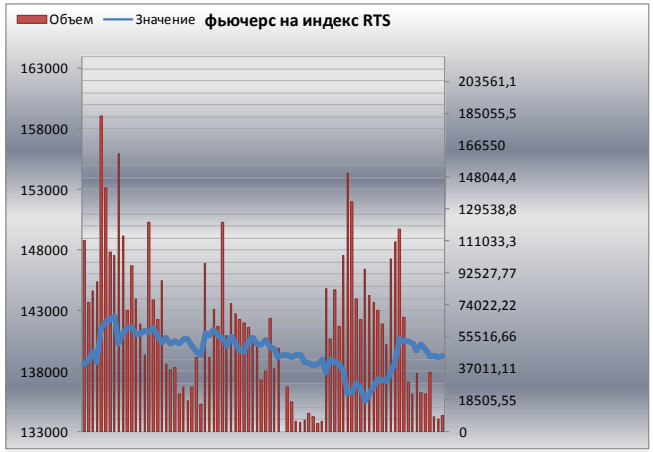
Медвежьи настроения по-прежнему не покидают российские рынки

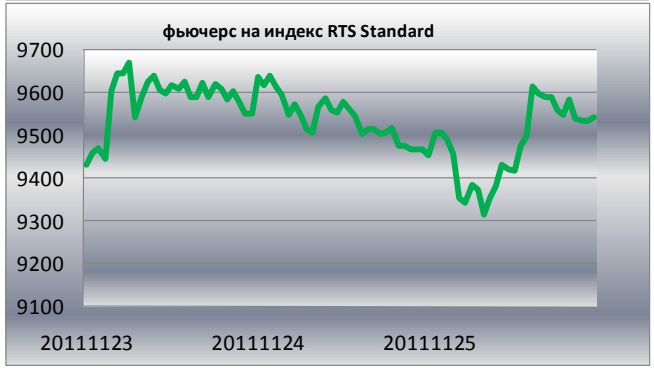
Основные индексы Европы закончили вечернюю торговую сессию в плюсе: FTSE100 +0,72%, DAX30 +1,19%, CAC40 +1,23%. Ангела Меркель по-прежнему сохраняет жёсткие позиции против выпуска общих облигаций еврозоны на фоне увеличения доходности бондов ряда стран ЕС. Меж тем, в воскресенье стало известно, что МВФ подготовил экстренный кредит для Италии в размере 400-600 млрд евро. (ставка от 4% до 5%), хотя эксперты утверждают, что это несколько завышенная сумма, ведь МВФ располагает только суммой в 280 млрд евро, и помимо Италии есть еще ряд «нуждающихся» стран.

Фондовые площадки США закрылись в небольшом минусе: DowJones -0,23%, SnP500 -0,27%, Nasdaq -0,75%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $107,76 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1707,34 за тройскую унцию.

К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1410,84 пункта, увеличившись на +1,30%, РТС остановился на уровне 1413,18 пункта с изменением на +0,74%. Бумаги Лукойла и Сбербанка подросли на несколько процентов за день: у обеих компаний выходит отчетность. В целом российский рынок по-прежнему падает, сильнее западных площадок.





	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	139250	1392,50	-1,00	1 030 736	0,20%	22 478 023 086	15,50%
ROSN-12.11	20564	205,64	-0,70	107 744	0,26%	14 784 021	4,47%
LKOH-12.11	16320	1632,00	-0,92	180 852	-0,75%	72 560 767	5,31%
GAZR-12.11	16440	164,40	-1,44	409 176	2,20%	277 412 473	5,49%
GMKR-12.11	51202	5120,20	-1,36	127 704	-0,11%	31 046 423	8,62%
SBRF-12.11	7833	78,33	-0,97	1 105 928	-0,56%	646 234 470	7,49%
VTBR-12.11	6155	0,0616	-1,05	205 614	2,12%	24 407 414	10,17%
GOLD-12.11	1693	1693,0000	-0,14	96 450	-1,01%	203 884 539	9,56%
Si-12.11	31683	31,68	0,20	1 716 320	-0,12%	1 339 287 429	5,01%
Eu-12.11	41900	41,90	-0,06	86 476	-0,26%	11 941 137	5,49%
ED-12.11	1,32	1,32	-0,26	94 720	28,48%	971 477 600	20,19%
SBPR-12.11	6012	60,12	-0,56	65 490	0,13%	117 504 165	296,39%
RTSS-12.11	9545	9545,00	-0,73	61 964	0,06%	15 002 510	8,20%
BR-12.11	107	106,54	-0,74	29 874	-3,91%	231 367 336	16,42%

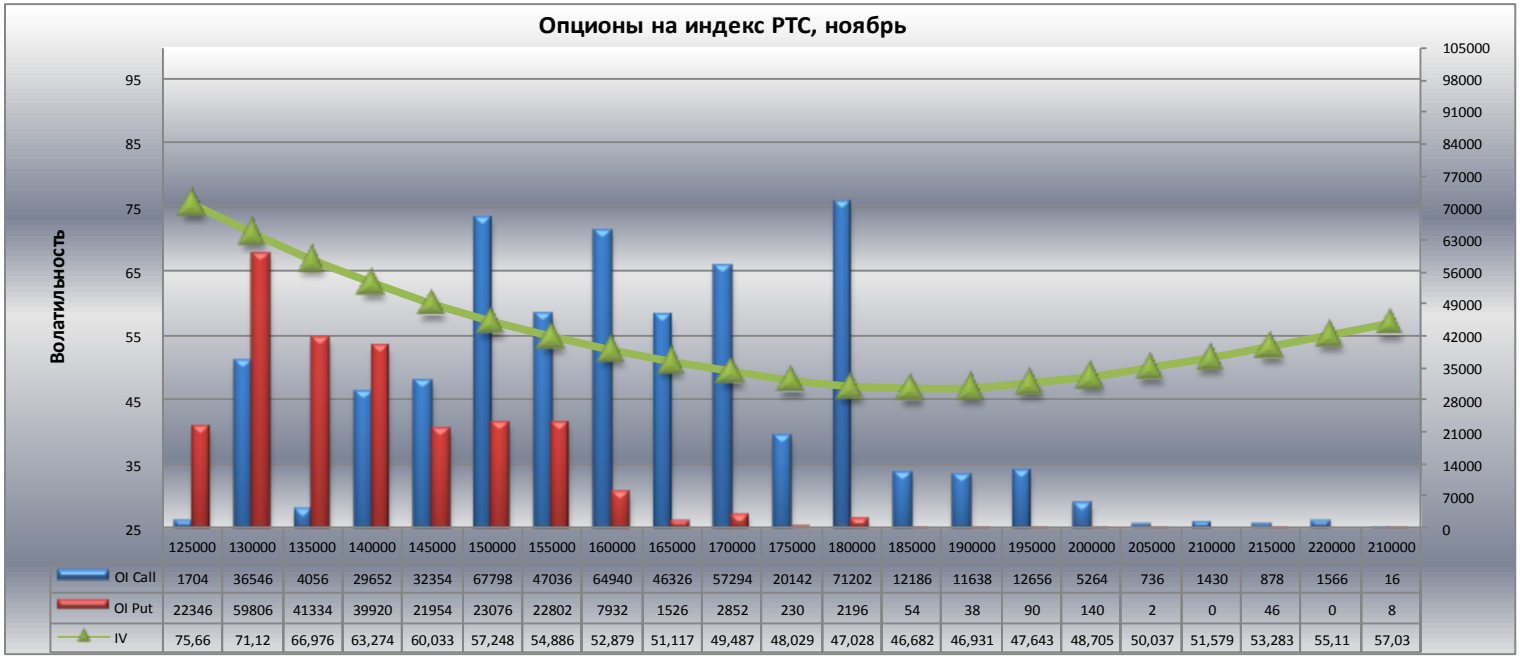
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	54894,49	-0,70%	00:12:30
CAC 40	2856,97	1,23%	19:35:18
DAX 30	5492,87	1,19%	19:35:31
DJ Industrial	11231,78	-0,23%	00:42:54
FTSE 100	5164,65	0,72%	19:35:22
Hang Seng	18021,29	1,88%	10:19:17
Nikkei 225	8283	1,51%	09:00:03
S&P 500	1158,67	-0,27%	00:02:19
Brent 12.11	112,39	0,45%	01:09:18
Gold	1707,34	1,28%	10:19:18
Palladium	581,85	2,06%	10:19:25
Platinum	1556,9	1,55%	10:18:11
RTSI	1 403,23	-0,70%	23:50:00
RTS_Standard	9 516,59	-0,68%	23:50:00
RTSI_DEREX	1402,25	1,21%	18:45:00

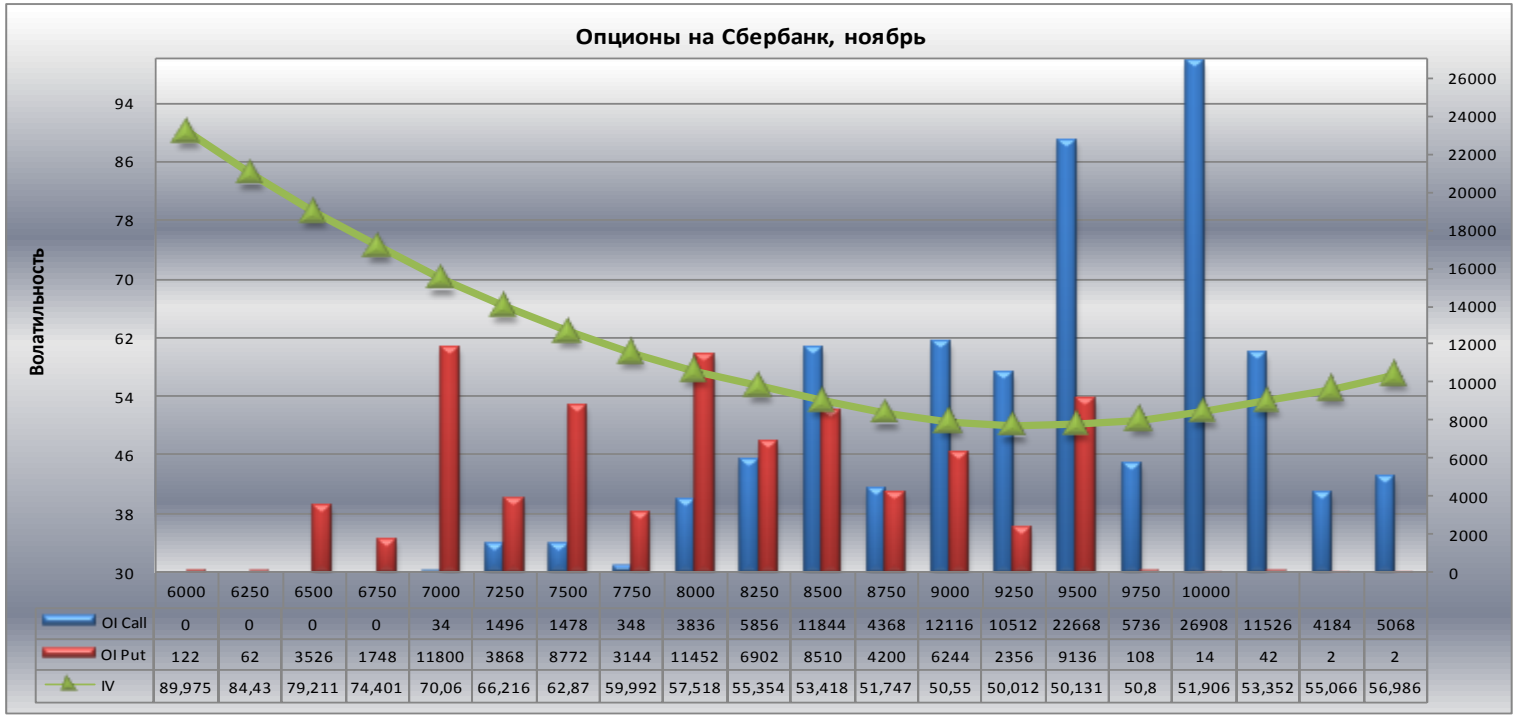
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1	1030736	22478023085,75	139250
ROSN-12.11	-0,7	107744	14784021,00	20564
LKOH-12.11	-0,92	180852	72560767,00	16320
GAZR-12.11	-1,44	409176	277412473,00	16440
GMKR-12.11	-1,36	127704	31046423,00	51202
SBRF-12.11	-0,97	1105928	646234470,00	7833
VTBR-12.11	-1,05	205614	24407414,00	6155
GOLD-12.11	-0,14	96450	203884539,09	1693
Si-12.11	0,2	1716320	1339287429,00	31683
Eu-12.11	-0,06	86476	11941137,00	41900
ED-12.11	-0,26	94720	971477600,02	1,3228
SBPR-12.11	-0,56	65490	117504165,00	6012
RTSS-12.11	-0,73	61964	15002510,00	9545
BR-12.11	-0,74	29 874	231367335,61	106,54

Дневная сессия

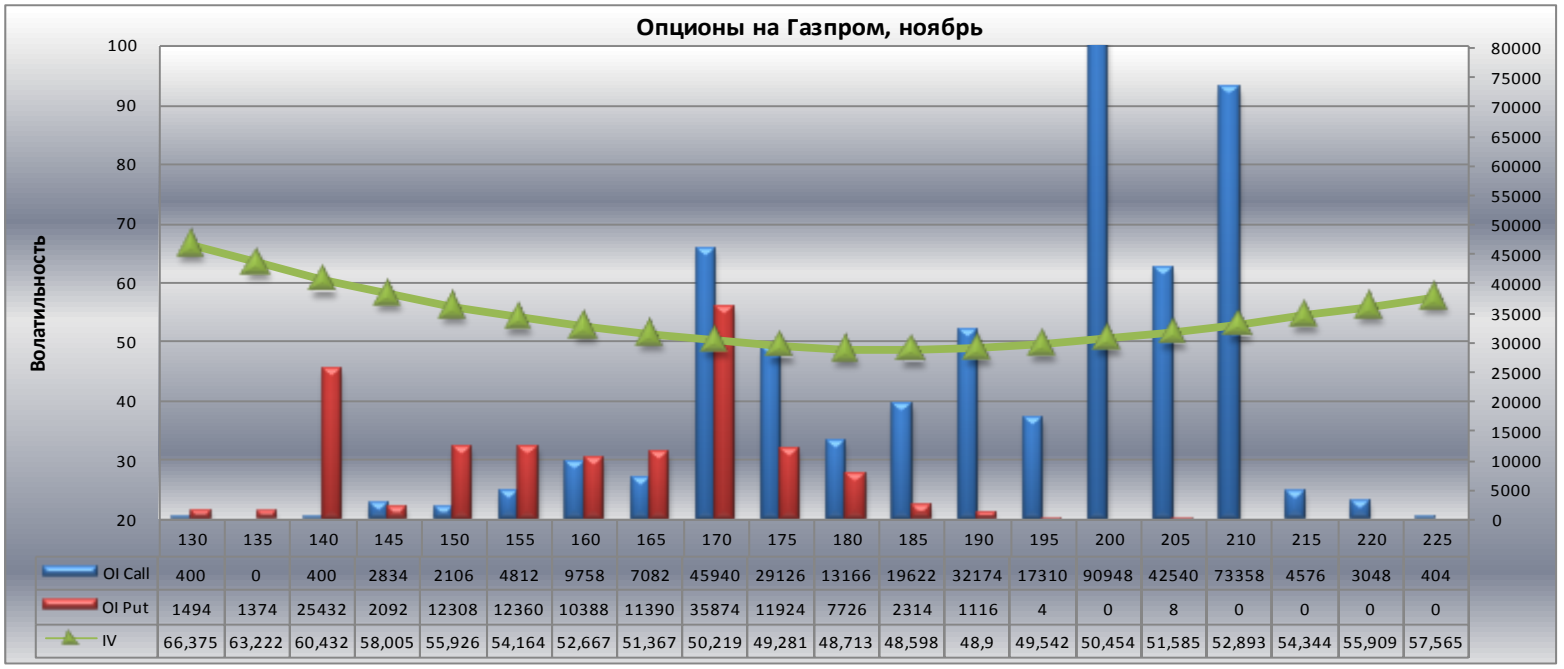
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	1,1	1028722	1,45039E+11	140660
ROSN-12.11	1,29	107464	330656228	20707
LKOH-12.11	0,49	182218	1367399986	16471
GAZR-12.11	0,21	400354	5050984126	16681
GMKR-12.11	0,18	127850	360139998	51910
SBRF-12.11	4,11	1112152	8629436324	7910
VTBR-12.11	1,02	201346	239914903	6222
GOLD-12.11	-0,35	97430	2133495748	1695,3
Si-12.11	0,1	1718458	26726832805	31620
Eu-12.11	-0,41	86700	217394180	41926
ED-12.11	-0,45	73726	4810863297	1,3264
SBPR-12.11	2,73	65404	39645010	6050
RTSS-12.11	1,16	61928	182981530	9615,5
BR-12.11	-0,13	31088	1408678994	107,32


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 1704 36546 4056 29652 32354 67798 47036 64940 46326 57294 20142 71202 12186 11638 12656 5264 736 1430 878 1566 16
OI Put 22346 59806 41334 39920 21954 23076 22802 7932 1526 2852 230 2196 54 38 90 140 2 0 46 0 8
IV 75,66 71,12 66,976 63,274 60,033 57,248 54,886 52,879 51,117 49,487 48,029 47,028 46,682 46,931 47,643 48,705 50,037 51,579 53,283 55,11 57,03

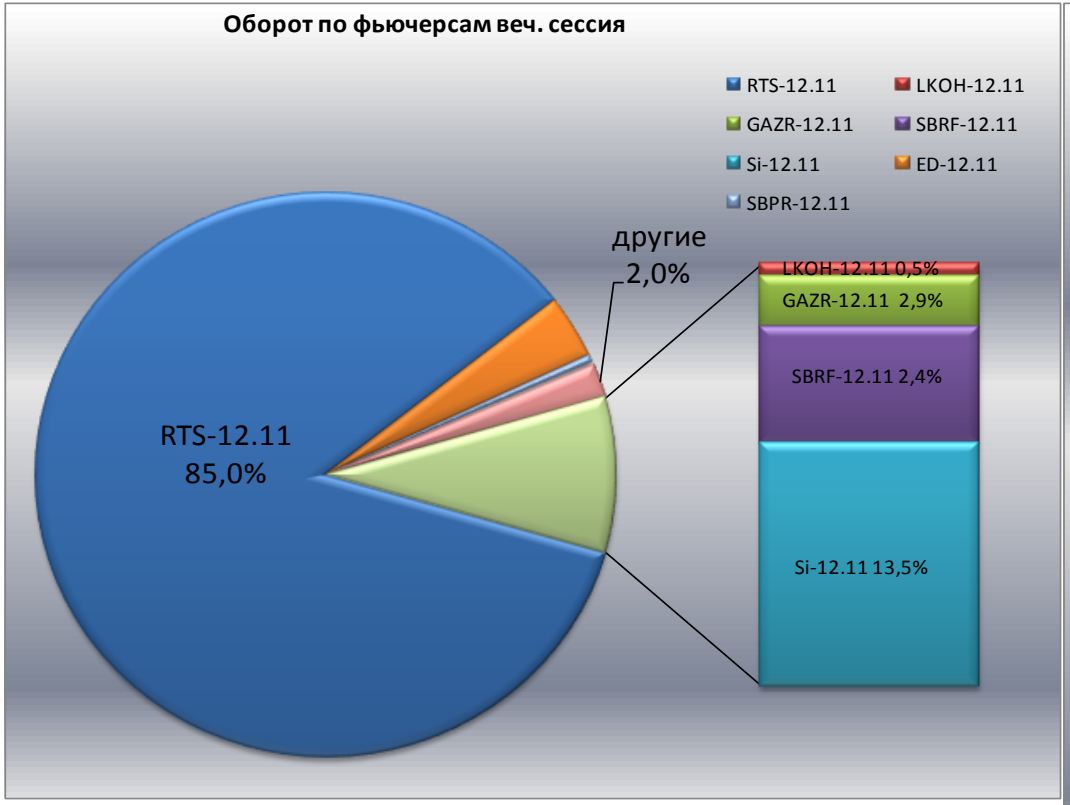

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
94
86
78
70
62
54
46
38
30
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 34 1496 1478 348 3836 5856 11844 4368 12116 10512 22668 5736 26908 11526 4184 5068
OI Put 122 62 3526 1748 11800 3868 8772 3144 11452 6902 8510 4200 6244 2356 9136 108 14 42 2 2
IV 89,975 84,43 79,211 74,401 70,06 66,216 62,87 59,992 57,518 55,354 53,418 51,747 50,55 50,012 50,131 50,8 51,906 53,352 55,066 56,986

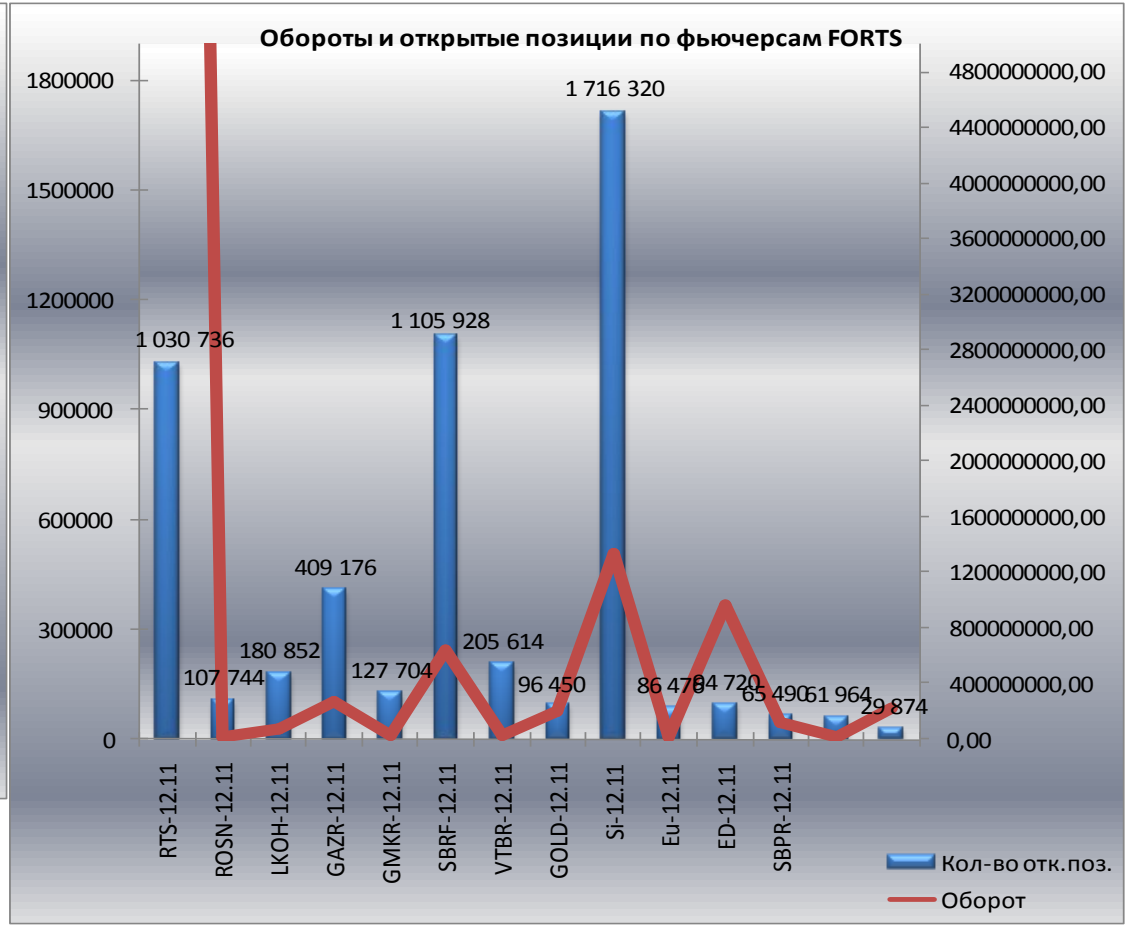


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1326	1872	1346
OI Put	0	0	0	0	12	0	100	502	1180	824	2622	704	1454
IV	65,664	61,331	57,213	53,366	49,831	46,635	43,792	41,299	39,137	37,267	35,626	34,129	32,72



	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	9758	7082	45940	29126	13166	19622	32174	17310	90948	42540	73358	4576	3048	404
OI Put	1494	1374	25432	2092	12308	12360	10388	11390	35874	11924	7726	2314	1116	4	0	8	0	0	0	0
IV	66,375	63,222	60,432	58,005	55,926	54,164	52,667	51,367	50,219	49,281	48,713	48,598	48,9	49,542	50,454	51,585	52,893	54,344	55,909	57,565


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
2,0%
RTS-12.11
85,0%
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
1 030 736
107 744
180 852
409 176
127 704
1 105 928
205 614
96 450
1 716 320
86 478
64 720
65 490
61 964
29 874
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