Рынки завершили торговую сессию взрывным ростом индексов

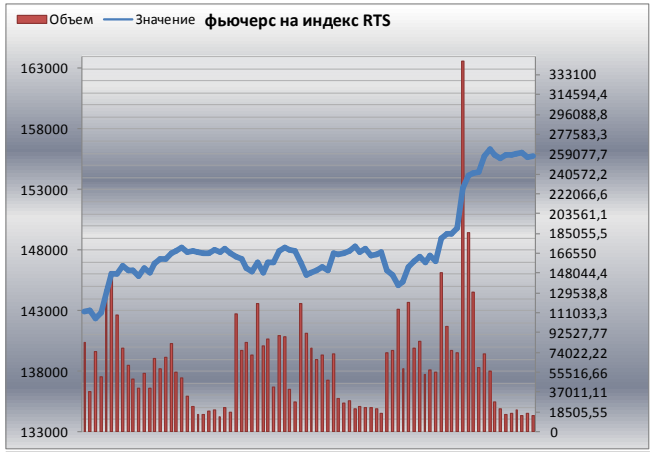
Уныние по поводу снижения агентством S&P рейтинга аж 37 крупнейшим банкам длилось недолго. Центробанки решили действовать слаженно: ФРС, ЕЦБ, а также ЦБ Канады, Великобритании, Японии и Швейцарии договорились понизить процентные ставки по долларовым свопам на 50 б.п. и продлить действия соглашений о свопах до 1 февраля 2013 года. Народный банк Китая также решил понизить норму обязательных банковских резервов на 50 б. п. с 5 декабря.

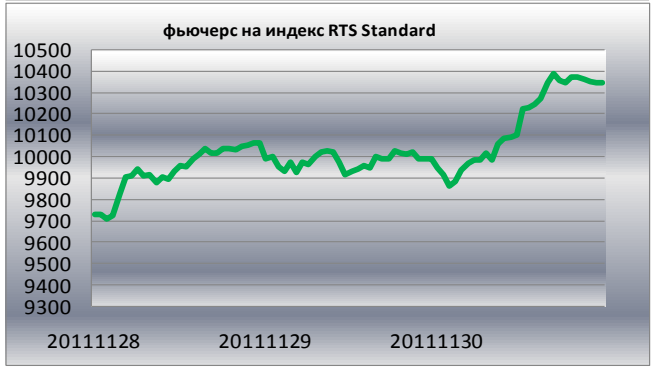
В итоге основные индексы закончили вечернюю торговую сессию со следующими изменениями: FTSE100 +0,46%, DAX30 +4,98%, CAC40 +4,22%, DJ Industrial +4,24%, S&P500 +4,33%.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $110,77 за баррель. Заметно подросло в цене золото, состав $1750,94 за тройскую унцию.

К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1499,62 пункта, прибавив +3,09%, РТС остановился на уровне 1540,81 пункта, прибавив 5,08%.

В лидерах роста Сбербанк(+6,02%), ФСК ЕЭС (+6,73%), Верхнесалд (+15,72%).





	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	155720	1557,20	0,81	924 388	-2,61%	26 853 516 784	12,98%
ROSN-12.11	22515	225,15	0,39	104 742	-0,24%	31 942 704	8,09%
LKOH-12.11	17300	1730,00	0,18	185 014	1,61%	141 286 202	7,19%
GAZR-12.11	17685	176,85	0,48	405 982	-1,53%	466 866 405	6,40%
GMKR-12.11	54703	5470,30	0,46	125 352	-0,17%	33 668 650	5,65%
SBRF-12.11	9017	90,17	2,69	1 180 308	5,48%	1 910 092 836	16,22%
VTBR-12.11	6850	0,0685	0,94	211 672	0,86%	49 555 337	25,06%
GOLD-12.11	1750	1749,7000	-0,10	83 870	-8,53%	539 836 581	17,02%
Si-12.11	30807	30,81	0,09	1 482 162	-0,05%	1 915 726 288	4,70%
Eu-12.11	41415	41,42	-0,26	70 304	-0,11%	28 462 007	25,49%
ED-12.11	1,34	1,34	-0,36	60 592	-11,49%	2 382 627 119	39,00%
SBPR-12.11	6911	69,11	2,07	60 050	0,50%	15 087 949	14,73%
RTSS-12.11	10350	10350,00	0,78	48 560	-0,13%	14 877 345	1,98%
BR-12.11	110	110,48	-1,15	29 298	-4,47%	329 022 908	24,34%

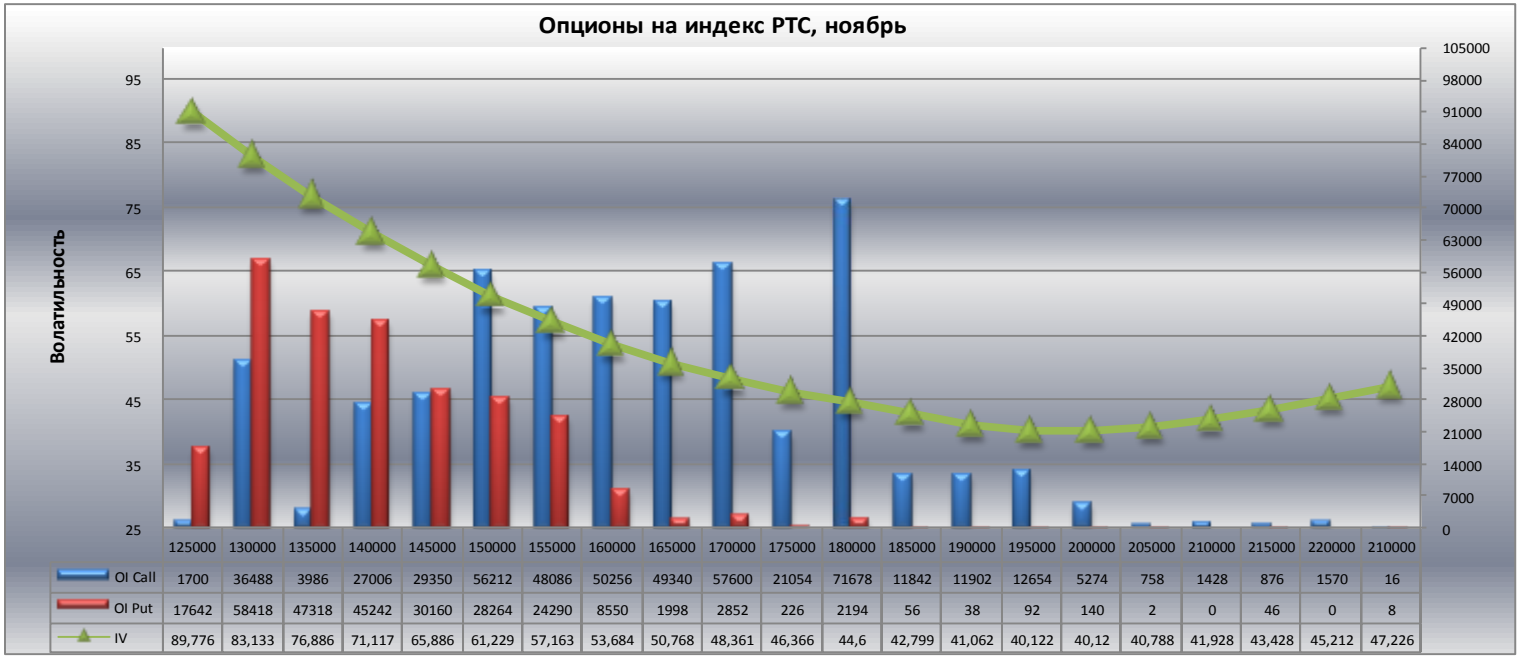
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	56874,98	2,85%	00:12:30
CAC 40	3154,62	4,22%	19:35:18
DAX 30	6088,84	4,98%	19:35:31
DJ Industrial	12045,68	4,24%	00:42:54
FTSE 100	5337	0,46%	19:35:22
Hang Seng	18992,1	5,57%	10:19:17
Nikkei 225	8610,25	2,08%	09:00:03
S&P 500	1246,96	4,33%	00:02:19
Brent	110,77211	0,23%	01:09:18
Gold	1750,94	0,04%	10:19:18
Palladium	616,2	0,59%	10:19:25
Platinum	1559,2	-0,10%	10:18:11
RTSI	1 551,05	0,61%	23:50:00
RTS_Standard	10 331,49	0,83%	23:50:00
RTSI_DEREX	1532,54	5,47%	18:45:00

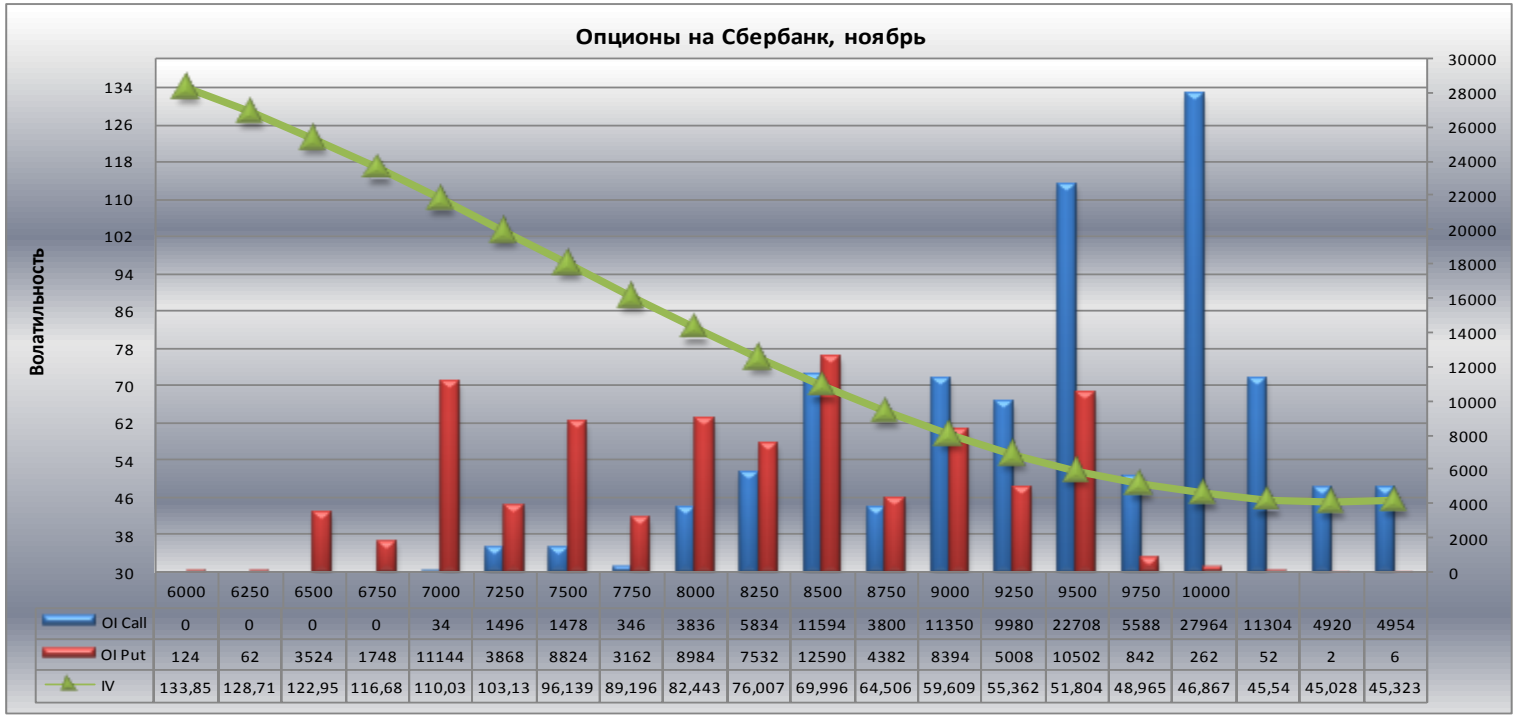
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,81	924388	26853516784,46	155720
ROSN-12.11	0,39	104742	31942704,00	22515
LKOH-12.11	0,18	185014	141286202,00	17300
GAZR-12.11	0,48	405982	466866405,00	17685
GMKR-12.11	0,46	125352	33668650,00	54703
SBRF-12.11	2,69	1180308	1910092836,00	9017
VTBR-12.11	0,94	211672	49555337,00	6850
GOLD-12.11	-0,1	83870	539836581,18	1749,7
Si-12.11	0,09	1482162	1915726288,00	30807
Eu-12.11	-0,26	70304	28462007,00	41415
ED-12.11	-0,36	60592	2382627119,25	1,344
SBPR-12.11	2,07	60050	15087949,00	6911
RTSS-12.11	0,78	48560	14877345,00	10350
BR-12.11	-1,15	29 298	329022908,16	110,48

Дневная сессия

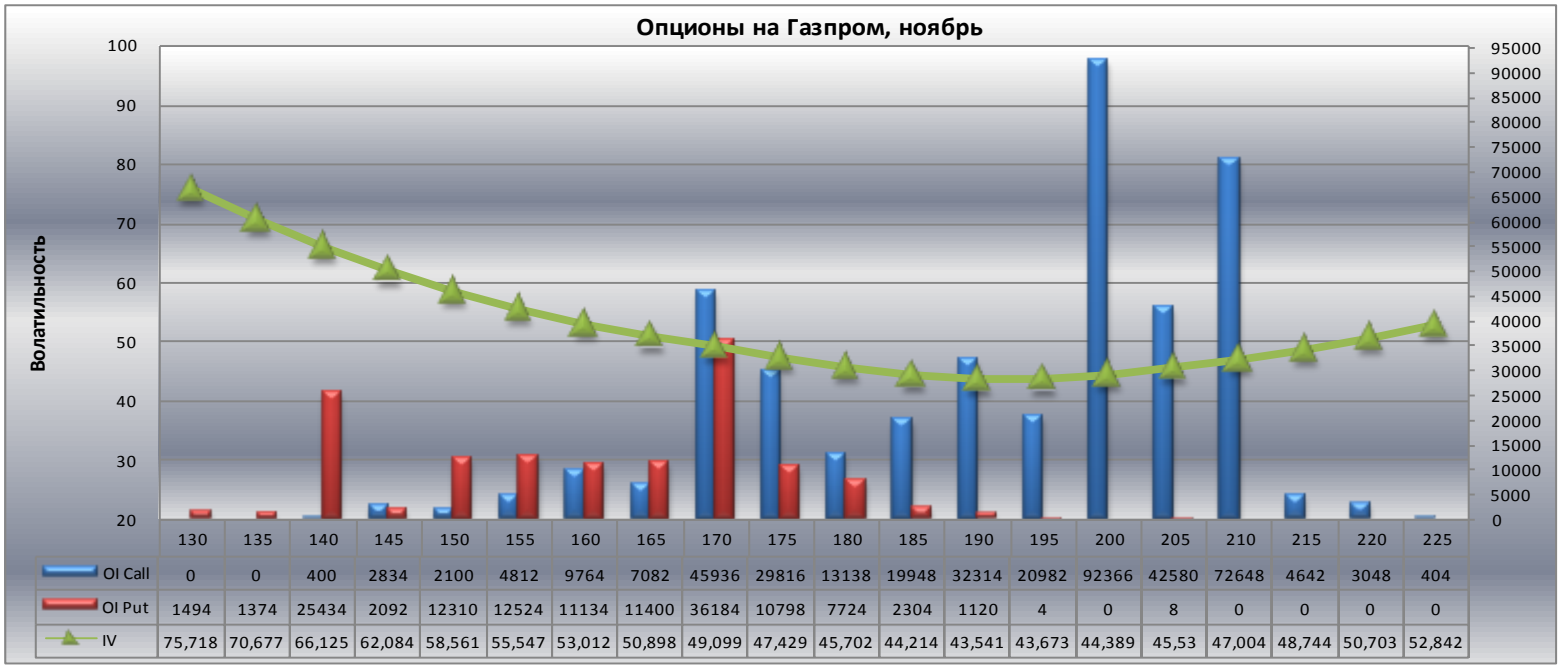
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	5,55	949184	2,06836E+11	154465
ROSN-12.11	3,52	104994	394894816	22448
LKOH-12.11	1,59	182074	1963874889	17269
GAZR-12.11	2,58	412276	7290845436	17593
GMKR-12.11	4,06	125566	595889508	54455
SBRF-12.11	6	1118992	11774510599	8781
VTBR-12.11	5,87	209872	197762374	6786
GOLD-12.11	1,99	91696	3171585407	1751,2
Si-12.11	-2,01	1482924	40737702185	30778
Eu-12.11	-0,81	70378	111640488	41525
ED-12.11	1,25	68454	6109574241	1,3488
SBPR-12.11	5,06	59750	102440142	6771
RTSS-12.11	3,27	48622	751195855	10275
BR-12.11	1,48	30670	1351906915	111,77


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 1700 36488 3986 27006 29350 56212 48086 50256 49340 57600 21054 71678 11842 11902 12654 5274 758 1428 876 1570 16
OI Put 17642 58418 47318 45242 30160 28264 24290 8550 1998 2852 226 2194 56 38 92 140 2 0 46 0 8
IV 89,776 83,133 76,886 71,117 65,886 61,229 57,163 53,684 50,768 48,361 46,366 44,6 42,799 41,062 40,122 40,12 40,788 41,928 43,428 45,212 47,226

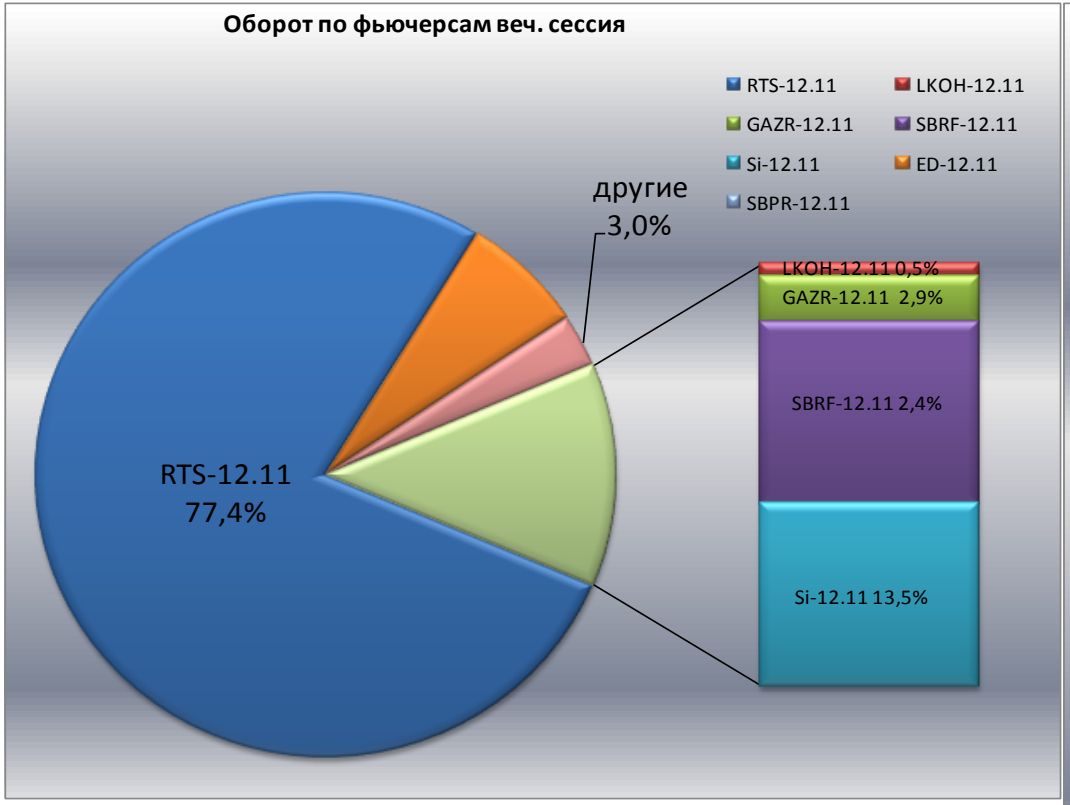

Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
134
126
118
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
30000
28000
26000
24000
22000
20000
18000
16000
14000
12000
10000
8000
6000
4000
2000
0
6000 6250 6500 6750 7000 7250 7500 7750 8000 8250 8500 8750 9000 9250 9500 9750 10000
OI Call 0 0 0 0 34 1496 1478 346 3836 5834 11594 3800 11350 9980 22708 5588 27964 11304 4920 4954
OI Put 124 62 3524 1748 11144 3868 8824 3162 8984 7532 12590 4382 8394 5008 10502 842 262 52 2 6
IV 133,85 128,71 122,95 116,68 110,03 103,13 96,139 89,196 82,443 76,007 69,996 64,506 59,609 55,362 51,804 48,965 46,867 45,54 45,028 45,323

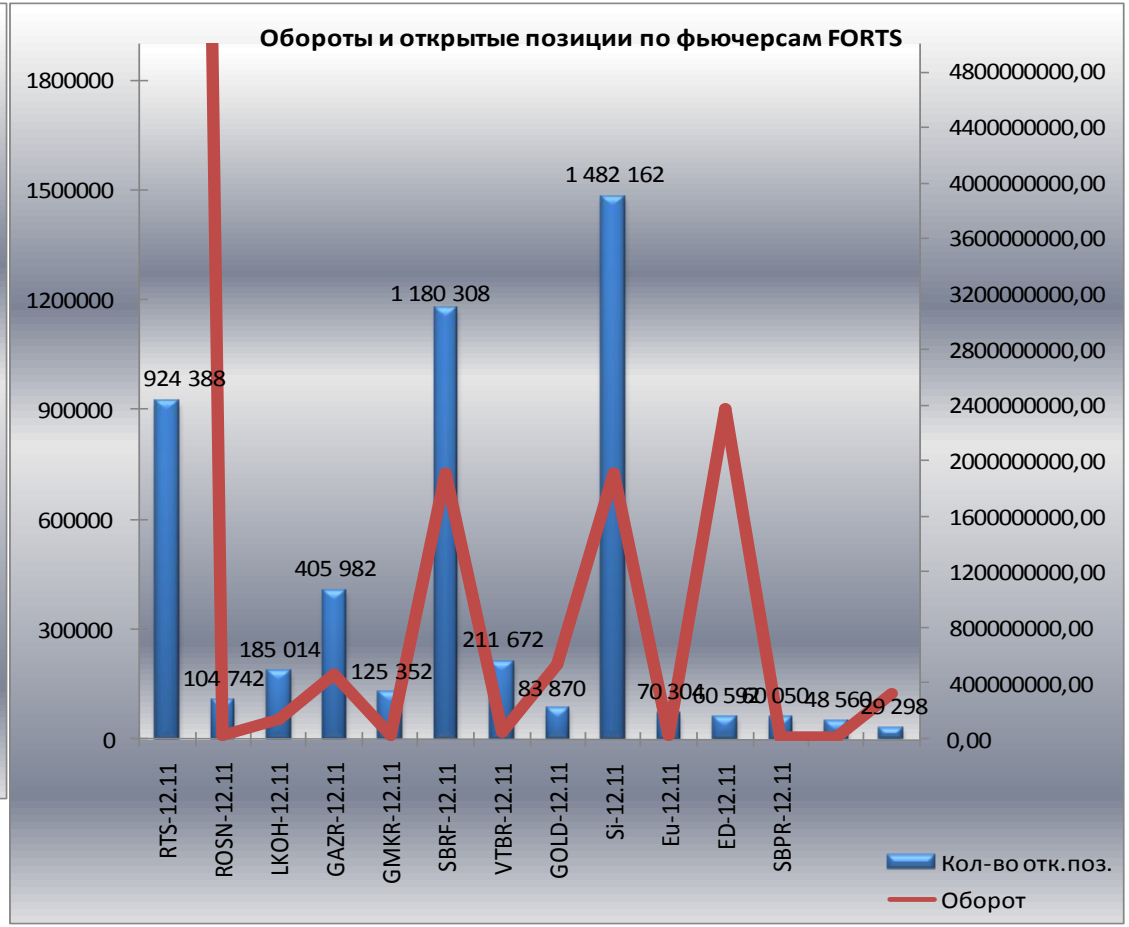


	1200	1250	1300	1350	1400	1450	1500	1550	1600	1650	1700	1750	1800
OI Call	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1330	1872	1352
OI Put	0	0	0	0	12	0	100	566	1280	824	2868	1338	1454
IV	89,988	87,739	81,562	75,761	70,4	65,523	61,159	57,321	54,006	51,194	48,844	46,881	45,169



	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	45936	29816	13138	19948	32314	20982	92366	42580	72648	4642	3048	404
OI Put	1494	1374	25434	2092	12310	12524	11134	11400	36184	10798	7724	2304	1120	4	0	8	0	0	0	0
IV	75,718	70,677	66,125	62,084	58,561	55,547	53,012	50,898	49,099	47,429	45,702	44,214	43,541	43,673	44,389	45,53	47,004	48,744	50,703	52,842


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
3,0%
RTS-12.11
77,4%
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
924 388
104 742
185 014
405 982
125 352
1 180 308
211 672
83 870
1 482 162
70 304
60 595
50 050
48 560
29 298
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