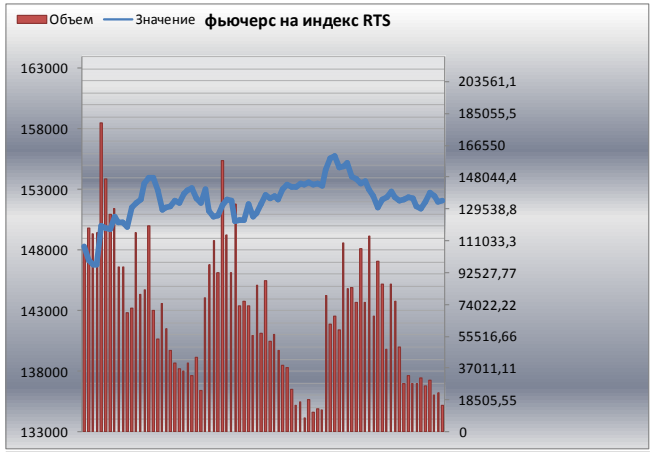
Позитив на фоне отставки Берлускони не продлился долго

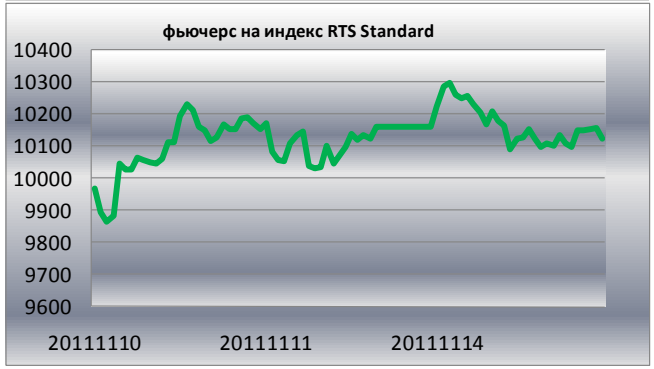
Инвесторы сомневаются в том, что смена итальянского премьера сможет спасти страну от долгового кризиса. Если утренние торги еще шли позитивно, то ближе к вчеру настроения поменялись: как оказалось, на состоявшемся аукционе по размещению 5летних итальянских облигаций на сумму 3 млрд долл их доходность составила 6,29%, а для первичных бумаг это небывалая доходность. Просели как европейские, так и американские рынки. К тому же, наихудшую динамику показал финансовый сектор, т.к. рейтинговое агентство Moody's всерьез намеревается пересмотреть кредитный рейтинг Credit Suisse.

Фьючерс на нефть марки Brent составил в $112,28 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1770,66 за тройскую унцию

По итогам вечерней торговой сессии 11 ноября индекс ММВБ понизился на 0,04% до 1484,38 пункта, РТС вырос на 0,02% и достиг отметки 1527,41 пункта.

Лучше рынка выглядели бумаги нефтяного сектора рынка, такие как Новатэк (+1,83,%), Сургутнефтегаз и Татнефть (+0,97%).





	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	152105	1521,05	0,03	878 048	-0,18%	24 196 809 254	15,87%
ROSN-12.11	22148	221,48	0,26	101 612	-0,31%	19 396 126	6,91%
LKOH-12.11	17367	1736,70	0,57	167 980	0,17%	95 638 066	6,18%
GAZR-12.11	18419	184,19	0,20	356 466	-0,81%	263 676 817	6,19%
GMKR-12.11	55200	5520,00	0,55	137 186	-0,16%	41 008 149	9,90%
SBRF-12.11	8032	80,32	-0,22	991 160	-1,11%	558 305 022	5,99%
VTBR-12.11	7199	0,0720	-0,03	94 284	0,17%	4 023 687	1,75%
GOLD-12.11	1786	1785,5000	-0,25	80 616	-0,10%	80 881 399	9,07%
Si-12.11	30720	30,72	0,23	1 576 812	-0,47%	1 291 093 480	4,65%
Eu-12.11	41871	41,87	0,12	117 116	0,04%	9 117 200	6,13%
ED-12.11	1,36	1,36	-0,19	64 474	-0,78%	635 980 204	16,86%
SBPR-12.11	6393	63,93	-0,42	65 180	0,00%	940 814	1,87%
RTSS-12.11	10125	10124,50	0,27	72 874	-0,01%	12 048 090	4,01%
BR-12.11	108	107,80	2,80	3 222	-66,72%	32 770 034	20,56%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58258,23	-0,49%	00:12:30
CAC 40	3108,95	-1,28%	19:35:18
DAX 30	5985,02	-1,19%	19:35:31
DJ Industrial	12078,98	-0,62%	00:42:54
FTSE 100	5519,04	-0,48%	19:35:22
Hang Seng	19266,38	-1,24%	10:19:17
Nikkei 225	8530,65	-0,85%	09:00:03
S&P 500	1251,78	-0,96%	00:02:19
Brent 12.11	112,28	0,35%	01:09:18
Gold	1770,66	-0,44%	10:19:18
Palladium	662	-0,35%	10:19:25
Platinum	1638,3	-0,35%	10:18:11
RTSI	1 527,41	0,02%	23:50:00
RTS_Standard	10 087,78	0,15%	23:50:00
RTSI_DEREX	1521,43	-0,79%	18:45:00

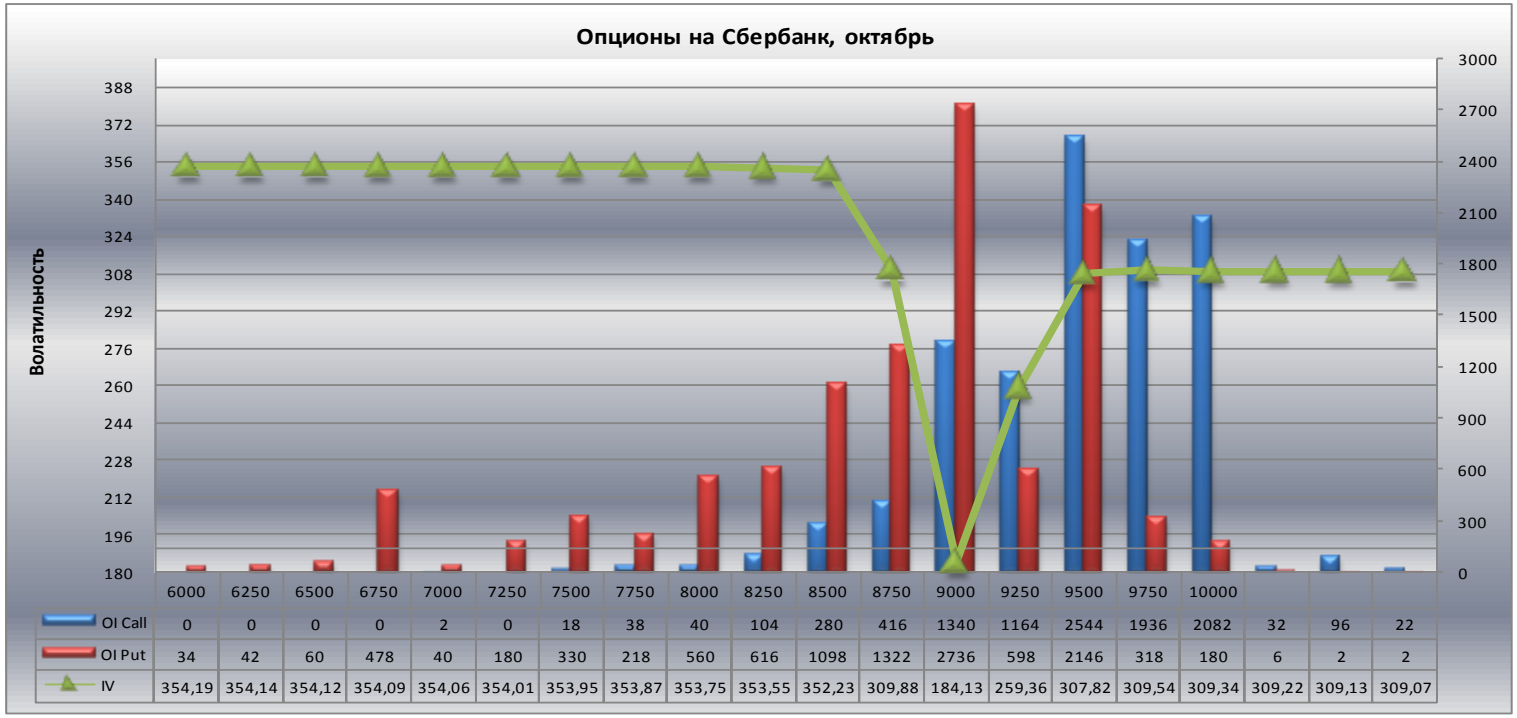
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,03	878048	24196809254,18	152105
ROSN-12.11	0,26	101612	19396126,00	22148
LKOH-12.11	0,57	167980	95638066,00	17367
GAZR-12.11	0,2	356466	263676817,00	18419
GMKR-12.11	0,55	137186	41008149,00	55200
SBRF-12.11	-0,22	991160	558305022,00	8032
VTBR-12.11	-0,03	94284	4023687,00	7199
GOLD-12.11	-0,25	80616	80881398,57	1785,5
Si-12.11	0,23	1576812	1291093480,00	30720
Eu-12.11	0,12	117116	9117200,00	41871
ED-12.11	-0,19	64474	635980203,99	1,3621
SBPR-12.11	-0,42	65180	940814,00	6393
RTSS-12.11	0,27	72874	12048090,00	10124,5
BR-12.11	2,8	3 222	32770034,49	107,8

Дневная сессия

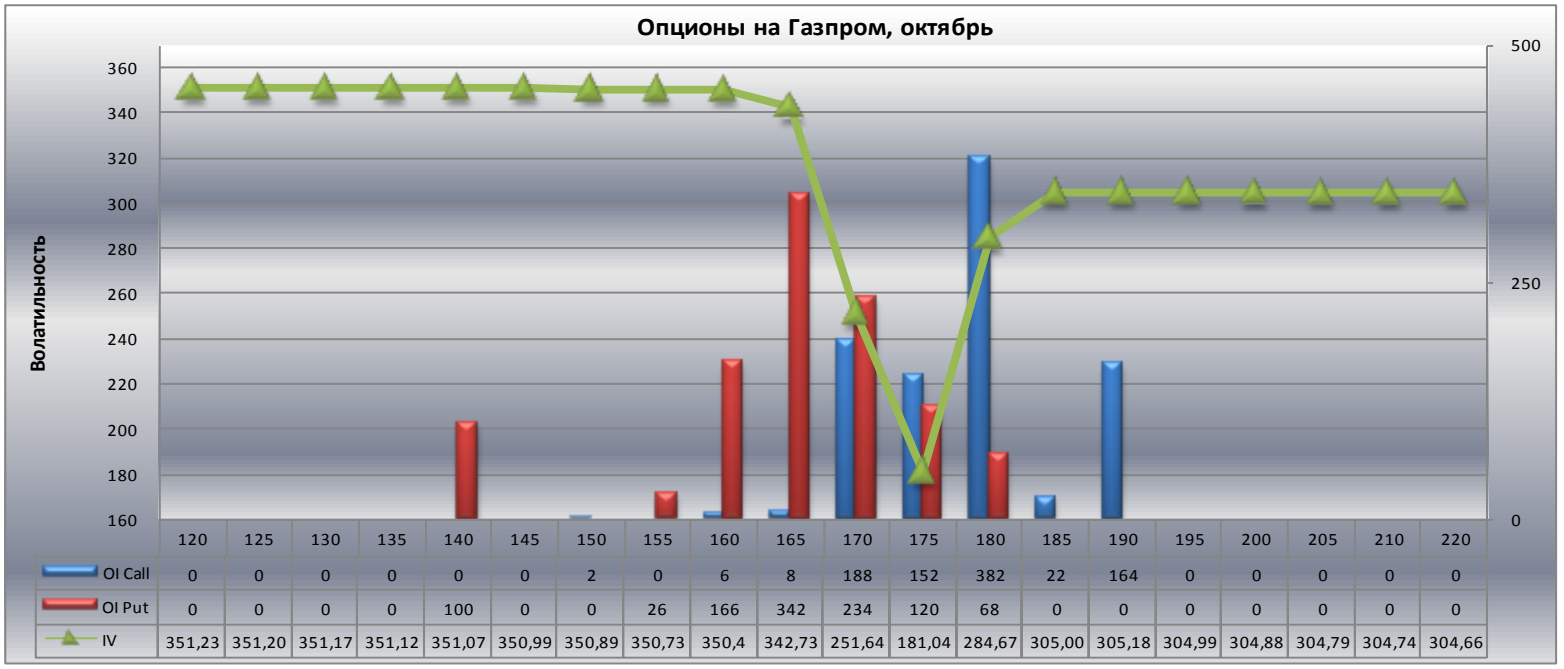
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,07	879658	152435898798,79	152060
ROSN-12.11	0,56	101930	280726871,00	22091
LKOH-12.11	-0,79	167692	1548753403,00	17266
GAZR-12.11	-0,27	359384	4260387099,00	18383
GMKR-12.11	-0,75	137408	414348431,00	54900
SBRF-12.11	-0,97	1002314	9326481022,00	8050
VTBR-12.11	-0,4	94120	229449681,00	7201
GOLD-12.11	0,37	80698	891894693,28	1788
Si-12.11	0,07	1584250	27749947038,00	30648
Eu-12.11	-0,3	117070	148776533,00	41820
ED-12.11	-0,36	64984	3773173460,60	1,3647
SBPR-12.11	-0,23	65180	50392301,00	6423
RTSS-12.11	-0,27	72882	300428880,00	10098
BR-12.11	-0,85	9 682	159406747,54	111,98


Опционы на индекс РТС, октябрь
Волатильность
205
189
173
157
141
125
109
93
77
61
45
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 220000 210000
OI Call 30 240 504 6790 14824 18456 28618 20440 29866 18970 11406 4224 2488 454 230 750 14 20 6 0 16
OI Put 18244 32126 32026 33112 36870 29968 13860 4476 602 46 12 2 0 2 0 2 12 0 0 0 8
IV 208,74 204,96 197,85 186,27 169,71 148,85 125,53 102,54 82,731 68,043 56,975 50,34 56,224 68,734 84,651 101,79 118,55 133,81 146,97 157,82 166,42

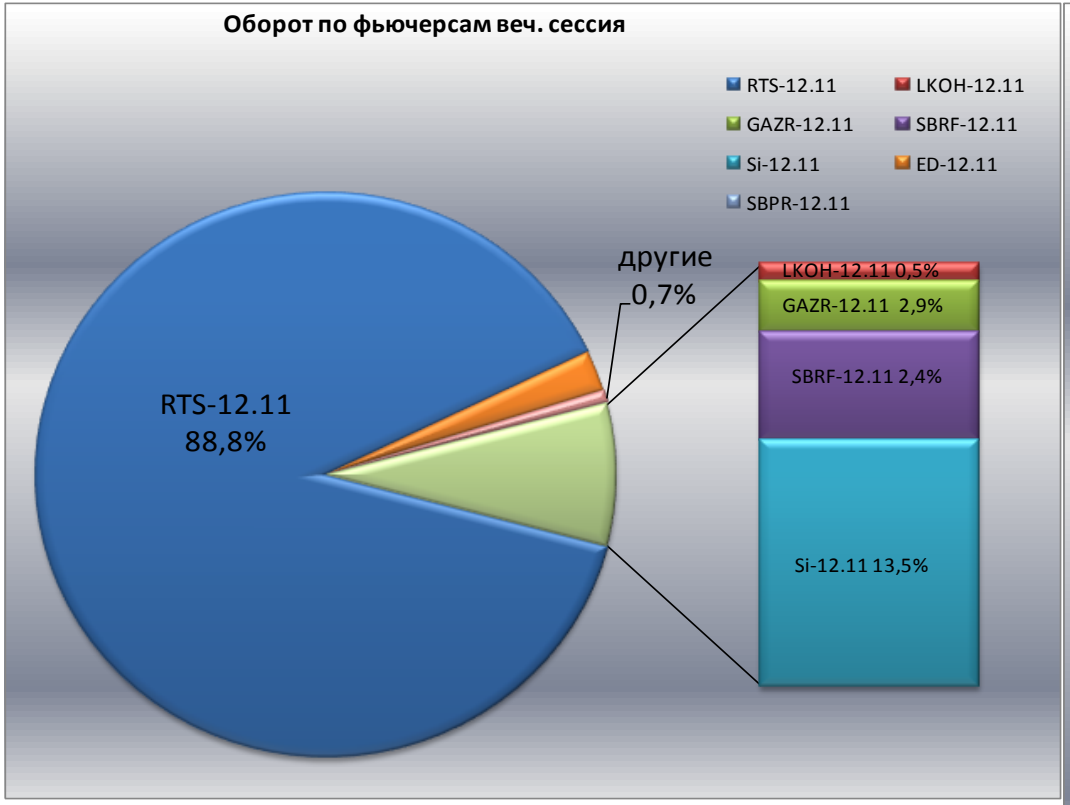

Опционы на Сбербанк, октябрь
Волатильность
388
372
356
340
324
308
292
276
260
244
228
212
196
180
3000
2700
2400
2100
1800
1500
1200
900
600
300
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 2 0 18 38 40 104 280 416 1340 1164 2544 1936 2082 32 96 22
OI Put 34 42 60 478 40 180 330 218 560 616 1098 1322 2736 598 2146 318 180 6 2 2
IV 354,19 354,14 354,12 354,09 354,06 354,01 353,95 353,87 353,75 353,55 352,23 309,88 184,13 259,36 307,82 309,54 309,34 309,22 309,13 309,07

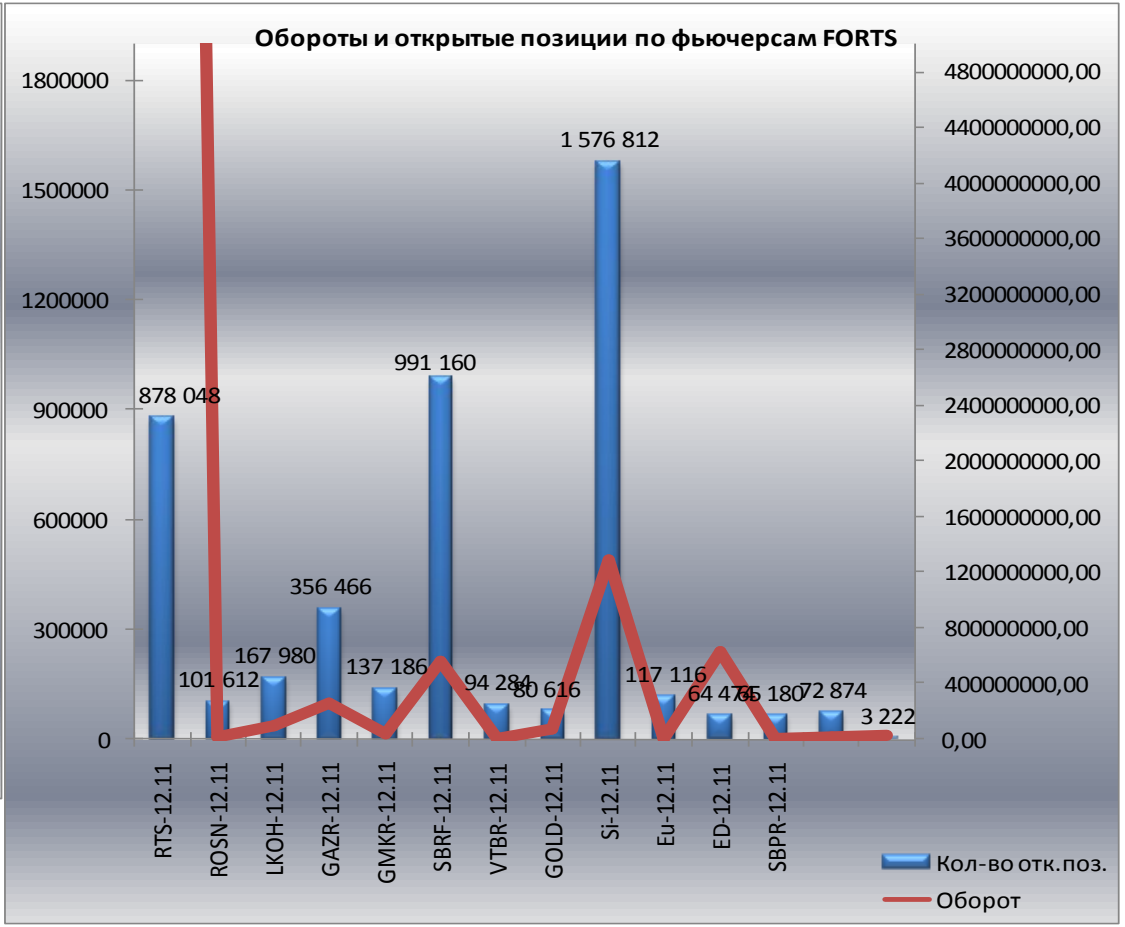


	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850	1900
OI Call	0	0	0	0	0	0	2	0	6	8	188	152	382
OI Put	0	0	0	0	100	0	0	26	166	342	234	120	68
IV	351,23	351,203	351,17	351,128	351,073	350,999	350,893	350,73	350,4	342,731	251,64	181,046	284,676



	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	188	152	382	22	164	0	0	0	0	0
OI Put	0	0	0	0	100	0	0	26	166	342	234	120	68	0	0	0	0	0	0	0
IV	351,23	351,20	351,17	351,12	351,07	350,99	350,89	350,73	350,4	342,73	251,64	181,04	284,67	305,00	305,18	304,99	304,88	304,79	304,74	304,66


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
88,8%
другие
0,7%
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
878 048
101 612
167 980
356 466
137 186
991 160
94 284
80 616
1 576 812
117 116
64 476
35 180
72 874
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