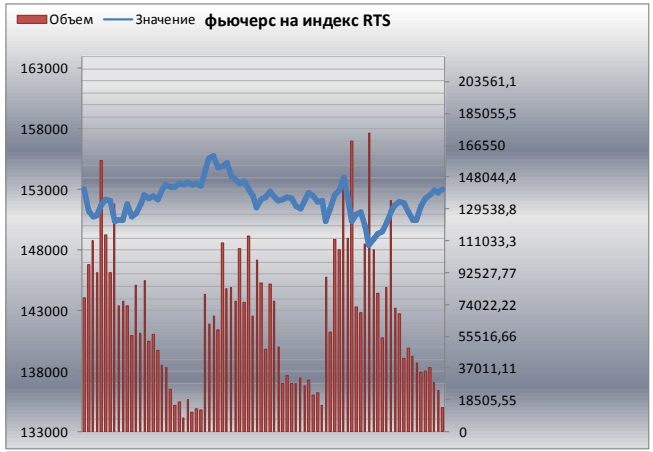
Российские рынки сохраняют потенциал разворота наверх

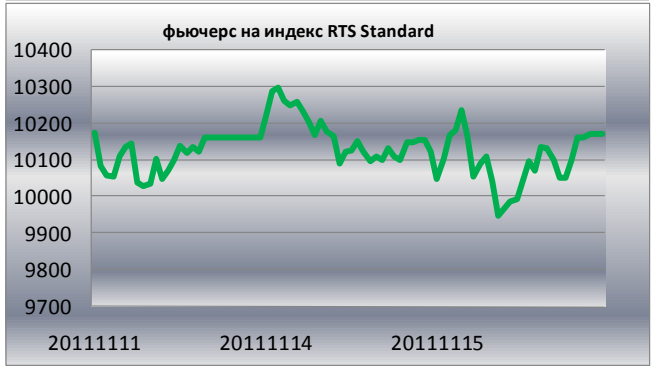
Какие-либо громкие заявления, а тем более действия, направленные на выход еврозоны из долгового кризиса, вчера замечены не были. Зато вышли положительные данные (лучше прогнозируемых значений) по ВВП Германии и Франции, на что сразу отреагировали «быки». В итоге основные индексы закончили вечернюю торговую сессию со следующими изменениями: DowJones +0,14%, SnP500 +0,48%, Nasdaq +1,09%, а по Европе— FTSE100 -0,03%, DAX -0,87%, CAC40 -1,92%.

На сырьевых рынках наблюдалось снижение. Фьючерс на нефть марки Brent составил в $112,39 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1767,06 за тройскую унцию

По итогам вечерней торговой сессии российский рынок закрылся в основном в плюсе: ММВБ прибавил 0,23% (1 487,84 пунктов), а РТС - 0,13% (1 528,96 пунктов).

Динамику лучше рынка показали Сургутнефтегаз (+3%), Акрон (+5,86%), Холдинг МРСК (+2,79%). Норникель же упал на –3,47%, Полюс Золото на –2,53%. В принципе, российские индексы имеют некоторый потенциал роста, если этому только не помешает неблагоприятная конъюнктура на мировых рынках.





	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	153045	1530,45	0,71	809 110	-0,65%	32 259 763 594	16,64%
ROSN-12.11	22270	222,70	0,54	101 876	-0,12%	21 525 842	4,34%
LKOH-12.11	17579	1757,90	0,48	162 956	-0,31%	86 540 744	4,51%
GAZR-12.11	18807	188,07	0,57	355 454	2,72%	466 844 454	7,89%
GMKR-12.11	52517	5251,70	-0,93	136 318	0,61%	96 082 876	11,85%
SBRF-12.11	8171	81,71	0,95	1 022 830	1,48%	893 087 336	9,14%
VTBR-12.11	7230	0,0723	0,91	92 892	-0,14%	5 802 793	3,20%
GOLD-12.11	1783	1783,1000	-0,44	82 480	-0,06%	172 281 829	18,04%
Si-12.11	30698	30,70	-0,37	1 542 088	-0,71%	2 063 405 768	6,23%
Eu-12.11	41590	41,59	-0,45	116 286	0,51%	26 167 954	17,01%
ED-12.11	1,35	1,35	-0,05	74 014	15,82%	1 178 732 996	23,74%
SBPR-12.11	6440	64,40	1,05	63 884	0,20%	7 025 463	8,70%
RTSS-12.11	10174	10174,00	0,37	72 622	-0,01%	7 614 135	1,03%
BR-12.11	108	107,80	2,80	3 222	-76,89%	32 770 034	7,54%

	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58258,23	-0,49%	00:12:30
CAC 40	3049,13	-1,92%	19:35:18
DAX 30	5933,14	-0,87%	19:35:31
DJ Industrial	12096,16	0,14%	00:42:54
FTSE 100	5517,44	-0,03%	19:35:22
Hang Seng	18866,58	-2,49%	10:19:17
Nikkei 225	8463,42	-0,92%	09:00:03
S&P 500	1257,81	0,48%	00:02:19
Brent 12.11	112,39	0,45%	01:09:18
Gold	1767,06	-0,85%	10:19:18
Palladium	652,74	-2,15%	10:19:25
Platinum	1620,1	-1,38%	10:18:11
RTSI	1 528,96	0,13%	23:50:00
RTS_Standard	10 139,44	0,16%	23:50:00
RTSI_DEREX	1517,51	0,56%	18:45:00

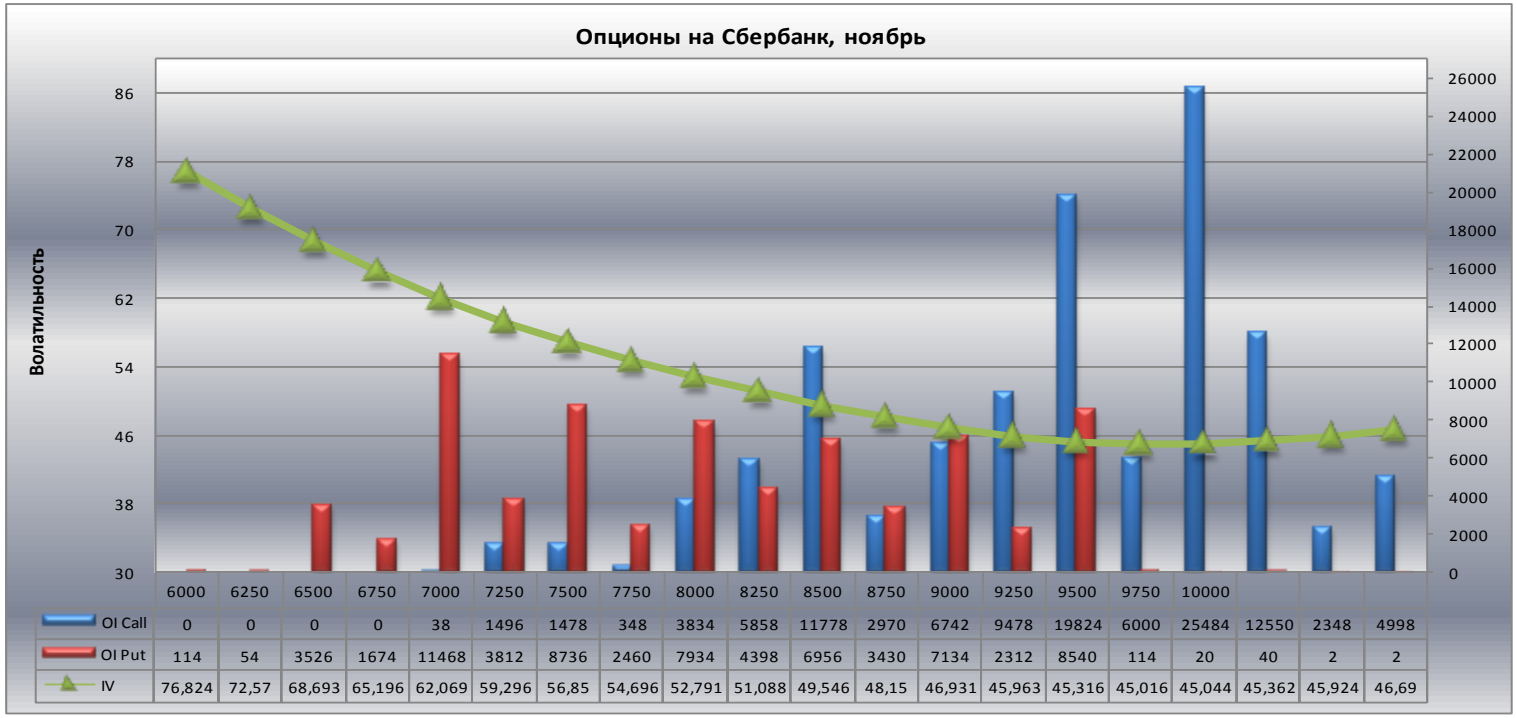
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,71	809110	32259763594,21	153045
ROSN-12.11	0,54	101876	21525842,00	22270
LKOH-12.11	0,48	162956	86540744,00	17579
GAZR-12.11	0,57	355454	466844454,00	18807
GMKR-12.11	-0,93	136318	96082876,00	52517
SBRF-12.11	0,95	1022830	893087336,00	8171
VTBR-12.11	0,91	92892	5802793,00	7230
GOLD-12.11	-0,44	82480	172281828,51	1783,1
Si-12.11	-0,37	1542088	2063405768,00	30698
Eu-12.11	-0,45	116286	26167954,00	41590
ED-12.11	-0,05	74014	1178732996,06	1,3548
SBPR-12.11	1,05	63884	7025463,00	6440
RTSS-12.11	0,37	72622	7614135,00	10174
BR-12.11	2,8	3 222	32770034,49	107,8

Дневная сессия

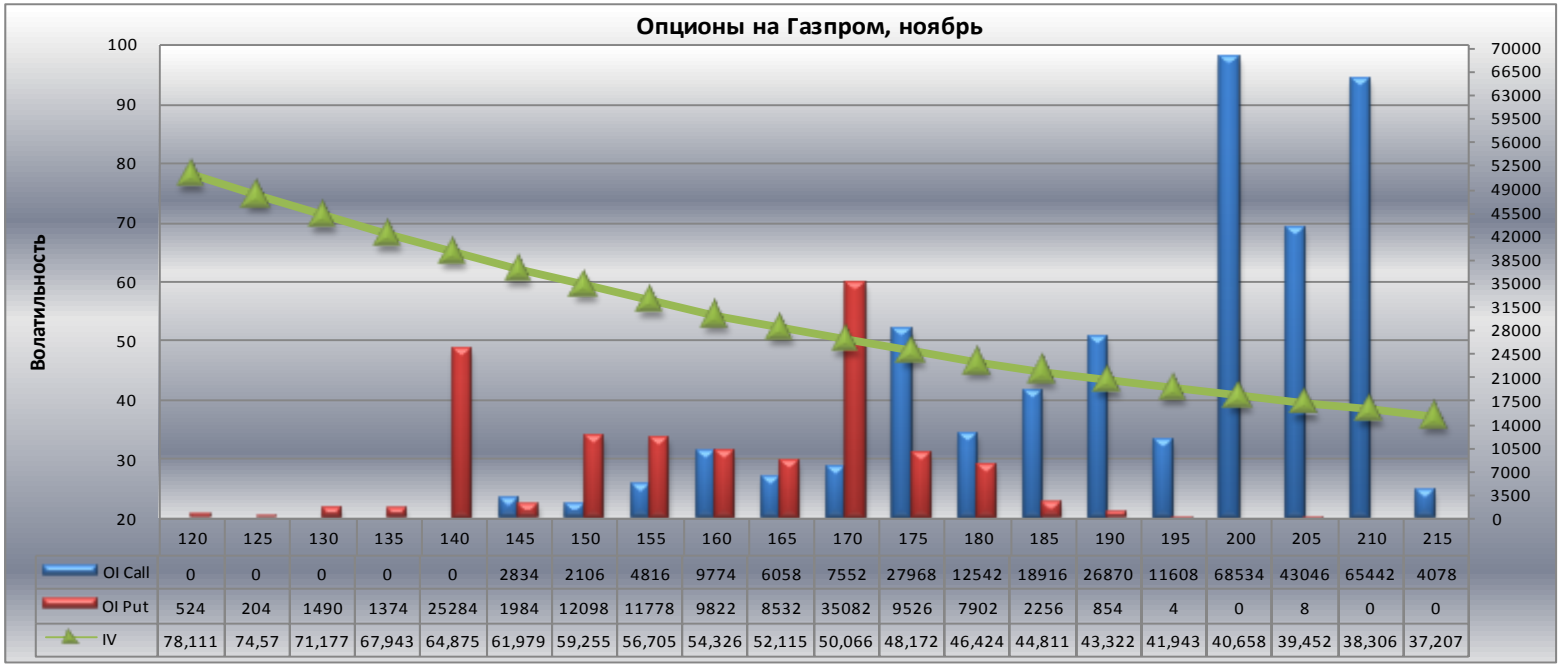
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,06	814386	1,93854E+11	151965
ROSN-12.11	0,27	101996	495509396	22151
LKOH-12.11	1,37	163470	1919289200	17502
GAZR-12.11	1,73	346048	5917172585	18701
GMKR-12.11	-3,45	135486	810609186	53008
SBRF-12.11	0,56	1007894	9772780420	8095
VTBR-12.11	-0,5	93018	181447840	7165
GOLD-12.11	0,19	82528	954795435,6	1791,4
Si-12.11	0,54	1553116	33096547711	30812
Eu-12.11	-0,09	115698	153878103	41783
ED-12.11	-0,67	63902	4965210634	1,3555
SBPR-12.11	-0,78	63758	80733372	6373
RTSS-12.11	0,38	72630	741944310	10136
BR-12.11	-0,16	13940	434627071	111,8


Опционы на индекс РТС, ноябрь
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 30 212 486 5238 17216 20258 28910 19484 29204 18676 11406 4224 2486 454 230 750 14 20 6 0 16
OI Put 18242 31948 29048 30122 30640 27326 15410 3286 512 46 12 2 0 2 0 2 12 0 0 0 8
IV 204,38 204,39 204,39 204,39 204,40 204,40 204,41 204,43 204,46 202,76 103,87 132,40 208,33 209,54 209,57 209,58 209,59 209,60 209,60 209,61 209,61

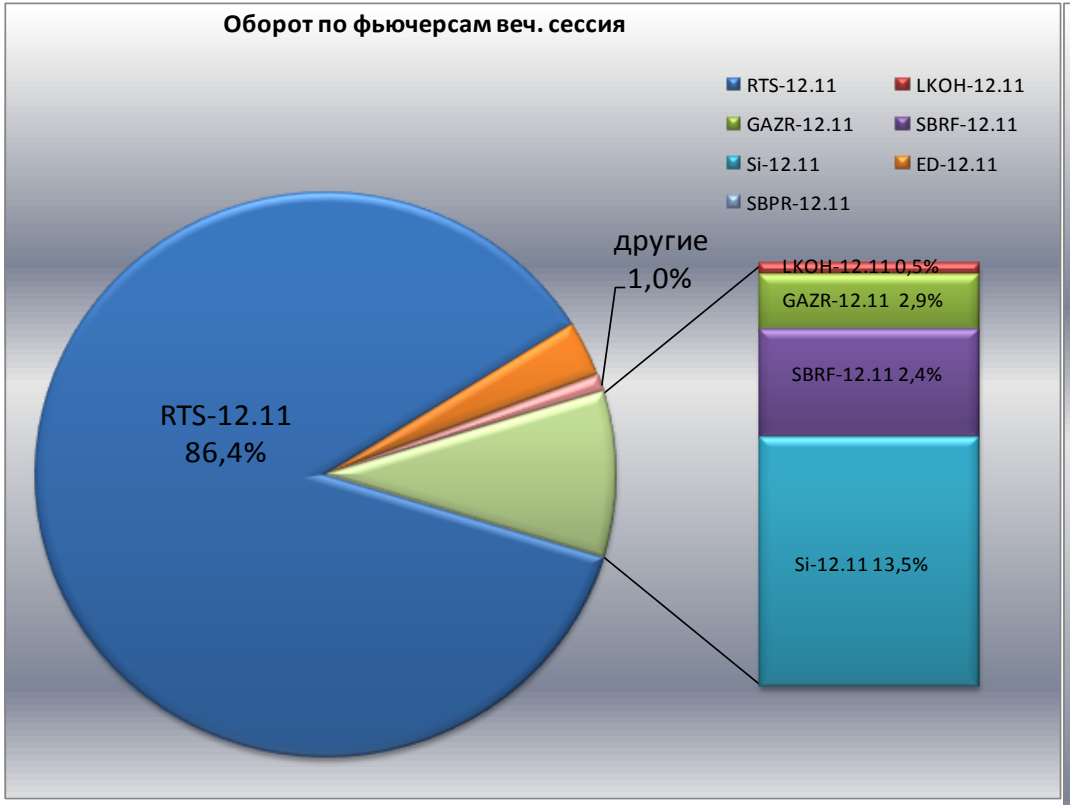

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
86
78
70
62
54
46
38
30
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 38 1496 1478 348 3834 5858 11778 2970 6742 9478 19824 6000 25484 12550 2348 4998
OI Put 114 54 3526 1674 11468 3812 8736 2460 7934 4398 6956 3430 7134 2312 8540 114 20 40 2 2
IV 76,824 72,57 68,693 65,196 62,069 59,296 56,85 54,696 52,791 51,088 49,546 48,15 46,931 45,963 45,316 45,016 45,044 45,362 45,924 46,69

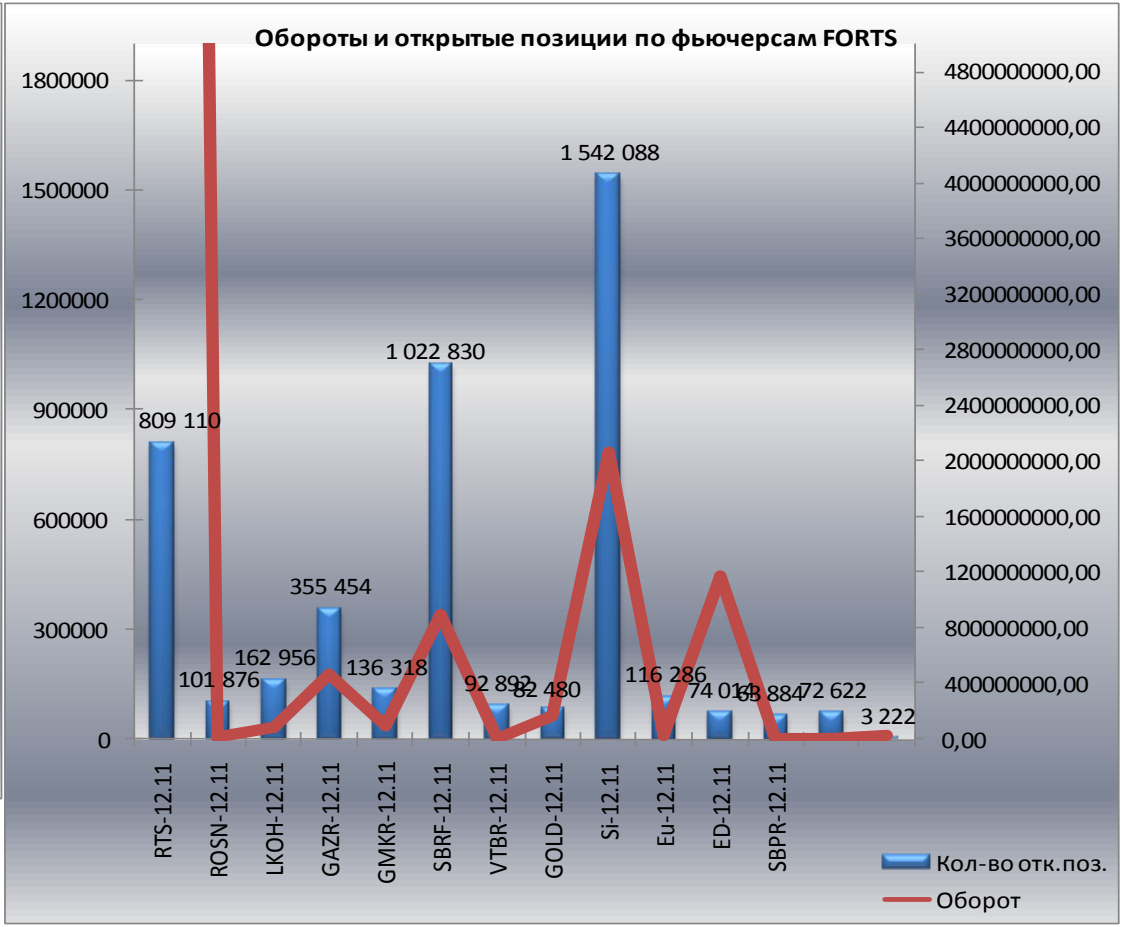


	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800	1850
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1326	1860	1348	1528
OI Put	0	0	0	10	0	100	502	1180	606	2586	510	1454	1266
IV	56,621	52,903	49,567	46,595	43,96	41,625	39,543	37,666	35,957	34,413	33,082	32,049	31,383



	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	2834	2106	4816	9774	6058	7552	27968	12542	18916	26870	11608	68534	43046	65442	4078
OI Put	524	204	1490	1374	25284	1984	12098	11778	9822	8532	35082	9526	7902	2256	854	4	0	8	0	0
IV	78,111	74,57	71,177	67,943	64,875	61,979	59,255	56,705	54,326	52,115	50,066	48,172	46,424	44,811	43,322	41,943	40,658	39,452	38,306	37,207


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
86,4%
другие
1,0%
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
809 110
101 876
162 956
355 454
136 318
1 022 830
92 892
82 480
1 542 088
116 286
74 014
55 884
72 622
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