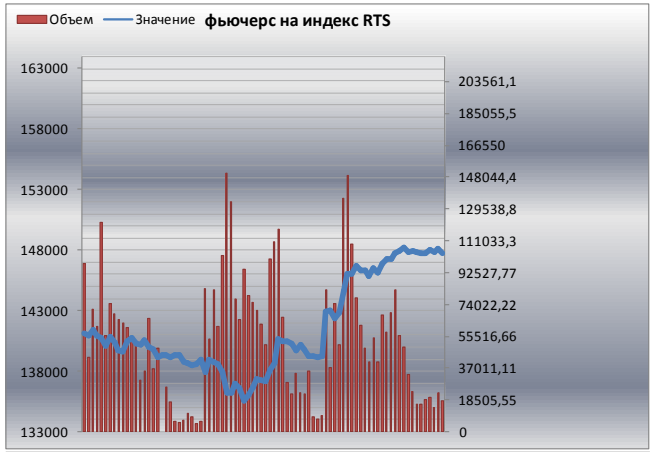
Восходящая динамика на фоне благоприятных новостей

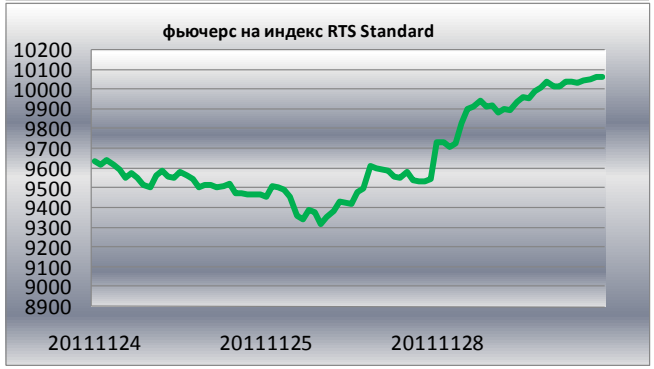
Как заявляют авторитетные западные СМИ, Фонд стабильности EFSF пока останется ориентированным на помощь Ирландии, Греции и Португалии, но возможно расширение фонда, по некоторым оценкам, фонд сможет гарантировать возмещение 20-30% от вновь размещаемых бумаг "периферийных" стран ЕС, что фактически увеличивает его доступные ресурсы с 250 млрд евро до 750-1250 млрд евро. В итоге основные индексы Европы неплохо подросли: FTSE100 +2,87%, DAX30 +4,60%, CAC40 +5,46%. Индексы США же закончили сессию со след. изменениями: DJ Industrial +2,59%, S&P500 +2,92%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $109,29 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1712,29 за тройскую унцию.

К концу торговой сессии индекс ММВБ подрос до отметки 1466,22 пункта (+3,93%), РТС остановился на уровне 1475,25 пункта(+4,39%).

Лучше рынка выглядели ОГК-3(+7,67%), Иркутскэнерго (+6,62%), МТС (+5,55%), Мосэнергосбыт (+5,38%). Также неплохо подросли привилегированные акции Сбербанка (+6,90%).





	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	147750	1477,50	-0,10	967 286	-1,29%	21 228 204 122	14,97%
ROSN-12.11	21821	218,21	0,52	107 564	0,00%	19 257 652	8,19%
LKOH-12.11	17197	1719,70	0,37	186 820	-0,40%	50 114 093	4,40%
GAZR-12.11	17250	172,50	0,00	412 524	-1,25%	320 996 970	9,96%
GMKR-12.11	53800	5380,00	0,12	126 774	-0,26%	27 998 372	5,87%
SBRF-12.11	8362	83,62	0,50	1 112 724	-1,21%	710 681 803	9,26%
VTBR-12.11	6499	0,0650	0,60	204 378	0,36%	13 121 548	5,81%
GOLD-12.11	1713	1713,1000	-0,35	88 308	-4,84%	583 628 133	34,83%
Si-12.11	31518	31,52	0,55	1 566 248	-2,65%	1 806 087 239	7,28%
Eu-12.11	41950	41,95	-0,10	74 488	-1,08%	20 375 707	7,64%
ED-12.11	1,33	1,33	-0,57	60 706	-17,74%	1 095 060 179	20,67%
SBPR-12.11	6490	64,90	0,92	65 150	0,31%	2 060 778	1,13%
RTSS-12.11	10067	10066,50	0,56	55 634	-0,10%	16 262 600	2,29%
BR-12.11	109	108,72	-0,20	30 862	6,72%	234 055 994	27,72%

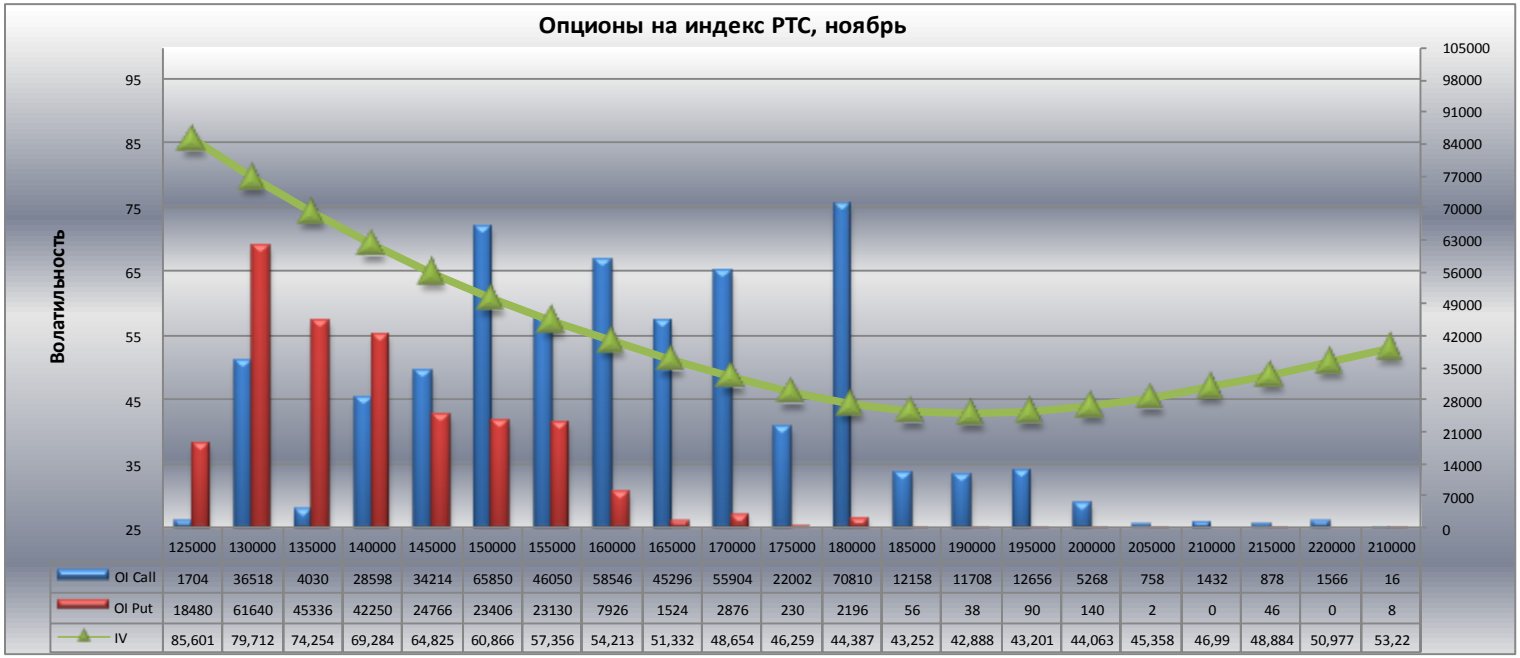
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56017,35	2,05%	00:12:30
CAC 40	3012,93	5,46%	19:35:18
DAX 30	5745,33	4,60%	19:35:31
DJ Industrial	11523,01	2,59%	00:42:54
FTSE 100	5312,76	2,87%	19:35:22
Hang Seng	18247,9	1,17%	10:19:17
Nikkei 225	8459,28	2,07%	09:00:03
S&P 500	1192,55	2,92%	00:02:19
Brent 12.11	109,29	0,27%	01:09:18
Gold	1712,29	0,09%	10:19:18
Palladium	584,25	1,02%	10:19:25
Platinum	1546,16	0,43%	10:18:11
RTSI	1 403,23	-0,70%	23:50:00
RTS_Standard	9 516,59	-0,68%	23:50:00
RTSI_DEREX	1469,37	4,21%	18:45:00

Вечерняя сессия

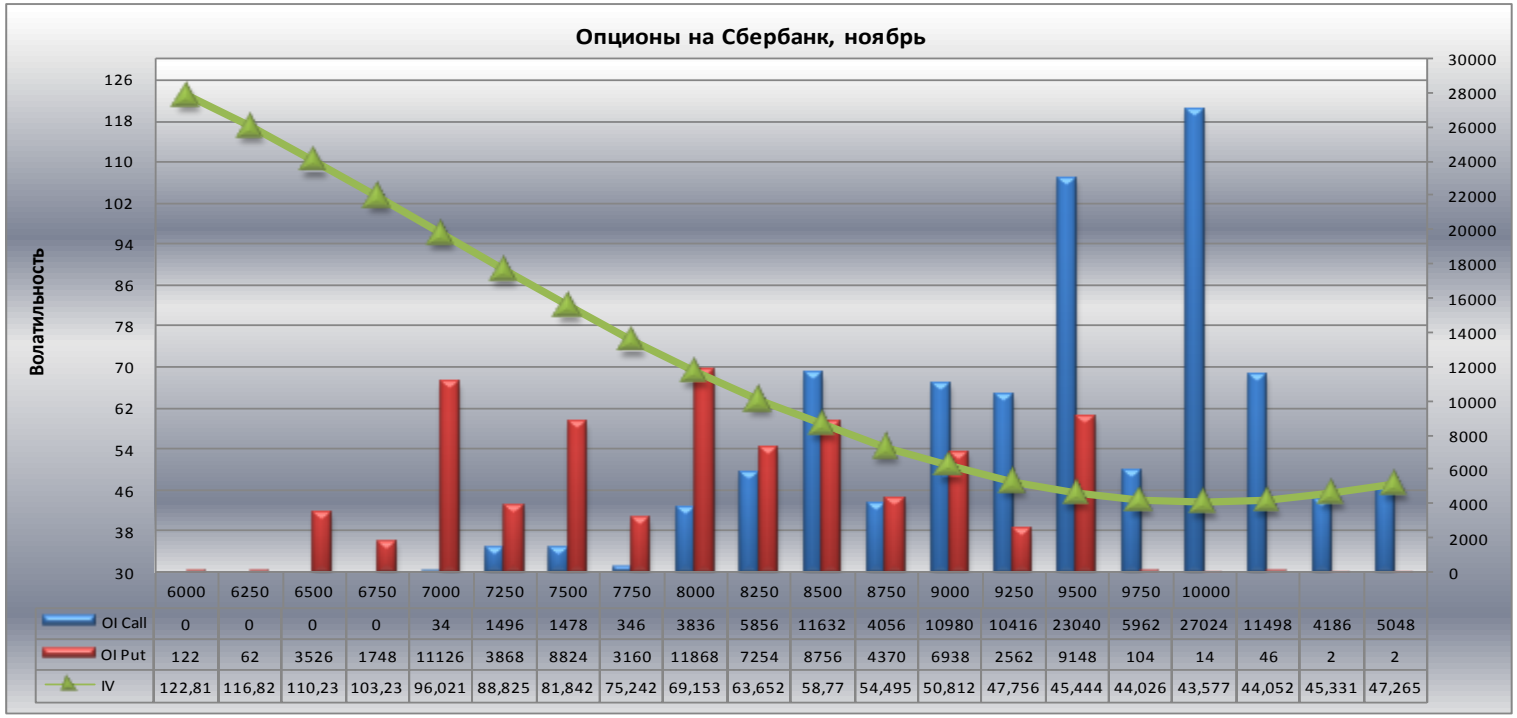
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,1	967286	21228204121,99	147750
ROSN-12.11	0,52	107564	19257652,00	21821
LKOH-12.11	0,37	186820	50114093,00	17197
GAZR-12.11	0	412524	320996970,00	17250
GMKR-12.11	0,12	126774	27998372,00	53800
SBRF-12.11	0,5	1112724	710681803,00	8362
VTBR-12.11	0,6	204378	13121548,00	6499
GOLD-12.11	-0,35	88308	583628133,24	1713,1
Si-12.11	0,55	1566248	1806087239,00	31518
Eu-12.11	-0,1	74488	20375707,00	41950
ED-12.11	-0,57	60706	1095060178,79	1,3309
SBPR-12.11	0,92	65150	2060778,00	6490
RTSS-12.11	0,56	55634	16262600,00	10066,5
BR-12.11	-0,2	30 862	234055993,85	108,72

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	5,15	979966	1,41839E+11	147905
ROSN-12.11	5,07	107560	235178971	21756
LKOH-12.11	4	187562	1139173032	17130
GAZR-12.11	3,41	417754	3222339811	17250
GMKR-12.11	3,52	127100	477043707	53735
SBRF-12.11	5,2	1126376	7678845795	8321
VTBR-12.11	3,82	203640	225686415	6460
GOLD-12.11	1,41	92802	1675863531	1719,2
Si-12.11	-0,87	1608882	24805917525	31345
Eu-12.11	0,15	75302	266662875	41990
ED-12.11	0,91	73798	5297020241	1,3385
SBPR-12.11	6,46	64948	181731451	6441
RTSS-12.11	4,11	55690	711481830	10011
BR-12.11	1,51	28918	844285855,7	108,94

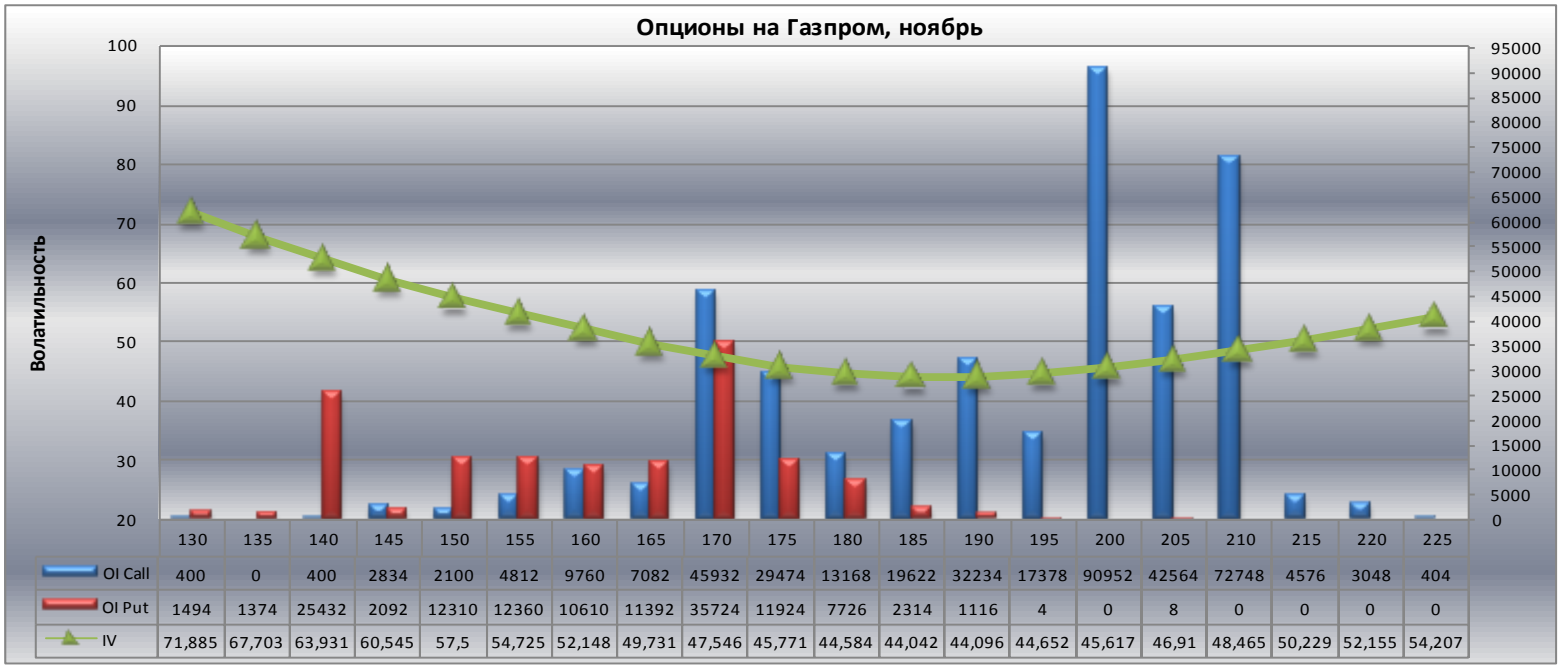


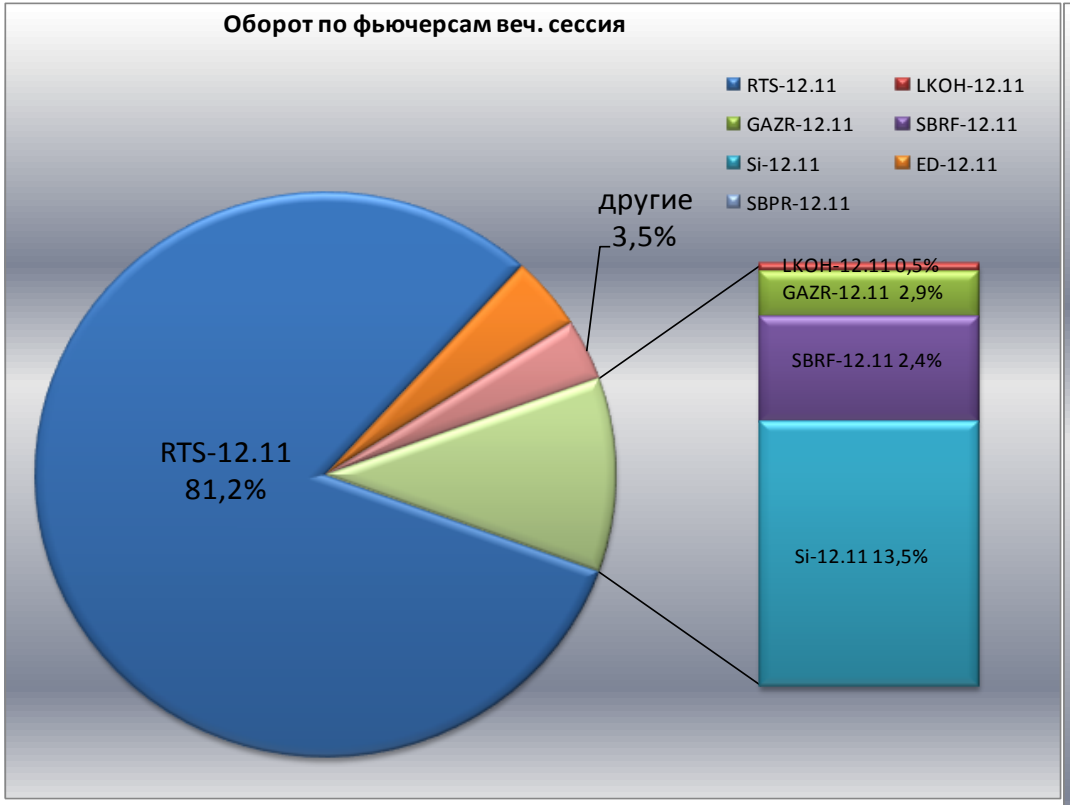
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	1704	36518	4030	28598	34214	65850	46050	58546	45296	55904	22002	70810	12158	11708	12656	5268	758	1432	878	1566	16
OI Put	18480	61640	45336	42250	24766	23406	23130	7926	1524	2876	230	2196	56	38	90	140	2	0	46	0	8
IV	85,601	79,712	74,254	69,284	64,825	60,866	57,356	54,213	51,332	48,654	46,259	44,387	43,252	42,888	43,201	44,063	45,358	46,99	48,884	50,977	53,22

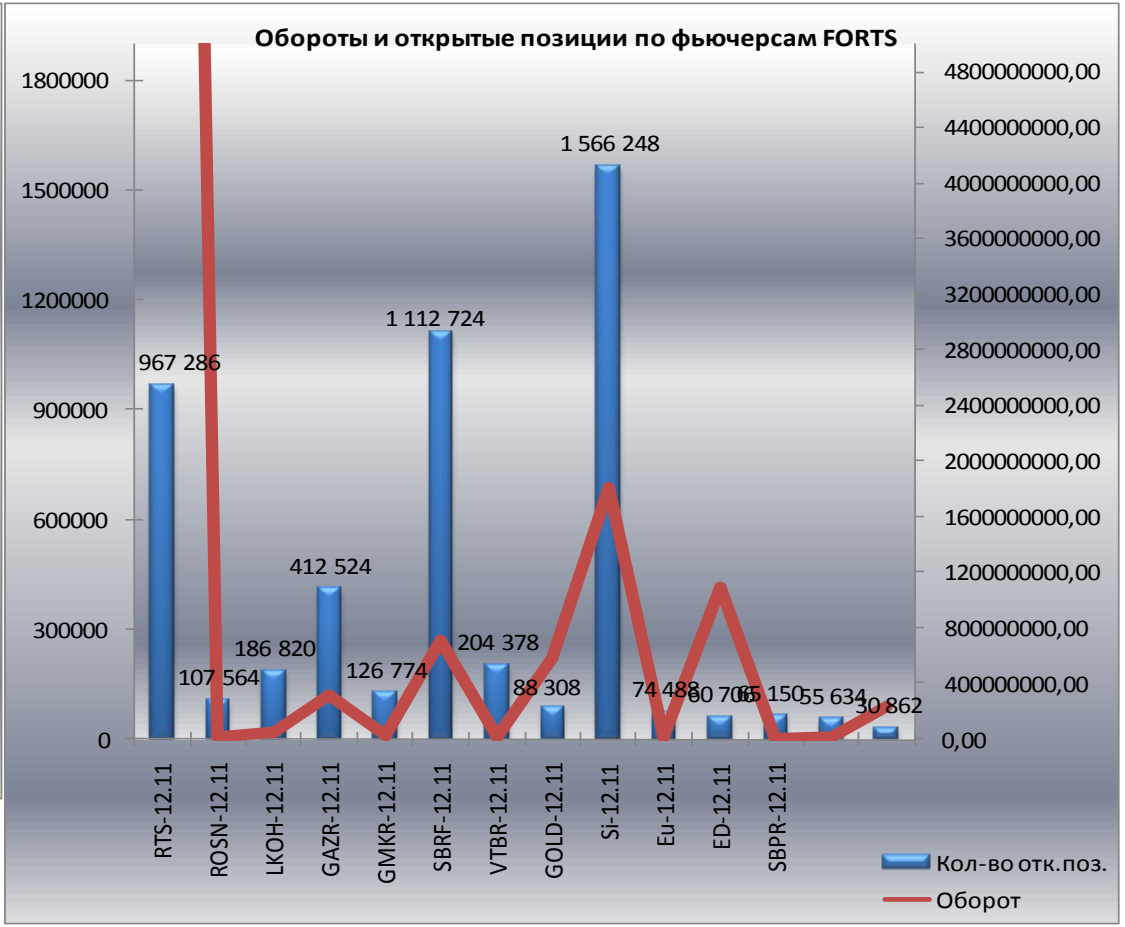


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	34	1496	1478	346	3836	5856	11632	4056	10980	10416	23040	5962	27024	11498	4186	5048
OI Put	122	62	3526	1748	11126	3868	8824	3160	11868	7254	8756	4370	6938	2562	9148	104	14	46	2	2
IV	122,81	116,82	110,23	103,23	96,021	88,825	81,842	75,242	69,153	63,652	58,77	54,495	50,812	47,756	45,444	44,026	43,577	44,052	45,331	47,265


Опционы на Лукойл, ноябрь
Волатильность
148
132
116
100
84
68
52
36
20
3200
2800
2400
2000
1600
1200
800
400
0
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 1334 1876 1354
OI Put 0 0 0 0 12 0 100 568 1280 824 2868 708 1454
IV 99,126 90,642 82,601 75,095 68,189 61,913 56,274 51,254 46,825 42,964 39,666 36,96 34,899


Опционы на Газпром, ноябрь
Волатильность
100
90
80
70
60
50
40
30
20
95000
90000
85000
80000
75000
70000
65000
60000
55000
50000
45000
40000
35000
30000
25000
20000
15000
10000
5000
0
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 2100 4812 9760 7082 45932 29474 13168 19622 32234 17378 90952 42564 72748 4576 3048 404
OI Put 1494 1374 25432 2092 12310 12360 10610 11392 35724 11924 7726 2314 1116 4 0 8 0 0 0 0
IV 71,885 67,703 63,931 60,545 57,5 54,725 52,148 49,731 47,546 45,771 44,584 44,042 44,096 44,652 45,617 46,91 48,465 50,229 52,155 54,207


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
другие
3,5%
RTS-12.11
81,2%
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
967 286
107 564
186 820
412 524
126 774
1 112 724
204 378
88 308
1 566 248
74 488
60 706
65 150
55 634
30 862
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