Риски по-прежнему очень высоки

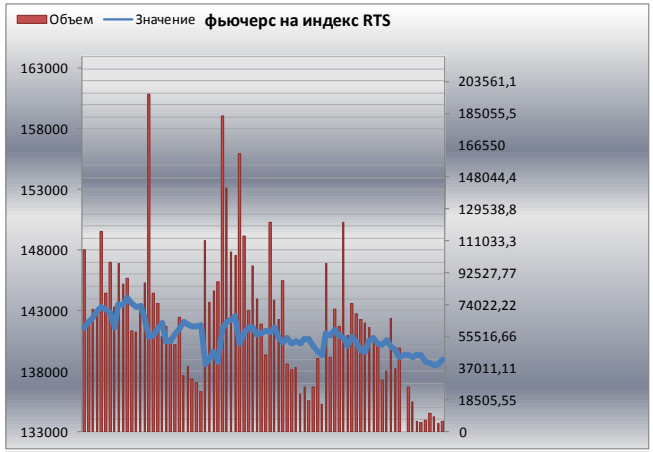
Главы ведущих стран еврозоны заявили, что до 9 декабря (дата очередного саммита ЕС) проект реформы базового законодательства Еврозоны будет опубликован. В итоге основные индексы Европы закончили вечернюю торговую сессию со следующими изменениями: FTSE100 –0,24%, DAX30 –0,54%, CAC40 –0,01%.

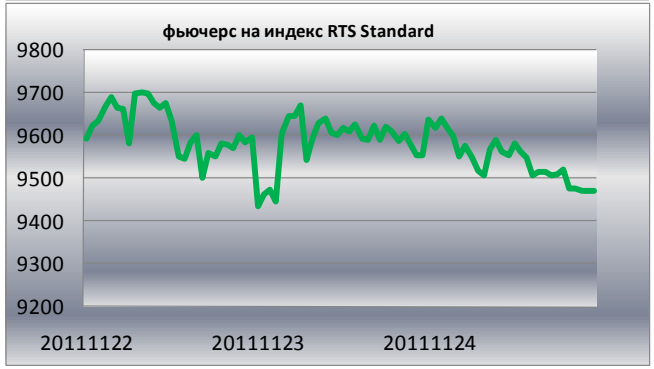
Американские биржи не торговали в четверг в связи с празднованием Дня благодарения. Также, агентство S&P понизило рейтинг Египта до B+ с BB-, а также Португалии с BBB– до BB+ с негативным прогнозом и заявило, что готово понизить рейтинг Японии.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $112,39 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1690,85 за тройскую унцию.

К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1392,75 пункта, упав на -0,82%, РТС остановился на уровне 1402,83 пункта, упав на –1,35%. Российский рубль сдал позиции по отношению к доллару США и к единой европейской валюте. Бивалютная корзина по итогам торгов выросла на 2 копейки и ее значение составило 36,1860 рубля.

Лучше рынка выглядели МРСК СК(+4,67%), ОГК-1 (+3,57%), Мосэнергосбыт (+2,71%).





	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	138890	1388,90	-0,17	1 006 930	-0,73%	8 208 532 701	6,42%
ROSN-12.11	20440	204,40	-0,01	106 372	-0,02%	9 008 880	4,38%
LKOH-12.11	16350	1635,00	-0,25	180 008	0,59%	70 552 983	6,99%
GAZR-12.11	16596	165,96	-0,30	392 470	0,32%	168 058 527	4,65%
GMKR-12.11	51880	5188,00	0,13	129 108	-0,06%	12 988 560	2,25%
SBRF-12.11	7558	75,58	-0,53	1 021 826	1,04%	459 789 471	8,33%
VTBR-12.11	6148	0,0615	-0,18	180 132	0,09%	4 356 349	2,22%
GOLD-12.11	1696	1696,0000	-0,31	110 606	0,59%	85 929 959	9,21%
Si-12.11	31578	31,58	-0,03	1 762 420	-0,02%	557 128 315	2,34%
Eu-12.11	42110	42,11	0,02	91 554	0,01%	8 464 704	11,35%
ED-12.11	1,33	1,33	0,00	66 104	13,73%	791 218 691	22,09%
SBPR-12.11	5837	58,37	-0,88	66 284	-0,02%	746 127	2,77%
RTSS-12.11	9470	9469,50	-0,37	62 180	0,04%	7 228 580	4,10%
BR-12.11	108	107,55	0,08	40 278	1,29%	96 321 312	13,76%

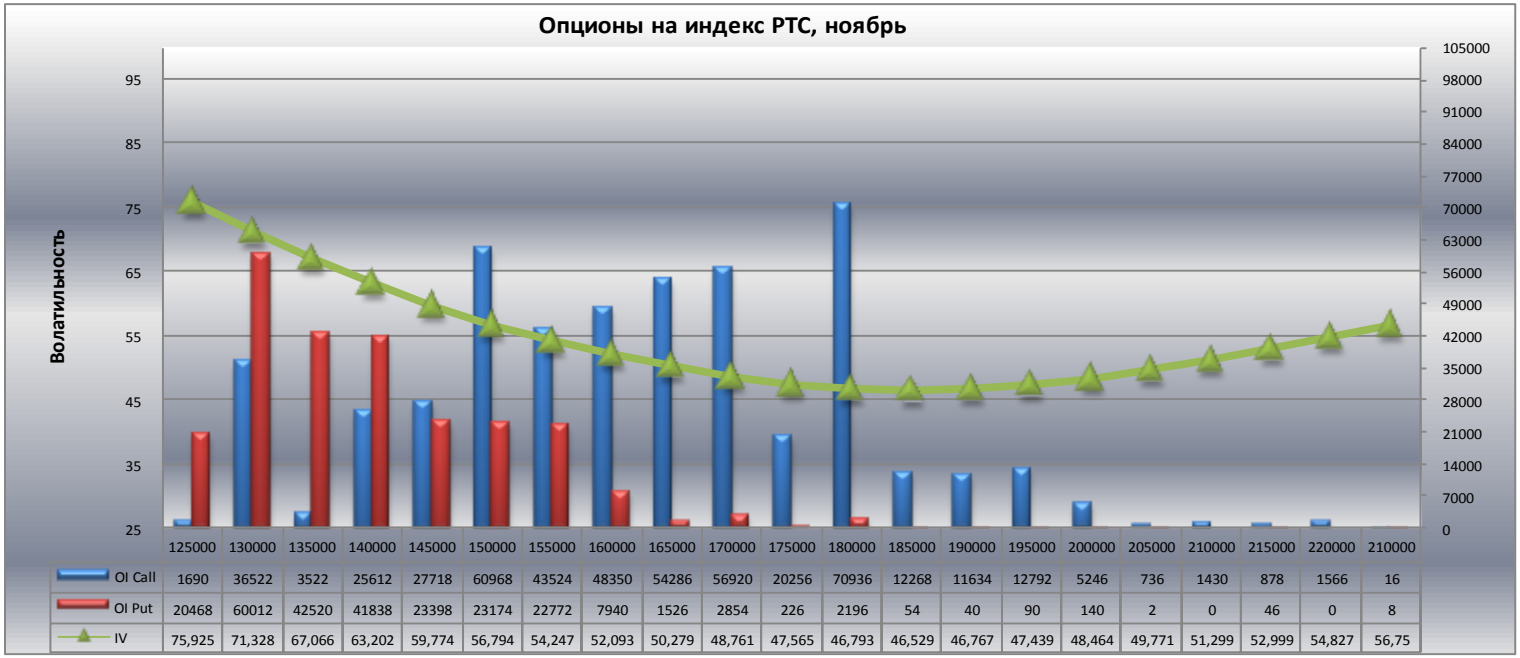
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55279,88	0,56%	00:12:30
CAC 40	2822,25	-0,01%	19:35:18
DAX 30	5428,11	-0,54%	19:35:31
DJ Industrial	11257,55	-2,06%	00:42:54
FTSE 100	5127,57	-0,24%	19:35:22
Hang Seng	17707,37	-1,27%	10:19:17
Nikkei 225	8180,65	0,19%	09:00:03
S&P 500	1161,79	-2,21%	00:02:19
Brent 12.11	112,39	0,45%	01:09:18
Gold	1690,85	-0,30%	10:19:18
Palladium	579	-1,84%	10:19:25
Platinum	1544	-0,92%	10:18:11
RTSI	1 400,51	-0,17%	23:50:00
RTS_Standard	9 458,90	-0,28%	23:50:00
RTSI_DEREX	1389,24	-0,92%	18:45:00

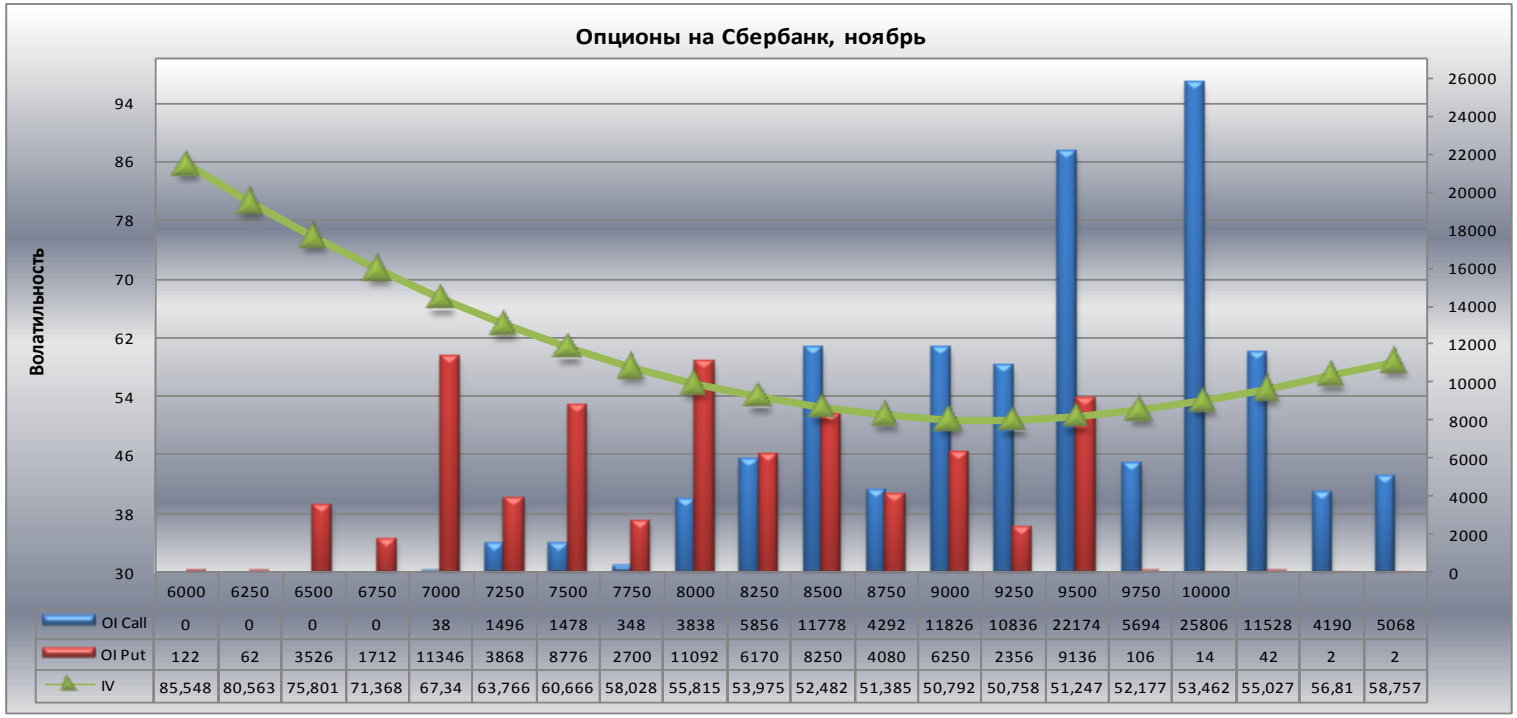
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,17	1006930	8208532700,88	138890
ROSN-12.11	-0,01	106372	9008880,00	20440
LKOH-12.11	-0,25	180008	70552983,00	16350
GAZR-12.11	-0,3	392470	168058527,00	16596
GMKR-12.11	0,13	129108	12988560,00	51880
SBRF-12.11	-0,53	1021826	459789471,00	7558
VTBR-12.11	-0,18	180132	4356349,00	6148
GOLD-12.11	-0,31	110606	85929959,04	1696
Si-12.11	-0,03	1762420	557128315,00	31578
Eu-12.11	0,02	91554	8464704,00	42110
ED-12.11	0	66104	791218690,50	1,3326
SBPR-12.11	-0,88	66284	746127,00	5837
RTSS-12.11	-0,37	62180	7228580,00	9469,5
BR-12.11	0,08	40 278	96321311,88	107,55

Дневная сессия

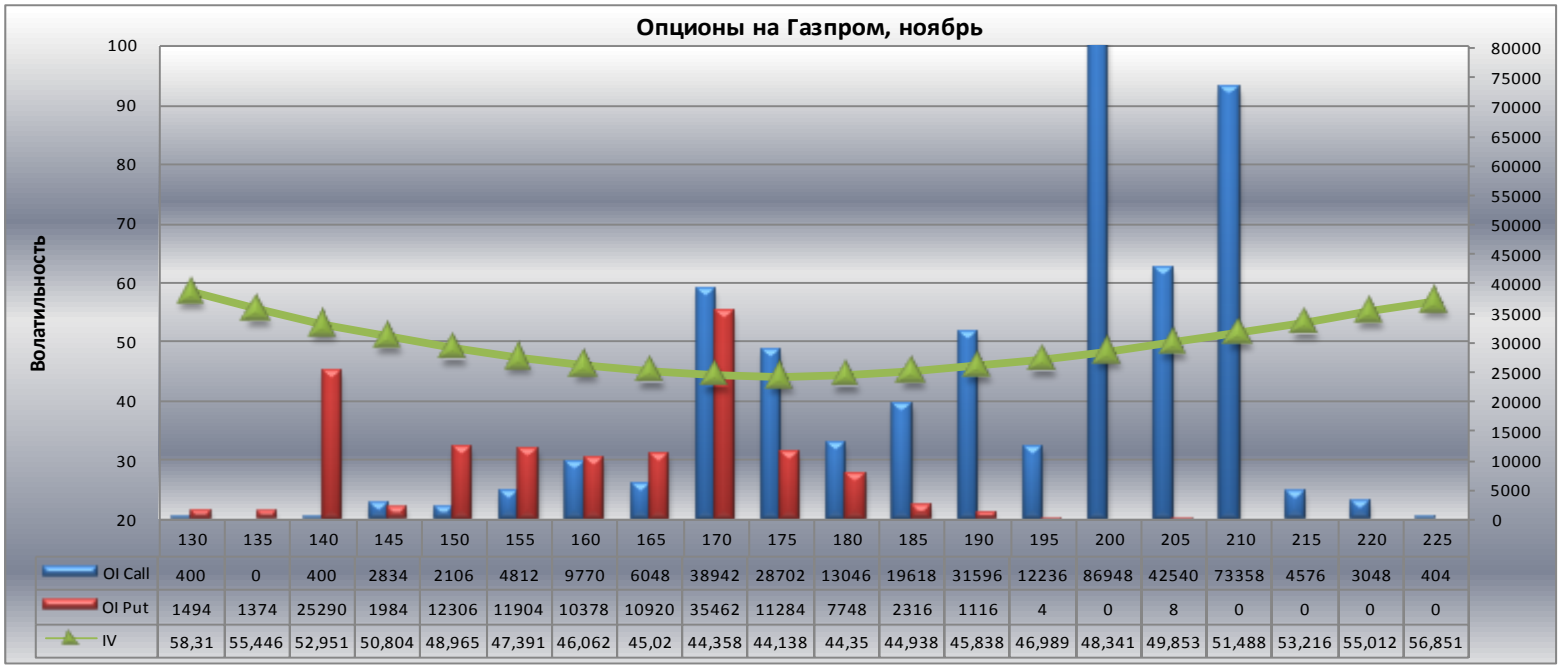
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,22	1014324	1,27957E+11	139130
ROSN-12.11	-1,04	106394	205699687	20443
LKOH-12.11	-1,5	178948	1008911061	16391
GAZR-12.11	-1,16	391208	3617828006	16646
GMKR-12.11	-1,21	129182	577020626	51814
SBRF-12.11	-1,24	1011288	5516782386	7598
VTBR-12.11	-1,94	179962	196668665	6159
GOLD-12.11	0,21	109954	933353153,7	1701,2
Si-12.11	0,47	1762730	23826703291	31588
Eu-12.11	-0,05	91542	74553751	42100
ED-12.11	-0,52	58122	3582349110	1,3324
SBPR-12.11	-0,94	66298	26907954	5889
RTSS-12.11	-0,91	62154	176233790	9505
BR-12.11	-0,05	39766	700140418,4	107,46


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 1690 36522 3522 25612 27718 60968 43524 48350 54286 56920 20256 70936 12268 11634 12792 5246 736 1430 878 1566 16
OI Put 20468 60012 42520 41838 23398 23174 22772 7940 1526 2854 226 2196 54 40 90 140 2 0 46 0 8
IV 75,925 71,328 67,066 63,202 59,774 56,794 54,247 52,093 50,279 48,761 47,565 46,793 46,529 46,767 47,439 48,464 49,771 51,299 52,999 54,827 56,75

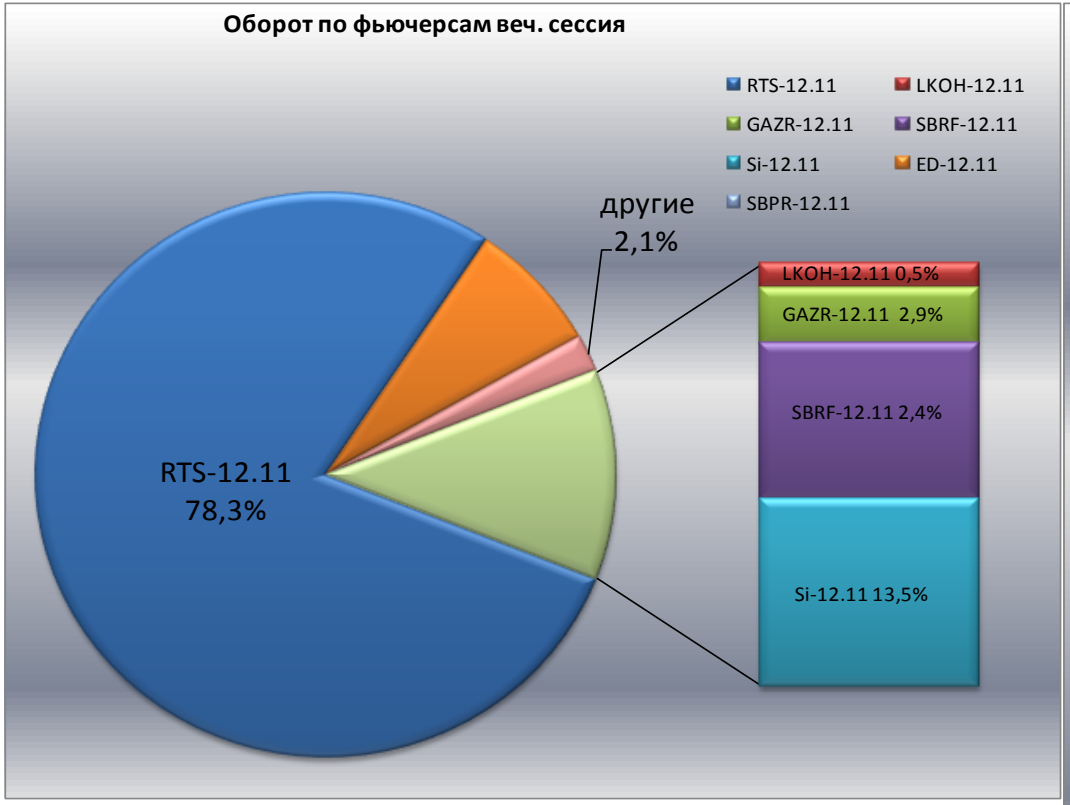

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
94
86
78
70
62
54
46
38
30
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 38 1496 1478 348 3838 5856 11778 4292 11826 10836 22174 5694 25806 11528 4190 5068
OI Put 122 62 3526 1712 11346 3868 8776 2700 11092 6170 8250 4080 6250 2356 9136 106 14 42 2 2
IV 85,548 80,563 75,801 71,368 67,34 63,766 60,666 58,028 55,815 53,975 52,482 51,385 50,792 50,758 51,247 52,177 53,462 55,027 56,81 58,757

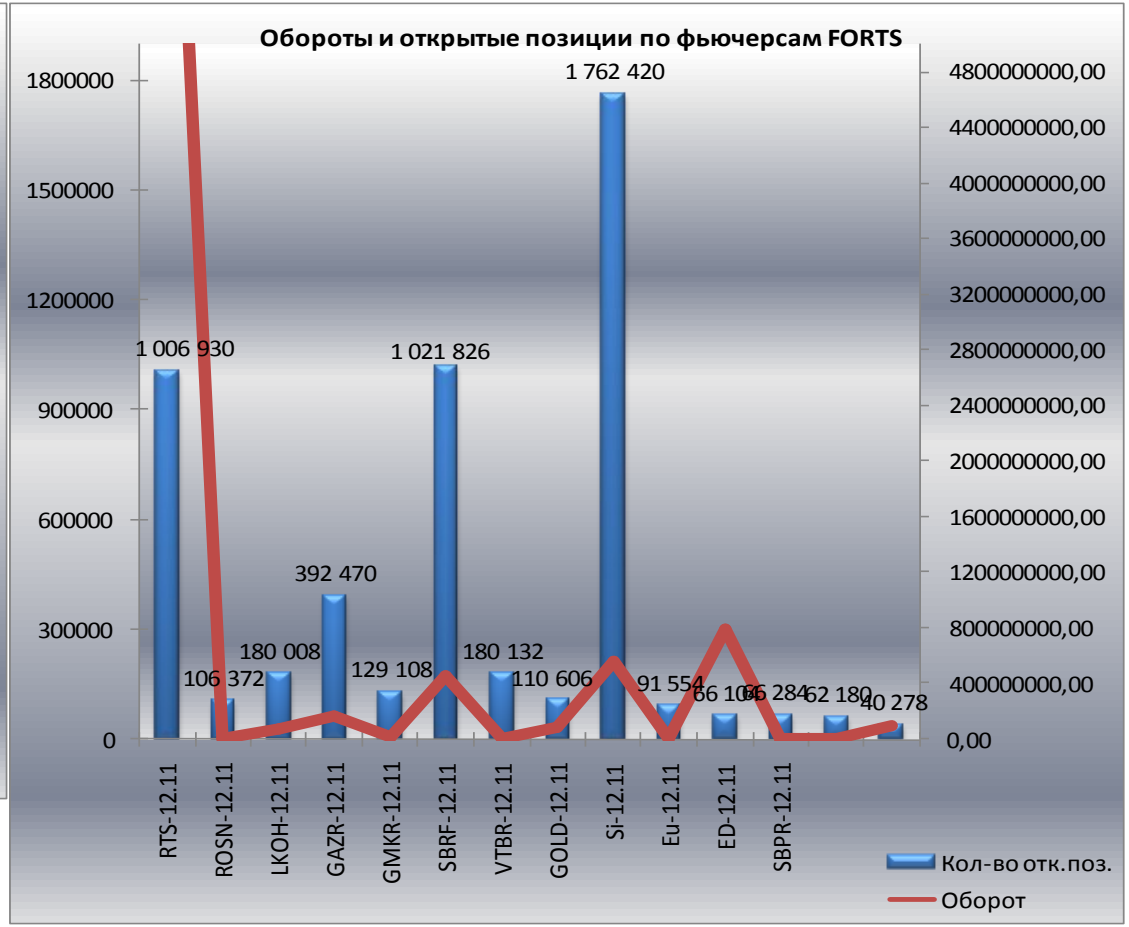


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1326	1872	1344
OI Put	0	0	0	0	10	0	100	502	1180	780	2612	704	1454
IV	58,275	54,186	50,503	47,264	44,485	42,159	40,261	38,749	37,594	36,804	36,433	36,513	37,021



	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	6048	38942	28702	13046	19618	31596	12236	86948	42540	73358	4576	3048	404
OI Put	1494	1374	25290	1984	12306	11904	10378	10920	35462	11284	7748	2316	1116	4	0	8	0	0	0	0
IV	58,31	55,446	52,951	50,804	48,965	47,391	46,062	45,02	44,358	44,138	44,35	44,938	45,838	46,989	48,341	49,853	51,488	53,216	55,012	56,851


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
2,1%
RTS-12.11
78,3%
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
1 006 930
106 372
180 008
392 470
129 108
1 021 826
180 132
110 606
1 762 420
91 554
66 106
66 284
62 180
40 278
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