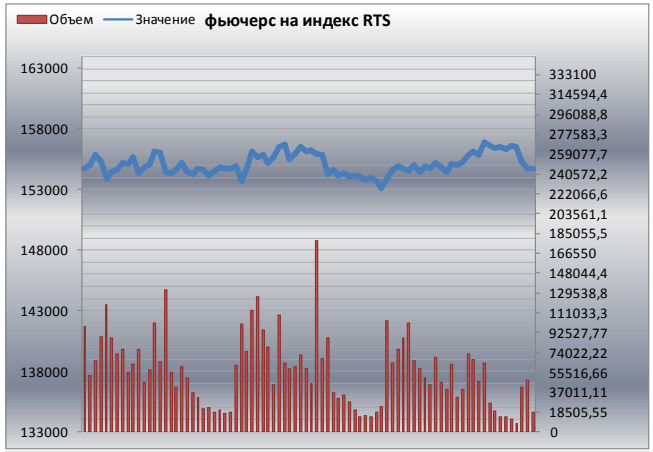
S&P намеревается подвергнуть рейтинги 15 стран ЕС пересмотру

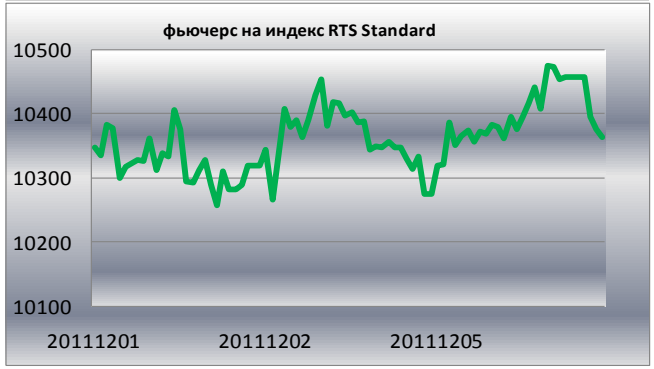
Рейтинговое агентство S&P поместило рейтинги 15 стран еврозоны в список для пересмотра, обосновав это очевидным усилением системного кризиса еврозоны. Также, на предстоящем в конце недели саммите ЕС ожидается обуждение пересмотра договоров ЕС, также будет рассмотрен текст нового договора, в котором будут предусмотрены автоматические санкции против стран-нарушителей 3% дефицита годового бюджета.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу вечерней торговой сессии составил $109,24 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1714,81 за тройскую унцию.

Выборы в Госдуму прошли, стали окончательно известны их итоги—некоторая неопределенность в связи с этим исчезла. Более того, российский рынок не обратил ни малейшего внимания на результаты выборов. К концу торговой сессии индекс ММВБ закрылся на отметке 1517,89 пункта (+0,80%), РТС остановился на уровне 1559,28 пункта (+0,89%).

Лучше рынка выглядели Распадская (+5,67%), Белон (+5,85%), Мечел (+3,98%), Северсталь (+2,97%).





	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	154680	1546,80	-0,74	883 764	0,40%	25 278 369 152	19,56%
ROSN-12.11	22559	225,59	0,40	100 448	0,36%	59 007 609	28,77%
LKOH-12.11	17257	1725,70	-0,48	172 710	0,19%	69 006 740	5,51%
GAZR-12.11	18452	184,52	-0,29	332 078	-1,89%	493 683 713	12,62%
GMKR-12.11	55550	5555,00	0,06	121 570	0,00%	33 754 191	9,61%
SBRF-12.11	8945	89,45	-0,71	1 034 206	0,38%	644 633 227	9,19%
VTBR-12.11	7116	0,0712	-0,61	203 798	-2,47%	19 046 714	6,17%
GOLD-12.11	1726	1725,5000	-0,98	77 062	-3,29%	359 508 517	29,39%
Si-12.11	31005	31,01	0,33	1 369 688	-0,44%	1 138 920 091	5,97%
Eu-12.11	41592	41,59	-0,07	67 142	0,20%	8 485 870	10,45%
ED-12.11	1,34	1,34	-0,53	51 442	-41,55%	1 353 457 549	24,78%
SBPR-12.11	6832	68,32	-1,09	62 248	0,27%	1 663 845	6,46%
RTSS-12.11	10365	10364,50	-0,41	43 114	-0,25%	15 560 930	7,42%
BR-12.11	110	109,75	-1,31	30 426	-3,29%	283 836 536	33,84%

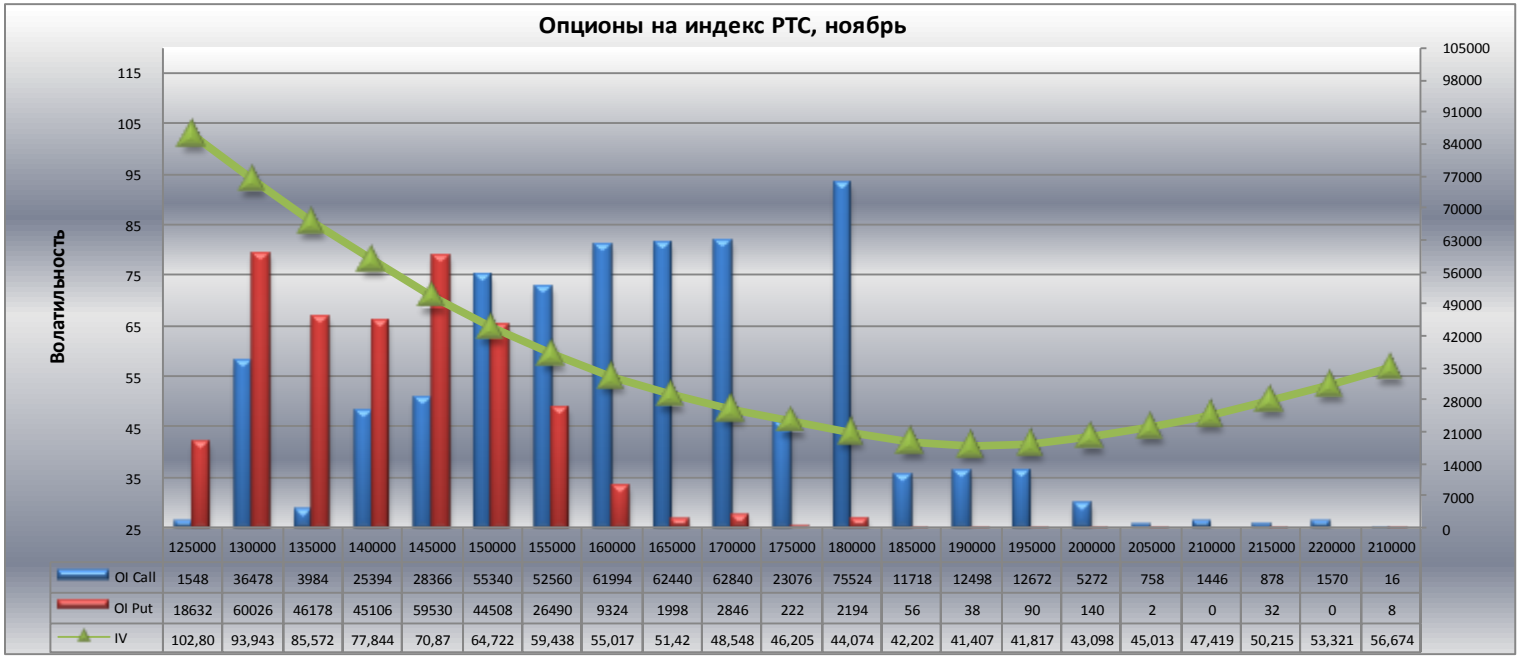
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	58910,48	1,77%	00:12:30
CAC 40	3201,28	1,15%	19:35:18
DAX 30	6106,09	0,42%	19:35:31
DJ Industrial	12097,83	0,65%	00:42:54
FTSE 100	5567,96	0,28%	19:35:22
Hang Seng	18854,12	-1,70%	10:19:17
Nikkei 225	8582,63	-1,30%	09:00:03
S&P 500	1257,08	1,03%	00:02:19
Brent	109,24	-0,52%	01:09:18
Gold	1714,81	-1,14%	10:19:18
Palladium	633,1	-2,07%	10:19:25
Platinum	1512,5	-1,31%	10:18:11
RTSI	1 553,21	-0,39%	23:50:00
RTS_Standard	10 358,63	-0,45%	23:50:00
RTSI_DEREX	1545,76	0,87%	18:45:00

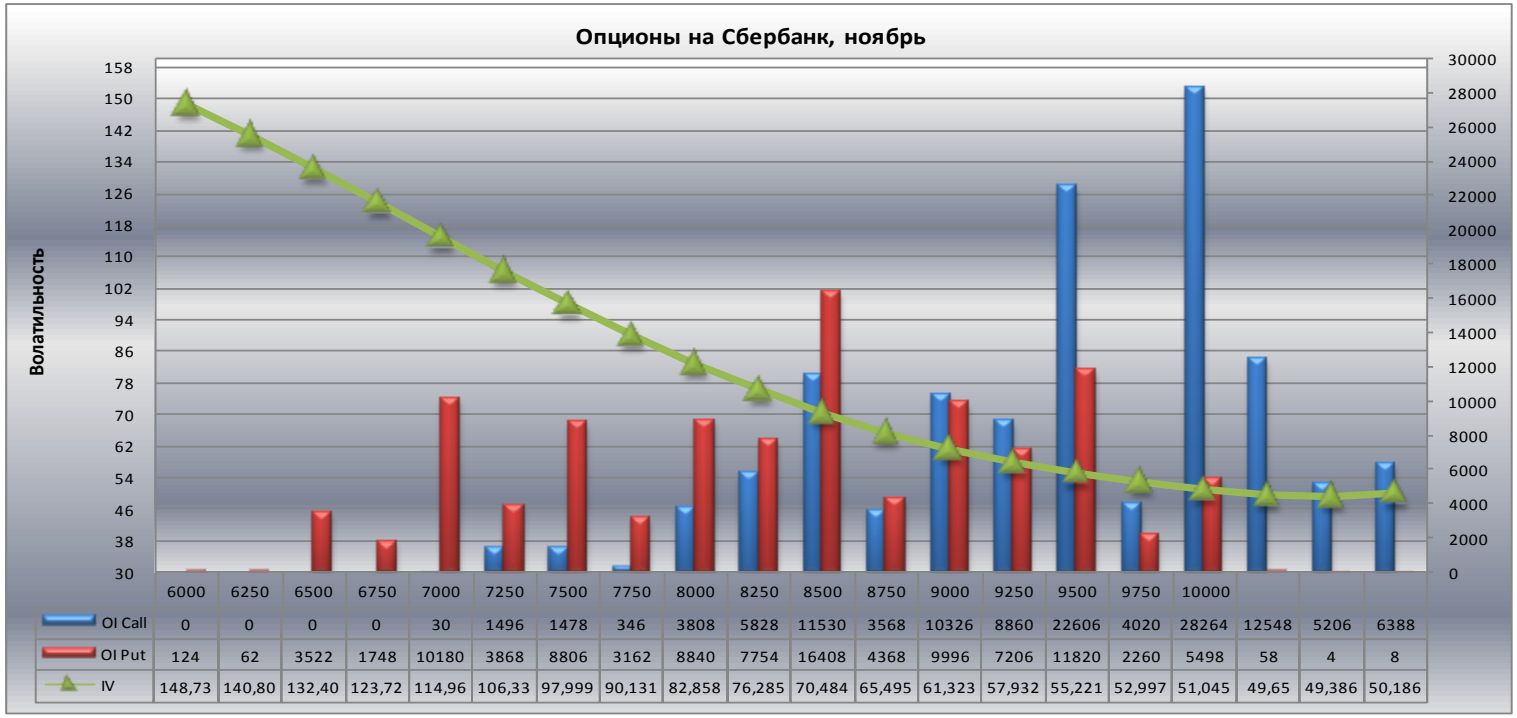
Вечерняя сессия

	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,74	883764	25278369151,57	154680
ROSN-12.11	0,4	100448	59007609,00	22559
LKOH-12.11	-0,48	172710	69006740,00	17257
GAZR-12.11	-0,29	332078	493683713,00	18452
GMKR-12.11	0,06	121570	33754191,00	55550
SBRF-12.11	-0,71	1034206	644633227,00	8945
VTBR-12.11	-0,61	203798	19046714,00	7116
GOLD-12.11	-0,98	77062	359508517,42	1725,5
Si-12.11	0,33	1369688	1138920091,00	31005
Eu-12.11	-0,07	67142	8485870,00	41592
ED-12.11	-0,53	51442	1353457549,32	1,3402
SBPR-12.11	-1,09	62248	1663845,00	6832
RTSS-12.11	-0,41	43114	15560930,00	10364,5
BR-12.11	-1,31	30 426	283836535,50	109,75

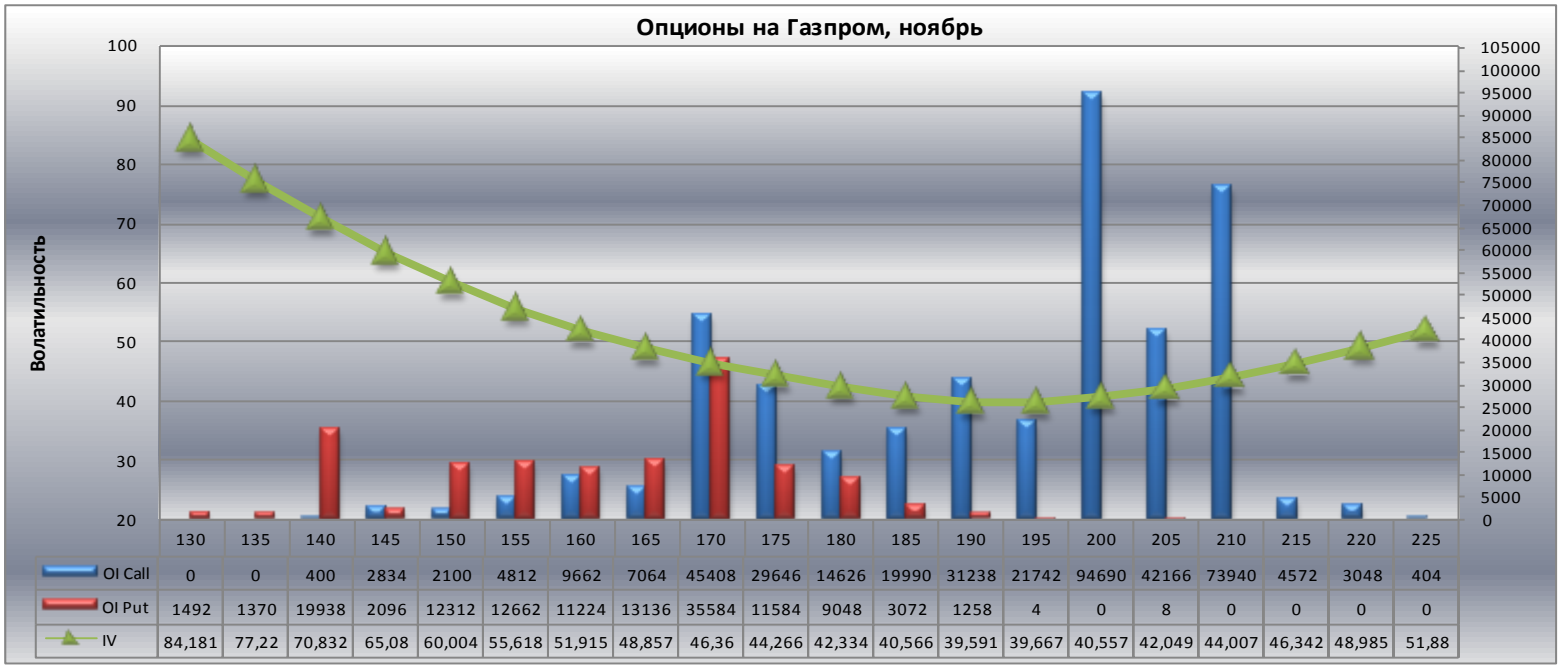
Дневная сессия

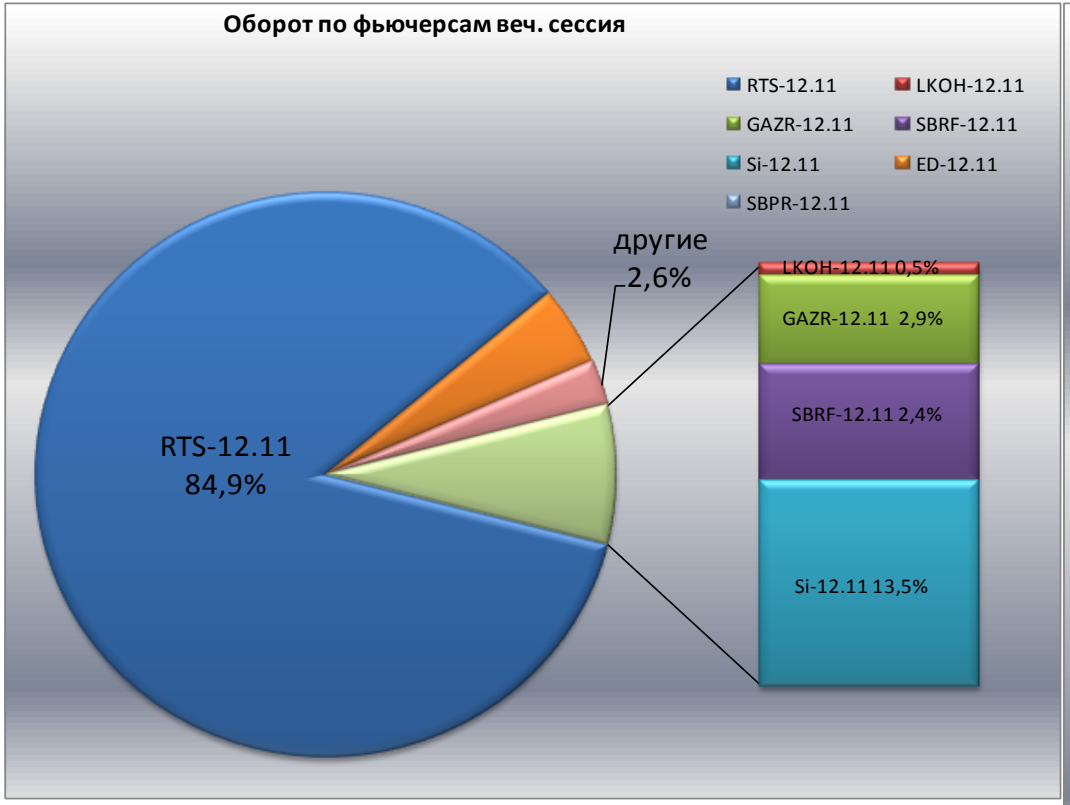
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	1,01	880270	1,29263E+11	155840
ROSN-12.11	0,83	100092	205134183	22470
LKOH-12.11	1,5	172382	1252583982	17340
GAZR-12.11	0,6	338480	3912447535	18505
GMKR-12.11	2,18	121572	351188537	55517
SBRF-12.11	0,36	1030254	7010765561	9010
VTBR-12.11	2,38	208950	308877585	7039
GOLD-12.11	-0,35	79686	1223086695	1742,9
Si-12.11	-0,02	1375756	19069555616	30904
Eu-12.11	0	67008	81185609	41630
ED-12.11	-0,01	88004	5461743794	1,3474
SBPR-12.11	0,55	62078	25745685	6915
RTSS-12.11	0,6	43222	209678150	10408
BR-12.11	1,93	31460	838716556,5	111,21

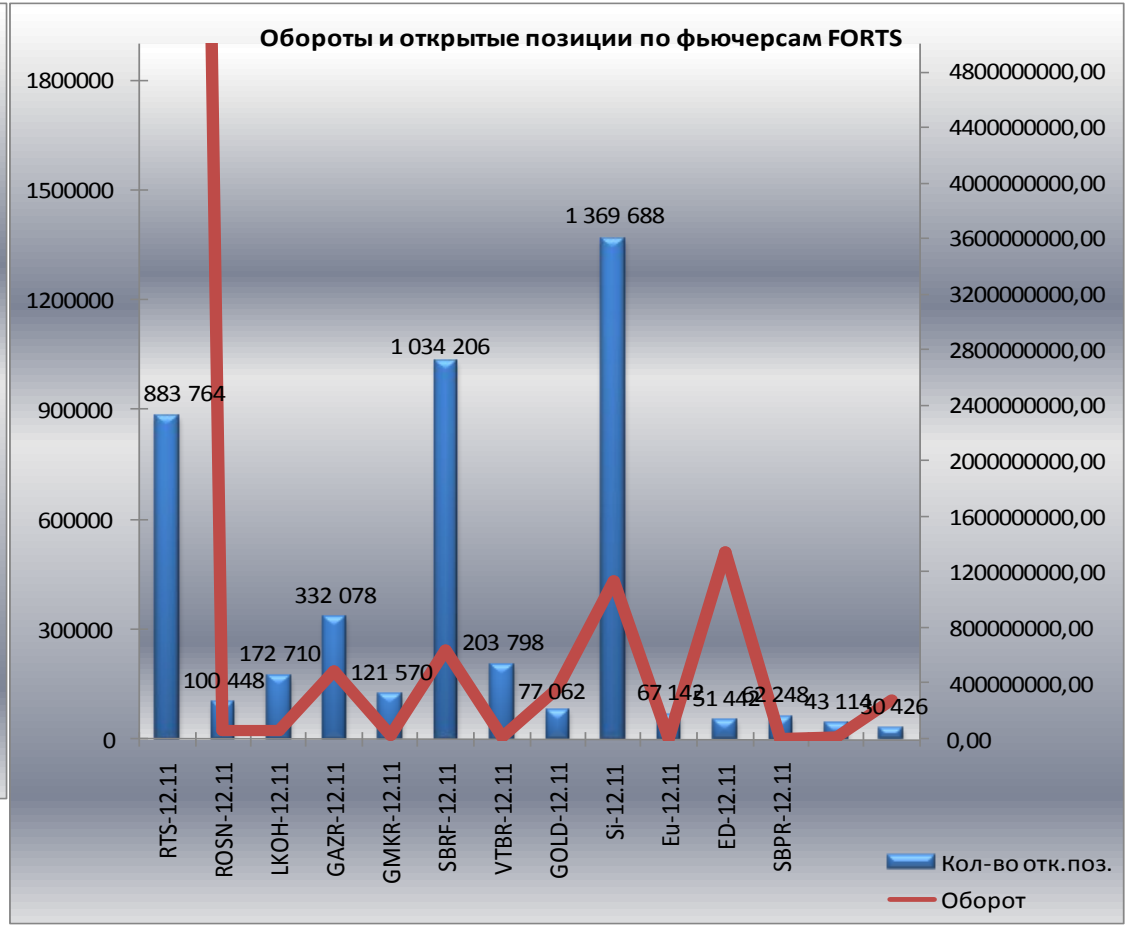

Опционы на индекс РТС, ноябрь
Волатильность
115
105
95
85
75
65
55
45
35
25
105000
98000
91000
84000
77000
70000
63000
56000
49000
42000
35000
28000
21000
14000
7000
0
125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 210000
OI Call 1548 36478 3984 25394 28366 55340 52560 61994 62440 62840 23076 75524 11718 12498 12672 5272 758 1446 878 1570 16
OI Put 18632 60026 46178 45106 59530 44508 26490 9324 1998 2846 222 2194 56 38 90 140 2 0 32 0 8
IV 102,80 93,943 85,572 77,844 70,87 64,722 59,438 55,017 51,42 48,548 46,205 44,074 42,202 41,407 41,817 43,098 45,013 47,419 50,215 53,321 56,674


Опционы на Сбербанк, ноябрь
Волатильность
158
150
142
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 30 1496 1478 346 3808 5828 11530 3568 10326 8860 22606 4020 28264 12548 5206 6388
OI Put 124 62 3522 1748 10180 3868 8806 3162 8840 7754 16408 4368 9996 7206 11820 2260 5498 58 4 8
IV 148,73 140,80 132,40 123,72 114,96 106,33 97,999 90,131 82,858 76,285 70,484 65,495 61,323 57,932 55,221 52,997 51,045 49,65 49,386 50,186


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 1354
OI Put 0 0 0 0 12 0 100 566 1280 820 2880 1338 1460
IV 70,032 98,764 90,612 82,903 75,757 69,266 63,497 58,486 54,246 50,759 47,972 45,774 43,971


Опционы на Газпром, ноябрь
Волатильность
100
90
80
70
60
50
40
30
20
105000
100000
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 9662 7064 45408 29646 14626 19990 31238 21742 94690 42166 73940 4572 3048 404
OI Put 1492 1370 19938 2096 12312 12662 11224 13136 35584 11584 9048 3072 1258 4 0 8 0 0 0 0
IV 84,181 77,22 70,832 65,08 60,004 55,618 51,915 48,857 46,36 44,266 42,334 40,566 39,591 39,667 40,557 42,049 44,007 46,342 48,985 51,88


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
2,6%
RTS-12.11
84,9%
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
883 764
100 448
172 710
332 078
121 570
1 034 206
203 798
77 062
1 369 688
67 142
51 442
62 248
43 114
30 426
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