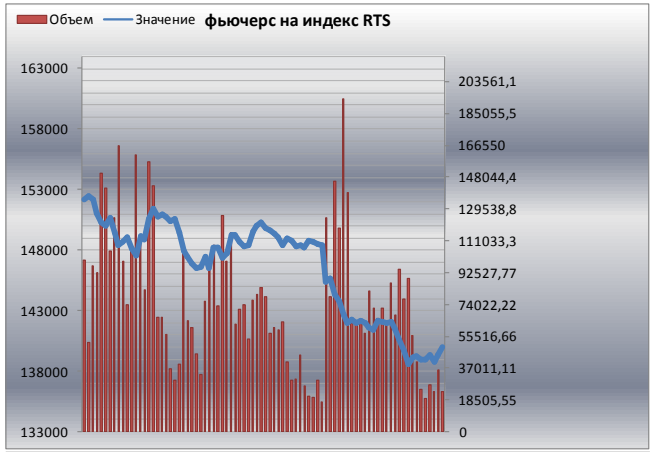
## Российский рынок продемонстрировал обвальное снижение

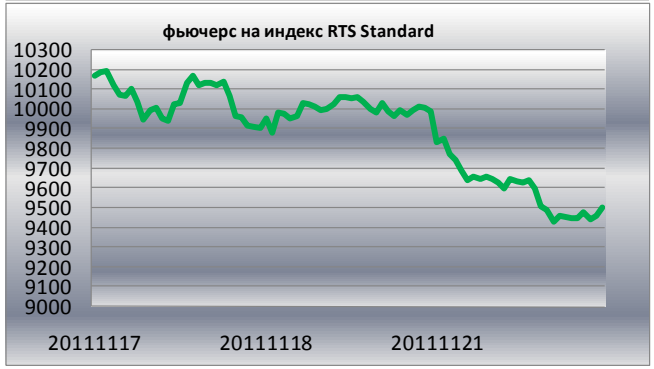
В понедельник торги закрылись со значительным снижением. Основные индексы закончили вечернюю торговую сессию со следующими изменениями: DJ Industrial –2,11%, S&P 500 – 1,87%, а по Европе— FTSE100 –2,62%, DAX –3,35%, CAC40 –3,41%. "Суперкомитет" Конгресса США так и не смог представить согласованную программу оптимизации бюджета США (план экономии на 1,2 трлн долл). Ставки по гособлигациям Франции начали расти, а Германия по-прежнему выступает против расширения полномочий ЕЦБ.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии подешевел, составив в $106,93 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1721,94 за тройскую унцию. Благодаря стабильным ценам на нефть, российский рынок местами сохраняет позитивный тренд, несмотря на внешний неблагоприятный фон.

Российский рынок закончил сессию обвальным снижением: в течение дня ММВБ упал на 4,79% (1 390,56 пункта), а РТС на 4,74% (1424,977 пункта), снизившись к концу вечерней сессии еще на 0,99% (1410,93 пункта).

Сильнее всего просели акции Северстали (-8,78%), Уралкалия (-4,79%). Лучше рынка выглядели Акрон (+1,52%), Полюс Золото (+1,54%).




| | 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 | 139960 | 1399,60 | -0,41 | 1 008 760 | -0,79% | 35 798 677 668 | 20,25% |
| ROSN-12.11 | 20400 | 204,00 | -0,10 | 101 492 | 0,20% | 43 887 384 | 9,36% |
| LKOH-12.11 | 16499 | 1649,90 | -0,32 | 171 860 | 1,72% | 183 698 626 | 10,75% |
| GAZR-12.11 | 16842 | 168,42 | -1,02 | 404 806 | 2,59% | 555 454 584 | 7,93% |
| GMKR-12.11 | 50899 | 5089,90 | 0,55 | 129 826 | 0,11% | 30 369 076 | 4,60% |
| SBRF-12.11 | 7540 | 75,40 | -0,93 | 1 004 666 | -1,10% | 1 043 923 340 | 11,18% |
| VTBR-12.11 | 6345 | 0,0635 | 0,09 | 130 316 | 0,27% | 40 431 751 | 18,86% |
| GOLD-12.11 | 1688 | 1688,0000 | -1,38 | 100 226 | 11,53% | 773 406 857 | 48,13% |
| Si-12.11 | 31211 | 31,21 | 0,08 | 1 742 148 | 0,70% | 2 445 290 802 | 8,29% |
| Eu-12.11 | 42220 | 42,22 | 0,59 | 99 236 | 0,09% | 23 519 450 | 18,79% |
| ED-12.11 | 1,35 | 1,35 | 0,32 | 82 248 | 9,31% | 1 033 957 671 | 33,79% |
| SBPR-12.11 | 5883 | 58,83 | -1,08 | 64 058 | -0,33% | 6 896 921 | 14,99% |
| RTSS-12.11 | 9500 | 9500,00 | -0,10 | 72 514 | 0,20% | 26 503 770 | 3,67% |
| BR-12.11 | 107 | 106,90 | 0,00 | 30 270 | -0,09% | 221 717 459 | 27,99% |

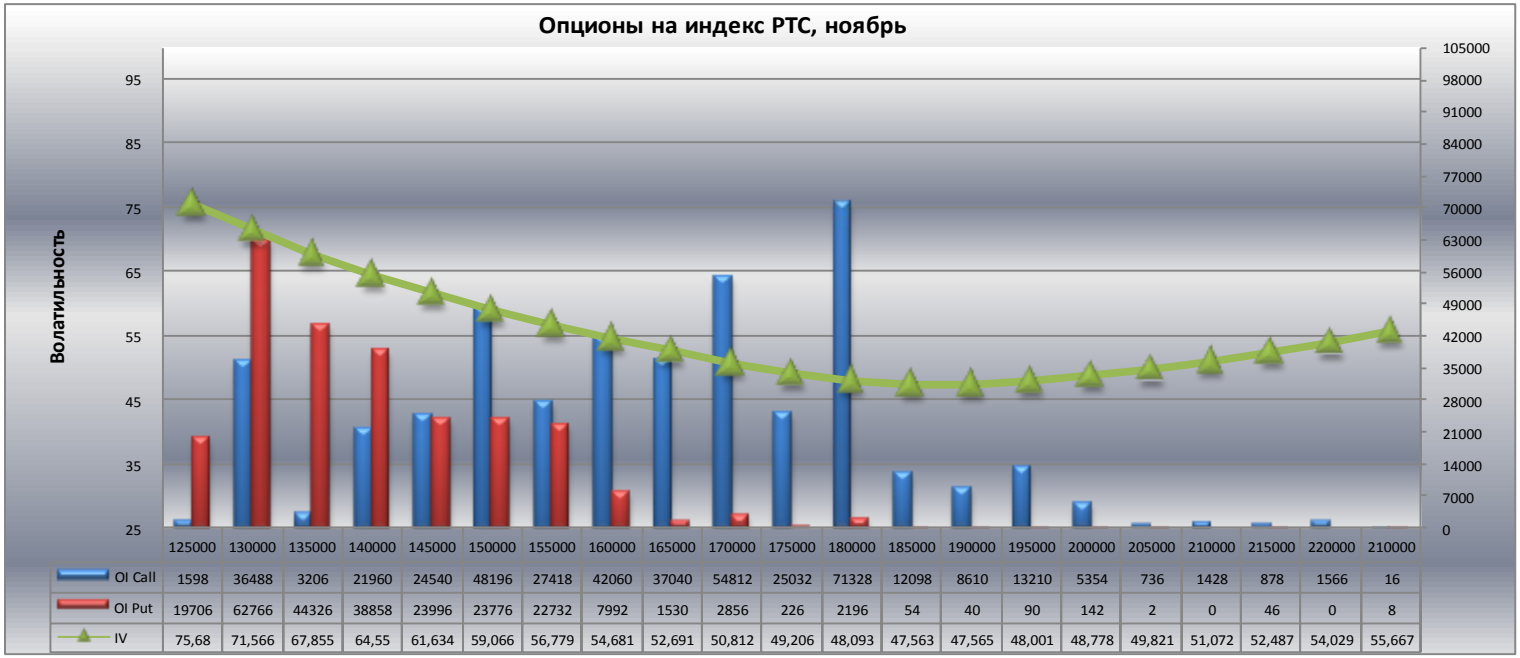
| | Закрытие | Изменение % | Время |
|---|---|---|---|
| BOVESPA Brazil | 56284,59 | -0,79% | 00:12:30 |
| CAC 40 | 2894,94 | -3,41% | 19:35:18 |
| DAX 30 | 5606 | -3,35% | 19:35:31 |
| DJ Industrial | 11547,31 | -2,11% | 00:42:54 |
| FTSE 100 | 5222,6 | -2,62% | 19:35:22 |
| Hang Seng | 18119,21 | -0,59% | 10:19:17 |
| Nikkei 225 | 8337,91 | -0,12% | 09:00:03 |
| S&P 500 | 1192,98 | -1,87% | 00:02:19 |
| Brent 12.11 | 112,39 | 0,45% | 01:09:18 |
| Gold | 1685 | 0,38% | 10:19:18 |
| Palladium | 600,5 | -0,77% | 10:19:25 |
| Platinum | 1585,9 | -0,18% | 10:18:11 |
| RTSI | 1 410,93 | -0,99% | 23:50:00 |
| RTS_Standard | 9 399,94 | -1,16% | 23:50:00 |
| RTSI_DEREX | 1485,72 | -0,82% | 18:45:00 |

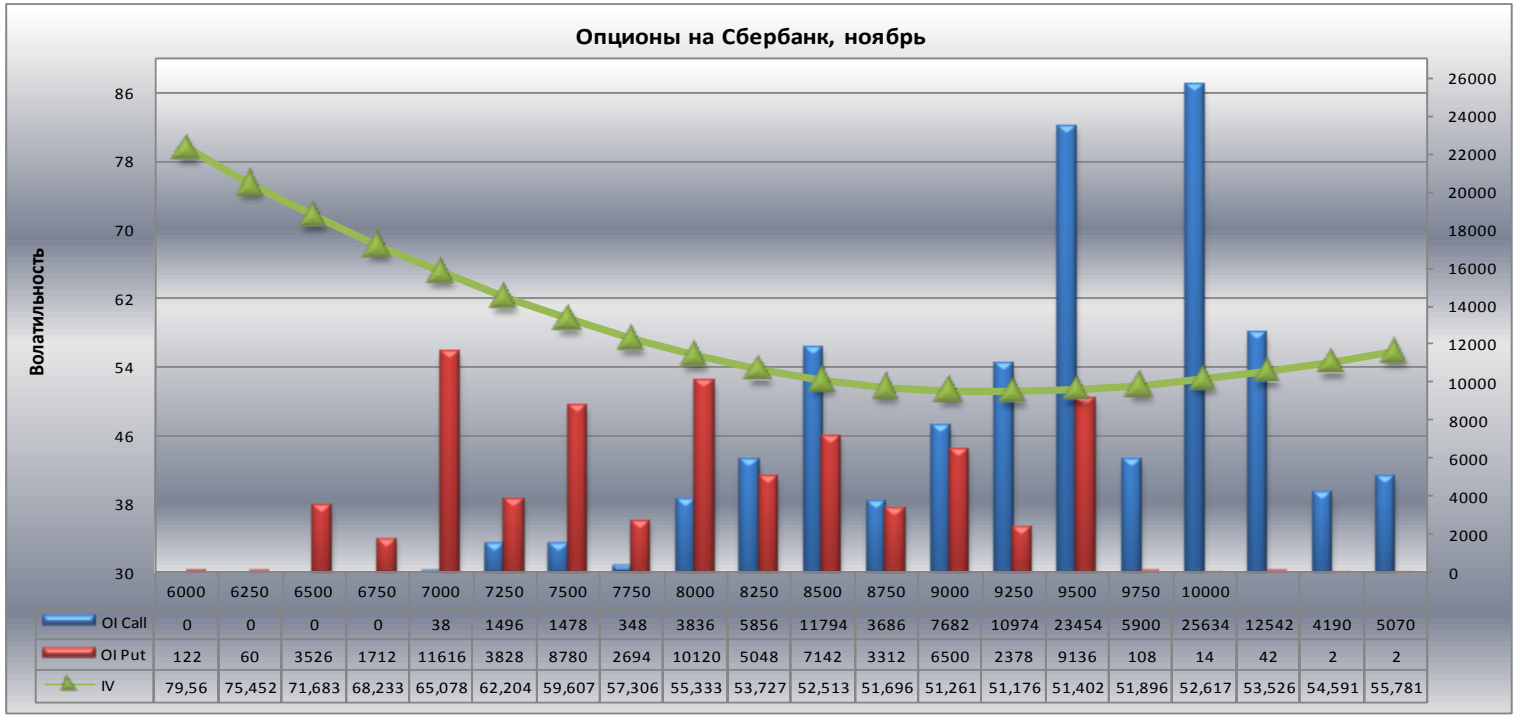
# Вечерняя сессия

| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.11 | -0,41 | 1008760 | 35798677668,29 | 139960 |
| ROSN-12.11 | -0,1 | 101492 | 43887384,00 | 20400 |
| LKOH-12.11 | -0,32 | 171860 | 183698626,00 | 16499 |
| GAZR-12.11 | -1,02 | 404806 | 555454584,00 | 16842 |
| GMKR-12.11 | 0,55 | 129826 | 30369076,00 | 50899 |
| SBRF-12.11 | -0,93 | 1004666 | 1043923340,00 | 7540 |
| VTBR-12.11 | 0,09 | 130316 | 40431751,00 | 6345 |
| GOLD-12.11 | -1,38 | 100226 | 773406857,06 | 1688 |
| Si-12.11 | 0,08 | 1742148 | 2445290802,00 | 31211 |
| Eu-12.11 | 0,59 | 99236 | 23519450,00 | 42220 |
| ED-12.11 | 0,32 | 82248 | 1033957671,44 | 1,35 |
| SBPR-12.11 | -1,08 | 64058 | 6896921,00 | 5883 |
| RTSS-12.11 | -0,1 | 72514 | 26503770,00 | 9500 |
| BR-12.11 | 0 | 30 270 | 221717459,38 | 106,9 |

# Дневная сессия

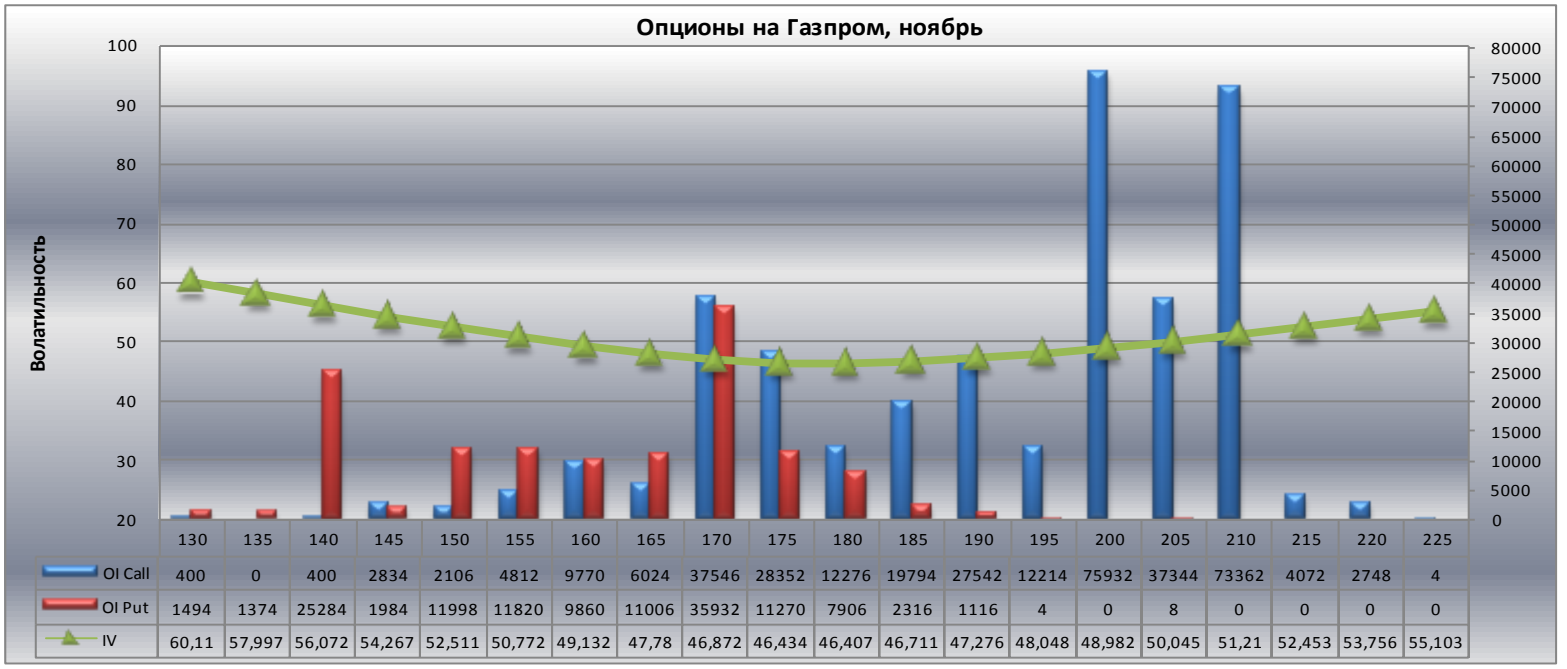
| | % измен.закр. | Кол-во отк.поз. | Оборот | Расч. цена |
|---|---|---|---|---|
| RTS-12.11 | -5,73 | 1016798 | 1,76775E+11 | 140530 |
| ROSN-12.11 | -5,64 | 101294 | 468670241 | 20420 |
| LKOH-12.11 | -3,86 | 168958 | 1709531499 | 16552 |
| GAZR-12.11 | -5,79 | 394598 | 7001539686 | 17015 |
| GMKR-12.11 | -5,38 | 129678 | 659523439 | 50620 |
| SBRF-12.11 | -5,4 | 1015880 | 9341200866 | 7611 |
| VTBR-12.11 | -6,9 | 129970 | 214366956 | 6339 |
| GOLD-12.11 | -0,75 | 89862 | 1607047300 | 1711,6 |
| Si-12.11 | 0,71 | 1730078 | 29507382006 | 31186 |
| Eu-12.11 | -0,01 | 99142 | 125161063 | 41974 |
| ED-12.11 | -0,69 | 75242 | 3060218940 | 1,3457 |
| SBPR-12.11 | -5,07 | 64272 | 46022176 | 5949 |
| RTSS-12.11 | -4,9 | 72372 | 723131880 | 9509 |
| BR-12.11 | -1,56 | 30296 | 792058407,6 | 106,93 |


Опционы на индекс РТС, ноябрь
Волатильность
95
85
75
65
55
45
35
25
105000
98000
91000
84000
77000
70000
63000
56000
49000
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 210000
OI Call 1598 36488 3206 21960 24540 48196 27418 42060 37040 54812 25032 71328 12098 8610 13210 5354 736 1428 878 1566 16
OI Put 19706 62766 44326 38858 23996 23776 22732 7992 1530 2856 226 2196 54 40 90 142 2 0 46 0 8
IV 75,68 71,566 67,855 64,55 61,634 59,066 56,779 54,681 52,691 50,812 49,206 48,093 47,563 47,565 48,001 48,778 49,821 51,072 52,487 54,029 55,667

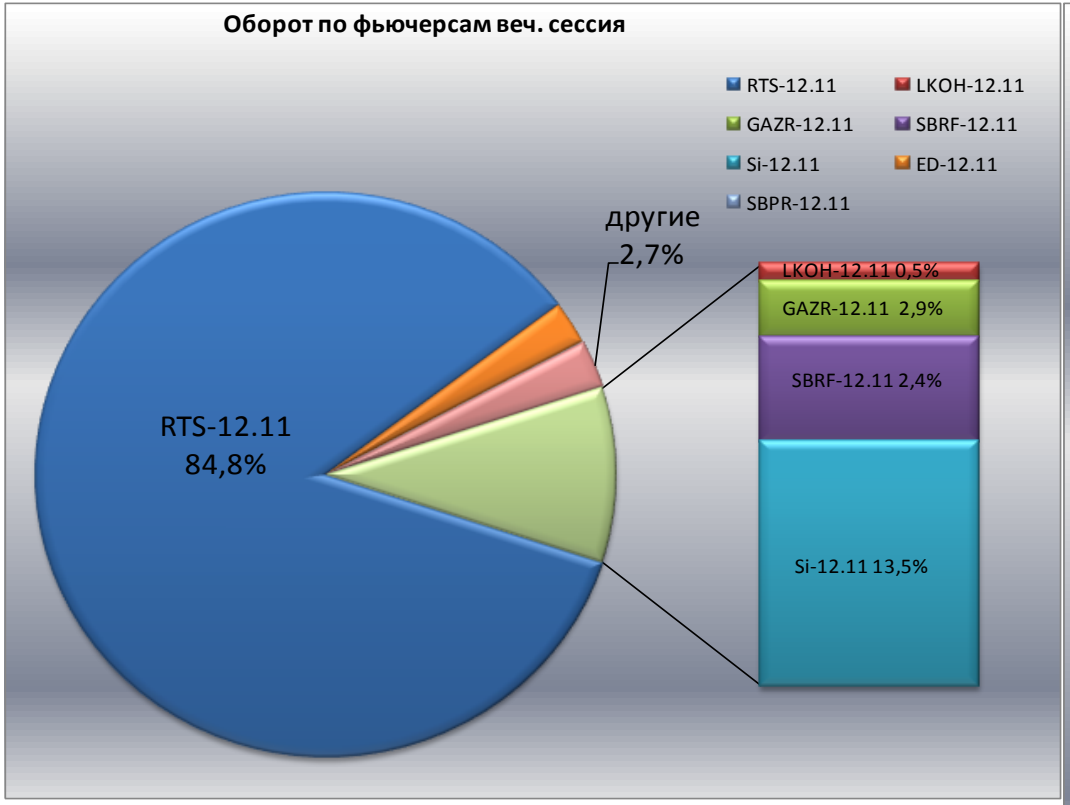

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
86
78
70
62
54
46
38
30
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 38 1496 1478 348 3836 5856 11794 3686 7682 10974 23454 5900 25634 12542 4190 5070
OI Put 122 60 3526 1712 11616 3828 8780 2694 10120 5048 7142 3312 6500 2378 9136 108 14 42 2 2
IV 79,56 75,452 71,683 68,233 65,078 62,204 59,607 57,306 55,333 53,727 52,513 51,696 51,261 51,176 51,402 51,896 52,617 53,526 54,591 55,781

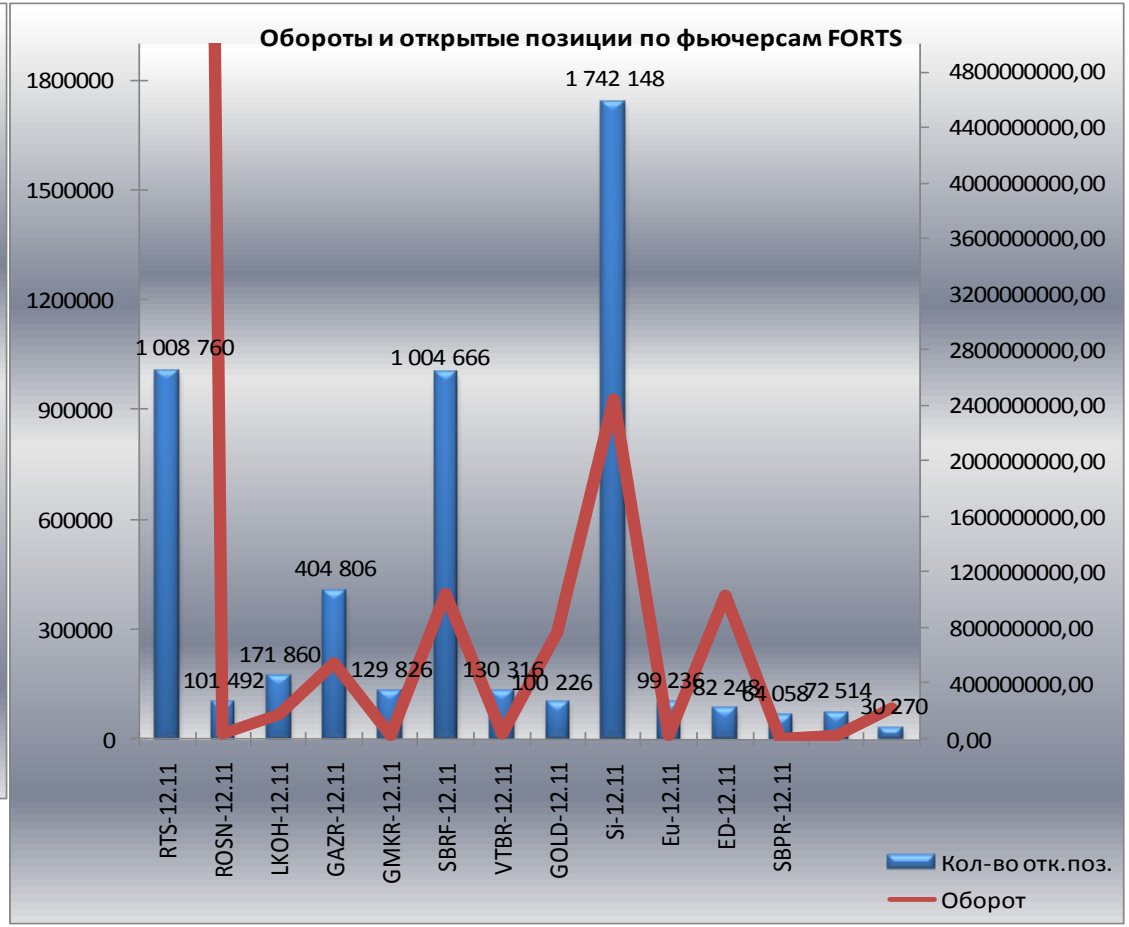



| | 1200 | 1250 | 1300 | 1350 | 1400 | 1450 | 1500 | 1550 | 1600 | 1650 | 1700 | 1750 | 1800 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1326 | 1860 | 1348 |
| OI Put | 0 | 0 | 0 | 0 | 10 | 0 | 100 | 502 | 1180 | 606 | 2608 | 702 | 1454 |
| IV | 55,662 | 52,309 | 49,36 | 46,767 | 44,453 | 42,322 | 40,293 | 38,407 | 36,878 | 35,922 | 35,58 | 35,77 | 36,381 |




| | 130 | 135 | 140 | 145 | 150 | 155 | 160 | 165 | 170 | 175 | 180 | 185 | 190 | 195 | 200 | 205 | 210 | 215 | 220 | 225 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OI Call | 400 | 0 | 400 | 2834 | 2106 | 4812 | 9770 | 6024 | 37546 | 28352 | 12276 | 19794 | 27542 | 12214 | 75932 | 37344 | 73362 | 4072 | 2748 | 4 |
| OI Put | 1494 | 1374 | 25284 | 1984 | 11998 | 11820 | 9860 | 11006 | 35932 | 11270 | 7906 | 2316 | 1116 | 4 | 0 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| IV | 60,11 | 57,997 | 56,072 | 54,267 | 52,511 | 50,772 | 49,132 | 47,78 | 46,872 | 46,434 | 46,407 | 46,711 | 47,276 | 48,048 | 48,982 | 50,045 | 51,21 | 52,453 | 53,756 | 55,103 |


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
2,7%
RTS-12.11
84,8%
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
1 008 760
101 492
171 860
404 806
129 826
1 004 666
130 316
100 226
1 742 148
99 236
82 248
64 058
72 514
30 270
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