Рейтинги ведущих банков мира пересмотрены

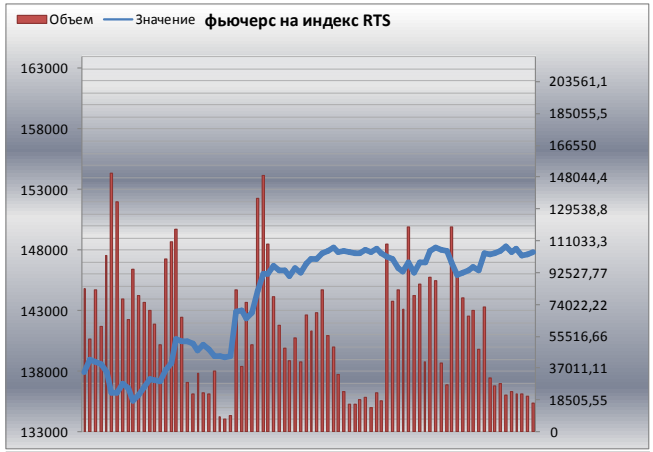
Агентство S&P понизило рейтинг 37 ведущих западных банков, таких как Bank of America, Goldman Sachs, Citigroup, Merrill Lynch, Wells Fargo, Credit Suisse, UBS, Deutsche Bank, Barclays и др., а Fitch изменило прогноз по рейтингу США.

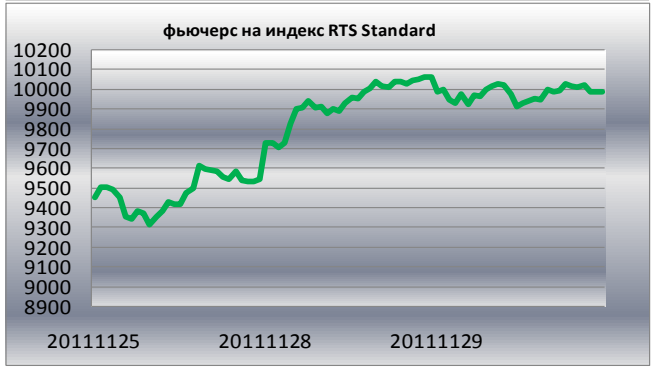
В итоге основные индексы Европы неплохо подросли: FTSE100 +0,46%, DAX30 +0,95%, CAC40 +0,46%. Индексы США же закончили сессию со след. изменениями: DJ Industrial +0,28%, S&P500 +0,22%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $110,68 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1721,2 за тройскую унцию.

К концу торговой сессии индекс ММВБ составил 1454,67 пункта (-0,79%), РТС остановился на уровне 1466,36 пункта(-0,66%).

Лучше рынка выглядели Акрон (+2,43%), МРСК Центр (+4,73%), Северсталь (+4,24%). Также неплохо подросли акции Седьмого Континента (+18,37%).





	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	147795	1477,95	0,99	947 468	0,85%	26 580 333 523	17,90%
ROSN-12.11	21936	219,36	1,18	108 694	-0,61%	25 958 087	8,63%
LKOH-12.11	17227	1722,70	1,36	175 072	-0,49%	136 571 915	10,38%
GAZR-12.11	17179	171,79	0,20	406 544	1,97%	397 822 168	8,01%
GMKR-12.11	52352	5235,20	0,04	127 164	-0,07%	18 692 242	4,69%
SBRF-12.11	8371	83,71	1,05	1 091 802	0,05%	738 162 238	8,32%
VTBR-12.11	6440	0,0644	0,47	211 296	-0,18%	6 751 802	3,67%
GOLD-12.11	1724	1723,6000	0,38	94 220	-0,55%	196 133 670	15,18%
Si-12.11	31352	31,35	-0,18	1 498 388	-0,30%	1 170 689 675	4,65%
Eu-12.11	41789	41,79	-0,18	70 254	-0,23%	9 898 723	6,86%
ED-12.11	1,33	1,33	0,08	70 302	-1,02%	778 518 576	10,94%
SBPR-12.11	6470	64,70	0,43	61 076	0,10%	1 453 703	1,39%
RTSS-12.11	9991	9991,00	0,42	51 762	-0,04%	5 894 950	0,92%
BR-12.11	111	110,95	0,74	31 868	-4,14%	260 318 196	19,67%

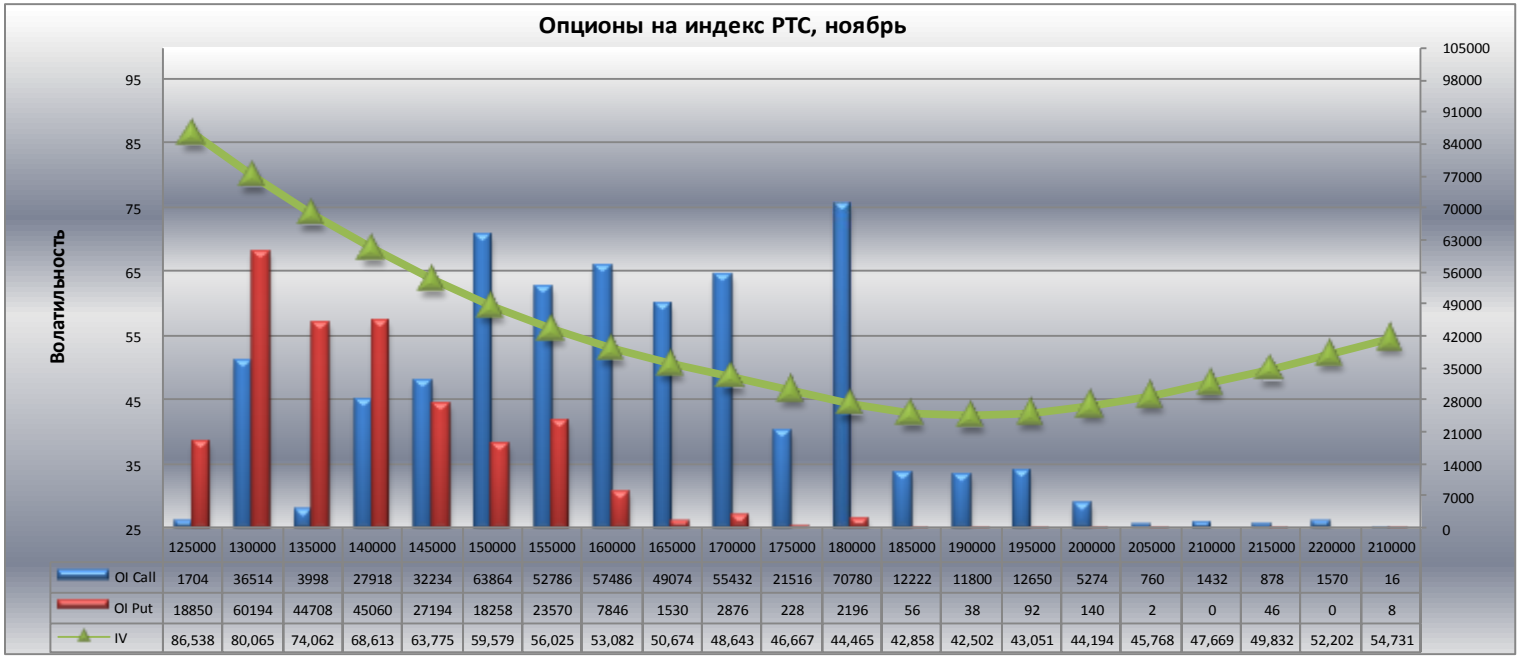
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	55299,76	-1,28%	00:12:30
CAC 40	3026,76	0,46%	19:35:18
DAX 30	5799,91	0,95%	19:35:31
DJ Industrial	11555,63	0,28%	00:42:54
FTSE 100	5337	0,46%	19:35:22
Hang Seng	17946,87	-1,69%	10:19:17
Nikkei 225	8414,24	-0,75%	09:00:03
S&P 500	1195,19	0,22%	00:02:19
Brent	110,68	-0,13%	01:09:18
Gold	1721,2	0,46%	10:19:18
Palladium	588,8	1,21%	10:19:25
Platinum	1535,93	-0,31%	10:18:11
RTSI	1 479,78	0,81%	23:50:00
RTS_Standard	9 973,22	0,64%	23:50:00
RTSI_DEREX	1455,33	-0,90%	18:45:00

Вечерняя сессия

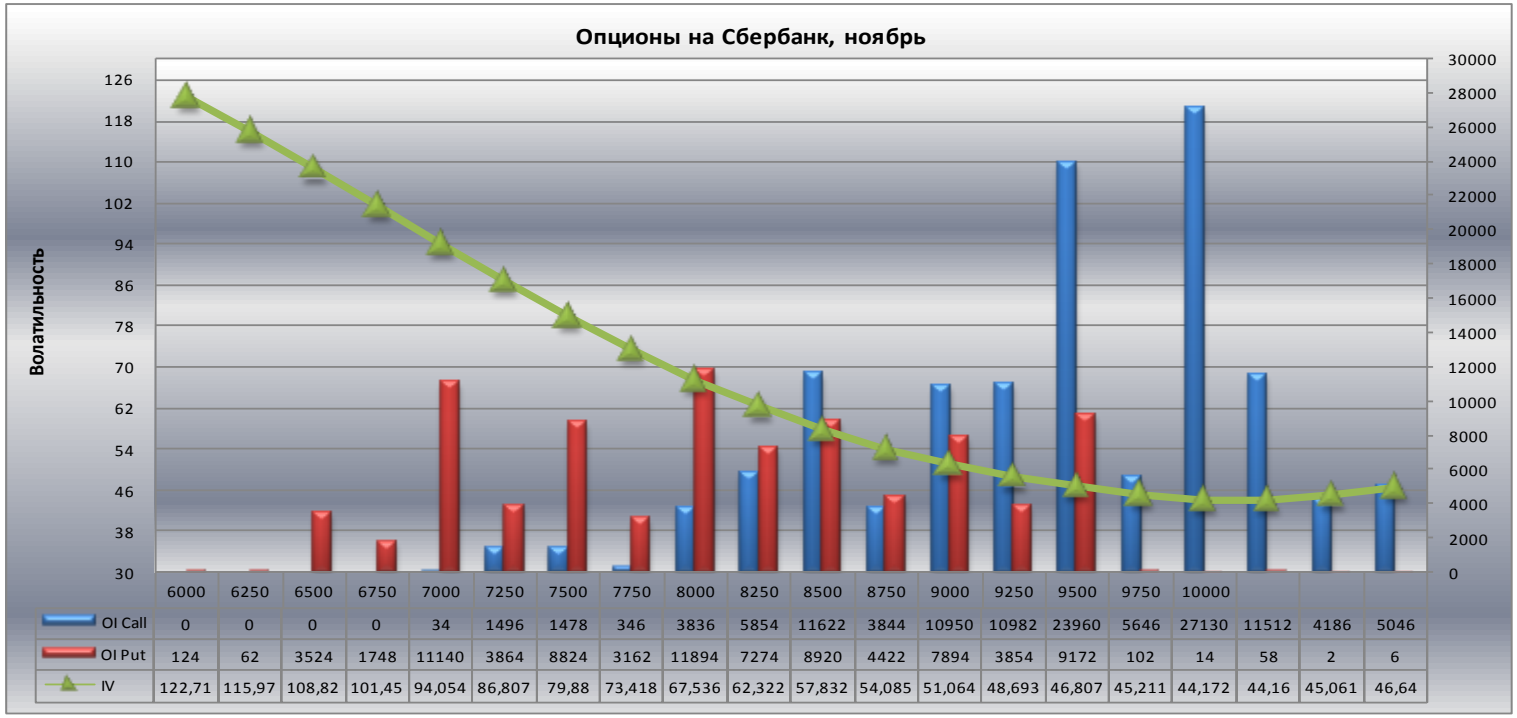
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,99	947468	26580333523,04	147795
ROSN-12.11	1,18	108694	25958087,00	21936
LKOH-12.11	1,36	175072	136571915,00	17227
GAZR-12.11	0,2	406544	397822168,00	17179
GMKR-12.11	0,04	127164	18692242,00	52352
SBRF-12.11	1,05	1091802	738162238,00	8371
VTBR-12.11	0,47	211296	6751802,00	6440
GOLD-12.11	0,38	94220	196133669,52	1723,6
Si-12.11	-0,18	1498388	1170689675,00	31352
Eu-12.11	-0,18	70254	9898723,00	41789
ED-12.11	0,08	70302	778518576,13	1,3331
SBPR-12.11	0,43	61076	1453703,00	6470
RTSS-12.11	0,42	51762	5894950,00	9991
BR-12.11	0,74	31 868	260318195,82	110,95

Дневная сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,06	939456	1,48501E+11	146345
ROSN-12.11	-0,33	109360	300690205	21685
LKOH-12.11	-0,76	175940	1315872357	16999
GAZR-12.11	-0,58	398688	4965931130	17150
GMKR-12.11	-2,62	127248	398955656	52330
SBRF-12.11	-0,44	1091224	8873545637	8284
VTBR-12.11	-0,77	211678	183860430	6410
GOLD-12.11	-0,13	94744	1292027743	1717
Si-12.11	0,21	1502844	25166499680	31410
Eu-12.11	-0,3	70414	144382048	41863
ED-12.11	-0,48	71030	7117462238	1,3321
SBPR-12.11	0,06	61018	104556888	6445
RTSS-12.11	-0,61	51782	642230910	9949,5
BR-12.11	1,1	33244	1323740369	110,14

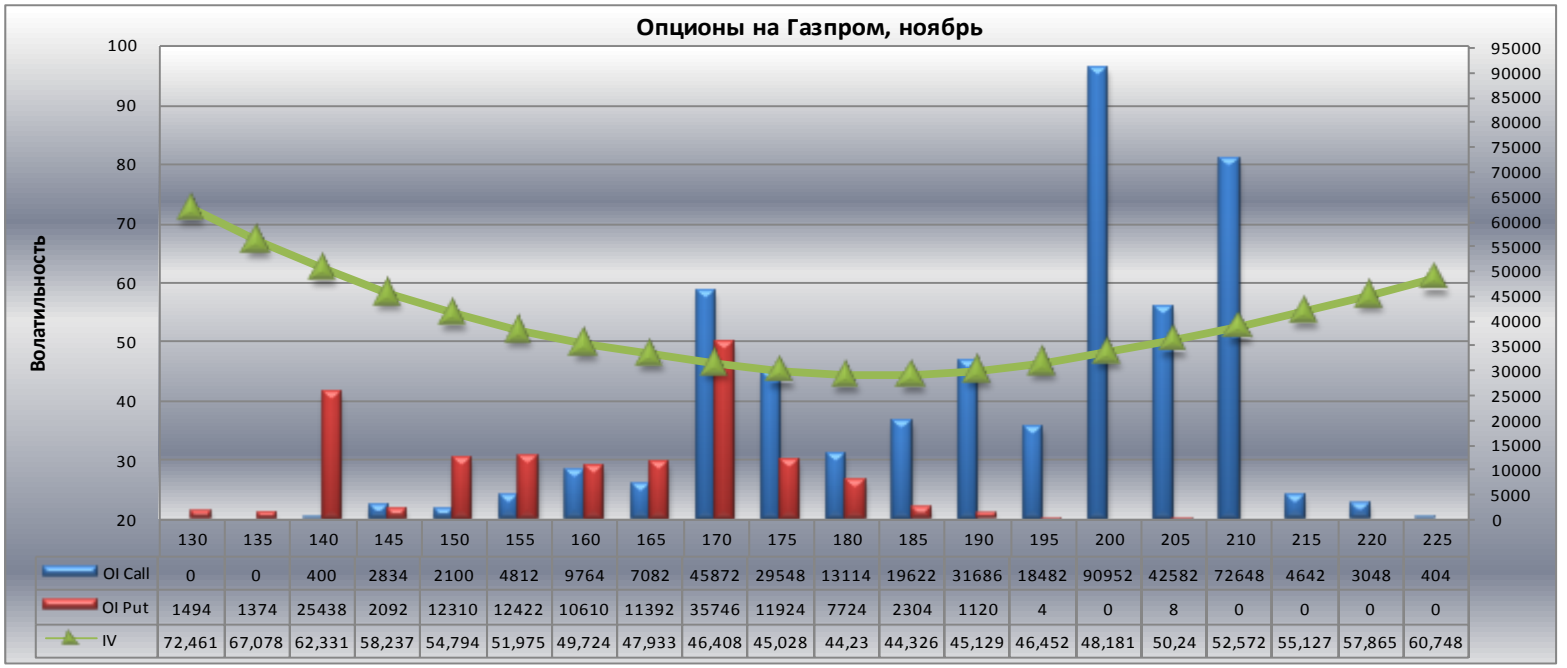


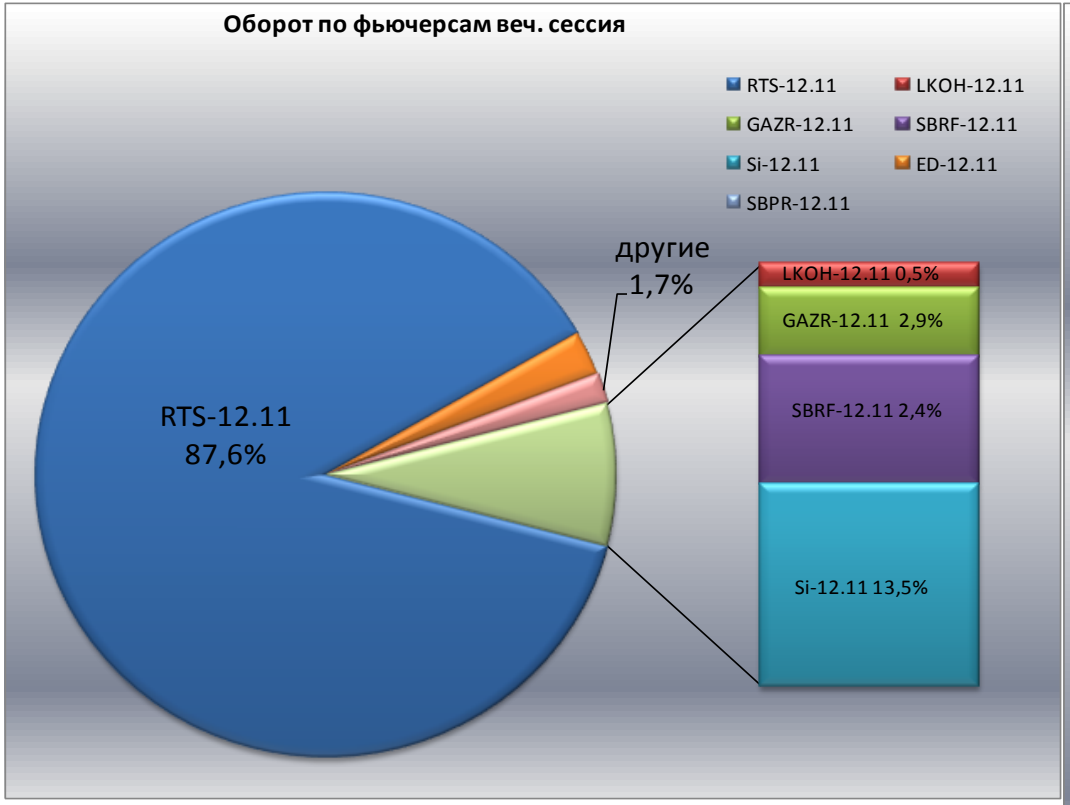
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	1704	36514	3998	27918	32234	63864	52786	57486	49074	55432	21516	70780	12222	11800	12650	5274	760	1432	878	1570	16
OI Put	18850	60194	44708	45060	27194	18258	23570	7846	1530	2876	228	2196	56	38	92	140	2	0	46	0	8
IV	86,538	80,065	74,062	68,613	63,775	59,579	56,025	53,082	50,674	48,643	46,667	44,465	42,858	42,502	43,051	44,194	45,768	47,669	49,832	52,202	54,731

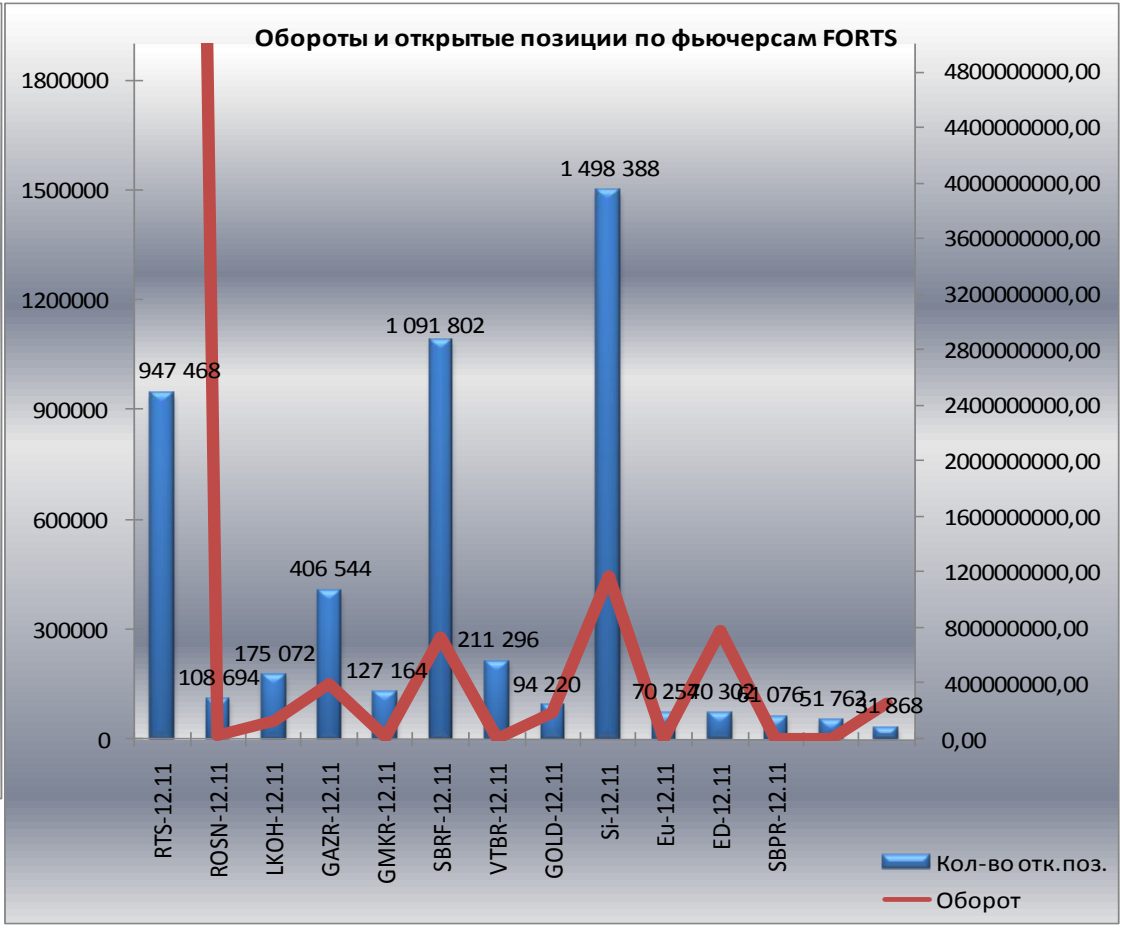


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	34	1496	1478	346	3836	5854	11622	3844	10950	10982	23960	5646	27130	11512	4186	5046
OI Put	124	62	3524	1748	11140	3864	8824	3162	11894	7274	8920	4422	7894	3854	9172	102	14	58	2	6
IV	122,71	115,97	108,82	101,45	94,054	86,807	79,88	73,418	67,536	62,322	57,832	54,085	51,064	48,693	46,807	45,211	44,172	44,16	45,061	46,64


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 1330 1872 1352
OI Put 0 0 0 0 12 0 100 568 1280 824 2868 1060 1454
IV 92,258 85,068 78,217 71,804 65,91 60,592 55,886 51,805 48,342 45,46 43,085 41,066 39,126


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 0 0 400 2834 2100 4812 9764 7082 45872 29548 13114 19622 31686 18482 90952 42582 72648 4642 3048 404
OI Put 1494 1374 25438 2092 12310 12422 10610 11392 35746 11924 7724 2304 1120 4 0 8 0 0 0 0
IV 72,461 67,078 62,331 58,237 54,794 51,975 49,724 47,933 46,408 45,028 44,23 44,326 45,129 46,452 48,181 50,24 52,572 55,127 57,865 60,748


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
1,7%
RTS-12.11
87,6%
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
947 468
108 694
175 072
406 544
127 164
1 091 802
211 296
94 220
1 498 388
70 254
70 302
61 076
51 762
31 868
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