494	230	750	14	20	6	0	16
OI Put	18676	32896	33616	39726	37504	19134	11358	4506	606	62	12	2	0	2	0	2	12	0	0	0	8
IV	143,62	131,67	118,50	104,74	91,091	78,207	66,641	56,752	48,656	42,243	37,471	34,862	34,986	37,653	42,284	48,323	55,308	62,862	70,677	78,507	86,161

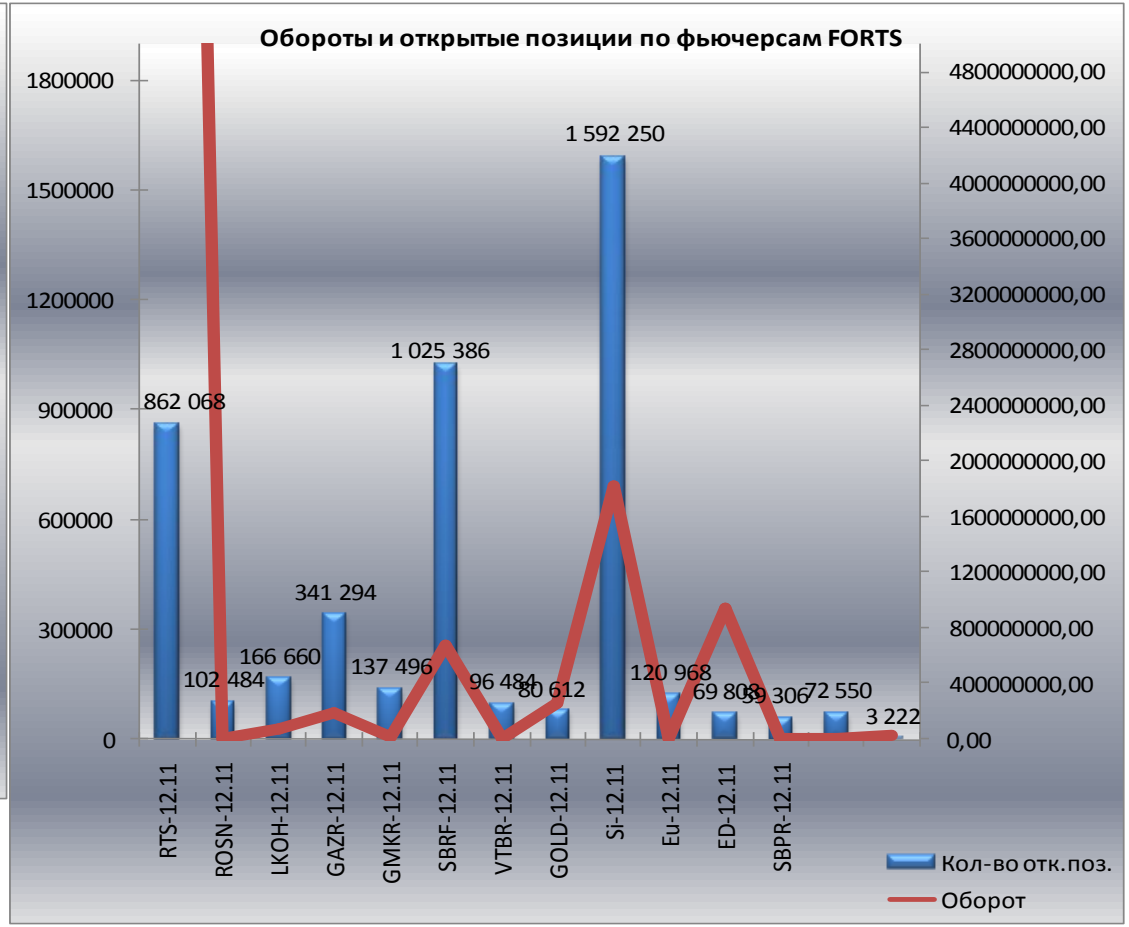


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	2	0	18	40	40	114	180	334	1744	1050	2376	1786	2080	32	118	22
OI Put	34	42	60	478	40	180	330	218	768	616	1114	1388	2632	708	1446	326	178	6	2	2
IV	186,12	182,69	178,91	172,62	163,18	150,34	134,41	116,33	97,516	79,595	64,093	52,104	44,196	40,828	42,481	48,739	58,41	70,197	82,961	95,779


Опционы на Лукойл, октябрь
Волатильность
150
138
126
114
102
90
78
66
54
42
30
500
400
300
200
100
0
1300 1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800 1850 1900
OI Call 0 0 0 0 0 0 2 0 6 8 94 132 380
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 26 166 342 206 120 34
IV 144,453 133,137 120,491 107,07 93,523 80,506 68,605 58,252 49,658 42,783 37,545 34,388 34,042


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
150
138
126
114
102
90
78
66
54
42
30
1500
1250
1000
750
500
250
0
120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200 205 210 220
OI Call 0 0 0 0 0 0 2 0 6 8 94 132 380 22 164 0 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 26 166 342 206 120 34 0 0 0 0 0 0 0
IV 144,45 133,13 120,49 107,07 93,523 80,506 68,605 58,252 49,658 42,783 37,545 34,388 34,042 36,473 41,101 47,32 54,618 62,57 70,827 87,185


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
1,5%
RTS-12.11
81,8%
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
862 068
102 484
166 660
341 294
137 496
1 025 386
96 484
80 612
1 592 250
120 968
69 808
39 306
72 550
3 222
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